

野村資産設計ファンド<愛称:未来時計>

2015/2020/2025/2030/2035/2040/2045/2050/2060

運用報告書(全体版)

| | | | | |
|------|---------------------------------|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 2015 | 作成対象期間 (2021年6月23日~2021年12月22日) | 第88期 (決算日2021年7月26日) | 第89期 (決算日2021年8月23日) | 第90期 (決算日2021年9月22日) |
| | | 第91期 (決算日2021年10月22日) | 第92期 (決算日2021年11月22日) | 第93期 (決算日2021年12月22日) |
| 2020 | 作成対象期間 (2021年6月23日~2021年12月22日) | 第38期 (決算日2021年7月26日) | 第39期 (決算日2021年8月23日) | 第40期 (決算日2021年9月22日) |
| | | 第41期 (決算日2021年10月22日) | 第42期 (決算日2021年11月22日) | 第43期 (決算日2021年12月22日) |
| | 2025/2030/2035/2040 | 作成対象期間 (2021年6月23日~2021年12月22日) | 第28期 (決算日2021年12月22日) | |
| | 2045 | 作成対象期間 (2021年6月23日~2021年12月22日) | 第23期 (決算日2021年12月22日) | |
| | 2050 | 作成対象期間 (2021年6月23日~2021年12月22日) | 第13期 (決算日2021年12月22日) | |
| | 2060 | 作成対象期間 (2021年6月23日~2021年12月22日) | 第5期 (決算日2021年12月22日) | |

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
 当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
 今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類 | 野村資産設計ファンド | | | | | | | | | |
|--------------------------|--|--|------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | 2015 | 2020 | 2025 | 2030 | 2035 | 2040 | 2045 | 2050 | 2060 | |
| 追加型投信/内外/資産複合/インデックス型 | 2007年6月11日以降、無期限とします。(2015/2020/2025/2030/2035/2040) | | | | | | | | | |
| 信託期間 | 2010年9月10日以降、無期限とします。(2045) 2015年9月17日以降、無期限とします。(2050) 2019年9月13日以降、無期限とします。(2060) | | | | | | | | | |
| 運用方針 | 各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内及び外国の各債券、各株式、各不動産投資信託証券(REIT)に実質的に投資し、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行うことを基本とします。各ファンドには、それぞれ安定運用開始時期(ターゲットイヤー)が定められており、当初設定以降、安定運用開始時期に近づくにしたがって、定期的に各マザーファンド受益証券への基本投資割合を変更し、株式の実質組み入れの漸減と公社債の実質組み入れの漸増を行ない、リスクの漸減を図ることを基本とします。なお、各マザーファンド受益証券への基本投資割合の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上で行ないます。 <2021年7月1日時点の各マザーファンド受益証券への基本投資割合> | | | | | | | | | |
| | マザーファンド | 2015 | 2020 | 2025 | 2030 | 2035 | 2040 | 2045 | 2050 | 2060 |
| | 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 60% | 60% | 48% | 37% | 27% | 21% | 16% | 13% | 10% |
| | 外国債券マザーファンド | | | 9% | 9.7% | 9.7% | 9.7% | 9.7% | 8.4% | 6.4% |
| | 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 10% | 10% | 5% | 5.3% | 5.3% | 5.3% | 5.3% | 4.6% | 3.6% |
| | 国内株式マザーファンド | 10% | 10% | 14% | 19% | 22% | 24.5% | 29% | 32% | 35% |
| | 外国株式MSCI-KOKUSA1マザーファンド | | | 8% | 10.9% | 12.6% | 14.1% | 16.7% | 18.4% | 20.1% |
| | 新興国株式マザーファンド | | | 6% | 8.1% | 9.4% | 10.4% | 12.3% | 13.6% | 14.9% |
| | J-REITインデックス マザーファンド | 5% | 5% | 5% | 5% | 7% | 7.5% | 5.5% | 5% | 5% |
| | 海外REITインデックス マザーファンド | 5% | 5% | 5% | 5% | 7% | 7.5% | 5.5% | 5% | 5% |
| | ※安定運用開始時期の到来以降の各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド：60%、外国債券マザーファンド、新興国債券(現地通貨建て) マザーファンドの合計：10%、国内株式マザーファンド：10%、外国株式MSCI-KOKUSA1マザーファンド、新興国株式マザーファンドの合計：10%、J-REITインデックス マザーファンド：5%、海外REITインデックス マザーファンド：5%を基本とします。なお、家計や市場の構造変化等を考慮し、基本投資割合が変更となる場合があります。 | | | | | | | | | |
| | ※「野村資産設計ファンド2015」は、2015年6月22日の翌日より安定運用を開始しました。 ※「野村資産設計ファンド2020」は、2020年6月22日の翌日より安定運用を開始しました。 | | | | | | | | | |
| | 主な投資対象 | 主な投資制限 | | | | | | | | |
| 野村資産設計ファンド | 各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 | 外貨建資産への直接投資は行ないません。デリバティブの直接利用は行ないません。株式への直接投資は行ないません。 | | | | | | | | |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | わが国の公社債を主要投資対象とします。 | 外貨建資産への投資は行ないません。 | | | | | | | | |
| 外国債券マザーファンド | 外国の公社債を主要投資対象とします。 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 | | | | | | | | |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。 | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 | | | | | | | | |
| 国内株式マザーファンド | わが国の株式を主要投資対象とします。 | 株式への投資割合には制限を設けません。 | | | | | | | | |
| 外国株式MSCI-KOKUSA1マザーファンド | 外国の株式を主要投資対象とします。 | 株式への投資割合には制限を設けません。 | | | | | | | | |
| 新興国株式マザーファンド | 新興国の株式を主要投資対象とします。 | 株式への投資割合には制限を設けません。 | | | | | | | | |
| J-REITインデックス マザーファンド | J-REITを主要投資対象とします。 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 | | | | | | | | |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 | | | | | | | | |
| 分配方針 | 安定運用開始時期前は2回決算、安定運用開始時期以降は毎月決算を行ない、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。 | | | | | | | | | |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104
 (受付時間) 営業日の午前9時~午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

－ 目 次 －

■野村資産設計ファンド（2015／2020／2025／2030／2035／2040／2045／2050／2060）の運用状況のご報告

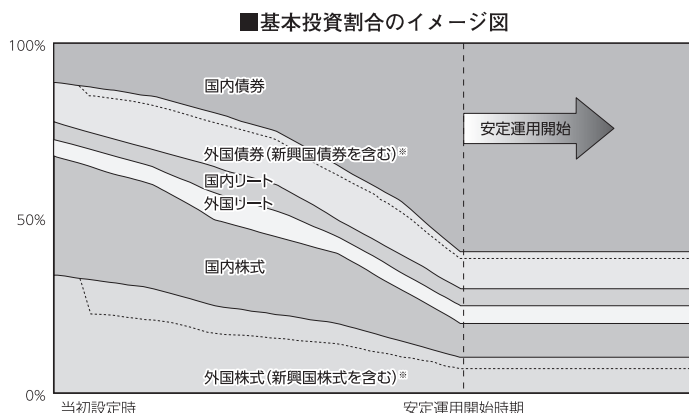
| | 2015 | 2020 | 2025 | 2030 | 2035 | 2040 | 2045 | 2050 | 2060 |
|---------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 運用の概要 | 1ページ | | | | | | | | |
| 各ファンドの運用状況 | 3ページ | 10ページ | 17ページ | 23ページ | 29ページ | 35ページ | 41ページ | 47ページ | 53ページ |
| マザーファンドの運用経過 | 59ページ | | | | | | | | |
| 各ファンドの信託財産の状況 | 62ページ | 72ページ | 82ページ | 91ページ | 100ページ | 109ページ | 118ページ | 127ページ | 136ページ |

■各マザーファンドの運用状況のご報告

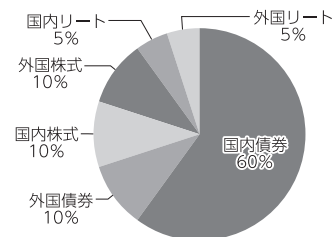
- | | |
|-----------------------------------|--------|
| 1. 国内株式マザーファンド 運用報告書 | 146ページ |
| 2. 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 運用報告書 | 183ページ |
| 3. 新興国株式マザーファンド 運用報告書 | 227ページ |
| 4. 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド 運用報告書 | 261ページ |
| 5. 外国債券マザーファンド 運用報告書 | 292ページ |
| 6. 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド 運用報告書 | 315ページ |
| 7. J-REITインデックス マザーファンド 運用報告書 | 331ページ |
| 8. 海外REITインデックス マザーファンド 運用報告書 | 342ページ |

◎運用の概要

- (1) [野村資産設計ファンド2015/2020/2025/2030/2035/2040/2045/2050/2060] の各ファンドは、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、国内及び外国（新興国を含む）の各債券、国内及び外国（新興国を含む）の各株式、国内及び外国の各不動産投資信託証券（REIT）に実質的に投資します。
- (2) 各ファンドには、それぞれ安定運用開始時期（ターゲットイヤー）が定められており、当初設定以降、安定運用開始時期に近づくにしたがって、定期的に株式の実質組み入れの漸減と公社債の実質組み入れの漸増を行ない、リスクの漸減を図ることを基本とします。なお、各資産への資産配分比率の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上で行ないます。



■安定運用開始時期の到来以降の基本投資割合



※家計や市場の構造変化等を考慮し、変更となる場合があります。
外国債券、外国株式は各々、2本のマザーファンドの合計の投資割合とします。

- ※2010年9月より、基本投資割合に新興国債券、新興国株式が追加されています。
※新興国債券、新興国株式の割合は、各々外国債券、外国株式内に点線で示しています。
※上記の図表は基本投資割合に変更がない場合のイメージ図であり、また、実際に上記のような運用を行なうことを保証するものではありません。

| 資産 | 実質的な投資をするマザーファンド | 各マザーファンドの対象指数 |
|--------|--------------------------|--|
| 国内債券 | 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | NOMURA-BPI総合 |
| 外国債券 | 外国債券マザーファンド | 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) | 新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド | JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円換算ベース) |
| 国内株式 | 国内株式マザーファンド | 東証株価指数 (TOPIX) |
| 外国株式 | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし) |
| (新興国) | 新興国株式マザーファンド | MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース) |
| 国内REIT | J-REITインデックス マザーファンド | 東証REIT指数 (配当込み) |
| 外国REIT | 海外REITインデックス マザーファンド | S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース) |

- * 「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円換算ベース)」は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。
- * 「MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし)」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。
- * 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)」は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・ドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。
- * 「S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、ドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託 証券組入比率 | 純資産額 |
|------------------|---------------|----------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|----------------|------|
| | | 税金 分配 | み騰 落率 | 期騰 落率 | 中騰 落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 64期(2019年7月22日) | 11,061 | 10 | 0.3 | 125.25 | 0.4 | 19.5 | 0.3 | 69.0 | — | 10.3 | 841 |
| 65期(2019年8月22日) | 11,047 | 10 | △0.0 | 125.29 | 0.0 | 18.3 | 0.4 | 70.2 | — | 10.2 | 836 |
| 66期(2019年9月24日) | 11,170 | 10 | 1.2 | 126.89 | 1.3 | 20.5 | 0.2 | 68.0 | — | 10.3 | 835 |
| 67期(2019年10月23日) | 11,216 | 10 | 0.5 | 127.54 | 0.5 | 19.8 | 0.3 | 68.4 | — | 10.4 | 831 |
| 68期(2019年11月22日) | 11,212 | 10 | 0.1 | 127.66 | 0.1 | 19.6 | 0.4 | 69.1 | — | 9.9 | 823 |
| 69期(2019年12月23日) | 11,238 | 10 | 0.3 | 128.17 | 0.4 | 19.9 | 0.3 | 68.9 | — | 9.9 | 825 |
| 70期(2020年1月22日) | 11,332 | 10 | 0.9 | 129.47 | 1.0 | 19.6 | 0.3 | 68.8 | — | 10.3 | 830 |
| 71期(2020年2月25日) | 11,292 | 10 | △0.3 | 129.18 | △0.2 | 18.8 | 0.4 | 69.6 | — | 10.3 | 826 |
| 72期(2020年3月23日) | 10,100 | 10 | △10.5 | 115.81 | △10.4 | 17.1 | 0.4 | 74.2 | — | 7.3 | 725 |
| 73期(2020年4月22日) | 10,425 | 10 | 3.3 | 119.35 | 3.1 | 19.5 | 0.5 | 69.0 | — | 9.8 | 748 |
| 74期(2020年5月22日) | 10,594 | 10 | 1.7 | 121.53 | 1.8 | 19.3 | 0.5 | 68.9 | — | 10.0 | 761 |
| 75期(2020年6月22日) | 10,757 | 10 | 1.6 | 123.67 | 1.8 | 19.6 | 0.4 | 68.9 | — | 10.1 | 773 |
| 76期(2020年7月22日) | 10,832 | 10 | 0.8 | 124.67 | 0.8 | 19.8 | 0.4 | 68.7 | — | 10.0 | 773 |
| 77期(2020年8月24日) | 10,878 | 10 | 0.5 | 125.44 | 0.6 | 20.1 | 0.4 | 68.1 | — | 10.3 | 773 |
| 78期(2020年9月23日) | 10,841 | 10 | △0.2 | 125.21 | △0.2 | 19.2 | 0.3 | 69.4 | — | 9.7 | 768 |
| 79期(2020年10月22日) | 10,857 | 10 | 0.2 | 125.51 | 0.2 | 19.5 | 0.4 | 69.1 | — | 10.0 | 758 |
| 80期(2020年11月24日) | 11,081 | 10 | 2.2 | 128.29 | 2.2 | 20.7 | 0.4 | 67.4 | — | 10.6 | 770 |
| 81期(2020年12月22日) | 11,112 | 10 | 0.4 | 128.86 | 0.4 | 19.4 | 0.4 | 69.1 | — | 10.1 | 768 |
| 82期(2021年1月22日) | 11,262 | 10 | 1.4 | 130.85 | 1.5 | 20.0 | 0.4 | 68.5 | — | 10.1 | 776 |
| 83期(2021年2月22日) | 11,376 | 10 | 1.1 | 132.37 | 1.2 | 20.1 | 0.6 | 67.9 | — | 10.4 | 780 |
| 84期(2021年3月22日) | 11,471 | 10 | 0.9 | 133.73 | 1.0 | 19.7 | 0.5 | 68.5 | — | 10.2 | 786 |
| 85期(2021年4月22日) | 11,531 | 10 | 0.6 | 134.49 | 0.6 | 19.0 | 0.5 | 69.1 | — | 10.2 | 784 |
| 86期(2021年5月24日) | 11,538 | 10 | 0.1 | 134.81 | 0.2 | 19.1 | 0.5 | 69.6 | — | 10.1 | 783 |
| 87期(2021年6月22日) | 11,661 | 10 | 1.2 | 136.43 | 1.2 | 19.3 | 0.4 | 68.8 | — | 10.4 | 788 |
| 88期(2021年7月26日) | 11,683 | 10 | 0.3 | 136.96 | 0.4 | 19.0 | 0.4 | 69.4 | — | 10.2 | 790 |
| 89期(2021年8月23日) | 11,599 | 10 | △0.6 | 136.12 | △0.6 | 19.1 | 0.5 | 69.3 | — | 10.0 | 783 |
| 90期(2021年9月22日) | 11,629 | 10 | 0.3 | 136.73 | 0.4 | 19.4 | 0.4 | 69.4 | — | 9.8 | 781 |
| 91期(2021年10月22日) | 11,728 | 10 | 0.9 | 138.03 | 0.9 | 19.4 | 0.5 | 68.7 | — | 10.4 | 787 |
| 92期(2021年11月22日) | 11,753 | 10 | 0.3 | 138.54 | 0.4 | 19.4 | 0.5 | 69.1 | — | 10.0 | 787 |
| 93期(2021年12月22日) | 11,663 | 10 | △0.7 | 137.63 | △0.7 | 19.3 | 0.4 | 69.0 | — | 10.2 | 779 |

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（次ページご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | |
|--|--------------------------------|
| | '15年6月22日の翌日以降 ^(注1) |
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 60% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) | 10% ^(注2) |
| [新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円換算ベース) | |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数 (TOPIX) | 10% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし) | 10% ^(注2) |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース) | |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数 (配当込み) | 5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース) | 5% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式 (新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

(注1) 「野村資産設計ファンド2015」は、2015年6月22日の翌日より安定運用を開始しました。

(注2) 各々、2本のマザーファンドの合計の投資割合とします。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|------|---------------------|--------|------|--------|------|--------|--------|--------|--------|------------|
| | | 円 | 騰落率 | % | 騰落率 | | | | | |
| 第88期 | (期首) 2021年6月22日 | 11,661 | — | 136.43 | — | 19.3 | 0.4 | 68.8 | — | 10.4 |
| | 6月末 | 11,671 | 0.1 | 136.60 | 0.1 | 19.4 | 0.5 | 68.9 | — | 10.3 |
| | (期末) 2021年7月26日 | 11,693 | 0.3 | 136.96 | 0.4 | 19.0 | 0.4 | 69.4 | — | 10.2 |
| 第89期 | (期首) 2021年7月26日 | 11,683 | — | 136.96 | — | 19.0 | 0.4 | 69.4 | — | 10.2 |
| | 7月末 | 11,658 | △0.2 | 136.68 | △0.2 | 18.8 | 0.4 | 69.1 | — | 10.2 |
| | (期末) 2021年8月23日 | 11,609 | △0.6 | 136.12 | △0.6 | 19.1 | 0.5 | 69.3 | — | 10.0 |
| 第90期 | (期首) 2021年8月23日 | 11,599 | — | 136.12 | — | 19.1 | 0.5 | 69.3 | — | 10.0 |
| | 8月末 | 11,698 | 0.9 | 137.34 | 0.9 | 19.5 | 0.4 | 68.9 | — | 10.1 |
| | (期末) 2021年9月22日 | 11,639 | 0.3 | 136.73 | 0.4 | 19.4 | 0.4 | 69.4 | — | 9.8 |
| 第91期 | (期首) 2021年9月22日 | 11,629 | — | 136.73 | — | 19.4 | 0.4 | 69.4 | — | 9.8 |
| | 9月末 | 11,646 | 0.1 | 136.85 | 0.1 | 19.3 | 0.6 | 69.1 | — | 9.9 |
| | (期末) 2021年10月22日 | 11,738 | 0.9 | 138.03 | 0.9 | 19.4 | 0.5 | 68.7 | — | 10.4 |
| 第92期 | (期首) 2021年10月22日 | 11,728 | — | 138.03 | — | 19.4 | 0.5 | 68.7 | — | 10.4 |
| | 10月末 | 11,749 | 0.2 | 138.23 | 0.1 | 19.3 | 0.5 | 68.7 | — | 10.5 |
| | (期末) 2021年11月22日 | 11,763 | 0.3 | 138.54 | 0.4 | 19.4 | 0.5 | 69.1 | — | 10.0 |
| 第93期 | (期首) 2021年11月22日 | 11,753 | — | 138.54 | — | 19.4 | 0.5 | 69.1 | — | 10.0 |
| | 11月末 | 11,630 | △1.0 | 137.04 | △1.1 | 18.7 | 0.5 | 69.5 | — | 10.0 |
| | (期末) 2021年12月22日 | 11,673 | △0.7 | 137.63 | △0.7 | 19.3 | 0.4 | 69.0 | — | 10.2 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

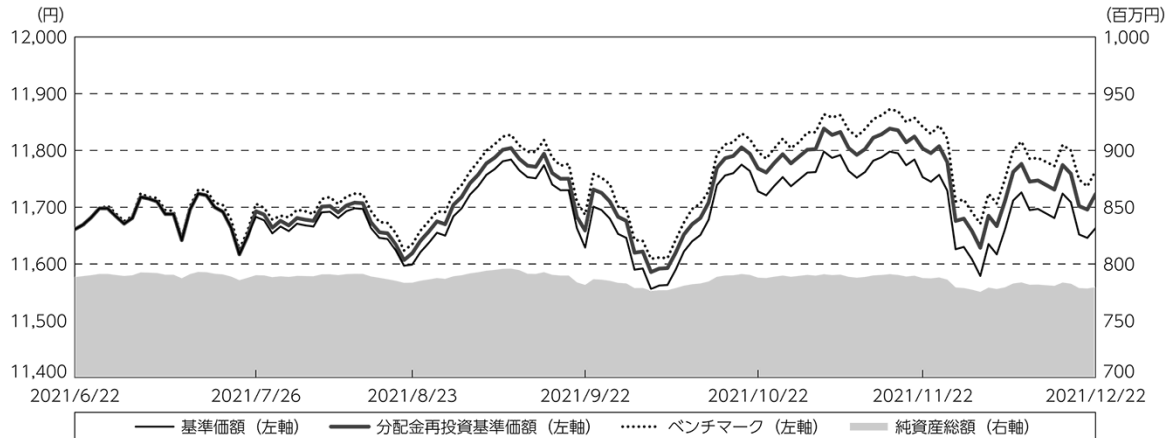
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



第88期首：11,661円

第93期末：11,663円 (既払分配金(税込み)：60円)

騰落率：0.5% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

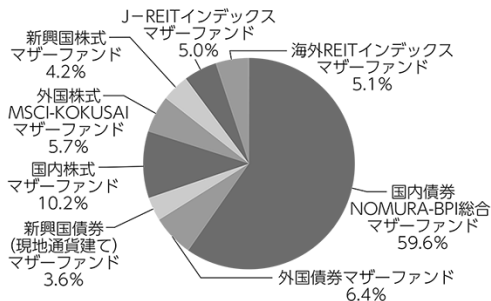
外国REITや外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資 産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念は高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

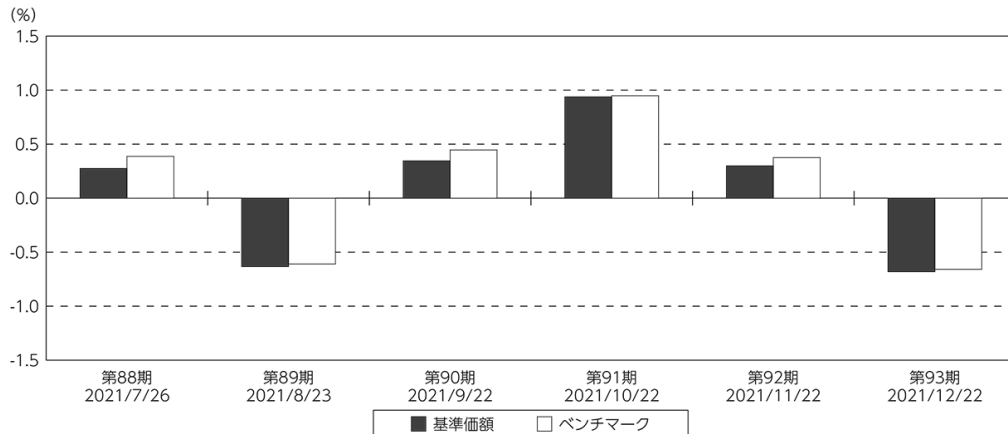
○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率※は+0.5%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+0.9%を0.4ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第88期 | 第89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年7月26日 | 2021年7月27日～ 2021年8月23日 | 2021年8月24日～ 2021年9月22日 | 2021年9月23日～ 2021年10月22日 | 2021年10月23日～ 2021年11月22日 | 2021年11月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | 10 0.086% | 10 0.086% | 10 0.086% | 10 0.085% | 10 0.085% | 10 0.086% |
| 当期の収益 | 10 | 4 | 10 | 10 | 10 | 4 |
| 当期の収益以外 | — | 5 | — | — | — | 5 |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,306 | 2,300 | 2,303 | 2,351 | 2,376 | 2,371 |

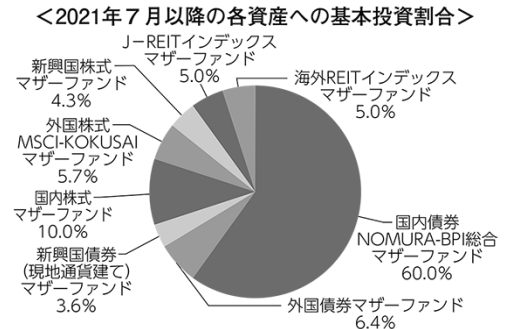
(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

国内および外国(新興国を含む)の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行いません。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



○最近20期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|------------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 24期(2019年12月23日) | 11,597 | 5 | 2.6 | 125.90 | 3.0 | 21.9 | 0.3 | 66.9 | — | 9.9 | 845 |
| 25期(2020年6月22日) | 11,136 | 5 | △3.9 | 121.29 | △3.7 | 21.6 | 0.5 | 66.9 | — | 10.1 | 794 |
| 26期(2020年7月22日) | 11,213 | 10 | 0.8 | 122.26 | 0.8 | 19.8 | 0.4 | 68.7 | — | 10.0 | 791 |
| 27期(2020年8月24日) | 11,261 | 10 | 0.5 | 123.02 | 0.6 | 20.1 | 0.4 | 68.1 | — | 10.2 | 773 |
| 28期(2020年9月23日) | 11,222 | 10 | △0.3 | 122.79 | △0.2 | 19.2 | 0.3 | 69.4 | — | 9.7 | 765 |
| 29期(2020年10月22日) | 11,240 | 10 | 0.2 | 123.08 | 0.2 | 19.5 | 0.4 | 69.1 | — | 10.0 | 766 |
| 30期(2020年11月24日) | 11,472 | 10 | 2.2 | 125.81 | 2.2 | 20.7 | 0.4 | 67.4 | — | 10.6 | 782 |
| 31期(2020年12月22日) | 11,504 | 10 | 0.4 | 126.37 | 0.4 | 19.4 | 0.4 | 69.1 | — | 10.1 | 786 |
| 32期(2021年1月22日) | 11,660 | 10 | 1.4 | 128.32 | 1.5 | 20.0 | 0.4 | 68.5 | — | 10.1 | 787 |
| 33期(2021年2月22日) | 11,778 | 10 | 1.1 | 129.81 | 1.2 | 20.1 | 0.6 | 67.9 | — | 10.4 | 783 |
| 34期(2021年3月22日) | 11,877 | 10 | 0.9 | 131.14 | 1.0 | 19.7 | 0.5 | 68.5 | — | 10.2 | 774 |
| 35期(2021年4月22日) | 11,940 | 10 | 0.6 | 131.89 | 0.6 | 19.0 | 0.5 | 69.1 | — | 10.2 | 776 |
| 36期(2021年5月24日) | 11,947 | 10 | 0.1 | 132.21 | 0.2 | 19.1 | 0.5 | 69.6 | — | 10.1 | 780 |
| 37期(2021年6月22日) | 12,075 | 10 | 1.2 | 133.79 | 1.2 | 19.3 | 0.4 | 68.8 | — | 10.4 | 789 |
| 38期(2021年7月26日) | 12,098 | 10 | 0.3 | 134.31 | 0.4 | 19.0 | 0.4 | 69.4 | — | 10.2 | 792 |
| 39期(2021年8月23日) | 12,012 | 10 | △0.6 | 133.49 | △0.6 | 19.1 | 0.5 | 69.3 | — | 10.0 | 786 |
| 40期(2021年9月22日) | 12,043 | 10 | 0.3 | 134.09 | 0.4 | 19.4 | 0.4 | 69.4 | — | 9.8 | 788 |
| 41期(2021年10月22日) | 12,145 | 10 | 0.9 | 135.36 | 0.9 | 19.4 | 0.5 | 68.7 | — | 10.4 | 800 |
| 42期(2021年11月22日) | 12,172 | 10 | 0.3 | 135.87 | 0.4 | 19.4 | 0.5 | 69.0 | — | 10.0 | 798 |
| 43期(2021年12月22日) | 12,079 | 10 | △0.7 | 134.97 | △0.7 | 19.3 | 0.4 | 69.0 | — | 10.2 | 786 |

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | '19年7月～'20年6月22日 | '20年6月22日の翌日以降 ^(注1) |
|---|------------------|--------------------------------|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 57% | 60% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) | 9% | 10% ^(注2) |
| [新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド] 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 (円換算ベース) | 2% | |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数 (TOPIX) | 11% | 10% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし) | 6.4% | 10% ^(注2) |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース) | 4.6% | |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数 (配当込み) | 5% | 5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース) | 5% | 5% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式 (新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

(注1) 「野村資産設計ファンド2020」は、2020年6月22日の翌日より安定運用を開始しました。

(注2) 各々、2本のマザーファンドの合計の投資割合とします。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|------|---------------------|--------|------|--------|------|--------|--------|--------|--------|------------|
| | | 円 | 騰落率 | | 騰落率 | | | | | |
| 第38期 | (期首) 2021年6月22日 | 12,075 | — | 133.79 | — | 19.3 | 0.4 | 68.8 | — | 10.4 |
| | 6月末 | 12,086 | 0.1 | 133.96 | 0.1 | 19.4 | 0.5 | 68.9 | — | 10.3 |
| | (期末) 2021年7月26日 | 12,108 | 0.3 | 134.31 | 0.4 | 19.0 | 0.4 | 69.4 | — | 10.2 |
| 第39期 | (期首) 2021年7月26日 | 12,098 | — | 134.31 | — | 19.0 | 0.4 | 69.4 | — | 10.2 |
| | 7月末 | 12,072 | △0.2 | 134.04 | △0.2 | 18.8 | 0.4 | 69.1 | — | 10.2 |
| | (期末) 2021年8月23日 | 12,022 | △0.6 | 133.49 | △0.6 | 19.1 | 0.5 | 69.3 | — | 10.0 |
| 第40期 | (期首) 2021年8月23日 | 12,012 | — | 133.49 | — | 19.1 | 0.5 | 69.3 | — | 10.0 |
| | 8月末 | 12,113 | 0.8 | 134.69 | 0.9 | 19.5 | 0.4 | 68.9 | — | 10.1 |
| | (期末) 2021年9月22日 | 12,053 | 0.3 | 134.09 | 0.4 | 19.4 | 0.4 | 69.4 | — | 9.8 |
| 第41期 | (期首) 2021年9月22日 | 12,043 | — | 134.09 | — | 19.4 | 0.4 | 69.4 | — | 9.8 |
| | 9月末 | 12,061 | 0.1 | 134.20 | 0.1 | 19.3 | 0.6 | 69.1 | — | 9.9 |
| | (期末) 2021年10月22日 | 12,155 | 0.9 | 135.36 | 0.9 | 19.4 | 0.5 | 68.7 | — | 10.4 |
| 第42期 | (期首) 2021年10月22日 | 12,145 | — | 135.36 | — | 19.4 | 0.5 | 68.7 | — | 10.4 |
| | 10月末 | 12,167 | 0.2 | 135.56 | 0.1 | 19.3 | 0.5 | 68.7 | — | 10.5 |
| | (期末) 2021年11月22日 | 12,182 | 0.3 | 135.87 | 0.4 | 19.4 | 0.5 | 69.0 | — | 10.0 |
| 第43期 | (期首) 2021年11月22日 | 12,172 | — | 135.87 | — | 19.4 | 0.5 | 69.0 | — | 10.0 |
| | 11月末 | 12,044 | △1.1 | 134.40 | △1.1 | 18.7 | 0.5 | 69.5 | — | 10.0 |
| | (期末) 2021年12月22日 | 12,089 | △0.7 | 134.97 | △0.7 | 19.3 | 0.4 | 69.0 | — | 10.2 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

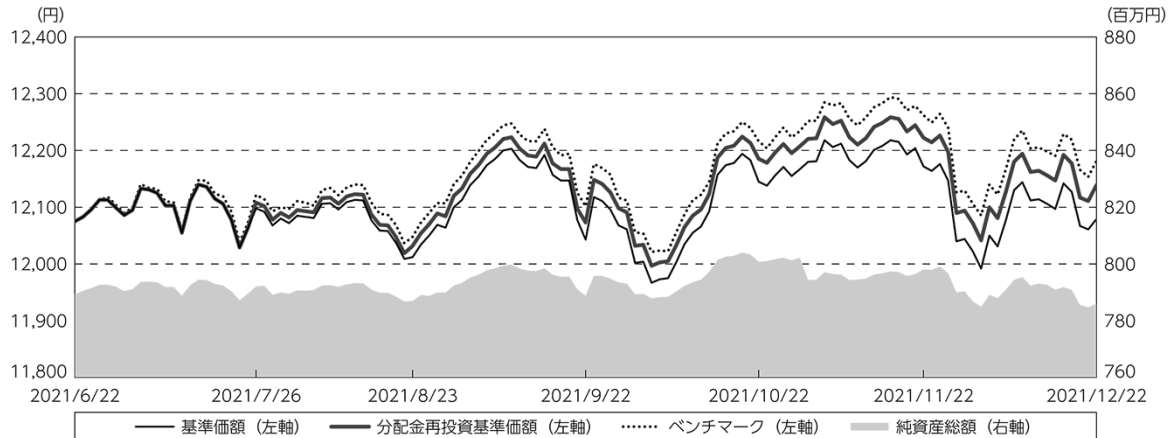
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○作成期間中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

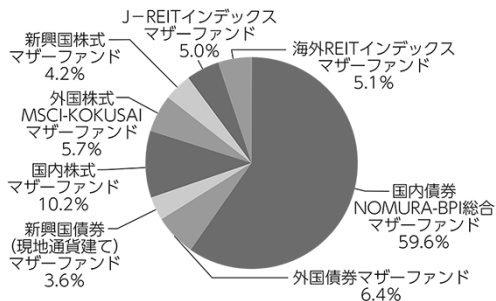
外国REITや外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資 産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念は高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は上記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

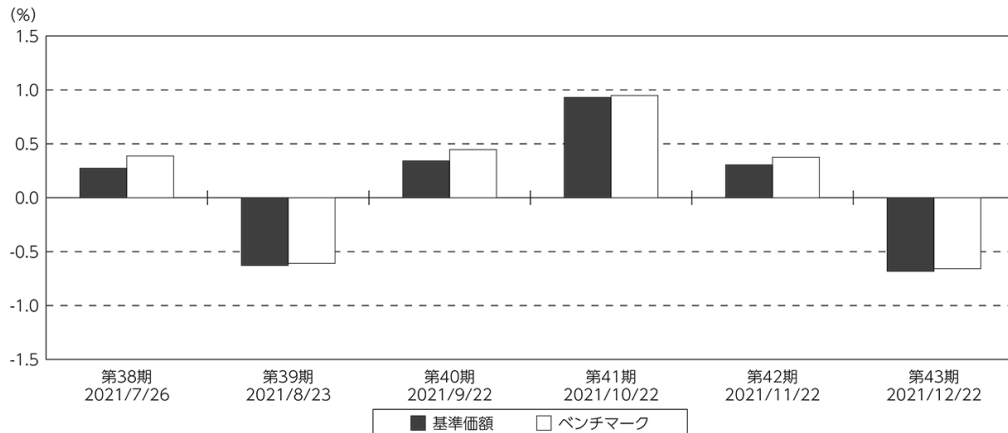
○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率※は+0.5%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+0.9%を0.4ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第38期 | 第39期 | 第40期 | 第41期 | 第42期 | 第43期 |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年7月26日 | 2021年7月27日～ 2021年8月23日 | 2021年8月24日～ 2021年9月22日 | 2021年9月23日～ 2021年10月22日 | 2021年10月23日～ 2021年11月22日 | 2021年11月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | 10 0.083% | 10 0.083% | 10 0.083% | 10 0.082% | 10 0.082% | 10 0.083% |
| 当期の収益 | 10 | 4 | 10 | 10 | 10 | 4 |
| 当期の収益以外 | — | 5 | — | — | — | 5 |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,521 | 3,515 | 3,518 | 3,569 | 3,595 | 3,590 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

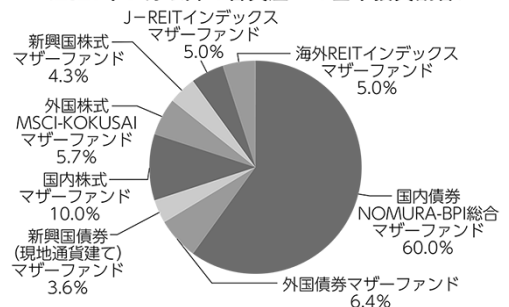
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

国内および外国(新興国を含む)の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

<2021年7月以降の各資産への基本投資割合>



○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|------------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|-------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 24期(2019年12月23日) | 12,002 | 5 | 4.0 | 129.35 | 4.4 | 31.7 | 0.5 | 56.9 | — | 10.0 | 943 |
| 25期(2020年6月22日) | 11,443 | 5 | △4.6 | 123.68 | △4.4 | 31.3 | 0.7 | 56.9 | — | 10.3 | 906 |
| 26期(2020年12月22日) | 12,079 | 5 | 5.6 | 130.99 | 5.9 | 29.0 | 0.6 | 59.2 | — | 10.2 | 956 |
| 27期(2021年6月22日) | 12,945 | 5 | 7.2 | 140.95 | 7.6 | 29.0 | 0.6 | 58.9 | — | 10.5 | 993 |
| 28期(2021年12月22日) | 13,029 | 5 | 0.7 | 142.43 | 1.0 | 27.1 | 0.5 | 61.1 | — | 10.4 | 1,008 |

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | '19年7月～'20年6月末 | '20年7月～'21年6月末 | '21年7月以降 |
|---|----------------|----------------|----------|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 43% | 45% | 48% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | 12.2% | 9.7% | 9% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.8% | 5.3% | 5% |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数（TOPIX） | 16% | 15% | 14% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 9.3% | 8.6% | 8% |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） | 6.7% | 6.4% | 6% |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数（配当込み） | 5% | 5% | 5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） | 5% | 5% | 5% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式（新興国を含む）・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベンチマーク | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 | 投資信託 組入比率 |
|-------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2021年6月22日 | 12,945 | — | 140.95 | — | 29.0 | 0.6 | 58.9 | — | 10.5 |
| 6月末 | 12,968 | 0.2 | 141.25 | 0.2 | 29.1 | 0.7 | 59.0 | — | 10.4 |
| 7月末 | 12,933 | △0.1 | 141.02 | 0.0 | 26.5 | 0.5 | 61.4 | — | 10.4 |
| 8月末 | 13,013 | 0.5 | 141.97 | 0.7 | 27.3 | 0.6 | 60.9 | — | 10.3 |
| 9月末 | 12,981 | 0.3 | 141.59 | 0.5 | 27.0 | 0.8 | 61.1 | — | 10.0 |
| 10月末 | 13,138 | 1.5 | 143.36 | 1.7 | 27.0 | 0.7 | 60.8 | — | 10.6 |
| 11月末 | 12,971 | 0.2 | 141.65 | 0.5 | 26.3 | 0.7 | 61.7 | — | 10.1 |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2021年12月22日 | 13,034 | 0.7 | 142.43 | 1.0 | 27.1 | 0.5 | 61.1 | — | 10.4 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

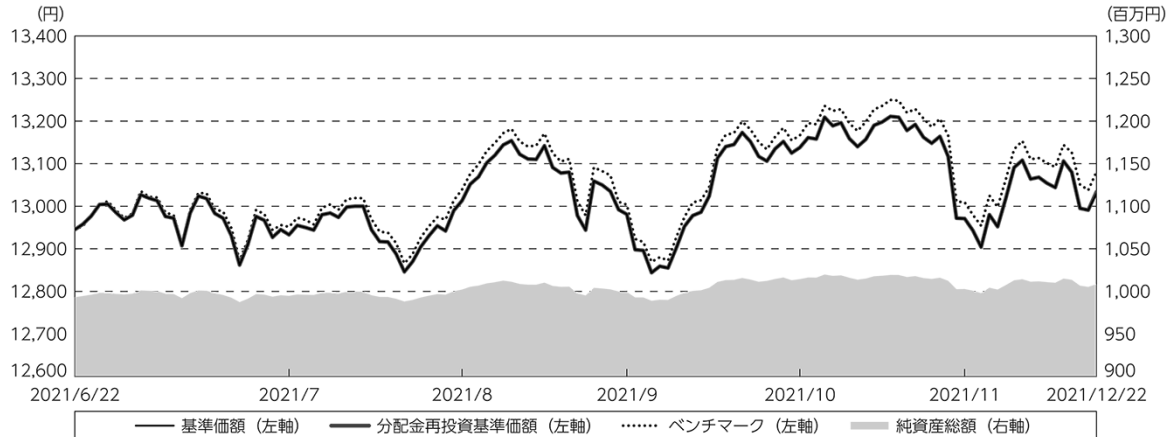
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：12,945円

期 末：13,029円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 0.7% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

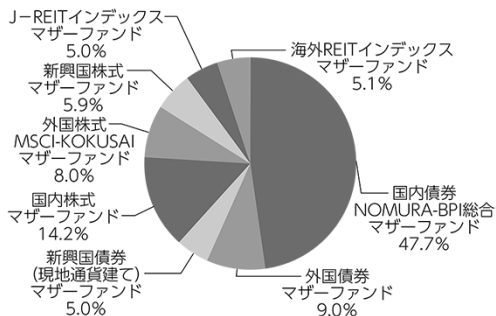
外国株式や外国REITなどの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資 産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念は高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は上記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

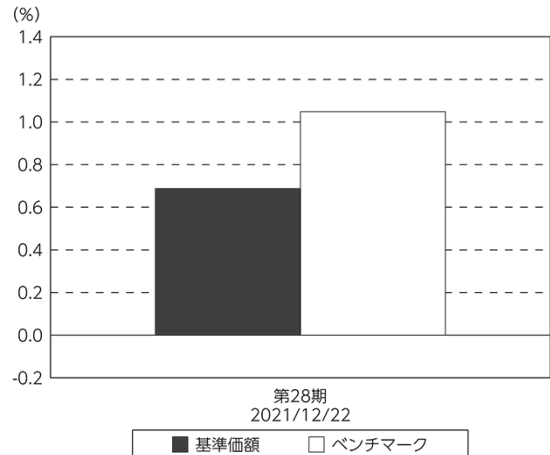
マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+0.7%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+1.0%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第28期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.038% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 4,443 |

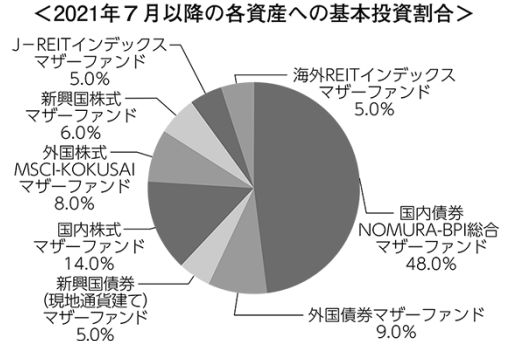
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|------------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|-------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 24期(2019年12月23日) | 12,415 | 5 | 5.2 | 132.96 | 5.6 | 40.5 | 0.6 | 47.0 | — | 11.1 | 875 |
| 25期(2020年6月22日) | 11,731 | 5 | △5.5 | 125.92 | △5.3 | 40.0 | 0.9 | 46.9 | — | 11.4 | 874 |
| 26期(2020年12月22日) | 12,570 | 5 | 7.2 | 135.32 | 7.5 | 38.7 | 0.8 | 49.3 | — | 10.4 | 940 |
| 27期(2021年6月22日) | 13,677 | 5 | 8.8 | 147.75 | 9.2 | 38.6 | 0.9 | 49.0 | — | 10.7 | 1,019 |
| 28期(2021年12月22日) | 13,799 | 5 | 0.9 | 149.58 | 1.2 | 36.7 | 0.7 | 51.2 | — | 10.5 | 1,060 |

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | '19年7月～'20年6月末 | '20年7月～'21年6月末 | '21年7月以降 |
|---|----------------|----------------|----------|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 33% | 35% | 37% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | 12.2% | 9.7% | 9.7% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.8% | 5.3% | 5.3% |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数（TOPIX） | 20.5% | 20% | 19% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 11.9% | 11.5% | 10.9% |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） | 8.6% | 8.5% | 8.1% |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数（配当込み） | 5.5% | 5% | 5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） | 5.5% | 5% | 5% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式（新興国を含む）・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算してあります。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベンチマーク | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 | 投 資 信 託 証 入 比 率 |
|-------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2021年6月22日 | 13,677 | — | 147.75 | — | 38.6 | 0.9 | 49.0 | — | 10.7 |
| 6月末 | 13,710 | 0.2 | 148.15 | 0.3 | 38.7 | 0.9 | 49.0 | — | 10.6 |
| 7月末 | 13,638 | △0.3 | 147.53 | △0.1 | 36.0 | 0.7 | 51.6 | — | 10.6 |
| 8月末 | 13,754 | 0.6 | 148.88 | 0.8 | 36.9 | 0.8 | 51.0 | — | 10.4 |
| 9月末 | 13,743 | 0.5 | 148.67 | 0.6 | 36.6 | 1.1 | 51.2 | — | 10.1 |
| 10月末 | 13,944 | 2.0 | 150.89 | 2.1 | 36.6 | 1.0 | 50.9 | — | 10.7 |
| 11月末 | 13,721 | 0.3 | 148.59 | 0.6 | 35.8 | 1.0 | 51.8 | — | 10.3 |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2021年12月22日 | 13,804 | 0.9 | 149.58 | 1.2 | 36.7 | 0.7 | 51.2 | — | 10.5 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

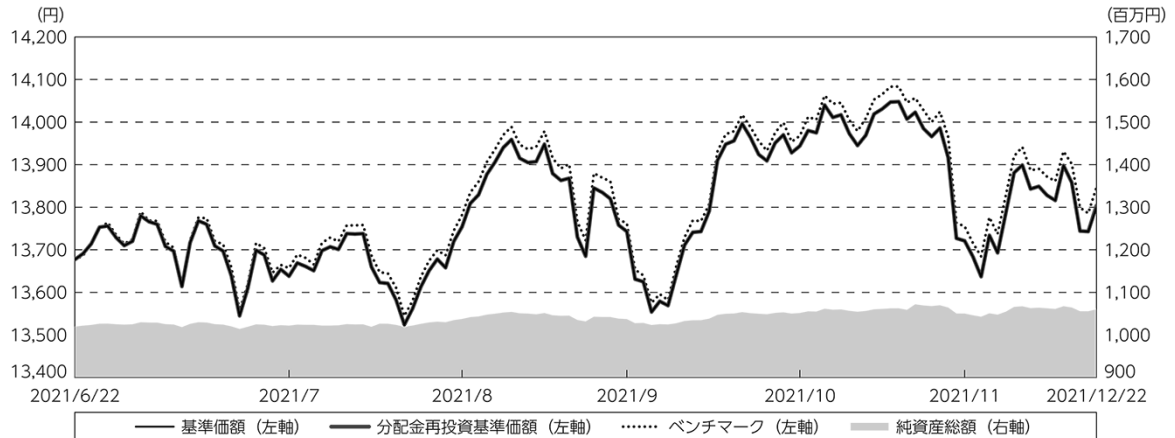
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：13,677円

期 末：13,799円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 0.9% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

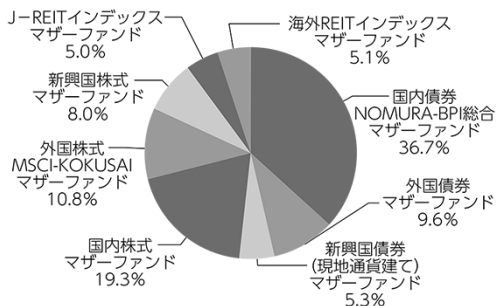
外国株式や外国REITなどの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資 産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念が高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



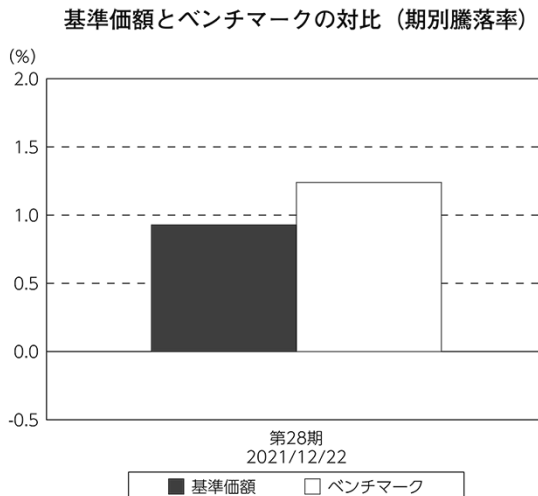
当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は上記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+0.9%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+1.2%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第28期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.036% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 5,614 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

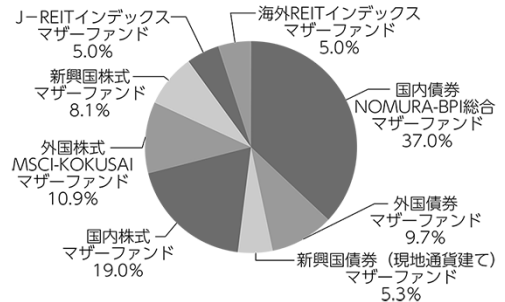
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

<2021年7月以降の各資産への基本投資割合>



○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|------------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 24期(2019年12月23日) | 12,403 | 5 | 6.2 | 131.59 | 6.5 | 45.4 | 0.7 | 38.2 | — | 15.0 | 617 |
| 25期(2020年6月22日) | 11,582 | 5 | △6.6 | 123.09 | △6.5 | 44.8 | 1.0 | 38.1 | — | 15.3 | 607 |
| 26期(2020年12月22日) | 12,537 | 5 | 8.3 | 133.61 | 8.5 | 43.5 | 0.9 | 39.5 | — | 15.3 | 670 |
| 27期(2021年6月22日) | 13,924 | 5 | 11.1 | 148.89 | 11.4 | 43.4 | 1.0 | 39.1 | — | 15.8 | 762 |
| 28期(2021年12月22日) | 14,088 | 5 | 1.2 | 151.13 | 1.5 | 42.5 | 0.9 | 41.3 | — | 14.6 | 787 |

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | '19年7月～'20年6月末 | '20年7月～'21年6月末 | '21年7月以降 |
|---|----------------|----------------|----------|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 24% | 25% | 27% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | 12.2% | 9.7% | 9.7% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.8% | 5.3% | 5.3% |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数（TOPIX） | 23% | 22.5% | 22% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 13.4% | 12.9% | 12.6% |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） | 9.6% | 9.6% | 9.4% |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数（配当込み） | 7.5% | 7.5% | 7% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） | 7.5% | 7.5% | 7% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式（新興国を含む）・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベンチマーク | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 | 投資信託 組入比率 |
|-------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2021年6月22日 | 13,924 | — | 148.89 | — | 43.4 | 1.0 | 39.1 | — | 15.8 |
| 6月末 | 13,962 | 0.3 | 149.34 | 0.3 | 43.4 | 1.1 | 39.1 | — | 15.6 |
| 7月末 | 13,873 | △0.4 | 148.55 | △0.2 | 41.8 | 0.8 | 41.7 | — | 14.7 |
| 8月末 | 14,016 | 0.7 | 150.18 | 0.9 | 42.7 | 0.9 | 41.1 | — | 14.4 |
| 9月末 | 14,006 | 0.6 | 149.94 | 0.7 | 42.3 | 1.2 | 41.3 | — | 14.0 |
| 10月末 | 14,258 | 2.4 | 152.69 | 2.6 | 42.2 | 1.1 | 41.0 | — | 14.8 |
| 11月末 | 13,989 | 0.5 | 149.92 | 0.7 | 41.6 | 1.2 | 41.9 | — | 14.3 |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2021年12月22日 | 14,093 | 1.2 | 151.13 | 1.5 | 42.5 | 0.9 | 41.3 | — | 14.6 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

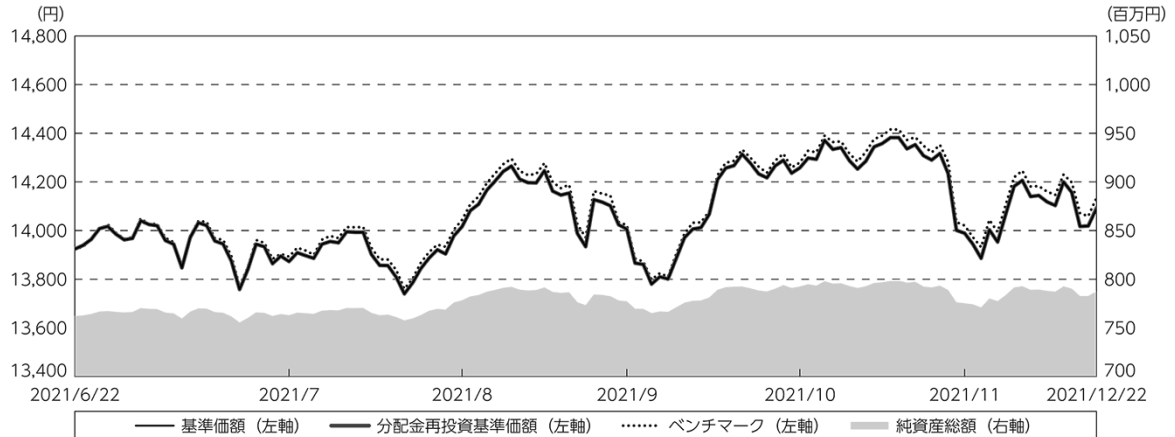
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

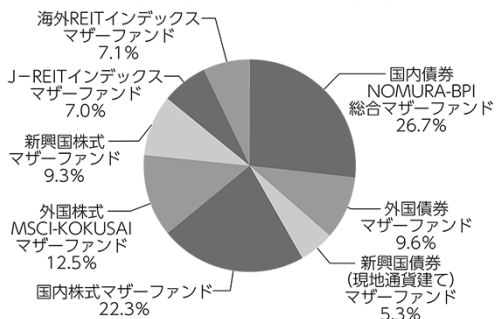
外国株式や外国REITなどの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念は高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



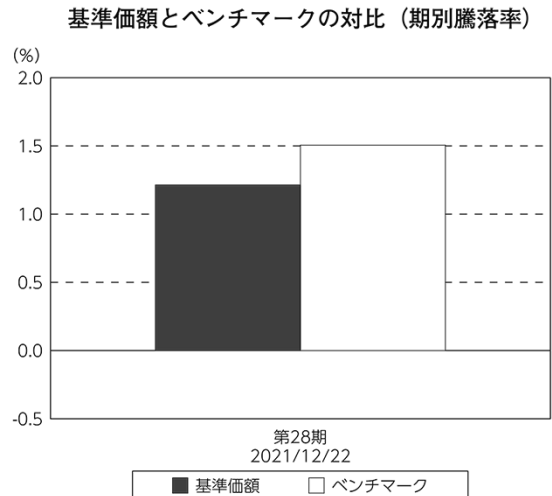
当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+1.2%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+1.5%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第28期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.035% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 6,212 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

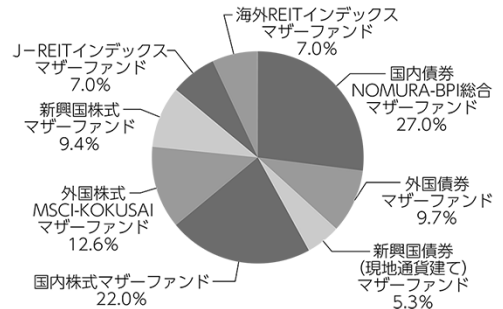
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

<2021年7月以降の各資産への基本投資割合>



○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|------------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|-------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 24期(2019年12月23日) | 12,381 | 5 | 6.9 | 130.16 | 7.2 | 51.2 | 0.8 | 33.2 | — | 14.1 | 1,207 |
| 25期(2020年6月22日) | 11,526 | 5 | △6.9 | 121.36 | △6.8 | 50.6 | 1.1 | 33.1 | — | 14.4 | 1,116 |
| 26期(2020年12月22日) | 12,570 | 5 | 9.1 | 132.66 | 9.3 | 48.3 | 1.0 | 34.5 | — | 15.4 | 1,181 |
| 27期(2021年6月22日) | 14,066 | 5 | 11.9 | 148.92 | 12.3 | 48.2 | 1.1 | 34.2 | — | 15.8 | 1,311 |
| 28期(2021年12月22日) | 14,256 | 5 | 1.4 | 151.38 | 1.7 | 47.3 | 1.0 | 35.4 | — | 15.6 | 1,345 |

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | '19年7月～'20年6月末 | '20年7月～'21年6月末 | '21年7月以降 |
|---|----------------|----------------|----------|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 19% | 20% | 21% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | 12.2% | 9.7% | 9.7% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.8% | 5.3% | 5.3% |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数（TOPIX） | 26% | 25% | 24.5% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 15.1% | 14.4% | 14.1% |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） | 10.9% | 10.6% | 10.4% |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数（配当込み） | 7% | 7.5% | 7.5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） | 7% | 7.5% | 7.5% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式（新興国を含む）・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベンチマーク | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|-------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|---------------------------|
| | 円 | 騰 落 率 | 円 | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) | | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2021年6月22日 | 14,066 | — | 148.92 | — | 48.2 | 1.1 | 34.2 | — | 15.8 |
| 6月末 | 14,109 | 0.3 | 149.42 | 0.3 | 48.2 | 1.2 | 34.2 | — | 15.7 |
| 7月末 | 14,003 | △0.4 | 148.47 | △0.3 | 46.6 | 0.9 | 35.8 | — | 15.8 |
| 8月末 | 14,166 | 0.7 | 150.28 | 0.9 | 47.5 | 1.0 | 35.2 | — | 15.4 |
| 9月末 | 14,164 | 0.7 | 150.10 | 0.8 | 47.1 | 1.4 | 35.3 | — | 15.1 |
| 10月末 | 14,442 | 2.7 | 153.11 | 2.8 | 46.9 | 1.3 | 35.1 | — | 15.9 |
| 11月末 | 14,145 | 0.6 | 150.06 | 0.8 | 46.4 | 1.3 | 35.9 | — | 15.4 |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2021年12月22日 | 14,261 | 1.4 | 151.38 | 1.7 | 47.3 | 1.0 | 35.4 | — | 15.6 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

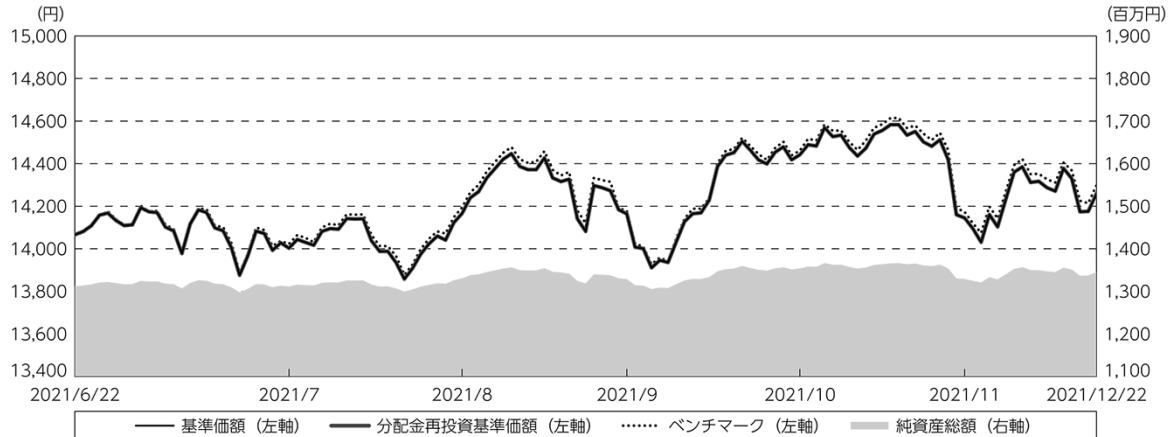
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：14,066円

期 末：14,256円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 1.4% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

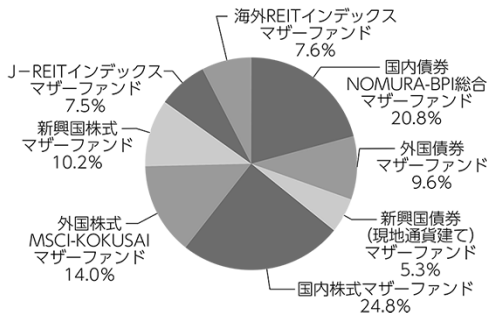
外国株式や外国REITなどの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資 産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念が高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

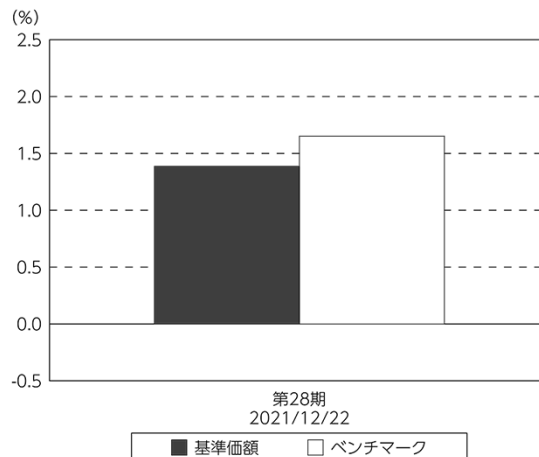
マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+1.4%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+1.7%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第28期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.035% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 5,916 |

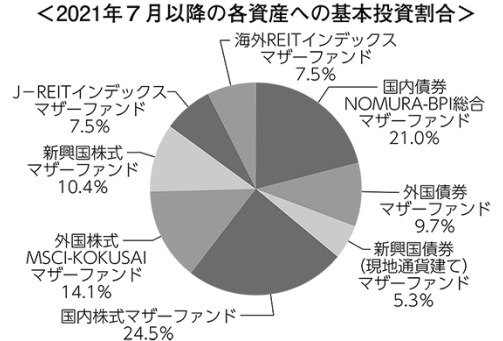
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|------------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 19期(2019年12月23日) | 22,083 | 5 | 7.6 | 223.40 | 7.8 | 59.9 | 0.9 | 28.2 | — | 10.4 | 149 |
| 20期(2020年6月22日) | 20,568 | 5 | △6.8 | 208.30 | △6.8 | 59.2 | 1.3 | 28.2 | — | 10.6 | 145 |
| 21期(2020年12月22日) | 22,705 | 5 | 10.4 | 230.32 | 10.6 | 57.9 | 1.2 | 29.6 | — | 10.6 | 148 |
| 22期(2021年6月22日) | 25,462 | 5 | 12.2 | 258.92 | 12.4 | 57.8 | 1.3 | 29.3 | — | 11.0 | 191 |
| 23期(2021年12月22日) | 25,825 | 5 | 1.4 | 263.24 | 1.7 | 55.9 | 1.1 | 30.5 | — | 11.8 | 208 |

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | '19年7月～'20年6月末 | '20年7月～'21年6月末 | '21年7月以降 |
|---|----------------|----------------|----------|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 14.5% | 15% | 16% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | 11.8% | 9.7% | 9.7% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.7% | 5.3% | 5.3% |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数（TOPIX） | 30.5% | 30% | 29% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 17.7% | 17.2% | 16.7% |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） | 12.8% | 12.8% | 12.3% |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数（配当込み） | 5% | 5% | 5.5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） | 5% | 5% | 5.5% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式（新興国を含む）・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベンチマーク | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 | 投資信託 組入比率 |
|-------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| | 円 | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) | | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2021年6月22日 | 25,462 | — | 258.92 | — | 57.8 | 1.3 | 29.3 | — | 11.0 |
| 6月末 | 25,556 | 0.4 | 259.95 | 0.4 | 57.8 | 1.4 | 29.3 | — | 10.9 |
| 7月末 | 25,295 | △0.7 | 257.58 | △0.5 | 55.3 | 1.1 | 30.9 | — | 11.9 |
| 8月末 | 25,632 | 0.7 | 261.16 | 0.9 | 56.1 | 1.2 | 30.2 | — | 11.6 |
| 9月末 | 25,692 | 0.9 | 261.42 | 1.0 | 55.7 | 1.6 | 30.3 | — | 11.4 |
| 10月末 | 26,198 | 2.9 | 266.65 | 3.0 | 55.5 | 1.5 | 30.3 | — | 12.0 |
| 11月末 | 25,614 | 0.6 | 260.88 | 0.8 | 55.0 | 1.6 | 30.9 | — | 11.7 |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2021年12月22日 | 25,830 | 1.4 | 263.24 | 1.7 | 55.9 | 1.1 | 30.5 | — | 11.8 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

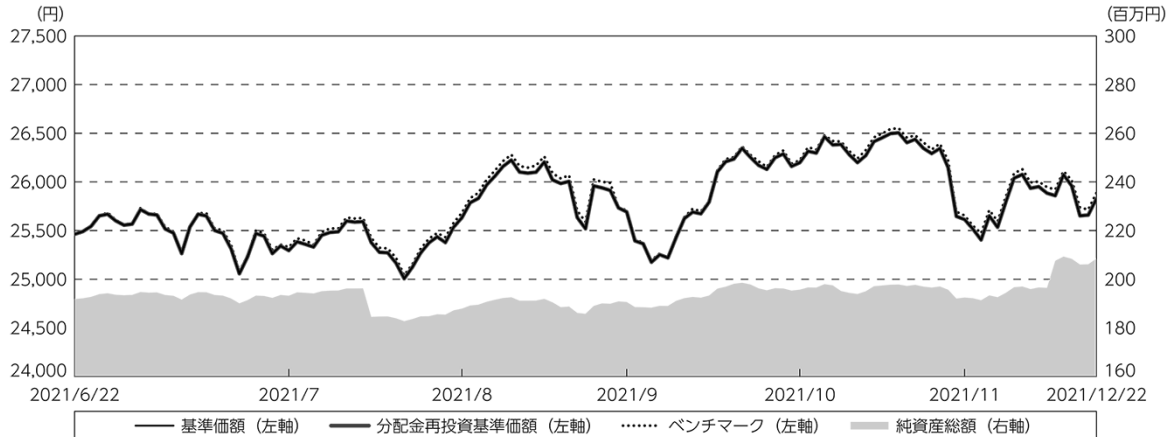
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：25,462円

期 末：25,825円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 1.4% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

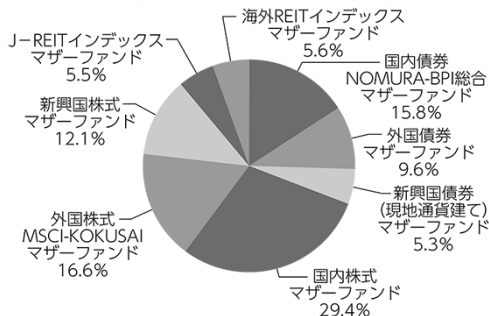
外国株式や外国REITなどの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念は高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



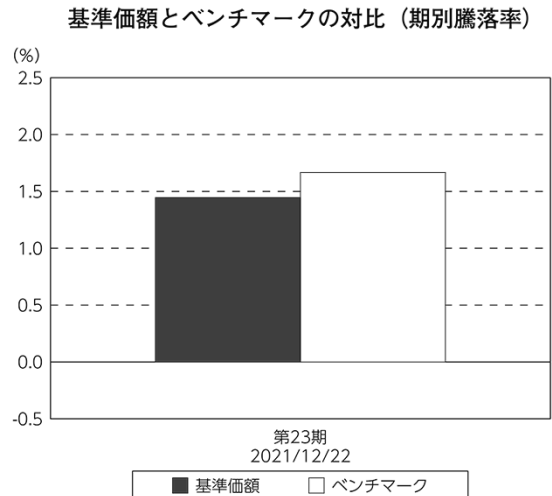
当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+1.4%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+1.7%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第23期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.019% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 15,824 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

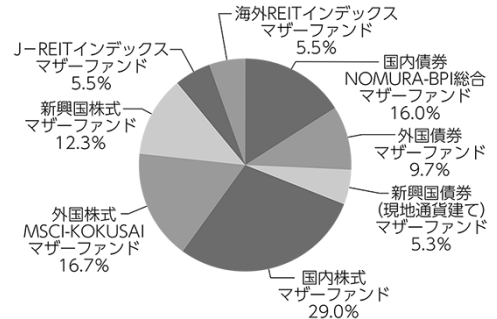
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

<2021年7月以降の各資産への基本投資割合>



○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|------------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 9期(2019年12月23日) | 12,417 | 5 | 8.1 | 125.41 | 8.3 | 64.7 | 1.0 | 23.3 | — | 10.5 | 239 |
| 10期(2020年6月22日) | 11,512 | 5 | △7.2 | 116.36 | △7.2 | 64.0 | 1.4 | 23.3 | — | 10.7 | 219 |
| 11期(2020年12月22日) | 12,786 | 5 | 11.1 | 129.46 | 11.3 | 62.7 | 1.3 | 24.7 | — | 10.7 | 234 |
| 12期(2021年6月22日) | 14,435 | 5 | 12.9 | 146.50 | 13.2 | 62.6 | 1.4 | 24.4 | — | 11.0 | 245 |
| 13期(2021年12月22日) | 14,651 | 5 | 1.5 | 149.03 | 1.7 | 61.7 | 1.2 | 25.5 | — | 10.9 | 253 |

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | '19年7月～'20年6月末 | '20年7月～'21年6月末 | '21年7月以降 |
|---|----------------|----------------|----------|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 12% | 12.5% | 13% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | 9.8% | 8.1% | 8.4% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.2% | 4.4% | 4.6% |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数（TOPIX） | 33% | 32.5% | 32% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 19.2% | 18.7% | 18.4% |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） | 13.8% | 13.8% | 13.6% |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数（配当込み） | 5% | 5% | 5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） | 5% | 5% | 5% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式（新興国を含む）・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベンチマーク | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 | 投 資 信 託 証 入 比 率 |
|-------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2021年6月22日 | 14,435 | — | 146.50 | — | 62.6 | 1.4 | 24.4 | — | 11.0 |
| 6月末 | 14,491 | 0.4 | 147.10 | 0.4 | 62.6 | 1.5 | 24.4 | — | 10.9 |
| 7月末 | 14,320 | △0.8 | 145.53 | △0.7 | 61.1 | 1.2 | 25.9 | — | 11.0 |
| 8月末 | 14,529 | 0.7 | 147.74 | 0.8 | 61.8 | 1.4 | 25.3 | — | 10.7 |
| 9月末 | 14,583 | 1.0 | 148.05 | 1.1 | 61.4 | 1.8 | 25.4 | — | 10.5 |
| 10月末 | 14,878 | 3.1 | 151.10 | 3.1 | 61.2 | 1.6 | 25.4 | — | 11.1 |
| 11月末 | 14,529 | 0.7 | 147.65 | 0.8 | 60.7 | 1.7 | 25.9 | — | 10.8 |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2021年12月22日 | 14,656 | 1.5 | 149.03 | 1.7 | 61.7 | 1.2 | 25.5 | — | 10.9 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

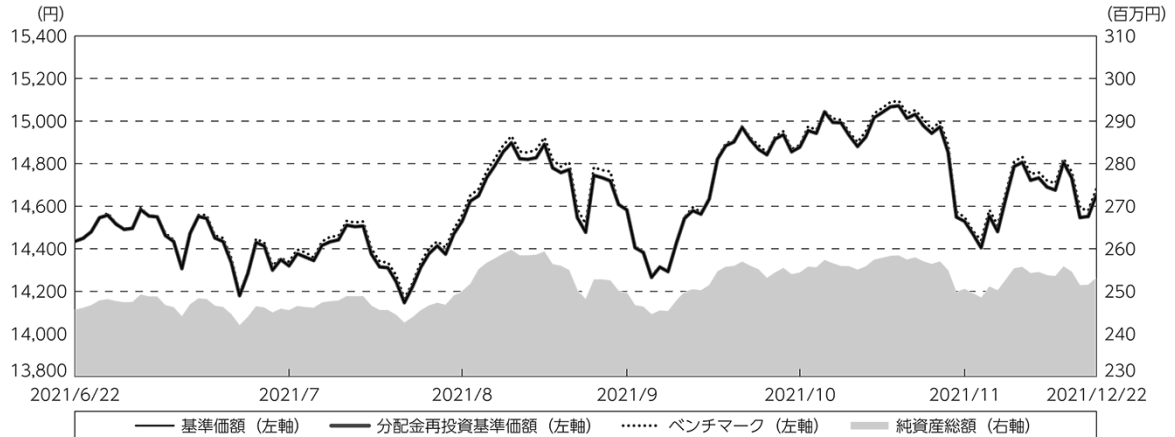
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

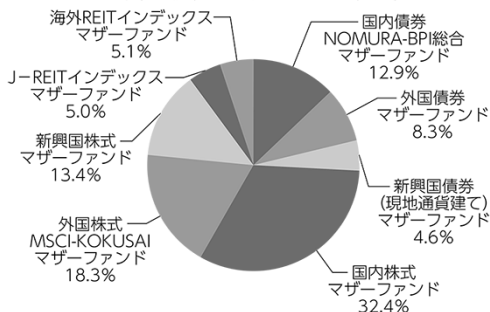
外国株式や外国REITなどの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資 産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念が高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

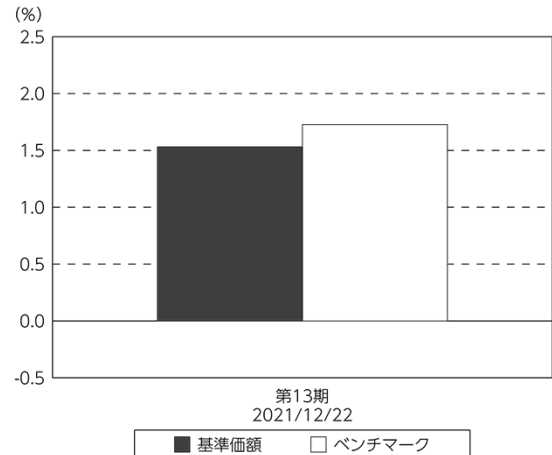
マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+1.5%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+1.7%を0.2ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



- (注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。
 (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

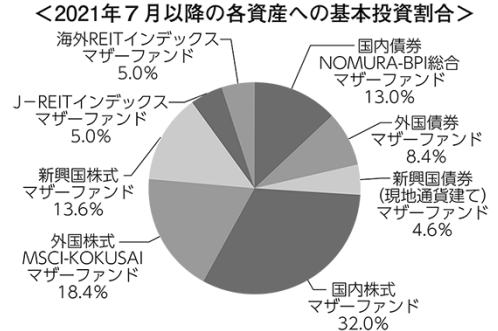
| 項 目 | 第13期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.034% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 4,849 |

- (注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
 (注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。



○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|------|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 2019年9月13日 | 10,000 | — | — | 100.00 | — | — | — | — | — | — | 1 |
| 1期(2019年12月23日) | 10,588 | 5 | 5.9 | 105.95 | 6.0 | 68.5 | 1.0 | 19.4 | — | 10.5 | 21 |
| 2期(2020年6月22日) | 9,785 | 0 | △7.6 | 97.92 | △7.6 | 67.8 | 1.5 | 19.4 | — | 10.8 | 76 |
| 3期(2020年12月22日) | 10,938 | 5 | 11.8 | 109.63 | 12.0 | 67.5 | 1.4 | 19.7 | — | 10.8 | 88 |
| 4期(2021年6月22日) | 12,431 | 5 | 13.7 | 124.87 | 13.9 | 67.4 | 1.5 | 19.5 | — | 11.1 | 111 |
| 5期(2021年12月22日) | 12,634 | 5 | 1.7 | 127.16 | 1.8 | 67.4 | 1.4 | 19.6 | — | 11.0 | 149 |

*基準価額の騰落率は分配金込み。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

| | 当初設定時～'20年6月末 | '20年7月～'21年6月末 | '21年7月以降 |
|---|---------------|----------------|----------|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合 | 10% | 10% | 10% |
| [外国債券マザーファンド] FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | 8.2% | 6.5% | 6.4% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 1.8% | 3.5% | 3.6% |
| [国内株式マザーファンド] 東証株価指数（TOPIX） | 35% | 35% | 35% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 20.3% | 20.1% | 20.1% |
| [新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） | 14.7% | 14.9% | 14.9% |
| [J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数（配当込み） | 5% | 5% | 5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） | 5% | 5% | 5% |

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式（新興国を含む）・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | ベンチマーク | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 債 券 組入比率 | 債 券 先物比率 | 投資信託 組入比率 |
|-------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) | 円 | % | % | % | % | % | % | % | % |
| 2021年6月22日 | 12,431 | — | 124.87 | — | 67.4 | 1.5 | 19.5 | — | 11.1 |
| 6月末 | 12,482 | 0.4 | 125.41 | 0.4 | 67.3 | 1.6 | 19.5 | — | 11.0 |
| 7月末 | 12,318 | △0.9 | 123.89 | △0.8 | 66.9 | 1.3 | 20.0 | — | 11.1 |
| 8月末 | 12,513 | 0.7 | 125.93 | 0.8 | 67.5 | 1.5 | 19.4 | — | 10.8 |
| 9月末 | 12,575 | 1.2 | 126.32 | 1.2 | 67.0 | 1.9 | 19.5 | — | 10.6 |
| 10月末 | 12,840 | 3.3 | 129.03 | 3.3 | 66.9 | 1.8 | 19.5 | — | 11.2 |
| 11月末 | 12,523 | 0.7 | 125.93 | 0.8 | 66.5 | 1.9 | 19.9 | — | 10.9 |
| (期 末) | | | | | | | | | |
| 2021年12月22日 | 12,639 | 1.7 | 127.16 | 1.8 | 67.4 | 1.4 | 19.6 | — | 11.0 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

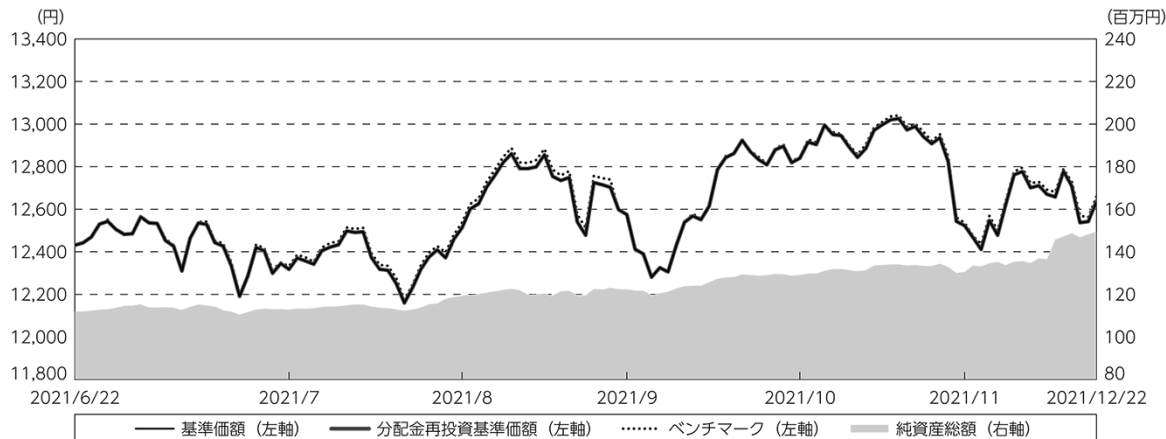
* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2021年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT(+12.3%)、外国株式(+10.6%)、国内株式(+1.6%)、外国債券(+1.4%)、国内債券(+0.1%)が上昇し、新興国株式(-6.6%)、国内REIT(-3.7%)、新興国債券(-3.0%)は下落しました。

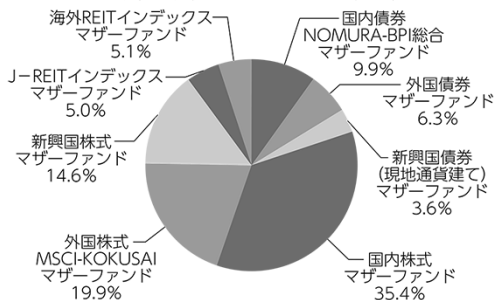
外国株式や外国REITなどの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

| 資 産 | 変動要因等 |
|--------|---|
| 国内債券 | 日銀による金融緩和策が継続する一方で、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは小幅に上昇しました。利子収入などからリターンはプラスとなりました。 |
| 外国債券 | インフレ懸念などを背景としたFRB（米連邦準備制度理事会）による早期の利上げ開始観測などから、米国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和縮小への懸念は高まったものの、欧州で新型コロナウイルスの感染拡大から経済活動の制限が再び強化されたことなどを背景に、ユーロ圏債券利回りは低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは上昇しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内株式 | 国内における新型コロナウイルス感染拡大の鎮静化に伴い景気回復期待が高まったことや外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。 |
| 外国株式 | 米国におけるインフラ投資法案の成立、堅調な経済指標や企業業績の発表などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |
| (新興国) | 中国当局による企業への規制強化や中国大手不動産企業の債務問題、米国における早期の利上げ開始観測などを受け新興国からの資金流出懸念が高まったことなどを背景に、中国を中心に下落しました。主要新興国通貨はまちまちの展開となりました。 |
| 国内REIT | 東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落が継続したことなどを背景に、下落しました。 |
| 外国REIT | 米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。米ドルは内外金利差の拡大などから対円で上昇（円安）しましたが、ユーロは内外金利差の縮小などから対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年12月22日現在)>



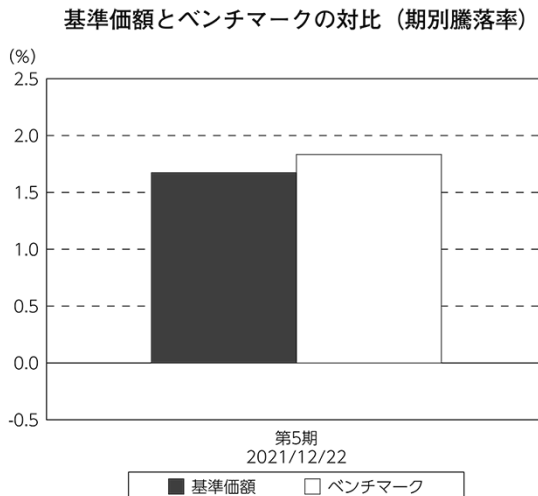
当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上と高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、59ページをご参照ください。

○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+1.7%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+1.8%を0.1ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項 目 | 第5期 |
|-----------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.040% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,633 |

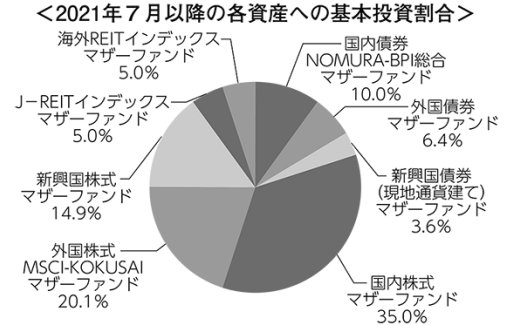
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

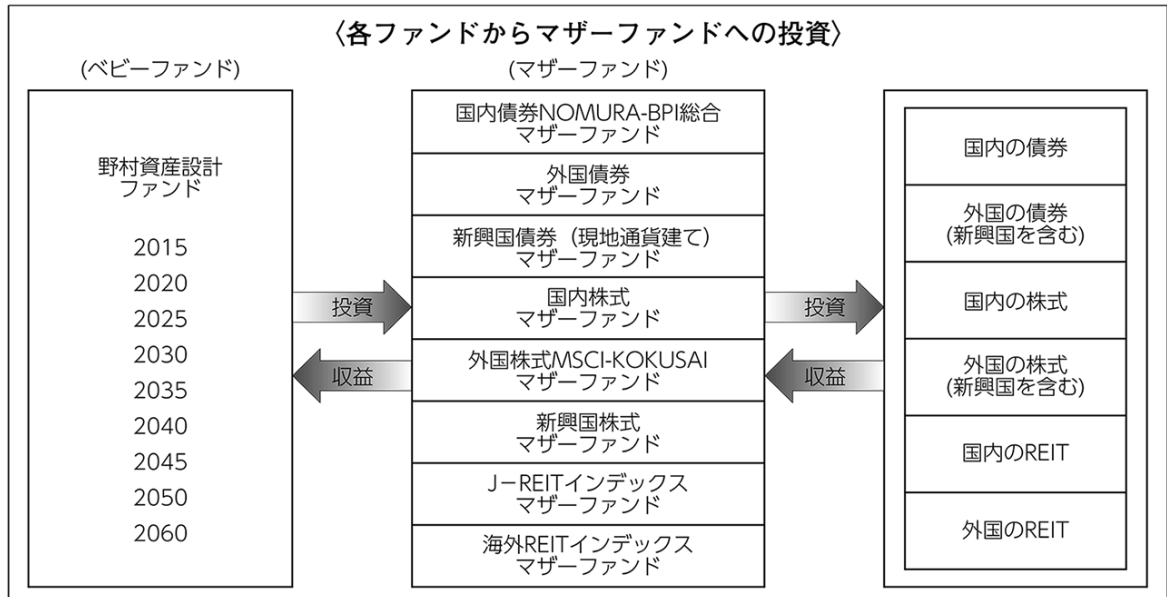
◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行ない、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行ないます。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行なう8つのマザーファンドへの投資を通じて行ないます。なお、2021年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



◎マザーファンドの運用経過



【国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド】

NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ない、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した利付債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。

【外国債券マザーファンド】

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ため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行なっていません。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債などに分散投資しました。毎月の指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行なっておりません。

[国内株式マザーファンド]

東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目指し、先物を含む実質の株式組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。現物株式につきましては、東証1部上場銘柄に幅広く分散投資し、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行なってまいりました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。また、日々の追加設定・解約による資金移動に対しては売買にかかるコストなどを考慮し、株式先物を利用してまいりました。

[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]

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、株式（投資信託証券や先物を含む）組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行ない、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

[新興国株式マザーファンド]

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指すため、新興国の株式（ETF（上場投資信託証券）やDR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行ないました。当運用期間中の資金流入出や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行ないました。実質株式組入比率（投資信託証券や株式先物を含む）は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

[J-REITインデックス マザーファンド]

東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、実質投資信託証券組入比率（先物を含む）は当運用期間を通じて高位に維持しました。J-REITへの投資にあたっては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証REIT指数（配当込み）でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行なってまいりました。また、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用してまいりました。

[海外REITインデックス マザーファンド]

S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、実質投資信託証券組入比率（先物を含む）は当運用期間を通じて高位に維持しました。REITへの投資にあたっては、組入銘柄の構成比率がS&P先進国REIT指数（除く日本）の銘柄構成比とほぼ同水準になるように運用を行ないました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行ないませんでした。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 第88期～第93期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------|-----------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 50 | 0.425 | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (18) | (0.154) | 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 |
| （ 販 売 会 社 ） | (28) | (0.243) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (3) | (0.028) | 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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.001 | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.006 | (d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (0) | (0.003) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.002) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 51 | 0.433 | |
| 作成期間の平均基準価額は、11,675円です。 | | | |

* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

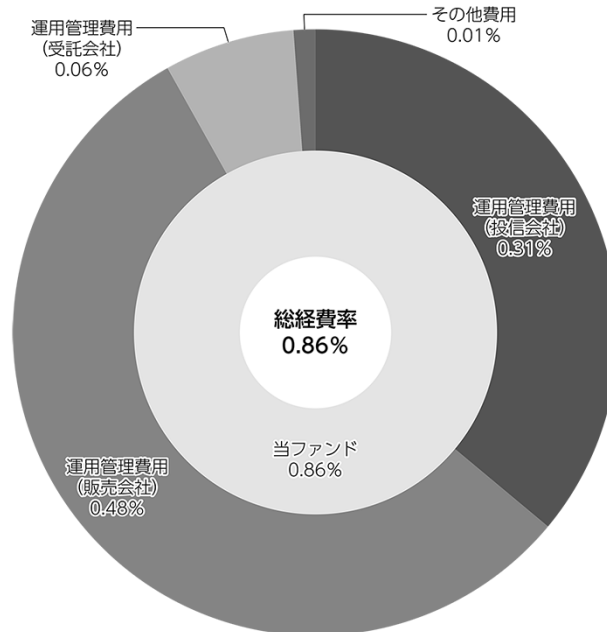
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.86%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 第88期～第93期 | | | |
|-------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | 設定 | | 解約 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内株式マザーファンド | 千口 2,708 | 千円 5,555 | 千口 3,561 | 千円 7,493 |
| 外国債券マザーファンド | 233 | 597 | 884 | 2,268 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 212 | 887 | 1,428 | 6,211 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 8,306 | 11,047 | 12,536 | 16,700 |
| J-REITインデックスマザーファンド | 940 | 2,560 | 814 | 2,293 |
| 海外REITインデックスマザーファンド | 266 | 778 | 2,124 | 6,486 |
| 新興国株式マザーファンド | 2,309 | 3,697 | 1,277 | 2,119 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | 1,667 | 2,340 | 233 | 326 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 第88期～第93期 | | |
|----------------------|-----------------|---------------------------------|------------------|
| | 国内株式 マザーファンド | 外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド | 新興国株式 マザーファンド |
| (a) 当作成期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,541,230千円 | 5,440,478千円 |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

<野村資産設計ファンド2015>

該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

| 区分 | 第88期～第93期 | | | | | |
|------------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

該当事項はございません。

<新興国株式マザーファンド>

| 区分 | 第88期～第93期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.0%

<国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド>

| 区分 | 第88期～第93期 | | | | | |
|-----|----------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.1%

<外国債券マザーファンド>

| 区分 | 第88期～第93期 | | | | | |
|--------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

<新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド>

| 区 分 | 第88期～第93期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.3%

<J-REITインデックス マザーファンド>

| 区 分 | 第88期～第93期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.1%

<海外REITインデックス マザーファンド>

| 区 分 | 第88期～第93期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.1%

利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 第88期～第93期 | | |
|-----|------------|-----------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 第93期末保有額 |
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 第88期～第93期 |
|-----|-----------|
| | 買 付 額 |
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 第88期～第93期 |
|------------------|-----------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 8千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.024千円 |
| (B) / (A) | 0.3% |

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第87期末 | 第93期末 | |
|--------------------------|---------|---------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 38,871 | 38,019 | 79,160 |
| 外国債券マザーファンド | 19,963 | 19,313 | 49,649 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 11,098 | 9,882 | 44,254 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 353,146 | 348,916 | 464,337 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 14,378 | 14,504 | 39,236 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 14,093 | 12,234 | 39,604 |
| 新興国株式マザーファンド | 19,958 | 20,990 | 33,039 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 19,082 | 20,516 | 28,302 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 第93期末 | |
|--------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 79,160 | 10.1 |
| 外国債券マザーファンド | 49,649 | 6.4 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 44,254 | 5.7 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 464,337 | 59.5 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 39,236 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 39,604 | 5.1 |
| 新興国株式マザーファンド | 33,039 | 4.2 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 28,302 | 3.6 |
| コール・ローン等、その他 | 3,196 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 780,777 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、第93期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第93期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、第93期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、第93期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、第93期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、第93期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルピア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルグアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第88期末 | 第89期末 | 第90期末 | 第91期末 | 第92期末 | 第93期末 |
|------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | 2021年7月26日現在 | 2021年8月23日現在 | 2021年9月22日現在 | 2021年10月22日現在 | 2021年11月22日現在 | 2021年12月22日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 791,520,259 | 784,705,323 | 784,223,458 | 789,151,573 | 788,808,182 | 780,777,848 |
| コール・ローン等 | 2,509,557 | 2,410,802 | 2,422,978 | 2,378,915 | 2,457,961 | 2,505,958 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 77,972,387 | 79,102,154 | 81,692,855 | 76,928,770 | 80,104,168 | 79,160,140 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 50,861,509 | 50,126,912 | 49,475,835 | 50,661,321 | 49,864,468 | 49,649,006 |
| 外国株式MSCI-HOUCSAIマザーファンド(評価額) | 45,726,357 | 44,926,853 | 42,774,496 | 47,412,335 | 45,463,257 | 44,254,718 |
| 国内債券XOMURA-DPI総合マザーファンド(評価額) | 474,368,799 | 470,825,213 | 469,797,570 | 467,082,525 | 471,482,398 | 464,337,535 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 39,100,607 | 38,069,263 | 38,059,948 | 38,927,892 | 38,554,690 | 39,236,888 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 40,641,530 | 39,425,030 | 37,970,490 | 41,843,446 | 39,512,276 | 39,604,031 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 32,288,298 | 32,028,236 | 32,844,977 | 35,314,488 | 33,607,762 | 33,039,154 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 27,932,968 | 27,790,860 | 27,630,108 | 28,432,827 | 27,761,202 | 28,302,303 |
| 未収入金 | 118,247 | — | 1,554,201 | 169,054 | — | 688,115 |
| (B) 負債 | 1,427,377 | 1,190,088 | 2,686,782 | 1,219,265 | 1,240,195 | 1,214,861 |
| 未払収益分配金 | 676,254 | 675,486 | 672,050 | 671,844 | 670,079 | 668,387 |
| 未払解約金 | 125,383 | — | 1,462,386 | — | — | — |
| 未払信託報酬 | 623,321 | 512,611 | 550,214 | 545,305 | 567,909 | 544,361 |
| 未払利息 | 1 | 2 | 1 | 2 | 2 | 1 |
| その他未払費用 | 2,418 | 1,989 | 2,131 | 2,114 | 2,205 | 2,112 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 790,092,882 | 783,515,235 | 781,536,676 | 787,932,308 | 787,567,987 | 779,562,987 |
| 元本 | 676,254,136 | 675,486,048 | 672,050,484 | 671,844,311 | 670,079,073 | 668,387,113 |
| 次期繰越損益金 | 113,838,746 | 108,029,187 | 109,486,192 | 116,087,997 | 117,488,914 | 111,175,874 |
| (D) 受益権総口数 | 676,254,136口 | 675,486,048口 | 672,050,484口 | 671,844,311口 | 670,079,073口 | 668,387,113口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 11,683円 | 11,599円 | 11,629円 | 11,728円 | 11,753円 | 11,663円 |

(注) 第88期首元本額は676,120,211円、第88～93期中追加設定元本額は1,536,227円、第88～93期中一部解約元本額は9,269,325円、1口当たり純資産額は、第88期1.1683円、第89期1.1599円、第90期1.1629円、第91期1.1728円、第92期1.1753円、第93期1.1663円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第88期 | 第89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年7月26日 | 2021年7月27日～ 2021年8月23日 | 2021年8月24日～ 2021年9月22日 | 2021年9月23日～ 2021年10月22日 | 2021年10月23日～ 2021年11月22日 | 2021年11月23日～ 2021年12月22日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 51 | △ 40 | △ 34 | △ 38 | △ 48 | △ 29 |
| 支払利息 | △ 51 | △ 40 | △ 34 | △ 38 | △ 48 | △ 29 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,818,821 | △ 4,489,989 | 3,230,848 | 7,854,431 | 2,946,154 | △ 4,801,218 |
| 売買益 | 5,203,010 | 8,722 | 6,109,328 | 11,052,062 | 4,465,401 | 867,837 |
| 売買損 | △ 2,384,189 | △ 4,498,711 | △ 2,878,480 | △ 3,197,631 | △ 1,519,247 | △ 5,669,055 |
| (C) 信託報酬等 | △ 625,739 | △ 514,600 | △ 552,345 | △ 547,419 | △ 570,114 | △ 546,473 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,193,031 | △ 5,004,629 | 2,678,469 | 7,306,974 | 2,375,992 | △ 5,347,720 |
| (E) 前期繰越損益金 | 134,765,566 | 136,076,066 | 129,686,580 | 131,599,997 | 137,823,678 | 139,122,106 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 22,443,597 | △ 22,366,764 | △ 22,206,807 | △ 22,147,130 | △ 22,040,677 | △ 21,930,125 |
| (配当等相当額) | (19,716,134) | (19,745,517) | (19,693,302) | (19,741,506) | (19,738,351) | (19,743,880) |
| (売買損益相当額) | (△ 42,159,731) | (△ 42,112,281) | (△ 41,900,109) | (△ 41,888,636) | (△ 41,779,028) | (△ 41,674,005) |
| (G) 計(D+E+F) | 114,515,000 | 108,704,673 | 110,158,242 | 116,759,841 | 118,158,993 | 111,844,261 |
| (H) 収益分配金 | △ 676,254 | △ 675,486 | △ 672,050 | △ 671,844 | △ 670,079 | △ 668,387 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 113,838,746 | 108,029,187 | 109,486,192 | 116,087,997 | 117,488,914 | 111,175,874 |
| 追加信託差損益金 | △ 22,443,597 | △ 22,366,764 | △ 22,206,807 | △ 22,147,130 | △ 22,040,677 | △ 21,930,125 |
| (配当等相当額) | (19,716,431) | (19,745,693) | (19,693,587) | (19,741,981) | (19,738,544) | (19,744,121) |
| (売買損益相当額) | (△ 42,160,028) | (△ 42,112,457) | (△ 41,900,394) | (△ 41,889,111) | (△ 41,779,221) | (△ 41,674,246) |
| 分配準備積立金 | 136,282,343 | 135,683,782 | 135,090,777 | 138,235,127 | 139,529,591 | 138,766,180 |
| 繰越損益金 | — | △ 5,287,831 | △ 3,397,778 | — | — | △ 5,660,181 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第88期 | 第89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 |
|------------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年7月26日 | 2021年7月27日～ 2021年8月23日 | 2021年8月24日～ 2021年9月22日 | 2021年9月23日～ 2021年10月22日 | 2021年10月23日～ 2021年11月22日 | 2021年11月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 828,521円 | 283,202円 | 817,183円 | 1,320,978円 | 552,872円 | 312,461円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金相抵後) | 1,364,510円 | 0円 | 0円 | 2,590,618円 | 1,823,120円 | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 19,716,431円 | 19,745,693円 | 19,693,587円 | 19,741,981円 | 19,738,544円 | 19,744,121円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 134,765,566円 | 136,076,066円 | 134,945,644円 | 134,995,375円 | 137,823,678円 | 139,122,106円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 156,675,028円 | 156,104,961円 | 155,456,414円 | 158,648,952円 | 159,938,214円 | 159,178,688円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 2,316円 | 2,310円 | 2,313円 | 2,361円 | 2,386円 | 2,381円 |
| g. 分配金 | 676,254円 | 675,486円 | 672,050円 | 671,844円 | 670,079円 | 668,387円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |

○分配金のお知らせ

| | 第88期 | 第89期 | 第90期 | 第91期 | 第92期 | 第93期 |
|------------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 第38期～第43期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------|-----------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 51 | 0.425 | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (19) | (0.154) | 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 |
| （ 販 売 会 社 ） | (29) | (0.243) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (3) | (0.028) | 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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.001 | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.006 | (d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (0) | (0.003) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.002) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 52 | 0.433 | |
| 作成期間の平均基準価額は、12,090円です。 | | | |

* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

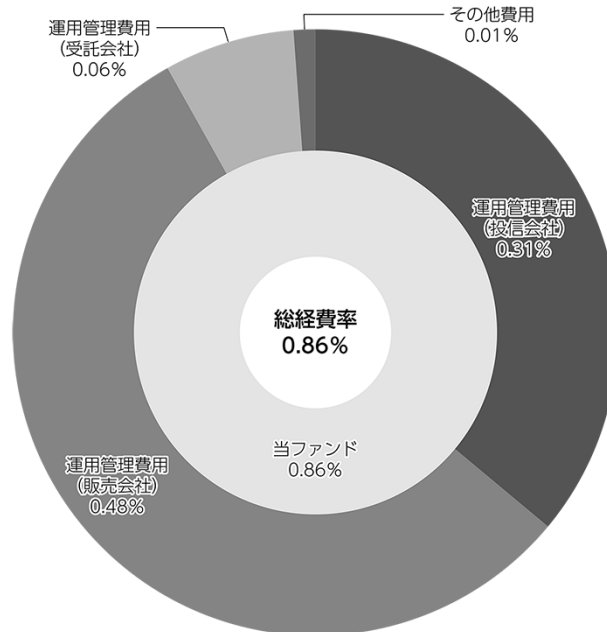
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.86%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 第38期～第43期 | | | |
|-------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | 設定 | | 解約 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内株式マザーファンド | 千口 3,469 | 千円 7,170 | 千口 4,047 | 千円 8,507 |
| 外国債券マザーファンド | 567 | 1,452 | 1,084 | 2,792 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 421 | 1,794 | 1,567 | 6,843 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 15,247 | 20,283 | 16,915 | 22,518 |
| J-REITインデックスマザーファンド | 1,239 | 3,386 | 1,008 | 2,825 |
| 海外REITインデックスマザーファンド | 543 | 1,621 | 2,315 | 7,101 |
| 新興国株式マザーファンド | 2,789 | 4,477 | 1,595 | 2,642 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 2,214 | 3,109 | 631 | 883 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 第38期～第43期 | | |
|----------------------|-----------------|---------------------------------|------------------|
| | 国内株式 マザーファンド | 外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド | 新興国株式 マザーファンド |
| (a) 当作成期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,541,230千円 | 5,440,478千円 |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

<野村資産設計ファンド2020>

該当事項はございません。

＜国内株式マザーファンド＞

| 区 分 | 第38期～第43期 | | | | | |
|------------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

該当事項はございません。

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区 分 | 第38期～第43期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.0%

＜国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド＞

| 区 分 | 第38期～第43期 | | | | | |
|-----|----------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.1%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区 分 | 第38期～第43期 | | | | | |
|--------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

<新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド>

| 区 分 | 第38期～第43期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.3%

<J-REITインデックス マザーファンド>

| 区 分 | 第38期～第43期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.1%

<海外REITインデックス マザーファンド>

| 区 分 | 第38期～第43期 | | | | | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.1%

利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 第38期～第43期 | | |
|-----|------------|-----------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 第43期末保有額 |
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 第38期～第43期 |
|-----|-----------|
| | 買 付 額 |
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 第38期～第43期 |
|------------------|-----------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 8千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.024千円 |
| (B) / (A) | 0.3% |

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 第37期末 | 第43期末 | |
|--------------------------|---------|---------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 38,913 | 38,335 | 79,819 |
| 外国債券マザーファンド | 19,987 | 19,471 | 50,054 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 11,110 | 9,964 | 44,623 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 353,509 | 351,840 | 468,229 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 14,393 | 14,625 | 39,563 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 14,108 | 12,336 | 39,933 |
| 新興国株式マザーファンド | 19,985 | 21,179 | 33,336 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 19,101 | 20,683 | 28,533 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 第43期末 | |
|--------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 79,819 | 10.1 |
| 外国債券マザーファンド | 50,054 | 6.4 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 44,623 | 5.7 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 468,229 | 59.4 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 39,563 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 39,933 | 5.1 |
| 新興国株式マザーファンド | 33,336 | 4.2 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 28,533 | 3.6 |
| コール・ローン等、その他 | 3,775 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 787,865 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、第43期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第43期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、第43期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、第43期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、第43期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、第43期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルピア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルグアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第38期末 | 第39期末 | 第40期末 | 第41期末 | 第42期末 | 第43期末 |
|------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | 2021年7月26日現在 | 2021年8月23日現在 | 2021年9月22日現在 | 2021年10月22日現在 | 2021年11月22日現在 | 2021年12月22日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 793,357,056 | 788,128,970 | 790,013,412 | 802,292,231 | 799,298,088 | 787,865,426 |
| コール・ローン等 | 2,614,161 | 2,484,562 | 2,543,515 | 2,775,814 | 2,587,592 | 2,612,620 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 78,147,535 | 79,438,308 | 82,460,464 | 78,183,905 | 81,178,056 | 79,819,237 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 50,975,433 | 50,341,263 | 49,935,753 | 51,482,399 | 50,518,115 | 50,054,148 |
| 外国株式USCI-HOKUSAIマザーファンド(評価額) | 45,830,625 | 45,118,510 | 43,171,519 | 48,183,706 | 46,058,828 | 44,623,829 |
| 国内債券NOMURA-DPI総合マザーファンド(評価額) | 475,437,733 | 472,819,432 | 474,139,769 | 474,703,261 | 477,621,918 | 468,229,698 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 39,189,621 | 38,230,435 | 38,413,911 | 39,561,685 | 39,057,828 | 39,563,156 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 40,732,222 | 39,592,258 | 38,318,092 | 42,554,402 | 40,031,208 | 39,933,752 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 32,392,769 | 32,180,576 | 33,142,001 | 35,884,815 | 34,080,575 | 33,336,444 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 28,036,957 | 27,923,626 | 27,888,388 | 28,903,900 | 28,163,968 | 28,533,253 |
| 未収入金 | — | — | — | 58,344 | — | 1,159,289 |
| (B) 負債 | 1,281,584 | 1,171,014 | 1,210,477 | 1,481,276 | 1,231,739 | 1,775,835 |
| 未払収益分配金 | 654,702 | 655,169 | 655,000 | 659,349 | 655,649 | 650,774 |
| 未払解約金 | — | — | 6 | 266,810 | — | 571,575 |
| 未払信託報酬 | 624,462 | 513,850 | 553,323 | 552,972 | 573,862 | 551,347 |
| 未払利息 | 1 | 2 | 2 | 2 | 2 | 1 |
| その他未払費用 | 2,419 | 1,993 | 2,146 | 2,143 | 2,226 | 2,138 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 792,075,472 | 786,957,956 | 788,802,935 | 800,810,955 | 798,066,349 | 786,089,591 |
| 元本 | 654,702,490 | 655,169,049 | 655,000,245 | 659,349,325 | 655,649,700 | 650,774,184 |
| 次期繰越損益金 | 137,372,982 | 131,788,907 | 133,802,690 | 141,461,630 | 142,416,649 | 135,315,407 |
| (D) 受益権総口数 | 654,702,490口 | 655,169,049口 | 655,000,245口 | 659,349,325口 | 655,649,700口 | 650,774,184口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,098円 | 12,012円 | 12,043円 | 12,145円 | 12,172円 | 12,079円 |

(注) 第38期首元本額は653,651,476円、第38～43期中追加設定元本額は20,523,145円、第38～43期中一部解約元本額は23,400,437円、1口当たり純資産額は、第38期1.2098円、第39期1.2012円、第40期1.2043円、第41期1.2145円、第42期1.2172円、第43期1.2079円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第38期 | 第39期 | 第40期 | 第41期 | 第42期 | 第43期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年7月26日 | 2021年7月27日～ 2021年8月23日 | 2021年8月24日～ 2021年9月22日 | 2021年9月23日～ 2021年10月22日 | 2021年10月23日～ 2021年11月22日 | 2021年11月23日～ 2021年12月22日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 51 | △ 43 | △ 40 | △ 42 | △ 52 | △ 39 |
| 支払利息 | △ 51 | △ 43 | △ 40 | △ 42 | △ 52 | △ 39 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,820,930 | △ 4,508,169 | 3,241,357 | 7,976,599 | 2,956,838 | △ 4,814,784 |
| 売買益 | 5,212,892 | 4,832 | 6,108,265 | 11,219,901 | 4,555,410 | 978,861 |
| 売買損 | △ 2,391,962 | △ 4,513,001 | △ 2,866,908 | △ 3,243,302 | △ 1,598,572 | △ 5,793,645 |
| (C) 信託報酬等 | △ 626,881 | △ 515,843 | △ 555,469 | △ 555,115 | △ 576,088 | △ 553,485 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,193,998 | △ 5,024,055 | 2,685,848 | 7,421,442 | 2,380,698 | △ 5,368,308 |
| (E) 前期繰越損益金 | 148,811,847 | 149,922,395 | 143,722,984 | 145,635,076 | 150,208,587 | 150,107,017 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 12,978,161 | △ 12,454,264 | △ 11,951,142 | △ 10,935,539 | △ 9,516,987 | △ 8,772,528 |
| (配当等相当額) | (80,204,752) | (80,801,534) | (81,283,402) | (82,937,718) | (83,812,974) | (83,890,008) |
| (売買損益相当額) | (△ 93,182,913) | (△ 93,255,798) | (△ 93,234,544) | (△ 93,873,257) | (△ 93,329,961) | (△ 92,662,536) |
| (G) 計(D+E+F) | 138,027,684 | 132,444,076 | 134,457,690 | 142,120,979 | 143,072,298 | 135,966,181 |
| (H) 収益分配金 | △ 654,702 | △ 655,169 | △ 655,000 | △ 659,349 | △ 655,649 | △ 650,774 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 137,372,982 | 131,788,907 | 133,802,690 | 141,461,630 | 142,416,649 | 135,315,407 |
| 追加信託差損益金 | △ 12,978,161 | △ 12,454,264 | △ 11,951,142 | △ 10,935,539 | △ 9,516,987 | △ 8,772,528 |
| (配当等相当額) | (80,208,504) | (80,803,439) | (81,285,896) | (82,944,874) | (83,816,473) | (83,894,923) |
| (売買損益相当額) | (△ 93,186,665) | (△ 93,257,703) | (△ 93,237,038) | (△ 93,880,413) | (△ 93,333,460) | (△ 92,667,451) |
| 分配準備積立金 | 150,351,143 | 149,551,473 | 149,180,723 | 152,397,169 | 151,933,636 | 149,769,368 |
| 繰越損益金 | — | △ 5,308,302 | △ 3,426,891 | — | — | △ 5,681,433 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 第38期 | 第39期 | 第40期 | 第41期 | 第42期 | 第43期 |
|------------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年7月26日 | 2021年7月27日～ 2021年8月23日 | 2021年8月24日～ 2021年9月22日 | 2021年9月23日～ 2021年10月22日 | 2021年10月23日～ 2021年11月22日 | 2021年11月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 829,833円 | 284,247円 | 823,580円 | 1,339,162円 | 560,900円 | 313,125円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金相抵後) | 1,364,165円 | 0円 | 0円 | 2,658,181円 | 1,819,798円 | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 80,208,504円 | 80,803,439円 | 81,285,896円 | 82,944,874円 | 83,816,473円 | 83,894,923円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 148,811,847円 | 149,922,395円 | 149,012,143円 | 149,059,175円 | 150,208,587円 | 150,107,017円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 231,214,349円 | 231,010,081円 | 231,121,619円 | 236,001,392円 | 236,405,758円 | 234,315,065円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 3,531円 | 3,525円 | 3,528円 | 3,579円 | 3,605円 | 3,600円 |
| g. 分配金 | 654,702円 | 655,169円 | 655,000円 | 659,349円 | 655,649円 | 650,774円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |

○分配金のお知らせ

| | 第38期 | 第39期 | 第40期 | 第41期 | 第42期 | 第43期 |
|------------------|------|------|------|------|------|------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 |

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

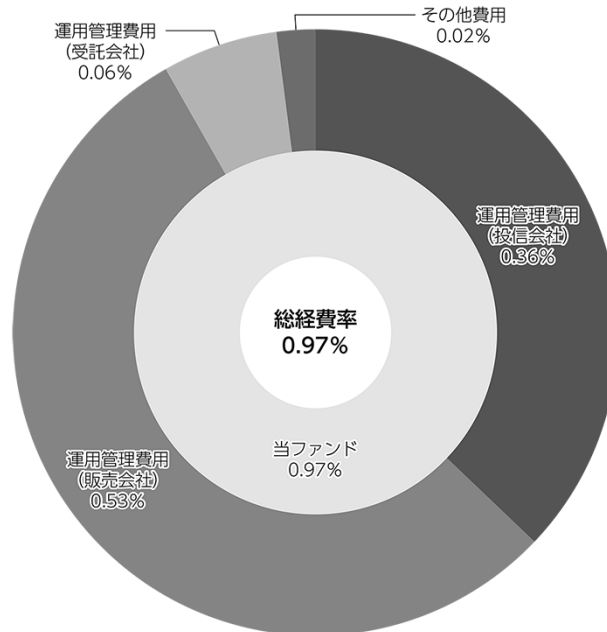
| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 62 | 0.474 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (24) | (0.182) | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等 |
| （ 販 売 会 社 ） | (34) | (0.265) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (4) | (0.028) | 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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.001 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.008 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (1) | (0.004) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.003) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 63 | 0.484 | |
| 期中の平均基準価額は、13,000円です。 | | | |

＊期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
 ＊各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
 ＊売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
 ＊各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.97%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設定 | | 解約 | |
|-------------------------|--------|--------|--------|--------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 5,729 | 11,801 | 10,349 | 21,452 |
| 外国債券マザーファンド | 882 | 2,254 | 3,297 | 8,408 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 663 | 2,802 | 3,822 | 16,286 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 38,293 | 50,902 | 10,930 | 14,565 |
| J-REITインデックスマザーファンド | 1,522 | 4,162 | 877 | 2,478 |
| 海外REITインデックスマザーファンド | 613 | 1,818 | 2,546 | 7,781 |
| 新興国株式マザーファンド | 4,641 | 7,446 | 4,165 | 7,078 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | 2,405 | 3,343 | 1,957 | 2,798 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 | | |
|---------------------|---------------|-------------------------|--------------|
| | 国内株式マザーファンド | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 新興国株式マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,975,248千円 | 5,451,594千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2025＞
該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

該当事項はございません。

<新興国株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.1%

<国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.1%

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.5%

＜J-REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.1%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.1%

利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-----------|
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 12千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.033千円 |
| (B) / (A) | 0.3% |

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|---------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 73,494 | 68,874 | 143,403 |
| 外国債券マザーファンド | 37,553 | 35,138 | 90,330 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 21,106 | 17,947 | 80,371 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 333,845 | 361,208 | 480,695 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 18,124 | 18,768 | 50,770 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 17,763 | 15,831 | 51,246 |
| 新興国株式マザーファンド | 37,447 | 37,922 | 59,690 |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 36,417 | 36,866 | 50,857 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 143,403 | 14.1 |
| 外国債券マザーファンド | 90,330 | 8.9 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 80,371 | 7.9 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 480,695 | 47.4 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 50,770 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 51,246 | 5.1 |
| 新興国株式マザーファンド | 59,690 | 5.9 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 50,857 | 5.0 |
| コール・ローン等、その他 | 7,377 | 0.7 |
| 投資信託財産総額 | 1,014,739 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルビア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルクアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,014,739,428 |
| コール・ローン等 | 5,799,335 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 143,403,080 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 90,330,770 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 80,371,948 |
| 国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額) | 480,695,762 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 50,770,801 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 51,246,358 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 59,690,531 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 50,857,136 |
| 未収入金 | 1,573,707 |
| (B) 負債 | 6,349,781 |
| 未払収益分配金 | 386,967 |
| 未払解約金 | 1,185,959 |
| 未払信託報酬 | 4,760,304 |
| 未払利息 | 3 |
| その他未払費用 | 16,548 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,008,389,647 |
| 元本 | 773,935,098 |
| 次期繰越損益金 | 234,454,549 |
| (D) 受益権総口数 | 773,935,098口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,029円 |

(注) 期首元本額は767,089,216円、期中追加設定元本額は15,365,572円、期中一部解約元本額は8,519,690円、1口当たり純資産額は1.3029円です。

○損益の状況 (2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 410 |
| 支払利息 | △ 410 |
| (B) 有価証券売買損益 | 11,548,248 |
| 売買益 | 19,199,682 |
| 売買損 | △ 7,651,434 |
| (C) 信託報酬等 | △ 4,776,852 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 6,770,986 |
| (E) 前期繰越損益金 | 225,528,387 |
| (F) 追加信託差損益金 | 2,542,143 |
| (配当等相当額) | (111,938,553) |
| (売買損益相当額) | (△109,396,410) |
| (G) 計(D+E+F) | 234,841,516 |
| (H) 収益分配金 | △ 386,967 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 234,454,549 |
| 追加信託差損益金 | 2,542,143 |
| (配当等相当額) | (111,959,082) |
| (売買損益相当額) | (△109,416,939) |
| 分配準備積立金 | 231,912,406 |

* 損益の状況の中で(B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 4,981,105円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 1,789,881円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 111,959,082円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 225,528,387円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 344,258,455円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 4,448円 |
| g. 分配金 | 386,967円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 65 | 0.474 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (25) | (0.182) | 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 |
| （ 販 売 会 社 ） | (36) | (0.265) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (4) | (0.028) | 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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.002 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.009 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (1) | (0.005) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.003) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 66 | 0.486 | |
| 期中の平均基準価額は、13,751円です。 | | | |

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

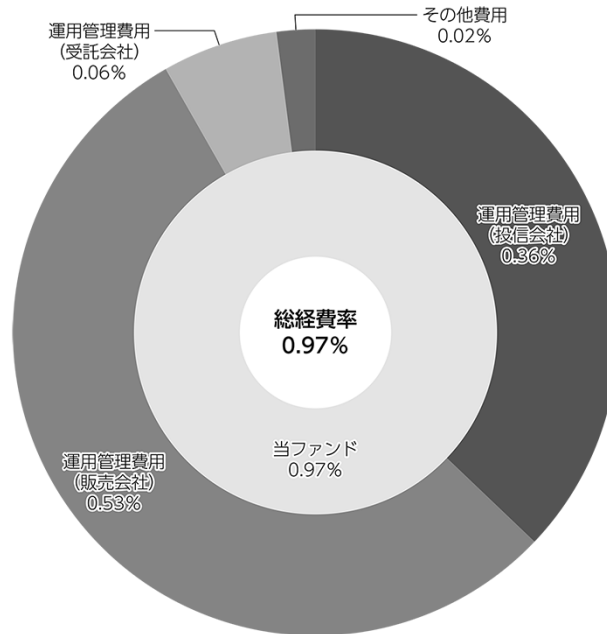
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.97%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設定 | | 解約 | |
|-------------------------|--------|--------|--------|--------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 10,652 | 22,051 | 12,972 | 26,934 |
| 外国債券マザーファンド | 2,727 | 6,970 | 1,470 | 3,765 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 1,735 | 7,436 | 4,995 | 21,331 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 39,020 | 51,893 | 12,859 | 17,139 |
| J-REITインデックスマザーファンド | 2,163 | 5,951 | 1,036 | 2,923 |
| 海外REITインデックスマザーファンド | 1,144 | 3,442 | 2,733 | 8,331 |
| 新興国株式マザーファンド | 7,763 | 12,506 | 5,004 | 8,440 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | 4,289 | 5,999 | 595 | 835 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 | | |
|---------------------|---------------|-------------------------|--------------|
| | 国内株式マザーファンド | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 新興国株式マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,975,248千円 | 5,451,594千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2030＞
該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

該当事項はございません。

<新興国株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.1%

<国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.0%

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

<新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.6%

<J-REITインデックス マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.1%

<海外REITインデックス マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.1%

利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-----------|
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 16千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.037千円 |
| (B) / (A) | 0.2% |

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|---------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 100,480 | 98,160 | 204,380 |
| 外国債券マザーファンド | 38,510 | 39,767 | 102,231 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 28,939 | 25,679 | 114,999 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 266,237 | 292,398 | 389,124 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 18,583 | 19,709 | 53,317 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 18,214 | 16,625 | 53,816 |
| 新興国株式マザーファンド | 51,008 | 53,767 | 84,629 |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 37,338 | 41,032 | 56,603 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 204,380 | 19.2 |
| 外国債券マザーファンド | 102,231 | 9.6 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 114,999 | 10.8 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 389,124 | 36.5 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 53,317 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 53,816 | 5.1 |
| 新興国株式マザーファンド | 84,629 | 7.9 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 56,603 | 5.3 |
| コール・ローン等、その他 | 6,466 | 0.6 |
| 投資信託財産総額 | 1,065,565 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルビア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルグアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,065,565,045 |
| コール・ローン等 | 6,033,347 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 204,380,376 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 102,231,533 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 114,999,687 |
| 国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額) | 389,124,144 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 53,317,385 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 53,816,834 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 84,629,761 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 56,603,758 |
| 未収入金 | 428,220 |
| (B) 負債 | 5,387,197 |
| 未払収益分配金 | 384,160 |
| 未払解約金 | 51,712 |
| 未払信託報酬 | 4,934,172 |
| 未払利息 | 3 |
| その他未払費用 | 17,150 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,060,177,848 |
| 元本 | 768,321,504 |
| 次期繰越損益金 | 291,856,344 |
| (D) 受益権総口数 | 768,321,504口 |
| 1万円当たり基準価額(C/D) | 13,799円 |

(注) 期首元本額は745,309,635円、期中追加設定元本額は40,875,939円、期中一部解約元本額は17,864,070円、1口当たり純資産額は1.3799円です。

○損益の状況 (2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 440 |
| 支払利息 | △ 440 |
| (B) 有価証券売買損益 | 14,138,505 |
| 売買益 | 23,720,086 |
| 売買損 | △ 9,581,581 |
| (C) 信託報酬等 | △ 4,951,322 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 9,186,743 |
| (E) 前期繰越損益金 | 254,297,365 |
| (F) 追加信託差損益金 | 28,756,396 |
| (配当等相当額) | (168,254,988) |
| (売買損益相当額) | (△139,498,592) |
| (G) 計(D+E+F) | 292,240,504 |
| (H) 収益分配金 | △ 384,160 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 291,856,344 |
| 追加信託差損益金 | 28,756,396 |
| (配当等相当額) | (168,313,771) |
| (売買損益相当額) | (△139,557,375) |
| 分配準備積立金 | 263,099,948 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 6,199,612円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 2,987,131円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 168,313,771円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 254,297,365円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 431,797,879円 |
| f. 分配対象収益(1万円当たり) | 5,619円 |
| g. 分配金 | 384,160円 |
| h. 分配金(1万円当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 66 | 0.474 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (26) | (0.182) | 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 |
| （ 販 売 会 社 ） | (37) | (0.265) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (4) | (0.028) | 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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.002 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.001) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.010 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (1) | (0.005) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.004) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 67 | 0.487 | |
| 期中の平均基準価額は、14,017円です。 | | | |

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

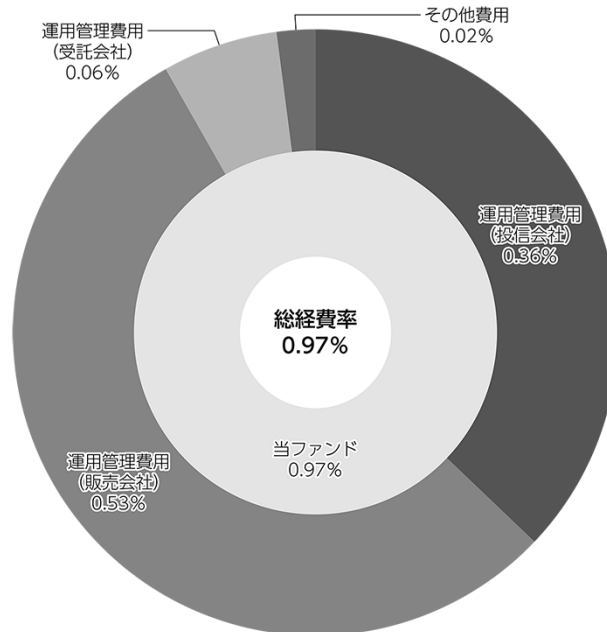
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.97%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------|--------|--------|-------|--------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 7,895 | 16,276 | 7,911 | 16,604 |
| 外国債券マザーファンド | 1,748 | 4,466 | 978 | 2,513 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 1,169 | 4,959 | 3,366 | 14,554 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 23,014 | 30,608 | 6,603 | 8,795 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 2,042 | 5,612 | 2,368 | 6,685 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 925 | 2,748 | 4,041 | 12,103 |
| 新興国株式マザーファンド | 6,320 | 10,140 | 2,998 | 5,032 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 2,945 | 4,123 | 369 | 520 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | | |
|---------------------|-----------------|---------------------------------|------------------|
| | 国内株式 マザーファンド | 外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド | 新興国株式 マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,975,248千円 | 5,451,594千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2035＞
該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

該当事項はございません。

<新興国株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.1%

<国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.0%

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.4%

＜J-REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.1%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.1%

利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-----------|
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 15千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.037千円 |
| (B) / (A) | 0.2% |

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|---------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 84,325 | 84,309 | 175,540 |
| 外国債券マザーファンド | 28,725 | 29,495 | 75,823 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 24,216 | 22,019 | 98,607 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 141,863 | 158,273 | 210,630 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 20,794 | 20,468 | 55,368 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 20,381 | 17,265 | 55,887 |
| 新興国株式マザーファンド | 42,964 | 46,286 | 72,854 |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 27,855 | 30,431 | 41,979 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 175,540 | 22.2 |
| 外国債券マザーファンド | 75,823 | 9.6 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 98,607 | 12.5 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 210,630 | 26.6 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 55,368 | 7.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 55,887 | 7.1 |
| 新興国株式マザーファンド | 72,854 | 9.2 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 41,979 | 5.3 |
| コール・ローン等、その他 | 4,795 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 791,483 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルビア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルグアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 791,483,942 |
| コール・ローン等 | 4,491,179 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 175,540,333 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 75,823,907 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 98,607,456 |
| 国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額) | 210,630,143 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 55,368,822 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 55,887,517 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 72,854,595 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 41,979,574 |
| 未収入金 | 300,416 |
| (B) 負債 | 3,989,005 |
| 未払収益分配金 | 279,483 |
| 未払解約金 | 5,228 |
| 未払信託報酬 | 3,691,476 |
| 未払利息 | 2 |
| その他未払費用 | 12,816 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 787,494,937 |
| 元本 | 558,966,343 |
| 次期繰越損益金 | 228,528,594 |
| (D) 受益権総口数 | 558,966,343口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,088円 |

(注) 期首元本額は547,332,779円、期中追加設定元本額は22,419,188円、期中一部解約元本額は10,785,624円、1口当たり純資産額は1.4088円です。

○損益の状況 (2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 302 |
| 支払利息 | △ 302 |
| (B) 有価証券売買損益 | 12,926,570 |
| 売買益 | 21,390,862 |
| 売買損 | △ 8,464,292 |
| (C) 信託報酬等 | △ 3,704,292 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 9,221,976 |
| (E) 前期繰越損益金 | 205,369,854 |
| (F) 追加信託差損益金 | 14,216,247 |
| (配当等相当額) | (132,911,207) |
| (売買損益相当額) | (△118,694,960) |
| (G) 計(D+E+F) | 228,808,077 |
| (H) 収益分配金 | △ 279,483 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 228,528,594 |
| 追加信託差損益金 | 14,216,247 |
| (配当等相当額) | (132,947,569) |
| (売買損益相当額) | (△118,731,322) |
| 分配準備積立金 | 214,312,347 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 5,561,494円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 3,660,482円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 132,947,569円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 205,369,854円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 347,539,399円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 6,217円 |
| g. 分配金 | 279,483円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 67 | 0.474 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (26) | (0.182) | 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 |
| （ 販 売 会 社 ） | (38) | (0.265) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (4) | (0.028) | 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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.002 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.001) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 2 | 0.011 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (1) | (0.006) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.004) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 69 | 0.488 | |
| 期中の平均基準価額は、14,171円です。 | | | |

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

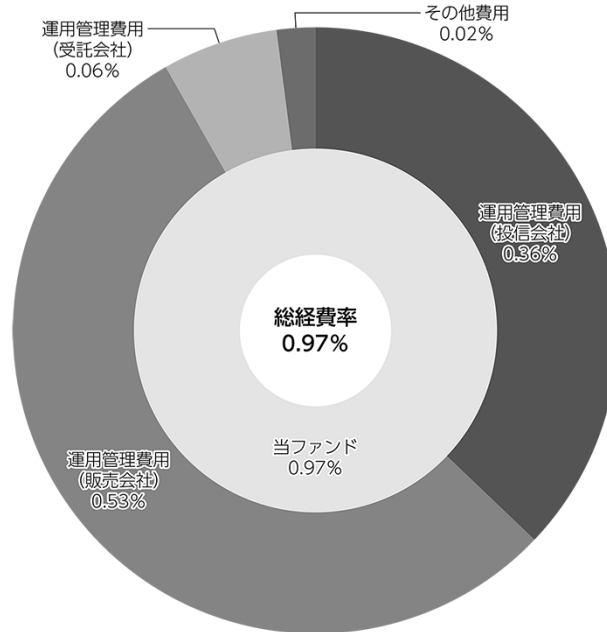
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.97%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------|--------|--------|--------|--------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 13,488 | 27,958 | 14,383 | 30,198 |
| 外国債券マザーファンド | 2,704 | 6,904 | 1,764 | 4,521 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 1,857 | 7,880 | 6,294 | 27,186 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 24,517 | 32,599 | 9,601 | 12,790 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 3,449 | 9,493 | 1,783 | 5,033 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 1,445 | 4,297 | 4,927 | 15,077 |
| 新興国株式マザーファンド | 10,583 | 16,991 | 4,763 | 8,001 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 4,624 | 6,486 | 582 | 824 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | | |
|---------------------|-----------------|---------------------------------|------------------|
| | 国内株式 マザーファンド | 外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド | 新興国株式 マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,975,248千円 | 5,451,594千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2040＞
該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.1%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

該当事項はございません。

<新興国株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.2%

<国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.0%

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.7%

＜J-REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.2%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.2%

利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-----------|
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 28千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.069千円 |
| (B) / (A) | 0.2% |

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|---------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 161,180 | 160,285 | 333,729 |
| 外国債券マザーファンド | 49,412 | 50,353 | 129,443 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 46,502 | 42,065 | 188,379 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 195,238 | 210,154 | 279,673 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 35,772 | 37,438 | 101,275 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 35,061 | 31,579 | 102,223 |
| 新興国株式マザーファンド | 81,604 | 87,424 | 137,606 |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 47,908 | 51,950 | 71,665 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 333,729 | 24.7 |
| 外国債券マザーファンド | 129,443 | 9.6 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 188,379 | 13.9 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 279,673 | 20.7 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 101,275 | 7.5 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 102,223 | 7.6 |
| 新興国株式マザーファンド | 137,606 | 10.2 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 71,665 | 5.3 |
| コール・ローン等、その他 | 8,285 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 1,352,278 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルビア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルグアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,352,278,841 |
| コール・ローン等 | 8,089,317 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 333,729,848 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 129,443,683 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 188,379,244 |
| 国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額) | 279,673,202 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 101,275,216 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 102,223,974 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 137,606,030 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 71,665,945 |
| 未収入金 | 192,382 |
| (B) 負債 | 6,920,581 |
| 未払収益分配金 | 471,864 |
| 未払解約金 | 101,007 |
| 未払信託報酬 | 6,325,698 |
| 未払利息 | 5 |
| その他未払費用 | 22,007 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,345,358,260 |
| 元本 | 943,728,009 |
| 次期繰越損益金 | 401,630,251 |
| (D) 受益権総口数 | 943,728,009口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,256円 |

(注) 期首元本額は932,555,583円、期中追加設定元本額は27,523,370円、期中一部解約元本額は16,350,944円、1口当たり純資産額は1.4256円です。

○損益の状況 (2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 579 |
| 支払利息 | △ 579 |
| (B) 有価証券売買損益 | 24,238,317 |
| 売買益 | 39,677,674 |
| 売買損 | △ 15,439,357 |
| (C) 信託報酬等 | △ 6,347,705 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 17,890,033 |
| (E) 前期繰越損益金 | 403,231,979 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 19,019,897 |
| (配当等相当額) | (137,670,684) |
| (売買損益相当額) | (△156,690,581) |
| (G) 計(D+E+F) | 402,102,115 |
| (H) 収益分配金 | △ 471,864 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 401,630,251 |
| 追加信託差損益金 | △ 19,019,897 |
| (配当等相当額) | (137,718,518) |
| (売買損益相当額) | (△156,738,415) |
| 分配準備積立金 | 420,650,148 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 10,241,709円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 7,648,324円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 137,718,518円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 403,231,979円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 558,840,530円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 5,921円 |
| g. 分配金 | 471,864円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|-----------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 122 | 0.474 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (47) | (0.182) | 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 |
| （ 販 売 会 社 ） | (68) | (0.265) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (7) | (0.028) | 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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 1 | 0.002 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.001) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 3 | 0.012 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (2) | (0.006) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (1) | (0.004) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 126 | 0.489 | |
| 期中の平均基準価額は、25,664円です。 | | | |

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

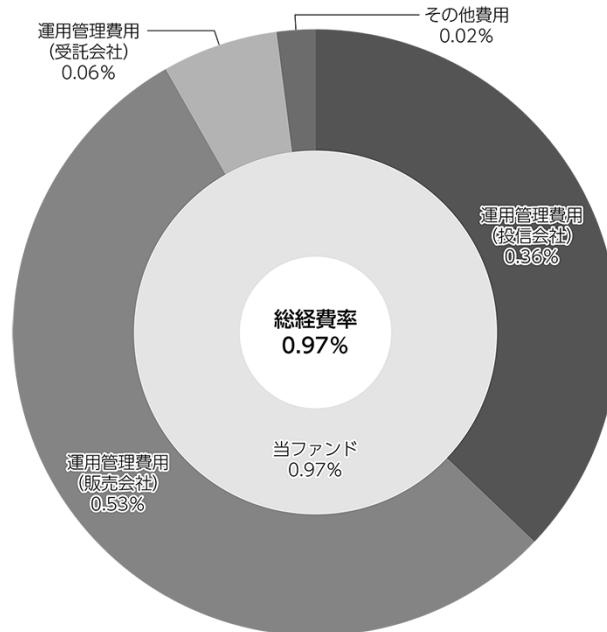
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.97%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------|-------|--------|-------|--------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 6,127 | 12,771 | 5,037 | 10,515 |
| 外国債券マザーファンド | 1,446 | 3,703 | 875 | 2,246 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 1,379 | 5,970 | 1,789 | 7,703 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 6,428 | 8,553 | 3,050 | 4,064 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 1,184 | 3,276 | 420 | 1,181 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 927 | 2,781 | 759 | 2,321 |
| 新興国株式マザーファンド | 3,983 | 6,392 | 2,384 | 3,954 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 1,758 | 2,453 | 722 | 1,018 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | | |
|---------------------|-----------------|---------------------------------|------------------|
| | 国内株式 マザーファンド | 外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド | 新興国株式 マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,975,248千円 | 5,451,594千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2045＞
該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

該当事項はございません。

<新興国株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.0%

<国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.0%

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.1%

＜J-REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.0%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.0%

利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-----------|
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 4千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.008千円 |
| (B) / (A) | 0.2% |

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|--------|--------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 28,302 | 29,392 | 61,198 |
| 外国債券マザーファンド | 7,230 | 7,800 | 20,053 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 8,127 | 7,718 | 34,565 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 21,427 | 24,805 | 33,011 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 3,489 | 4,253 | 11,505 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 3,420 | 3,587 | 11,613 |
| 新興国株式マザーファンド | 14,419 | 16,018 | 25,212 |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 7,012 | 8,048 | 11,102 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 61,198 | 29.2 |
| 外国債券マザーファンド | 20,053 | 9.6 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 34,565 | 16.5 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 33,011 | 15.8 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 11,505 | 5.5 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 11,613 | 5.5 |
| 新興国株式マザーファンド | 25,212 | 12.0 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 11,102 | 5.3 |
| コール・ローン等、その他 | 1,185 | 0.6 |
| 投資信託財産総額 | 209,444 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルビア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルグアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|-------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 209,444,452 |
| コール・ローン等 | 1,180,916 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 61,198,299 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 20,053,652 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 34,565,497 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド(評価額) | 33,011,365 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 11,505,815 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 11,613,595 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 25,212,714 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 11,102,599 |
| (B) 負債 | 960,284 |
| 未払収益分配金 | 40,365 |
| 未払解約金 | 4 |
| 未払信託報酬 | 916,782 |
| その他未払費用 | 3,133 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 208,484,168 |
| 元本 | 80,730,280 |
| 次期繰越損益金 | 127,753,888 |
| (D) 受益権総口数 | 80,730,280口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 25,825円 |

(注) 期首元本額は75,336,549円、期中追加設定元本額は14,269,317円、期中一部解約元本額は8,875,586円、1口当たり純資産額は2,5825円です。

○損益の状況 (2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 19 |
| 支払利息 | △ 19 |
| (B) 有価証券売買損益 | 3,459,318 |
| 売買益 | 6,053,457 |
| 売買損 | △ 2,594,139 |
| (C) 信託報酬等 | △ 919,915 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,539,384 |
| (E) 前期繰越損益金 | 30,387,416 |
| (F) 追加信託差損益金 | 94,867,453 |
| (配当等相当額) | (78,854,298) |
| (売買損益相当額) | (16,013,155) |
| (G) 計(D+E+F) | 127,794,253 |
| (H) 収益分配金 | △ 40,365 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 127,753,888 |
| 追加信託差損益金 | 94,867,453 |
| (配当等相当額) | (78,901,693) |
| (売買損益相当額) | (15,965,760) |
| 分配準備積立金 | 32,886,435 |

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 1,476,236円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 1,063,148円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 94,867,453円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 30,387,416円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 127,794,253円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 15,829円 |
| g. 分配金 | 40,365円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 69 | 0.474 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (26) | (0.182) | 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 |
| （ 販 売 会 社 ） | (39) | (0.265) | 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 |
| （ 受 託 会 社 ） | (4) | (0.028) | 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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.002 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.001) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 新 株 予 約 権 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 2 | 0.012 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (1) | (0.006) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.003) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 71 | 0.489 | |
| 期中の平均基準価額は、14,555円です。 | | | |

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

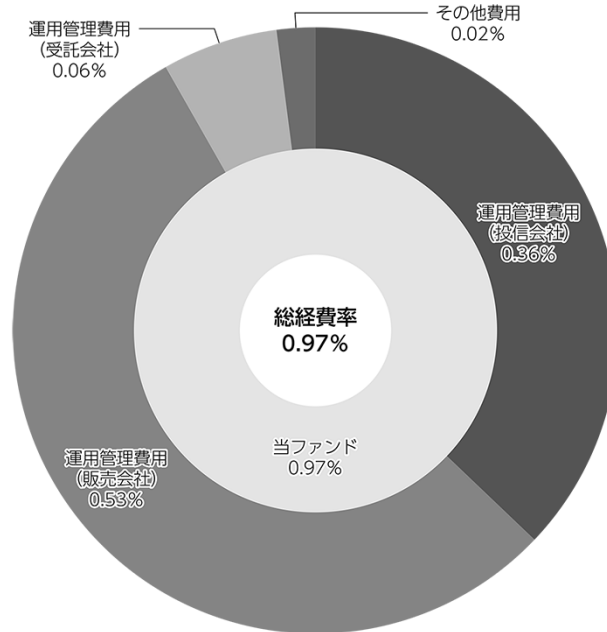
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.97%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------------|-------|-------|-------|-------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 4,036 | 8,370 | 3,877 | 8,214 |
| 外国債券マザーファンド | 1,005 | 2,565 | 525 | 1,344 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 786 | 3,347 | 1,765 | 7,625 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 3,471 | 4,617 | 1,841 | 2,452 |
| J-REITインデックスマザーファンド | 572 | 1,583 | 341 | 962 |
| 海外REITインデックスマザーファンド | 305 | 911 | 720 | 2,198 |
| 新興国株式マザーファンド | 3,148 | 5,071 | 1,553 | 2,581 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | 1,317 | 1,861 | 279 | 394 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | | |
|---------------------|-----------------|---------------------------------|------------------|
| | 国内株式 マザーファンド | 外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド | 新興国株式 マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,975,248千円 | 5,451,594千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

<野村資産設計ファンド2050>
該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

該当事項はございません。

<新興国株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.0%

<国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.0%

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.1%

＜J-REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.0%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.0%

利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-----------|
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 6千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.01千円 |
| (B) / (A) | 0.2% |

* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|--------|--------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 39,234 | 39,393 | 82,022 |
| 外国債券マザーファンド | 7,727 | 8,207 | 21,100 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 11,307 | 10,329 | 46,256 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 22,848 | 24,478 | 32,575 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 4,465 | 4,696 | 12,704 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 4,376 | 3,961 | 12,823 |
| 新興国株式マザーファンド | 19,899 | 21,493 | 33,831 |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 7,448 | 8,485 | 11,706 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 82,022 | 32.2 |
| 外国債券マザーファンド | 21,100 | 8.3 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 46,256 | 18.2 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 32,575 | 12.8 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 12,704 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 12,823 | 5.0 |
| 新興国株式マザーファンド | 33,831 | 13.3 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 11,706 | 4.6 |
| コール・ローン等、その他 | 1,537 | 0.6 |
| 投資信託財産総額 | 254,554 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルビア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルグアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 254,554,317 |
| コール・ローン等 | 1,441,378 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 82,022,051 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 21,100,069 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 46,256,922 |
| 国内債券NOMURA-BPT総合マザーファンド(評価額) | 32,575,991 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 12,704,824 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 12,823,705 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 33,831,201 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 11,706,337 |
| 未収入金 | 91,839 |
| (B) 負債 | 1,281,568 |
| 未払収益分配金 | 86,433 |
| 未払解約金 | 1 |
| 未払信託報酬 | 1,191,029 |
| その他未払費用 | 4,105 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 253,272,749 |
| 元本 | 172,867,463 |
| 次期繰越損益金 | 80,405,286 |
| (D) 受益権総口数 | 172,867,463口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,651円 |

(注) 期首元本額は170,177,057円、期中追加設定元本額は9,179,820円、期中一部解約元本額は6,489,414円、1口当たり純資産額は1,4651円です。

○損益の状況 (2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 49 |
| 支払利息 | △ 49 |
| (B) 有価証券売買損益 | 4,864,642 |
| 売買益 | 8,146,302 |
| 売買損 | △ 3,281,660 |
| (C) 信託報酬等 | △ 1,195,134 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 3,669,459 |
| (E) 前期繰越損益金 | 49,827,600 |
| (F) 追加信託差損益金 | 26,994,660 |
| (配当等相当額) | (30,394,470) |
| (売買損益相当額) | (△ 3,399,810) |
| (G) 計(D+E+F) | 80,491,719 |
| (H) 収益分配金 | △ 86,433 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 80,405,286 |
| 追加信託差損益金 | 26,994,660 |
| (配当等相当額) | (30,416,476) |
| (売買損益相当額) | (△ 3,421,816) |
| 分配準備積立金 | 53,410,626 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 1,960,543円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 1,708,916円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 30,416,476円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 49,827,600円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 83,913,535円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 4,854円 |
| g. 分配金 | 86,433円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月23日～2021年12月22日)

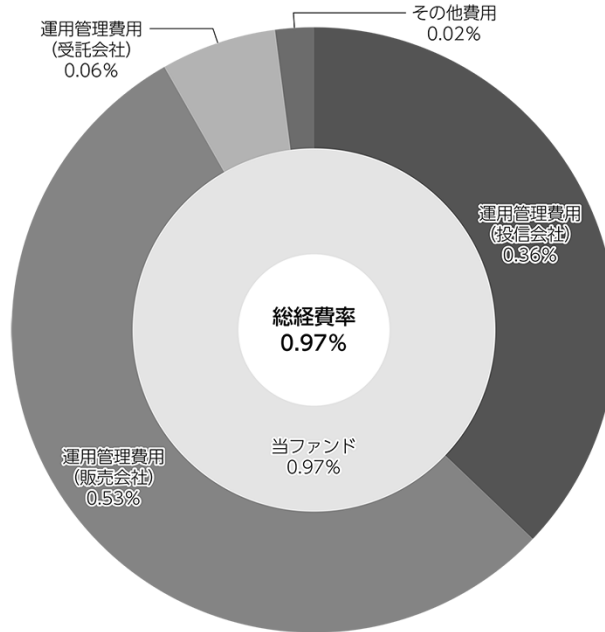
| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|---------------------------------------|---|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社) | 59 (23) (33) (3) | 0.474 (0.182) (0.265) (0.028) | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理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 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 0 (0) (0) (0) (0) | 0.003 (0.002) (0.000) (0.000) (0.001) | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 証 券) | 0 (0) (0) (0) | 0.001 (0.001) (0.000) (0.000) | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) (そ の 他) | 2 (1) (0) (0) | 0.012 (0.006) (0.002) (0.004) | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 61 | 0.490 | |
| 期中の平均基準価額は、12,541円です。 | | | |

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.97%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------------------|-------|--------|-------|-------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 9,055 | 18,861 | 2,860 | 5,971 |
| 外国債券マザーファンド | 1,209 | 3,099 | 342 | 875 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 2,213 | 9,579 | 1,086 | 4,667 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 3,791 | 5,048 | 998 | 1,331 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 1,031 | 2,837 | 292 | 818 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 785 | 2,402 | 439 | 1,332 |
| 新興国株式マザーファンド | 5,440 | 8,760 | 1,311 | 2,148 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 1,512 | 2,110 | 291 | 407 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年6月23日～2021年12月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | | |
|---------------------|-----------------|---------------------------------|------------------|
| | 国内株式 マザーファンド | 外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド | 新興国株式 マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 62,762,175千円 | 84,975,248千円 | 5,451,594千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 396,671,745千円 | 1,063,132,626千円 | 62,978,803千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.15 | 0.07 | 0.08 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月23日～2021年12月22日)

利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2060＞
該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 44,466 | 百万円 88 | % 0.2 | 百万円 18,295 | 百万円 - | % - |
| 貸付有価証券(株式) | 34,821 | 1,524 | 4.4 | 32,559 | 1,447 | 4.4 |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

該当事項はございません。

<新興国株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 9,078 | 百万円 1,623 | % 17.9 | 百万円 6,282 | 百万円 1,623 | % 25.8 |

平均保有割合 0.0%

<国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 122,158 | 百万円 305 | % 0.2 | 百万円 68,008 | 百万円 1,256 | % 1.8 |

平均保有割合 0.0%

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 65,714 | 百万円 80 | % 0.1 | 百万円 30,467 | 百万円 21 | % 0.1 |

平均保有割合 0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,969 | 百万円 709 | % 14.3 | 百万円 5,332 | 百万円 709 | % 13.3 |

平均保有割合 0.0%

＜J-REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 投資信託証券 | 百万円 5,385 | 百万円 255 | % 4.7 | 百万円 4,828 | 百万円 511 | % 10.6 |

平均保有割合 0.0%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 6,894 | 百万円 31 | % 0.4 | 百万円 2,845 | 百万円 31 | % 1.1 |

平均保有割合 0.0%

利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|-----------|--------------|
| 株式 | 百万円 102 | 百万円 25 | 百万円 1,172 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜国内株式マザーファンド＞

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-----------|
| 株式 | 百万円 41 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 3千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.005千円 |
| (B) / (A) | 0.2% |

*売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社、野村信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2021年6月23日～2021年12月22日)

| 期首残高 (元 本) | 当期設定 元 本 | 当期解約 元 本 | 期末残高 (元 本) | 取 引 の 理 由 |
|---------------|-------------|-------------|---------------|-------------|
| 百万円 1 | 百万円 - | 百万円 - | 百万円 1 | 当初設定時における取得 |

○組入資産の明細

(2021年12月22日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|--------|--------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 19,225 | 25,419 | 52,926 |
| 外国債券マザーファンド | 2,821 | 3,688 | 9,481 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 5,530 | 6,657 | 29,811 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 8,316 | 11,109 | 14,784 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 2,031 | 2,770 | 7,495 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 1,991 | 2,337 | 7,565 |
| 新興国株式マザーファンド | 9,775 | 13,904 | 21,885 |
| 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド | 2,695 | 3,917 | 5,403 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 52,926 | 35.2 |
| 外国債券マザーファンド | 9,481 | 6.3 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 29,811 | 19.9 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 14,784 | 9.8 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 7,495 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 7,565 | 5.0 |
| 新興国株式マザーファンド | 21,885 | 14.6 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 5,403 | 3.6 |
| コール・ローン等、その他 | 802 | 0.6 |
| 投資信託財産総額 | 150,152 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（631,284,741千円）の投資信託財産総額（865,370,191千円）に対する比率は72.9%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,187,221,253千円）の投資信託財産総額（1,189,332,120千円）に対する比率は99.8%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（50,879,564千円）の投資信託財産総額（51,426,258千円）に対する比率は98.9%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（68,120,869千円）の投資信託財産総額（69,208,796千円）に対する比率は98.4%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（8,743,712千円）の投資信託財産総額（8,752,465千円）に対する比率は99.9%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カタールリヤル=31.18円、1米ドル=114.18円、1カナダドル=88.41円、1英ポンド=151.41円、1スイスフラン=123.62円、1スウェーデンクローナ=12.49円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=17.32円、1トルコリラ=9.2492円、1ユーロ=128.80円、1チェココルナ=5.1047円、1フォリント=0.350462円、1ズロチ=27.8693円、1ルーブル=1.54円、1ドミニカペソ=2.0054円、1レイ=26.0419円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=83.72円、1リンギ=27.1418円、1バーツ=3.39円、1フィリピンペソ=2.2856円、1ルビア=0.008円、1ウォン=0.096円、1新台湾ドル=4.1042円、1人民元=17.9177円、1オフショア人民元=17.9054円、1豪ドル=81.55円、1ニュージーランドドル=77.17円、1インドルピー=1.52円、1新シェケル=36.13円、1メキシコペソ=5.4835円、1レアル=19.8715円、1チリペソ=0.131121円、1コロンビアペソ=0.028556円、1ソル=28.1668円、1ウルグアイペソ=2.5756円、1UAEディルハム=31.14円、1セルビアディナール=1.095429円、1エジプトポンド=7.2645円、1ランド=7.19円、1クウェートディナール=377.70円、1サウジアラビアリヤル=30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年12月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 150,152,639 |
| コール・ローン等 | 798,173 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 52,926,413 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 9,481,232 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 29,811,614 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド(評価額) | 14,784,507 |
| J-REITインデックスマザーファンド(評価額) | 7,495,274 |
| 海外REITインデックスマザーファンド(評価額) | 7,565,490 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 21,885,941 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額) | 5,403,995 |
| (B) 負債 | 644,458 |
| 未払収益分配金 | 59,169 |
| 未払解約金 | 4 |
| 未払信託報酬 | 583,303 |
| その他未払費用 | 1,982 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 149,508,181 |
| 元本 | 118,338,103 |
| 次期繰越損益金 | 31,170,078 |
| (D) 受益権総口数 | 118,338,103口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,634円 |

(注) 期首元本額は89,969,734円、期中追加設定元本額は43,700,054円、期中一部解約元本額は15,331,685円、1口当たり純資産額は1.2634円です。

○損益の状況 (2021年6月23日～2021年12月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 15 |
| 支払利息 | △ 15 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,310,056 |
| 売買益 | 4,099,696 |
| 売買損 | △ 1,789,640 |
| (C) 信託報酬等 | △ 585,285 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 1,724,756 |
| (E) 前期繰越損益金 | 14,074,974 |
| (F) 追加信託差損益金 | 15,429,517 |
| (配当等相当額) | (15,037,814) |
| (売買損益相当額) | (391,703) |
| (G) 計(D+E+F) | 31,229,247 |
| (H) 収益分配金 | △ 59,169 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 31,170,078 |
| 追加信託差損益金 | 15,429,517 |
| (配当等相当額) | (15,097,191) |
| (売買損益相当額) | (332,326) |
| 分配準備積立金 | 15,740,561 |

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年6月23日～2021年12月22日)は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|----------------------------|
| | 2021年6月23日～ 2021年12月22日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 941,440円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 783,316円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 15,429,517円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 14,074,974円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 31,229,247円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 2,638円 |
| g. 分配金 | 59,169円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

○分配金のお知らせ

| | |
|----------------|----|
| 1万口当たり分配金（税込み） | 5円 |
|----------------|----|

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

＜マザーファンドの対象指数について＞

- * NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。
- * 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一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- * 本書に含まれるJP モルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行なうものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JP モルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行ない、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JP モルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。
- * TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- * 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ためにその使用を許諾されています。ここに記載されたいかなるファンドも、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のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではありません。また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。請求目録見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。
- * 東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- * [S&P先進国REIT指数（除く日本）]はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しいかなる意思表明等を行なうものではありません。

国内株式マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日2021年5月10日）

作成対象期間（2020年5月12日～2021年5月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 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す。 |
| 主な投資対象 | わが国の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資は行いません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベ 東 (T O P I X) | ン 証 株 価 指 数 (T O P I X) | マ ー ク 数 指 数 (T O P I X) | 株 組 入 比 率 | 式 株 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|-------------|--------|---|---|---|-----------------------|----------------------------|------------------|
| | 騰 落 率 | 中 率 | | | | | | |
| | 円 | % | | | % | % | % | 百万円 |
| 16期(2017年5月10日) | 15,104 | 21.4 | 1,585.19 | | 18.7 | 98.6 | 1.4 | 335,246 |
| 17期(2018年5月10日) | 17,299 | 14.5 | 1,777.62 | | 12.1 | 98.4 | 1.6 | 379,913 |
| 18期(2019年5月10日) | 15,442 | △10.7 | 1,549.42 | | △12.8 | 97.9 | 2.1 | 394,025 |
| 19期(2020年5月11日) | 15,150 | △1.9 | 1,480.62 | | △4.4 | 97.5 | 2.5 | 423,056 |
| 20期(2021年5月10日) | 20,400 | 34.7 | 1,952.27 | | 31.9 | 97.5 | 2.5 | 385,597 |

*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基準価額 | | ベ 東 (T O P I X) | ン 証 株 価 指 数 (T O P I X) | マ ー ク 数 指 数 (T O P I X) | 株 組 入 比 率 | 式 株 先 物 比 率 |
|--------------------|-------------|--------|---|---|---|-----------------------|----------------------------|
| | 騰 落 率 | 中 率 | | | | | |
| (期首) 2020年5月11日 | 円 | % | | | % | % | % |
| | 15,150 | — | 1,480.62 | | — | 97.5 | 2.5 |
| 5月末 | 15,997 | 5.6 | 1,563.67 | | 5.6 | 96.8 | 2.1 |
| 6月末 | 15,971 | 5.4 | 1,558.77 | | 5.3 | 97.4 | 2.6 |
| 7月末 | 15,330 | 1.2 | 1,496.06 | | 1.0 | 97.5 | 2.5 |
| 8月末 | 16,582 | 9.5 | 1,618.18 | | 9.3 | 98.1 | 1.1 |
| 9月末 | 16,796 | 10.9 | 1,625.49 | | 9.8 | 97.8 | 2.0 |
| 10月末 | 16,320 | 7.7 | 1,579.33 | | 6.7 | 98.2 | 1.8 |
| 11月末 | 18,142 | 19.7 | 1,754.92 | | 18.5 | 96.8 | 2.0 |
| 12月末 | 18,680 | 23.3 | 1,804.68 | | 21.9 | 98.0 | 1.9 |
| 2021年1月末 | 18,723 | 23.6 | 1,808.78 | | 22.2 | 98.0 | 2.0 |
| 2月末 | 19,310 | 27.5 | 1,864.49 | | 25.9 | 97.3 | 2.3 |
| 3月末 | 20,408 | 34.7 | 1,954.00 | | 32.0 | 97.0 | 2.8 |
| 4月末 | 19,832 | 30.9 | 1,898.24 | | 28.2 | 97.8 | 2.2 |
| (期末) 2021年5月10日 | 円 | % | | | % | % | % |
| | 20,400 | 34.7 | 1,952.27 | | 31.9 | 97.5 | 2.5 |

*騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証株価指数 (TOPIX) です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン開発進展を受けて早期のワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどをを受けて、基準価額は上昇しました。

○投資環境

国内株式市場は、期首より新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや国内外の経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどから上昇しましたが、米中対立が再度激化するとの懸念が高まったことなどで下落しました。その後、新型コロナウイルスのワクチン供給への期待感、欧米での新型コロナウイルス感染再拡大による景気減速懸念や米大統領選挙をめぐる不透明感などから、一進一退の展開となりました。

2020年11月以降は、米国大統領選挙の結果を受けて政治的な不透明感が和らぎ米国株式市場が上昇したことや、新型コロナウイルスのワクチン開発進展を受けて早期のワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどから上昇しました。2021年3月下旬以降は、新型コロナウイルス感染再拡大による景気減速懸念などから軟調な展開となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

実質株式組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指すため、現物株式につきましては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数（TOPIX）でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ないました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。

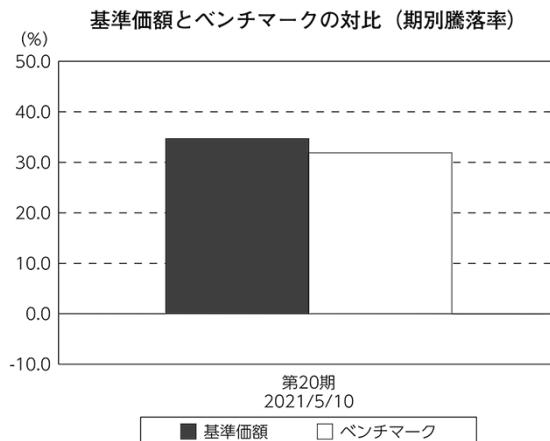
なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+34.7%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の+31.9%を2.8ポイント上回りました。

（プラス要因）

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには配当金が計上されたこと



(注) ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。

◎今後の運用方針

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、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してまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2020年5月12日～2021年5月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式) | 0 | 0.001 | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| 合 計 | (0) | (0.001) | |
| 期中の平均基準価額は、17,674円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年5月12日～2021年5月10日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----|-----------|------------|--------|-------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 | 上場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 内 | | 11,104 | 26,007,918 | 75,960 | 177,635,945 |
| | | (△20,554) | () | | |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|---|-------|-----|----------|-----|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 国 | 内 | 証券 | 千円 | 証券 | 千円 |
| | | — | — | — | — |
| | | | | (52,900) | (—) |

* () 内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|--------|---------------|---------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国内 | 株式先物取引 | 百万円 92,148 | 百万円 95,233 | 百万円 - | 百万円 - |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年5月12日～2021年5月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 203,643,863千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 420,655,377千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.48 |

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月12日～2021年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|------------|--------------------|------------|----------|--------------------|----------|----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | B A | | うち利害関係人 との取引状況D | D C | |
| 株式 | 百万円 26,007 | 百万円 687 | % 2.6 | 百万円 177,635 | 百万円 9 | % 0.0 |
| 貸付有価証券(株式) | 98,488 | 4,429 | 4.5 | 113,098 | 6,010 | 5.3 |

*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|-----------|------------|--------------|
| 株式 | 百万円 46 | 百万円 755 | 百万円 1,225 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|-----------|
| 株式 | 百万円 19 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 5,668千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 292千円 |
| (B) / (A) | 5.2% |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021年5月10日現在)

国内株式

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | | |
| 極洋 | 9.4 | 6.2 | 18,631 | |
| 日本水産 | 269 | 176.8 | 95,472 | |
| マルハニチロ | 38.9 | 29.8 | 79,327 | |
| 雪国まいたけ | — | 15.6 | 30,794 | |
| カネコ種苗 | 8.1 | 5.8 | 9,123 | |
| サカタのタネ | 32.1 | 22.7 | 86,827 | |
| ホクト | 20.5 | 16 | 32,480 | |
| ホクリヨウ | 4.2 | 2.9 | 2,096 | |
| 鉱業 (0.2%) | | | | |
| 住石ホールディングス | 54.3 | 33.3 | 4,329 | |
| 日鉄鉱業 | 6.2 | 4.4 | 30,316 | |
| 三井松島ホールディングス | 10.4 | 8 | 7,920 | |
| I N P E X | 1,079.2 | 700.1 | 569,181 | |
| 石油資源開発 | 35.1 | 24.9 | 55,726 | |
| K&Oエナジーグループ | 13.1 | 9.2 | 13,312 | |
| 建設業 (2.4%) | | | | |
| ヒノキヤグループ | 6.7 | 4.7 | 12,177 | |
| ショーボンドホールディングス | 41.9 | 27.2 | 126,572 | |
| ミライト・ホールディングス | 79.9 | 66 | 119,592 | |
| タマホーム | 14.5 | 11.5 | 28,485 | |
| サンヨーホームズ | 2.3 | 2.2 | 1,685 | |
| 日本アクア | 10.7 | 7.6 | 4,704 | |
| ファーストコーポレーション | 8.2 | 5.8 | 4,518 | |
| ベストテラ | 4.6 | 3.6 | 5,929 | |
| R o b o t H o m e | 55.5 | 35.7 | 6,247 | |
| キャンディル | 4.5 | 3.3 | 1,785 | |
| スペースビューホールディングス | 32.8 | 23.2 | 17,864 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 5.2 | 3.7 | 3,614 | |
| 第一カッター興業 | 3.3 | 4.7 | 6,655 | |
| 明豊ファシリティワークス | 8.6 | — | — | |
| 安藤・間 | 160.2 | 122.1 | 105,128 | |
| 東急建設 | 78.8 | 55.8 | 32,643 | |
| コムシスホールディングス | 95.4 | 67.5 | 241,650 | |
| ピーアールホールディングス | 29.3 | 25.5 | 14,713 | |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 高松コンストラクショングループ | 16.7 | 11.8 | 24,496 | |
| 東建コーポレーション | 8.3 | 5.9 | 58,587 | |
| ソネック | 2.8 | 2 | 1,872 | |
| ヤマウラ | 11.7 | 8.3 | 7,669 | |
| オリエンタル白石 | — | 64 | 19,200 | |
| 大成建設 | 207.1 | 136.8 | 578,664 | |
| 大林組 | 621.2 | 439.6 | 457,623 | |
| 清水建設 | 630.4 | 411.8 | 385,033 | |
| 飛鳥建設 | 17.8 | 12.6 | 14,301 | |
| 長谷工コーポレーション | 240.5 | 144 | 221,184 | |
| 松井建設 | 24.4 | 17.3 | 12,559 | |
| 錢高組 | 2.7 | 1.9 | 8,607 | |
| 鹿島建設 | 487.7 | 322.1 | 509,884 | |
| 不動テトラ | 16.2 | 10.8 | 20,595 | |
| 大末建設 | 7.2 | 5.5 | 5,357 | |
| 鉄建建設 | 13.5 | 8.9 | 16,625 | |
| 西松建設 | 47.9 | 31.5 | 92,736 | |
| 三井住友建設 | 150.1 | 106.2 | 51,613 | |
| 大豊建設 | 13.9 | 9.6 | 38,256 | |
| 前田建設工業 | 155.6 | 110.1 | 108,008 | |
| 佐田建設 | 13.4 | 10.1 | 4,403 | |
| ナカノフドー建設 | 17 | 10.5 | 4,042 | |
| 奥村組 | 33.7 | 24.2 | 67,348 | |
| 東鉄工業 | 26.6 | 18.9 | 49,196 | |
| イチケン | 4.5 | 3.2 | 6,188 | |
| 富士ビー・エス | 9.2 | 5.7 | 3,368 | |
| 淺沼組 | 7 | 5.3 | 24,035 | |
| 戸田建設 | 258 | 182.6 | 148,088 | |
| 熊谷組 | 28.8 | 20.4 | 64,056 | |
| 北野建設 | 3.8 | 2.7 | 6,534 | |
| 植木組 | 2.7 | 3.9 | 6,009 | |
| 矢作建設工業 | 27.4 | 19.4 | 15,558 | |
| ピーエス三菱 | 20.4 | 14.5 | 9,584 | |
| 日本ハウスホールディングス | 42.4 | 30 | 9,990 | |
| 大東建託 | 67.8 | 48 | 558,240 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 新日本建設 | 26.4 | 18.7 | 16,194 |
| N I P P O | 51.4 | 36.4 | 106,069 |
| 東亜道路工業 | 3.9 | 2.7 | 12,136 |
| 前田道路 | 54.8 | 27.2 | 59,649 |
| 日本道路 | 6 | 4.2 | 33,726 |
| 東亜建設工業 | 19.4 | 11.7 | 29,097 |
| 日本国土開発 | 60.4 | 42.8 | 26,022 |
| 若築建設 | 11.2 | 7.9 | 10,301 |
| 東洋建設 | 69.6 | 49.3 | 29,234 |
| 五洋建設 | 246.3 | 186.7 | 164,856 |
| 世紀東急工業 | 29.8 | 21.1 | 18,757 |
| 福田組 | 7.2 | 5.1 | 25,423 |
| 住友林業 | 157.3 | 103.4 | 253,330 |
| 日本基礎技術 | 20.9 | 13.4 | 6,954 |
| 巴コーポレーション | 27.6 | 19.5 | 7,605 |
| 大和ハウス工業 | 614.6 | 406 | 1,388,926 |
| ライト工業 | 35.5 | 25.2 | 45,309 |
| 積水ハウス | 679.6 | 476.8 | 1,105,222 |
| 日特建設 | 16.2 | 11.5 | 9,211 |
| 北陸電気工事 | 10.7 | 7.6 | 8,664 |
| ユアテック | 35.5 | 25.1 | 19,904 |
| 日本リーテック | 13 | 9.2 | 16,615 |
| 四電工 | 3.4 | 2.4 | 7,908 |
| 中電工 | 25 | 20.2 | 47,853 |
| 関電工 | 88.4 | 71.5 | 68,282 |
| きんでん | 147.6 | 89.3 | 165,562 |
| 東京エネシス | 20.6 | 14.6 | 14,162 |
| トーエネック | 6.2 | 4.4 | 16,918 |
| 住友電設 | 17.5 | 12.4 | 29,003 |
| 日本電設工業 | 34.1 | 24.1 | 43,404 |
| 協和エクシオ | 94.2 | 66.7 | 199,766 |
| 新日本空調 | 16.4 | 11.6 | 26,134 |
| 九電工 | 43.6 | 30.8 | 117,348 |
| 三機工業 | 44.8 | 31.2 | 44,085 |
| 日揮ホールディングス | 191.2 | 146.7 | 190,269 |
| 中外炉工業 | 6.7 | 4.8 | 10,401 |
| ヤマト | 19.9 | 14.1 | 9,841 |
| 太平電業 | 15 | 9.7 | 26,228 |
| 高砂熱学工業 | 54 | 39.7 | 67,291 |
| 三晃金属工業 | 2.7 | 1.7 | 4,562 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 朝日工業社 | 4.2 | 3.3 | 9,619 |
| 明星工業 | 40.2 | 28.4 | 22,521 |
| 大気社 | 30.2 | 21.4 | 64,521 |
| ダイダン | 14.8 | 9.8 | 27,371 |
| 日比谷総合設備 | 20 | 14.1 | 27,142 |
| フィル・カンパニー | 3.6 | 2.5 | 7,587 |
| テスホールディングス | — | 9.1 | 17,117 |
| O S J Bホールディングス | 97.9 | — | — |
| レイズネクスト | 33.3 | 23.6 | 28,367 |
| 食料品 (3.3%) | | | |
| ニッポン | 58.2 | 41.2 | 66,332 |
| 日清製粉グループ本社 | 224.6 | 159 | 293,196 |
| 日東富士製粉 | 1.4 | 1 | 7,180 |
| 昭和産業 | 18.2 | 11.8 | 35,695 |
| 鳥越製粉 | 17.6 | 12.5 | 10,225 |
| 中部飼料 | 24.3 | 17.2 | 24,252 |
| フィード・ワン | 133.5 | 18.9 | 16,726 |
| 東洋精糖 | 3.4 | 2.4 | 2,906 |
| 日本甜菜製糖 | 10.4 | 7.3 | 11,928 |
| DM三井製糖ホールディングス | 17.4 | 11.1 | 20,634 |
| 塩水港精糖 | 21.5 | 16.8 | 3,981 |
| 日新製糖 | 9.4 | 6.7 | 12,026 |
| 森永製菓 | 46.7 | 33 | 123,750 |
| 中村屋 | 5.1 | 3.4 | 13,090 |
| 江崎グリコ | 58.9 | 38.7 | 164,281 |
| 名糖産業 | 9.6 | 6.2 | 9,479 |
| 井村屋グループ | 11.3 | 8 | 20,008 |
| 不二家 | 11.1 | 9 | 19,620 |
| 山崎製パン | 149 | 105.5 | 185,152 |
| 第一屋製パン | 3.4 | 2.7 | 2,589 |
| モロゾフ | 3.4 | 2.2 | 11,770 |
| 亀田製菓 | 11.3 | 8 | 37,440 |
| 寿スピリッツ | 19.1 | 13.5 | 87,615 |
| カルビー | 90.6 | 64.1 | 171,531 |
| 森永乳業 | 36.8 | 26 | 163,280 |
| 六甲バター | 13.2 | 9.3 | 15,168 |
| ヤクルト本社 | 136.7 | 96.8 | 537,240 |
| 明治ホールディングス | 131.5 | 93 | 644,490 |
| 雪印メグミルク | 47.9 | 33.9 | 77,325 |
| プリマハム | 31.1 | 19.8 | 66,231 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本ハム | 76 | 53.8 | 259,854 |
| 林兼産業 | 6.6 | 4.7 | 2,979 |
| 丸大食品 | 21.2 | 13.8 | 23,749 |
| S Foods | 15.9 | 12.6 | 41,769 |
| 柿安本店 | 6.9 | 4.9 | 12,558 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 128 | 90.6 | 66,409 |
| サッポロホールディングス | 67.8 | 48 | 107,520 |
| アサヒグループホールディングス | 416.4 | 307.4 | 1,457,383 |
| キリンホールディングス | 843.1 | 596.7 | 1,242,329 |
| 宝ホールディングス | 147.4 | 104.3 | 153,529 |
| オエノンホールディングス | 52.4 | 40 | 15,720 |
| 養命酒製造 | 6.1 | 4.3 | 7,993 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ | 139.5 | 107.7 | 197,198 |
| サントリー食品インターナショナル | 133 | 94.1 | 355,227 |
| ダイドーグループホールディングス | 10.2 | 7.9 | 41,475 |
| 伊藤園 | 60.4 | 42.7 | 266,448 |
| キーコーヒー | 19.5 | 13.8 | 28,828 |
| ユニカフェ | 5.1 | 4.2 | 4,221 |
| ジャパンフーズ | 2.8 | 2 | 2,418 |
| 日清オイリオグループ | 25.6 | 18.1 | 56,743 |
| 不二製油グループ本社 | 48.5 | 34.3 | 97,480 |
| かどや製油 | 2.2 | 1.5 | 6,240 |
| J-オイルミルズ | 10.3 | 13.1 | 24,772 |
| キッコーマン | 143.1 | 101.3 | 700,996 |
| 味の素 | 439 | 334.6 | 777,108 |
| ブルドックソース | — | 6.4 | 14,886 |
| キュービー | 110.7 | 78.3 | 203,893 |
| ハウス食品グループ本社 | 74.4 | 52.6 | 183,837 |
| カゴメ | 75.4 | 57.5 | 184,862 |
| 焼津水産化学工業 | 9.6 | 6.8 | 6,704 |
| アリアケジャパン | 18.2 | 12.9 | 86,172 |
| ビエトロ | 2.6 | 1.8 | 3,204 |
| エバラ食品工業 | 4.8 | 3.1 | 8,298 |
| やまみ | 1.7 | 1.5 | 3,214 |
| ニチレイ | 94.7 | 67 | 189,208 |
| 東洋水産 | 102.3 | 72.4 | 329,782 |
| イートアンドホールディングス | 6.9 | 4.9 | 9,074 |
| 大冷 | 2.6 | 1.6 | 3,118 |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 11 | 7.9 | 6,525 |
| 日清食品ホールディングス | 84.5 | 55.2 | 436,080 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 永谷園ホールディングス | 9.7 | 6.9 | 15,752 |
| 一正蒲鉾 | 7.7 | 5.5 | 6,968 |
| フジッコ | 21.5 | 15.2 | 29,518 |
| ロック・フィールド | 21.4 | 15.2 | 24,000 |
| 日本たばこ産業 | 1,148 | 754.4 | 1,620,074 |
| ケンコーマヨネーズ | 11.1 | 8.6 | 15,342 |
| わらべや日洋ホールディングス | 13 | 9.2 | 18,712 |
| なとり | 11.1 | 7.9 | 15,254 |
| イフジ産業 | 3.5 | 2.2 | 2,081 |
| ピックルスコーポレーション | 4.3 | 3.4 | 11,475 |
| ファーマフーズ | — | 13.3 | 44,355 |
| 北の達人コーポレーション | 69.4 | 49.1 | 24,157 |
| ユウグレナ | 85.7 | 71.7 | 65,892 |
| 紀文食品 | — | 6.9 | 11,253 |
| ミヨシ油脂 | 7.6 | 4.9 | 6,027 |
| 理研ビタミン | 18.8 | 13.3 | 18,753 |
| 繊維製品 (0.5%) | | | |
| 片倉工業 | 28.2 | 18.4 | 26,900 |
| グンゼ | 14.2 | 10.1 | 40,955 |
| 東洋紡 | 76.7 | 54.3 | 78,897 |
| ユニチカ | 56.8 | 40.2 | 16,080 |
| 富士紡ホールディングス | 9.4 | 6.6 | 29,964 |
| 倉敷紡績 | 19.2 | 12.6 | 23,814 |
| シキボウ | 10.2 | 7.7 | 7,384 |
| 日本毛織 | 63.8 | 45.2 | 45,742 |
| ダイトウボウ | 31.4 | 22.2 | 2,419 |
| トーア紡コーポレーション | 7.7 | 5.4 | 2,484 |
| ダイドーリミテッド | 25.5 | 18 | 3,240 |
| 帝国繊維 | 21.8 | 15.5 | 32,612 |
| 帝人 | 158.3 | 129.2 | 242,379 |
| 東レ | 1,404.7 | 994.1 | 703,922 |
| サカイオーベックス | 5.1 | 3.6 | 11,088 |
| 住江織物 | 4.3 | 3 | 5,988 |
| 日本フェルト | 11 | 7.8 | 3,424 |
| イチカワ | 2.7 | 1.8 | 2,401 |
| 日東製網 | 2.2 | 1.5 | 2,322 |
| アツギ | 16 | 10.6 | 6,805 |
| ダイニック | 7.3 | 5.2 | 4,232 |
| セーレン | 47.7 | 33.8 | 66,450 |
| ソトー | 7.7 | 5.5 | 4,400 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東海染工 | 2.7 | 1.7 | 1,912 |
| 小松マテール | 31.8 | 22.5 | 20,857 |
| ワコールホールディングス | 50.6 | 34.3 | 89,248 |
| ホギメディカル | 22.1 | 18.5 | 61,975 |
| レナウン | 49.8 | — | — |
| クラウディアホールディングス | 4.8 | 3.4 | 972 |
| T S I ホールディングス | 65.1 | 41.7 | 14,052 |
| マツオカコーポレーション | 5.6 | 4.4 | 8,254 |
| ワールド | 27.5 | 18 | 26,262 |
| 三陽商会 | 10.1 | 7.1 | 5,942 |
| ナイガイ | 7.1 | 5 | 1,700 |
| オンワードホールディングス | 116.5 | 82.5 | 25,245 |
| ルックホールディングス | 6.6 | 4.7 | 5,997 |
| ゴールドウイン | 35.2 | 22.7 | 153,225 |
| デサント | 37.8 | 23.4 | 45,442 |
| キング | 9.1 | 7.3 | 3,883 |
| ヤマトインターナショナル | 17 | 12.1 | 4,029 |
| パルプ・紙 (0.3%) | | | |
| 特種東海製紙 | 12.3 | 8.4 | 39,606 |
| 王子ホールディングス | 811 | 618.1 | 470,992 |
| 日本製紙 | 85.8 | 60.7 | 87,772 |
| 三菱製紙 | 22 | 19.5 | 7,078 |
| 北越コーポレーション | 115.6 | 98.2 | 57,741 |
| 中越パルプ工業 | 8.2 | 5.2 | 6,567 |
| 巴川製紙所 | 5.8 | 4.5 | 3,654 |
| 大王製紙 | 85.5 | 66.2 | 127,501 |
| 阿波製紙 | 5 | 3.5 | 1,515 |
| レンゴー | 183.4 | 141.6 | 136,644 |
| トーモク | 11.9 | 8.4 | 17,194 |
| ザ・バック | 14.7 | 10.4 | 29,452 |
| 化学 (7.4%) | | | |
| クラレ | 305.5 | 216.2 | 270,682 |
| 旭化成 | 1,285.9 | 910.1 | 1,098,945 |
| 共和レザー | 10.5 | 7.5 | 5,775 |
| 昭和電工 | 138.1 | 104.3 | 382,781 |
| 住友化学 | 1,425.3 | 1,080.8 | 651,722 |
| 住友精化 | 8.6 | 6.7 | 26,063 |
| 日産化学 | 107.7 | 75.7 | 452,686 |
| ラサ工業 | 6.8 | 4.5 | 10,026 |
| クレハ | 16.6 | 11.8 | 93,220 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 多木化学 | 7.6 | 5.4 | 31,806 |
| テイカ | 14.2 | 10.1 | 14,412 |
| 石原産業 | 34.8 | 24.6 | 23,074 |
| 片倉コープアグリ | 5 | 3.5 | 4,242 |
| 日本曹達 | 28.7 | 19.2 | 64,608 |
| 東ソー | 299.9 | 212.2 | 432,463 |
| トクヤマ | 55.9 | 40.8 | 103,183 |
| セントラル硝子 | 39.6 | 26.2 | 62,198 |
| 東亜合成 | 121.8 | 83.8 | 104,666 |
| 大阪ソーダ | 19.7 | 14 | 36,232 |
| 関東電化工業 | 46 | 32.6 | 29,307 |
| デンカ | 70.8 | 50.1 | 226,452 |
| 信越化学工業 | 333.1 | 253.9 | 4,716,192 |
| 日本カーバイド工業 | 6.6 | 5 | 6,755 |
| 堺化学工業 | 12.5 | 9.6 | 18,768 |
| 第一稀元素化学工業 | 21 | 13.8 | 19,320 |
| エア・ウォーター | 180.4 | 140 | 270,200 |
| 日本酸素ホールディングス | 186.4 | 113.1 | 241,355 |
| 日本化学工業 | 6 | 3.9 | 11,696 |
| 東邦アセチレン | 2.9 | 2.1 | 2,692 |
| 日本パーカライジング | 97.9 | 69.3 | 75,259 |
| 高圧ガス工業 | 30.8 | 21.8 | 15,979 |
| チタン工業 | 2.4 | 1.7 | 3,534 |
| 四国化成工業 | 29.9 | 18.2 | 22,750 |
| 戸田工業 | 4.5 | 2.9 | 6,243 |
| ステラ ケミファ | 10.6 | 7.5 | 23,700 |
| 保土谷化学工業 | 7.2 | 4 | 17,880 |
| 日本触媒 | 30.1 | 24.9 | 147,657 |
| 大日精化工業 | 17.2 | 11.3 | 26,848 |
| カネカ | 50.2 | 35.5 | 158,507 |
| 三菱瓦斯化学 | 180.5 | 137.6 | 359,824 |
| 三井化学 | 176.1 | 118.5 | 433,710 |
| J S R | 180.8 | 137.8 | 463,697 |
| 東京応化工業 | 33.3 | 23.6 | 172,516 |
| 大阪有機化学工業 | 17.9 | 12.7 | 51,879 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 1,296.9 | 917.8 | 797,843 |
| KHネオケム | 34.2 | 22.6 | 61,404 |
| ダイセル | 252.6 | 184.6 | 165,401 |
| 住友パークライト | 30.5 | 21.6 | 100,440 |
| 積水化学工業 | 417.1 | 290.4 | 581,961 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本ゼオン | 175 | 123.8 | 216,773 |
| アイカ工業 | 58.2 | 38.2 | 161,395 |
| 宇部興産 | 98 | 69.3 | 161,676 |
| 積水樹脂 | 34.9 | 22.7 | 49,349 |
| タキロンシーアイ | 42 | 29.7 | 20,047 |
| 旭有機材 | 11 | 7.8 | 11,294 |
| 日立化成 | 89.7 | — | — |
| ニチバン | 10.2 | 7.2 | 13,456 |
| リケンテクノス | 48.8 | 33.5 | 18,525 |
| 大倉工業 | 9.2 | 6.5 | 12,863 |
| 積水化成成品工業 | 26 | 18.4 | 11,021 |
| 群栄化学工業 | 4.4 | 3.1 | 7,517 |
| タイガースポリマー | 10.2 | 7.2 | 3,520 |
| ミライアル | 6.8 | 4.4 | 5,957 |
| ダイキアクシス | 6.9 | 5.2 | 4,747 |
| ダイキョーニシカワ | 40.9 | 28.9 | 22,946 |
| 竹本容器 | 6.9 | 4.9 | 4,914 |
| 森六ホールディングス | 10.4 | 7.4 | 15,806 |
| 恵和 | — | 2.7 | 6,820 |
| 日本化薬 | 120.1 | 85 | 91,375 |
| カーリットホールディングス | 20.7 | 13.6 | 9,860 |
| 日本精化 | 15.6 | 9.9 | 14,315 |
| 扶桑化学工業 | 19.7 | 10.8 | 46,224 |
| トリケミカル研究所 | 4.3 | 12.7 | 46,418 |
| ADEKA | 89.3 | 63.2 | 138,028 |
| 日油 | 73 | 51.7 | 317,955 |
| 新日本理化 | 32.1 | 22.7 | 6,514 |
| ハリマ化成グループ | 16 | 10.2 | 9,577 |
| 花王 | 474.3 | 335.7 | 2,343,521 |
| 第一工業製薬 | 7.2 | 4.7 | 17,437 |
| 石原ケミカル | 5.3 | 3.5 | 7,448 |
| 日華化学 | 6.5 | 4.6 | 5,667 |
| ニイタカ | 4 | 2.8 | 7,448 |
| 三洋化成工業 | 11.6 | 8.2 | 44,280 |
| 有機合成薬品工業 | 14.9 | 10.5 | 3,066 |
| 大日本塗料 | 21.9 | 15.5 | 13,609 |
| 日本ペイントホールディングス | 160.1 | 566.4 | 992,899 |
| 関西ペイント | 218 | 154.3 | 434,200 |
| 神東塗料 | 15.3 | 10.8 | 2,268 |
| 中国塗料 | 55.2 | 33.1 | 33,232 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本特殊塗料 | 14.5 | 10.3 | 10,938 |
| 藤倉化成 | 26.2 | 18.5 | 10,193 |
| 太陽ホールディングス | 14.3 | 10.1 | 55,449 |
| D I C | 81.9 | 58 | 170,810 |
| サカタインクス | 42.3 | 30 | 32,580 |
| 東洋インキSCホールディングス | 41 | 29 | 60,610 |
| T&K TOKA | 15 | 9.6 | 7,728 |
| 富士フィルムホールディングス | 379.8 | 246.4 | 1,795,270 |
| 資生堂 | 393.6 | 278.6 | 2,206,512 |
| ライオン | 257.5 | 182.3 | 371,892 |
| 高砂香料工業 | 12.4 | 8.8 | 23,698 |
| マンダム | 44.5 | 29.4 | 60,622 |
| ミルボン | 26.5 | 18.7 | 108,273 |
| ファンケル | 80.2 | 51.1 | 180,894 |
| コーセー | 37.3 | 26.4 | 425,568 |
| コタ | 11.4 | 8.9 | 13,714 |
| シーボン | 2.6 | 1.8 | 3,555 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 84.5 | 59.8 | 171,685 |
| ノエビアホールディングス | 16.8 | 11.9 | 57,953 |
| アジュバンコスメジャパン | 4.4 | 3.1 | 3,220 |
| 新日本製菓 | — | 3.8 | 7,957 |
| エステー | 12.7 | 9 | 16,587 |
| アグロ カネショウ | 8.2 | 5.3 | 7,870 |
| コニシ | 32.5 | 23 | 37,122 |
| 長谷川香料 | 34.1 | 24.2 | 52,828 |
| 星光PMC | 11.3 | 8 | 6,408 |
| 小林製薬 | 55.5 | 39.3 | 386,319 |
| 荒川化学工業 | 17.8 | 11.7 | 14,894 |
| メック | 13.6 | 9.6 | 24,355 |
| 日本高純度化学 | 5.4 | 3.8 | 10,161 |
| タカラバイオ | 51.8 | 36.7 | 104,081 |
| J C U | 24 | 15.8 | 64,622 |
| 新田ゼラチン | 12.4 | 8.8 | 5,693 |
| O A Tアグリオ | 3.4 | 2.7 | 3,831 |
| デクセリアルズ | 51.1 | 39.2 | 79,066 |
| アース製薬 | 14.9 | 10.6 | 66,144 |
| 北興化学工業 | 20.3 | 13.1 | 13,139 |
| 大成ラミック | 6.5 | 4.3 | 12,104 |
| クミアイ化学工業 | 81.9 | 58 | 52,142 |
| 日本農薬 | 35.3 | 25 | 14,400 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アキレス | 13.7 | 9.7 | 13,754 |
| 有沢製作所 | 31.3 | 19.5 | 18,915 |
| 日東電工 | 136.7 | 84.7 | 764,841 |
| レック | 21.1 | 16.6 | 19,538 |
| 三光合成 | 22.6 | 14.7 | 6,629 |
| きもと | 33.7 | 21.5 | 5,955 |
| 藤森工業 | 17.8 | 12.6 | 53,046 |
| 前澤化成工業 | 12.6 | 8.9 | 10,128 |
| 未来工業 | 10.6 | 5 | 8,915 |
| ウェーブブロックホールディングス | 6.8 | 4.8 | 3,532 |
| J S P | 11.6 | 8.2 | 14,276 |
| エフビコ | 21.8 | 25.8 | 114,294 |
| 天馬 | 13.2 | 10.5 | 24,318 |
| 信越ポリマー | 35.6 | 21.6 | 23,544 |
| 東リ | 49.3 | 34.9 | 9,004 |
| ニフコ | 72.7 | 51.5 | 198,790 |
| バルカー | 16.1 | 11.4 | 24,441 |
| ユニ・チャーム | 381.8 | 297.2 | 1,264,288 |
| ショーエイコーポレーション | 2.9 | 3.1 | 3,118 |
| 医薬品 (5.2%) | | | |
| 協和キリン | 199.3 | 141 | 475,875 |
| 武田薬品工業 | 1,648.1 | 1,166.4 | 4,350,672 |
| アステラス製薬 | 1,717.5 | 1,215.5 | 2,093,091 |
| 大日本住友製薬 | 146.8 | 103.9 | 203,020 |
| 塩野義製薬 | 253.3 | 176.3 | 1,022,011 |
| わかもと製薬 | 23.6 | 16.7 | 5,544 |
| あすか製薬 | 22.6 | — | — |
| 日本新薬 | 51.8 | 39.7 | 294,177 |
| ピオフェルミン製薬 | 3.4 | 2.4 | 7,260 |
| 中外製薬 | 206.5 | 438.5 | 1,828,983 |
| 科研製薬 | 33.9 | 24 | 110,160 |
| エーザイ | 237.1 | 154.9 | 1,123,025 |
| ロート製薬 | 101.7 | 66.8 | 191,048 |
| 小野薬品工業 | 454.9 | 321.9 | 927,232 |
| 久光製薬 | 52.4 | 40.8 | 267,648 |
| 持田製薬 | 27.5 | 19.5 | 76,830 |
| 参天製薬 | 369 | 244 | 348,920 |
| 扶桑薬品工業 | 7 | 4.5 | 11,146 |
| 日本ケミファ | 2.6 | 1.7 | 3,986 |
| ツムラ | 61.4 | 46.8 | 174,564 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日医工 | 56.1 | 39.7 | 38,628 |
| キッセイ薬品工業 | 35 | 24.8 | 56,990 |
| 生化学工業 | 38.4 | 24.7 | 25,688 |
| 栄研化学 | 34.8 | 24.6 | 54,366 |
| 日水製薬 | 8.3 | 5.2 | 5,148 |
| 鳥居薬品 | 12.4 | 8.8 | 22,668 |
| J C R ファーマ | 14 | 39.5 | 120,870 |
| 東和薬品 | 25.3 | 20.2 | 46,904 |
| 富士製薬工業 | 13.5 | 8.6 | 10,526 |
| 沢井製薬 | 40.7 | — | — |
| ゼリア新薬工業 | 35.9 | 25.4 | 51,079 |
| 第一三共 | 566.8 | 1,203.5 | 3,517,228 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 43.7 | 30.9 | 58,957 |
| 大幸薬品 | 24.2 | 17.2 | 17,870 |
| ダイト | 11.9 | 9 | 31,230 |
| 大塚ホールディングス | 377.4 | 291.4 | 1,277,497 |
| 大正製薬ホールディングス | 41.9 | 33.4 | 226,118 |
| ペプチドリーム | 100.7 | 72.3 | 352,101 |
| あすか製薬ホールディングス | — | 16 | 22,112 |
| サワイグループホールディングス | — | 30.7 | 163,631 |
| 石油・石炭製品 (0.5%) | | | |
| 日本コークス工業 | 167.3 | 118.4 | 13,024 |
| ニチレキ | 23.4 | 16.5 | 23,331 |
| ユシロ化学工業 | 11.1 | 7.9 | 9,085 |
| ビービー・カストロール | 7.1 | 5 | 7,010 |
| 富士石油 | 52.9 | 34 | 8,330 |
| MORESCO | 7.2 | 5.1 | 5,630 |
| 出光興産 | 219.8 | 155.6 | 436,924 |
| ENEOSホールディングス | 2,979.9 | 2,108.9 | 1,070,266 |
| コスモエネルギーホールディングス | 57.3 | 44.3 | 115,312 |
| ゴム製品 (0.6%) | | | |
| 横浜ゴム | 114.7 | 81.2 | 173,199 |
| TOYO TIRE | 113.7 | 73.8 | 154,684 |
| ブリヂストン | 570.6 | 372.8 | 1,725,318 |
| 住友ゴム工業 | 177.9 | 125.9 | 177,267 |
| 藤倉コンポジット | 17.3 | 12.2 | 6,014 |
| オカモト | 12.1 | 8.5 | 34,595 |
| フコク | 8.7 | 6.1 | 4,819 |
| ニッタ | 22.3 | 14.5 | 39,353 |
| 住友理工 | 38.4 | 27.2 | 20,264 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三ツ星ベルト | 26.1 | 17 | 29,376 |
| バンドー化学 | 34.8 | 24.7 | 18,623 |
| ガラス・土石製品 (0.8%) | | | |
| 日東紡績 | 29.5 | 20.9 | 84,122 |
| AGC | 195.8 | 128.7 | 673,101 |
| 日本板硝子 | 94.8 | 71.1 | 54,818 |
| 石塚硝子 | 3.6 | 2.4 | 4,675 |
| 日本山村硝子 | 8.2 | 5.8 | 5,643 |
| 日本電気硝子 | 79.6 | 52 | 145,288 |
| オハラ | 7.8 | 5.5 | 8,662 |
| 住友大阪セメント | 37.5 | 25.2 | 92,610 |
| 太平洋セメント | 125.1 | 83 | 241,696 |
| 日本ヒューム | 19.9 | 12.8 | 9,331 |
| 日本コンクリート工業 | 42.6 | 30.2 | 12,261 |
| 三谷セキサン | 9.2 | 6.5 | 26,617 |
| アジアバイルホールディングス | 28.1 | 21.6 | 11,296 |
| 東海カーボン | 207.5 | 137.1 | 262,683 |
| 日本カーボン | 10.2 | 7.7 | 38,461 |
| 東洋炭素 | 11.6 | 8.2 | 18,646 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 11 | 7.8 | 29,523 |
| TOTO | 141.5 | 100.1 | 583,583 |
| 日本碍子 | 237.8 | 154.3 | 315,543 |
| 日本特殊陶業 | 150.7 | 106.6 | 182,072 |
| ダントーホールディングス | 14.8 | 10.4 | 3,369 |
| MARUWA | 7.6 | 4.8 | 54,432 |
| 品川リフラクトリーズ | 5.2 | 3.3 | 10,857 |
| 黒崎播磨 | 3.9 | 2.4 | 11,400 |
| ヨータイ | 15.7 | 10 | 11,060 |
| イソライト工業 | 10.2 | 6.2 | 4,092 |
| 東京窯業 | 25.2 | 17.8 | 5,891 |
| ニッカトー | 9 | 6.3 | 4,624 |
| フジミインコーポレーテッド | 17.6 | 11.2 | 52,136 |
| クミネ工業 | 8 | 4.4 | 5,341 |
| エーアンドエーマテリアル | 3.3 | 2.7 | 2,748 |
| ニチアス | 54.2 | 35.4 | 106,093 |
| ニチハ | 27.5 | 19.5 | 63,667 |
| 鉄鋼 (0.9%) | | | |
| 日本製鉄 | 876.6 | 661.8 | 1,509,565 |
| 神戸製鋼所 | 358.5 | 253.7 | 231,374 |
| 中山製鋼所 | 27.2 | 19.2 | 9,388 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 合同製鐵 | 10.5 | 7.5 | 14,265 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 529 | 401.1 | 691,897 |
| 東京製鐵 | 95.4 | 54 | 64,206 |
| 共英製鋼 | 22.1 | 15.6 | 23,805 |
| 大和工業 | 41.6 | 29.5 | 109,740 |
| 東京製鋼 | 8.1 | 5.3 | 9,184 |
| 大阪製鐵 | 10.4 | 7.4 | 10,411 |
| 淀川製鋼所 | 26.4 | 18.2 | 47,156 |
| 丸一鋼管 | 63.6 | 45 | 130,455 |
| モリ工業 | 5.9 | 4.1 | 11,180 |
| 大同特殊鋼 | 32.1 | 22.7 | 138,697 |
| 日本高周波鋼業 | 7.2 | 5.1 | 2,325 |
| 日本冶金工業 | 16.2 | 10.8 | 26,935 |
| 山陽特殊製鋼 | 13.4 | 16.6 | 30,577 |
| 愛知製鋼 | 11 | 7.8 | 27,378 |
| 日立金属 | 211 | 130.7 | 278,391 |
| 日本金属 | 4.5 | 3.5 | 4,228 |
| 大平洋金属 | 13.2 | 9.4 | 24,111 |
| 新日本電工 | 126.2 | 89.4 | 36,385 |
| 栗本鐵工所 | 9.7 | 6.3 | 11,025 |
| 虹技 | 2.9 | 1.9 | 2,314 |
| 日本鑄鉄管 | 2 | 1.6 | 2,192 |
| 三菱製鋼 | 14.5 | 10.3 | 9,424 |
| 日亜鋼業 | 28.6 | 20.3 | 6,496 |
| 日本精練 | 3.2 | 2 | 8,700 |
| エンビプロ・ホールディングス | 8.4 | 5.9 | 6,690 |
| シンニッタン | 30.4 | 16.8 | 4,552 |
| 新家工業 | 4.5 | 3.4 | 5,810 |
| 非鉄金属 (0.8%) | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 32.2 | 20.9 | 22,300 |
| 日本軽金属ホールディングス | 495.6 | 37.8 | 87,620 |
| 三井金属鉱業 | 52.9 | 37.4 | 152,592 |
| 東邦亜鉛 | 10 | 7.7 | 19,958 |
| 三菱マテリアル | 129.4 | 91.6 | 250,434 |
| 住友金属鉱山 | 250.4 | 177.2 | 936,147 |
| DOWAホールディングス | 49.6 | 35.1 | 177,606 |
| 古河機械金属 | 34.8 | 22.9 | 30,663 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 20.4 | 14.4 | 15,422 |
| 東邦チタニウム | 35.1 | 24.8 | 25,891 |
| UACJ | 29.7 | 21 | 60,564 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| CKサンエツ | 4.1 | 2.9 | 10,454 |
| 古河電気工業 | 60.8 | 43.1 | 129,300 |
| 住友電気工業 | 732.4 | 483.8 | 811,574 |
| フジクラ | 236.5 | 167.4 | 98,766 |
| 昭和電線ホールディングス | 22.7 | 13.4 | 21,761 |
| 東京特殊電線 | 2.9 | 1.8 | 4,705 |
| タツタ電線 | 38.8 | 24.4 | 14,957 |
| カナレ電気 | 3.2 | 2.3 | 4,112 |
| 平河ヒューテック | 9.8 | 7.7 | 10,325 |
| リョービ | 24.1 | 17.1 | 28,847 |
| アーレスティ | 25.7 | 17 | 8,534 |
| アサヒホールディングス | 34.3 | 52 | 122,668 |
| 金属製品 (0.6%) | | | |
| 稲葉製作所 | 11 | 7.8 | 11,661 |
| 官地エンジニアリンググループ | 6 | 4.5 | 10,566 |
| トーカロ | 54.4 | 35.8 | 55,561 |
| アルファC o | 6.9 | 4.9 | 6,169 |
| SUMCO | 234.5 | 177.4 | 469,932 |
| 川田テクノロジーズ | 4 | 2.8 | 12,250 |
| RS Technologies | 5.5 | 4.5 | 28,260 |
| ジェイテックコーポレーション | — | 1.5 | 4,245 |
| 信和 | 11.3 | 7.4 | 5,964 |
| 東洋製織グループホールディングス | 124.8 | 88.3 | 122,825 |
| ホッカンホールディングス | 10.8 | 7 | 10,094 |
| コロナ | 10.8 | 7.7 | 7,422 |
| 横河ブリッジホールディングス | 36.4 | 23.8 | 50,955 |
| 駒井ハルテック | 3.7 | 2.8 | 5,563 |
| 高田機工 | 1.8 | 1.3 | 3,491 |
| 三和ホールディングス | 184.7 | 130.7 | 186,378 |
| 文化シャッター | 57.7 | 40.8 | 39,494 |
| 三協立山 | 25.2 | 17.9 | 15,376 |
| アルインコ | 14.2 | 9.2 | 9,549 |
| 東洋シャッター | 4.7 | 3.1 | 2,024 |
| L I X I L | 289 | 190.9 | 560,291 |
| 日本フィルコン | 15 | 9.6 | 4,780 |
| ノーリツ | 40.6 | 28.7 | 49,392 |
| 長府製作所 | 19.9 | 14.1 | 28,778 |
| リンナイ | 38.1 | 27 | 303,750 |
| ダイニチ工業 | 10.5 | 6.6 | 5,511 |
| 日東精工 | 27 | 17.4 | 9,813 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三洋工業 | 2.6 | 1.7 | 3,139 |
| 岡部 | 39.7 | 28.1 | 21,187 |
| ジーテクト | 24.3 | 17.2 | 25,284 |
| 東プレ | 36.5 | 25.9 | 38,979 |
| 高周波熱練 | 37.7 | 26.7 | 15,512 |
| 東京製綱 | 14 | 9.9 | 10,890 |
| サンコール | 14.7 | 11.9 | 5,593 |
| モリテック スチール | 15.3 | 10.8 | 4,870 |
| パイオラックス | 29 | 20.5 | 31,098 |
| エイチワン | 19.2 | 13.6 | 11,369 |
| 日本発條 | 210.1 | 138.1 | 112,827 |
| 中央発條 | 2.4 | 6.7 | 7,443 |
| アドパネクス | 2.8 | 2 | 2,968 |
| 立川ブラインド工業 | 8.6 | 6.1 | 8,387 |
| 三益半導体工業 | 15.3 | 10.8 | 29,473 |
| 機械 (5.8%) | | | |
| 日本ドライケミカル | 4.9 | 3.4 | 5,899 |
| 日本製鋼所 | 59.4 | 42.1 | 117,332 |
| 三浦工業 | 84.8 | 60 | 354,600 |
| タクマ | 66.4 | 47 | 107,160 |
| ツガミ | 40.6 | 28.7 | 50,540 |
| オークマ | 22.8 | 16.2 | 100,926 |
| 芝浦機械 | 22.1 | 14.4 | 39,139 |
| アマダ | 242.9 | 203.2 | 250,952 |
| アイダエンジニアリング | 51.3 | 36.3 | 35,102 |
| 滝澤鉄工所 | 6.1 | 4 | 4,676 |
| F U J I | 84.2 | 55.4 | 164,316 |
| 牧野フライス製作所 | 23 | 16.3 | 72,372 |
| オーエスジー | 90.5 | 68.4 | 127,360 |
| ダイジェット工業 | 2.2 | 1.6 | 2,115 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 51.4 | 36.4 | 19,656 |
| DMG森精機 | 123.9 | 87.7 | 159,000 |
| ソディック | 46 | 29.2 | 31,477 |
| ディスコ | 26.5 | 18.8 | 659,880 |
| 日東工器 | 10.7 | 6.6 | 12,949 |
| 日進工具 | 7.7 | 10.9 | 16,905 |
| パンチ工業 | 17.7 | 11.6 | 6,844 |
| 富士ダイス | 8.6 | 7 | 4,662 |
| 豊和工業 | 10.8 | 7.6 | 6,976 |
| OKK | 8 | 5.3 | 2,353 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東洋機械金属 | 14 | 9.9 | 5,256 |
| 津田駒工業 | 3.8 | 2.7 | 2,511 |
| エンシュウ | 4.7 | 3.3 | 3,234 |
| 島精機製作所 | 30.8 | 20.3 | 45,167 |
| オプトラン | 21.8 | 17.4 | 49,068 |
| NCホールディングス | 5.9 | 4.2 | 2,935 |
| イワキポンプ | 12.4 | 8.8 | 8,800 |
| フリーー | 19.1 | 13.5 | 13,459 |
| ヤマシンフィルタ | 42.6 | 27.9 | 23,184 |
| 日阪製作所 | 24.2 | 17.1 | 14,791 |
| やまびこ | 38 | 26.9 | 32,522 |
| 平田機工 | 9.3 | 6.6 | 47,982 |
| ベガサスミシン製造 | 19.8 | 14 | 7,112 |
| マルマエ | 7.2 | 5.7 | 9,997 |
| タツモ | 9.1 | 5.9 | 10,466 |
| ナブテスコ | 115.4 | 81.7 | 411,768 |
| 三井海洋開発 | 20.8 | 14.7 | 33,574 |
| レオン自動車 | 19.2 | 13.6 | 16,755 |
| SMC | 62.1 | 41.1 | 2,680,953 |
| ホソカワミクロン | 6.9 | 4.9 | 31,262 |
| ユニオンツール | 7.3 | 5.2 | 18,434 |
| オイレス工業 | 25.3 | 19.4 | 31,544 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 5.7 | 4.7 | 24,581 |
| サトーホールディングス | 27.9 | 18.2 | 50,505 |
| 技研製作所 | 17.2 | 12.2 | 55,571 |
| 日本エアテック | 6.6 | 4.5 | 5,413 |
| カワタ | 5.8 | 3.8 | 3,553 |
| 日精樹脂工業 | 16.4 | 10.7 | 11,138 |
| オカダアイオン | 6.2 | 4.4 | 5,478 |
| ワイエイシイホールディングス | 8.4 | 5.5 | 5,318 |
| 小松製作所 | 897.2 | 635.2 | 2,182,547 |
| 住友重機械工業 | 113.4 | 80.2 | 260,650 |
| 日立建機 | 79.4 | 65.5 | 239,075 |
| 日工 | 27.1 | 20.9 | 15,277 |
| 巴工業 | 8.4 | 5.5 | 11,594 |
| 井関農機 | 19.8 | 14 | 22,904 |
| TOWA | 20 | 13.1 | 28,728 |
| 丸山製作所 | 4 | 2.8 | 5,177 |
| 北川鉄工所 | 8.9 | 6.3 | 10,350 |
| ローツェ | 8.7 | 6.1 | 59,475 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| タカキタ | 6.9 | 4.9 | 3,273 |
| クボタ | 1,050.9 | 736.4 | 2,001,903 |
| 荏原実業 | 5 | 3.5 | 17,325 |
| 三菱化工機 | 6.8 | 4.5 | 12,699 |
| 月島機械 | 36.5 | 25.8 | 32,353 |
| 帝国電機製作所 | 16.3 | 9.8 | 13,308 |
| 東京機械製作所 | 8.1 | 5.7 | 2,981 |
| 新東工業 | 47 | 33.3 | 25,907 |
| 澁谷工業 | 17.3 | 12.3 | 44,157 |
| アイチ コーポレーション | 34.2 | 23.8 | 21,586 |
| 小森コーポレーション | 50.2 | 35.5 | 27,441 |
| 鶴見製作所 | 15.2 | 10.8 | 19,375 |
| 住友精密工業 | 2.9 | 2.1 | 4,687 |
| 日本ギア工業 | 7.9 | 5.6 | 1,831 |
| 酒井重工業 | 3.7 | 2.5 | 5,275 |
| 荏原製作所 | 81.9 | 58.1 | 284,109 |
| 石井鐵工所 | 2.6 | 2 | 5,898 |
| 西島製作所 | 20 | 14.1 | 12,506 |
| 北越工業 | 20.4 | 14.4 | 15,969 |
| ダイキン工業 | 252.4 | 178.6 | 4,128,339 |
| オルガノ | 7.1 | 4.5 | 33,165 |
| トーヨーカネツ | 8.6 | 5.3 | 13,970 |
| 栗田工業 | 107.2 | 75.9 | 381,018 |
| 椿本チエイン | 28.3 | 20 | 60,800 |
| 大同工業 | 9.4 | 6.7 | 5,808 |
| 木村化工機 | 16.5 | 11.7 | 9,020 |
| アネスト岩田 | 30.8 | 23.6 | 24,945 |
| ダイフク | 101.2 | 77.1 | 866,604 |
| サムコ | 4.9 | 3.5 | 11,392 |
| 加藤製作所 | 10.8 | 7.7 | 8,385 |
| 油研工業 | 3.3 | 2.4 | 4,087 |
| タダノ | 95.6 | 67.6 | 79,092 |
| フジテック | 72 | 48.3 | 125,193 |
| CKD | 54.3 | 32.5 | 80,047 |
| キトー | 15 | 11.8 | 21,523 |
| 平和 | 55.2 | 39.1 | 75,502 |
| 理想科学工業 | 17.5 | 10.3 | 14,358 |
| SANKYO | 44.1 | 33.3 | 97,768 |
| 日本金銭機械 | 21.9 | 15.5 | 9,331 |
| マースグループホールディングス | 12.6 | 8.9 | 14,400 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フクシマガリレイ | 12.2 | 9.6 | 39,984 |
| オーイズミ | 8.3 | 5.9 | 2,383 |
| ダイコク電機 | 9.1 | 6.4 | 6,035 |
| 竹内製作所 | 33.1 | 23.5 | 72,262 |
| アマノ | 51.9 | 36.7 | 108,485 |
| J U K I | 27.6 | 19.5 | 16,828 |
| サンデンホールディングス | 25.9 | — | — |
| 蛇の目ミシン工業 | 18 | 12.7 | 10,172 |
| マックス | 30.2 | 18.8 | 31,302 |
| グローリー | 50.9 | 36 | 86,076 |
| 新晃工業 | 18.4 | 13 | 30,888 |
| 大和冷機工業 | 28.6 | 22.5 | 25,200 |
| セガサミーホールディングス | 196.5 | 127.5 | 204,510 |
| 日本ビストンリング | 7.2 | 5.1 | 5,763 |
| リケン | 9.2 | 6.5 | 15,567 |
| T P R | 26.6 | 18.9 | 31,657 |
| ツバキ・ナカシマ | 40.4 | 26.9 | 45,999 |
| ホシザキ | 57.9 | 44.1 | 451,584 |
| 大豊工業 | 16.1 | 11.4 | 11,605 |
| 日本精工 | 372.9 | 287.9 | 308,340 |
| N T N | 458.4 | 324.5 | 111,628 |
| ジェイテクト | 190 | 134.5 | 147,546 |
| 不二越 | 18.4 | 13 | 56,680 |
| 日本トムソン | 58.8 | 38.4 | 26,995 |
| THK | 115.2 | 87.4 | 338,675 |
| ユースン精機 | 15.3 | 9.3 | 8,137 |
| 前澤給装工業 | 7.2 | 9.8 | 10,946 |
| イーグル工業 | 24.5 | 17.3 | 20,760 |
| 前澤工業 | 13.2 | 8.4 | 5,594 |
| 日本ビラー工業 | 20 | 14.2 | 26,823 |
| キッツ | 80.3 | 43.3 | 31,392 |
| マキタ | 258.3 | 182.8 | 935,936 |
| 日立造船 | 157 | 111.1 | 91,768 |
| 三菱重工業 | 332 | 220.3 | 771,490 |
| I H I | 142.7 | 94.3 | 218,776 |
| スター精密 | 30.5 | 21.6 | 36,547 |
| 電気機器 (17.6%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 132 | 85.7 | 74,816 |
| イビデン | 121.3 | 67.4 | 328,575 |
| コニカミノルタ | 432.8 | 284.4 | 181,447 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ブラザー工業 | 241.9 | 171.2 | 371,161 |
| ミネベアミツミ | 367.7 | 241.6 | 692,184 |
| 日立製作所 | 951.8 | 674 | 3,628,816 |
| 東芝 | — | 277.4 | 1,252,461 |
| 三菱電機 | 1,980.7 | 1,401.8 | 2,377,452 |
| 富士電機 | 119.4 | 84.5 | 435,175 |
| 東洋電機製造 | 7.2 | 5.5 | 7,084 |
| 安川電機 | 213.2 | 150.9 | 780,153 |
| シンフォニアテクノロジー | 25.6 | 18.2 | 27,664 |
| 明電舎 | 36.4 | 23.8 | 57,572 |
| オリジン | 5.4 | 3.8 | 5,145 |
| 山洋電気 | 9.6 | 6.8 | 53,720 |
| デンヨー | 16.9 | 11.9 | 24,347 |
| 東芝テック | 24.8 | 15 | 66,450 |
| 芝浦メカトロニクス | 3.5 | 2.5 | 15,175 |
| マブチモーター | 54.8 | 38.8 | 172,466 |
| 日本電産 | 476.7 | 337.4 | 4,214,126 |
| ユニー・エム・シー・エレクトロニクス | 11.9 | 7.3 | 6,913 |
| トレックス・セミコンダクター | 11.4 | 7.5 | 13,845 |
| 東光高岳 | 11 | 7.1 | 10,181 |
| ダブル・スコープ | 31.3 | 33.2 | 23,870 |
| ダイヘン | 21.7 | 15.3 | 75,429 |
| ヤーマン | 32.3 | 22.9 | 34,624 |
| J V Cケンウッド | 161.4 | 121.3 | 28,626 |
| ミマキエン지니어リング | 17.7 | 12.6 | 8,555 |
| I - P E X | 8.1 | 6.5 | 12,870 |
| 日新電機 | 46.4 | 32.9 | 40,861 |
| 大崎電気工業 | 39.4 | 27.9 | 17,102 |
| オムロン | 177.6 | 116.7 | 995,451 |
| 日東工業 | 29.1 | 20.6 | 40,952 |
| I D E C | 28.6 | 18.8 | 32,636 |
| 正興電機製作所 | 4.7 | 4.4 | 7,620 |
| 不二電機工業 | 3.3 | 2.3 | 2,964 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 66.1 | 50.4 | 151,452 |
| サクサホールディングス | 4.6 | 3.3 | 4,920 |
| メルコホールディングス | 6.8 | 4.8 | 20,736 |
| テクノメディカ | 4.4 | 3.1 | 5,053 |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 4.3 | 4.1 | 11,594 |
| 日本電気 | 240.3 | 178.1 | 1,130,935 |
| 富士通 | 191 | 126.1 | 2,115,327 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 沖電気工業 | 80.5 | 56.9 | 68,109 |
| 岩崎通信機 | 8.7 | 6.1 | 5,624 |
| 電気興業 | 9.5 | 6.7 | 17,326 |
| サンケン電気 | 21.6 | 16.4 | 82,984 |
| ナカヨ | 3.8 | 2.7 | 4,114 |
| アイホン | 11.2 | 7.9 | 16,471 |
| ルネサスエレクトロニクス | 947.1 | 603.4 | 748,819 |
| セイコーエプソン | 245.8 | 173.9 | 328,844 |
| ワコム | 133.2 | 101.5 | 69,832 |
| アルバック | 36.4 | 25.8 | 130,032 |
| アクセル | 8.3 | 5.9 | 6,342 |
| E I Z O | 15.4 | 11.9 | 49,504 |
| 日本信号 | 50.4 | 32.7 | 31,457 |
| 京三製作所 | 46.4 | 30.1 | 12,551 |
| 能美防災 | 26.2 | 18.5 | 38,998 |
| ホーチキ | 14.4 | 10.2 | 13,372 |
| 星和電機 | 9.8 | 6.9 | 4,209 |
| エレコム | 21.9 | 32.1 | 74,696 |
| パナソニック | 2,263.1 | 1,495.1 | 1,929,426 |
| シャープ | 229.2 | 186.4 | 339,620 |
| アンリツ | 127.5 | 84.3 | 188,494 |
| 富士通ゼネラル | 53.8 | 42.8 | 124,804 |
| ソニーグループ | 1,240.8 | 878.2 | 9,466,996 |
| TDK | 95.6 | 67.7 | 1,003,314 |
| 帝国通信工業 | 8.7 | 6.2 | 6,875 |
| タムラ製作所 | 66.2 | 50.4 | 26,560 |
| アルプスアルパイン | 175.3 | 114.5 | 147,018 |
| 池上通信機 | 6.3 | 4.4 | 3,907 |
| 日本電波工業 | 17.9 | 13.6 | 10,009 |
| 鈴木 | 9.7 | 6.3 | 7,585 |
| 日本トリム | 2.7 | 3 | 11,535 |
| ローランド ディー. ジー. | 10.9 | 8.3 | 15,496 |
| フォスター電機 | 20.8 | 14.1 | 16,835 |
| SMK | 5.1 | 3.6 | 10,216 |
| ヨコオ | 12.8 | 10.8 | 28,490 |
| ティアック | 14.2 | 8.8 | 1,126 |
| ホシデン | 54.1 | 38.3 | 41,708 |
| ヒロセ電機 | 30.7 | 21.6 | 334,800 |
| 日本航空電子工業 | 45.4 | 32.1 | 61,953 |
| TOA | 21.2 | 16.5 | 15,147 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| マクセルホールディングス | 42.6 | 27.9 | 37,386 |
| 古野電気 | 25.5 | 18 | 20,106 |
| ユニデンホールディングス | 5.4 | 3.6 | 9,453 |
| スマitcoコーポレーション | 15.2 | 11.9 | 12,364 |
| アイコム | 11 | 5.8 | 15,404 |
| リオン | 8.3 | 5.9 | 16,018 |
| 本多通信工業 | 16.9 | 10.9 | 5,559 |
| 船井電機 | 20 | 15.7 | 14,302 |
| 横河電機 | 181.7 | 140.3 | 289,859 |
| 新電元工業 | 7 | 5.4 | 19,494 |
| アズビル | 125 | 94.8 | 435,606 |
| 東亜ディーケーケー | 9.8 | 6.9 | 5,913 |
| 日本光電工業 | 81.9 | 57.9 | 192,807 |
| チノー | 6.8 | 4.4 | 6,023 |
| 共和電業 | 20.7 | 14.7 | 5,659 |
| 日本電子材料 | 7.8 | 5.4 | 10,800 |
| 堀場製作所 | 39.2 | 27.8 | 209,890 |
| アドバンテスト | 147.3 | 104.2 | 1,062,840 |
| 小野測器 | 8.3 | 5.8 | 3,056 |
| エスバック | 17.6 | 12.4 | 23,907 |
| キーエンス | 179.5 | 137.6 | 7,360,224 |
| 日置電機 | 10.3 | 6.7 | 36,180 |
| シスメックス | 141.6 | 109.4 | 1,220,904 |
| 日本マイクロニクス | 34.5 | 24.4 | 41,431 |
| メガチップス | 18.4 | 14 | 52,990 |
| OBARA GROUP | 11.6 | 6.4 | 24,448 |
| 澤藤電機 | 2.4 | 1.5 | 3,468 |
| 原田工業 | 9.4 | 5.7 | 5,152 |
| コーセル | 26.4 | 17.1 | 18,382 |
| イリソ電子工業 | 16.6 | 11.8 | 63,366 |
| オブテックスグループ | 32.5 | 23 | 39,836 |
| 千代田インテグレ | 9.2 | 5.9 | 10,797 |
| アイ・オー・データ機器 | 6.4 | 5.2 | 5,740 |
| レーザーテック | 87 | 61.6 | 1,157,464 |
| スタンレー電気 | 139.3 | 98.1 | 313,429 |
| 岩崎電気 | 7.7 | 5.1 | 7,695 |
| ウシオ電機 | 109.3 | 71.9 | 106,627 |
| 岡谷電機産業 | 15.5 | 10 | 3,980 |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 18.2 | 12.9 | 4,656 |
| エノモト | 5.9 | 3.9 | 7,137 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本セラミック | 20.1 | 14.2 | 39,305 |
| 遠藤照明 | 10 | 7.1 | 5,474 |
| 古河電池 | 14.1 | 10 | 16,400 |
| 双信電機 | 9.6 | 6.8 | 3,454 |
| 山一電機 | 14.3 | 9.1 | 14,469 |
| 図研 | 12.9 | 9.1 | 27,036 |
| 日本電子 | 39.1 | 25.5 | 156,315 |
| カシオ計算機 | 175.2 | 112.7 | 223,596 |
| ファナック | 188.2 | 123 | 3,269,340 |
| 日本シイエムケイ | 46.5 | 30.2 | 13,801 |
| エンブラス | 10.1 | 6.3 | 26,302 |
| 大真空 | 7.2 | 4.7 | 12,149 |
| ローム | 87.9 | 58.3 | 617,980 |
| 浜松ホトニクス | 142.1 | 100.6 | 641,828 |
| 三井ハイテック | 21.8 | 13.7 | 57,882 |
| 新光電気工業 | 66.5 | 47.1 | 156,843 |
| 京セラ | 278.7 | 213.7 | 1,474,743 |
| 太陽誘電 | 88.1 | 62.3 | 311,500 |
| 村田製作所 | 581.9 | 411.8 | 3,582,248 |
| 双葉電子工業 | 31.3 | 24 | 21,888 |
| 北陸電気工業 | 8 | 5.2 | 4,867 |
| ニチコン | 67.2 | 44.1 | 47,804 |
| 日本ケミコン | 15.1 | 14.1 | 24,928 |
| KOA | 29.9 | 19.4 | 32,301 |
| 市光工業 | 29.6 | 21 | 14,994 |
| 小糸製作所 | 118.7 | 84 | 587,160 |
| ミツバ | 36.4 | 25.8 | 17,415 |
| SCREENホールディングス | 34.4 | 24.3 | 253,206 |
| キャノン電子 | 20.8 | 12.9 | 23,052 |
| キャノン | 1,066.3 | 696.6 | 1,826,136 |
| リコー | 503.9 | 356.6 | 439,331 |
| 象印マホービン | 58 | 37.9 | 65,870 |
| MUTOHホールディングス | 2.5 | 1.8 | 2,827 |
| 東京エレクトロン | 125.7 | 82.1 | 4,109,926 |
| 輸送用機器 (7.2%) | | | |
| トヨタ紡織 | 57.7 | 40.8 | 84,496 |
| 芦森工業 | 4.1 | 2.6 | 2,646 |
| ユニプレス | 38.4 | 23 | 25,530 |
| 豊田自動織機 | 160.3 | 113.5 | 1,023,770 |
| モリタホールディングス | 34.6 | 22.5 | 36,112 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------|---------|---------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三櫻工業 | 25.1 | 19.4 | 23,454 |
| デンソー | 436.1 | 308.7 | 2,245,483 |
| 東海理化電機製作所 | 52.2 | 36.9 | 65,534 |
| 三井E&Sホールディングス | 71.5 | 54.3 | 32,417 |
| 川崎重工業 | 154.1 | 109.1 | 306,243 |
| 名村造船所 | 63.7 | 42.1 | 7,914 |
| サノヤスホールディングス | 24.1 | 17.2 | 2,614 |
| 日本車輛製造 | 7.2 | 5.1 | 12,474 |
| 三菱ロジスネクスト | 26.2 | 18.6 | 22,320 |
| 近畿車輛 | 3 | 2.4 | 3,110 |
| 日産自動車 | 2,336.1 | 1,653.3 | 962,881 |
| いすゞ自動車 | 573.9 | 372.2 | 430,263 |
| トヨタ自動車 | 2,210.2 | 1,420.2 | 12,080,221 |
| 日野自動車 | 247.4 | 175.1 | 168,096 |
| 三菱自動車工業 | 733.2 | 518.9 | 161,377 |
| エフテック | 13.8 | 9.8 | 7,291 |
| レシップホールディングス | 7.7 | 5.6 | 3,091 |
| GMB | 3.5 | 2.5 | 2,405 |
| ファルテック | 3.5 | 2.4 | 2,133 |
| 武蔵精密工業 | 44.1 | 31.2 | 61,401 |
| 日産車体 | 38.7 | 20.5 | 15,088 |
| 新明和工業 | 53.4 | 39.6 | 40,867 |
| 極東開発工業 | 36.8 | 24.2 | 41,309 |
| 日信工業 | 40.3 | — | — |
| トビー工業 | 16.3 | 11.5 | 16,077 |
| ティラド | 7.2 | 4.4 | 8,659 |
| タチエス | 32.5 | 21.5 | 25,477 |
| NOK | 106.5 | 67.8 | 98,445 |
| フタバ産業 | 55.1 | 35.1 | 19,234 |
| KYB | 22.2 | 15.7 | 50,161 |
| 大同メタル工業 | 38 | 29 | 17,081 |
| プレス工業 | 98.2 | 69.5 | 23,421 |
| ミクニ | 25.1 | 17.8 | 5,642 |
| 太平洋工業 | 41.5 | 29.4 | 37,102 |
| ケーヒン | 45.5 | — | — |
| 河西工業 | 26.7 | 18.9 | 8,920 |
| アイシン | 163.1 | 102.6 | 443,232 |
| マツダ | 582.8 | 440 | 396,000 |
| 今仙電機製作所 | 18.4 | 12.3 | 9,102 |
| 本田技研工業 | 1,559.6 | 1,103.8 | 3,787,137 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| スズキ | 392.6 | 277.9 | 1,194,136 |
| SUBARU | 614.9 | 401.7 | 854,817 |
| 安永 | 9.5 | 6.8 | 8,316 |
| ヤマハ発動機 | 258.3 | 198.1 | 569,537 |
| ショーワ | 46.8 | — | — |
| TBK | 23.5 | 16.6 | 6,905 |
| エクセディ | 26.9 | 19 | 30,590 |
| 豊田合成 | 64 | 45.3 | 122,898 |
| 愛三工業 | 31 | 21.9 | 17,279 |
| 盟和産業 | 3 | 2.1 | 1,810 |
| 日本プラスト | 15.5 | 11.8 | 6,938 |
| ヨロズ | 18.5 | 12 | 15,216 |
| エフ・シー・シー | 32.4 | 22.9 | 41,082 |
| シマノ | 74.1 | 52.5 | 1,323,262 |
| テイ・エス テック | 46 | 65.1 | 99,993 |
| ジャムコ | 9.9 | 8.2 | 7,462 |
| 精密機器 (2.6%) | | | |
| テルモ | 560.5 | 429.7 | 1,822,357 |
| クリエートメディック | 6.5 | 4.6 | 4,682 |
| 日機装 | 59.4 | 45.3 | 52,593 |
| 日本エム・ディ・エム | 11.4 | 8.1 | 18,225 |
| 島津製作所 | 236.7 | 180.4 | 718,894 |
| JMS | 16.7 | 11.8 | 11,693 |
| クボテック | 5.1 | 3.6 | 1,317 |
| 長野計器 | 14.3 | 10.1 | 12,534 |
| ブイ・テクノロジー | 9.3 | 6.6 | 36,432 |
| 東京計器 | 12.6 | 8.9 | 9,603 |
| 愛知時計電機 | 2.6 | 1.8 | 7,731 |
| インターアクション | 10.6 | 7 | 16,639 |
| オーバル | 17.7 | 12.5 | 3,575 |
| 東京精密 | 35.9 | 23.6 | 124,136 |
| マニー | 78.9 | 55.8 | 142,959 |
| ニコン | 302.5 | 214.1 | 230,585 |
| トプコン | 99.7 | 70.6 | 112,324 |
| オリンパス | 1,096 | 775.7 | 1,767,820 |
| 理研計器 | 17.5 | 12.4 | 35,811 |
| タムロン | 16 | 11.3 | 27,266 |
| HOYA | 395.6 | 275.9 | 3,629,464 |
| シード | 8.4 | 5.4 | 3,888 |
| ノーリツ銅機 | 13.4 | 12.6 | 31,739 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エー・アンド・デイ | 18.1 | 11.8 | 15,989 |
| 朝日インテック | 224.3 | 147.6 | 438,076 |
| シチズン時計 | 232 | 177.9 | 69,736 |
| リズム | 6.2 | 4.4 | 3,577 |
| 大研医器 | 13.7 | 11.1 | 6,415 |
| メニコン | 28.1 | 21.5 | 147,275 |
| シンシア | 2.1 | 1.5 | 1,332 |
| 松風 | 8.9 | 6.4 | 13,676 |
| セイコーホールディングス | 28 | 19.8 | 41,718 |
| ニプロ | 137.1 | 104.5 | 144,837 |
| その他製品 (2.4%) | | | |
| 中本パックス | 5 | 3.6 | 5,774 |
| スノーピーク | 10.6 | 8.3 | 34,569 |
| パラマウントベッドホールディングス | 20.9 | 26.9 | 60,256 |
| トランザクション | 10.8 | 7.7 | 10,487 |
| 粧美堂 | 5.8 | 4.1 | 1,701 |
| ニホンフラッシュ | 18.5 | 12 | 16,056 |
| 前田工織 | 21.8 | 15.4 | 52,591 |
| 永大産業 | 25.9 | 18.3 | 6,350 |
| アートネイチャー | 21.2 | 13.5 | 9,166 |
| バンダイナムコホールディングス | 204.8 | 115.9 | 937,746 |
| アイフィスジャパン | 5 | 3.6 | 2,674 |
| 共立印刷 | 33 | 23.4 | 3,135 |
| SHOEI | 17.3 | 13.2 | 53,130 |
| フランスベッドホールディングス | 28 | 18 | 16,758 |
| パイロットコーポレーション | 32.3 | 23.7 | 84,964 |
| 萩原工業 | 11 | 7.8 | 11,341 |
| トッパン・フォームズ | 42.4 | 25 | 28,875 |
| フジシールインターナショナル | 44.4 | 28.8 | 71,395 |
| タカラトミー | 88.8 | 62.9 | 60,698 |
| 廣済堂 | 13.8 | 9.8 | 10,054 |
| エステールホールディングス | 5.3 | 3.7 | 2,319 |
| アーク | 75.6 | — | — |
| タカノ | 7.7 | 4.8 | 3,076 |
| プロネクサス | 17 | 11.2 | 13,092 |
| ホクシン | 12.2 | 8.6 | 2,141 |
| ウッドワン | 6.7 | 4.7 | 7,914 |
| 大建工業 | 13.3 | 9.4 | 19,975 |
| 凸版印刷 | 279.6 | 213.1 | 416,184 |
| 大日本印刷 | 259.2 | 169.3 | 388,882 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 共同印刷 | 6.1 | 4.3 | 11,949 |
| N I S S H A | 40.7 | 28.8 | 38,505 |
| 光村印刷 | 1.7 | 1.2 | 2,122 |
| TAKARA & COMPANY | 9.5 | 6.9 | 13,137 |
| アシックス | 163.5 | 124 | 226,176 |
| ツツミ | 6.2 | 3.5 | 8,372 |
| ローランド | — | 10.9 | 57,988 |
| 小松ウオール工業 | 6 | 4.3 | 8,853 |
| ヤマハ | 117.8 | 83.4 | 524,586 |
| 河合楽器製作所 | 6.1 | 3.9 | 13,611 |
| クリナップ | 18.4 | 13 | 7,241 |
| ビジョン | 119.7 | 90 | 333,000 |
| オリバー | 4.2 | 3 | 7,686 |
| 兼松サステック | 1.3 | 0.9 | 1,601 |
| キングジム | 16.5 | 11.7 | 11,138 |
| リンテック | 47.1 | 30 | 75,210 |
| イトーキ | 42.1 | 27.8 | 10,869 |
| 任天堂 | 121.5 | 80.2 | 4,990,044 |
| 三菱鉛筆 | 32.6 | 23.1 | 34,349 |
| タカラスタンダード | 40.9 | 29 | 46,690 |
| コクヨ | 95 | 67.2 | 114,374 |
| ナカバヤシ | 19.5 | 13.8 | 8,376 |
| グローブライド | 8.9 | 6.8 | 30,056 |
| オカムラ | 69.1 | 48.2 | 65,600 |
| 美津濃 | 18 | 13.9 | 32,136 |
| 電気・ガス業 (1.3%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 1,581.3 | 1,189.1 | 410,239 |
| 中部電力 | 606 | 428.9 | 584,376 |
| 関西電力 | 750.5 | 531.2 | 583,257 |
| 中国電力 | 285.7 | 202.2 | 251,334 |
| 北陸電力 | 181.1 | 128.2 | 87,047 |
| 東北電力 | 494.8 | 328.3 | 320,420 |
| 四国電力 | 178.4 | 116.5 | 95,180 |
| 九州電力 | 408.3 | 309.6 | 313,315 |
| 北海道電力 | 185.4 | 131.2 | 70,323 |
| 沖縄電力 | 36.7 | 27.3 | 40,677 |
| 電源開発 | 157.6 | 111.5 | 188,658 |
| エフオン | 10.6 | 8.5 | 8,763 |
| イーレックス | 28.2 | 20.6 | 40,396 |
| レノバ | 33.1 | 23.8 | 74,732 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東京瓦斯 | 380.9 | 269.6 | 629,381 |
| 大阪瓦斯 | 384.4 | 253.9 | 546,392 |
| 東邦瓦斯 | 97.4 | 68.9 | 436,137 |
| 北海道瓦斯 | 10.6 | 7.5 | 11,760 |
| 広島ガス | 40.8 | 28.9 | 11,213 |
| 西部ガスホールディングス | 22.3 | 15.8 | 40,337 |
| 静岡ガス | 56.2 | 39.8 | 39,083 |
| メタウォーター | 9.6 | 15.8 | 33,180 |
| 陸運業 (3.4%) | | | |
| S B S ホールディングス | 17.1 | 10.4 | 29,286 |
| 東武鉄道 | 206.5 | 146.1 | 430,702 |
| 相鉄ホールディングス | 63.4 | 48.1 | 108,369 |
| 東急 | 499.6 | 353.6 | 516,256 |
| 京浜急行電鉄 | 254.4 | 180 | 260,100 |
| 小田急電鉄 | 294.6 | 224.5 | 673,051 |
| 京王電鉄 | 102.8 | 78.3 | 564,543 |
| 京成電鉄 | 137.8 | 105.1 | 348,932 |
| 富士急行 | 27 | 19.1 | 100,466 |
| 新京成電鉄 | 5.1 | 3.6 | 7,840 |
| 東日本旅客鉄道 | 348.6 | 246.7 | 1,895,396 |
| 西日本旅客鉄道 | 176.5 | 124.9 | 777,002 |
| 東海旅客鉄道 | 164.7 | 116.6 | 1,897,082 |
| 西武ホールディングス | 265.8 | 168.9 | 197,106 |
| 鴻池運輸 | 31.5 | 22.3 | 26,247 |
| 西日本鉄道 | 54.9 | 38.9 | 110,826 |
| ハマキョウレックス | 15.2 | 10.8 | 34,344 |
| サカイ引越センター | 10.4 | 6.4 | 36,224 |
| 近鉄グループホールディングス | 187.6 | 132.8 | 540,496 |
| 阪急阪神ホールディングス | 250.2 | 177.1 | 624,277 |
| 南海電気鉄道 | 88.9 | 62.9 | 150,016 |
| 京阪ホールディングス | 83.5 | 59.1 | 227,535 |
| 神戸電鉄 | 4.5 | 3.2 | 11,584 |
| 名古屋鉄道 | 154.2 | 109.2 | 279,552 |
| 山陽電気鉄道 | 13.4 | 9.5 | 17,955 |
| アルプス物流 | — | 9.3 | 8,862 |
| 日本通運 | 64.9 | 46 | 411,240 |
| ヤマトホールディングス | 328.9 | 186 | 577,530 |
| 山九 | 52.1 | 34.1 | 168,113 |
| 丸運 | 10.7 | 7.6 | 2,143 |
| 丸全昭和運輸 | 15.2 | 10.8 | 35,316 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| センコーグループホールディングス | 103.4 | 73.2 | 76,128 |
| トナミホールディングス | 4.5 | 3.2 | 17,120 |
| ニッコンホールディングス | 67.1 | 44.6 | 104,141 |
| 日本石油輸送 | 2 | 1.4 | 3,708 |
| 福山通運 | 24 | 17 | 73,695 |
| セイノーホールディングス | 140.5 | 99.4 | 155,759 |
| エスライン | 5.6 | 3.6 | 3,315 |
| 神奈川中央交通 | 4.6 | 3.3 | 12,193 |
| 日立物流 | 34.4 | 29.2 | 101,324 |
| 丸和運輸機関 | 19.8 | 28 | 54,012 |
| C&Fロジホールディングス | 19 | 13.4 | 23,557 |
| 九州旅客鉄道 | 164.5 | 102.7 | 259,831 |
| S Gホールディングス | 196.9 | 250.9 | 628,253 |
| 海運業 (0.3%) | | | |
| 日本郵船 | 156.9 | 111 | 490,065 |
| 商船三井 | 118.7 | 78.8 | 368,784 |
| 川崎汽船 | 57.8 | 40.9 | 129,448 |
| N Sユナイテッド海運 | 10.3 | 6.3 | 15,025 |
| 明治海運 | 19.9 | 14.1 | 7,064 |
| 飯野海運 | 88.8 | 61.6 | 34,557 |
| 共栄タンカー | 3.3 | 2.3 | 2,302 |
| 乾汽船 | 10.8 | 9.1 | 10,428 |
| 空運業 (0.4%) | | | |
| 日本航空 | 331.7 | 323.4 | 749,317 |
| ANAホールディングス | 342.9 | 358.3 | 920,114 |
| バスコ | 3.6 | 2.6 | 3,666 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | |
| トランコム | 5.2 | 4 | 36,080 |
| 日新 | 16.2 | 10.6 | 15,073 |
| 三菱倉庫 | 59.5 | 45.9 | 153,994 |
| 三井倉庫ホールディングス | 21.4 | 14.1 | 33,431 |
| 住友倉庫 | 67.5 | 46.9 | 69,318 |
| 滋澤倉庫 | 10.3 | 7.3 | 15,768 |
| 東陽倉庫 | 33.9 | 22.3 | 7,403 |
| 日本トランスシティ | 41.3 | 29.2 | 15,709 |
| ケイヒン | 3.6 | 2.6 | 3,640 |
| 中央倉庫 | 11.4 | 8.1 | 8,926 |
| 川西倉庫 | 3.4 | 2.4 | 2,805 |
| 安田倉庫 | 15.4 | 10.9 | 10,387 |
| ファイズホールディングス | 4 | 2.4 | 2,239 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東洋埠頭 | 5.7 | 4 | 6,020 |
| 宇徳 | 16 | 9.5 | 4,778 |
| 上組 | 104.7 | 73 | 162,425 |
| サンリツ | 4.4 | 3.4 | 2,437 |
| キムラユニティー | 5 | 3.5 | 4,487 |
| キューソー流通システム | 4.7 | 3.3 | 5,395 |
| 近鉄エクスプレス | 39.9 | 25.1 | 68,447 |
| 東海運 | 10.7 | 7.6 | 2,698 |
| エーアイテイー | 13.2 | 8.3 | 8,864 |
| 内外トランスライン | 6.6 | 4.7 | 8,732 |
| 日本コンセプト | 6 | 4.2 | 6,715 |
| 情報・通信業 (9.4%) | | | |
| NEC ネットズエスアイ | 18.4 | 45.5 | 86,131 |
| クロスキャット | 5.1 | 3.6 | 3,679 |
| システナ | 69.3 | 49.1 | 111,948 |
| デジタルアーツ | 9.6 | 8 | 69,920 |
| 日鉄ソリューションズ | 29.1 | 19.9 | 66,167 |
| キューブシステム | 10.3 | 7.3 | 8,022 |
| エイジア | 3.5 | 2.1 | 4,046 |
| コア | 8.2 | 5.8 | 8,723 |
| ラクーンホールディングス | 8.7 | 9.7 | 30,991 |
| ソリトンシステムズ | 8.5 | 6.9 | 12,226 |
| ソフトクリエイトホールディングス | 8.5 | 5.4 | 13,559 |
| T I S | 194.4 | 137.6 | 368,905 |
| J N Sホールディングス | 7.8 | 6.8 | 3,706 |
| 電算システム | 7.4 | 5.2 | 17,368 |
| グリー | 119.2 | 84.4 | 49,458 |
| GMOペパボ | — | 1.2 | 7,116 |
| コーエーテクモホールディングス | 39.7 | 36.6 | 170,739 |
| 三菱総合研究所 | 8.3 | 5.9 | 24,426 |
| ボルテージ | 4.5 | 3.7 | 2,397 |
| 電算 | 2.2 | 1.5 | 3,603 |
| AGS | 11 | 7 | 5,635 |
| ファイナデックス | 16.4 | 11.6 | 13,978 |
| ブレインパッド | 5 | 3.6 | 18,576 |
| KL a b | 37.7 | 25.2 | 19,656 |
| ポルトウウィン・ビットクルーホールディ | 23.4 | 18.3 | 21,191 |
| イーブックイニシアティブジャパン | 2.8 | 2.2 | 5,988 |
| ネクソン | 542.1 | 348.1 | 1,207,907 |
| アイスタイル | 54.4 | 42 | 21,084 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エムアップホールディングス | 5.6 | 3.6 | 10,227 |
| エイチーム | 13.4 | 9.5 | 15,504 |
| エニグモ | 18.4 | 13 | 17,030 |
| テクノスジャパン | 15.1 | 10.7 | 7,040 |
| e n i s h | 8.9 | 7.2 | 3,859 |
| コロブラ | 63.7 | 45.2 | 36,792 |
| オルトプラス | 11.8 | 10.6 | 5,183 |
| ブロードリーフ | 96.3 | 68.2 | 39,078 |
| クロス・マーケティンググループ | 8.6 | 6.1 | 3,208 |
| デジタルハーツホールディングス | 10.3 | 6.2 | 9,851 |
| システム情報 | 14.6 | 10.3 | 10,289 |
| メディアドゥ | 6.1 | 5.4 | 28,458 |
| じげん | 48.1 | 34 | 13,872 |
| ブイキューブ | 11.9 | 7.5 | 21,210 |
| エンカレッジ・テクノロジー | 4.3 | 2.4 | 1,572 |
| サイバーリンクス | 3 | 4.5 | 7,375 |
| ディー・エル・イー | 15.6 | 11.1 | 3,307 |
| フィックスターズ | 20.7 | 14.6 | 14,687 |
| CARTA HOLDINGS | 9.4 | 5.6 | 8,512 |
| オプティム | 10.2 | 9.6 | 26,409 |
| セレス | 6.4 | 4.5 | 17,100 |
| SHIFT | 7.8 | 6.9 | 106,053 |
| ティーガイア | 17.2 | 14.6 | 28,163 |
| セック | 2.8 | 2 | 5,470 |
| 日本アジアグループ | 20.5 | 13.3 | 12,502 |
| 豆蔵ホールディングス | 2.4 | — | — |
| テクマトリックス | 13.7 | 21.3 | 44,218 |
| プロシップ | 5.6 | 4 | 5,648 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 46.8 | 33.2 | 70,085 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 41.1 | 26.3 | 351,105 |
| ザッパラス | 8.4 | 5.3 | 2,734 |
| システムリサーチ | 5.1 | 4 | 8,600 |
| インターネットイニシアティブ | 28.7 | 36.6 | 89,157 |
| さくらインターネット | 20.8 | 14.7 | 9,775 |
| ヴィンクス | 5.4 | 3.9 | 4,083 |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 3.6 | 3.1 | 17,360 |
| SRAホールディングス | 10.3 | 7.3 | 19,213 |
| システムインテグレータ | 6.1 | 3.9 | 2,616 |
| 朝日ネット | 13.8 | 11.1 | 8,347 |
| eBASE | 23.2 | 16.4 | 16,236 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|--------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アバント | 18.5 | 14.7 | 24,210 |
| アドソル日進 | 6.9 | 4.9 | 13,107 |
| ODKソリューションズ | — | 2.9 | 2,447 |
| フリービット | 10.1 | 8.2 | 7,585 |
| コムチュア | 21.8 | 12.6 | 32,848 |
| サイバーコム | 3.5 | 2.4 | 3,720 |
| アステリア | 11.8 | 9.9 | 8,157 |
| アイル | 10.8 | 7.6 | 13,406 |
| マークライنز | 9.7 | 5.7 | 18,297 |
| メディカル・データ・ビジョン | 14.8 | 15.7 | 30,395 |
| g u m i | 24.9 | 19 | 26,619 |
| ショーケース | 4.6 | 3 | 2,517 |
| モバイルファクトリー | 4.3 | 3.1 | 4,454 |
| テラスカイ | 7 | 4.4 | 12,245 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 7.6 | 6.1 | 13,291 |
| PC Iホールディングス | 7.3 | 5.2 | 7,586 |
| パイプドHD | 2.5 | 2.8 | 4,684 |
| アイビーシー | 3.2 | 2.2 | 2,191 |
| ネオジャパン | 3.7 | 2.6 | 4,609 |
| PR TIMES | 1.7 | 2.9 | 9,120 |
| ラクス | — | 41.4 | 85,615 |
| ランドコンピュータ | 2.9 | 2.1 | 2,320 |
| ダブルスタンダード | 2.5 | 1.8 | 6,444 |
| オープンドア | 9.6 | 8.2 | 16,998 |
| マイネット | 6.3 | 4.5 | 3,888 |
| アカツキ | 6.9 | 5.5 | 22,192 |
| ベネフィットジャパン | 1.5 | 1 | 1,924 |
| U b i c o mホールディングス | 4.3 | 3.6 | 11,358 |
| L I N E | 44.5 | — | — |
| カナミックネットワーク | 17.8 | 14.7 | 9,569 |
| ノムラシステムコーポレーション | 4.2 | 6 | 1,872 |
| チェンジ | 6.8 | 25.3 | 83,869 |
| シンクロ・フード | 8.3 | 8.2 | 3,099 |
| オークネット | 12 | 7.3 | 9,380 |
| キャピタル・アセット・プランニング | — | 2.7 | 3,437 |
| セグエグループ | 4.2 | 3.5 | 4,662 |
| エイトレッド | 3.2 | 2.6 | 6,804 |
| AOI TYO Holdings | 19.6 | 13.9 | 8,840 |
| マクロミル | 39.7 | 28.1 | 24,587 |
| ビーグリー | 3.8 | 2.7 | 3,790 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オロ | 5.1 | 4.3 | 16,168 |
| ユーザーローカル | 1.9 | 2.1 | 9,870 |
| テモナ | 4.1 | 3 | 2,718 |
| ニーズウェル | 3.7 | 2.8 | 1,778 |
| サインポスト | 4 | 3.3 | 3,075 |
| ソルクシーズ | 8.2 | 5.3 | 4,849 |
| フェイス | 6.8 | 4.2 | 3,855 |
| プロトコーポレーション | 17.4 | 16.4 | 19,499 |
| ハイマックス | 2.3 | 3.9 | 4,442 |
| 野村総合研究所 | 275.5 | 238.9 | 807,482 |
| サイバネットシステム | 13.8 | 9.8 | 8,192 |
| CEホールディングス | 10.2 | 7.3 | 4,321 |
| 日本システム技術 | 3.1 | 2.4 | 3,820 |
| インテージホールディングス | 24.2 | 17.2 | 23,564 |
| 東邦システムサイエンス | 5.1 | 3.6 | 3,340 |
| ソースネクスト | 92.2 | 65.2 | 21,581 |
| インフォコム | 21.3 | 12.5 | 34,587 |
| HEROZ | 2.8 | 3.9 | 10,853 |
| ラクスル | 15.6 | 14.9 | 73,084 |
| I P S | — | 3.2 | 8,028 |
| F I G | 21 | 14.9 | 4,261 |
| システムサポート | 2.2 | 4.1 | 6,232 |
| イーソル | 9.2 | 7.5 | 8,970 |
| アルテリア・ネットワークス | 21.5 | 15.2 | 24,122 |
| E d u L a b | — | 1.3 | 8,229 |
| 東海ソフト | 1.3 | 2.1 | 2,576 |
| ウイングアーク1st | — | 7.2 | 18,648 |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング | 3.3 | 3.1 | 6,448 |
| サーバーワークス | — | 1.3 | 5,674 |
| 東名 | — | 1.3 | 1,471 |
| ヴィッツ | — | 1.3 | 2,694 |
| トピラシステムズ | 2.3 | 1.8 | 2,408 |
| S a n s a n | — | 12.2 | 105,652 |
| L i n k - U | — | 2.5 | 2,952 |
| ギフティ | — | 8.3 | 26,062 |
| ベース | — | 1.6 | 9,712 |
| フォーカスシステムズ | 12 | 9.2 | 8,546 |
| クレスコ | 11.8 | 9 | 15,273 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 187.2 | 142.7 | 191,218 |
| オービック | 67.4 | 43.4 | 866,264 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------|---------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ジャストシステム | 31.6 | 19.6 | 127,400 |
| TDCソフト | 17 | 12 | 12,636 |
| Zホールディングス | 2,669.2 | 1,889.8 | 898,032 |
| トレンドマイクロ | 86.4 | 73.5 | 393,225 |
| IDホールディングス | 7.4 | 5.2 | 7,098 |
| 日本オラクル | 39.4 | 27.9 | 302,715 |
| アルファシステムズ | 6 | 3.7 | 13,468 |
| フューチャー | 23.5 | 16.6 | 34,926 |
| C A C H o l d i n g s | 12.6 | 8.9 | 12,691 |
| S Bテクノロジー | 7 | 4.9 | 15,484 |
| トーセ | 5.3 | 3.7 | 2,963 |
| オービックビジネスコンサルタント | 19.9 | 14.1 | 89,394 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 88.6 | 62.7 | 239,827 |
| アイティフォー | 23.5 | 17.9 | 14,194 |
| 東計電算 | 2.9 | 2 | 8,660 |
| エックスネット | 3 | 2.2 | 2,244 |
| 大塚商会 | 105.2 | 74.4 | 421,104 |
| サイボウズ | 22.7 | 16.1 | 37,947 |
| ソフトブレイン | 11.4 | — | — |
| 電通国際情報サービス | 12 | 17 | 68,255 |
| A C C E S S | 18.2 | 17.2 | 15,342 |
| デジタルガレージ | 35 | 22.7 | 104,533 |
| EMシステムズ | 27.3 | 22.7 | 18,727 |
| ウェザーニューズ | 6.6 | 4.1 | 22,222 |
| C I J | 13.2 | 9.4 | 8,168 |
| ビジネスエンジニアリング | 2.2 | 1.4 | 4,893 |
| 日本エンタープライズ | 19.7 | 14 | 3,192 |
| WOWOW | 9.3 | 6.6 | 17,853 |
| スカラ | 12.9 | 12.2 | 9,259 |
| インテリジェント ウェイブ | 11.3 | 8 | 5,440 |
| I M A G I C A G R O U P | 16.5 | 11.7 | 5,885 |
| ネットワンシステムズ | 74 | 56.1 | 191,020 |
| システムソフト | 41.8 | 28.4 | 4,629 |
| アルゴグラフィックス | 16.5 | 10.7 | 32,902 |
| マーベラス | 29.7 | 21.7 | 17,815 |
| エイベックス | 33.4 | 23.7 | 35,573 |
| 日本ユニシス | 60.7 | 47.7 | 169,812 |
| 兼松エレクトロニクス | 10.6 | 7.5 | 28,200 |
| 都築電気 | — | 6.1 | 11,181 |
| T B Sホールディングス | 118.2 | 91.2 | 199,272 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本テレビホールディングス | 162.2 | 114.8 | 165,426 |
| 朝日放送グループホールディングス | 19.3 | 13.7 | 9,672 |
| テレビ朝日ホールディングス | 53.4 | 42.5 | 85,467 |
| スカパーJ SATホールディングス | 127.9 | 90.5 | 41,992 |
| テレビ東京ホールディングス | 15.9 | 9.8 | 22,363 |
| 日本BS放送 | 6.6 | 4.6 | 5,032 |
| ビジョン | 18.1 | 17.1 | 18,297 |
| スマートバリュー | 5.1 | 3.6 | 3,132 |
| USEN-NEXT HOLDINGS | 7.4 | 13.1 | 27,680 |
| ワイヤレスゲート | 9.2 | 5.6 | 2,615 |
| コネクシオ | 11 | 7.8 | 11,497 |
| 日本通信 | 151.5 | 121.5 | 26,973 |
| クロップス | 3.5 | 2.5 | 2,240 |
| 日本電信電話 | 2,598.2 | 1,609 | 4,592,086 |
| KDDI | 1,448.5 | 1,103.2 | 3,795,008 |
| ソフトバンク | 1,766.4 | 1,250.1 | 1,811,394 |
| 光通信 | 20 | 16.2 | 359,316 |
| NTTドコモ | 1,435.8 | — | — |
| エムティーアイ | 18.8 | 13.3 | 10,320 |
| GMOインターネット | 76.6 | 48.7 | 153,892 |
| ファイバーゲート | 6.2 | 4.5 | 7,069 |
| アイドママーケティングコミュニケーション | 5.8 | 3.5 | 1,445 |
| KADOKAWA | 52.3 | 35.6 | 139,552 |
| 学研ホールディングス | 26.1 | 19.4 | 27,295 |
| ゼンリン | 38.8 | 24.9 | 28,933 |
| 昭文社ホールディングス | 8.9 | 5.5 | 2,623 |
| インプレスホールディングス | 16.1 | 11.4 | 2,736 |
| アイネット | 10 | 7.1 | 10,486 |
| 松竹 | 12.9 | 9.1 | 113,113 |
| 東宝 | 114.7 | 81.2 | 358,092 |
| 東映 | 7.3 | 4.5 | 112,905 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 517.5 | 366.3 | 641,391 |
| ビー・シー・エー | 3.3 | 2 | 8,880 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 3.3 | 4.7 | 8,525 |
| DTS | 43.4 | 28.5 | 74,385 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 82.9 | 58.7 | 359,831 |
| シーイーシー | 20.8 | 14.7 | 20,491 |
| カプコン | 91.6 | 117.9 | 396,144 |
| アイ・エス・ピー | 3.8 | 6.3 | 8,523 |
| ジャステック | 12.4 | 8.8 | 11,316 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| SCSK | 44.8 | 31.7 | 200,661 |
| 日本システムウエア | 6.4 | 4.5 | 9,967 |
| アイネス | 19.1 | 13.5 | 19,386 |
| TKC | 16.4 | 23.3 | 83,647 |
| 富士ソフト | 24.9 | 14.7 | 81,144 |
| NSD | 62.5 | 44.2 | 80,002 |
| コナミホールディングス | 70.6 | 50 | 337,000 |
| 福井コンピュータホールディングス | 7.6 | 6.3 | 26,082 |
| JBCホールディングス | 13.1 | 9.3 | 12,899 |
| ミロク情報サービス | 17.1 | 13.6 | 25,404 |
| ソフトバンクグループ | 1,542.2 | 1,091.5 | 11,100,555 |
| 卸売業 (4.9%) | | | |
| ハウスイ | 1.5 | 1.1 | 1,084 |
| 高千穂交易 | 7.5 | 5.3 | 5,941 |
| オルパヘルスケアホールディングス | 2.3 | 2.2 | 3,790 |
| 伊藤忠食品 | 4.8 | 3.3 | 16,797 |
| エレマテック | 18.2 | 11 | 13,365 |
| JALUX | 5.5 | 3.9 | 6,368 |
| あらた | 15.5 | 11 | 50,600 |
| トーマンデバイス | 2.9 | 1.8 | 7,488 |
| 東京エレクトロン デバイス | 7.1 | 4.5 | 29,745 |
| フィールズ | 14.9 | 12.1 | 6,352 |
| 双日 | 1,077.5 | 762.6 | 261,571 |
| アルフレッサ ホールディングス | 216.8 | 143.2 | 293,273 |
| 横浜冷凍 | 51 | 38.7 | 34,636 |
| 神栄 | 2.7 | 1.9 | 2,515 |
| ラサ商事 | 10.3 | 7.3 | 6,591 |
| アルコニックス | 20.7 | 14.7 | 24,240 |
| 神戸物産 | 67.3 | 95.3 | 277,894 |
| ハイパー | 2.9 | 2.8 | 1,565 |
| あい ホールディングス | 27.8 | 19.7 | 44,167 |
| ディーブイエックス | 6.9 | 4.2 | 4,116 |
| ダイワボウホールディングス | 16.6 | 62.9 | 114,163 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 46.5 | 32.9 | 76,689 |
| ラクト・ジャパン | 7.3 | 6 | 17,358 |
| グリムス | — | 4.1 | 7,564 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 36.7 | 24 | 17,688 |
| 八洲電機 | 15.1 | 10.7 | 10,389 |
| メディアスホールディングス | 11.1 | 7.8 | 7,659 |
| レスターホールディングス | 20.3 | 14.4 | 29,332 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ジュレットクホールディングス | 4.4 | 3.1 | 3,100 |
| 大光 | 8.3 | 5.3 | 3,731 |
| OCHIホールディングス | 5.7 | 4 | 5,180 |
| TOKAIホールディングス | 103.1 | 66.9 | 61,280 |
| 黒谷 | 5.3 | 3.7 | 4,447 |
| Cominix | 3.4 | 2.4 | 1,852 |
| 三洋貿易 | 19.6 | 13.9 | 15,568 |
| ビューティガレージ | 3.1 | 2.2 | 7,953 |
| ウイン・パートナーズ | 14.1 | 10 | 10,140 |
| ミタチ産業 | 5.8 | 3.8 | 2,618 |
| シップヘルスケアホールディングス | 31.3 | 48.7 | 142,934 |
| 明治電機工業 | 6.1 | 4.7 | 6,617 |
| デリカフーズホールディングス | 6.9 | 5.3 | 3,333 |
| スターティアホールディングス | 4.4 | 2.7 | 3,010 |
| コマダホールディングス | 42.5 | 30.1 | 61,765 |
| ビーバンドットコム | 1.9 | 1.9 | 1,533 |
| アセンテック | 2.1 | 3.5 | 5,124 |
| 富士興産 | 5.9 | 4.2 | 5,443 |
| 協栄産業 | 2.2 | 1.5 | 2,062 |
| 小野建 | 17.5 | 12.4 | 17,236 |
| 南陽 | 4.3 | 2.8 | 5,042 |
| 佐鳥電機 | 13.2 | 8.6 | 6,914 |
| エコートレーディング | 4.5 | 2.9 | 1,757 |
| 伯東 | 11.9 | 8.4 | 12,969 |
| コンドータック | 15.1 | 10.7 | 11,031 |
| 中山福 | 11.2 | 7.9 | 3,752 |
| ナガイレーベン | 25.9 | 18.3 | 47,104 |
| 三菱食品 | 21.4 | 15.2 | 46,360 |
| 松田産業 | 14.2 | 10.1 | 23,957 |
| 第一興商 | 29 | 27.4 | 116,450 |
| メディバルホールディングス | 210.5 | 138.4 | 292,716 |
| SPK | 8.4 | 5.9 | 7,805 |
| 萩原電気ホールディングス | 7.2 | 5.1 | 13,611 |
| アズロン | 12.7 | 9.9 | 137,709 |
| スズデン | 6.8 | 4.8 | 6,460 |
| 尾家産業 | 5.7 | 4 | 4,908 |
| シモジマ | 11.9 | 8.4 | 9,760 |
| ドウシシャ | 18.4 | 13 | 24,492 |
| 小津産業 | 4.3 | 3 | 6,453 |
| 高速 | 11.6 | 7.3 | 10,636 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| たけびし | 6.8 | 4.8 | 7,142 |
| リックス | 4.4 | 3.1 | 4,665 |
| 丸文 | 17.3 | 12.2 | 6,392 |
| ハビネット | 16.3 | 11.5 | 17,491 |
| 橋本総業ホールディングス | 3.9 | 2.8 | 7,341 |
| 日本ライフライン | 57.8 | 44.6 | 66,409 |
| タカショー | 12.6 | 8.9 | 6,781 |
| マルカ | 6.9 | 4.5 | 9,675 |
| IDOM | 52.6 | 46.5 | 28,783 |
| 進和 | 11.5 | 8.2 | 17,088 |
| エスケイジャパン | 4.2 | 3.3 | 1,504 |
| ダイトロン | 8.2 | 5.8 | 11,849 |
| シークス | 24.8 | 17.5 | 27,212 |
| 田中商事 | 6 | 4.2 | 2,801 |
| オーハシテクニカ | 11 | 7.1 | 10,557 |
| 白銅 | 7 | 4.9 | 8,927 |
| ダイコー通産 | — | 1.6 | 2,872 |
| 伊藤忠商事 | 1,364.6 | 965.7 | 3,441,754 |
| 丸紅 | 2,030.7 | 1,361.6 | 1,351,524 |
| 高島 | 3.1 | 2.2 | 3,916 |
| 長瀬産業 | 109.7 | 75.8 | 129,314 |
| 蝶理 | 12.4 | 8.8 | 13,657 |
| 豊田通商 | 217.7 | 138.7 | 708,757 |
| 三共生興 | 29.5 | 20.9 | 11,014 |
| 兼松 | 72.8 | 55.2 | 83,572 |
| ツカモトコーポレーション | 3.5 | 2.3 | 3,210 |
| 三井物産 | 1,714.8 | 1,121 | 2,846,779 |
| 日本紙パルプ商事 | 11.1 | 7.2 | 26,424 |
| カメイ | 25.4 | 18 | 20,970 |
| 東都水産 | 2.5 | 1.6 | 6,808 |
| OUGホールディングス | 3.1 | 2.2 | 6,155 |
| スターゼン | 7.2 | 10.2 | 23,337 |
| 山善 | 76.2 | 53.9 | 55,247 |
| 椿本興業 | 3.6 | 2.5 | 8,912 |
| 住友商事 | 1,230.9 | 871.4 | 1,359,384 |
| 内田洋行 | 7.7 | 5.9 | 28,733 |
| 三菱商事 | 1,369 | 840.6 | 2,531,046 |
| 第一実業 | 9.5 | 6.3 | 26,523 |
| キヤノンマーケティングジャパン | 48.4 | 34.2 | 88,988 |
| 西華産業 | 11 | 7.3 | 12,556 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 佐藤商事 | 16.1 | 11.4 | 12,437 |
| 菱洋エレクトロ | 19.8 | 10.5 | 28,549 |
| 東京産業 | 17.6 | 12.5 | 7,950 |
| ユアサ商事 | 18.5 | 14.1 | 44,203 |
| 神鋼商事 | 4.9 | 3.1 | 7,901 |
| トルク | 11.6 | 8.2 | 2,074 |
| 阪和興業 | 36.4 | 27.6 | 99,498 |
| 正栄食品工業 | 12.6 | 8.9 | 36,623 |
| カナデン | 15.8 | 11.2 | 13,104 |
| 菱電商事 | 14 | 9.9 | 16,671 |
| フルサト工業 | 10.8 | 7 | 11,487 |
| 岩谷産業 | 43.3 | 33.1 | 238,982 |
| ナイス | 8.3 | 5.5 | 11,082 |
| 昭光通商 | 6.2 | 2.9 | 2,299 |
| ニチモウ | 3 | 2.1 | 4,160 |
| 極東貿易 | 5.6 | 4 | 5,628 |
| イワキ | 25.6 | 18.4 | 13,965 |
| 三愛石油 | 48 | 34 | 43,248 |
| 稲畑産業 | 43 | 33.2 | 55,278 |
| G S Iクレオス | 4.8 | 6.8 | 8,330 |
| 明和産業 | 18 | 12.7 | 6,210 |
| クワザワホールディングス | 6.9 | 4.9 | 2,930 |
| ヤマエ久野 | 14.2 | 10.1 | 11,009 |
| ワキタ | 41.6 | 27.2 | 29,920 |
| 東邦ホールディングス | 62.6 | 44.3 | 84,923 |
| サンゲツ | 53.2 | 37.3 | 60,799 |
| ミツウロコグループホールディングス | 28.8 | 20.3 | 27,567 |
| シナネンホールディングス | 8 | 5.1 | 15,631 |
| 伊藤忠エネクス | 43.1 | 30.5 | 33,367 |
| サンリオ | 54.8 | 38.8 | 68,055 |
| サンワテクノス | 13.8 | 9.1 | 11,675 |
| リョーサン | 21.5 | 15.2 | 34,625 |
| 新光商事 | 30.6 | 18.6 | 14,173 |
| トーホー | 8.8 | 6.2 | 10,831 |
| 三信電気 | 10.5 | 7.4 | 15,162 |
| 東陽テクニカ | 20.9 | 13.6 | 15,150 |
| モスフードサービス | 25.6 | 19.5 | 59,962 |
| 加賀電子 | 19.4 | 12.5 | 31,100 |
| ソーダニッカ | 20.1 | 13.1 | 7,768 |
| 立花エレクトック | 14.4 | 10.2 | 16,309 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フォーバル | 8.5 | 4.8 | 3,921 |
| P A L T A C | 31.3 | 22.1 | 121,108 |
| 三谷産業 | 25.6 | 18.1 | 7,547 |
| 太平洋興発 | 7.7 | 5.4 | 3,742 |
| 西本W i s m e t t a cホールディングス | 3.5 | 3.1 | 8,357 |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス | 1.7 | 1.2 | 2,653 |
| コア商事ホールディングス | — | 10.3 | 8,404 |
| 国際紙パルプ商事 | 46.2 | 29.4 | 7,261 |
| ヤマタネ | 9.8 | 5.9 | 8,785 |
| 丸紅建材リース | 1.9 | 1.3 | 2,431 |
| 日鉄物産 | 13.9 | 9.8 | 45,913 |
| 泉州電業 | 6 | 3.9 | 13,572 |
| トラスコ中山 | 40.6 | 31.6 | 95,274 |
| オートパックスセブン | 72.4 | 51.2 | 76,544 |
| モリト | 14.2 | 10.1 | 6,201 |
| 加藤産業 | 28.2 | 19.9 | 65,769 |
| 北恵 | 4.9 | 3.5 | 3,297 |
| イノテック | 10.1 | 7.8 | 10,467 |
| イエローハット | 36.8 | 26.1 | 50,555 |
| J Kホールディングス | 17.6 | 12.5 | 10,612 |
| 日伝 | 17.6 | 11.4 | 23,746 |
| 北沢産業 | 14.6 | 9.3 | 2,390 |
| 杉本商事 | 10.5 | 6.9 | 15,649 |
| 因幡電機産業 | 55.5 | 36.8 | 96,305 |
| 東テク | 6.5 | 4.6 | 13,731 |
| ミスミグループ本社 | 244.5 | 173.2 | 601,004 |
| アルテック | 15.5 | 10.1 | 3,282 |
| タキヒヨー | 5.9 | 4.6 | 8,551 |
| 蔵王産業 | 3.8 | 2.7 | 3,866 |
| スズケン | 82.6 | 58.5 | 238,972 |
| ジェコス | 13.4 | 9.5 | 8,721 |
| グローセル | 19.5 | 15 | 6,465 |
| 小売業 (4.59%) | | | |
| ローソン | 49.3 | 34.9 | 177,990 |
| サンエー | 16.2 | 10.4 | 44,824 |
| カワチ薬品 | 15.1 | 9.6 | 23,001 |
| エービーシー・マート | 30.5 | 21.6 | 129,384 |
| ハードオフコーポレーション | 7.7 | 6.1 | 4,849 |
| アスクル | 20.4 | 11.2 | 43,400 |
| ゲオホールディングス | 35.1 | 18.5 | 22,348 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アダストリア | 27 | 19.1 | 36,060 |
| ジーフット | 11.8 | 8.3 | 3,419 |
| シー・ヴィ・エス・バイエリア | 2.8 | 2 | 792 |
| くら寿司 | 10.2 | 16.2 | 63,180 |
| キャンドウ | 9.3 | 6.6 | 14,308 |
| アイケイ | — | 4 | 3,304 |
| パルグループホールディングス | 19.9 | 12.1 | 19,263 |
| エディオン | 89.5 | 58.5 | 69,498 |
| サーラコーポレーション | 39.6 | 28 | 17,304 |
| ワッツ | 8.6 | 6.7 | 6,043 |
| ハローズ | 7.3 | 5.5 | 16,555 |
| フジオフードグループ本社 | 16.4 | 11.6 | 16,785 |
| あみやき亭 | 4.2 | 3 | 8,592 |
| ひらまつ | 35.9 | 25.4 | 4,114 |
| 大黒天物産 | 4.7 | 4.4 | 38,236 |
| ハニーズホールディングス | 17.2 | 10.9 | 11,728 |
| ファーマライズホールディングス | 4.7 | 3.3 | 2,580 |
| アルベン | 14.9 | 10.6 | 26,584 |
| ハブ | 5.5 | 4.4 | 2,882 |
| クオールホールディングス | 28.7 | 18.6 | 25,370 |
| ジンズホールディングス | 10.3 | 9.4 | 73,320 |
| ビックカメラ | 115.7 | 81.9 | 93,775 |
| DCMホールディングス | 108.1 | 85.2 | 92,953 |
| Monotaro | 138.7 | 196.4 | 500,820 |
| 東京一番フーズ | 4.9 | 3.5 | 2,044 |
| DDホールディングス | 7.7 | 6.6 | 3,570 |
| きちりホールディングス | 5.2 | 3.7 | 2,131 |
| アークランドサービスホールディングス | 14.2 | 11.5 | 26,300 |
| J. フロント リテイリング | 233 | 164.9 | 173,145 |
| ドトール・日レスホールディングス | 31.1 | 21.8 | 35,948 |
| マツモトキヨシホールディングス | 80.6 | 57.1 | 254,380 |
| ブロンコビリー | 10.2 | 7.2 | 17,532 |
| ZOZO | 134.2 | 81.4 | 292,633 |
| トレジャー・ファクトリー | 5.7 | 4 | 4,640 |
| 物語コーポレーション | 5.2 | 7.4 | 49,210 |
| ココカラファイン | 20.4 | 12.3 | 92,865 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 341 | 241.6 | 189,414 |
| Hamee | 6.9 | 3.5 | 5,540 |
| マーケットエンタープライズ | — | 0.9 | 1,371 |
| ウエルシアホールディングス | 58 | 73 | 253,675 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| クリエイトSDホールディングス | 32.9 | 20.4 | 69,360 |
| 丸善CHIホールディングス | 22.8 | 16.1 | 6,327 |
| ミサワ | 3.9 | 2.8 | 1,926 |
| ティーライフ | 2.9 | 1.8 | 2,444 |
| エー・ビーホールディングス | 3.7 | 2.6 | 1,123 |
| チムニー | 5.9 | 4.2 | 5,271 |
| シュッピン | 13.3 | 9.4 | 10,546 |
| オイシックス・ラ・大地 | 17.4 | 18.2 | 55,510 |
| ネクステージ | 28 | 24.3 | 42,816 |
| ジョイフル本田 | 57.1 | 40.4 | 55,146 |
| 鳥貴族ホールディングス | 5.7 | 5.1 | 8,323 |
| キリン堂ホールディングス | 7.7 | — | — |
| ホットランド | 13 | 10.3 | 14,100 |
| すかいらくホールディングス | 218.6 | 154.7 | 254,017 |
| SFPホールディングス | 11.1 | 6.7 | 8,870 |
| 綿半ホールディングス | 7.3 | 10.3 | 13,441 |
| ヨシックス | 3.2 | 2.7 | 5,424 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 56.7 | 40.1 | 44,390 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 9 | 7.2 | 10,742 |
| BEENOS | 9 | 7 | 24,430 |
| あさひ | 14.5 | 10.3 | 15,347 |
| 日本調剤 | 11.8 | 8.4 | 14,868 |
| コスモス薬品 | 8.6 | 13.9 | 219,481 |
| トーエル | 9.4 | 6.7 | 5,641 |
| オンリー | 3.3 | 2.3 | 1,069 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 763.2 | 540.1 | 2,540,090 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 104.9 | 74.2 | 59,582 |
| ツルハホールディングス | 42.4 | 30.1 | 391,601 |
| サンマルクホールディングス | 15.4 | 10.9 | 18,530 |
| フェリシモ | 4.3 | 3.1 | 4,154 |
| トリドールホールディングス | 48.2 | 34.2 | 59,986 |
| TOKYO BASE | 17.6 | 12.4 | 9,126 |
| ウイルプラスホールディングス | 2.4 | 2.2 | 2,904 |
| JMホールディングス | 14.8 | 9.3 | 19,929 |
| サツドラホールディングス | 2.9 | 2.1 | 4,798 |
| アレンザホールディングス | 9.7 | 10.5 | 12,915 |
| 串カツ田中ホールディングス | 4 | 3.7 | 6,334 |
| パロックジャパンリミテッド | 13.5 | 9.6 | 7,372 |
| クスリのアオキホールディングス | 17.5 | 13.7 | 109,463 |
| 力の源ホールディングス | 8.8 | 6.3 | 3,868 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| FOOD & LIFE COMPANIE | 107.1 | 80.8 | 381,780 |
| L I X I Lビバ | 19.3 | — | — |
| メディカルシステムネットワーク | 18.8 | 12 | 8,580 |
| はるやまホールディングス | 9.1 | 6.5 | 4,348 |
| ノジマ | 34.7 | 24.6 | 80,319 |
| カッパ・クリエイト | 27.4 | 19.4 | 29,003 |
| ライトオン | 14.6 | 10.3 | 7,261 |
| ジーンズメイト | 5.9 | — | — |
| 良品計画 | 259 | 158.9 | 371,190 |
| 三城ホールディングス | 20.7 | 17.1 | 4,839 |
| アドヴァン | 29.8 | 14.1 | 13,747 |
| アルビス | 7.4 | 4.4 | 10,278 |
| コナカ | 23 | 16.3 | 5,558 |
| ハウス オブ ローゼ | 2.4 | 1.7 | 2,825 |
| G-7ホールディングス | 11.5 | 6.7 | 19,249 |
| イオン北海道 | 25.7 | 18.2 | 20,566 |
| コジマ | 33.5 | 23.7 | 21,021 |
| ヒマラヤ | 6.8 | 4.8 | 4,756 |
| コーナン商事 | 27.7 | 19.6 | 60,172 |
| エコス | 7.2 | 5.1 | 9,577 |
| ワタミ | 23.1 | 18.1 | 17,810 |
| マルシェ | 5.1 | 3.6 | 1,731 |
| バン・パシフィック・インターナショナルホ | 428.8 | 276 | 651,636 |
| 西松屋チェーン | 42.8 | 30.3 | 52,509 |
| ゼンショーホールディングス | 93.5 | 74.1 | 209,184 |
| 幸楽苑ホールディングス | 12.4 | 8.8 | 14,396 |
| ハークスレイ | 4.1 | 2.9 | 2,650 |
| サイゼリヤ | 28.9 | 20.5 | 50,450 |
| V Tホールディングス | 80.8 | 52 | 22,308 |
| 魚力 | 5.4 | 4.3 | 8,178 |
| ポプラ | 5.1 | 3.6 | 1,116 |
| フジ・コーポレーション | 5.2 | 7.3 | 9,606 |
| ユナイテッドアローズ | 20.4 | 15.8 | 31,837 |
| ハイデイ日高 | 28.2 | 19.9 | 34,546 |
| 京都きもの友禅 | 12.4 | 8.8 | 2,349 |
| コロワイド | 64.8 | 45.9 | 85,465 |
| ピーシーデポコーポレーション | 25.9 | 16 | 7,440 |
| 壺番屋 | 13.7 | 9.7 | 47,530 |
| トップカルチャー | 7 | 5 | 1,745 |
| P L A N T | 5 | 3.5 | 2,569 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| スギホールディングス | 38.9 | 27.6 | 238,188 |
| 葉王堂ホールディングス | 8.5 | 6 | 14,436 |
| ヴィア・ホールディングス | 23.9 | — | — |
| スクロール | 30 | 19.7 | 17,572 |
| ヨンドシーホールディングス | 19.8 | 12.7 | 24,028 |
| ファミリーマート | 155.9 | — | — |
| 木曽路 | 25.5 | 18 | 41,040 |
| S R Sホールディングス | 23 | 17.7 | 14,691 |
| 千趣会 | 35.2 | 24.9 | 10,009 |
| タカキュー | 15 | 10.7 | 1,455 |
| リテールパートナーズ | 25.8 | 16.7 | 20,173 |
| ケーヨー | 40.1 | 25.5 | 18,436 |
| 上新電機 | 22.9 | 15.8 | 44,666 |
| 日本瓦斯 | 30.8 | 68.2 | 128,829 |
| ロイヤルホールディングス | 34.1 | 24.1 | 47,163 |
| 東天紅 | 1.4 | 1 | 1,004 |
| いなげや | 24.2 | 15.4 | 24,162 |
| 島忠 | 36.7 | — | — |
| チヨダ | 20.5 | 14.5 | 12,948 |
| ライフコーポレーション | 14.8 | 14 | 49,490 |
| リンガーハット | 24 | 17 | 38,539 |
| M r M a x H D | 26.8 | 19 | 12,293 |
| テンアライド | 18 | 12.7 | 4,191 |
| A O K Iホールディングス | 39 | 27.6 | 17,636 |
| オークワ | 30.6 | 21.7 | 25,410 |
| コメリ | 30.1 | 21.3 | 61,088 |
| 青山商事 | 40.3 | 30.7 | 26,494 |
| しまむら | 22.7 | 16.1 | 176,939 |
| はせがわ | 10.3 | 7.3 | 2,131 |
| 高島屋 | 142.1 | 100.6 | 123,738 |
| 松屋 | 39.3 | 30.2 | 28,539 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 92.4 | 65.4 | 56,505 |
| 近鉄百貨店 | 7.5 | 5.3 | 16,668 |
| 丸井グループ | 178.8 | 116.8 | 244,929 |
| アクシアル リテイリング | 16.2 | 11.5 | 48,817 |
| 井筒屋 | 10.6 | 7 | 1,778 |
| イオン | 750.7 | 531.3 | 1,640,654 |
| イズミ | 39.7 | 28.1 | 122,937 |
| 平和堂 | 39.6 | 25.5 | 58,395 |
| フジ | 23.5 | 16.7 | 35,571 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ヤオコー | 22.1 | 15.7 | 109,586 |
| ゼビオホールディングス | 23.6 | 16.7 | 15,297 |
| ケーズホールディングス | 188.2 | 117.5 | 172,255 |
| Olympicグループ | 10.1 | 7.1 | 5,552 |
| 日産東京販売ホールディングス | 28.7 | 20.3 | 5,014 |
| シルバーライフ | 2.6 | 2.8 | 7,165 |
| 一家ダイニングプロジェクト | 2 | 2.8 | 1,573 |
| Genky DrugStores | 8.6 | 6.1 | 20,831 |
| ナルミヤ・インターナショナル | 4.4 | 2.6 | 3,192 |
| ブックオフグループホールディングス | 11.4 | 8 | 8,048 |
| ギフト | — | 1.7 | 3,651 |
| アインホールディングス | 24 | 20 | 127,000 |
| 元気寿司 | 4.9 | 3.9 | 9,562 |
| ヤマダホールディングス | 594.4 | 462.8 | 260,093 |
| アークランドサカモト | 30.5 | 21.6 | 33,415 |
| ニトリホールディングス | 84.5 | 54.8 | 1,080,108 |
| グルメ杵屋 | 13.9 | 9.8 | 9,408 |
| 愛眼 | 15.6 | 11 | 2,497 |
| ケーユーホールディングス | 10.2 | 7.2 | 7,120 |
| 吉野家ホールディングス | 64.1 | 45.4 | 93,978 |
| 松屋フーズホールディングス | 9.4 | 6.6 | 23,265 |
| サガミホールディングス | 26.1 | 19.3 | 20,052 |
| 関西スーパーマーケット | 16.2 | 10.4 | 10,784 |
| 王将フードサービス | 14.3 | 9.1 | 51,779 |
| ブレナス | 21.8 | 15.5 | 31,697 |
| ミニストップ | 14.5 | 10.2 | 14,881 |
| アークス | 39.9 | 26.3 | 63,935 |
| パローホールディングス | 43.2 | 28.2 | 66,241 |
| 藤久 | 2.1 | 3.2 | 2,531 |
| ベルク | 9.6 | 6.8 | 40,256 |
| 大庄 | 10.4 | 7.4 | 7,429 |
| ファーストリテイリング | 26.1 | 18.5 | 1,621,710 |
| サンドラッグ | 73.4 | 51.9 | 201,372 |
| サックスパー ホールディングス | 16.5 | 11.7 | 7,464 |
| ヤマザワ | 4.5 | 3.2 | 5,446 |
| やまや | 4 | 2.8 | 6,512 |
| ベルーナ | 41.9 | 29.6 | 35,549 |
| 銀行業 (5.1%) | | | |
| 島根銀行 | 5.1 | 4.8 | 3,475 |
| じもとホールディングス | 132 | 9.3 | 6,630 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|----------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 1,015.1 | 718.4 | 178,881 |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 26.4 | 17.3 | 21,694 |
| 九州フィナンシャルグループ | 427.5 | 282.4 | 124,820 |
| ゆうちょ銀行 | 553.5 | 391.7 | 408,151 |
| 富山第一銀行 | 46.6 | 33 | 9,603 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 1,115.8 | 842.4 | 368,128 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 130 | 90.3 | 66,189 |
| 関西みらいフィナンシャルグループ | 114.7 | — | — |
| 三十三フィナンシャルグループ | 18.1 | 12 | 16,332 |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 33.9 | 22.5 | 54,427 |
| ひろぎんホールディングス | — | 203.9 | 126,418 |
| 新生銀行 | 143.4 | 112.7 | 182,912 |
| あおぞら銀行 | 116.4 | 82.4 | 200,808 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 13,364.3 | 9,458.4 | 5,749,761 |
| りそなホールディングス | 2,143.9 | 1,595.6 | 747,059 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 369.3 | 261.3 | 1,007,834 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 1,351.2 | 956.9 | 3,798,893 |
| 千葉銀行 | 652 | 461.4 | 330,362 |
| 群馬銀行 | 375.3 | 284.6 | 107,578 |
| 武蔵野銀行 | 29.1 | 20.6 | 34,669 |
| 千葉興業銀行 | 53.6 | 35.2 | 9,820 |
| 筑波銀行 | 81.2 | 57.5 | 10,177 |
| 七十七銀行 | 66 | 43.4 | 62,322 |
| 青森銀行 | 15.1 | 10.7 | 25,102 |
| 秋田銀行 | 12.5 | 8.3 | 11,653 |
| 山形銀行 | 22 | 15.5 | 16,414 |
| 岩手銀行 | 12.8 | 9.1 | 19,665 |
| 東邦銀行 | 174.7 | 123.6 | 27,562 |
| 東北銀行 | 9.4 | 6.6 | 7,022 |
| みちのく銀行 | 12.5 | 8.9 | 9,122 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 164.6 | 124.8 | 246,105 |
| 静岡銀行 | 483.8 | 336.7 | 291,918 |
| 十六銀行 | 24.5 | 17.3 | 36,208 |
| スルガ銀行 | 199.9 | 121.2 | 50,298 |
| 八十二銀行 | 471.5 | 311.4 | 124,560 |
| 山梨中央銀行 | 22.7 | 16.1 | 13,797 |
| 大垣共立銀行 | 38.6 | 27.3 | 55,883 |
| 福井銀行 | 16.7 | 11.8 | 20,886 |
| 北國銀行 | 20.1 | 12.8 | 31,782 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------|----------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 清水銀行 | 8.1 | 5.7 | 9,336 |
| 富山銀行 | 3.8 | 2.7 | 7,535 |
| 滋賀銀行 | 39.2 | 27.7 | 60,801 |
| 南都銀行 | 32.5 | 20.1 | 37,788 |
| 百五銀行 | 175.8 | 124.4 | 41,052 |
| 京都銀行 | 70 | 49.5 | 297,000 |
| 紀陽銀行 | 69.2 | 49 | 73,500 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 130 | 92 | 90,252 |
| 広島銀行 | 288.4 | — | — |
| 山陰合同銀行 | 115.8 | 87.1 | 45,553 |
| 中国銀行 | 168.1 | 119 | 108,290 |
| 鳥取銀行 | 6.7 | 4.4 | 5,046 |
| 伊予銀行 | 278.8 | 183.2 | 116,332 |
| 百十四銀行 | 20.8 | 14.7 | 23,079 |
| 四国銀行 | 29.7 | 19.6 | 14,406 |
| 阿波銀行 | 31.9 | 21.2 | 48,950 |
| 大分銀行 | 11.2 | 8 | 15,520 |
| 宮崎銀行 | 13 | 8.6 | 19,823 |
| 佐賀銀行 | 11.9 | 7.8 | 10,873 |
| 沖縄銀行 | 17.9 | 12.7 | 35,013 |
| 琉球銀行 | 45.1 | 30 | 22,020 |
| セブン銀行 | 652.6 | 462 | 108,108 |
| みずほフィナンシャルグループ | 26,547.1 | 1,878.8 | 3,048,353 |
| 高知銀行 | 7.1 | 5 | 4,145 |
| 山口フィナンシャルグループ | 243.9 | 172.6 | 116,332 |
| 長野銀行 | 6.4 | 4.5 | 5,395 |
| 名古屋銀行 | 14.6 | 11.1 | 31,202 |
| 北洋銀行 | 294.5 | 208.4 | 61,478 |
| 愛知銀行 | 7.1 | 4.6 | 13,468 |
| 中京銀行 | 8 | 5 | 8,630 |
| 大光銀行 | 6.7 | 4.7 | 6,960 |
| 愛媛銀行 | 27.3 | 19.3 | 18,064 |
| トマト銀行 | 7.5 | 5.3 | 5,602 |
| 京葉銀行 | 83.3 | 59 | 25,665 |
| 栃木銀行 | 94.4 | 66.8 | 12,224 |
| 北日本銀行 | 6.1 | 4.3 | 7,920 |
| 東和銀行 | 34.3 | 24.3 | 15,381 |
| 福島銀行 | 18.4 | 15.8 | 3,728 |
| 大東銀行 | 10.2 | 6.6 | 4,210 |
| トモニホールディングス | 151 | 106.9 | 33,032 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フィデアホールディングス | 189.7 | 134.2 | 17,580 |
| 池田泉州ホールディングス | 224.7 | 159 | 28,302 |
| 証券、商品先物取引業 (0.8%) | | | |
| F P G | 60.3 | 46.5 | 34,503 |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | — | 9.3 | 15,670 |
| マーキュリアインベストメント | 8.7 | 5.4 | 4,363 |
| S B Iホールディングス | 218.2 | 170.4 | 516,312 |
| 日本アジア投資 | 16.5 | 11.7 | 2,960 |
| ジャフコ グループ | 30 | 21.3 | 166,992 |
| 大和証券グループ本社 | 1,567.6 | 1,035.5 | 647,291 |
| 野村ホールディングス | 3,437.6 | 2,111.1 | 1,225,493 |
| 岡三証券グループ | 166.5 | 117.8 | 56,426 |
| 丸三証券 | 58 | 41.1 | 27,454 |
| 東洋証券 | 69.8 | 45.6 | 8,025 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 224.4 | 147.4 | 63,087 |
| 光世証券 | 4.7 | 3.3 | 2,349 |
| 水戸証券 | 56.5 | 36.9 | 11,512 |
| いちよし証券 | 36.5 | 27.7 | 17,534 |
| 松井証券 | 111.6 | 67.7 | 59,034 |
| だいこう証券ビジネス | 9.5 | — | — |
| マネックスグループ | 143.4 | 124 | 113,832 |
| 極東証券 | 26.2 | 18.5 | 15,762 |
| 岩井コスモホールディングス | 18.5 | 14.2 | 25,290 |
| 藍澤證券 | 35.1 | 24.8 | 25,891 |
| マネーパートナーズグループ | 20.8 | 14.7 | 3,777 |
| スパークス・グループ | 90.2 | 63.9 | 18,850 |
| 小林洋行 | 5.6 | 4 | 1,124 |
| 保険業 (1.9%) | | | |
| かんぽ生命保険 | 69.2 | 171.4 | 377,937 |
| S O M P Oホールディングス | 367.3 | 243.7 | 1,036,943 |
| アニコム ホールディングス | 16.2 | 38.9 | 40,728 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 510.8 | 335.8 | 1,106,796 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 160.5 | — | — |
| 第一生命ホールディングス | 1,105.5 | 730.5 | 1,502,273 |
| 東京海上ホールディングス | 690.7 | 455.4 | 2,491,948 |
| T & Dホールディングス | 583.9 | 413.3 | 577,380 |
| アドバンスクリエイト | 4.1 | 6.5 | 6,805 |
| その他金融業 (1.1%) | | | |
| 全国保証 | 55.1 | 36 | 177,660 |
| ジェイリース | 5.4 | 4.6 | 3,785 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| イントラスト | 6.9 | 3.9 | 2,574 |
| 日本モーゲージサービス | 4 | 7 | 7,154 |
| C a s a | 6.8 | 3.9 | 3,619 |
| アルヒ | 31.1 | 20.4 | 37,270 |
| プレミアグループ | 10.6 | 6.4 | 15,430 |
| クレディセゾン | 136.9 | 80.7 | 104,748 |
| 芙蓉総合リース | 20.5 | 14.5 | 109,330 |
| みずほリース | 30.1 | 21.3 | 71,568 |
| 東京センチュリー | 39.3 | 32.1 | 215,391 |
| 日本証券金融 | 86.1 | 58.5 | 48,145 |
| アイフル | 298 | 232 | 75,168 |
| リコーリース | 15.4 | 10.9 | 38,095 |
| イオンフィナンシャルサービス | 119.6 | 84.6 | 107,526 |
| アコム | 392.7 | 277.9 | 131,168 |
| ジャックス | 21.6 | 15.3 | 33,552 |
| オリエントコーポレーション | 528.4 | 374 | 55,352 |
| 日立キャピタル | 46.1 | — | — |
| アブラスフィナンシャル | 93.7 | — | — |
| オリックス | 1,221.9 | 839.4 | 1,528,547 |
| 三菱HCキャピタル | 495.8 | 478.2 | 306,526 |
| 九州リースサービス | 9.6 | 6.8 | 4,617 |
| 日本取引所グループ | 560.7 | 373.5 | 988,841 |
| イー・ギャランティ | 20.9 | 15.9 | 33,708 |
| アサックス | 10.1 | 7.2 | 5,004 |
| NECキャピタルソリューション | 7.9 | 5.6 | 11,597 |
| 不動産業 (2.0%) | | | |
| いちご | 248.6 | 154 | 53,746 |
| 日本駐車場開発 | 192.8 | 151.6 | 24,104 |
| スター・マイカ・ホールディングス | 10.1 | 7.1 | 7,881 |
| SREホールディングス | — | 2 | 10,020 |
| ADワークスグループ | 36.2 | 27.4 | 4,466 |
| ビューリック | 417.2 | 293.3 | 371,611 |
| 三栄建築設計 | 7.8 | 5.5 | 10,917 |
| 野村不動産ホールディングス | 118.6 | 84 | 236,712 |
| 三重交通グループホールディングス | 39.6 | 28 | 13,776 |
| サムティ | 27.7 | 19.6 | 40,278 |
| ディア・ライフ | 27.6 | 17.8 | 8,579 |
| コーセーアールイー | 5.7 | 4.1 | 2,546 |
| 日本商業開発 | 12.4 | 8.8 | 15,338 |
| プレサンスコーポレーション | 32.1 | 22.7 | 38,680 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ユニゾホールディングス | 6.3 | — | — |
| THEグローバル社 | 9.2 | — | — |
| ハウスコム | 3.4 | 2.4 | 2,990 |
| 日本管理センター | 12.9 | 7.5 | 9,645 |
| サンセイランディック | 5.7 | 4.1 | 3,480 |
| エストラスト | 2.7 | 1.6 | 1,086 |
| フージャースホールディングス | 38.9 | 22.5 | 15,547 |
| オープンハウス | 56.8 | 43.9 | 199,306 |
| 東急不動産ホールディングス | 531.2 | 376 | 241,768 |
| 飯田グループホールディングス | 163 | 115.3 | 320,534 |
| イーグランド | 3.1 | 2.2 | 2,072 |
| ムゲンエステート | 13.5 | 8.5 | 4,267 |
| ビーロット | 9.1 | 6.5 | 4,348 |
| ファーストブラザーズ | 4.4 | 2.5 | 2,505 |
| ハウスドゥ | 9.6 | 6.8 | 7,262 |
| シーアールイー | 4.8 | 3.6 | 5,310 |
| プロパティエージェント | 3.1 | 2.2 | 5,486 |
| ケイアイスター不動産 | 6.1 | 4.3 | 16,254 |
| アグレ都市デザイン | 3.2 | 2.5 | 2,522 |
| グッドコムアセット | 4.7 | 6.6 | 9,702 |
| ジェイ・エス・ビー | 4.2 | 2.6 | 8,983 |
| テンボイノベーション | 4.4 | 3.9 | 3,455 |
| グローバル・リンク・マネジメント | 3.3 | 2.4 | 2,196 |
| フェイスネットワーク | — | 1.1 | 1,442 |
| パーク24 | 104.9 | 74.2 | 165,466 |
| バラカ | 5 | 3.6 | 6,120 |
| 三井不動産 | 963.6 | 630.2 | 1,584,953 |
| 三菱地所 | 1,368.9 | 908.4 | 1,700,979 |
| 平和不動産 | 35.8 | 23.7 | 92,667 |
| 東京建物 | 205.8 | 136.6 | 235,908 |
| ダイビル | 50.3 | 35.1 | 44,857 |
| 京阪神ビルディング | 31.7 | 23.8 | 36,176 |
| 住友不動産 | 439.2 | 310.8 | 1,216,160 |
| テーオーシー | 38.3 | 27.1 | 20,081 |
| 東京楽天地 | 3.2 | 2.3 | 9,763 |
| レオパレス21 | 256 | 114.7 | 17,549 |
| スターツコーポレーション | 26.6 | 16.5 | 45,474 |
| フジ住宅 | 22.7 | 16 | 10,656 |
| 空港施設 | 19.5 | 13.8 | 8,763 |
| 明和地所 | 10.7 | 6.5 | 4,342 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ゴールドクレスト | 15.4 | 12.5 | 20,375 |
| エスリード | 7.6 | 5.4 | 9,061 |
| 日神グループホールディングス | 28.9 | 20.4 | 10,220 |
| 日本エスコン | 35.3 | 25.1 | 19,050 |
| タカラレーベン | 89.3 | 57.9 | 21,365 |
| AVANTIA | 11 | 7.1 | 6,439 |
| イオンモール | 97.9 | 69.3 | 121,760 |
| 毎日コムネット | 5 | 4.7 | 3,642 |
| ファースト住建 | 8.3 | 5.9 | 7,339 |
| カチタス | 48.4 | 34.2 | 114,228 |
| トーセイ | 26.9 | 19.1 | 21,449 |
| 穴吹興産 | 4.3 | 3 | 6,381 |
| サンフロンティア不動産 | 27 | 17 | 17,408 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 17 | 13.6 | 14,320 |
| インテリックス | 5.5 | 3.1 | 2,672 |
| ランドビジネス | 6.6 | 5.8 | 2,331 |
| サンネクスタグループ | 6 | 4.4 | 4,360 |
| グランディハウス | 15.2 | 9.4 | 4,371 |
| 日本空港ビルデング | 62.3 | 48 | 233,760 |
| サービス業 (5.5%) | | | |
| 明豊ファシリティワークス | — | 6.1 | 4,812 |
| 日本工営 | 12.7 | 8.3 | 25,688 |
| L I F U L L | 66 | 40.9 | 16,728 |
| ミクシィ | — | 34 | 92,004 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 12.7 | 9.2 | 16,486 |
| 日本M&Aセンター | 143 | 219.7 | 608,788 |
| メンバーズ | 5.6 | 4 | 11,904 |
| 中広 | 2.6 | 1.8 | 628 |
| UTグループ | 29.8 | 19.3 | 71,796 |
| アイティメディア | 7.6 | 4.5 | 8,968 |
| タケエイ | 18.1 | 14.9 | 19,131 |
| E・Jホールディングス | 3.3 | 7 | 7,945 |
| 夢真ビーネックスグループ | 23.7 | 35.5 | 50,694 |
| コシダカホールディングス | 45.6 | 35.8 | 20,298 |
| アルトナー | 4.6 | 3.2 | 2,601 |
| バスナグループ | 20.5 | 14.5 | 28,144 |
| CDS | 4.7 | 3.3 | 5,174 |
| リンクアンドモチベーション | 41.7 | 24.6 | 16,974 |
| GCA | 22.9 | 17.5 | 14,875 |
| エス・エム・エス | 58.9 | 45.5 | 139,230 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サニーサイドアップグループ | 6.5 | 4.6 | 3,477 |
| パーソルホールディングス | 189.2 | 133.9 | 283,600 |
| リニカル | 9.1 | 7.5 | 5,557 |
| クックパッド | 66.1 | 42.1 | 11,872 |
| エスクリ | 5.9 | 4.2 | 1,768 |
| アイ・ケイ・ケイ | 9.2 | 6.5 | 4,355 |
| 学情 | 6.7 | 4.7 | 6,462 |
| スタジオアリス | 9.5 | 6.7 | 16,080 |
| シミックホールディングス | 9.3 | 7.4 | 11,669 |
| エブコ | 4 | 3.2 | 3,139 |
| N J S | 4.2 | 3.3 | 6,642 |
| 総合警備保障 | 75.3 | 53.3 | 259,837 |
| カカコム | 139.8 | 99 | 285,318 |
| セントケア・ホールディング | 12.2 | 9.8 | 11,701 |
| サイネックス | 3.2 | 2.3 | 1,531 |
| ルネサンス | 10.5 | 8.4 | 9,752 |
| ディップ | 26.7 | 20.9 | 67,507 |
| デジタルホールディングス | 10.3 | 9.3 | 17,958 |
| 新日本科学 | 20.5 | 16.3 | 11,947 |
| ツクイホールディングス | 44.6 | 6.3 | 5,802 |
| キャリアデザインセンター | 4.3 | 3.4 | 3,634 |
| ベネフィット・ワン | 68.9 | 48.7 | 133,535 |
| エムスリー | 417.4 | 236.3 | 1,763,270 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 12 | 10.7 | 3,712 |
| プラス | 2.5 | 1.7 | 887 |
| アウトソーシング | 108.3 | 76.7 | 146,036 |
| ウエルネット | 19.1 | 13.5 | 7,033 |
| ワールドホールディングス | 6.4 | 4.6 | 12,792 |
| ディー・エヌ・エー | 92.7 | 56.7 | 119,070 |
| 博報堂DYホールディングス | 263.3 | 186.4 | 342,603 |
| ぐるなび | 32.9 | 23.3 | 13,793 |
| タカミヤ | 20.1 | 16.2 | 8,488 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 14.9 | 9.1 | 6,643 |
| ファンコムコミュニケーションズ | 52 | 36.8 | 14,646 |
| ライク | 6.2 | 3.5 | 8,102 |
| ビジネス・ブレイクスルー | 7.9 | 5.6 | 2,514 |
| エスプール | 48.6 | 34.4 | 32,955 |
| WDBホールディングス | 8.6 | 6.1 | 14,377 |
| 手間いらず | 1.2 | 1.7 | 9,469 |
| ティア | 11 | 7.8 | 3,829 |

国内株式マザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| CDG | 2 | 1.2 | 1,912 |
| アドウェイズ | — | 21.8 | 18,769 |
| バリューコマース | 10.6 | 9 | 30,150 |
| インフォマート | 207.4 | 135.5 | 121,950 |
| J Pホールディングス | 59.4 | 38.2 | 12,109 |
| E P Sホールディングス | 25.6 | 20.2 | 28,280 |
| レッグス | 4.7 | 3.3 | 8,210 |
| プレステージ・インターナショナル | 70.9 | 50.2 | 37,348 |
| アミューズ | 10.3 | 7.3 | 17,235 |
| ドリームインキュベータ | 5.7 | 4.1 | 4,157 |
| クイック | 11.7 | 8.3 | 10,341 |
| T A C | 11.4 | 7.2 | 1,764 |
| ケネディクス | 176.3 | — | — |
| 電通グループ | 195.1 | 150.6 | 532,371 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 7.2 | 6.3 | 5,317 |
| びあ | 5.4 | 3.8 | 10,795 |
| イオンファンタジー | 7.3 | 5.2 | 10,535 |
| シーティーエス | 21.4 | 15.1 | 13,408 |
| ネクシィーズグループ | 5.8 | 4.7 | 4,681 |
| H. U. グループホールディングス | 52.9 | 37.5 | 137,062 |
| アルプス技研 | 16.7 | 11.8 | 24,095 |
| ダイオーズ | 3.7 | 2.6 | 2,574 |
| 日本空調サービス | 19.8 | 14 | 10,402 |
| オリエンタルランド | 201.3 | 142.5 | 2,175,262 |
| ダスキン | 47 | 31.1 | 82,539 |
| 明光ネットワークジャパン | 23.9 | 15.7 | 9,247 |
| ファルコホールディングス | 10.4 | 6.4 | 10,867 |
| 秀英予備校 | 4.1 | 2.9 | 1,186 |
| 田谷 | 3.5 | — | — |
| ラウンドワン | 52.8 | 45.7 | 56,622 |
| リゾートトラスト | 86.8 | 61.4 | 104,257 |
| ビー・エム・エル | 24.4 | 17.2 | 65,962 |
| ワタベウェディング | 3 | — | — |
| りらいあコミュニケーションズ | 34.2 | 20.4 | 27,213 |
| リゾー教育 | 86.5 | 68 | 19,856 |
| 早稲田アカデミー | 8.2 | 5.7 | 5,278 |
| ユー・エス・エス | 211.9 | 150 | 300,150 |
| 東京個別指導学院 | 6.7 | 11.8 | 6,985 |
| サイバーエージェント | 116.6 | 330.2 | 723,138 |
| 楽天グループ | 882.2 | 624.9 | 833,616 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 9.7 | 7 | 11,067 |
| モーニングスター | — | 19.5 | 8,989 |
| テー・オー・ダブリュー | 30.1 | 23.4 | 7,628 |
| 山田コンサルティンググループ | 12.2 | 7.8 | 9,656 |
| セントラルスポーツ | 7.1 | 5 | 12,150 |
| フルキャストホールディングス | 18.9 | 11.4 | 22,560 |
| エン・ジャパン | 33.6 | 23.8 | 81,872 |
| リソルホールディングス | 2.1 | 1.5 | 6,000 |
| テクノプロ・ホールディングス | 37.8 | 26.7 | 226,149 |
| アトラグループ | 4.3 | 3.1 | 1,038 |
| インターワークス | 3.6 | 3.8 | 1,482 |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 7.7 | 5.4 | 70,902 |
| Ke e P e r 技研 | 7 | 8.6 | 19,848 |
| ファーストロジック | 3.6 | 2.6 | 2,015 |
| 三機サービス | 3.6 | 2.6 | 2,797 |
| G u n o s y | 11.7 | 8.3 | 8,482 |
| デザインワン・ジャパン | 5.6 | 3.3 | 841 |
| イー・ガーディアン | 8.3 | 5.4 | 15,044 |
| リブセンス | 12.1 | 7.4 | 1,709 |
| ジャパンマテリアル | 58.2 | 41.2 | 52,530 |
| ベクトル | 23.6 | 16.7 | 15,998 |
| ウチヤマホールディングス | 9.3 | 6.6 | 2,494 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 16.1 | 10 | 12,630 |
| ライクキッズ | 3.2 | — | — |
| キャリアリンク | 6.2 | 4.4 | 9,838 |
| I B J | 12.9 | 11 | 10,032 |
| アサンテ | 7.6 | 4.8 | 8,750 |
| N・フィールド | 13 | 1.7 | 2,034 |
| バリューHR | 7.5 | 5.3 | 8,798 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 15.4 | 11 | 51,590 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 7.2 | 5.2 | 8,819 |
| ER Iホールディングス | 5.3 | 3.7 | 2,175 |
| アピスト | 2.9 | 2.1 | 6,426 |
| シグマクシス | 13 | 7.3 | 15,614 |
| ウィルグループ | 12.4 | 9.8 | 9,976 |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | 26.1 | 19.9 | 5,034 |
| メドピア | — | 10.3 | 59,019 |
| レアジョブ | — | 2.5 | 5,112 |
| リクルートホールディングス | 1,355.9 | 959.6 | 5,044,617 |
| エラン | 11.2 | 18.5 | 25,382 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 土木管理総合試験所 | 8.2 | 6.5 | 2,639 |
| ネットマーケティング | 7.3 | 6.4 | 3,782 |
| 日本郵政 | 1,551.4 | 1,013.5 | 962,216 |
| ベルシステム24ホールディングス | 31.7 | 22.4 | 37,945 |
| 鎌倉新書 | 14.2 | 13.5 | 18,427 |
| SMN | 4 | 2.9 | 2,334 |
| 一蔵 | 2 | 1.7 | 681 |
| LITALICO | 6.5 | — | — |
| グローバルキッズCOMPANY | 3.4 | 2.4 | 2,431 |
| エアトリ | 9.9 | 8.4 | 18,866 |
| アトラエ | 5.7 | 9.3 | 15,614 |
| ストライク | 7.1 | 5.1 | 21,828 |
| ソラスト | 52.2 | 32.9 | 46,389 |
| セラク | 5.9 | 4.2 | 9,706 |
| インソース | 7.9 | 13 | 31,928 |
| ペイカレント・コンサルティング | 11.5 | 8.8 | 299,200 |
| Orchestra Holdings | 3.9 | 3 | 8,361 |
| アイモバイル | 6.7 | 3.8 | 5,198 |
| キャリアインデックス | 7.7 | 5.5 | 3,311 |
| MS-Japan | 6.1 | 5.4 | 5,610 |
| 船場 | 3.1 | 2.7 | 2,305 |
| グレイステクノロジー | 8.7 | 13.6 | 34,720 |
| ジャパンエレベーターサービホールディン | 19.9 | 38.6 | 86,541 |
| フルテック | 2.6 | 1.9 | 2,800 |
| グリーンズ | 4.8 | 5 | 2,960 |
| ツナググループ・ホールディングス | 3.2 | 2.9 | 887 |
| GameWith | 5.6 | 4 | 2,660 |
| ソウルドアウト | 3.9 | 3.2 | 5,078 |
| MS&Consulting | 3.5 | 2.1 | 1,274 |
| ウェルビー | — | 4.9 | 7,261 |
| エル・ティール・エス | — | 1.3 | 5,778 |
| ミダック | 2.5 | 2.9 | 15,747 |
| 日総工産 | 12.6 | 10.5 | 8,148 |
| キュービーネットホールディングス | 7.8 | 6.1 | 10,815 |
| RPAホールディングス | 14.4 | 15.4 | 11,781 |
| スプリックス | 5.3 | 3.8 | 4,054 |
| マネジメントソリューションズ | 8.2 | 6.5 | 12,844 |
| ブロード・パートナーズ | 2.5 | 2.4 | 7,113 |
| and factory | 1.8 | 3 | 2,109 |
| テノ・ホールディングス | — | 1.4 | 1,582 |
| フロンティア・マネジメント | — | 3 | 4,977 |
| ピアラ | — | 0.9 | 1,423 |
| コプロ・ホールディングス | — | 1.7 | 2,254 |
| ギークス | 1.9 | 2.3 | 3,930 |
| カーブスホールディングス | 51.9 | 36.8 | 30,212 |
| フォーラムエンジニアリング | 9.8 | 9.3 | 9,699 |
| ダイレクトマーケティングミックス | — | 7 | 24,395 |
| ポピンスホールディングス | — | 3.5 | 16,100 |
| LITALICO | — | 5.4 | 24,948 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|------------------|---------|---------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 9.5 | 6.8 | 4,964 |
| リログループ | 103.5 | 73.2 | 167,701 |
| 東祥 | 11.8 | 8.3 | 13,935 |
| エイチ・アイ・エス | 29.5 | 20.6 | 47,153 |
| ラックランド | 4.4 | 3.8 | 9,492 |
| 共立メンテナンス | 31.4 | 22.2 | 78,477 |
| イチネンホールディングス | 21.2 | 13.9 | 18,056 |
| 建設技術研究所 | 13.1 | 8.6 | 22,041 |
| スペース | 12.3 | 8.7 | 7,856 |
| 長大 | 7.5 | 5.3 | 9,402 |
| 燦ホールディングス | 8.2 | 5.8 | 6,177 |
| スバル興業 | 1.1 | 0.8 | 6,536 |
| 東京テアトル | 7.4 | 5.2 | 6,531 |
| タナベ経営 | 3.6 | 2.6 | 3,629 |
| ナガワ | 6 | 4.3 | 35,475 |
| よみうりランド | 4.1 | — | — |
| 東京都競馬 | 12.4 | 8.8 | 47,696 |
| 常磐興産 | 7.6 | 5.4 | 7,695 |
| カナモト | 31 | 23.6 | 65,490 |
| 東京ドーム | 76.6 | — | — |
| 西尾レントオール | 17.5 | 12.4 | 39,866 |
| トランス・コスモス | 18 | 12.7 | 39,560 |
| 乃村工藝社 | 81.1 | 57.4 | 47,699 |
| 藤田観光 | 8.3 | 5.3 | 10,266 |
| KNT-CTホールディングス | 11.8 | 7.1 | 7,625 |
| 日本管財 | 20.3 | 14.3 | 32,103 |
| トーカイ | 18.3 | 12.9 | 31,759 |
| 白洋舎 | 2.2 | 1.5 | 3,501 |
| セコム | 200.9 | 132 | 1,229,844 |
| セントラル警備保障 | 9.1 | 6.4 | 19,136 |
| 丹青社 | 35.7 | 25.3 | 21,758 |
| メイテック | 23.2 | 16.2 | 99,306 |
| 応用地質 | 20.4 | 15.1 | 20,052 |
| 船井総研ホールディングス | 39.1 | 27.4 | 62,170 |
| 進学会ホールディングス | 7.4 | 5.2 | 2,199 |
| オオバ | 13.7 | 9.4 | 8,074 |
| いであ | 4.6 | 3.3 | 6,157 |
| 学究社 | 5.5 | 3.9 | 5,112 |
| ベネッセホールディングス | 63 | 49.1 | 119,951 |
| イオンデライト | 23.3 | 16.5 | 55,852 |
| ナック | 10.5 | 6.3 | 5,966 |
| ニチイ学館 | 26.9 | — | — |
| ダイセキ | 31.7 | 22.5 | 92,587 |
| ステップ | 6.9 | 4.9 | 7,884 |
| 計 | 株数・金額 232,660 | 147,249 | 375,833,453 |
| | 銘柄数<比率> | 2,155 | 2,172 <97.5%> |

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

*銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

国内新株予約権証券

2021年5月10日現在の組入れはございません。

| 銘 柄 | | 期首（前期末） |
|--------|---------------|--------------|
| | | 証 券 数 |
| 千葉興業銀行 | | 証券 52,900 |
| 合 計 | 証 券 数 ・ 金 額 | 52,900 |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 |

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 | | | 当 期 末 | |
|--------|--------|-------|--------------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国 内 | 株式先物取引 | TOPIX | 百万円 9,730 | 百万円 - |

*単位未満は切り捨て。

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2021年5月10日現在)

| 区 分 | 当 期 末 | |
|--------------------------------------|-------|------------------------------|
| | 数 | 量 |
| 貸付有価証券<株式>総株数 (野 村 証 券 株 式 会 社) | | 株 2,502,700 (311,700) |

* () 内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

(2021年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 375,833,453 | % 88.4 |
| コール・ローン等、その他 | 49,237,916 | 11.6 |
| 投資信託財産総額 | 425,071,369 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月10日現在)

| 項目 | 当期末 | 円 |
|-----------------|------------------|---|
| (A) 資産 | 425,022,491,500 | |
| コール・ローン等 | 44,988,320,369 | |
| 株式(評価額) | 375,833,453,070 | |
| 未収入金 | 46,035,390 | |
| 未収配当金 | 3,735,225,261 | |
| その他未収収益 | 44,504,310 | |
| 差入委託証拠金 | 374,953,100 | |
| (B) 負債 | 39,424,949,574 | |
| 未払金 | 13,358,038 | |
| 未払解約金 | 35,484,489,542 | |
| 未払利息 | △ 98,598 | |
| 受入担保金 | 3,927,200,592 | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 385,597,541,926 | |
| 元本 | 189,017,112,223 | |
| 次期繰越損益金 | 196,580,429,703 | |
| (D) 受益権総口数 | 189,017,112,223口 | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 20,400円 | |

(注) 期首元本額は279,253,369,640円、期中追加設定元本額は23,335,658,932円、期中一部解約元本額は113,571,916,349円、1口当たり純資産額は2.0400円です。

○損益の状況 (2020年5月12日～2021年5月10日)

| 項目 | 当期 | 円 |
|------------------|------------------|---|
| (A) 配当等収益 | 9,039,191,180 | |
| 受取配当金 | 8,853,039,847 | |
| その他収益金 | 180,150,118 | |
| 支払利息 | 6,001,215 | |
| (B) 有価証券売買損益 | 115,100,625,944 | |
| 売買益 | 121,958,784,335 | |
| 売買損 | △ 6,858,158,391 | |
| (C) 先物取引等取引損益 | 2,127,065,351 | |
| 取引益 | 2,641,860,695 | |
| 取引損 | △ 514,795,344 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 126,266,882,475 | |
| (E) 前期繰越損益金 | 143,803,269,334 | |
| (F) 追加信託差損益金 | 17,543,964,090 | |
| (G) 解約差損益金 | △ 91,033,686,196 | |
| (H) 計(D+E+F+G) | 196,580,429,703 | |
| 次期繰越損益金(H) | 196,580,429,703 | |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

* 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 元本額 | 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) | 32,220,763,485 | |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 27,093,324,207 | |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 24,083,598,606 | |
| 野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け) | 15,014,456,932 | |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX | 9,945,323,488 | |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 8,958,214,964 | |
| のむらっぴ・ファンド(普通型) | 8,695,111,419 | |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 7,585,527,508 | |
| マイバランスDC50 | 5,299,473,498 | |
| マイバランスDC70 | 5,206,076,741 | |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 4,285,699,847 | |
| マイ・ロード | 3,191,469,284 | |
| マイバランスDC30 | 3,167,103,613 | |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 2,958,763,691 | |
| のむらっぴ・ファンド(積極型) | 2,605,707,453 | |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 2,494,073,607 | |
| 野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け) | 2,339,716,726 | |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 2,307,293,190 | |
| のむらっぴ・ファンド(保守型) | 2,278,293,916 | |

| ファンド名 | 当期末 元本額 | 円 |
|-------------------------------------|---------------|---|
| 野村6資産均等バランス | 1,951,592,442 | |
| 野村インデックスファンド・TOPIX | 1,679,369,131 | |
| ノムラPOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用) | 1,590,034,474 | |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 1,461,328,501 | |
| 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 | 1,352,391,649 | |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 1,151,048,194 | |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 912,963,559 | |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 782,670,090 | |
| 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) | 699,275,196 | |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式 | 691,314,864 | |
| 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) | 580,285,208 | |
| 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) | 515,311,620 | |
| バランスセレクト70 | 440,069,742 | |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け) | 404,598,424 | |
| 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) | 391,895,637 | |
| 野村DC運用戦略ファンド | 365,001,395 | |
| のむらっぴ・ファンド(やや積極型) | 361,028,737 | |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け) | 326,996,341 | |
| 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) | 321,094,000 | |

| ファンド名 | 当期末 |
|-------------------------------------|-------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| バランスセレクト50 | 313,849,023 |
| のむらっぴ・ファンド (やぎ保守型) | 302,031,995 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け) | 253,526,608 |
| 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) | 246,968,397 |
| 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) | 208,220,831 |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け) | 200,134,268 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 161,263,364 |
| 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) | 151,076,855 |
| バランスセレクト30 | 140,022,812 |
| 国内債券・株式バランスファンド (確定拠出年金向け) | 119,310,499 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 101,390,924 |
| 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) | 96,567,613 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 83,905,441 |
| 世界6資産分散ファンド | 79,787,197 |
| 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) | 75,664,570 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 73,941,030 |
| 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) | 67,530,749 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 66,741,873 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 59,068,096 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 39,493,907 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 39,488,612 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 39,277,688 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 34,867,911 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 30,864,791 |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け) | 30,247,336 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | 27,270,818 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 26,478,951 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用) | 23,325,274 |
| インデックス・ブレンド (タイプV) | 22,186,770 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 19,460,583 |
| ネクストコア | 19,011,164 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030 | 18,375,215 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 15,996,706 |
| インデックス・ブレンド (タイプIII) | 15,910,681 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 13,386,405 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 13,064,858 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 8,983,053 |
| 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) | 8,495,347 |
| 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) | 8,207,928 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 7,785,224 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 6,709,190 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 5,973,831 |
| インデックス・ブレンド (タイプIV) | 5,531,274 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 5,138,457 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 4,381,261 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 4,117,723 |
| インデックス・ブレンド (タイプII) | 3,751,683 |
| 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) | 3,423,934 |
| インデックス・ブレンド (タイプI) | 3,307,598 |
| 野村IFP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) | 2,388,183 |
| 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) | 885,380 |
| 多資産分散投資ファンド (バランス10) (確定拠出年金向け) | 60,963 |

○お知らせ

該当事項はございません。

外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日2021年3月31日）

作成対象期間（2020年4月1日～2021年3月31日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 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います。 |
| 主な投資対象 | 外国の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|--------------------------------------|-------|--------|--------|------------|---------|
| | 円 | 騰落率 | MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし) | 騰落率 | | | | |
| 15期(2017年3月31日) | 23,082 | 14.6 | 246.86 | 15.0 | 95.0 | 2.4 | 2.5 | 364,352 |
| 16期(2018年4月2日) | 24,752 | 7.2 | 265.15 | 7.4 | 95.6 | 1.9 | 2.3 | 454,743 |
| 17期(2019年4月1日) | 27,269 | 10.2 | 293.26 | 10.6 | 95.6 | 1.7 | 2.6 | 566,435 |
| 18期(2020年3月31日) | 24,094 | △11.6 | 260.14 | △11.3 | 95.8 | 1.5 | 2.7 | 556,023 |
| 19期(2021年3月31日) | 37,781 | 56.8 | 408.16 | 56.9 | 95.9 | 1.9 | 2.2 | 927,648 |

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに、営業日当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。(以下同じ)

*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ためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、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のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|--------------------|--------|------|--------------------------------------|------|--------|--------|------------|
| | 円 | 騰落率 | MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし) | 騰落率 | | | |
| (期首) 2020年3月31日 | 24,094 | — | 260.14 | — | 95.8 | 1.5 | 2.7 |
| 4月末 | 26,460 | 9.8 | 285.29 | 9.7 | 96.0 | 1.3 | 2.6 |
| 5月末 | 27,600 | 14.6 | 297.62 | 14.4 | 94.9 | 2.5 | 2.5 |
| 6月末 | 28,131 | 16.8 | 303.46 | 16.7 | 95.9 | 1.6 | 2.5 |
| 7月末 | 29,070 | 20.7 | 313.19 | 20.4 | 96.3 | 1.2 | 2.5 |
| 8月末 | 31,303 | 29.9 | 337.76 | 29.8 | 95.8 | 1.0 | 2.3 |
| 9月末 | 30,075 | 24.8 | 324.53 | 24.8 | 96.3 | 1.3 | 2.3 |
| 10月末 | 29,243 | 21.4 | 315.51 | 21.3 | 96.3 | 1.3 | 2.3 |
| 11月末 | 32,609 | 35.3 | 352.10 | 35.4 | 95.6 | 1.5 | 2.2 |
| 12月末 | 33,554 | 39.3 | 362.28 | 39.3 | 96.3 | 1.5 | 2.2 |
| 2021年1月末 | 34,249 | 42.1 | 370.12 | 42.3 | 96.3 | 1.5 | 2.2 |
| 2月末 | 35,409 | 47.0 | 383.43 | 47.4 | 96.2 | 1.1 | 2.2 |
| (期末) 2021年3月31日 | 37,781 | 56.8 | 408.16 | 56.9 | 95.9 | 1.9 | 2.2 |

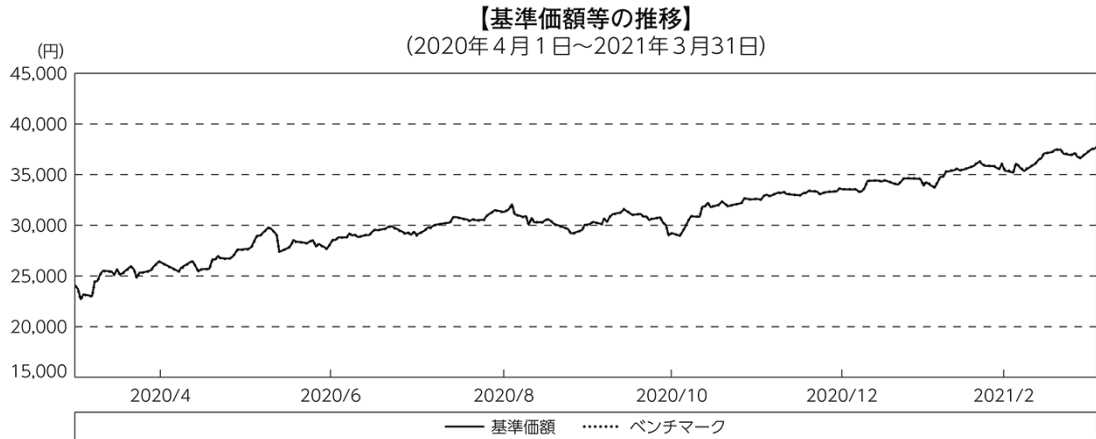
*騰落率は期首比です。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から欧米で新型コロナウイルス感染拡大の勢いが鈍化しつつあるとの見方や、FRB（米連邦準備制度理事会）の緊急資金供給策の発表などを受けて上昇しました。その後も、各国で経済活動の再開が段階的に進んだことや、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などを背景に上昇しました。2020年9月以降は、主要株価指数が史上最高値を更新したことで利益確定の動きが広がったとの見方や、欧米で新型コロナウイルス新規感染者数が急増したことなどから軟調に推移しましたが、11月に入ると、米大手製薬会社が新型コロナウイルスワクチンの臨床試験による高い有効性を発表したことや、米大統領・議会選挙の結果を受けて再び上昇しました。その後も、新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったこと、欧米の経済指標が市場予想を上回ったことなどを受けて上昇しました。

為替市場は、期首から新型コロナウイルス感染拡大の責任を巡る米中対立への懸念や、世界的な経済活動再開への期待などから、主要通貨は対円で一進一退となりました。2020年6月中旬以降は、FOMC（米連邦公開市場委員会）でゼロ金利政策の維持が表明され、米国の低金利が長期化するとの観測や、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大などが懸念される中、下落（円高）しました。2021年1月以降は、米長期金利が上昇し日米金利差の拡大が意識されたことや、米国で新型コロナウイルスの新規感染者数の減少傾向が見られたことなどから上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

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、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流出入に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+56.8%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の+56.9%を0.1ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

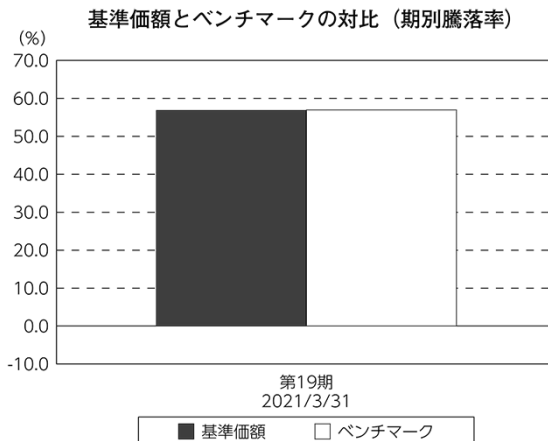
（その他、差異を生じた要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）

◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。

○1万口当たりの費用明細

(2020年4月1日～2021年3月31日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式) | 1 | 0.002 | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 | 2 | 0.006 | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株 式) | (2) | (0.005) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 3 | 0.009 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| (保 管 費 用) | (2) | (0.008) | |
| (そ の 他) | (0) | (0.001) | |
| 合 計 | 6 | 0.017 | |
| 期中の平均基準価額は、30,149円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年4月1日～2021年3月31日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---------|---------------|---------------------------|----------------------------------|--------------------------|----------------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 79,265 (31,411) | 千米ドル 749,342 (18,392) | 百株 53,899 (3,468) | 千米ドル 399,285 (28,262) |
| | カナダ | 14,061 (△ 950) | 千カナダドル 54,569 (-) | 9,065 (439) | 千カナダドル 23,633 (978) |
| | イギリス | 58,322 (27,201) | 千英ポンド 32,903 (12,718) | 47,971 (18,850) | 千英ポンド 18,858 (2,488) |
| | スイス | 4,537 (58) | 千スイスフラン 32,105 (△ 232) | 2,921 (116) | 千スイスフラン 16,682 (760) |
| | スウェーデン | 8,077 (390) | 千スウェーデンクローナ 140,085 (273) | 3,784 (-) | 千スウェーデンクローナ 51,047 (273) |
| | ノルウェー | 1,556 | 千ノルウェークローネ 25,531 | 784 | 千ノルウェークローネ 11,654 |
| | デンマーク | 1,328 (2,286) | 千デンマーククローネ 62,169 (4,458) | 657 (1,960) | 千デンマーククローネ 30,755 (1,028) |
| | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ドイツ | 5,870 (704) | 32,171 (△ 511) | 3,151 (99) | 12,699 (-) |
| | イタリア | 13,005 (1,689) | 8,944 (1,178) | 9,367 (910) | 3,674 (-) |
| | フランス | 5,163 (△ 366) | 27,505 (△ 93) | 2,870 (397) | 14,636 (993) |
| | イギリス | - (2,399) | - (10,629) | - (2,399) | - (10,629) |
| | オランダ | 2,542 (230) | 15,630 (△ 9,460) | 2,283 (1,689) | 6,383 (1,178) |
| | スペイン | 9,215 (72,268) | 5,679 (1,555) | 18,448 (69,600) | 5,130 (1,160) |
| ベルギー | 400 (53) | 2,883 (347) | 230 | 1,249 | |
| オーストリア | 222 | 521 | 289 | 815 | |
| ルクセンブルグ | 294 (194) | 382 (-) | 410 | 186 | |
| フィンランド | 2,479 | 3,627 | 1,561 | 2,275 | |
| アイルランド | 388 (87) | 2,454 (630) | 2,738 | 1,182 | |

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----------|---------------------|------------------------------|--------------------|------------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 | ユーロ | 百株 | 千ユーロ | 百株 | 千ユーロ |
| | ポルトガル | 825 (4,524) | 333 (150) | 290 (4,170) | 126 (33) |
| | 香港 | 21,168 (△ 2,737) | 千香港ドル 84,642 (-) | 16,737 (1,340) | 千香港ドル 56,690 (3,681) |
| | シンガポール | 10,124 (4,583) | 千シンガポールドル 3,503 (825) | 19,153 (1,155) | 千シンガポールドル 3,773 (132) |
| 国 | オーストラリア | 20,689 (2,210) | 千豪ドル 36,530 (469) | 17,558 (932) | 千豪ドル 16,453 (52) |
| | ニュージーランド | 1,020 | 千ニュージーランドドル 1,178 | 1,580 | 千ニュージーランドドル 813 |
| | イスラエル | 33 | 千新シェケル 1,999 | 8 | 千新シェケル 636 |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|------|----------------------|-------------------|----------------------|------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外 | アメリカ | 証券 — (17,750) | 千米ドル — (82) | 証券 17,750 | 千米ドル 77 |
| | 国 | スイス | — (170,600) | 千スイスフラン — (18) | 170,600 |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分です。

投資信託証券

| 銘柄 | 買付 | | 売付 | |
|--------------------------------------|--------------------------------|-----------------|---------|--------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| アメリカ | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| AGNC INVESTMENT CORP | 13,000 | 184 | — | — |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 4,500 | 713 | — | — |
| AMERICAN TOWER CORP | 7,300 | 1,731 | 3,000 | 729 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 46,000 | 300 | 22,000 | 168 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 3,300 | 524 | 2,500 | 435 |
| BOSTON PROPERTIES | 2,400 | 180 | 2,100 | 217 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 1,500 | 128 | — | — |
| CROWN CASTLE INTL CORP | 10,100 | 1,630 | 2,500 | 411 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 7,200 | 1,050 | 2,700 | 395 |
| DUKE REALTY CORP | 5,600 | 228 | — | — |
| EQUINIX INC | 2,330 | 1,781 | 770 | 604 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 2,900 | 179 | — | — |
| EQUITY RESIDENTIAL | 5,600 | 335 | 3,000 | 167 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 1,430 | 312 | 800 | 173 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | — | — | 11,100 | 968 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 12,300 | 335 | — | — |
| INVITATION HOMES INC | 7,000 | 203 | — | — |
| IRON MOUNTAIN INC | 5,900 | 162 | — | — |
| KIMCO REALTY CORP | — | — | 65,000 | 722 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 16,000 | 352 | — | — |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 1,700 | 210 | — | — |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | — | — | 27,900 | 1,051 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 4,300 | 138 | — | — |
| PROLOGIS INC | 16,700 | 1,685 | 8,500 | 869 |
| PUBLIC STORAGE | 4,500 | 1,014 | 2,500 | 554 |
| REALTY INCOME CORP | 5,700 | 334 | — | — |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 2,400 | 709 | 2,070 | 579 |
| SL GREEN REALTY CORP | — | — | 12,500 | 526 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 6,900 | 536 | — | — |
| SUN COMMUNITIES INC | 3,500 | 530 | — | — |
| UDR INC | 4,700 | 158 | 4,900 | 188 |
| VENTAS INC | 14,900 | 604 | 7,800 | 361 |
| VEREIT INC | 25,000 | 165 | — | — |
| VEREIT INC | (Δ 185,000) | (Δ 962) | — | — |
| VEREIT INC | (37,000) | (962) | — | — |
| VICI PROPERTIES INC | 19,000 | 406 | — | — |
| WELLTOWER INC | 10,800 | 631 | 5,900 | 397 |
| WEYERHAEUSER CO | 6,000 | 180 | — | — |
| 小計 | 280,460 (Δ 148,000) | 17,643 (—) | 187,540 | 9,522 |
| カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 3,400 | 153 | — | — |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | — | — | 16,000 | 249 |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | — | — | 20,000 | 193 |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | — | — | 11,000 | 264 |
| 小計 | 3,400 | 153 | 47,000 | 708 |
| イギリス | | 千英ポンド | | 千英ポンド |
| SEGRO PLC | 17,000 | 162 | — | — |
| 小計 | 17,000 | 162 | — | — |

| 銘 柄 | | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|----------------------------|--|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | フランス | | | | |
| | ICADE | — | — | 5,200 | 322 |
| | KLEPIERRE | — | — | — | — |
| | | (—) | (△ 27) | — | — |
| | COVIVIO | 1,900 | 109 | — | — |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 2,800 | 176 | — | — |
| | 小 計 | 4,700 | 286 | 5,200 | 322 |
| | | (—) | (△ 27) | — | — |
| | ユ ー ロ 計 | 4,700 | 286 | 5,200 | 322 |
| | | (—) | (△ 27) | — | — |
| | 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| | LINK REIT | 62,000 | 3,986 | 39,000 | 2,594 |
| | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 100,000 | 746 | — | — |
| | 小 計 | 162,000 | 4,733 | 39,000 | 2,594 |
| | シンガポール | | 千シンガポールドル | | 千シンガポールドル |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | — | — | — | — |
| | | (316,779) | (547) | — | — |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 139,200 | 446 | 60,000 | 196 |
| | | (19,240) | (44) | — | — |
| | ASCENDAS REAL ESTATE-RTS | — | — | — | — |
| | | (19,240) | (56) | (19,240) | (0.58799) |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | — | — | — | — |
| | | — | — | (439,972) | (655) |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 420,000 | 861 | — | — |
| | | (7,980) | (12) | — | — |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS | — | — | — | — |
| | | (7,980) | (15) | (7,980) | (0.04308) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | — | — | — | — | |
| | (—) | (△ 2) | — | — | |
| 小 計 | 559,200 | 1,307 | 60,000 | 196 | |
| | (371,219) | (674) | (467,192) | (656) | |
| オーストラリア | | 千豪ドル | | 千豪ドル | |
| GPT GROUP | 45,000 | 175 | — | — | |
| LENLEASE GROUP | 23,000 | 297 | — | — | |
| STOCKLAND TRUST GROUP | 112,000 | 393 | 60,000 | 236 | |
| GOODMAN GROUP | 43,000 | 729 | 14,000 | 180 | |
| SCENTRE GROUP | 220,000 | 566 | 270,000 | 762 | |
| VICINITY CENTRES | 200,000 | 283 | — | — | |
| 小 計 | 643,000 | 2,446 | 344,000 | 1,180 | |

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* () 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|--------|----------------|----------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外 国 | 株式先物取引 | 百万円 128,672 | 百万円 124,008 | 百万円 — | 百万円 — |

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2020年4月1日～2021年3月31日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 169,458,786千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 712,894,879千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.23 |

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年4月1日～2021年3月31日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2021年3月31日現在)

外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|--------|---------|------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| AFLAC INC | 1,147 | 1,089 | 5,644 | 624,879 | 保険 |
| AES CORP | 1,010 | 1,100 | 2,956 | 327,347 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AT & T INC | 11,424 | 11,810 | 36,292 | 4,017,901 | 各種電気通信サービス |
| ABBOTT LABORATORIES | 2,768 | 2,937 | 35,170 | 3,893,734 | ヘルスケア機器・用品 |
| ABBVIE INC | 2,316 | 2,926 | 31,246 | 3,459,328 | バイオテクノロジー |
| ABIOMED INC | 72 | 72 | 2,231 | 247,009 | ヘルスケア機器・用品 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 1,208 | 1,290 | 11,953 | 1,323,332 | 娯楽 |
| ACUITY BRANDS INC | 62 | — | — | — | 電気設備 |
| ADOBE INC | 757 | 794 | 36,999 | 4,096,205 | ソフトウェア |
| ADVANCE AUTO PARTS | 109 | 109 | 2,028 | 224,537 | 専門小売り |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 1,663 | 1,993 | 15,146 | 1,676,902 | 半導体・半導体製造装置 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 490 | 519 | 6,479 | 717,311 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AIRBNB INC-CLASS A | — | 87 | 1,592 | 176,357 | ホテル・レストラン・レジャー |
| AIR PRODUCTS | 347 | 363 | 10,258 | 1,135,745 | 化学 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 258 | 274 | 2,772 | 306,924 | 情報技術サービス |
| ALBEMARLE CORP | 167 | 197 | 2,864 | 317,093 | 化学 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 342 | 369 | 5,662 | 626,873 | バイオテクノロジー |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 118 | 125 | 6,590 | 729,670 | ヘルスケア機器・用品 |
| ALLEGHANY CORP | 23 | 23 | 1,478 | 163,693 | 保険 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 66 | — | — | — | 情報技術サービス |
| ALLIANT ENERGY CORP | 376 | 409 | 2,215 | 245,238 | 電力 |
| ALLSTATE CORP | 506 | 496 | 5,808 | 643,076 | 保険 |
| ALLY FINANCIAL INC | 574 | 630 | 2,898 | 320,837 | 消費者金融 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 175 | 187 | 2,526 | 279,756 | バイオテクノロジー |
| ALPHABET INC-CL C | 483 | 492 | 101,132 | 11,196,386 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ALPHABET INC-CL A | 468 | 498 | 101,955 | 11,287,453 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ALTICE USA INC-A | 200 | 360 | 1,188 | 131,523 | メディア |
| ALTRIA GROUP INC | 2,931 | 3,105 | 15,916 | 1,762,085 | タバコ |
| AMAZON.COM INC | 658 | 706 | 215,917 | 23,904,209 | インターネット販売・通信販売 |
| AMERCO | 11 | 17 | 1,052 | 116,537 | 陸運・鉄道 |
| AMEREN CORPORATION | 391 | 415 | 3,375 | 373,667 | 総合公益事業 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 146 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 777 | 834 | 7,066 | 782,330 | 電力 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 1,079 | 1,136 | 16,300 | 1,804,624 | 消費者金融 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 125 | 125 | 1,454 | 161,069 | 保険 |
| AMERICAN INTL GROUP | 1,378 | 1,450 | 6,864 | 759,946 | 保険 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 283 | 306 | 4,493 | 497,487 | 水道 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 239 | 257 | 3,059 | 338,755 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 203 | 192 | 4,469 | 494,847 | 資本市場 |
| AMETEK INC | 355 | 373 | 4,753 | 526,261 | 電気設備 |
| AMGEN INC | 930 | 961 | 24,000 | 2,657,147 | バイオテクノロジー |
| AMPHENOL CORP-CL A | 464 | 1,004 | 6,585 | 729,051 | 電子装置・機器・部品 |
| ANALOG DEVICES INC | 581 | 618 | 9,431 | 1,044,139 | 半導体・半導体製造装置 |
| ANSYS INC | 134 | 145 | 4,812 | 532,781 | ソフトウェア |
| ANTHEM INC | 394 | 409 | 14,891 | 1,648,613 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APACHE CORPORATION | 541 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | — | 275 | 1,296 | 143,549 | 資本市場 |
| APPLE INC | 6,940 | 28,174 | 337,806 | 37,398,531 | コンピュータ・周辺機器 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------------|---------|--------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| APPLIED MATERIALS | 1,436 | 1,507 | 19,102 | 2,114,863 | 半導体・半導体製造装置 |
| ARAMARK | 410 | 390 | 1,494 | 165,410 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ARCHER DANIELS MIDLAND | 884 | 938 | 5,431 | 601,268 | 食品 |
| ARCONIC INC | 570 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| ARISTA NETWORKS INC | 81 | 96 | 2,869 | 317,633 | 通信機器 |
| ARROW ELECTRS INC | 121 | 121 | 1,324 | 146,604 | 電子装置・機器・部品 |
| ASSURANT INC | 90 | 102 | 1,476 | 163,412 | 保険 |
| ATMOS ENERGY CORP | 184 | 202 | 1,997 | 221,151 | ガス |
| AUTODESK INC. | 342 | 367 | 9,851 | 1,090,646 | ソフトウェア |
| AUTOLIV INC | 119 | 140 | 1,306 | 144,640 | 自動車部品 |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 679 | 706 | 13,265 | 1,468,571 | 情報技術サービス |
| AUTOZONE | 36 | 37 | 5,373 | 594,912 | 専門小売り |
| AVALARA INC | — | 131 | 1,640 | 181,592 | ソフトウェア |
| AVANTOR INC | — | 840 | 2,389 | 264,574 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AVERY DENNISON CORP | 134 | 134 | 2,481 | 274,717 | 容器・包装 |
| BAKER HUGHES CO | 1,010 | 1,110 | 2,412 | 267,035 | エネルギー設備・サービス |
| BALL CORP | 475 | 551 | 4,657 | 515,643 | 容器・包装 |
| BANK OF AMERICA CORP | 13,370 | 12,900 | 50,297 | 5,568,391 | 銀行 |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP | 1,279 | 1,343 | 6,427 | 711,599 | 資本市場 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC. | 755 | 855 | 7,317 | 810,075 | ヘルスケア機器・用品 |
| BECTON, DICKINSON | 420 | 484 | 11,867 | 1,313,817 | ヘルスケア機器・用品 |
| BEIGENE, LTD ADR | 63 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| WR BERKLEY CORP | 217 | 239 | 1,824 | 201,940 | 保険 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 2,055 | 2,272 | 58,660 | 6,494,333 | 各種金融サービス |
| BEST BUY COMPANY INC | 363 | 393 | 4,547 | 503,486 | 専門小売り |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 36 | 36 | 2,053 | 227,343 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 280 | 306 | 2,293 | 253,943 | バイオテクノロジー |
| BIOGEN INC | 283 | 252 | 6,955 | 770,038 | バイオテクノロジー |
| BLACK KNIGHT INC | 242 | 270 | 1,966 | 217,731 | 情報技術サービス |
| BLACKROCK INC | 181 | 254 | 19,053 | 2,109,433 | 資本市場 |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A | 1,040 | 1,126 | 8,360 | 925,596 | 資本市場 |
| BOEING CO | 838 | 885 | 22,302 | 2,469,152 | 航空宇宙・防衛 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 65 | 67 | 15,760 | 1,744,845 | インターネット販売・通信販売 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 226 | 226 | 1,825 | 202,090 | 情報技術サービス |
| BORGWARNER INC | 296 | 404 | 1,879 | 208,113 | 自動車部品 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 2,193 | 2,350 | 9,155 | 1,013,616 | ヘルスケア機器・用品 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 3,670 | 3,742 | 23,690 | 2,622,786 | 医薬品 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 179 | 194 | 2,967 | 328,566 | 情報技術サービス |
| BROADCOM INC | 622 | 668 | 30,498 | 3,376,528 | 半導体・半導体製造装置 |
| BROWN & BROWN INC | 388 | 388 | 1,785 | 197,638 | 保険 |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B | 478 | 527 | 3,689 | 408,409 | 飲料 |
| BURLINGTON STORES INC | 105 | 114 | 3,473 | 384,572 | 専門小売り |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 179 | 179 | 1,739 | 192,622 | 資本市場 |
| CBRE GROUP INC | 483 | 548 | 4,335 | 480,013 | 不動産管理・開発 |
| CDK GLOBAL INC | 200 | — | — | — | ソフトウェア |
| CDW CORPORATION | 224 | 239 | 3,939 | 436,108 | 電子装置・機器・部品 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 353 | 353 | 1,603 | 177,543 | 化学 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 201 | 220 | 2,151 | 238,227 | 航空貨物・物流サービス |
| CIGNA CORP | 580 | 595 | 14,625 | 1,619,144 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CME GROUP INC | 562 | 600 | 12,296 | 1,361,334 | 資本市場 |
| CMS ENERGY CORP | 433 | 482 | 2,941 | 325,616 | 総合公益事業 |
| CSX CORP | 1,162 | 1,279 | 12,325 | 1,364,580 | 陸運・鉄道 |
| CVS HEALTH CORP | 2,040 | 2,184 | 16,615 | 1,839,543 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CABLE ONE INC | — | 8 | 1,451 | 160,727 | メディア |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------|--------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 千米ドル | 千円 | | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | | | | | |
| CABOT OIL & GAS CORP | 640 | 640 | 1,202 | 133,135 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 446 | 469 | 6,137 | 679,516 | | | ソフトウェア |
| CAMPBELL SOUP CO | 248 | 309 | 1,587 | 175,767 | | | 食品 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 723 | 766 | 9,847 | 1,090,238 | | | 消費者金融 |
| CARDINAL HEALTH INC | 443 | 472 | 2,939 | 325,444 | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARMAX INC | 261 | 279 | 3,789 | 419,552 | | | 専門小売り |
| CARLYLE GROUP INC/THE | — | 220 | 816 | 90,385 | | | 資本市場 |
| CARNIVAL CORP | 621 | 1,290 | 3,437 | 380,604 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| CARRIER GLOBAL CORP | — | 1,390 | 5,888 | 651,864 | | | 建設関連製品 |
| CARVANA CO | — | 102 | 2,595 | 287,392 | | | 専門小売り |
| CATALENT INC | — | 280 | 2,899 | 321,054 | | | 医薬品 |
| CATERPILLAR INC DEL | 868 | 899 | 20,953 | 2,319,805 | | | 機械 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 196 | 195 | 2,954 | 327,043 | | | 化学 |
| CENTENE CORP | 921 | 975 | 6,374 | 705,726 | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 754 | 940 | 2,143 | 237,273 | | | 総合公益事業 |
| CENTURYLINK INC | 1,480 | — | — | — | | | 各種電気通信サービス |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | — | 216 | 1,769 | 195,874 | | | ソフトウェア |
| CERNER CORP | 499 | 520 | 3,725 | 412,425 | | | ヘルスケア・テクノロジー |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 235 | 230 | 14,583 | 1,614,539 | | | メディア |
| CHEVIERE ENERGY INC | 364 | 364 | 2,628 | 290,954 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHEVRON CORP | 2,960 | 3,190 | 33,791 | 3,741,075 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHEWY INC - CLASS A | — | 123 | 988 | 109,456 | | | インターネット販売・通信販売 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 41 | 44 | 6,272 | 694,398 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 375 | 398 | 3,499 | 387,398 | | | 家庭用品 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 246 | 246 | 2,584 | 286,181 | | | 保険 |
| CISCO SYSTEMS | 6,638 | 7,002 | 36,249 | 4,013,165 | | | 通信機器 |
| CINTAS CORP | 134 | 143 | 4,823 | 534,013 | | | 商業サービス・用品 |
| CITIGROUP | 3,421 | 3,457 | 25,222 | 2,792,357 | | | 銀行 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 700 | 700 | 3,134 | 347,031 | | | 銀行 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 199 | 198 | 2,740 | 303,358 | | | ソフトウェア |
| CLOROX CO | 193 | 213 | 4,128 | 457,098 | | | 家庭用品 |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | — | 329 | 2,164 | 239,667 | | | ソフトウェア |
| COCA COLA CO | 6,368 | 6,765 | 35,955 | 3,980,685 | | | 飲料 |
| COGNEX CORP | 278 | 278 | 2,273 | 251,666 | | | 電子装置・機器・部品 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 866 | 875 | 6,874 | 761,117 | | | 情報技術サービス |
| COLGATE PALMOLIVE CO. | 1,265 | 1,363 | 10,812 | 1,197,071 | | | 家庭用品 |
| COMCAST CORP-CL A | 7,104 | 7,566 | 41,597 | 4,605,299 | | | メディア |
| COMERICA INC | 230 | — | — | — | | | 銀行 |
| CONAGRA BRANDS INC | 769 | 821 | 3,146 | 348,301 | | | 食品 |
| CONCHO RESOURCES INC | 310 | — | — | — | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CONOCOPHILLIPS | 1,710 | 2,231 | 11,920 | 1,319,688 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 525 | 570 | 4,239 | 469,372 | | | 総合公益事業 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 259 | 283 | 6,620 | 732,987 | | | 飲料 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 139 | — | — | — | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| THE COOPER COMPANIES, INC. | 75 | 91 | 3,502 | 387,761 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| COPART INC | 319 | 358 | 3,803 | 421,113 | | | 商業サービス・用品 |
| CORNING INC | 1,190 | 1,290 | 5,624 | 622,677 | | | 電子装置・機器・部品 |
| CORTEVA INC | 1,150 | 1,217 | 5,712 | 632,441 | | | 化学 |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 691 | 733 | 25,640 | 2,838,623 | | | 食品・生活必需品小売り |
| COSTAR GROUP INC | 58 | 66 | 5,293 | 585,990 | | | 専門サービス |
| COTY INC-CL A | 490 | — | — | — | | | パーソナル用品 |
| COUPA SOFTWARE INC | — | 114 | 2,720 | 301,198 | | | ソフトウェア |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | — | 290 | 5,083 | 562,752 | | | ソフトウェア |
| CROWN HOLDINGS INC | 212 | 228 | 2,212 | 244,972 | | | 容器・包装 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|-----------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| CUMMINS INC | 226 | 249 | 6,561 | 726,440 | 機械 |
| DR HORTON INC | 538 | 561 | 5,006 | 554,254 | 家庭用耐久財 |
| DTE ENERGY COMPANY | 305 | 328 | 4,379 | 484,885 | 総合公益事業 |
| DXC TECHNOLOGY CO | 378 | — | — | — | 情報技術サービス |
| DANAHER CORP | 981 | 1,060 | 23,638 | 2,616,962 | ヘルスケア機器・用品 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 198 | 220 | 3,191 | 353,335 | ホテル・レストラン・レジャー |
| DATADOG INC - CLASS A | — | 293 | 2,266 | 250,973 | ソフトウェア |
| DAVITA INC | 148 | 125 | 1,368 | 151,506 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY | 471 | 494 | 18,471 | 2,044,996 | 機械 |
| DELL TECHNOLOGIES-C | 266 | 407 | 3,605 | 399,177 | コンピュータ・周辺機器 |
| DELTA AIR LINES INC | 252 | 252 | 1,232 | 136,425 | 旅客航空輸送業 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 352 | 352 | 2,236 | 247,614 | ヘルスケア機器・用品 |
| DEVON ENERGY CORP | 624 | 1,000 | 2,200 | 243,562 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DEXCOM INC | 144 | 161 | 5,589 | 618,860 | ヘルスケア機器・用品 |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 231 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DISNEY (WALT) CO | 2,820 | 3,000 | 55,659 | 6,162,007 | 娯楽 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 496 | 500 | 4,763 | 527,311 | 消費者金融 |
| DISCOVERY INC - A | 245 | 245 | 1,064 | 117,826 | メディア |
| DISCOVERY INC - C | 570 | 491 | 1,817 | 201,181 | メディア |
| DISH NETWORK CORP-A | 371 | 384 | 1,377 | 152,492 | メディア |
| DOCUSIGN INC | 166 | 293 | 5,770 | 638,834 | ソフトウェア |
| DOLLAR GENERAL CORP | 397 | 418 | 8,433 | 933,634 | 複合小売り |
| DOLLAR TREE INC | 376 | 382 | 4,439 | 491,550 | 複合小売り |
| DOMINION ENERGY INC | 1,278 | 1,340 | 10,121 | 1,120,498 | 総合公益事業 |
| DOMINOS PIZZA INC | 59 | 63 | 2,322 | 257,168 | ホテル・レストラン・レジャー |
| DOVER CORP | 229 | 243 | 3,362 | 372,277 | 機械 |
| DOW INC | 1,152 | 1,245 | 8,043 | 890,545 | 化学 |
| DRAFTKINGS INC - CL A | — | 277 | 1,689 | 187,066 | ホテル・レストラン・レジャー |
| DROPOX INC-CLASS A | 390 | 510 | 1,338 | 148,213 | ソフトウェア |
| DUKE ENERGY CORP | 1,138 | 1,230 | 11,837 | 1,310,531 | 電力 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 1,150 | 877 | 6,868 | 760,429 | 化学 |
| DYNATRACE INC | — | 290 | 1,354 | 149,998 | ソフトウェア |
| EOG RESOURCES INC | 904 | 981 | 7,186 | 795,651 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 350 | — | — | — | 資本市場 |
| EAST WEST BANCORP INC | 207 | — | — | — | 銀行 |
| EASTMAN CHEMICAL CO. | 208 | 230 | 2,564 | 283,941 | 化学 |
| EATON VANCE CORP | 164 | — | — | — | 資本市場 |
| EBAY INC | 1,200 | 1,128 | 6,804 | 753,281 | インターネット販売・通信販売 |
| ECOLAB INC | 401 | 430 | 9,245 | 1,023,513 | 化学 |
| EDISON INTERNATIONAL | 555 | 612 | 3,637 | 402,732 | 電力 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 325 | 1,042 | 8,632 | 955,756 | ヘルスケア機器・用品 |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 600 | 740 | 2,131 | 235,945 | 医薬品 |
| ELECTRONIC ARTS | 461 | 485 | 6,519 | 721,813 | 娯楽 |
| EMERSON ELEC | 938 | 982 | 8,949 | 990,848 | 電気設備 |
| ENPHASE ENERGY INC | — | 195 | 2,936 | 325,122 | 半導体・半導体製造装置 |
| ENTERGY CORP | 313 | 336 | 3,314 | 367,000 | 電力 |
| EPAM SYSTEMS INC | 84 | 95 | 3,643 | 403,354 | 情報技術サービス |
| EQUIFAX INC | 185 | 197 | 3,610 | 399,731 | 専門サービス |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 620 | 690 | 2,236 | 247,579 | 各種金融サービス |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 37 | 44 | 979 | 108,443 | 保険 |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 349 | 396 | 1,748 | 193,558 | 水道 |
| ETSY INC | — | 209 | 4,156 | 460,153 | インターネット販売・通信販売 |
| EVERGY INC | 359 | 359 | 2,131 | 235,965 | 電力 |
| EVERSOURCE ENERGY | 503 | 564 | 4,866 | 538,798 | 電力 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------------|---------|--------|---------|------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 226 | 258 | 3,190 | 353,183 | バイオテクノロジー |
| EXELON CORPORATION | 1,515 | 1,637 | 7,120 | 788,360 | 電力 |
| EXPEDIA GROUP INC | 207 | 223 | 3,921 | 434,193 | インターネット販売・通信販売 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC | 273 | 271 | 2,906 | 321,745 | 航空貨物・物流サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 6,621 | 7,007 | 39,722 | 4,397,698 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FLIR SYSTEMS INC | 207 | — | — | — | 電子装置・機器・部品 |
| FMC CORP | 196 | 212 | 2,353 | 260,569 | 化学 |
| FACEBOOK INC-A | 3,761 | 3,984 | 114,739 | 12,702,776 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 59 | 64 | 1,992 | 220,598 | 資本市場 |
| FAIR ISAAC CORP | — | 46 | 2,240 | 248,092 | ソフトウェア |
| FASTENAL CO | 874 | 969 | 4,905 | 543,041 | 商社・流通業 |
| FEDEX CORPORATION | 391 | 417 | 11,922 | 1,319,980 | 航空貨物・物流サービス |
| F5 NETWORKS INC | 93 | 104 | 2,159 | 239,061 | 通信機器 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 964 | 1,035 | 14,749 | 1,632,948 | 情報技術サービス |
| FNF GROUP | 405 | 454 | 1,855 | 205,371 | 保険 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 1,120 | 1,200 | 4,574 | 506,431 | 銀行 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 257 | 290 | 4,874 | 539,603 | 銀行 |
| FISERV INC | 908 | 952 | 11,496 | 1,272,761 | 情報技術サービス |
| FIRSTENERGY CORP | 834 | 866 | 2,986 | 330,672 | 電力 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 138 | 135 | 3,734 | 413,476 | 情報技術サービス |
| FLOWSERVE CORP | 206 | — | — | — | 機械 |
| FORD MOTOR COMPANY | 6,070 | 6,560 | 8,173 | 904,916 | 自動車 |
| FORTINET INC | 228 | 224 | 4,061 | 449,680 | ソフトウェア |
| FORTIVE CORP | 476 | 518 | 3,699 | 409,520 | 機械 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 216 | 234 | 2,246 | 248,698 | 建設関連製品 |
| FOX CORP-CLASS A | 528 | 580 | 2,152 | 238,289 | メディア |
| FOX CORP-CLASS B | 254 | 254 | 910 | 100,783 | メディア |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 434 | 510 | 1,495 | 165,603 | 資本市場 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 2,250 | 2,390 | 7,810 | 864,702 | 金属・鉱業 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 297 | 319 | 4,007 | 443,681 | 保険 |
| GAP INC | 315 | — | — | — | 専門小売り |
| GARTNER INC | 141 | 141 | 2,562 | 283,682 | 情報技術サービス |
| GENERAC HOLDINGS INC | — | 102 | 3,241 | 358,816 | 電気設備 |
| GENERAL DYNAMICS | 383 | 410 | 7,466 | 826,571 | 航空宇宙・防衛 |
| GENERAL ELEC CO | 13,550 | 14,530 | 19,324 | 2,139,459 | コングロマリット |
| GENERAL MILLS | 943 | 1,028 | 6,352 | 703,231 | 食品 |
| GENERAL MOTORS CO | 1,990 | 2,153 | 12,597 | 1,394,636 | 自動車 |
| GENUINE PARTS CO | 232 | 232 | 2,727 | 301,975 | 販売 |
| GILEAD SCIENCES INC | 1,982 | 2,082 | 13,637 | 1,509,763 | バイオテクノロジー |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 473 | 492 | 10,055 | 1,113,298 | 情報技術サービス |
| GLOBE LIFE INC | 157 | 157 | 1,543 | 170,894 | 保険 |
| GODADDY INC - CLASS A | 269 | 269 | 2,043 | 226,186 | 情報技術サービス |
| GOLDMAN SACHS GROUP | 501 | 543 | 18,028 | 1,995,895 | 資本市場 |
| GRAINGER(W.W.) INC | 70 | 74 | 2,966 | 328,377 | 商社・流通業 |
| GRUBHUB INC | 145 | — | — | — | インターネット販売・通信販売 |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 121 | 136 | 1,367 | 151,423 | ソフトウェア |
| HCA HEALTHCARE INC | 424 | 454 | 8,559 | 947,646 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 268 | — | — | — | 商社・流通業 |
| HP INC | 2,320 | 2,250 | 7,101 | 786,151 | コンピュータ・周辺機器 |
| HALLIBURTON CO | 1,280 | 1,500 | 3,225 | 357,039 | エネルギー設備・サービス |
| HANESBRANDS INC | 510 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 224 | — | — | — | 自動車 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES | 545 | 589 | 3,988 | 441,524 | 保険 |
| HASBRO INC | 196 | 214 | 2,073 | 229,527 | レジャー用品 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-----------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| HEICO CORP | 63 | 63 | 779 | 86,347 | 航空宇宙・防衛 |
| HEICO CORP-CLASS A | 124 | 123 | 1,411 | 156,231 | 航空宇宙・防衛 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 117 | 127 | 1,948 | 215,683 | 情報技術サービス |
| HERSHEY CO/THE | 235 | 251 | 3,987 | 441,443 | 食品 |
| HESS CORP | 432 | 473 | 3,360 | 372,006 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 2,020 | 2,200 | 3,471 | 384,340 | コンピュータ・周辺機器 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 416 | 468 | 5,712 | 632,420 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HOLLYFRONTIER CORP | 236 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HOLOGIC INC | 433 | 434 | 3,205 | 354,931 | ヘルスケア機器・用品 |
| HOME DEPOT | 1,706 | 1,784 | 54,379 | 6,020,397 | 専門小売り |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 1,120 | 1,165 | 25,407 | 2,812,862 | コンプロマリット |
| HORMEL FOODS CORP | 456 | 500 | 2,408 | 266,589 | 食品 |
| HOWMET AEROSPACE INC | — | 660 | 2,096 | 232,065 | 航空宇宙・防衛 |
| HUBSPOT INC | — | 70 | 3,066 | 339,529 | ソフトウェア |
| HUMANA INC | 204 | 217 | 9,237 | 1,022,728 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC | 132 | 132 | 2,235 | 247,468 | 陸運・鉄道 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 1,540 | 1,720 | 2,753 | 304,864 | 銀行 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 65 | 65 | 1,336 | 148,003 | 航空宇宙・防衛 |
| IAC/INTERACTIVE CORP | — | 136 | 2,801 | 310,165 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| IAC/INTERACTIVE CORP | 126 | — | — | — | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| IPG PHOTONICS CORP | 59 | 59 | 1,207 | 133,642 | 電子装置・機器・部品 |
| IDEX CORP | 123 | 123 | 2,588 | 286,590 | 機械 |
| IDEX LABORATORIES INC | 136 | 142 | 6,801 | 752,974 | ヘルスケア機器・用品 |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 500 | 529 | 11,889 | 1,316,320 | 機械 |
| ILLUMINA INC | 228 | 244 | 9,013 | 997,905 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| INCYTE CORP | 285 | 312 | 2,503 | 277,126 | バイオテクノロジー |
| INGERSOLL-RAND INC | 528 | 580 | 2,902 | 321,315 | 機械 |
| INGREDION INC | 96 | — | — | — | 食品 |
| INSULET CORP | 98 | 106 | 2,770 | 306,736 | ヘルスケア機器・用品 |
| INTEL CORP | 6,802 | 6,791 | 43,306 | 4,794,430 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 876 | 930 | 10,344 | 1,145,227 | 資本市場 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 1,388 | 1,485 | 20,005 | 2,214,855 | 情報技術サービス |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 155 | 371 | 5,195 | 575,207 | 化学 |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO) | 598 | 601 | 3,305 | 365,951 | 容器・包装 |
| INTERPUBLIC GROUP | 580 | 670 | 1,963 | 217,408 | メディア |
| INTUIT INC | 404 | 433 | 16,179 | 1,791,230 | ソフトウェア |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 181 | 194 | 14,115 | 1,562,749 | ヘルスケア機器・用品 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 214 | 214 | 956 | 105,926 | バイオテクノロジー |
| IQVIA HOLDINGS INC | 252 | 322 | 6,143 | 680,140 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| JPMORGAN CHASE & CO | 4,903 | 5,051 | 78,027 | 8,638,463 | 銀行 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 200 | 213 | 2,729 | 302,146 | 建設・土木 |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC | 430 | — | — | — | 各種金融サービス |
| JOHNSON & JOHNSON | 4,114 | 4,362 | 71,977 | 7,968,613 | 医薬品 |
| JONES LANG LASALLE INC | 76 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 530 | 530 | 1,349 | 149,448 | 通信機器 |
| KLA CORP | 244 | 255 | 8,085 | 895,121 | 半導体・半導体製造装置 |
| KKR & CO INC-A | 784 | 855 | 4,205 | 465,618 | 資本市場 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 151 | 151 | 3,920 | 434,028 | 陸運・鉄道 |
| KELLOGG CO | 400 | 433 | 2,760 | 305,649 | 食品 |
| KEURIG DR PEPPER INC | — | 920 | 3,211 | 355,569 | 飲料 |
| KEYCORP | 1,580 | 1,580 | 3,174 | 351,417 | 銀行 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 289 | 304 | 4,302 | 476,364 | 電子装置・機器・部品 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 533 | 572 | 7,911 | 875,863 | 家庭用品 |
| KINDER MORGAN INC | 3,150 | 3,440 | 5,717 | 632,960 | 石油・ガス・消耗燃料 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 208 | 208 | 1,020 | 112,996 | 陸運・鉄道 |
| KOHL'S CORP | 253 | — | — | — | 複合小売り |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 1,041 | 1,090 | 4,390 | 486,074 | 食品 |
| KROGER CO | 1,269 | 1,260 | 4,798 | 531,195 | 食品・生活必需品小売り |
| LKQ CORP | 450 | 490 | 2,100 | 232,506 | 販売 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 344 | 344 | 6,985 | 773,414 | 航空宇宙・防衛 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 149 | 158 | 4,005 | 443,496 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH | 224 | 237 | 13,586 | 1,504,200 | 半導体・半導体製造装置 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 217 | 239 | 1,886 | 208,819 | 食品 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 538 | 586 | 3,587 | 397,171 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 344 | 378 | 11,155 | 1,235,071 | パーソナル用品 |
| LEAR CORP | 84 | 97 | 1,723 | 190,776 | 自動車部品 |
| LEGGETT & PLATT INC | 189 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 215 | 215 | 2,078 | 230,100 | 情報技術サービス |
| LENNAR CORP-A | 430 | 465 | 4,732 | 523,964 | 家庭用耐久財 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 51 | 57 | 1,802 | 199,574 | 建設関連製品 |
| LIBERTY BROADBAND CORP-A | — | 40 | 588 | 65,159 | メディア |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C | 167 | 259 | 3,942 | 436,473 | メディア |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP | 129 | 129 | 571 | 63,253 | メディア |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | 267 | 299 | 1,325 | 146,775 | メディア |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 293 | 340 | 1,478 | 163,664 | 娯楽 |
| ELI LILLY & CO. | 1,353 | 1,427 | 26,470 | 2,930,587 | 医薬品 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 299 | 299 | 1,875 | 207,584 | 保険 |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 230 | 266 | 2,220 | 245,868 | 娯楽 |
| LOCKHEED MARTIN | 397 | 420 | 15,562 | 1,722,944 | 航空宇宙・防衛 |
| LOEWS CORP | 433 | 431 | 2,270 | 251,320 | 保険 |
| LOWES COS INC | 1,205 | 1,214 | 23,068 | 2,553,905 | 専門小売り |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 172 | 208 | 6,595 | 730,184 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | — | 1,470 | 1,944 | 215,309 | 各種電気通信サービス |
| M & T BANK CORP | 200 | 217 | 3,338 | 369,658 | 銀行 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 790 | 800 | 3,056 | 338,418 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MSCI INC | 131 | 137 | 5,728 | 634,173 | 資本市場 |
| MANPOWERGROUP INC | 96 | — | — | — | 専門サービス |
| MARATHON OIL CORP | 1,230 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 985 | 1,060 | 5,681 | 629,009 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MARKEL CORP | 21 | 23 | 2,693 | 298,239 | 保険 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 58 | 61 | 3,038 | 336,441 | 資本市場 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 794 | 848 | 10,304 | 1,140,855 | 保険 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA | 432 | 464 | 6,877 | 761,449 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 97 | 105 | 3,608 | 399,454 | 建設資材 |
| MASCO CORP | 428 | 425 | 2,550 | 282,357 | 建設関連製品 |
| MASIMO CORP | — | 82 | 1,854 | 205,285 | ヘルスケア機器・用品 |
| MASTERCARD INC | 1,403 | 1,474 | 52,798 | 5,845,341 | 情報技術サービス |
| MATCH GROUP INC | 84 | — | — | — | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| MATCH GROUP INC | — | 416 | 5,469 | 605,535 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 424 | 452 | 4,064 | 449,967 | 半導体・半導体製造装置 |
| MCCORMICK & CO INC. | 189 | 402 | 3,613 | 400,103 | 食品 |
| MCDONALD'S CORP | 1,179 | 1,236 | 27,807 | 3,078,571 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MCKESSON CORP | 256 | 262 | 5,149 | 570,055 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR | 340 | 340 | 681 | 75,433 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MERCADOLIBRE INC | 69 | 74 | 10,610 | 1,174,662 | インターネット販売・通信販売 |
| MERCK & CO INC | 3,983 | 4,193 | 32,269 | 3,572,537 | 医薬品 |
| METLIFE INC | 1,206 | 1,254 | 7,704 | 852,973 | 保険 |
| METTLER-TOLEDO INTL | 38 | 38 | 4,447 | 492,402 | ライフサイエンス・ツール/サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|--------|---------|------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| MICROSOFT CORP | 11,321 | 11,902 | 275,947 | 30,550,188 | ソフトウェア |
| MICROCHIP TECHNOLOGY | 373 | 427 | 6,409 | 709,617 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICRON TECHNOLOGY | 1,740 | 1,845 | 15,966 | 1,767,665 | 半導体・半導体製造装置 |
| MIDDLEBY CORP | 87 | — | — | — | 機械 |
| MODERNA INC | — | 463 | 5,486 | 607,364 | バイオテクノロジー |
| MOHAWK INDUSTRIES | 87 | 102 | 1,989 | 220,236 | 家庭用耐久財 |
| MOLINA HEALTHCARE INC | — | 97 | 2,281 | 252,578 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B | 284 | 314 | 1,643 | 181,949 | 飲料 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 2,259 | 2,386 | 14,024 | 1,552,697 | 食品 |
| MONGODB INC | 74 | 88 | 2,285 | 253,002 | 情報技術サービス |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | — | 69 | 2,363 | 261,704 | 半導体・半導体製造装置 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 638 | 666 | 6,039 | 668,683 | 飲料 |
| MOODYS CORP | 268 | 283 | 8,420 | 932,189 | 資本市場 |
| MORGAN STANLEY | 1,910 | 2,331 | 18,435 | 2,041,036 | 資本市場 |
| DAIRY FARM INTL HLDGS LTD | 450 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| MOSAIC CO/THE | 560 | 560 | 1,755 | 194,300 | 化学 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 268 | 276 | 5,150 | 570,204 | 通信機器 |
| NRG ENERGY INC | 405 | 405 | 1,502 | 166,302 | 電力 |
| NVR INC | 5 | 5 | 2,630 | 291,246 | 家庭用耐久財 |
| NASDAQ INC | 184 | 184 | 2,713 | 300,365 | 資本市場 |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 580 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| NETAPP INC | 352 | 352 | 2,542 | 281,440 | コンピュータ・周辺機器 |
| NETFLIX INC | 685 | 732 | 37,585 | 4,161,066 | 娯楽 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 142 | 142 | 1,338 | 148,184 | バイオテクノロジー |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 1,840 | 1,840 | 916 | 101,445 | 不動産管理・開発 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 354 | 354 | 2,336 | 258,662 | コングロマリット |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD | 333 | 403 | 1,331 | 147,456 | コングロマリット |
| NEWELL BRANDS INC | 660 | 660 | 1,762 | 195,093 | 家庭用耐久財 |
| NEWMONT CORP | 1,276 | 1,317 | 7,886 | 873,080 | 金属・鉱業 |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I | 550 | 670 | 1,721 | 190,557 | メディア |
| NEXTERA ENERGY INC | 765 | 3,252 | 24,136 | 2,672,134 | 電力 |
| NIKE INC-B | 1,952 | 2,083 | 27,693 | 3,065,945 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NISOURCE INC | 582 | 650 | 1,559 | 172,635 | 総合公益事業 |
| NOBLE ENERGY INC | 710 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NORDSON CORP | — | 87 | 1,775 | 196,517 | 機械 |
| NORDSTROM INC | 150 | — | — | — | 複合小売り |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 403 | 418 | 11,298 | 1,250,815 | 陸運・鉄道 |
| NORTHERN TRUST CORP | 321 | 321 | 3,435 | 380,326 | 資本市場 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 251 | 260 | 8,389 | 928,821 | 航空宇宙・防衛 |
| NORTONLIFELOCK INC | 980 | 910 | 1,920 | 212,574 | ソフトウェア |
| NUCOR CORP | 467 | 509 | 4,091 | 453,008 | 金属・鉱業 |
| NVIDIA CORP | 909 | 1,025 | 52,815 | 5,847,189 | 半導体・半導体製造装置 |
| OGE ENERGY CORP | 325 | 325 | 1,054 | 116,757 | 電力 |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC, | 119 | 118 | 6,023 | 666,807 | 専門小売り |
| OCCIDENTAL PETE CORP | 1,420 | 1,580 | 4,318 | 478,061 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| OKTA INC | 165 | 203 | 4,335 | 479,935 | 情報技術サービス |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 153 | 153 | 3,681 | 407,560 | 陸運・鉄道 |
| OMNICOM GROUP | 345 | 345 | 2,603 | 288,180 | メディア |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 590 | 680 | 2,711 | 300,152 | 半導体・半導体製造装置 |
| ONEOK INC | 670 | 740 | 3,719 | 411,757 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ORACLE CORPORATION | 3,598 | 3,230 | 22,787 | 2,522,820 | ソフトウェア |
| OTIS WORLDWIDE CORP | — | 696 | 4,853 | 537,375 | 機械 |
| OWENS CORNING INC | 168 | 168 | 1,546 | 171,187 | 建設関連製品 |
| PG&E CORP | — | 2,370 | 2,723 | 301,477 | 電力 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| PNC FINANCIAL | 689 | 698 | 12,397 | 1,372,568 | 銀行 |
| PPG INDUSTRIES | 368 | 398 | 6,081 | 673,232 | 化学 |
| PPL CORPORATION | 1,148 | 1,290 | 3,750 | 415,165 | 電力 |
| PPD INC | — | 200 | 754 | 83,497 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| PVH CORP | 116 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| PTC INC | 170 | 187 | 2,468 | 273,276 | ソフトウェア |
| PACCAR | 538 | 583 | 5,440 | 602,323 | 機械 |
| PACKAGING CORP OP AMERICA | 145 | 161 | 2,180 | 241,430 | 容器・包装 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 152 | 156 | 4,960 | 549,227 | ソフトウェア |
| PARKER HANNIFIN CORP | 201 | 216 | 6,854 | 758,842 | 機械 |
| PAYCHEX INC | 505 | 548 | 5,437 | 602,019 | 情報技術サービス |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 75 | 81 | 2,917 | 323,000 | ソフトウェア |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 1,747 | 1,845 | 43,641 | 4,831,564 | 情報技術サービス |
| PELTON INTERACTIVE INC-A | — | 402 | 4,308 | 476,964 | レジャー用品 |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC | 710 | — | — | — | 銀行 |
| PEPSICO INC | 2,182 | 2,290 | 32,641 | 3,613,758 | 飲料 |
| PERKINELMER INC | 174 | 188 | 2,401 | 265,850 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| PFIZER INC | 8,658 | 9,210 | 33,257 | 3,681,916 | 医薬品 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 2,437 | 2,586 | 23,105 | 2,558,055 | タバコ |
| PHILLIPS 66 | 703 | 711 | 5,852 | 647,901 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 170 | 191 | 1,541 | 170,687 | 電力 |
| PINTEREST INC- CLASS A | 460 | 847 | 5,870 | 649,929 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 261 | 335 | 5,380 | 595,705 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PLUG POWER INC | — | 776 | 2,641 | 292,440 | 電気設備 |
| POLARIS INC | 83 | — | — | — | レジャー用品 |
| POOL CORP | — | 65 | 2,225 | 246,374 | 販売 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 366 | 382 | 6,578 | 728,339 | 資本市場 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 444 | 444 | 2,692 | 298,077 | 保険 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 3,899 | 4,109 | 55,656 | 6,161,720 | 家庭用品 |
| PROGRESSIVE CO | 920 | 961 | 9,182 | 1,016,578 | 保険 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 630 | 666 | 6,132 | 678,932 | 保険 |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE | 781 | 858 | 5,131 | 568,130 | 総合公益事業 |
| PULTEGROUP INC | 379 | 430 | 2,268 | 251,117 | 家庭用耐久財 |
| QORVO INC | 176 | 194 | 3,446 | 381,509 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUALCOMM INC | 1,791 | 1,868 | 24,304 | 2,690,756 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 205 | 219 | 2,813 | 311,530 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| RPM INTERNATIONAL INC | 211 | 211 | 1,976 | 218,811 | 化学 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 78 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 196 | 196 | 2,406 | 266,422 | 資本市場 |
| RAYTHEON COMPANY | 433 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | — | 2,506 | 19,501 | 2,159,032 | 航空宇宙・防衛 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 127 | 175 | 8,246 | 912,929 | バイオテクノロジー |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 1,500 | 1,620 | 3,387 | 375,021 | 銀行 |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 90 | 105 | 1,347 | 149,235 | 保険 |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A | 343 | 361 | 3,625 | 401,381 | 商業サービス・用品 |
| RESMED INC | 225 | 245 | 4,638 | 513,483 | ヘルスケア機器・用品 |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 119 | 125 | 3,584 | 396,826 | ソフトウェア |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 171 | 203 | 1,574 | 174,309 | 専門サービス |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 178 | 196 | 5,245 | 580,756 | 電気設備 |
| ROKU INC | 142 | 175 | 5,484 | 607,162 | 娯楽 |
| ROLLINS INC | 239 | 358 | 1,216 | 134,626 | 商業サービス・用品 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 164 | 175 | 7,088 | 784,817 | コンサルティング |
| ROSS STORES INC | 561 | 598 | 7,198 | 796,970 | 専門小売り |
| S&P GLOBAL INC | 384 | 396 | 13,970 | 1,546,628 | 資本市場 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-----------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 191 | 191 | 1,171 | 129,707 | 資本市場 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 367 | 370 | 2,537 | 280,881 | ソフトウェア |
| SVB FINANCIAL GROUP | 81 | 87 | 4,268 | 472,592 | 銀行 |
| SABRE CORP | 420 | — | — | — | 情報技術サービス |
| SALESFORCE.COM INC | 1,304 | 1,508 | 31,668 | 3,505,964 | ソフトウェア |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC | 112 | 126 | 921 | 101,970 | バイオテクノロジー |
| HENRY SCHEIN INC | 231 | 231 | 1,593 | 176,383 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD | 2,140 | 2,340 | 6,369 | 705,165 | エネルギー設備・サービス |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 1,797 | 2,539 | 16,442 | 1,820,356 | 資本市場 |
| SEAGEN INC | — | 207 | 2,846 | 315,131 | バイオテクノロジー |
| SEALED AIR CORP | 219 | 265 | 1,234 | 136,627 | 容器・包装 |
| SEATTLE GENETICS INC | 187 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| SEMPRA ENERGY | 436 | 473 | 6,223 | 688,977 | 総合公益事業 |
| SERVICENOW INC | 296 | 323 | 15,763 | 1,745,137 | ソフトウェア |
| SHERWIN-WILLIAMS | 129 | 134 | 10,021 | 1,109,506 | 化学 |
| SIGNATURE BANK | 89 | — | — | — | 銀行 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 2,290 | 1,750 | 1,071 | 118,570 | メディア |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 272 | 271 | 4,837 | 535,573 | 半導体・半導体製造装置 |
| SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A | — | 761 | 3,082 | 341,213 | ソフトウェア |
| SMITH (A. O.) CORP | 218 | 218 | 1,508 | 166,988 | 建設関連製品 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 174 | 186 | 2,391 | 264,710 | 食品 |
| SNAP-ON INC | 84 | 84 | 1,949 | 215,788 | 機械 |
| SNAP INC-A | 1,170 | 1,522 | 7,550 | 835,931 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | — | 39 | 866 | 95,882 | 情報技術サービス |
| SOLAREdge TECHNOLOGIES INC | — | 82 | 2,223 | 246,174 | 半導体・半導体製造装置 |
| SOUTHERN CO. | 1,647 | 1,767 | 10,874 | 1,203,873 | 電力 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 198 | 249 | 1,541 | 170,665 | 旅客航空輸送業 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A | 146 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| SPLUNK INC | 237 | 270 | 3,562 | 394,420 | ソフトウェア |
| SPRINT CORP | 1,290 | — | — | — | 無線通信サービス |
| SQUARE INC - A | 531 | 636 | 13,535 | 1,498,569 | 情報技術サービス |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 239 | 259 | 5,190 | 574,653 | 機械 |
| STARBUCKS CORP | 1,852 | 1,949 | 21,491 | 2,379,337 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STATE STREET CORP | 559 | 596 | 5,144 | 569,500 | 資本市場 |
| STEEL DYNAMICS | 334 | 334 | 1,712 | 189,618 | 金属・鉱業 |
| STRYKER CORP | 529 | 565 | 13,735 | 1,520,618 | ヘルスケア機器・用品 |
| SUNRUN INC | — | 185 | 1,071 | 118,627 | 電気設備 |
| SYNOPSIS INC | 239 | 255 | 6,109 | 676,415 | ソフトウェア |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 940 | 860 | 3,531 | 390,934 | 消費者金融 |
| SYSCO CORP | 758 | 813 | 6,495 | 719,067 | 食品・生活必需品小売り |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 412 | — | — | — | 資本市場 |
| TJX COS INC | 1,898 | 2,003 | 13,323 | 1,475,095 | 専門小売り |
| T-MOBILE US INC | 530 | 931 | 11,603 | 1,284,677 | 無線通信サービス |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 181 | 194 | 3,435 | 380,349 | 娯楽 |
| TAPESTRY INC | 450 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| TARGET CORP | 788 | 836 | 16,690 | 1,847,831 | 複合小売り |
| TARGA RESOURCES CORP | 348 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TELADOC HEALTH INC | — | 193 | 3,372 | 373,367 | ヘルスケア・テクノロジー |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 57 | 58 | 2,349 | 260,126 | 航空宇宙・防衛 |
| TELEFLEX INC | 71 | 75 | 3,135 | 347,165 | ヘルスケア機器・用品 |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A | — | 100 | 1,682 | 186,236 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| TERADYNE INC | 250 | 272 | 3,154 | 349,191 | 半導体・半導体製造装置 |
| TESLA INC | 212 | 1,256 | 79,872 | 8,842,630 | 自動車 |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 1,670 | 1,730 | 1,960 | 217,001 | 医薬品 |

| 銘柄 | 株数 | 当期末 | | | | 業種等 |
|------------------------------|-------|-------|--------|-----------|-------------------------|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 1,465 | 1,521 | 28,281 | 3,131,041 | 半導体・半導体製造装置 | |
| TEXTRON INC | 335 | 379 | 2,095 | 231,991 | 航空宇宙・防衛 | |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | — | 68 | 4,293 | 475,337 | ソフトウェア | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 628 | 655 | 29,571 | 3,273,836 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| 3M CORP | 902 | 956 | 18,607 | 2,060,045 | コングロマリット | |
| TIFFANY & CO | 169 | — | — | — | 専門小売り | |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 178 | 195 | 3,452 | 382,223 | 専門小売り | |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | — | 164 | 1,201 | 133,014 | 資本市場 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 76 | 86 | 5,074 | 561,807 | 航空宇宙・防衛 | |
| TRUNSONIC | 290 | 311 | 2,788 | 308,741 | 専門サービス | |
| TRAVELERS COS INC/THE | 408 | 426 | 6,561 | 726,443 | 保険 | |
| TRIMBLE INC | 388 | 422 | 3,208 | 355,255 | 電子装置・機器・部品 | |
| TRIPADVISOR INC | 146 | — | — | — | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 2,085 | 2,253 | 13,243 | 1,466,147 | 銀行 | |
| TWILIO INC - A | 186 | 233 | 7,483 | 828,549 | 情報技術サービス | |
| TWITTER INC | 1,147 | 1,328 | 8,365 | 926,097 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 61 | 65 | 2,700 | 298,988 | ソフトウェア | |
| TYSON FOODS INC-CL A | 469 | 501 | 3,805 | 421,262 | 食品 | |
| UGI CORP | 309 | 360 | 1,495 | 165,600 | ガス | |
| US BANCORP | 2,305 | 2,231 | 12,464 | 1,379,955 | 銀行 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 655 | 1,615 | 8,633 | 955,846 | 陸運・鉄道 | |
| ULTA BEAUTY INC | 85 | 86 | 2,648 | 293,248 | 専門小売り | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 240 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 250 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| UNION PAC CORP | 1,088 | 1,113 | 24,611 | 2,724,768 | 陸運・鉄道 | |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 92 | — | — | — | 旅客航空輸送業 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 1,099 | 1,174 | 19,798 | 2,191,873 | 航空貨物・物流サービス | |
| UNITED RENTALS INC | 112 | 122 | 4,065 | 450,054 | 商社・流通業 | |
| UNITED TECHNOLOGIES | 1,286 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 1,482 | 1,572 | 58,723 | 6,501,293 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 118 | 130 | 1,770 | 196,008 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| UNUM GROUP | 312 | — | — | — | 保険 | |
| V F CORP | 525 | 563 | 4,511 | 499,448 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| VAIL RESORTS INC | 60 | 67 | 1,944 | 215,228 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| VALERO ENERGY CORP | 628 | 665 | 4,773 | 528,459 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 142 | 153 | 2,707 | 299,695 | ヘルスケア機器・用品 | |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 207 | 227 | 5,662 | 626,846 | ヘルスケア・テクノロジー | |
| VERISIGN INC | 162 | 176 | 3,429 | 379,703 | 情報技術サービス | |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 6,468 | 6,857 | 40,175 | 4,447,792 | 各種電気通信サービス | |
| VERISK ANALYTICS INC | 242 | 260 | 4,574 | 506,465 | 専門サービス | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS | 404 | 436 | 9,286 | 1,028,093 | バイオテクノロジー | |
| VIACOMCBS INC-CLASS B | 880 | 951 | 4,432 | 490,734 | メディア | |
| VIATRIS INC | — | 2,007 | 2,840 | 314,441 | 医薬品 | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 2,678 | 2,804 | 59,416 | 6,578,029 | 情報技術サービス | |
| VISTRA CORP | 590 | 700 | 1,246 | 138,022 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| VMWARE INC - CLASS A | 130 | 142 | 2,132 | 236,110 | ソフトウェア | |
| VOYA FINANCIAL INC | 217 | 217 | 1,381 | 152,913 | 各種金融サービス | |
| VULCAN MATERIALS CO | 208 | 223 | 3,840 | 425,207 | 建設資材 | |
| WABCO HOLDINGS INC | 81 | — | — | — | 機械 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 498 | 536 | 5,005 | 554,181 | 総合公益事業 | |
| WABTEC CORP | 288 | 288 | 2,295 | 254,183 | 機械 | |
| WALMART INC | 2,225 | 2,348 | 31,871 | 3,528,521 | 食品・生活必需品小売り | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,182 | 1,203 | 6,373 | 705,609 | 食品・生活必需品小売り | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 403 | 445 | 4,794 | 530,791 | 商業サービス・用品 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------------|---------|-------|--------|-----------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 668 | 693 | 8,959 | 991,862 | 商業サービス・用品 |
| WATERS CORP | 103 | 105 | 2,966 | 328,405 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| WAYFAIR INC - CLASS A | 86 | 115 | 3,645 | 403,618 | インターネット販売・通信販売 |
| WELLS FARGO CO | 6,291 | 6,500 | 25,603 | 2,834,563 | 銀行 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 118 | 124 | 3,451 | 382,106 | ヘルスケア機器・用品 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 476 | 516 | 3,377 | 373,949 | コンピュータ・周辺機器 |
| WESTERN UNION CO | 660 | 660 | 1,639 | 181,502 | 情報技術サービス |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 50 | — | — | — | 化学 |
| WESTROCK CO | 387 | 432 | 2,299 | 254,533 | 容器・包装 |
| WHIRLPOOL CORP | 94 | 103 | 2,268 | 251,142 | 家庭用耐久財 |
| WILLIAMS COS | 1,910 | 1,980 | 4,688 | 519,079 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 254 | 291 | 7,077 | 783,604 | ソフトウェア |
| WYNN RESORTS LTD | 155 | 171 | 2,145 | 237,494 | ホテル・レストラン・レジャー |
| XPO LOGISTICS INC | 143 | 143 | 1,774 | 196,405 | 航空貨物・物流サービス |
| XCEL ENERGY INC | 812 | 885 | 5,841 | 646,755 | 電力 |
| XILINX INC | 399 | 412 | 4,956 | 548,718 | 半導体・半導体製造装置 |
| XYLEM INC | 278 | 303 | 3,177 | 351,821 | 機械 |
| XEROX HOLDINGS CORP | 289 | — | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| YUM BRANDS INC | 471 | 508 | 5,576 | 617,353 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 84 | 89 | 4,225 | 467,859 | 電子装置・機器・部品 |
| ZENDESK INC | — | 188 | 2,399 | 265,663 | ソフトウェア |
| ZILLOW GROUP INC - A | — | 98 | 1,240 | 137,312 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ZILLOW GROUP INC - C | 202 | 246 | 3,044 | 337,056 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 319 | 349 | 5,626 | 622,918 | ヘルスケア機器・用品 |
| ZIONS BANCORP NA | 275 | — | — | — | 銀行 |
| ZOETIS INC | 740 | 794 | 12,468 | 1,380,440 | 医薬品 |
| ZSCALER INC | — | 119 | 1,972 | 218,419 | ソフトウェア |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | — | 323 | 10,116 | 1,119,946 | ソフトウェア |
| ALLEGION PLC | 148 | 148 | 1,854 | 205,288 | 建設関連製品 |
| ALLERGAN PLC | 510 | — | — | — | 医薬品 |
| AMCOR PLC | 2,500 | 2,680 | 3,146 | 348,329 | 容器・包装 |
| AON PLC | — | 375 | 8,703 | 963,550 | 保険 |
| AON PLC | 369 | — | — | — | 保険 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 639 | 650 | 2,545 | 281,801 | 保険 |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 212 | 212 | 1,066 | 118,033 | 保険 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 292 | 360 | 1,064 | 117,853 | 化学 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 995 | 1,050 | 29,247 | 3,238,018 | 情報技術サービス |
| BUNGE LIMITED | 220 | 220 | 1,755 | 194,386 | 食品 |
| CAPRI HOLDINGS LTD | 199 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 351 | 326 | 1,681 | 186,123 | 飲料 |
| EATON CORP PLC | 645 | 654 | 9,133 | 1,011,199 | 電気設備 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 62 | 62 | 1,576 | 174,545 | 保険 |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC | — | 359 | 3,127 | 346,297 | 医薬品 |
| IHS MARKIT LTD | 593 | 638 | 6,182 | 684,504 | 専門サービス |
| INVESCO LTD | 580 | 680 | 1,692 | 187,378 | 資本市場 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 90 | 90 | 1,498 | 165,888 | 医薬品 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 1,200 | 1,185 | 7,196 | 796,725 | 建設関連製品 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 240 | 240 | 609 | 67,435 | 各種電気通信サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C | 640 | 640 | 1,616 | 178,978 | 各種電気通信サービス |
| LINDE PLC | 842 | 872 | 24,351 | 2,695,951 | 化学 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 990 | 1,128 | 5,338 | 591,061 | 半導体・半導体製造装置 |
| MEDTRONIC PLC | 2,099 | 2,230 | 26,499 | 2,933,714 | ヘルスケア機器・用品 |
| APTIV PLC | 392 | 454 | 6,232 | 690,051 | 自動車部品 |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 540 | — | — | — | 専門サービス |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 | | 期 末 | | 業 種 等 |
|--|--------------|---------|---------|-----------|-------------|--------------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 330 | — | — | — | | ホテル・レストラン・レジャー |
| NOVOCURE LTD | — | 140 | 1,753 | 194,129 | | ヘルスケア機器・用品 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 67 | 78 | 1,284 | 142,181 | | 保険 |
| ROYALTY PHARMA PLC-CL A | — | 289 | 1,260 | 139,595 | | 医薬品 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 373 | 373 | 2,823 | 312,601 | | コンピュータ・周辺機器 |
| PENTAIR PLC | 232 | 275 | 1,707 | 189,004 | | 機械 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 245 | 245 | 1,419 | 157,101 | | 電気設備 |
| STERIS PLC | 129 | 138 | 2,622 | 290,327 | | ヘルスケア機器・用品 |
| TECHNIPPMC PLC | 610 | — | — | — | | エネルギー設備・サービス |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 376 | 403 | 6,728 | 744,866 | | 建設関連製品 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 202 | 218 | 5,064 | 560,675 | | 保険 |
| PERRIGO CO PLC | 196 | — | — | — | | 医薬品 |
| CHUBB LTD | 712 | 743 | 12,000 | 1,328,541 | | 保険 |
| GARMIN LTD | 205 | 242 | 3,163 | 350,249 | | 家庭用耐久財 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 524 | 554 | 7,062 | 781,877 | | 電子装置・機器・部品 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | 189 | 187 | 2,139 | 236,901 | | ソフトウェア |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 55 | 71 | 904 | 100,102 | | ソフトウェア |
| WIX.COM LTD | 77 | 94 | 2,509 | 277,849 | | 情報技術サービス |
| AERCAP HOLDINGS NV | 170 | — | — | — | | 商社・流通業 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 421 | 452 | 4,747 | 525,579 | | 化学 |
| MYLAN NV | 770 | — | — | — | | 医薬品 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 432 | 468 | 9,255 | 1,024,691 | | 半導体・半導体製造装置 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 266 | 386 | 3,294 | 364,735 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| FLEX LTD | 760 | — | — | — | | 電子装置・機器・部品 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 465,696 | 519,005 | 5,756,681 | 637,322,181 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 608 | 593 | — | < 68.7% > | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 377 | 410 | 2,938 | 257,938 | | 金属・鉱業 |
| AIR CANADA | 204 | 320 | 853 | 74,943 | | 旅客航空輸送業 |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 850 | 970 | 1,918 | 168,419 | | 総合公益事業 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B | 1,342 | 1,450 | 5,955 | 522,743 | | 食品・生活必需品小売り |
| ALTAGAS LTD | 420 | 420 | 878 | 77,127 | | ガス |
| ATCO LTD CL1 | 130 | 130 | 545 | 47,848 | | 総合公益事業 |
| AURORA CANNABIS INC | 2,000 | — | — | — | | 医薬品 |
| BCE INC | 227 | 256 | 1,474 | 129,436 | | 各種電気通信サービス |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC | — | 370 | 1,064 | 93,408 | | 電気設備 |
| BANK OF MONTREAL | 990 | 1,056 | 11,950 | 1,049,037 | | 銀行 |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX | 1,893 | 1,994 | 15,862 | 1,392,390 | | 銀行 |
| BARRICK GOLD | 2,770 | 2,990 | 7,367 | 646,706 | | 金属・鉱業 |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 510 | 510 | 2,000 | 175,624 | | 医薬品 |
| BLACKBERRY LTD | 710 | 940 | 1,107 | 97,200 | | ソフトウェア |
| BOMBARDIER B SHEARS | 2,800 | — | — | — | | 航空宇宙・防衛 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 1,402 | 2,108 | 12,076 | 1,060,095 | | 資本市場 |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | — | 187 | 1,094 | 96,069 | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| B2GOLD CORP | — | 1,750 | 931 | 81,723 | | 金属・鉱業 |
| CAE INC | 410 | 500 | 1,791 | 157,213 | | 航空宇宙・防衛 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 247 | 247 | 1,721 | 151,077 | | 容器・包装 |
| CGI INC | 384 | 372 | 3,869 | 339,701 | | 情報技術サービス |
| CI FINANCIAL CORP | 336 | — | — | — | | 資本市場 |
| CAMECO CORP | 560 | 720 | 1,460 | 128,172 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 696 | 750 | 9,312 | 817,407 | | 銀行 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 1,124 | 1,186 | 17,378 | 1,525,481 | | 陸運・鉄道 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 1,870 | 1,990 | 7,709 | 676,718 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 213 | 221 | 10,326 | 906,474 | | 陸運・鉄道 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|-------------------------------------|---------|-------|--------|-----------|----|--|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダドル | 千円 | | | |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A | 86 | 102 | 1,811 | 158,970 | | | 複合小売り |
| CANADIAN UTILITIES LTD A | 203 | 203 | 689 | 60,514 | | | 総合公益事業 |
| CANOPY GROWTH CORP | 330 | 350 | 1,406 | 123,445 | | | 医薬品 |
| CENOVUS ENERGY INC | 1,560 | 2,160 | 2,075 | 182,210 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 32 | 34 | 5,956 | 522,896 | | | ソフトウェア |
| CRONOS GROUP INC | 250 | — | — | — | | | 医薬品 |
| DOLLARAMA INC | 466 | 466 | 2,434 | 213,690 | | | 複合小売り |
| EMERA INC | 379 | 425 | 2,374 | 208,431 | | | 電力 |
| EMPIRE CO LTD A | 260 | 260 | 1,027 | 90,150 | | | 食品・生活必需品小売り |
| ENBRIDGE INC | 3,178 | 3,330 | 15,397 | 1,351,629 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 41 | 41 | 2,301 | 202,055 | | | 保険 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 990 | 930 | 2,250 | 197,557 | | | 金属・鉱業 |
| FIRSTSERVICE CORP | — | 60 | 1,106 | 97,151 | | | 不動産管理・開発 |
| FORTIS INC | 682 | — | — | — | | | 電力 |
| FORTIS INC | — | 753 | 4,109 | 360,764 | | | 電力 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 293 | 323 | 5,048 | 443,184 | | | 金属・鉱業 |
| GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT | — | 300 | 1,294 | 113,631 | | | 商業サービス・用品 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 318 | 318 | 1,227 | 107,748 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| GREAT-WEST LIFE CO INC | 420 | 420 | 1,411 | 123,875 | | | 保険 |
| HUSKY ENERGY INC | 520 | — | — | — | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HYDRO ONE LTD | 490 | 550 | 1,625 | 142,664 | | | 電力 |
| IGM FINANCIAL INC | 150 | 150 | 575 | 50,548 | | | 資本市場 |
| IA FINANCIAL CORP INC | 183 | 183 | 1,267 | 111,241 | | | 保険 |
| IMPERIAL OIL | 375 | 375 | 1,164 | 102,241 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 215 | 245 | 3,773 | 331,258 | | | 保険 |
| INTER PIPELINE LTD | 600 | 750 | 1,356 | 119,095 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KEYERA CORP | 340 | 340 | 889 | 78,075 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KINROSS GOLD CORP | 1,980 | 2,170 | 1,768 | 155,243 | | | 金属・鉱業 |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 441 | 427 | 1,720 | 151,052 | | | 金属・鉱業 |
| LOBLAW COMPANIES | 285 | 285 | 2,000 | 175,621 | | | 食品・生活必需品小売り |
| LUNDIN MINING CORP | 950 | 1,180 | 1,522 | 133,618 | | | 金属・鉱業 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 451 | 482 | 5,398 | 473,913 | | | 自動車部品 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 3,030 | 3,260 | 8,883 | 779,793 | | | 保険 |
| METHANEX CORP | 86 | — | — | — | | | 化学 |
| METRO INC | 396 | 435 | 2,522 | 221,430 | | | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 523 | 550 | 4,716 | 414,040 | | | 銀行 |
| NORTHLAND POWER INC | — | 300 | 1,344 | 118,055 | | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| NUTRIEN LTD | 900 | 961 | 6,617 | 580,879 | | | 化学 |
| ONEX CORPORATION | 132 | 132 | 1,037 | 91,085 | | | 各種金融サービス |
| OPEN TEXT CORP | 417 | 470 | 2,812 | 246,879 | | | ソフトウェア |
| OVINTIV INC | 410 | — | — | — | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | — | 353 | 1,307 | 114,773 | | | 金属・鉱業 |
| PARKLAND FUEL CORP | 217 | — | — | — | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PARKLAND CORP | — | 217 | 832 | 73,088 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 880 | 880 | 3,173 | 278,550 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 869 | 970 | 3,218 | 282,516 | | | 保険 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 310 | — | — | — | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| QUEBECOR INC-CL B | 270 | 270 | 935 | 82,075 | | | メディア |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 433 | 494 | 4,096 | 359,612 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| RITCHIE BROS. AUCTIONEERS | — | 183 | 1,344 | 117,988 | | | 商業サービス・用品 |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B | 555 | 582 | 3,471 | 304,688 | | | 無線通信サービス |
| ROYAL BANK OF CANADA | 2,248 | 2,348 | 27,504 | 2,414,342 | | | 銀行 |
| SSR MINING INC | — | 340 | 592 | 52,050 | | | 金属・鉱業 |
| SAPUTO INC | 366 | 410 | 1,545 | 135,681 | | | 食品 |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | | 業種等 | |
|------------------------------|---------|---------|--------|-----------|----------------|--|
| | | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダドル | 千円 | | |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 770 | 770 | 2,562 | 224,941 | メディア | |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 163 | 182 | 24,159 | 2,120,762 | 情報技術サービス | |
| STARS GROUP INC/THE | 380 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 923 | 988 | 6,332 | 555,831 | 保険 | |
| SUNCOR ENERGY INC | 2,440 | 2,490 | 6,635 | 582,494 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| TMX GROUP LTD | — | 95 | 1,228 | 107,874 | 資本市場 | |
| TC ENERGY CORP | 1,470 | 1,580 | 9,222 | 809,547 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 820 | 790 | 1,926 | 169,135 | 金属・鉱業 | |
| TELUS CORP | 586 | 586 | 1,481 | 130,037 | 各種電気通信サービス | |
| THOMSON REUTERS CORP | 317 | 278 | 3,076 | 270,066 | 専門サービス | |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | — | 128 | 1,220 | 107,111 | 商社・流通業 | |
| TORONTO DOMINION BANK | 2,841 | 3,007 | 24,846 | 2,181,055 | 銀行 | |
| WSP GLOBAL INC | 157 | 198 | 2,356 | 206,896 | 建設・土木 | |
| WEST FRASER TIMBER | 84 | 140 | 1,169 | 102,651 | 紙製品・林産品 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 123 | 123 | 1,376 | 120,871 | 食品・生活必需品小売り | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 716 | 761 | 3,622 | 317,970 | 金属・鉱業 | |
| YAMANA GOLD INC | — | 1,640 | 877 | 77,018 | 金属・鉱業 | |
| 小計 | 株数・金額 | 62,765 | 66,371 | 364,630 | 32,007,240 | |
| | 銘柄数<比率> | 84 | 87 | — | <3.5%> | |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | | |
| ANTOFAGASTA PLC | 590 | 620 | 1,048 | 159,600 | 金属・鉱業 | |
| ASHTED GROUP PLC | 687 | 735 | 3,174 | 483,248 | 商社・流通業 | |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 1,590 | 1,590 | 1,203 | 183,277 | 家庭用耐久財 | |
| AVIVA PLC | 6,040 | 6,700 | 2,761 | 420,419 | 保険 | |
| DIAGEO PLC | 3,681 | 3,901 | 11,820 | 1,799,363 | 飲料 | |
| SCHRODERS PLC | 197 | 197 | 678 | 103,313 | 資本市場 | |
| DCC PLC | 160 | 160 | 1,009 | 153,691 | コングロマリット | |
| BAE SYSTEMS PLC | 5,020 | 5,470 | 2,806 | 427,174 | 航空宇宙・防衛 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 3,597 | 3,830 | 10,609 | 1,615,023 | タバコ | |
| HALMA PLC | 590 | 650 | 1,532 | 233,223 | 電子装置・機器・部品 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 4,140 | 4,430 | 2,275 | 346,361 | 銀行 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 1,490 | 1,610 | 2,409 | 366,777 | タバコ | |
| HSBC HOLDINGS PLC | 31,810 | 33,620 | 14,478 | 2,204,054 | 銀行 | |
| LEGAL & GENERAL | 9,400 | 10,100 | 2,884 | 439,116 | 保険 | |
| MEGGITT PLC | 1,110 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 | |
| MORRISON SUPERMARKETS | 3,700 | 3,700 | 673 | 102,539 | 食品・生活必需品小売り | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 541 | 620 | 1,501 | 228,500 | 食品 | |
| PEARSON | 1,260 | 1,260 | 976 | 148,652 | メディア | |
| PERSIMMON PLC | 480 | 526 | 1,565 | 238,297 | 家庭用耐久財 | |
| PRUDENTIAL PLC | 4,100 | 4,280 | 6,751 | 1,027,811 | 保険 | |
| RIO TINTO PLC-REG | 1,749 | 1,850 | 10,319 | 1,570,907 | 金属・鉱業 | |
| ST JAMES S PLACE PLC | 810 | 950 | 1,214 | 184,894 | 資本市場 | |
| SSE PLC | 1,650 | 1,770 | 2,539 | 386,521 | 電力 | |
| BP PLC | 31,780 | 33,390 | 10,067 | 1,532,512 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 110,500 | 115,900 | 4,995 | 760,432 | 銀行 | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 5,000 | 6,200 | 1,134 | 172,767 | 家庭用耐久財 | |
| TESCO PLC | 15,300 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 1,370 | 1,500 | 2,064 | 314,316 | ヘルスケア機器・用品 | |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 7,820 | 8,270 | 10,808 | 1,645,437 | 医薬品 | |
| WEIR GROUP PLC | 380 | — | — | — | 機械 | |
| ASTRAZENECA PLC | 2,055 | 2,179 | 15,882 | 2,417,828 | 医薬品 | |
| BT GROUP PLC | 12,900 | 15,300 | 2,351 | 357,985 | 各種電気通信サービス | |
| CARNIVAL PLC | 229 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー | |
| MARKS & SPENCER PLC | 3,100 | — | — | — | 複合小売り | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|-----------------------------------|---------|--------|--------|-----------|-------------------------|--------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 千英ポンド | 千円 | | | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | | | | | |
| BARCLAYS PLC | 27,400 | 29,200 | 5,522 | 840,749 | 銀行 | | |
| INTERTEK GROUP PLC | 256 | 256 | 1,433 | 218,236 | 専門サービス | | |
| BURBERRY GROUP PLC | 660 | 660 | 1,277 | 194,513 | 繊維・アパレル・贅沢品 | | |
| NEXT PLC | 198 | 219 | 1,758 | 267,640 | 複合小売り | | |
| KINGFISHER PLC | 3,080 | 3,490 | 1,140 | 173,623 | 専門小売り | | |
| ITV PLC | 5,000 | — | — | — | メディア | | |
| SAINSBURY | 2,550 | 2,990 | 730 | 111,242 | 食品・生活必需品小売り | | |
| G4S PLC | 2,190 | — | — | — | 商業サービス・用品 | | |
| ADMIRAL GROUP PLC | 308 | 308 | 936 | 142,489 | 保険 | | |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS | 195 | 195 | 872 | 132,750 | 家庭用耐久財 | | |
| CENTRICA PLC | 9,200 | — | — | — | 総合公益事業 | | |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 6,560 | 6,760 | 9,774 | 1,488,042 | 石油・ガス・消耗燃料 | | |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B | 5,860 | 6,100 | 8,348 | 1,270,886 | 石油・ガス・消耗燃料 | | |
| BUNZLE | 500 | 550 | 1,266 | 192,738 | 商社・流通業 | | |
| RENTOKIL INTIAL PLC | 2,850 | 3,180 | 1,544 | 235,123 | 商業サービス・用品 | | |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | — | 296 | 651 | 99,132 | 医薬品 | | |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 492 | 532 | 3,678 | 559,939 | 資本市場 | | |
| UNILEVER PLC | 1,742 | 4,342 | 17,637 | 2,684,911 | パーソナル用品 | | |
| TUI AG-DI | 700 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー | | |
| EXPERIAN PLC | 1,411 | 1,529 | 3,837 | 584,226 | 専門サービス | | |
| MONDI PLC | 750 | 840 | 1,606 | 244,621 | 紙製品・林産品 | | |
| SEVERN TRENT PLC | 370 | 370 | 848 | 129,209 | 水道 | | |
| WHITBREAD PLC | 211 | 316 | 1,090 | 166,079 | ホテル・レストラン・レジャー | | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 520 | 520 | 808 | 123,093 | 資本市場 | | |
| SMITHS GROUP PLC | 610 | 610 | 937 | 142,679 | コングロマリット | | |
| ANGLO AMERICAN PLC | 1,600 | 2,060 | 5,911 | 899,857 | 金属・鉱業 | | |
| 3I GROUP PLC | 1,550 | 1,670 | 1,949 | 296,806 | 資本市場 | | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 1,102 | 1,190 | 7,725 | 1,176,049 | 家庭用品 | | |
| RELX PLC | 3,000 | 3,240 | 5,900 | 898,163 | 専門サービス | | |
| FRESNILLO PLC | — | 300 | 257 | 39,156 | 金属・鉱業 | | |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 1,060 | 1,060 | 972 | 148,099 | 水道 | | |
| OCADO GROUP PLC | 720 | 830 | 1,684 | 256,492 | インターネット販売・通信販売 | | |
| GLENCORE PLC | 17,000 | 16,800 | 4,805 | 731,562 | 金属・鉱業 | | |
| ENTAIN PLC | 870 | 1,020 | 1,562 | 237,880 | ホテル・レストラン・レジャー | | |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 2,770 | 13,800 | 1,497 | 228,039 | 航空宇宙・防衛 | | |
| EVRAZ PLC | 760 | 760 | 435 | 66,339 | 金属・鉱業 | | |
| NMC HEALTH PLC | 133 | 133 | 3 | 485 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | | |
| EASYJET PLC | 210 | — | — | — | 旅客航空輸送業 | | |
| NATWEST GROUP PLC | 7,700 | 7,700 | 1,519 | 231,269 | 銀行 | | |
| SAGE GROUP PLC (THE) | 1,750 | 1,750 | 1,060 | 161,493 | ソフトウェア | | |
| WPP PLC | 2,000 | 2,000 | 1,894 | 288,445 | メディア | | |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 290 | 340 | 796 | 121,269 | 飲料 | | |
| AVEVA GROUP PLC | 112 | 199 | 669 | 101,843 | ソフトウェア | | |
| COMPASS GROUP PLC | 2,510 | 2,920 | 4,311 | 656,321 | ホテル・レストラン・レジャー | | |
| NATIONAL GRID PLC | 5,480 | 5,910 | 5,064 | 771,025 | 総合公益事業 | | |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 3,660 | 3,660 | 1,063 | 161,911 | 資本市場 | | |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | — | 890 | 658 | 100,258 | 保険 | | |
| BHP GROUP PLC | 3,290 | 3,470 | 7,306 | 1,112,205 | 金属・鉱業 | | |
| VODAFONE GROUP PLC | 42,100 | 45,000 | 6,033 | 918,494 | 無線通信サービス | | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 258 | 288 | 1,442 | 219,649 | ホテル・レストラン・レジャー | | |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC | 481 | — | — | — | ソフトウェア | | |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 193 | 223 | 1,419 | 216,108 | 化学 | | |
| FERGUSON PLC | 346 | 366 | 3,218 | 489,968 | 商社・流通業 | | |
| M&G PLC | 3,780 | 4,400 | 921 | 140,258 | 各種金融サービス | | |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | 業 種 等 | | |
|----------------------------------|--------------|---------|---------|-----------|----------------------|--|
| | | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千英ポンド | 千円 | | |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 1,620 | 1,620 | 1,103 | 167,992 | 保険 | |
| TESCO PLC | — | 13,026 | 2,994 | 455,890 | 食品・生活必需品小売り | |
| INFORMA PLC | 1,860 | 2,480 | 1,410 | 214,663 | メディア | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 1,410 | 1,710 | 950 | 144,734 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 116 | 116 | 1,333 | 202,986 | 機械 | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 2,190 | 2,190 | 690 | 105,082 | 保険 | |
| JD SPORTS FASHION PLC | 760 | 930 | 776 | 118,214 | 専門小売り | |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 7,300 | 8,500 | 1,459 | 222,236 | コングロマリット | |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 302 | 302 | 933 | 142,149 | 化学 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 468,722 | 487,424 | 278,981 | 42,469,387 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 93 | 86 | — | < 4.6% > | |
| (スイス) | | | | 千スイスフラン | | |
| SGS SA-REG | 9 | 9 | 2,665 | 313,074 | 専門サービス | |
| BARRY CALLEBAUT AG | 4 | 4 | 984 | 115,617 | 食品 | |
| SWISSCOM AG-REG | 40 | 44 | 2,258 | 265,298 | 各種電気通信サービス | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 1 | 1 | 1,470 | 172,753 | 食品 | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 0.17 | 0.16 | 1,406 | 165,181 | 食品 | |
| GIVAUDAN-REG | 14 | 15 | 5,607 | 658,647 | 化学 | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 235 | 251 | 10,322 | 1,212,344 | 保険 | |
| NOVARTIS AG-REG | 3,361 | 3,670 | 30,042 | 3,528,505 | 医薬品 | |
| ABB LTD | 2,850 | 3,030 | 8,641 | 1,014,951 | 電気設備 | |
| ROCHE HOLDINGS AG-BEARER | — | 53 | 1,691 | 198,697 | 医薬品 | |
| ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 1,098 | 1,164 | 35,368 | 4,153,988 | 医薬品 | |
| ADECCO GROUP AG-REG | 249 | 249 | 1,609 | 189,040 | 専門サービス | |
| LAFARGEHOLCIM LTD | 774 | 884 | 4,955 | 582,047 | 建設資材 | |
| CLARIANT AG-REG | 320 | 320 | 618 | 72,668 | 化学 | |
| NESTLE SA-REG | 4,652 | 4,774 | 50,575 | 5,940,122 | 食品 | |
| BALOISE HOLDING AG | 74 | 74 | 1,209 | 142,102 | 保険 | |
| TEMENOS AG-REG | 104 | 104 | 1,417 | 166,426 | ソフトウェア | |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 88 | 88 | 2,231 | 262,069 | ヘルスケア機器・用品 | |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG | 16 | 17 | 2,063 | 242,401 | ヘルスケア機器・用品 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 3,960 | 4,120 | 4,290 | 503,975 | 資本市場 | |
| THE SWATCH GROUP AG-B | 47 | 47 | 1,306 | 153,460 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | 74 | 74 | 398 | 46,846 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| LONZA AG-REG | 115 | 121 | 6,438 | 756,183 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 51 | 52 | 2,454 | 288,274 | 保険 | |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 12 | 14 | 1,215 | 142,744 | 化学 | |
| SWISS PRIME SITE-REG | 114 | 135 | 1,190 | 139,847 | 不動産管理・開発 | |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES | 58 | — | — | — | 各種金融サービス | |
| DUFREY AG-REG | 65 | — | — | — | 専門小売り | |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 29 | 31 | 3,868 | 454,412 | 資本市場 | |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 61 | 67 | 1,881 | 220,965 | 機械 | |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 30 | 30 | 823 | 96,684 | 機械 | |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 84 | 84 | 2,283 | 268,251 | 海運業 | |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG | — | 270 | 2,614 | 307,094 | コンピュータ・周辺機器 | |
| GEBERIT AG-REG | 56 | 62 | 3,799 | 446,239 | 建設関連製品 | |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 358 | 358 | 2,195 | 257,832 | 資本市場 | |
| SWISS RE LTD | 462 | 483 | 4,567 | 536,423 | 保険 | |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A | 815 | 857 | 7,934 | 931,860 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| SIKA AG-REG | 199 | 238 | 6,392 | 750,820 | 化学 | |
| ALCON INC | 659 | 827 | 5,507 | 646,893 | ヘルスケア機器・用品 | |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | — | 54 | 505 | 59,427 | 銀行 | |
| UBS GROUP AG | 6,010 | 6,020 | 8,843 | 1,038,654 | 資本市場 | |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|-------------------------------------|---------|--------|-------------|---------|----------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイスフラン | 千円 | | |
| VIFOR PHARMA AG | 67 | 76 | 983 | 115,460 | 医薬品 | |
| 小計 | 株数・金額 | 27,221 | 28,779 | 234,638 | 27,558,293 | |
| | 銘柄数<比率> | 39 | 40 | — | <3.0%> | |
| (スウェーデン) | | | 千スウェーデンクローネ | | | |
| LUNDBERGS AB-B SHS | 126 | 126 | 6,002 | 76,173 | 各種金融サービス | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 2,510 | 2,670 | 29,757 | 377,618 | 銀行 | |
| SWEDBANK AB | 1,370 | 1,480 | 22,999 | 291,859 | 銀行 | |
| SWEDISH MATCH AB | 260 | 260 | 17,643 | 223,897 | タバコ | |
| SECURITAS AB-B SHS | 450 | 540 | 8,059 | 102,275 | 商業サービス・用品 | |
| INVESTOR AB-B SHS | 715 | 767 | 53,429 | 678,016 | 各種金融サービス | |
| HENNES&MAURITZ AB-B | 1,270 | 1,300 | 26,442 | 335,548 | 専門小売り | |
| ERICSSON LM-B | 4,740 | 4,910 | 56,956 | 722,771 | 通信機器 | |
| TELIA CO AB | 4,300 | 4,280 | 16,169 | 205,195 | 各種電気通信サービス | |
| SKANSKA AB-B SHS | 510 | 600 | 13,830 | 175,502 | 建設・土木 | |
| LUNDIN ENERGY AB | 288 | 288 | 8,127 | 103,136 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| ALFA LAVAL AB | 510 | 510 | 13,739 | 174,352 | 機械 | |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR | 158 | — | — | — | 無線通信サービス | |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | — | 151 | 6,570 | 83,373 | 不動産管理・開発 | |
| ICA GRUPPEN AB | 138 | 171 | 7,281 | 92,398 | 食品・生活必需品小売り | |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 550 | 730 | 9,011 | 114,360 | 家庭用耐久財 | |
| ELECTROLUX AB-B | 340 | 340 | 8,136 | 103,248 | 家庭用耐久財 | |
| SKF AB-B SHARES | 580 | 600 | 14,844 | 188,370 | 機械 | |
| VOLVO AB-B SHS | 2,340 | 2,330 | 51,819 | 657,585 | 機械 | |
| SANDVIK AB | 1,780 | 1,840 | 44,086 | 559,456 | 機械 | |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | — | 150 | 4,872 | 61,825 | 各種金融サービス | |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 250 | 250 | 7,735 | 98,157 | 各種金融サービス | |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B | — | 1,000 | 16,190 | 205,451 | 紙製品・林産品 | |
| HEXAGON AB-B SHS | 423 | 456 | 36,270 | 460,269 | 電子装置・機器・部品 | |
| TELE 2 AB-B SHS | 780 | 780 | 9,090 | 115,363 | 無線通信サービス | |
| ATLAS COPCO AB-A | 1,045 | 1,129 | 60,266 | 764,775 | 機械 | |
| ATLAS COPCO AB-B | 627 | 627 | 28,653 | 363,617 | 機械 | |
| EPIROC AB - A | 1,030 | 1,130 | 22,068 | 280,054 | 機械 | |
| EPIROC AB - B | 580 | 690 | 12,361 | 156,865 | 機械 | |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B | 925 | 1,030 | 28,160 | 357,352 | 家庭用品 | |
| EQT AB | — | 420 | 11,915 | 151,206 | 資本市場 | |
| BOLIDEN AB | 440 | 440 | 14,449 | 183,365 | 金属・鉱業 | |
| EVOLUTION GAMING GROUP | — | 273 | 34,520 | 438,069 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| KINNEVIK AB - B | 390 | — | — | — | 各種金融サービス | |
| KINNEVIK AB - B | — | 390 | 16,440 | 208,629 | 各種金融サービス | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A | 2,430 | 2,670 | 25,583 | 324,660 | 銀行 | |
| ASSA ABLOY AB-B | 1,590 | 1,700 | 42,534 | 539,756 | 建設関連製品 | |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | — | 510 | 13,708 | 173,964 | 建設関連製品 | |
| NORDEA BANK ABP | 5,150 | 5,480 | 47,599 | 604,034 | 銀行 | |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | — | 260 | 5,876 | 74,566 | コングロマリット | |
| 小計 | 株数・金額 | 38,595 | 43,278 | 853,201 | 10,827,128 | |
| | 銘柄数<比率> | 32 | 38 | — | <1.2%> | |
| (ノルウェー) | | | 千ノルウェークローネ | | | |
| DNB ASA | 1,450 | 1,550 | 28,287 | 366,606 | 銀行 | |
| TELENOR ASA | 1,160 | 1,160 | 17,469 | 226,406 | 各種電気通信サービス | |
| SCHIBSTED ASA-CL A | — | 106 | 3,826 | 49,592 | メディア | |
| EQUINOR ASA | 1,580 | 1,600 | 26,976 | 349,608 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 262 | 296 | 13,237 | 171,553 | 化学 | |
| MOWI ASA | 690 | 700 | 14,756 | 191,237 | 食品 | |
| NORSK HYDRO | 2,180 | 2,180 | 11,645 | 150,926 | 金属・鉱業 | |

| 銘柄 | 株数 | 当期(前期末) | | 期末 | | 業 種 等 |
|----------------------------------|---------|---------|------------|------------|-----------|-------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千ノルウェークローネ | 千円 | | |
| AKER AB ASA | 180 | — | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ORKLA ASA | 1,150 | 1,330 | 11,278 | 146,168 | | 食品 |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 310 | 310 | 6,212 | 80,512 | | 保険 |
| ADEVINTA ASA | — | 450 | 5,710 | 74,008 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | 129 | 181 | 5,654 | 73,281 | | メディア |
| 小 計 | 株数・金額 | 9,091 | 9,863 | 145,054 | 1,879,901 | |
| | 銘柄数<比率> | 10 | 11 | — | <0.2%> | |
| (デンマーク) | | | | 千デンマーククローネ | | |
| CARLSBERG B | 162 | 168 | 16,574 | 289,231 | | 飲料 |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 10 | 10 | 15,262 | 266,321 | | 海運業 |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A | 6 | 5 | 7,683 | 134,071 | | 海運業 |
| GN STORE NORD A/S | — | 212 | 10,472 | 182,750 | | ヘルスケア機器・用品 |
| DANSKE BANK AS | 970 | 1,090 | 13,134 | 229,197 | | 銀行 |
| GENMAB A/S | 100 | 110 | 22,330 | 389,660 | | バイオテクノロジー |
| ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS | — | 11 | 2,947 | 51,439 | | 建設関連製品 |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 298 | 332 | 41,334 | 721,278 | | 電気設備 |
| H LUNDBECK A/S | 105 | 105 | 2,283 | 39,851 | | 医薬品 |
| DSV PANALPINA A S | 325 | 338 | 41,016 | 715,734 | | 航空貨物・物流サービス |
| PANDORA A/S | 160 | 160 | 10,854 | 189,409 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CHR HANSEN HOLDING A/S | 167 | 182 | 10,326 | 180,200 | | 化学 |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES | 337 | 337 | 13,530 | 236,108 | | 化学 |
| COLOPLAST-B | 185 | 194 | 18,433 | 321,671 | | ヘルスケア機器・用品 |
| AMBU A/S-B | — | 290 | 8,146 | 142,149 | | ヘルスケア機器・用品 |
| NOVO NORDISK A/S-B | 2,772 | 2,842 | 122,404 | 2,135,966 | | 医薬品 |
| ISS A/S | 218 | — | — | — | | 商業サービス・用品 |
| TRYG A/S-NEW | — | 326 | 4,893 | 85,389 | | 保険 |
| TRYG A/S | 199 | 280 | 4,194 | 73,192 | | 保険 |
| ORSTED A/S | 300 | 318 | 31,761 | 554,244 | | 電力 |
| DEMANT A/S | 160 | 160 | 4,248 | 74,127 | | ヘルスケア機器・用品 |
| 小 計 | 株数・金額 | 6,474 | 7,472 | 401,833 | 7,011,995 | |
| | 銘柄数<比率> | 17 | 20 | — | <0.8%> | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | 千ユーロ | | |
| ADIDAS AG | 281 | 313 | 8,294 | 1,076,626 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 642 | 673 | 2,563 | 332,736 | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 168 | 168 | 563 | 73,160 | | 各種電気通信サービス |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD | 105 | 105 | 437 | 56,805 | | 化学 |
| HANNOVER RUECK SE | 96 | 96 | 1,509 | 195,883 | | 保険 |
| GEA GROUP AG | 242 | 242 | 848 | 110,097 | | 機械 |
| CONTINENTAL AG | 175 | 189 | 2,144 | 278,317 | | 自動車部品 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 1,534 | 1,659 | 7,730 | 1,003,476 | | 航空貨物・物流サービス |
| MERCK KGAA | 199 | 211 | 3,079 | 399,724 | | 医薬品 |
| RWE AG | 931 | 1,085 | 3,515 | 456,298 | | 総合公益事業 |
| SAP SE | 1,539 | 1,724 | 17,853 | 2,317,415 | | ソフトウェア |
| E.ON SE | 3,550 | 3,800 | 3,708 | 481,303 | | 総合公益事業 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 163 | 180 | 1,518 | 197,075 | | 家庭用品 |
| PUMA SE | 126 | 163 | 1,341 | 174,167 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BAYER AG-REG | 1,543 | 1,616 | 8,686 | 1,127,442 | | 医薬品 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 277 | 289 | 2,779 | 360,792 | | 家庭用品 |
| BASF SE | 1,445 | 1,512 | 10,868 | 1,410,699 | | 化学 |
| BEIERSDORF AG | 160 | 160 | 1,440 | 186,995 | | パーソナル用品 |
| HOCHTIEF AG | 38 | 38 | 286 | 37,140 | | 建設・土木 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 226 | 249 | 1,951 | 253,261 | | 建設資材 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE | 333 | 366 | 2,307 | 299,482 | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE-REG | 654 | 680 | 14,895 | 1,933,422 | | 保険 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|-----------------------------------|---------|--------|--------|-----------|----------------------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 420 | 560 | 640 | 83,191 | 旅客航空輸送業 | |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 228 | 229 | 6,068 | 787,691 | 保険 | |
| VOLKSWAGEN AG | 51 | 51 | 1,608 | 208,788 | 自動車 | |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 289 | 312 | 7,505 | 974,169 | 自動車 | |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 1,403 | 1,431 | 10,867 | 1,410,538 | 自動車 | |
| NEMETSCHKE SE | — | 92 | 496 | 64,484 | ソフトウェア | |
| THYSSENKRUPP AG | 620 | — | — | — | 金属・鉱業 | |
| SIEMENS AG | 1,201 | 1,263 | 17,818 | 2,312,828 | コングロマリット | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 3,140 | 3,340 | 3,440 | 446,537 | 資本市場 | |
| BAYER MOTOREN WERK | 521 | 559 | 4,963 | 644,316 | 自動車 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 78 | 102 | 691 | 89,698 | 自動車 | |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG | 5,180 | 5,580 | 9,550 | 1,239,612 | 各種電気通信サービス | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 53 | 57 | 2,426 | 314,896 | ヘルスケア機器・用品 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 1,990 | 2,188 | 7,775 | 1,009,202 | 半導体・半導体製造装置 | |
| RATIONAL AG | — | 8 | 568 | 73,743 | 機械 | |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR | 60 | 72 | 920 | 119,436 | ヘルスケア機器・用品 | |
| BECHTLE AG | — | 44 | 696 | 90,465 | 情報技術サービス | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 295 | 320 | 4,528 | 587,734 | 資本市場 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 227 | 254 | 2,342 | 304,041 | 自動車 | |
| FRAPORT AG | 63 | — | — | — | 運送インフラ | |
| WIRECARD AG | 180 | — | — | — | 情報技術サービス | |
| LANXESS | 120 | 127 | 813 | 105,567 | 化学 | |
| MTU AERO ENGINES AG | 84 | 92 | 1,851 | 240,384 | 航空宇宙・防衛 | |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | 562 | 555 | 2,200 | 285,562 | 不動産管理・開発 | |
| SYMRISE AG | 198 | 209 | 2,146 | 278,606 | 化学 | |
| BRENTNAG SE | 238 | 268 | 1,972 | 256,027 | 商社・流通業 | |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 330 | 330 | 1,005 | 130,558 | 化学 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 1,500 | 1,500 | 374 | 48,558 | 各種電気通信サービス | |
| COMMERZBANK AG | 1,580 | 1,580 | 838 | 108,899 | 銀行 | |
| LEG IMMOBILIEN SE | — | 125 | 1,408 | 182,855 | 不動産管理・開発 | |
| KION GROUP AG | 99 | 110 | 918 | 119,221 | 機械 | |
| VONOVIA SE | 795 | 878 | 4,883 | 633,869 | 不動産管理・開発 | |
| KNORR-BREMSE AG | 71 | 127 | 1,348 | 175,066 | 機械 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 239 | 460 | 2,096 | 272,149 | ヘルスケア機器・用品 | |
| METRO AG | 250 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り | |
| TEAMVIEWER AG | — | 252 | 898 | 116,577 | ソフトウェア | |
| SIEMENS ENERGY AG | — | 660 | 2,002 | 259,916 | 電気設備 | |
| ZALANDO SE | 215 | 249 | 2,059 | 267,288 | インターネット販売・通信販売 | |
| SCOUT24 AG | — | 171 | 1,102 | 143,162 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| COVESTRO AG | 269 | 305 | 1,775 | 230,407 | 化学 | |
| HELLOFRESH SE | — | 240 | 1,466 | 190,338 | インターネット販売・通信販売 | |
| QIAGEN N.V. | 354 | 394 | 1,609 | 208,962 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| UNIPER SE | 311 | 311 | 965 | 125,301 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| DELIVERY HERO SE | 179 | 221 | 2,418 | 313,966 | インターネット販売・通信販売 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 37,820 | 41,145 | 217,387 | 28,216,956 |
| 銘 柄 数 < 比 率 > | 58 | 62 | — | < 3.0% > | | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 1,750 | 1,880 | 3,222 | 418,257 | 保険 | |
| INTESA SANPAOLO | 23,300 | 27,800 | 6,459 | 838,421 | 銀行 | |
| MEDIOBANCA S.P.A. | 880 | 1,070 | 1,032 | 133,997 | 銀行 | |
| ENEL SPA | 12,630 | 13,580 | 11,452 | 1,486,471 | 電力 | |
| ENI SPA | 4,030 | 4,110 | 4,279 | 555,457 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| SNAM SPA | 3,200 | 3,500 | 1,653 | 214,565 | ガス | |
| TENARIS SA | 710 | 710 | 685 | 89,006 | エネルギー設備・サービス | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | | |
|-------------------------------------|---------|--------|--------|-----------|-------------------------|-----------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (ユーロ…イタリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | | |
| TELECOM ITALIA SPA | 15,500 | 11,700 | 538 | 69,934 | 各種電気通信サービス | | |
| TELECOM ITALIA-RNC | 8,800 | 8,800 | 431 | 55,992 | 各種電気通信サービス | | |
| ATLANTIA SPA | 790 | 790 | 1,262 | 163,862 | 運送インフラ | | |
| TERNA SPA | 2,220 | 2,220 | 1,434 | 186,148 | 電力 | | |
| RECORDATI SPA | 168 | 168 | 764 | 99,175 | 医薬品 | | |
| LEONARDO SPA | 640 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 | | |
| AMPLIFON SPA | — | 203 | 649 | 84,265 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | | |
| PRYSMIAN SPA | 370 | 430 | 1,168 | 151,646 | 電気設備 | | |
| DIASORIN SPA | — | 40 | 550 | 71,493 | ヘルスケア機器・用品 | | |
| FERRARI NV | 189 | 213 | 3,731 | 484,382 | 自動車 | | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 1,540 | 1,700 | 2,289 | 297,118 | 機械 | | |
| MONCLER SPA | 281 | 321 | 1,579 | 205,037 | 繊維・アパレル・贅沢品 | | |
| NEXI SPA | — | 740 | 1,082 | 140,572 | 情報技術サービス | | |
| STELLANTIS NV | — | 3,340 | 5,044 | 654,778 | 自動車 | | |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA | 910 | 1,010 | 1,414 | 183,537 | 銀行 | | |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 1,700 | — | — | — | 自動車 | | |
| UNICREDIT SPA | 3,130 | 3,610 | 3,299 | 428,327 | 銀行 | | |
| EXOR NV | 172 | 172 | 1,228 | 159,404 | 各種金融サービス | | |
| POSTE ITALIANE SPA | 770 | 880 | 955 | 123,990 | 保険 | | |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | — | 550 | 516 | 66,999 | 各種電気通信サービス | | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | 910 | — | — | — | 飲料 | | |
| PIRELLI & C. SPA | 530 | — | — | — | 自動車部品 | | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 85,120 | 89,537 | 56,724 | 7,362,843 | |
| 銘 柄 数 < 比 率 > | 24 | 25 | — | <0.8%> | | | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | | |
| BOUYGUES | 348 | 400 | 1,377 | 178,812 | 建設・土木 | | |
| AIRBUS SE | 918 | 968 | 9,457 | 1,227,565 | 航空宇宙・防衛 | | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 820 | 870 | 1,875 | 243,468 | 総合公益事業 | | |
| LOREAL-ORD | 394 | 420 | 13,767 | 1,787,034 | パーソナル用品 | | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 435 | 460 | 26,381 | 3,424,253 | 繊維・アパレル・贅沢品 | | |
| DASSAULT AVIATION SA | 3 | 3 | 311 | 40,371 | 航空宇宙・防衛 | | |
| THALES SA | 163 | 186 | 1,584 | 205,696 | 航空宇宙・防衛 | | |
| CAPGEMINI SA | 245 | 273 | 3,958 | 513,813 | 情報技術サービス | | |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA | 83 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り | | |
| INGENICO GROUP | 95 | — | — | — | 電子装置・機器・部品 | | |
| PUBLICIS GROUPE | 321 | 380 | 2,020 | 262,305 | メディア | | |
| FAURECIA | 105 | 150 | 673 | 87,400 | 自動車部品 | | |
| BOLLORE | 1,380 | 1,380 | 563 | 73,082 | 娯楽 | | |
| MICHELIN (CGDE) | 267 | 287 | 3,709 | 481,489 | 自動車部品 | | |
| PERNOD RICARD SA | 335 | 343 | 5,530 | 717,907 | 飲料 | | |
| RENAULT SA | 281 | 337 | 1,268 | 164,669 | 自動車 | | |
| REMY COINTREAU | 40 | 39 | 622 | 80,742 | 飲料 | | |
| SEB SA | 38 | 41 | 630 | 81,872 | 家庭用耐久財 | | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 869 | 887 | 11,375 | 1,476,575 | 電気設備 | | |
| VIVENDI SA | 1,300 | 1,400 | 3,907 | 507,180 | 娯楽 | | |
| ORANGE SA | 3,120 | 3,250 | 3,432 | 445,473 | 各種電気通信サービス | | |
| HERMES INTERNATIONAL | 50 | 53 | 5,049 | 655,443 | 繊維・アパレル・贅沢品 | | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 209 | 223 | 4,032 | 523,477 | ソフトウェア | | |
| KERING SA | 117 | 127 | 7,498 | 973,250 | 繊維・アパレル・贅沢品 | | |
| CNP ASSURANCES | 280 | 280 | 461 | 59,894 | 保険 | | |
| CARREFOUR SUPERMARCHE | 950 | 950 | 1,457 | 189,219 | 食品・生活必需品小売り | | |
| ATOS SE | 153 | 153 | 1,009 | 131,072 | 情報技術サービス | | |
| SANOFI | 1,767 | 1,869 | 15,673 | 2,034,411 | 医薬品 | | |
| ACCOR SA | 262 | 320 | 1,041 | 135,241 | ホテル・レストラン・レジャー | | |

| 銘柄 | 株数 | 当期末 | | | | 業種等 |
|----------------------------|-------|--------|--------|-----------|-------------------------|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | 業種等 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| STMICROELECTRONICS NV | 1,050 | 1,078 | 3,439 | 446,498 | 半導体・半導体製造装置 | |
| SOCIETE GENERALE | 1,270 | 1,290 | 2,910 | 377,832 | 銀行 | |
| TELEPERFORMANCE | 90 | 96 | 2,966 | 385,038 | 専門サービス | |
| EURAZEO SE | 59 | 59 | 389 | 50,495 | 各種金融サービス | |
| SODEXO | 132 | 138 | 1,139 | 147,884 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| AXA SA | 3,010 | 3,170 | 7,338 | 952,543 | 保険 | |
| PEUGEOT CITROEN | 880 | — | — | — | 自動車 | |
| JC DECAUX SA | 150 | — | — | — | メディア | |
| ESSILORLUXOTTICA | 439 | 478 | 6,596 | 856,212 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 1,840 | 1,840 | 2,296 | 298,062 | 銀行 | |
| BNP PARIBAS | 1,739 | 1,850 | 9,734 | 1,263,564 | 銀行 | |
| ORPEA | — | 93 | 925 | 120,158 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD) | 790 | 828 | 4,250 | 551,773 | 建設関連製品 | |
| WENDEL | 43 | 43 | 455 | 59,162 | 各種金融サービス | |
| ILIAD SA | 24 | 24 | 387 | 50,279 | 各種電気通信サービス | |
| SES FDR | 560 | 560 | 381 | 49,515 | メディア | |
| SAFRAN SA | 508 | 538 | 6,270 | 813,896 | 航空宇宙・防衛 | |
| ENGIE | 2,900 | 3,080 | 3,706 | 481,140 | 総合公益事業 | |
| ALSTOM | 303 | 433 | 1,849 | 240,044 | 機械 | |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 241 | — | — | — | メディア | |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 940 | 1,090 | 1,235 | 160,369 | 電力 | |
| IPSEN | 55 | 55 | 385 | 49,973 | 医薬品 | |
| ARKEMA | 99 | 116 | 1,205 | 156,515 | 化学 | |
| LEGRAND SA | 410 | 452 | 3,570 | 463,489 | 電気設備 | |
| EIFFAGE SA | 121 | 141 | 1,225 | 159,115 | 建設・土木 | |
| TOTAL SE | 3,762 | 4,159 | 16,739 | 2,172,848 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| ADP | 47 | 47 | 479 | 62,226 | 運送インフラ | |
| NATIXIS | 1,580 | 1,580 | 640 | 83,100 | 資本市場 | |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 144 | 144 | 921 | 119,586 | 娯楽 | |
| SCOR SE | 232 | 232 | 689 | 89,497 | 保険 | |
| VINCI | 810 | 873 | 7,717 | 1,001,708 | 建設・土木 | |
| DANONE | 972 | 1,038 | 6,103 | 792,226 | 食品 | |
| AIR LIQUIDE SA | 734 | 791 | 10,998 | 1,427,651 | 化学 | |
| BUREAU VERITAS SA | 470 | 470 | 1,136 | 147,573 | 専門サービス | |
| GETLINK | 720 | 720 | 952 | 123,642 | 運送インフラ | |
| SUEZ | 520 | 520 | 936 | 121,492 | 総合公益事業 | |
| EDENRED | 382 | 424 | 1,892 | 245,622 | 情報技術サービス | |
| VALEO SA | 373 | 373 | 1,094 | 142,099 | 自動車部品 | |
| BIOMERIEUX | 69 | 69 | 735 | 95,473 | ヘルスケア機器・用品 | |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | — | 154 | 599 | 77,877 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| FAURECIA | — | 56 | 253 | 32,854 | 自動車部品 | |
| WORLDLINE SA | 198 | 386 | 2,738 | 355,436 | 情報技術サービス | |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 41 | 45 | 1,564 | 203,070 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| AMUNDI SA | 100 | 100 | 702 | 91,184 | 資本市場 | |
| 小計 | 株数・金額 | 44,157 | 45,686 | 248,231 | 32,220,466 | |
| 銘柄数<比率> | | 70 | 68 | — | <3.5%> | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| ASM INTERNATIONAL NV | — | 78 | 1,866 | 242,276 | 半導体・半導体製造装置 | |
| RANDSTAD NV | 184 | 184 | 1,116 | 144,875 | 専門サービス | |
| WOLTERS KLUWER | 418 | 444 | 3,270 | 424,511 | 専門サービス | |
| VOPAK | 114 | 114 | 483 | 62,784 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| AEGON NV | 2,930 | 2,930 | 1,214 | 157,602 | 保険 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 5,600 | 5,600 | 1,624 | 210,795 | 各種電気通信サービス | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 1,426 | 1,527 | 7,384 | 958,517 | ヘルスケア機器・用品 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|---------------------------------------|---------|--------|--------|-----------|----------------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…オランダ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| HEINEKEN NV | 400 | 438 | 3,880 | 503,712 | 飲料 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 172 | 200 | 1,536 | 199,372 | 飲料 | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 285 | 291 | 4,300 | 558,267 | 化学 | |
| UNILEVER NV | 2,276 | — | — | — | パーソナル用品 | |
| ASML HOLDING NV | 666 | 703 | 36,342 | 4,717,237 | 半導体・半導体製造装置 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 1,706 | 1,860 | 4,454 | 578,220 | 食品・生活必需品小売り | |
| AKZO NOBEL | 324 | 312 | 2,984 | 387,400 | 化学 | |
| PROSUS NV | 768 | 816 | 7,747 | 1,005,574 | インターネット販売・通信販売 | |
| JDE PEET'S BV | — | 110 | 347 | 45,047 | 食品 | |
| DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV | — | 910 | 881 | 114,361 | 飲料 | |
| NN GROUP NV | 470 | 470 | 1,988 | 258,116 | 保険 | |
| ARGENX SE | — | 76 | 1,779 | 231,033 | バイオテクノロジー | |
| ARCELORMITTAL | 990 | 1,190 | 2,905 | 377,118 | 金属・鉱業 | |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV | 175 | 206 | 1,596 | 207,225 | インターネット販売・通信販売 | |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 700 | 700 | 726 | 94,267 | 銀行 | |
| ALTICE EUROPE N.V. | 990 | — | — | — | 各種電気通信サービス | |
| ADYEN NV | 16 | 30 | 5,726 | 743,283 | 情報技術サービス | |
| ING GROEP NV | 6,170 | 6,390 | 6,694 | 868,902 | 銀行 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 26,781 | 25,580 | 100,851 | 13,090,504 |
| 銘柄 数 < 比 率 > | 21 | 23 | — | < 1.4% > | | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| ENDESA S. A. | 500 | 500 | 1,142 | 148,296 | 電力 | |
| BANKINTER S. A. | 910 | — | — | — | 銀行 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A. | 10,560 | 10,900 | 4,903 | 636,527 | 銀行 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 490 | 500 | 1,045 | 135,705 | ガス | |
| REPSOL SA | 2,204 | 2,448 | 2,613 | 339,172 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| BANCO SANTANDER SA | 26,140 | 28,500 | 8,383 | 1,088,149 | 銀行 | |
| TELEFONICA SA | 7,320 | 8,200 | 3,147 | 408,501 | 各種電気通信サービス | |
| ENAGAS SA | 390 | 390 | 720 | 93,549 | ガス | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | 380 | 380 | 1,188 | 154,285 | 電気設備 | |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV | 403 | 370 | 1,026 | 133,291 | 建設・土木 | |
| FERROVIAL SA | 770 | 797 | 1,771 | 229,919 | 建設・土木 | |
| MAPPFRE SA | 1,630 | — | — | — | 保険 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 8,019 | — | — | — | 銀行 | |
| CAIXABANK | 5,300 | 6,000 | 1,611 | 209,185 | 銀行 | |
| IBERDROLA SA | 9,660 | 10,220 | 11,134 | 1,445,282 | 電力 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 667 | 760 | 4,604 | 597,609 | 情報技術サービス | |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 700 | 700 | 1,045 | 135,653 | 電力 | |
| INDITEX SA | 1,680 | 1,840 | 5,216 | 677,088 | 専門小売り | |
| AENA SME SA | 107 | 117 | 1,609 | 208,967 | 運送インフラ | |
| CELLNEX TELECOM SA | 386 | 539 | 2,538 | 329,521 | 各種電気通信サービス | |
| GRIFOLS SA | 468 | 468 | 1,051 | 136,497 | バイオテクノロジー | |
| BANKIA SA | 1,510 | — | — | — | 銀行 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 80,196 | 73,631 | 54,755 | 7,107,206 |
| 銘柄 数 < 比 率 > | 22 | 18 | — | < 0.8% > | | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| KBC GROEP NV | 382 | 409 | 2,596 | 337,003 | 銀行 | |
| SOFINA SA | — | 23 | 664 | 86,278 | 各種金融サービス | |
| SOLVAY SA | 114 | 116 | 1,260 | 163,667 | 化学 | |
| UCB SA | 195 | 206 | 1,674 | 217,386 | 医薬品 | |
| COLRUYT SA | 87 | 87 | 441 | 57,253 | 食品・生活必需品小売り | |
| GROUPE BRUXELLES LAM | 124 | 195 | 1,733 | 225,065 | 各種金融サービス | |
| PROXIMUS | 260 | 260 | 487 | 63,260 | 各種電気通信サービス | |
| GALAPAGOS NV | 70 | 70 | 452 | 58,713 | バイオテクノロジー | |

| 銘柄 | 株数 | 期 末 | | | 業 種 等 | |
|----------------------------------|--------------|--------|--------|---------|-------------------|--|
| | | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…ベルギー) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| ELIA GROUP SA/NV | — | 48 | 444 | 57,631 | 電力 | |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 67 | — | — | — | メディア | |
| AGEAS | 289 | 289 | 1,502 | 194,988 | 保険 | |
| UMICORE | 310 | 343 | 1,550 | 201,236 | 化学 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 1,201 | 1,277 | 7,004 | 909,163 | 飲料 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 3,099 | 3,323 | 19,812 | 2,571,649 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 11 | 12 | — | < 0.3% > | |
| (ユーロ…オーストリア) | | | | | | |
| OMV AG | 210 | 250 | 1,091 | 141,676 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| VERBUND AG | 110 | 110 | 666 | 86,524 | 電力 | |
| VOESTALPINE AG | 200 | 200 | 710 | 92,261 | 金属・鉱業 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 480 | 490 | 1,433 | 186,035 | 銀行 | |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 201 | 201 | 378 | 49,074 | 銀行 | |
| ANDRITZ AG | 117 | — | — | — | 機械 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,318 | 1,251 | 4,280 | 555,573 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 | 5 | — | < 0.1% > | |
| (ユーロ…ルクセンブルグ) | | | | | | |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE | 17 | — | — | — | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| AROUNDTOWN SA | 1,850 | 1,730 | 1,057 | 137,292 | 不動産管理・開発 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE | — | 216 | 1,752 | 227,518 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,867 | 1,946 | 2,810 | 364,810 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 2 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | | | | |
| KESKO OYJ-B SHS | — | 440 | 1,134 | 147,234 | 食品・生活必需品小売り | |
| WARTSILA OYJ | 630 | 660 | 592 | 76,964 | 機械 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 832 | 910 | 2,987 | 387,781 | 紙製品・林産品 | |
| STORA ENSO OYJ-R | 850 | 960 | 1,612 | 209,341 | 紙製品・林産品 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 682 | 804 | 3,118 | 404,809 | 保険 | |
| FORTUM OYJ | 720 | 720 | 1,648 | 213,920 | 電力 | |
| ELISA OYJ | 221 | 221 | 1,141 | 148,190 | 各種電気通信サービス | |
| METSO OYJ | 162 | — | — | — | 機械 | |
| NOKIA OYJ | 8,800 | 9,230 | 3,150 | 408,955 | 通信機器 | |
| NESTE OYJ | 668 | 714 | 3,295 | 427,797 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 210 | — | — | — | 自動車部品 | |
| KONE OYJ | 540 | 574 | 4,006 | 520,046 | 機械 | |
| ORION OYJ | 165 | 165 | 561 | 72,924 | 医薬品 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 14,480 | 15,398 | 23,250 | 3,017,967 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 12 | 11 | — | < 0.3% > | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| CRH PLC | 1,253 | 1,322 | 5,233 | 679,346 | 建設資材 | |
| KINGSPAN GROUP PLC | 245 | 264 | 1,842 | 239,185 | 建設関連製品 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 244 | 259 | 2,807 | 364,421 | 食品 | |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD | 1,398 | 1,398 | — | — | 銀行 | |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 353 | 423 | 1,710 | 222,037 | 容器・包装 | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 1,330 | — | — | — | 銀行 | |
| AIB GROUP PLC | 1,250 | — | — | — | 銀行 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 121 | 266 | 4,931 | 640,126 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 6,194 | 3,932 | 16,526 | 2,145,117 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 8 | 6 | — | < 0.2% > | |
| (ユーロ…ポルトガル) | | | | | | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL | 3,870 | 4,760 | 2,280 | 296,010 | 電力 | |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 810 | 810 | 805 | 104,507 | 石油・ガス・消耗燃料 | |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 | |
|--|--------------|---------|---------|-----------|----------------|--|
| | | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…ポルトガル) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| JERONIMO MARTINS | 380 | 380 | 523 | 67,968 | 食品・生活必需品小売り | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 5,060 | 5,950 | 3,609 | 468,486 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.1% > | |
| ユ ー ロ 計 | 株 数 ・ 金 額 | 306,092 | 307,381 | 748,240 | 97,121,583 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 237 | 235 | — | < 10.5% > | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 480 | 480 | 4,800 | 68,352 | 半導体・半導体製造装置 | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 3,100 | 3,600 | 7,326 | 104,322 | 不動産管理・開発 | |
| BANK OF EAST ASIA | 2,200 | 2,200 | 3,679 | 52,394 | 銀行 | |
| CLP HLDGS | 2,530 | 2,810 | 21,327 | 303,709 | 電力 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 1,887 | 1,983 | 91,931 | 1,309,109 | 資本市場 | |
| MTR CORP | 2,430 | 2,720 | 12,131 | 172,748 | 陸運・鉄道 | |
| HANG SENG BANK | 1,190 | 1,310 | 19,715 | 280,748 | 銀行 | |
| HENDERSON LAND | 2,294 | 2,294 | 8,248 | 117,458 | 不動産管理・開発 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 2,250 | 2,250 | 10,316 | 146,903 | 電力 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 15,603 | 17,403 | 21,545 | 306,811 | ガス | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 3,350 | 3,560 | 25,667 | 365,506 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| KERRY PROPERTIES | 1,140 | — | — | — | 不動産管理・開発 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 5,690 | 6,100 | 17,354 | 247,128 | 銀行 | |
| NWS HOLDINGS LTD | 2,205 | — | — | — | コングロマリット | |
| PCCW LTD | 7,500 | 7,500 | 3,360 | 47,846 | 各種電気通信サービス | |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 970 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 9,396 | — | — | — | 不動産管理・開発 | |
| SINO LAND CO.LTD | 4,800 | 4,800 | 5,328 | 75,870 | 不動産管理・開発 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 2,480 | 2,220 | 27,084 | 385,676 | 不動産管理・開発 | |
| SWIRE PACIFIC-A | 750 | 750 | 4,380 | 62,371 | 不動産管理・開発 | |
| VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED | 1,300 | — | — | — | 食品 | |
| WHEELOCK & COMPANY LTD | 1,340 | — | — | — | 不動産管理・開発 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED | 2,120 | 2,330 | 30,453 | 433,652 | 機械 | |
| XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD | — | 2,800 | 7,224 | 102,869 | 建設関連製品 | |
| SJM HOLDINGS LIMITED | 2,700 | 2,700 | 2,770 | 39,447 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| WYNN MACAU LTD | 2,280 | 2,280 | 3,451 | 49,155 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| AIA GROUP LTD | 18,930 | 19,980 | 191,907 | 2,732,768 | 保険 | |
| HKT TRUST AND HKT LTD | 5,996 | 5,996 | 6,823 | 97,165 | 各種電気通信サービス | |
| SANDS CHINA LTD | 3,840 | 3,840 | 14,822 | 211,070 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 1,730 | 1,730 | 4,221 | 60,109 | 不動産管理・開発 | |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 1,830 | 2,790 | 12,680 | 180,571 | 不動産管理・開発 | |
| ESR CAYMAN LTD | — | 2,600 | 6,565 | 93,485 | 不動産管理・開発 | |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 2,160 | 2,900 | 6,800 | 96,839 | 飲料 | |
| WH GROUP LIMITED | 14,600 | 16,100 | 11,624 | 165,528 | 食品 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | — | 2,689 | 10,931 | 155,663 | 不動産管理・開発 | |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 4,250 | 4,600 | 28,637 | 407,797 | コングロマリット | |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 1,070 | 1,070 | 5,007 | 71,308 | 電力 | |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 4,090 | 4,450 | 21,317 | 303,560 | 不動産管理・開発 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 140,483 | 140,837 | 649,434 | 9,247,951 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 35 | 32 | — | < 1.0% > | |
| (シンガポール) | | | | 千シンガポールドル | | |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING | 2,490 | 2,490 | 971 | 79,892 | 航空宇宙・防衛 | |
| DBS GROUP HLDGS | 2,840 | 3,020 | 8,758 | 720,520 | 銀行 | |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 700 | 700 | 558 | 45,956 | 不動産管理・開発 | |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD | 140 | — | — | — | 販売 | |
| SATS LTD | 1,150 | — | — | — | 運送インフラ | |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 1,290 | 1,290 | 1,283 | 105,597 | 資本市場 | |
| CAPITALAND LIMITED | 3,800 | 4,300 | 1,621 | 133,367 | 不動産管理・開発 | |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | 業種等 | | |
|--------------------------------------|-----------|----------|--------------|--------------|-------------------------|---------------------|
| | | 株数 | 株数 | | 期末 | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (シンガポール) | 百株 | 百株 | 千シンガポールドル | 千円 | | |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 3,100 | — | — | — | 陸運・鉄道 | |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 770 | 2,400 | 1,346 | 110,768 | 旅客航空輸送業 | |
| UNITED OVERSEAS BANK | 2,000 | 1,900 | 4,926 | 405,319 | 銀行 | |
| UOL GROUP LIMITED | 650 | 870 | 695 | 57,188 | 不動産管理・開発 | |
| VENTURE CORP LTD | 450 | 450 | 908 | 74,746 | 電子装置・機器・部品 | |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 2,400 | — | — | — | メディア | |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 12,900 | 14,000 | 3,444 | 283,337 | 各種電気通信サービス | |
| SEMCORP INDUSTRIES LTD | 1,400 | — | — | — | 総合公益事業 | |
| OCBC-ORD | 5,240 | 5,590 | 6,635 | 545,888 | 銀行 | |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 2,890 | 3,400 | 1,866 | 153,565 | 食品 | |
| KEPPEL CORP. | 2,320 | 2,320 | 1,238 | 101,922 | コングロマリット | |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 4,400 | — | — | — | 機械 | |
| GENTING SINGAPORE LTD | 8,700 | 11,300 | 1,056 | 86,922 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 59,630 20 | 54,030 14 | 35,310 — | 2,904,994 <0.3%> |
| (オーストラリア) | | | 千豪ドル | | | |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 250 | 295 | 1,946 | 164,224 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK | 4,390 | 4,750 | 13,347 | 1,125,995 | 銀行 | |
| WESTPAC BANKING CORP | 5,630 | 5,940 | 14,469 | 1,220,675 | 銀行 | |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 2,190 | 2,760 | 5,547 | 467,995 | 金属・鉱業 | |
| TELSTRA CORP LTD | 6,500 | 7,300 | 2,503 | 211,229 | 各種電気通信サービス | |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 920 | — | — | — | 銀行 | |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 770 | 770 | 1,034 | 87,302 | 飲料 | |
| ASX LTD | 307 | 307 | 2,164 | 182,636 | 資本市場 | |
| BHP GROUP LIMITED | 4,580 | 4,860 | 21,826 | 1,841,263 | 金属・鉱業 | |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 400 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 971 | — | — | — | 複合小売り | |
| COMPUTERSHARE LTD | 760 | 760 | 1,127 | 95,144 | 情報技術サービス | |
| COMPUTERSHARE LTD-RIGHTS | — | 86 | 11 | 928 | 情報技術サービス | |
| CSL LIMITED | 712 | 758 | 19,909 | 1,679,576 | バイオテクノロジー | |
| REA GROUP LTD | 88 | 88 | 1,225 | 103,352 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| TRANSURBAN GROUP | 4,340 | 4,620 | 5,996 | 505,886 | 運送インフラ | |
| COCHLEAR LTD | 89 | 103 | 2,152 | 181,601 | ヘルスケア機器・用品 | |
| ORIGIN ENERGY LTD | 2,650 | 2,650 | 1,221 | 103,058 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 2,778 | 2,951 | 25,201 | 2,126,001 | 銀行 | |
| BORAL LTD | 2,000 | — | — | — | 建設資材 | |
| RIO TINTO LTD | 575 | 607 | 6,652 | 561,223 | 金属・鉱業 | |
| APA GROUP | 1,800 | 2,050 | 2,045 | 172,592 | ガス | |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 880 | 990 | 3,327 | 280,698 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | 3,610 | 4,300 | 1,990 | 167,952 | 保険 | |
| TPG TELECOM LTD | 520 | — | — | — | 各種電気通信サービス | |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 73 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー | |
| ORICA LTD | 590 | 590 | 823 | 69,482 | 化学 | |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 880 | 900 | 1,730 | 146,001 | 金属・鉱業 | |
| WORLEY LTD | 470 | — | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| SUNCORP GROUP LTD | 1,903 | 2,220 | 2,164 | 182,597 | 保険 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK | 4,560 | 5,410 | 14,017 | 1,182,500 | 銀行 | |
| NEWCREST MINING | 1,170 | 1,320 | 3,252 | 274,379 | 金属・鉱業 | |
| OIL SEARCH LTD | 2,040 | 3,500 | 1,442 | 121,647 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| INCITEC PIVOT LTD | 2,330 | — | — | — | 化学 | |
| AMP LIMITED | 5,300 | 5,300 | 681 | 57,453 | 各種金融サービス | |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 1,080 | 1,700 | 850 | 71,706 | 旅客航空輸送業 | |
| QBE INSURANCE | 1,950 | 2,440 | 2,308 | 194,723 | 保険 | |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD | — | 1,940 | 1,891 | 159,566 | 金属・鉱業 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|--|--------------|---------|-------------|---------|-------------------------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (オーストラリア) | 百株 | 百株 | 千豪ドル | 千円 | | |
| CHALLENGER LIMITED | 800 | — | — | — | 各種金融サービス | |
| SANTOS LTD. | 2,610 | 3,100 | 2,210 | 186,460 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 690 | 780 | 2,746 | 231,684 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 170 | 170 | 527 | 44,457 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| TABCORP HOLDINGS | 3,400 | 3,709 | 1,713 | 144,559 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| WESFARMERS LIMITED | 1,750 | 1,902 | 9,936 | 838,205 | 複合小売り | |
| ALUMINA LTD | 3,500 | — | — | — | 金属・鉱業 | |
| WOODSIDE PETROLEUM | 1,520 | 1,630 | 3,925 | 331,116 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 1,970 | 2,120 | 8,533 | 719,843 | 食品・生活必需品小売り | |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 192 | 192 | 864 | 72,887 | 資本市場 | |
| SEEK LTD | 480 | 600 | 1,677 | 141,522 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| BRAMBLES LTD | 2,510 | 2,470 | 2,573 | 217,120 | 商業サービス・用品 | |
| MACQUARIE GROUP LIMITED | 530 | 568 | 8,551 | 721,430 | 資本市場 | |
| CROWN RESORTS LTD | 550 | 550 | 646 | 54,564 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| EVOLUTION MINING LTD | — | 2,720 | 1,136 | 95,913 | 金属・鉱業 | |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 670 | 730 | 2,860 | 241,342 | 建設資材 | |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 1,110 | 1,110 | 1,148 | 96,916 | 飲料 | |
| SYDNEY AIRPORT | 1,680 | 2,006 | 1,195 | 100,869 | 運送インフラ | |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 3,050 | 3,050 | 1,174 | 99,059 | 陸運・鉄道 | |
| XERO LIMITED | — | 198 | 2,487 | 209,826 | ソフトウェア | |
| AFTERPAY LTD | — | 348 | 3,515 | 296,596 | 情報技術サービス | |
| AMPOL LTD | — | 400 | 986 | 83,178 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| TPG TELECOM LTD | — | 520 | 327 | 27,636 | 各種電気通信サービス | |
| AUSNET SERVICES | 3,300 | 3,300 | 598 | 50,527 | 電力 | |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | 4,500 | 4,500 | 1,264 | 106,673 | 保険 | |
| AGL ENERGY LTD | 1,050 | 1,050 | 1,030 | 86,895 | 総合公益事業 | |
| SOUTH32 LTD | 7,800 | 7,800 | 2,184 | 184,242 | 金属・鉱業 | |
| CIMIC GROUP LTD | 180 | 180 | 313 | 26,421 | 建設・土木 | |
| COLES GROUP LTD | 1,760 | 2,270 | 3,570 | 301,225 | 食品・生活必需品小売り | |
| WISETECH GLOBAL LTD | 210 | 210 | 591 | 49,869 | ソフトウェア | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 116,038 | 120,448 | 231,157 | 19,500,444 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 61 | 58 | — | < 2.1% > | |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | | |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | 580 | 740 | 1,115 | 86,349 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| A2 MILK CO LTD | 1,170 | 1,170 | 999 | 77,316 | 食品 | |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L | 860 | 930 | 2,982 | 230,786 | ヘルスケア機器・用品 | |
| FLETCHER BUILDING LTD | 1,500 | — | — | — | 建設資材 | |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 3,070 | 3,070 | 1,399 | 108,325 | 各種電気通信サービス | |
| MERCURY NZ LTD | 1,000 | 1,000 | 620 | 47,975 | 電力 | |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 1,520 | 2,230 | 1,710 | 132,351 | 運送インフラ | |
| MERIDIAN ENERGY LTD | 2,010 | 2,010 | 1,074 | 83,132 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 11,710 | 11,150 | 9,902 | 766,238 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 8 | 7 | — | < 0.1% > | |
| (イスラエル) | | | 千新シェケル | | | |
| BANK HAPOLIM BM | 1,830 | 1,830 | 4,758 | 157,918 | 銀行 | |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | 2,380 | 2,380 | 5,236 | 173,782 | 銀行 | |
| ELBIT SYSTEMS LTD | 36 | 50 | 2,328 | 77,282 | 航空宇宙・防衛 | |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 1,720 | 1,720 | 2,385 | 79,179 | 銀行 | |
| ICL GROUP LTD | 1,250 | 1,250 | 2,475 | 82,145 | 化学 | |
| NICE LTD | 95 | 106 | 7,689 | 255,205 | ソフトウェア | |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 230 | 230 | 2,004 | 66,520 | 銀行 | |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|--------------------------|------------------------|-----------|-----------------|--------------|----------|
| | | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (イスラエル) AZRIELI GROUP | 百株 65 | 百株 65 | 千新シェケル 1,356 | 千円 45,023 | 不動産管理・開発 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 7,606 | 7,631 | 28,233 | 937,058 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > 8 | 8 | — | <0.1%> | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 1,720,128 | 1,803,673 | — | 889,554,397 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > 1,252 | 1,229 | — | <95.9%> | |

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

*株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--------------------------------|---------------|-----------|---------|------------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| AGNC INVESTMENT CORP | 80,000 | 93,000 | 1,570 | 173,899 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 17,900 | 22,400 | 3,724 | 412,333 | 0.0 |
| AMERICAN TOWER CORP | 69,400 | 73,700 | 17,477 | 1,934,984 | 0.2 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 214,000 | 238,000 | 2,075 | 229,763 | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 21,900 | 22,700 | 4,253 | 470,882 | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES | 24,700 | 25,000 | 2,575 | 285,105 | 0.0 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 14,500 | 16,000 | 1,777 | 196,762 | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTL CORP | 64,500 | 72,100 | 12,328 | 1,364,874 | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 40,700 | 45,200 | 6,384 | 706,777 | 0.1 |
| DUKE REALTY CORP | 56,600 | 62,200 | 2,642 | 292,524 | 0.0 |
| EQUINIX INC | 13,250 | 14,810 | 9,994 | 1,106,477 | 0.1 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 26,500 | 29,400 | 1,902 | 210,655 | 0.0 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 57,700 | 60,300 | 4,391 | 486,199 | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 10,070 | 10,700 | 2,975 | 329,460 | 0.0 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 20,700 | 20,700 | 2,753 | 304,795 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 11,100 | — | — | — | — |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 75,700 | 88,000 | 2,814 | 311,564 | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 109,000 | 109,000 | 1,885 | 208,765 | 0.0 |
| INVITATION HOMES INC | 85,000 | 92,000 | 2,967 | 328,476 | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC | 43,100 | 49,000 | 1,820 | 201,585 | 0.0 |
| KIMCO REALTY CORP | 65,000 | — | — | — | — |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 83,000 | 99,000 | 2,101 | 232,686 | 0.0 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 17,600 | 19,300 | 2,843 | 314,821 | 0.0 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 27,900 | — | — | — | — |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 32,200 | 36,500 | 1,355 | 150,079 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | 114,500 | 122,700 | 13,099 | 1,450,240 | 0.2 |
| PUBLIC STORAGE | 24,500 | 26,500 | 6,546 | 724,740 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 49,900 | 55,600 | 3,565 | 394,689 | 0.0 |
| REGENCY CENTERS CORP | 26,200 | 26,200 | 1,495 | 165,537 | 0.0 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 17,770 | 18,100 | 4,999 | 553,543 | 0.1 |
| SL GREEN REALTY CORP | 12,500 | — | — | — | — |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 47,900 | 54,800 | 6,323 | 700,060 | 0.1 |
| SUN COMMUNITIES INC | 14,300 | 17,800 | 2,666 | 295,240 | 0.0 |
| UDR INC | 46,300 | 46,100 | 2,046 | 226,605 | 0.0 |
| VENTAS INC | 56,800 | 63,900 | 3,496 | 387,109 | 0.0 |
| VEREIT INC | 160,000 | — | — | — | — |
| VEREIT INC | — | 37,000 | 1,433 | 158,648 | 0.0 |
| VICI PROPERTIES INC | 68,000 | 87,000 | 2,454 | 271,712 | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST | 27,000 | 27,000 | 1,257 | 139,205 | 0.0 |
| WP CAREY INC | 27,400 | 27,400 | 1,936 | 214,434 | 0.0 |
| WELLTOWER INC | 63,100 | 68,000 | 4,959 | 549,037 | 0.1 |
| WEYERHAEUSER CO | 115,000 | 121,000 | 4,289 | 474,885 | 0.1 |
| 小 計 | 2,153,190 | 2,098,110 | 153,185 | 16,959,169 | |
| | 口 数 ・ 金 額 | 口 数 | — | <1.8%> | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 41 | 37 | | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 11,500 | 14,900 | 803 | 70,549 | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--|---------------------------|-----------------|-----------------|-------------|----------------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | 千円 | % |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | 16,000 | — | — | — | — |
| H&R REAL ESTATE INVSTMT-UTS | 20,000 | — | — | — | — |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 22,000 | 22,000 | 428 | 37,638 | 0.0 |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 11,000 | — | — | — | — |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 80,500 5 | 36,900 2 | 1,232 — | 108,187 <0.0%> |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | |
| BRITISH LAND | 128,000 | 128,000 | 668 | 101,713 | 0.0 |
| SEGRO PLC | 176,000 | 193,000 | 1,821 | 277,350 | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 111,000 | 111,000 | 781 | 118,958 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 415,000 3 | 432,000 3 | 3,271 — | 498,023 <0.1%> |
| (ユーロ…フランス) | | | 千ユーロ | | |
| ICAIDE | 5,200 | — | — | — | — |
| KLEPIERRE | 32,300 | 32,300 | 655 | 85,066 | 0.0 |
| GECINA SA | 7,100 | 7,100 | 836 | 108,562 | 0.0 |
| COVIVIO | 6,600 | 8,500 | 621 | 80,651 | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 21,400 | 24,200 | 1,675 | 217,431 | 0.0 |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 72,600 5 | 72,100 4 | 3,788 — | 491,711 <0.1%> |
| (香港) | | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | 330,000 | 353,000 | 25,627 | 364,939 | 0.0 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 370,000 | 470,000 | 3,647 | 51,936 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 700,000 2 | 823,000 2 | 29,275 — | 416,876 <0.0%> |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 390,000 | 706,779 | 1,540 | 126,759 | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 440,800 | 539,240 | 1,655 | 136,195 | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 439,972 | — | — | — | — |
| SUNTEC REIT | 300,000 | 300,000 | 474 | 38,995 | 0.0 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | — | 427,980 | 834 | 68,659 | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 370,000 | 370,000 | 795 | 65,445 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 1,940,772 5 | 2,343,999 5 | 5,300 — | 436,056 <0.0%> |
| (オーストラリア) | | | 千豪ドル | | |
| MIRVAC GROUP | 660,000 | 660,000 | 1,597 | 134,739 | 0.0 |
| GPT GROUP | 285,000 | 330,000 | 1,488 | 125,552 | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP | 88,000 | 111,000 | 1,428 | 120,514 | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP | 348,000 | 400,000 | 1,720 | 145,099 | 0.0 |
| DEXUS | 171,000 | 171,000 | 1,633 | 137,764 | 0.0 |
| GOODMAN GROUP | 254,000 | 283,000 | 5,105 | 430,684 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | 870,000 | 820,000 | 2,304 | 194,382 | 0.0 |
| VICINITY CENTRES | 470,000 | 670,000 | 1,092 | 92,129 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 3,146,000 8 | 3,445,000 8 | 16,368 — | 1,380,866 <0.1%> |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 8,508,062 69 | 9,251,109 61 | — — | 20,290,891 <2.2%> |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | 当 期 | |
|--------|--------|----------|------------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外 国 | 株式先物取引 | CAN60 | 百万円 625 | 百万円 — |
| | | EURO50 | 1,924 | — |
| | | FT100 | 850 | — |
| | | SPI200 | 410 | — |
| | | SPEMINI | 12,893 | — |
| | | SWISSMKT | 542 | — |

*単位未満は切り捨て。

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2021年3月31日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 889,554,397 | % 95.9 |
| 投資証券 | 20,290,891 | 2.2 |
| コール・ローン等、その他 | 18,223,764 | 1.9 |
| 投資信託財産総額 | 928,069,052 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（924,695,878千円）の投資信託財産総額（928,069,052千円）に対する比率は99.6%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=110.71円、1カナダドル=87.78円、1英ポンド=152.23円、1スイスフラン=117.45円、1スウェーデンクローナ=12.69円、1ノルウェークローネ=12.96円、1デンマーククローネ=17.45円、1ユーロ=129.80円、1香港ドル=14.24円、1シンガポールドル=82.27円、1豪ドル=84.36円、1ニュージーランドドル=77.38円、1新シェケル=33.19円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月31日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 930,897,307,010 |
| コール・ローン等 | 11,360,420,610 |
| 株式(評価額) | 889,554,397,361 |
| 投資証券(評価額) | 20,290,891,015 |
| 未収入金 | 2,928,620,789 |
| 未収配当金 | 1,068,206,289 |
| 差入委託証拠金 | 5,694,770,946 |
| (B) 負債 | 3,249,055,909 |
| 未払金 | 2,860,485,021 |
| 未払解約金 | 385,126,122 |
| 未払利息 | 3,166 |
| その他未払費用 | 3,441,600 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 927,648,251,101 |
| 元本 | 245,531,591,330 |
| 次期繰越損益金 | 682,116,659,771 |
| (D) 受益権総口数 | 245,531,591,330口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 37,781円 |

(注) 期首元本額は230,777,414,749円、期中追加設定元本額は55,380,942,946円、期中一部解約元本額は40,626,766,365円、1口当たり純資産額は3.7781円です。

○損益の状況 (2020年4月1日～2021年3月31日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 13,052,106,182 |
| 受取配当金 | 13,036,907,012 |
| 受取利息 | 680,215 |
| その他収益金 | 20,299,141 |
| 支払利息 | △ 5,780,186 |
| (B) 有価証券売買損益 | 309,639,022,800 |
| 売買益 | 315,409,403,936 |
| 売買損 | △ 5,770,381,136 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 4,156,399,219 |
| 取引益 | 4,706,021,361 |
| 取引損 | △ 549,622,142 |
| (D) 保管費用等 | △ 64,488,873 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 326,783,039,328 |
| (F) 前期繰越損益金 | 325,246,401,340 |
| (G) 追加信託差損益金 | 115,522,734,190 |
| (H) 解約差損益金 | △ 85,435,515,087 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 682,116,659,771 |
| 次期繰越損益金(I) | 682,116,659,771 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

* 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|---|----------------|
| | 円 |
| 野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け) | 74,442,669,963 |
| 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) | 45,981,765,212 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI | 26,522,667,082 |
| 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) | 13,216,423,125 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 8,813,350,365 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 8,195,934,986 |
| のむらップ・ファンド(普通型) | 7,413,821,765 |
| 野村つみたて外国株投信 | 7,140,146,927 |
| のむらップ・ファンド(積極型) | 5,874,675,457 |
| 野村インデックスファンド・外国株式 | 5,178,091,514 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 4,908,070,670 |
| 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) | 4,311,126,171 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 4,032,789,678 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 3,834,191,486 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 2,627,138,869 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 2,466,653,600 |
| NET FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 2,021,283,487 |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村SMA・EW向け) | 1,908,713,316 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|------------------------------------|---------------|
| | 円 |
| マイバランスDC50 | 1,903,591,578 |
| ファンドラップ(ウェルス・スクエア)外国株式 | 1,857,341,281 |
| 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) | 1,678,880,730 |
| マイバランスDC70 | 1,540,701,049 |
| マイ・ロード | 1,087,359,782 |
| 野村6資産均等バランス | 983,476,455 |
| マイバランスDC30 | 858,222,247 |
| 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) | 842,367,196 |
| のむらップ・ファンド(保守型) | 819,498,259 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 676,118,737 |
| のむらップ・ファンド(やや積極型) | 487,897,427 |
| 野村外国株式インデックスファンド | 477,100,665 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 350,614,763 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 289,956,615 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 260,136,200 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 253,010,969 |
| 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) | 196,334,939 |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信 | 178,508,014 |

| ファンド名 | 当期末 |
|-------------------------------------|-------------|
| | 元本額 |
| | 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) | 176,662,260 |
| のむらっぴ・ファンド (やぎ保守型) | 174,692,702 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け) | 139,042,389 |
| バランスセレクト70 | 134,470,714 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 129,529,492 |
| 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) | 120,394,293 |
| バランスセレクト50 | 115,756,756 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け) | 102,922,540 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用) | 81,695,228 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け) | 71,722,146 |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け) | 57,114,645 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 50,195,153 |
| 世界6資産分散ファンド | 43,897,531 |
| バランスセレクト30 | 39,135,026 |
| 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) | 34,314,793 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 34,161,289 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 32,976,146 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 31,475,054 |
| 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) | 30,559,867 |
| インデックス・ブレンド (タイプV) | 29,572,851 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 25,928,039 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 23,182,058 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 20,090,323 |
| インデックス・ブレンド (タイプIII) | 19,291,406 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 13,989,553 |
| ネクストコア | 13,056,429 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 12,330,327 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 12,272,666 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 12,050,256 |
| 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) | 10,025,453 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 9,925,325 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | 9,896,292 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用) | 9,541,976 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 7,896,295 |
| インデックス・ブレンド (タイプIV) | 7,664,466 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 6,945,648 |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け) | 6,582,277 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 5,888,132 |
| 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) | 5,574,893 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2030 | 5,432,214 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2040 | 4,681,040 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 4,139,055 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2050 | 3,987,021 |
| インデックス・ブレンド (タイプII) | 3,031,339 |
| インデックス・ブレンド (タイプI) | 2,325,239 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2060 | 2,237,410 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 2,097,616 |
| 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) | 1,908,206 |
| 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) | 1,868,065 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 1,615,748 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,598,417 |
| 野村HFRs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) | 1,285,977 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 1,270,861 |
| 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) | 1,019,172 |
| 多資産分散投資ファンド (バランス10) (確定拠出年金向け) | 40,682 |

〇お知らせ

該当事項はございません。

新興国株式マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日2021年5月10日）

作成対象期間（2020年5月12日～2021年5月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資対象 | 新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|------------|--------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | | | |
| 9期(2017年5月10日) | 11,642 | 32.7 | 117.96 | 33.4 | 95.7 | 3.7 | 0.5 | 21,796 |
| 10期(2018年5月10日) | 13,270 | 14.0 | 134.93 | 14.4 | 97.5 | 2.1 | 0.4 | 33,831 |
| 11期(2019年5月10日) | 12,185 | △ 8.2 | 124.66 | △ 7.6 | 95.5 | 3.3 | 1.1 | 36,658 |
| 12期(2020年5月11日) | 10,763 | △11.7 | 110.86 | △11.1 | 90.8 | 4.9 | 4.3 | 36,969 |
| 13期(2021年5月10日) | 16,542 | 53.7 | 170.78 | 54.1 | 92.4 | 3.7 | 3.8 | 66,110 |

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*ベンチマーク (=「MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)」) は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・ドルベース) をもとに当社が円換算したものです。なお指数算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。

*MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。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ためにその使用を許諾されています。ここに記載されたいかなるファンドも、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のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI、為替レート (対顧客電信売買相場仲値)

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|------------|--------|------|--------|------|--------|--------|------------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | | |
| (期首) | 円 | % | | % | % | % | % |
| 2020年5月11日 | 10,763 | — | 110.86 | — | 90.8 | 4.9 | 4.3 |
| 5月末 | 10,990 | 2.1 | 113.30 | 2.2 | 91.3 | 4.7 | 3.9 |
| 6月末 | 11,896 | 10.5 | 122.44 | 10.4 | 90.9 | 5.0 | 3.9 |
| 7月末 | 12,629 | 17.3 | 130.15 | 17.4 | 91.5 | 4.3 | 4.1 |
| 8月末 | 13,209 | 22.7 | 136.08 | 22.7 | 92.4 | 3.2 | 4.2 |
| 9月末 | 12,669 | 17.7 | 130.46 | 17.7 | 91.0 | 4.7 | 4.2 |
| 10月末 | 13,133 | 22.0 | 135.30 | 22.0 | 91.5 | 4.2 | 4.1 |
| 11月末 | 14,340 | 33.2 | 147.71 | 33.2 | 91.5 | 4.5 | 4.0 |
| 12月末 | 14,716 | 36.7 | 151.82 | 36.9 | 92.5 | 3.5 | 3.9 |
| 2021年1月末 | 15,843 | 47.2 | 163.43 | 47.4 | 91.7 | 4.4 | 3.8 |
| 2月末 | 16,450 | 52.8 | 170.53 | 53.8 | 92.6 | 3.4 | 3.9 |
| 3月末 | 16,427 | 52.6 | 169.81 | 53.2 | 93.4 | 2.8 | 3.8 |
| 4月末 | 16,753 | 55.7 | 173.00 | 56.1 | 92.6 | 3.4 | 3.8 |
| (期末) | | | | | | | |
| 2021年5月10日 | 16,542 | 53.7 | 170.78 | 54.1 | 92.4 | 3.7 | 3.8 |

*騰落率は期首比です。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待などを受けて、基準価額は上昇しました。

○投資環境

新興国株式市場は、期首より、世界各国での経済活動再開や新型コロナウイルスのワクチン開発に関する報道などを受け、上昇しました。その後も、米国大統領選挙の結果を受け米中関係の改善期待が高まったことや、新型コロナウイルスのワクチン接種が開始されたことを受け経済正常化期待が高まったことなどから、上昇しました。2021年2月中旬以降は、米国の長期金利の上昇や米中外交トップ会談を受けた米中の対立激化懸念などから、下落しました。その後は、一進一退の展開となりました。

為替市場は、世界各国での経済活動再開などを受け、各国通貨が概ね対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指すため、新興国の株式（ETF（上場投資信託証券）やDR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行いました。期中の資金流入や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行い、実質株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+53.7%となり、ベンチマークの+54.1%を0.4ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

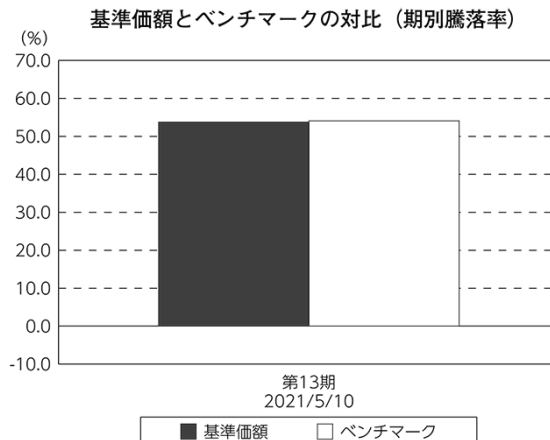
（その他の要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）

◎今後の運用方針

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



（注）ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年5月12日～2021年5月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 | |
|-----------------------|--------|------------|--|---|
| | 金 額 | 比 率 | | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 6 | % 0.042 | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 | |
| (株 式) | (5) | (0.034) | | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | | |
| (先物・オプション) | (1) | (0.007) | | |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 | 3 | 0.023 | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 | |
| (株 式) | (3) | (0.023) | | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | | |
| (c) そ の 他 費 用 | 9 | 0.063 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 | |
| (保 管 費 用) | (8) | (0.056) | | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (そ の 他) | (1) | (0.008) | | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 18 | 0.128 | | |
| 期中の平均基準価額は、14,087円です。 | | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年5月12日～2021年5月10日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|--------|---------------------|-----------------------------------|---------------------|--------------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | カタール | 百株 3,472 | 千カタールリヤル 2,436 | 百株 1,312 | 千カタールリヤル 738 |
| | アメリカ | 6,674 (1,222) | 千米ドル 27,268 (70) | 2,545 (223) | 千米ドル 5,619 (619) |
| | イギリス | 44 | 千英ポンド 62 | — | 千英ポンド — |
| | トルコ | 3,768 (207) | 千トルコリラ 2,494 (—) | 1,219 | 千トルコリラ 1,411 |
| | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ギリシャ | 54 (—) | 66 (△ 0.514) | 3,194 | 271 |
| | チェコ | 51 | 千チェココルナ 2,840 | 32 | 千チェココルナ 1,584 |
| | ハンガリー | 38 | 千フォリント 40,166 | 31 | 千フォリント 21,542 |
| | ポーランド | 518 | 千ズロチ 4,179 | 536 | 千ズロチ 1,561 |
| | 香港 | 116,828 (8,476) | 千香港ドル 236,324 (1,644) | 105,291 (1,076) | 千香港ドル 91,409 (1,888) |
| | マレーシア | 10,565 (12,191) | 千リンギ 8,300 (—) | 7,226 | 千リンギ 3,305 |
| | タイ | 20,728 (1,157) | 千バーツ 74,178 (1,807) | 26,608 (514) | 千バーツ 24,375 (93) |
| | フィリピン | 4,695 (86) | 千フィリピンペソ 31,241 (—) | 1,528 | 千フィリピンペソ 10,777 |
| | インドネシア | 54,243 | 千ルピア 20,739,353 | 42,338 | 千ルピア 10,597,626 |
| | 韓国 | 1,900 (399) | 千ウォン 15,067,999 (359,092) | 1,376 (65) | 千ウォン 5,568,892 (29,514) |
| | 台湾 | 37,840 (2,577) | 千新台幣ドル 362,435 (△ 828) | 19,678 (160) | 千新台幣ドル 128,227 (29) |
| | インド | 20,241 (210) | 千インドルピー 1,045,124 (16,436) | 3,648 (6) | 千インドルピー 169,963 (99) |
| | メキシコ | 15,216 (1,721) | 千メキシコペソ 38,180 (—) | 10,732 | 千メキシコペソ 18,129 |

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|----------|--------------------------|-------------------------------|-----------------------|--------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | ブラジル | 百株 10,026 (5,474) | 千レアル 34,055 (312) | 百株 6,437 (325) | 千レアル 12,227 (182) |
| | チリ | 682 (1) | 千チリペソ 105,804 (ー) | 2,249 | 千チリペソ 91,008 |
| | コロンビア | ー | 千コロンビアペソ ー | 2,213 | 千コロンビアペソ 289,280 |
| | アラブ首長国連邦 | 4,553 | 千UAEディルハム 3,258 | 1,018 | 千UAEディルハム 430 |
| | 南アフリカ | 3,289 (1,055) | 千ランド 56,805 (ー) | 4,436 | 千ランド 24,988 |
| | クウェート | 12,010 (590) | 千クウェートディナール 835 (ー) | ー | 千クウェートディナール ー |
| | サウジアラビア | 3,950 (△ 171) | 千サウジアラビアリヤル 15,899 (ー) | 727 | 千サウジアラビアリヤル 3,045 |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|----|---------------------|------------------|------------------------|---------------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外 国 | タイ | 証券 ー (36,997) | 千バーツ ー (ー) | 証券 9,593 (9,592) | 千バーツ 101 (ー) |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

投資信託証券

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|----|--|------------|--------------|---------|---------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 | アメリカ | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| | XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF | 37,500 | 1,355 | 549,800 | 22,948 |
| | ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF | 3,674,400 | 24,518 | — | — |
| | 小計 | 3,711,900 | 25,873 | 549,800 | 22,948 |
| 国 | メキシコ | | 千メキシコペソ | | 千メキシコペソ |
| | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | — (—) | — (△ 107) | — | — |
| | 小計 | — (—) | — (△ 107) | — | — |
| | 南アフリカ | | 千ランド | | 千ランド |
| | FORTRESS REIT LTD-A | — | — | 100,000 | 1,167 |
| | REDEFINE PROPERTIES LTD | — | — | 328,000 | 727 |
| | 小計 | — | — | 428,000 | 1,895 |

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

* () 内は分割、合併、有償増資などによる増減分です。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

| 種類別 | | 買建 | | 売建 | |
|-----|--------|---------------|---------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 外国 | 株式先物取引 | 百万円 22,735 | 百万円 22,886 | 百万円 — | 百万円 — |

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2020年5月12日～2021年5月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|--------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 17,479,816千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 47,617,380千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.36 |

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月12日～2021年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 22,392 | 百万円 4,754 | % 21.2 | 百万円 13,989 | 百万円 4,979 | % 35.6 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年5月10日現在)

外国株式

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期 末 | | 業 種 等 | | |
|--------------------------------|------------|-------|----------|-----------|----------------------|----------|--|
| | | | 評 価 額 | | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (カタール) | 百株 | 百株 | 千カタールリヤル | 千円 | | | |
| QATAR INSURANCE CO | 1,000 | — | — | — | 保険 | | |
| QATAR NATIONAL BANK | 2,892 | 3,250 | 5,846 | 172,771 | 銀行 | | |
| COMMERCIAL BANK OF QATAR | 1,179 | 1,179 | 646 | 19,116 | 銀行 | | |
| OOREDOO QSC | 431 | 431 | 306 | 9,055 | 各種電気通信サービス | | |
| QATAR FUEL CO | 347 | 347 | 630 | 18,641 | 石油・ガス・消耗燃料 | | |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 344 | 344 | 585 | 17,311 | 総合公益事業 | | |
| QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC | 470 | 470 | 439 | 12,980 | 銀行 | | |
| INDUSTRIES QATAR | 1,117 | 1,430 | 1,930 | 57,046 | コングロマリット | | |
| QATAR ISLAMIC BANK | 804 | 839 | 1,451 | 42,890 | 銀行 | | |
| QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT | — | 2,200 | 694 | 20,510 | 石油・ガス・消耗燃料 | | |
| MASRAF AL RAYAN | 2,116 | 2,370 | 1,057 | 31,234 | 銀行 | | |
| BARWA REAL ESTATE CO | 1,130 | 1,130 | 364 | 10,762 | 不動産管理・開発 | | |
| MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING | 3,050 | 3,050 | 589 | 17,430 | 化学 | | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 14,880 | 17,040 | 14,543 | 429,751 | |
| | 銘柄数 < 比率 > | | 12 | 12 | — | < 0.7% > | |
| (アメリカ) | | | | | 千米ドル | | |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 1,117 | 1,352 | 30,464 | 3,313,587 | インターネット販売・通信販売 | | |
| AUTOHOME INC-ADR | 38 | 38 | 359 | 39,054 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | | |
| BAIDU INC - SPON ADR | 178 | 189 | 3,626 | 394,404 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | | |
| BANCO DE CHILE-ADR | 143 | 181 | 414 | 45,123 | 銀行 | | |
| BANCO MACRO SA-ADR | 38 | — | — | — | 銀行 | | |
| BANCO SANTANDER CHILE-ADR | 124 | 138 | 326 | 35,559 | 銀行 | | |
| BANCOLOMBIA S. A.-SPONS ADR | 73 | 73 | 225 | 24,484 | 銀行 | | |
| BAOZUN INC-SPN ADR | 23 | 49 | 161 | 17,545 | インターネット販売・通信販売 | | |
| BEIGENE, LTD ADR | — | 32 | 1,013 | 110,282 | パイオテクノロジー | | |
| BEST INC - ADR | 86 | — | — | — | 航空貨物・物流サービス | | |
| BILIBILI INC-SPONSORED ADR | — | 120 | 1,222 | 132,924 | 娯楽 | | |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR | 40 | 40 | 76 | 8,301 | 飲料 | | |
| CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 170 | 96 | 99 | 10,817 | 金属・鉱業 | | |
| DAQO NEW ENERGY CORP-ADR | — | 41 | 306 | 33,312 | 半導体・半導体製造装置 | | |
| DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR | — | 60 | 51 | 5,592 | 娯楽 | | |
| ECOPETROL SA-SPONSORED ADR | 183 | 203 | 248 | 27,026 | 石油・ガス・消耗燃料 | | |
| ENEL AMERICAS S. A-ADR | 484 | 479 | 362 | 39,440 | 電力 | | |
| ENEL CHILE SA-ADR | 429 | 429 | 156 | 16,985 | 電力 | | |
| 58.COM INC-ADR | 57 | — | — | — | インタラクティブ・メディアおよびサービス | | |
| 51JOB INC-ADR | 13 | 22 | 155 | 16,946 | 専門サービス | | |
| GDS HOLDINGS LTD-ADR | 43 | 65 | 483 | 52,594 | 情報技術サービス | | |
| GSX TECHEHU INC- ADR | — | 50 | 129 | 14,069 | 各種消費者サービス | | |
| GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR | 74 | — | — | — | 銀行 | | |
| HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR | 88 | 112 | 642 | 69,926 | ホテル・レストラン・レジャー | | |
| HUTCHMED CHINA-ADR | 38 | 38 | 102 | 11,098 | 医薬品 | | |
| HUYA INC-ADR | 27 | 59 | 96 | 10,505 | 娯楽 | | |
| ITAU CORPBANCA-ADR | 54 | — | — | — | 銀行 | | |
| IQIYI INC-ADR | 91 | 214 | 294 | 31,982 | 娯楽 | | |
| JOYY INC | 42 | 42 | 372 | 40,564 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | | |
| JD.COM INC-ADR | 480 | 622 | 4,698 | 511,108 | インターネット販売・通信販売 | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--------------------------------|---------|--------|-------|---------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| KE HOLDINGS INC ADR | — | 94 | 481 | 52,374 | 不動産管理・開発 |
| KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR | — | 40 | 162 | 17,712 | 情報技術サービス |
| LI AUTO INC - ADR | — | 144 | 262 | 28,600 | 自動車 |
| STATE BANK OF INDIA-GDR | 110 | 138 | 672 | 73,175 | 銀行 |
| PJSC GAZPROM-ADR | 3,428 | 4,160 | 2,711 | 294,928 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR | 151 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| TRANSNEFT PJSC | 0.21 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LUCKIN COFFEE INC - ADR | 52 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| LUFAX HOLDING LTD | — | 113 | 125 | 13,704 | 消費者金融 |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 577 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR | 286 | 286 | 251 | 27,360 | 無線通信サービス |
| MOMO INC-SPON ADR | 88 | 88 | 126 | 13,754 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| NTO INC ADR | 409 | 902 | 3,331 | 362,420 | 自動車 |
| NETEASE INC-ADR | 45 | 300 | 3,301 | 359,081 | 娯楽 |
| NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR | 94 | 1,094 | 1,633 | 177,658 | 各種消費者サービス |
| NOAH HLDS LTD ADR | 15 | 30 | 132 | 14,373 | 資本市場 |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 876 | 876 | 76 | 8,360 | 不動産管理・開発 |
| PINDUODUO INC ADR | 130 | 276 | 3,699 | 402,372 | インターネット販売・通信販売 |
| RLX TECHNOLOGY INC-ADR | — | 80 | 88 | 9,606 | タバコ |
| QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR | 74 | 87 | 483 | 52,538 | 化学 |
| SOUTHERN COPPER CORP | 63 | 63 | 484 | 52,675 | 金属・鉱業 |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR | 246 | 264 | 1,481 | 161,189 | 各種消費者サービス |
| TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR | 53 | 53 | 24 | 2,697 | 各種電気通信サービス |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 74 | 274 | 440 | 47,893 | 娯楽 |
| TRIP.COM GROUP LTD-ADR | 294 | 352 | 1,380 | 150,161 | インターネット販売・通信販売 |
| 21VIANET GROUP INC-ADR | — | 72 | 185 | 20,126 | 情報技術サービス |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS | 266 | 308 | 870 | 94,640 | インターネット販売・通信販売 |
| WEIBO CORP-SPON ADR | 34 | 34 | 162 | 17,717 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| XPENG INC ADR | — | 110 | 295 | 32,195 | 自動車 |
| YPF S. A. -SPONSORED ADR | 106 | 106 | 42 | 4,600 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YUM CHINA HOLDINGS INC | 231 | 293 | 1,819 | 197,942 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ZAI LAB LTD - ADR | 23 | 48 | 768 | 83,596 | バイオテクノロジー |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC | 209 | 277 | 885 | 96,293 | 航空貨物・物流サービス |
| SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR | 1,037 | 1,056 | 506 | 55,064 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 85 | 85 | 273 | 29,724 | 食品・生活必需品小売り |
| NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 57 | 64 | 1,234 | 134,283 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NOVOLIPET STEEL - GDR REG S | 73 | 103 | 383 | 41,743 | 金属・鉱業 |
| ROSNEFT OJSC - GDR | 728 | 728 | 526 | 57,218 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PJSC ALROSA | 1,760 | 1,760 | 272 | 29,666 | 金属・鉱業 |
| SEVERSTAL-GDR REG S | 158 | 158 | 390 | 42,482 | 金属・鉱業 |
| MAGNITOGORS-SPON GDR REGS | 107 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI | 878 | 878 | 121 | 13,249 | 銀行 |
| DP WORLD PLC | 110 | — | — | — | 運送インフラ |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | 197 | 259 | 379 | 41,271 | 食品・生活必需品小売り |
| INTER RAO UES PJSC | 22,800 | 22,800 | 158 | 17,188 | 電力 |
| MAIL.RU GROUP-GDR REGS | — | 70 | 155 | 16,887 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| PJSC SBERBANK OF RUSSIA | 6,733 | 7,830 | 3,376 | 367,222 | 銀行 |
| PJSC PHOSAGRO-GDR REG S | 70 | 121 | 226 | 24,624 | 化学 |
| MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC | 851 | 851 | 215 | 23,470 | 資本市場 |
| TCS GROUP HOLDING-REG S | — | 93 | 571 | 62,211 | 銀行 |
| PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR | 395 | 450 | 1,651 | 179,584 | 金属・鉱業 |
| POLYUS PJSC-REG S-GDR | 33 | 47 | 482 | 52,460 | 金属・鉱業 |

| 銘柄 | 株数 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|--------------|---------|---------|---------|-----------|----------------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| TATNEFT-SPONSORED ADR | 162 | 165 | 689 | 75,018 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR | 271 | 302 | 2,497 | 271,646 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CREDICORP LTD | 43 | 49 | 601 | 65,475 | | 銀行 |
| SINA CORP | 41 | — | — | — | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| GLOBANT SA | 25 | 25 | 559 | 60,905 | | 情報技術サービス |
| YANDEX NV-A | — | 211 | 1,386 | 150,780 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 48,695 | 53,824 | 89,134 | 9,695,174 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 73 | 76 | — | <14.7%> | |
| (イギリス) | | | | 千英ポンド | | |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 150 | 194 | 313 | 47,871 | | 金属・鉱業 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 150 | 194 | 313 | 47,871 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | <0.1%> | |
| (トルコ) | | | | 千トルコリラ | | |
| AKBANK T. A. S | 2,050 | 2,050 | 1,055 | 13,949 | | 銀行 |
| ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII | 127 | — | — | — | | 飲料 |
| ARCELIK A. S | 145 | — | — | — | | 家庭用耐久財 |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 207 | 414 | 623 | 8,238 | | 航空宇宙・防衛 |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 1,110 | 1,160 | 2,289 | 30,254 | | 金属・鉱業 |
| FORD OTOMOTIVE SANAYI AS | 33 | 62 | 1,128 | 14,909 | | 自動車 |
| KOC HLDGS | 530 | 530 | 1,001 | 13,228 | | コングロマリット |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS | — | 880 | 668 | 8,836 | | コングロマリット |
| TURK HAVA YOLLARI AO | 321 | 321 | 418 | 5,524 | | 旅客航空輸送業 |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 770 | 770 | 1,168 | 15,433 | | 無線通信サービス |
| TURKIYE GARANTI BANKASI | 1,421 | 1,421 | 1,097 | 14,500 | | 銀行 |
| TURKIYE IS BANKASI AS-C | 918 | 918 | 466 | 6,161 | | 銀行 |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 83 | 83 | 801 | 10,593 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YAPI VE KREDI BANKASI A. S. | — | 1,900 | 404 | 5,347 | | 銀行 |
| HACI OMER SABANCI HOLDING | 750 | 810 | 703 | 9,289 | | 各種金融サービス |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 300 | 300 | 1,941 | 25,645 | | 食品・生活必需品小売り |
| TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | 96 | — | — | — | | 運送インフラ |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 8,864 | 11,621 | 13,768 | 181,912 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 15 | 14 | — | <0.3%> | |
| (ユーロ…ギリシャ) | | | | 千ユーロ | | |
| HELLENIC TELECOM | 167 | 180 | 252 | 33,463 | | 各種電気通信サービス |
| MOTOR OIL (HELLAS) SA | 38 | — | — | — | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| OPAP SA | 131 | 131 | 163 | 21,606 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| JUMBO SA | 67 | 67 | 102 | 13,539 | | 専門小売り |
| FF GROUP | 20 | 20 | 0.9744 | 128 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NATIONAL BANK OF GREECE | 330 | — | — | — | | 銀行 |
| TITANCEMENT INTERNATIONAL | 25 | — | — | — | | 建設資材 |
| EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS | 1,620 | — | — | — | | 銀行 |
| ALPHA BANK A. E. | 1,140 | — | — | — | | 銀行 |
| ユ ー ロ 計 | 株 数 ・ 金 額 | 3,540 | 399 | 519 | 68,739 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 9 | 4 | — | <0.1%> | |
| (チェコ) | | | | 千チェココルナ | | |
| KOMERCNI BANKA AS | 50 | 50 | 3,408 | 17,592 | | 銀行 |
| CEZ AS | 117 | 136 | 8,194 | 42,289 | | 電力 |
| MONETA MONEY BANK AS | 420 | 420 | 3,248 | 16,766 | | 銀行 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 587 | 606 | 14,851 | 76,648 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | <0.1%> | |
| (ハンガリー) | | | | 千フォリント | | |
| OTP BANK NYRT | 144 | 162 | 224,775 | 82,992 | | 銀行 |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|---|---------|--------|--------|---------|---------|--------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ハンガリー) | 百株 | 百株 | 千フォロント | 千円 | | |
| RICHTER GEDEON NYRT | 103 | 92 | 78,292 | 28,907 | | 医薬品 |
| MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC | 250 | 250 | 54,950 | 20,288 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| 小計 | 株数・金額 | 497 | 504 | 358,017 | 132,188 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | — | <0.2%> | |
| (ポーランド) | | | | 千ズロチ | | |
| BANK MILLENNIUM SA | 358 | — | — | — | — | 銀行 |
| MBANK | 9 | — | — | — | — | 銀行 |
| KGHM POLSKA MIEDZ S. A. | 99 | 99 | 2,179 | 63,341 | | 金属・鉱業 |
| BANK PEKAO SA | 105 | 157 | 1,314 | 38,181 | | 銀行 |
| ORANGE POLSKA SA | 391 | 391 | 263 | 7,661 | | 各種電気通信サービス |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY S. A. | 188 | 188 | 1,316 | 38,248 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LPP SA | 0.94 | 0.94 | 1,015 | 29,497 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SANTANDER BANK POLSKA SA | 28 | 31 | 703 | 20,437 | | 銀行 |
| CD PROJEKT RED SA | 40 | 49 | 800 | 23,269 | | 娯楽 |
| PKO BANK POLSKI SA | 562 | 686 | 2,457 | 71,397 | | 銀行 |
| CCC SA | 15 | — | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| GRUPA LOTOS SA | 68 | — | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I | 977 | 977 | 651 | 18,930 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CYFROWY POLSAT SA | 189 | 189 | 550 | 16,002 | | メディア |
| POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA | 517 | 517 | 515 | 14,970 | | 電力 |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 375 | 375 | 1,256 | 36,501 | | 保険 |
| DINO POLSKA SA | 38 | 38 | 970 | 28,203 | | 食品・生活必需品小売り |
| AMREST HOLDINGS SE | 48 | — | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| ALLEGRO. EU SA | — | 294 | 1,612 | 46,863 | | インターネット販売・通信販売 |
| 小計 | 株数・金額 | 4,012 | 3,994 | 15,608 | 453,506 | |
| | 銘柄数<比率> | 18 | 14 | — | <0.7%> | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H | 980 | 980 | 1,984 | 27,802 | | 金属・鉱業 |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 680 | 680 | 639 | 8,955 | | 運送インフラ |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES H | 1,060 | 1,060 | 549 | 7,692 | | 旅客航空輸送業 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD | — | 70 | 728 | 10,199 | | 飲料 |
| CHINA MOBILE LTD | 3,945 | — | — | — | — | 無線通信サービス |
| ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H | 770 | 910 | 4,372 | 61,259 | | 建設資材 |
| DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H | 1,660 | — | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD | 360 | 360 | 937 | 13,138 | | ガス |
| HUANENG POWER INTL INC-H | 2,380 | 2,380 | 671 | 9,402 | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| YANZHOU COAL MINING-H | 960 | 960 | 988 | 13,853 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS | — | 420 | 1,291 | 18,093 | | 不動産管理・開発 |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 445 | 445 | 2,231 | 31,265 | | パーソナル用品 |
| HUADIAN POWER INTL CORP-H | 880 | — | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-H | 760 | — | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 2,180 | 2,180 | 1,591 | 22,295 | | 自動車 |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED | 3,060 | 6,835 | 6,493 | 90,973 | | 医薬品 |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT | 2,440 | 2,860 | 5,588 | 78,294 | | 不動産管理・開発 |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 2,004 | 2,284 | 8,555 | 119,858 | | 不動産管理・開発 |
| CITIC LTD | 3,620 | 4,730 | 4,157 | 58,248 | | コングロマリット |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H | 980 | 980 | 561 | 7,867 | | 運送インフラ |
| LENOVO GROUP LTD | 4,980 | 4,980 | 5,288 | 74,095 | | コンピュータ・周辺機器 |
| PETROCHINA CO LTD-H | 14,000 | 14,000 | 4,312 | 60,411 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA UNICOM HONGKONG LTD | 3,780 | — | — | — | — | 各種電気通信サービス |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING | 1,034 | 1,034 | 1,448 | 20,294 | | 保険 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 16,929 | 17,409 | 7,242 | 101,462 | | 石油・ガス・消耗燃料 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|---------|--------|--------|---------|--------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 660 | 660 | 1,063 | 14,905 | 情報技術サービス |
| KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD | 1,420 | 1,740 | 4,184 | 58,627 | ソフトウェア |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 496 | 565 | 7,825 | 109,631 | ガス |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD | 1,860 | 3,160 | 2,727 | 38,206 | ガス |
| TOWNGAS CHINA COMPANY LTD | 530 | — | — | — | ガス |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 1,020 | 1,020 | 735 | 10,303 | 運送インフラ |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 3,700 | 3,700 | 691 | 9,693 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 820 | 820 | 1,074 | 15,049 | 運送インフラ |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 2,100 | 2,100 | 997 | 13,974 | 金属・鉱業 |
| WHARF(HOLDING) | 840 | 940 | 2,232 | 31,277 | 不動産管理・開発 |
| CHINA EVERBRIGHT LTD | 480 | 480 | 446 | 6,254 | 資本市場 |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 1,756 | 1,840 | 5,161 | 72,308 | ガス |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 430 | 430 | 1,898 | 26,597 | 電子装置・機器・部品 |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 3,420 | 4,190 | 8,053 | 112,825 | 自動車 |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD | 1,760 | 1,760 | 487 | 6,830 | 不動産管理・開発 |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 560 | 640 | 2,825 | 39,586 | ガス |
| BYD CO LTD-H | 440 | 545 | 7,902 | 110,714 | 自動車 |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H | 8,660 | — | — | — | 各種電気通信サービス |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H | 1,000 | 1,000 | 768 | 10,759 | エネルギー設備・サービス |
| SINOTRANS LIMITED-H | 1,110 | — | — | — | 航空貨物・物流サービス |
| MAANSHAN IRON & STEEL CO LTD - H | 1,340 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 2,810 | 2,810 | 1,360 | 19,054 | 商業サービス・用品 |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN | 780 | 780 | 567 | 7,944 | 紙製品・林産品 |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 4,344 | 5,504 | 4,265 | 59,763 | 保険 |
| AVICHINA INDUSTRY&TECH-H | 2,020 | 2,020 | 989 | 13,867 | 航空宇宙・防衛 |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDING | 1,500 | 1,500 | 1,530 | 21,435 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 2,380 | 2,240 | 4,300 | 60,254 | 自動車 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 4,920 | 5,250 | 8,358 | 117,095 | 保険 |
| ZIJIN MINING GROUP CO-H | 3,470 | 4,310 | 5,301 | 74,271 | 金属・鉱業 |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 1,160 | 1,600 | 2,806 | 39,317 | ヘルスケア機器・用品 |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 1,178 | 1,498 | 2,546 | 35,677 | 機械 |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H | 660 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H | 2,060 | — | — | — | 化学 |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS | 300 | — | — | — | コングロマリット |
| SHENZHEN EXPRESSWAY-H | 320 | — | — | — | 運送インフラ |
| TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO | 1,180 | 1,680 | 2,365 | 33,139 | 食品 |
| TSING TAO BREWERY CO-H | 240 | 300 | 2,194 | 30,744 | 飲料 |
| GUANGDONG INVESTMENT | 1,840 | 2,400 | 2,841 | 39,810 | 水道 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE | 1,240 | 2,480 | 1,116 | 15,635 | 医薬品 |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN | 933 | 1,033 | 6,711 | 94,027 | 飲料 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY-H | 1,140 | 1,140 | 763 | 10,700 | 運送インフラ |
| CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY | 3,670 | 3,670 | 19 | 272 | 半導体・半導体製造装置 |
| CNOOC LTD | 11,710 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 4,580 | 7,125 | 5,671 | 79,457 | 医薬品 |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 1,800 | 1,970 | 8,175 | 114,538 | 食品 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 3,585 | 4,245 | 34,639 | 485,295 | 保険 |
| LI NING CO LTD | 1,360 | 1,500 | 10,275 | 143,952 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 2,470 | 4,050 | 1,210 | 16,965 | 水道 |
| GOME RETAIL HODINGS LTD | 5,233 | 11,003 | 1,364 | 19,115 | 専門小売り |
| CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT | 2,400 | 2,400 | 432 | 6,052 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ATR CHINA LIMITED-H | 1,020 | 1,020 | 627 | 8,788 | 旅客航空輸送業 |
| ZTE CORP-H | 472 | 472 | 904 | 12,670 | 通信機器 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|---------|--------|--------|---------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H | 1,260 | — | — | — | 電気設備 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO - H | 2,310 | 2,310 | 3,973 | 55,664 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H | 1,400 | 2,100 | 3,469 | 48,603 | 海運業 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 5,977 | 5,977 | 3,072 | 43,047 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 1,532 | 1,532 | 835 | 11,701 | 建設・土木 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 62,080 | 69,140 | 43,212 | 605,407 | 銀行 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 501 | 617 | 10,939 | 153,261 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 1,840 | 1,840 | 1,297 | 18,173 | 自動車 |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD | 940 | 940 | 1,178 | 16,514 | 不動産管理・開発 |
| MINTH GROUP LTD | — | 480 | 1,466 | 20,544 | 自動車部品 |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 1,010 | 1,010 | 1,242 | 17,404 | 紙製品・林産品 |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 2,350 | 3,090 | 3,460 | 48,485 | 建設資材 |
| BANK OF CHINA LTD-H | 50,970 | 56,800 | 17,835 | 249,871 | 銀行 |
| SHUI ON LAND LTD | 1,970 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD | 720 | 1,030 | 2,327 | 32,612 | 不動産管理・開発 |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS | — | 560 | 530 | 7,429 | 不動産管理・開発 |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H | 800 | 1,432 | 1,452 | 20,343 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 2,531 | 2,846 | 18,875 | 264,439 | 銀行 |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 41,580 | 44,020 | 22,230 | 311,443 | 銀行 |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H | 570 | 570 | 457 | 6,404 | 金属・鉱業 |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING | 585 | 1,010 | 1,850 | 25,922 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H | 1,744 | 1,744 | 589 | 8,258 | 建設・土木 |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 2,990 | — | — | — | 建設・土木 |
| CHINA COAL ENERGY CO-H | 1,120 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 320 | 570 | 1,806 | 25,314 | 機械 |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H | 363 | 363 | 1,221 | 17,113 | 電気設備 |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO | 870 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 4,943 | 5,743 | 5,456 | 76,447 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H | 1,800 | 1,800 | 1,063 | 14,903 | 金属・鉱業 |
| CHINA CITIC BANK-H | 5,600 | 5,600 | 2,307 | 32,323 | 銀行 |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD | 685 | 685 | 846 | 11,861 | 不動産管理・開発 |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 477 | 515 | 8,765 | 122,801 | 電子装置・機器・部品 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 700 | 770 | 11,103 | 155,558 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | — | 230 | 595 | 8,345 | 家庭用品 |
| FOSUN INTERNATIONAL LIMITED | 1,659 | 1,659 | 1,931 | 27,060 | コングロマリット |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD | 3,300 | 3,300 | 953 | 13,361 | 不動産管理・開発 |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 1,460 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 2,040 | 2,040 | 836 | 11,717 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SOHO CHINA LTD | 1,060 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| KINGSOFT CORP LTD | 460 | 540 | 2,816 | 39,453 | ソフトウェア |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 375 | 375 | 717 | 10,055 | 機械 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 2,300 | 2,300 | 975 | 13,662 | 建設・土木 |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD | 700 | 700 | 667 | 9,346 | 食品 |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD | 330 | 515 | 2,065 | 28,932 | 通信機器 |
| CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H | 1,350 | — | — | — | 建設・土木 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 3,640 | 3,080 | 1,786 | 25,027 | 食品 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 1,722 | 1,980 | 5,494 | 76,977 | 保険 |
| CRRC CORP LTD-H | 2,753 | — | — | — | 機械 |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 1,490 | 1,490 | 1,034 | 14,487 | 食品・生活必需品小売り |
| BBMG CORPORATION - H | 1,270 | — | — | — | 建設資材 |
| CHINA ZHONGWANG HOLDING LTD | 888 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 872 | 872 | 2,110 | 29,564 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|---------|--------|--------|---------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD | 1,520 | 1,520 | 1,302 | 18,249 | 建設資材 |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-H | 1,560 | — | — | — | 建設・土木 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 1,998 | 1,998 | 1,327 | 18,595 | 自動車 |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 1,040 | 1,040 | 1,420 | 19,903 | 金属・鉱業 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | 1,370 | 1,370 | 458 | 6,429 | 銀行 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 2,180 | 2,180 | 2,336 | 32,740 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 509 | 509 | 889 | 12,465 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 1,540 | 1,900 | 5,861 | 82,119 | 不動産管理・開発 |
| YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD | 910 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H | 610 | 1,160 | 1,180 | 16,544 | 機械 |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 1,165 | 1,350 | 6,615 | 92,676 | 不動産管理・開発 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 591 | 591 | 1,778 | 24,922 | 保険 |
| CHINA MINSHENG BANKING-H | 4,808 | 3,748 | 1,574 | 22,053 | 銀行 |
| KAISA GROUP HLDS LTD | 1,150 | 1,314 | 456 | 6,389 | 不動産管理・開発 |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H | 399 | 399 | 493 | 6,912 | 電気設備 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 2,570 | 2,570 | 812 | 11,377 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 18,870 | 19,100 | 5,825 | 81,615 | 銀行 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 310 | 430 | 2,453 | 34,368 | 専門小売り |
| FAR EAST HORIZON LTD | 1,540 | 1,540 | 1,384 | 19,396 | 各種金融サービス |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | — | 470 | 2,714 | 38,026 | ヘルスケア機器・用品 |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 1,230 | 1,620 | 3,152 | 44,166 | 資本市場 |
| SEAZEN GROUP LTD | 1,680 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 810 | 810 | 1,391 | 19,496 | 医薬品 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 1,736 | 1,736 | 1,208 | 16,927 | 資本市場 |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 450 | 450 | 1,869 | 26,195 | 電子装置・機器・部品 |
| PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H | 5,870 | 5,870 | 1,602 | 22,451 | 保険 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 345 | 345 | 1,726 | 24,191 | 医薬品 |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 1,960 | 1,960 | 1,340 | 18,782 | 不動産管理・開発 |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP-H | 715 | — | — | — | 建設・土木 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 2,660 | 2,660 | 1,215 | 17,030 | 資本市場 |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD | 430 | — | — | — | 自動車部品 |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | 480 | 920 | 1,773 | 24,850 | 建設関連製品 |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD | 1,440 | 1,440 | — | — | 食品 |
| GREENTOWN SER | 600 | 1,280 | 1,523 | 21,340 | 商業サービス・用品 |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 1,260 | 1,260 | 1,660 | 23,266 | 不動産管理・開発 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD | 620 | — | — | — | 資本市場 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H | 5,400 | 7,750 | 4,014 | 56,243 | 銀行 |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD | 280 | 310 | 2,187 | 30,640 | 食品 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 560 | 560 | 994 | 13,933 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 1,890 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING | — | 150 | 188 | 2,639 | 各種消費者サービス |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 720 | 1,040 | 8,273 | 115,907 | 商業サービス・用品 |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD | 670 | 670 | 359 | 5,040 | 不動産管理・開発 |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD | 232 | 366 | 3,164 | 44,328 | ヘルスケア・テクノロジー |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS | 250 | 650 | 1,168 | 16,373 | 各種消費者サービス |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD | — | 360 | 594 | 8,332 | 金属・鉱業 |
| AK MEDICAL HOLDINGS LTD | — | 240 | 274 | 3,846 | ヘルスケア機器・用品 |
| A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD | 330 | 330 | 1,155 | 16,181 | 商業サービス・用品 |
| CHINA TOWER CORP LTD | 27,900 | 27,900 | 3,096 | 43,387 | 各種電気通信サービス |
| XIAOMI CORPORATION | 6,510 | 10,360 | 26,159 | 366,487 | コンピュータ・周辺機器 |
| WUXI APPTPEC CO LTD | 95 | 200 | 3,329 | 46,652 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| WEIMOB INC | — | 1,250 | 1,892 | 26,513 | ソフトウェア |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|---------|-------|---------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| MEITUAN-CLASS B | 647 | 2,582 | 73,018 | 1,022,995 | インターネット販売・通信販売 |
| TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD | — | 548 | 1,032 | 14,464 | インターネット販売・通信販売 |
| HAIDLILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD. | 240 | 510 | 2,200 | 30,831 | ホテル・レストラン・レジャー |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 2,620 | 3,020 | 3,110 | 43,579 | 半導体・半導体製造装置 |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 585 | 665 | 5,363 | 75,138 | バイオテクノロジー |
| EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES | — | 460 | 829 | 11,626 | 商業サービス・用品 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 6,200 | 6,200 | 961 | 13,463 | 資本市場 |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED | — | 360 | 1,404 | 19,670 | 専門小売り |
| LOGAN GROUP CO LTD | 740 | 1,280 | 1,589 | 22,272 | 不動産管理・開発 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 995 | 1,135 | 4,318 | 60,504 | 建設・土木 |
| POLY PROPERTY SERVICES CO LTD | — | 74 | 463 | 6,495 | 不動産管理・開発 |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD | — | 860 | 1,577 | 22,097 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD | 980 | 980 | 802 | 11,244 | 不動産管理・開発 |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDING | 190 | 460 | 784 | 10,994 | 各種消費者サービス |
| CANSINO BIOLOGICS INC | — | 50 | 1,517 | 21,253 | 医薬品 |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 770 | 770 | 840 | 11,780 | 専門小売り |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED | 790 | 790 | 1,042 | 14,609 | 運送インフラ |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 300 | 840 | 2,776 | 38,894 | 医薬品 |
| CHINA FEIHE LTD | — | 940 | 1,974 | 27,655 | 食品 |
| PHARMARON BEIJING CO LTD | — | 80 | 1,210 | 16,957 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | — | 450 | 2,308 | 32,342 | タバコ |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | — | 2,330 | 23,719 | 332,308 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| JIUMAQJIU INTERNATIONAL HOLDINGS | — | 570 | 1,747 | 24,476 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | — | 150 | 3,663 | 51,318 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | — | 1,392 | 4,468 | 62,601 | 家庭用耐久財 |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS | — | 270 | 841 | 11,783 | ソフトウェア |
| NONGFU SPRING LTD | — | 274 | 1,075 | 15,067 | 飲料 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 3,679 | 4,099 | 245,940 | 3,445,619 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| CHINA BOHAI BANK CO LTD | — | 1,600 | 558 | 7,823 | 銀行 |
| CHINA YOUZAN LIMITED | — | 8,880 | 1,962 | 27,494 | ソフトウェア |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | — | 224 | 2,582 | 36,183 | インターネット販売・通信販売 |
| SEAZEN GROUP LTD | — | 1,680 | 1,372 | 19,229 | 不動産管理・開発 |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD | — | 80 | 1,138 | 15,948 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 993 | 1,280 | 3,449 | 48,328 | 不動産管理・開発 |
| LUYE PHARMA GROUP LTD | 625 | — | — | — | 医薬品 |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 8,700 | 8,700 | 913 | 12,798 | 娯楽 |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 260 | 460 | 2,056 | 28,807 | 半導体・半導体製造装置 |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT | 2,320 | 2,780 | 6,366 | 89,190 | ヘルスケア・テクノロジー |
| CGN POWER CO LTD-H | 6,270 | 6,270 | 1,141 | 15,987 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED | 960 | — | — | — | 自動車 |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 826 | 826 | 921 | 12,914 | 資本市場 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | 392 | 392 | 1,691 | 23,697 | 自動車部品 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 1,020 | 1,020 | 1,136 | 15,919 | 資本市場 |
| 3SBIO, INC | 770 | 770 | 535 | 7,497 | バイオテクノロジー |
| LEGEND HLDS CORP | 181 | — | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| LEGEND HLDS CORP-RTS | 181 | 181 | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 930 | 930 | 473 | 6,631 | 医薬品 |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD | 5,920 | 5,920 | 603 | 8,459 | 資本市場 |
| CHINA LITERATURE LTD | 208 | 208 | 1,598 | 22,394 | メディア |
| SSY GROUP LTD | 820 | 820 | 385 | 5,399 | 医薬品 |
| DALI FOODS GROUP CO LTD | 1,115 | 1,115 | 524 | 7,341 | 食品 |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H | 800 | — | — | — | 電子装置・機器・部品 |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|--------------------------------------|------------------|---------|---------|---------|-------------------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | | |
| CHINA YUHUA EDUCATION CO. LTD | — | 760 | 541 | 7,591 | 各種消費者サービス | |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | — | 850 | 712 | 9,979 | 不動産管理・開発 | |
| CHINA REINSURANCE GROUP CO-H | 3,080 | — | — | — | 保険 | |
| BOC AVIATION LTD | 113 | 113 | 813 | 11,398 | 商社・流通業 | |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H | 250 | 250 | 1,070 | 14,990 | 保険 | |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | — | 680 | 1,094 | 15,338 | 自動車 | |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H | 924 | 924 | 1,740 | 24,388 | 資本市場 | |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 485 | — | — | — | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 575,922 | 594,859 | 955,066 | 13,380,488 | |
| | | 208 | 203 | — | <20.2%> | |
| (マレーシア) | | | 千リンギ | | | |
| AMMB HOLDING | 1,250 | 1,250 | 363 | 9,648 | 銀行 | |
| GENTING PLANTATIONS BHD | 146 | 146 | 128 | 3,396 | 食品 | |
| CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD | 2,800 | 5,080 | 2,113 | 56,054 | 銀行 | |
| DIGI.COM BERHAD | 1,860 | 1,860 | 779 | 20,671 | 無線通信サービス | |
| MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 564 | 564 | 310 | 8,236 | 運送インフラ | |
| RHB BANK BHD | 1,250 | 1,250 | 648 | 17,211 | 銀行 | |
| HAP SENG CONSOLIDATED | 338 | 338 | 270 | 7,172 | コングロマリット | |
| GAMUDA BERHAD | 1,002 | 1,002 | 350 | 9,302 | 建設・土木 | |
| YTL CORPORATION | 2,108 | — | — | — | 総合公益事業 | |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 134 | 134 | 224 | 5,952 | 銀行 | |
| HONG LEONG BANK | 374 | 374 | 656 | 17,408 | 銀行 | |
| IJM CORP | 1,526 | — | — | — | 建設・土木 | |
| KUALA LUMPUR KEPONG | 264 | 264 | 594 | 15,769 | 食品 | |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 77 | 77 | 216 | 5,739 | 飲料 | |
| MALAYAN BANKING | 2,460 | 2,910 | 2,397 | 63,602 | 銀行 | |
| MISC BHD | 999 | 999 | 671 | 17,817 | 海運業 | |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 44 | 44 | 594 | 15,767 | 食品 | |
| PPB GROUP BERHAD | 350 | 517 | 967 | 25,663 | 食品 | |
| PETRONAS DAGANGAN BHD | 145 | 145 | 279 | 7,422 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| PETRONAS GAS BERHAD | 437 | 630 | 989 | 26,235 | ガス | |
| TELEKOM MALAYSIA | 620 | 620 | 358 | 9,521 | 各種電気通信サービス | |
| TENAGA NASIONAL | 2,090 | 1,820 | 1,801 | 47,792 | 電力 | |
| QL RESOURCES BHD | 400 | 600 | 364 | 9,660 | 食品 | |
| DIALOG GROUP BHD | 2,193 | 3,130 | 951 | 25,242 | エネルギー設備・サービス | |
| PUBLIC BANK BHD | 2,039 | 10,520 | 4,313 | 114,407 | 銀行 | |
| ATRASIA GROUP BHD | 866 | — | — | — | 旅客航空輸送業 | |
| TOP GLOVE CORP BHD | 842 | 3,320 | 1,746 | 46,320 | ヘルスケア機器・用品 | |
| CARLSBERG BREWERY MALAYSIA BERHAD | 95 | — | — | — | 飲料 | |
| KOSSAN RUBBER INDUSTRIES BERHAD | — | 800 | 335 | 8,891 | ヘルスケア機器・用品 | |
| SUPERMAX CORP BHD | — | 1,118 | 554 | 14,712 | ヘルスケア機器・用品 | |
| GENTING BHD | 1,120 | 1,870 | 923 | 24,503 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| GENTING MALAYSIA BHD | 2,290 | 2,290 | 659 | 17,493 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| IOI CORP | 1,167 | 1,620 | 664 | 17,617 | 食品 | |
| SIME DARBY BERHAD | 2,200 | 2,200 | 495 | 13,129 | コングロマリット | |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD | 1,210 | 1,170 | 1,118 | 29,668 | ヘルスケア機器・用品 | |
| AXIATA GROUP BERHAD | 1,950 | 1,950 | 717 | 19,034 | 無線通信サービス | |
| MAXIS BHD | 1,462 | 1,462 | 660 | 17,528 | 無線通信サービス | |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 1,440 | 1,900 | 1,577 | 41,829 | 化学 | |
| IHH HEALTHCARE BHD | 1,560 | 1,560 | 882 | 23,420 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD | 514 | 514 | 222 | 5,889 | 運送インフラ | |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS | 811 | 2,480 | 1,334 | 35,390 | 金属・鋳業 | |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | | 業種等 |
|---------------------------------|--------|--------|--------|---------|-------------------------|
| | | 株数 | 期末 | | |
| | | | 評価額 | 金額 | |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千リンギ | 千円 | |
| SIME DARBY PLANTATION BHD | 1,443 | 1,443 | 679 | 18,027 | 食品 |
| 小計 | 44,444 | 59,974 | 32,918 | 873,157 | |
| 銘柄数<比率> | 40 | 38 | — | <1.3%> | |
| (タイ) | | | 千バーツ | | |
| BANGKOK BANK (F) | 286 | 480 | 5,712 | 19,934 | 銀行 |
| BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR | 737 | 737 | 2,616 | 9,131 | 食品・生活必需品小売り |
| KRUNG THAI BANK-NVDR | 2,670 | 2,670 | 3,017 | 10,531 | 銀行 |
| RATCH GROUP PCL-NVDR | 430 | 430 | 2,160 | 7,541 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR | 508 | 508 | 5,156 | 17,995 | 銀行 |
| TRUE CORP PCL-NVDR | 9,200 | 9,200 | 2,980 | 10,402 | 各種電気通信サービス |
| KASIKORN BANK PCL-NVDR | 373 | 373 | 4,662 | 16,272 | 銀行 |
| TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR | 10,989 | — | — | — | 銀行 |
| IRPC PCL - NVDR | 9,000 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR | 2,630 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR | 173 | 173 | 3,070 | 10,716 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR | 1,400 | 1,400 | 8,960 | 31,270 | 無線通信サービス |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 2,790 | 2,790 | 8,021 | 27,994 | 食品 |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 742 | 857 | 14,569 | 50,845 | 無線通信サービス |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 3,545 | 3,545 | 4,928 | 17,201 | 専門小売り |
| DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | — | 201 | 8,080 | 28,199 | 電子装置・機器・部品 |
| PTT PCL-NVDR | 7,590 | 8,260 | 33,453 | 116,750 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 1,998 | 1,998 | 3,036 | 10,598 | 食品 |
| KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | — | 680 | 4,998 | 17,443 | 消費者金融 |
| LAND & HOUSES PUB - NVDR | 6,200 | 6,200 | 5,022 | 17,526 | 不動産管理・開発 |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR | 506 | 587 | 27,236 | 95,056 | 建設資材 |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR | 2,570 | 2,940 | 18,081 | 63,102 | 運送インフラ |
| KASIKORN BANK PCL (F) | 720 | 920 | 11,546 | 40,295 | 銀行 |
| CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 1,339 | 1,880 | 9,729 | 33,954 | 不動産管理・開発 |
| BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 6,510 | 6,550 | 14,213 | 49,605 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR | 322 | 322 | 4,250 | 14,833 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 1,630 | 2,709 | 7,926 | 27,662 | ホテル・レストラン・レジャー |
| THAI OIL PCL-NVDR | 830 | 830 | 4,938 | 17,235 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CP ALL PCL-NVDR | 3,750 | 4,210 | 26,312 | 91,830 | 食品・生活必需品小売り |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | 4,760 | 4,760 | 4,236 | 14,785 | 陸運・鉄道 |
| PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 864 | 1,130 | 13,560 | 47,324 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR | 430 | 430 | 1,365 | 4,764 | 無線通信サービス |
| INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 1,109 | 1,109 | 5,465 | 19,073 | 化学 |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 1,519 | 1,519 | 10,563 | 36,866 | 化学 |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 950 | 950 | 5,818 | 20,307 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR | 4,471 | 4,471 | 3,532 | 12,326 | 運送インフラ |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR | 340 | 340 | 1,436 | 5,013 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 1,650 | 1,815 | 6,171 | 21,536 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| OSOTSPA PCL-NVDR | 330 | 330 | 1,146 | 4,002 | 飲料 |
| BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR | — | 1,540 | 3,080 | 10,749 | 資本市場 |
| ASSET WORLD CORP PCL-NVDR | — | 7,000 | 3,346 | 11,677 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 1,480 | 1,550 | 5,425 | 18,936 | 複合小売り |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR | 320 | 630 | 5,197 | 18,139 | 消費者金融 |
| SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR | — | 560 | 2,534 | 8,843 | ヘルスケア機器・用品 |
| PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | — | 2,580 | 7,675 | 26,787 | 専門小売り |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | 490 | 490 | 3,123 | 10,901 | 消費者金融 |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 | |
|---------------------------------------|--------------|--------|------------|---------|--------------------|--|
| | | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千バーツ | 千円 | | |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 330 | 590 | 4,321 | 15,082 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 98,484 | 93,248 | 332,679 | 1,161,053 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 41 | 44 | — | < 1.8% > | |
| (フィリピン) | | | 千フィリピンペソ | | | |
| AYALA LAND LTD | 4,990 | 6,080 | 19,608 | 44,527 | 不動産管理・開発 | |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 1,460 | 1,460 | 5,022 | 11,405 | コングロマリット | |
| BANK OF PHILIPPINE ISLANDS | 535 | 1,459 | 11,971 | 27,187 | 銀行 | |
| GLOBE TELECOM INC | 20 | 20 | 3,790 | 8,607 | 無線通信サービス | |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS | 690 | 690 | 9,342 | 21,216 | 運送インフラ | |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC | 1,737 | 2,550 | 13,030 | 29,591 | コングロマリット | |
| JOLLIBEE FOODS CORPORATION | 244 | 244 | 4,287 | 9,735 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| METROPOLITAN BANK & TRUST | 1,276 | 1,276 | 5,561 | 12,628 | 銀行 | |
| MEGAWORLD CORP | 9,100 | 9,100 | 2,739 | 6,220 | 不動産管理・開発 | |
| ROBINSONS LAND CO | 1,320 | — | — | — | 不動産管理・開発 | |
| SECURITY BANK CORP | 120 | — | — | — | 銀行 | |
| SM PRIME HLDGS | 6,529 | 7,739 | 26,160 | 59,407 | 不動産管理・開発 | |
| UNIVERSAL ROBINA CORP | 670 | 670 | 8,844 | 20,083 | 食品 | |
| SM INVESTMENTS CORP | 168 | 171 | 15,732 | 35,725 | コングロマリット | |
| AYALA CORPORATION | 207 | 211 | 15,214 | 34,550 | コングロマリット | |
| METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 7,478 | 7,478 | 2,961 | 6,724 | 各種金融サービス | |
| ABOITIZ POWER CORP | 767 | 767 | 1,787 | 4,058 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| MANILA ELECTRIC COMPANY | 169 | 169 | 4,627 | 10,507 | 電力 | |
| BDO UNIBANK INC | 1,249 | 1,249 | 12,999 | 29,521 | 銀行 | |
| PUREGOLD PRICE CLUB INC | — | 650 | 2,213 | 5,026 | 食品・生活必需品小売り | |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC | 54 | 54 | 2,737 | 6,217 | コングロマリット | |
| PLDT INC | 49 | 49 | 6,301 | 14,311 | 無線通信サービス | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 38,837 | 42,091 | 174,932 | 397,254 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 21 | 20 | — | < 0.6% > | |
| (インドネシア) | | | 千ルピア | | | |
| ANEKA TAMBANG TBK | — | 7,600 | 1,991,200 | 15,332 | 金属・鉱業 | |
| BARITO PACIFIC TBK PT | 16,600 | 16,600 | 1,543,800 | 11,887 | 化学 | |
| UNITED TRACTORS TBK PT | 991 | 1,470 | 3,198,337 | 24,627 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| INDOFOOD SUKSES MAK TBK | 2,662 | 2,662 | 1,730,300 | 13,323 | 食品 | |
| PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA | 4,990 | 4,990 | 3,293,400 | 25,359 | 食品 | |
| GUDANG GARAM TBK | 292 | 292 | 1,024,190 | 7,886 | タバコ | |
| HM SAMPOERNA TBK PT | 6,400 | — | — | — | タバコ | |
| INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA | 1,360 | 1,270 | 1,555,750 | 11,979 | 建設資材 | |
| INDAH KIAT PULP&PAPER | 1,486 | 2,400 | 2,220,000 | 17,094 | 紙製品・林産品 | |
| BUKIT ASAM TBK PT | 2,200 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| BANK MANDIRI | 11,070 | 13,300 | 7,913,500 | 60,933 | 銀行 | |
| PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA | 1,000 | — | — | — | 紙製品・林産品 | |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT | 5,235 | 5,235 | 2,892,337 | 22,270 | 家庭用品 | |
| BANK RAKYAT INDONESIA | 35,360 | 41,100 | 16,645,500 | 128,170 | 銀行 | |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT | 5,935 | 5,935 | 730,005 | 5,621 | ガス | |
| BANK NEGARA INDONESIA PT | 4,990 | 4,990 | 2,794,400 | 21,516 | 銀行 | |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 1,760 | 1,760 | 1,724,800 | 13,280 | 建設資材 | |
| BANK CENTRAL ASIA | 6,380 | 6,870 | 21,984,000 | 169,276 | 銀行 | |
| XL AXIATA TBK PT | 1,600 | — | — | — | 無線通信サービス | |
| JASA MARGA (PERSERO) TBK PT | 1,135 | — | — | — | 運送インフラ | |
| BUMI SERPONG DAMAI PT | 4,283 | — | — | — | 不動産管理・開発 | |
| ADARO ENERGY PT | 8,392 | 8,392 | 994,452 | 7,657 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| PAKUWON JATI TBK PT | 9,200 | — | — | — | 不動産管理・開発 | |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | | 業種等 | |
|--|---------|---------|------------|------------|----------------------|--|
| | | 株数 | 期末 | | | |
| | | | 評価額 | 金額 | | |
| (インドネシア) | 百株 | 百株 | 千ルピア | 千円 | | |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 1,780 | 1,780 | 1,504,100 | 11,581 | 食品 | |
| BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT | 2,080 | — | — | — | 銀行 | |
| KALBE FARMA PT | 15,400 | 15,400 | 2,248,400 | 17,312 | 医薬品 | |
| ACE HARDWARE INDONESIA | 3,000 | — | — | — | 専門小売り | |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK | 13,350 | 13,350 | 7,108,875 | 54,738 | 自動車 | |
| SARANA MENARA NUSANTARA PT | — | 14,790 | 1,686,060 | 12,982 | 各種電気通信サービス | |
| TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK | 33,200 | 37,500 | 11,962,500 | 92,111 | 各種電気通信サービス | |
| MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | — | 6,350 | 1,689,100 | 13,006 | 金属・鉱業 | |
| 小計 | 株数・金額 | 202,132 | 214,036 | 98,435,007 | 757,949 | |
| | 銘柄数<比率> | 28 | 22 | — | <1.1%> | |
| (韓国) | | | 千ウォン | | | |
| CHEIL WORLDWIDE INC | 59 | 59 | 137,175 | 13,401 | メディア | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 26 | 26 | 293,040 | 28,630 | 自動車 | |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE | 18 | 25 | 522,080 | 51,007 | 保険 | |
| DB INSURANCE CO LTD | 28 | 28 | 143,925 | 14,061 | 保険 | |
| COWAY CO LTD | 33 | 33 | 231,796 | 22,646 | 家庭用耐久財 | |
| KT & G CORP | 72 | 80 | 672,878 | 65,740 | タバコ | |
| S-1 CORPORATION | 14 | 14 | 116,000 | 11,333 | 商業サービス・用品 | |
| KOREA GAS CORPORATION | 15 | 15 | 52,607 | 5,139 | ガス | |
| CJ CORP | 11 | 11 | 109,780 | 10,725 | コングロマリット | |
| KAKAO CORP | 35 | 210 | 2,410,225 | 235,478 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| CJ ENM CO LTD | 6 | 6 | 97,958 | 9,570 | インターネット販売・通信販売 | |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | 29 | 29 | 108,025 | 10,554 | 機械 | |
| KMW CO.LTD. | 11 | 11 | 58,938 | 5,758 | 通信機器 | |
| SK TELECOM CO LTD | 12 | 27 | 842,400 | 82,302 | 無線通信サービス | |
| DAELIM INDUSTRIAL COMPANY | 16 | — | — | — | 建設・土木 | |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 247 | 247 | 252,317 | 24,651 | 資本市場 | |
| NCISOFT CORPORATION | 10 | 11 | 936,240 | 91,470 | 娯楽 | |
| LG UPLUS CORP | 133 | 133 | 186,865 | 18,256 | 各種電気通信サービス | |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES | — | 160 | 202,400 | 19,774 | 電気設備 | |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTR | 96 | — | — | — | 建設・土木 | |
| POSCO INTERNATIONAL CORP | 39 | — | — | — | 商社・流通業 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE | 5 | 6 | 1,052,570 | 102,836 | パーソナル用品 | |
| LG CHEMICALS LTD | 29 | 33 | 3,072,217 | 300,155 | 化学 | |
| LG CHEM LTD - PREFERRED | 3 | 6 | 274,050 | 26,774 | 化学 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF | 1 | 1 | 76,960 | 7,518 | パーソナル用品 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP | 286 | 324 | 1,344,600 | 131,367 | 銀行 | |
| S-OIL CORPORATION | 26 | 39 | 370,992 | 36,245 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| HANWHA SOLUTIONS CORP | 63 | 73 | 342,576 | 33,469 | 化学 | |
| MERITZ SECURITIES | 245 | 245 | 120,172 | 11,740 | 資本市場 | |
| SAMSUNG SECURITIES | 35 | 35 | 155,077 | 15,151 | 資本市場 | |
| POSCO CHEMICAL CO LTD | 18 | 22 | 336,150 | 32,841 | 建設資材 | |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 10 | 10 | 324,450 | 31,698 | 化学 | |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 19 | 19 | 182,084 | 17,789 | 専門小売り | |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN | 23 | 32 | 495,945 | 48,453 | 機械 | |
| HYUNDAI MOBIS | 44 | 49 | 1,373,625 | 134,203 | 自動車部品 | |
| SK HYNIX INC | 349 | 393 | 5,097,120 | 497,988 | 半導体・半導体製造装置 | |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR | 46 | 69 | 369,840 | 36,133 | 建設・土木 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD | 14 | 14 | 166,110 | 16,228 | 自動車 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD | 99 | 106 | 2,390,080 | 233,510 | 自動車 | |
| HYUNDAI STEEL CO | 47 | 47 | 284,350 | 27,781 | 金属・鉱業 | |
| INDUSTRIAL BK OF KOREA | 150 | 150 | 153,408 | 14,987 | 銀行 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-----------------------------------|---------|-------|------------|-----------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千ウォン | 千円 | |
| KCC CORP | 2 | — | — | — | 化学 |
| KIA CORP | 164 | 181 | 1,466,319 | 143,259 | 自動車 |
| KOREA ZINC CO LTD | 5 | 5 | 269,656 | 26,345 | 金属・鉱業 |
| KOREA ELECTRIC POWER | 148 | 196 | 476,280 | 46,532 | 電力 |
| HANWHA CORPORATION | 24 | 24 | 77,805 | 7,601 | コングロマリット |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 25 | 126 | 351,540 | 34,345 | 旅客航空輸送業 |
| OCI COMPANY LTD | 15 | — | — | — | 化学 |
| CJ LOGISTICS | 7 | 7 | 131,430 | 12,840 | 陸運・鉄道 |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO | 9 | 14 | 418,690 | 40,906 | 化学 |
| DUZONBIZON CO., LTD. | — | 12 | 104,036 | 10,164 | ソフトウェア |
| HLB INC | 18 | 74 | 245,680 | 24,002 | レジャー用品 |
| HLB INC RTS | 1 | — | — | — | レジャー用品 |
| LG ELECTRONICS INC | 61 | 74 | 1,133,730 | 110,765 | 家庭用耐久財 |
| LOTTE CORP | 16 | 16 | 57,591 | 5,626 | コングロマリット |
| LG CORP | 60 | 71 | 909,535 | 88,861 | コングロマリット |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 77 | 77 | 102,036 | 9,968 | 資本市場 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT | 42 | 42 | 192,643 | 18,821 | 建設・土木 |
| NAVER CORP | 91 | 87 | 3,151,530 | 307,904 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HYUNDAI DEPT STORE CO | 11 | — | — | — | 複合小売り |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 31 | 31 | 351,680 | 34,359 | 資本市場 |
| OTTOGI CORPORATION | 0.7 | 0.7 | 37,800 | 3,693 | 食品 |
| AMOREPACIFIC GROUP | 15 | 15 | 112,480 | 10,989 | パーソナル用品 |
| KANGWON LAND INC | 79 | 79 | 201,845 | 19,720 | ホテル・レストラン・レジャー |
| POSCO | 50 | 50 | 2,017,860 | 197,144 | 金属・鉱業 |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 85 | 85 | 152,934 | 14,941 | 建設・土木 |
| SAMSUNG SDI CO, LTD | 34 | 40 | 2,574,420 | 251,520 | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRO MECHANICS | 34 | 40 | 740,740 | 72,370 | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRONICS | 3,073 | 3,410 | 27,935,271 | 2,729,275 | コンピュータ・周辺機器 |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 307 | 307 | 184,507 | 18,026 | 機械 |
| SAMSUNG ELECTRONICS PFD | 524 | 594 | 4,445,364 | 434,312 | コンピュータ・周辺機器 |
| SHINSEGAE CO LTD | 4 | 4 | 134,718 | 13,161 | 複合小売り |
| SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 23 | 149,819 | 14,637 | 医薬品 |
| YUHAN CORPORATION | 36 | 38 | 239,843 | 23,432 | 医薬品 |
| HANON SYSTEMS | 116 | 116 | 191,642 | 18,723 | 自動車部品 |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO | 34 | 34 | 84,660 | 8,271 | 保険 |
| GS HOLDINGS CORP | 36 | 36 | 168,120 | 16,425 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LG DISPLAY CO LTD | 162 | 162 | 400,140 | 39,093 | 電子装置・機器・部品 |
| CELLTRION INC | 60 | 70 | 1,878,825 | 183,561 | バイオテクノロジー |
| HELIXMITH CO LTD | 15 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| HANA FINANCIAL HOLDINGS | 201 | 201 | 930,630 | 90,922 | 銀行 |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 11 | 11 | 226,290 | 22,108 | 航空貨物・物流サービス |
| CELLTRION PHARM INC | — | 10 | 138,390 | 13,520 | 医薬品 |
| LOTTE SHOPPING CO | 8 | 8 | 100,800 | 9,848 | 複合小売り |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO | 46 | 46 | 400,896 | 39,167 | 保険 |
| AMOREPACIFIC CORP | 19 | 24 | 681,420 | 66,574 | パーソナル用品 |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF | 4 | — | — | — | パーソナル用品 |
| SAMSUNG CARD CO | 13 | 13 | 46,580 | 4,550 | 消費者金融 |
| SK INNOVATION CO LTD | 35 | 39 | 1,131,165 | 110,514 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 5 | 5 | 217,770 | 21,276 | 食品 |
| PAN OCEAN CO LTD | 148 | 148 | 110,781 | 10,823 | 海運業 |
| LG INNOTEK CO LTD | 8 | 8 | 172,860 | 16,888 | 電子装置・機器・部品 |
| SK HOLDINGS CO LTD | 23 | 27 | 768,400 | 75,072 | コングロマリット |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|--|------------------|--------------|---------------|-----------------|-------------------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千ウォン | 千円 | | |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 255 | 285 | 1,661,550 | 162,333 | 銀行 | |
| MEDY-TOX INC | 2 | — | — | — | バイオテクノロジー | |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 45 | 45 | 149,612 | 14,617 | 航空宇宙・防衛 | |
| BNK FINANCIAL GROUP INC | 228 | — | — | — | 銀行 | |
| HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD | 4 | 4 | 166,845 | 16,300 | 医薬品 | |
| HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD | 132 | — | — | — | 保険 | |
| FILA HOLDINGS CORP | 29 | 29 | 144,888 | 14,155 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| SEEGENE, INC. | — | 27 | 223,312 | 21,817 | バイオテクノロジー | |
| E-MART CO | 11 | 11 | 190,731 | 18,634 | 食品・生活必需品小売り | |
| GS RETAIL CO LTD | 11 | 11 | 41,325 | 4,037 | 食品・生活必需品小売り | |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 53 | 53 | 263,340 | 25,728 | 自動車部品 | |
| HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E | 23 | — | — | — | 建設・土木 | |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD | 5 | 29 | 225,367 | 22,018 | 機械 | |
| BGF RETAIL CO LTD /NEW | 4 | 4 | 80,510 | 7,865 | 食品・生活必需品小売り | |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 18 | 18 | 216,900 | 21,191 | 食品 | |
| SK CHEMICALS CO LTD/NEW | — | 6 | 153,300 | 14,977 | 化学 | |
| NETMARBLE CORP | 14 | 14 | 191,835 | 18,742 | 娯楽 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 388 | 423 | 465,300 | 45,459 | 銀行 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | — | 17 | 191,160 | 18,676 | 医薬品 | |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 24 | 25 | 470,310 | 45,949 | 情報技術サービス | |
| ALTEOGEN INC | — | 21 | 164,010 | 16,023 | バイオテクノロジー | |
| SAMSUNG C&T CORP | 57 | 57 | 766,650 | 74,901 | コングロメリット | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 10 | 11 | 955,956 | 93,396 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| PEARL ABYSS CORP | 3 | 15 | 89,125 | 8,707 | 娯楽 | |
| DOOSAN BOBCAT INC | 33 | 33 | 172,190 | 16,822 | 機械 | |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 35 | 48 | 543,500 | 53,100 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 9,846 111 | 10,703 106 | 88,901,898 — | 8,685,715 <13.1%> | |
| (台湾) | | | 千新台幣ドル | | | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION | 320 | 320 | 9,280 | 36,165 | 通信機器 | |
| ACER INC | 1,607 | 2,567 | 8,768 | 34,172 | コンピュータ・周辺機器 | |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 458 | 498 | 19,473 | 75,891 | コンピュータ・周辺機器 | |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 284 | 324 | 16,727 | 65,187 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ASIA CEMENT | 1,269 | 1,869 | 9,405 | 36,652 | 建設資材 | |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP | 180 | 180 | 4,158 | 16,204 | 電子装置・機器・部品 | |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 3,206 | 3,366 | 3,363 | 13,106 | 銀行 | |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 690 | 690 | 7,866 | 30,654 | 半導体・半導体製造装置 | |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD | 520 | 520 | 9,880 | 38,503 | コンピュータ・周辺機器 | |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | — | 780 | 8,307 | 32,373 | 電子装置・機器・部品 | |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 486 | 486 | 4,129 | 16,094 | コンピュータ・周辺機器 | |
| QUANTA COMPUTER INC | 1,756 | 2,126 | 20,290 | 79,072 | コンピュータ・周辺機器 | |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 391 | 430 | 1,923 | 7,494 | 不動産管理・開発 | |
| EVA AIRWAYS CORP | 1,809 | — | — | — | 旅客航空輸送業 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 408 | 458 | 8,732 | 34,031 | コンピュータ・周辺機器 | |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 3,417 | 3,554 | 6,344 | 24,726 | 銀行 | |
| CHINA AIRLINES | 1,335 | — | — | — | 旅客航空輸送業 | |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 1,530 | 1,420 | 7,243 | 28,229 | 自動車部品 | |
| CHINA STEEL | 7,545 | 8,725 | 35,948 | 140,096 | 金属・鉱業 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 1,767 | 1,873 | 4,890 | 19,057 | 保険 | |
| ADVANTECH CO., LTD. | 215 | 267 | 9,309 | 36,278 | コンピュータ・周辺機器 | |
| COMPAL ELECTRONICS | 2,445 | 3,545 | 8,705 | 33,924 | コンピュータ・周辺機器 | |
| DELTA ELECTRONICS INC | 1,236 | 1,386 | 40,702 | 158,623 | 電子装置・機器・部品 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-------------------------------------|---------|--------|-----------|-----------|-------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千新台幣ドル | 千円 | |
| NANYA TECHNOLOGY CO | 630 | 1,000 | 8,550 | 33,320 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 2,420 | 2,630 | 29,857 | 116,359 | 各種電気通信サービス |
| AU OPTRONICS CORP | 4,890 | 6,700 | 18,860 | 73,502 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 1,022 | 1,282 | 12,884 | 50,210 | 無線通信サービス |
| EVERGREEN MARINE | 2,023 | 2,023 | 17,201 | 67,037 | 海運業 |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION | 2,294 | 2,344 | 7,795 | 30,380 | コングロマリット |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 223 | 268 | 5,550 | 21,631 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 114 | 114 | 6,522 | 25,418 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 340 | 400 | 23,153 | 90,231 | 半導体・半導体製造装置 |
| FORMOSA PLASTIC | 2,974 | 2,734 | 28,709 | 111,883 | 化学 |
| FORMOSA TAFFETA CO. | 650 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO | 2,189 | 2,479 | 22,493 | 87,659 | 化学 |
| GIANT MANUFACTURING | 187 | 187 | 6,150 | 23,969 | レジャー用品 |
| MEDIATEK INC | 945 | 1,075 | 113,990 | 444,231 | 半導体・半導体製造装置 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | 4,255 | 4,795 | 33,951 | 132,312 | 保険 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 4,893 | 6,687 | 12,638 | 49,254 | 銀行 |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 180 | 200 | 11,940 | 46,531 | 専門小売り |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 1,050 | 1,050 | 6,888 | 26,843 | 無線通信サービス |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 6,193 | 6,441 | 16,683 | 65,017 | 各種金融サービス |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD | 4,970 | 5,520 | 30,417 | 118,538 | 保険 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING | 8,387 | 8,387 | 10,778 | 42,004 | 保険 |
| E. SUN FINANCIAL HOLDINGS CO | 6,584 | 8,208 | 21,876 | 85,256 | 銀行 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 8,006 | 9,006 | 105,826 | 412,415 | 電子装置・機器・部品 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 7,113 | 8,223 | 26,809 | 104,479 | 銀行 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 60 | 70 | 21,155 | 82,443 | 電子装置・機器・部品 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS | 6,647 | 6,801 | 10,134 | 39,494 | 銀行 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS | 7,082 | 7,082 | 7,117 | 27,738 | 保険 |
| INVENTEC CO., LTD | 1,369 | 1,369 | 3,676 | 14,325 | コンピュータ・周辺機器 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 1,458 | 1,458 | 9,833 | 38,321 | コンピュータ・周辺機器 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 7,415 | 7,595 | 10,367 | 40,404 | 銀行 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING | 12,362 | 12,582 | 29,064 | 113,268 | 銀行 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 6,177 | 7,623 | 17,152 | 66,843 | 銀行 |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC | 461 | 461 | 4,845 | 18,883 | 半導体・半導体製造装置 |
| NAN YA PLASTICS CORP | 3,407 | 3,807 | 33,732 | 131,458 | 化学 |
| WISTRON CORP | 2,164 | 2,124 | 6,618 | 25,791 | コンピュータ・周辺機器 |
| POU CHEN CORP | 1,354 | 1,354 | 4,633 | 18,055 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 3,008 | 3,648 | 27,216 | 106,066 | 食品 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 378 | 378 | 10,248 | 39,938 | 食品・生活必需品小売り |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 883 | 883 | 9,277 | 36,156 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PHISON ELECTRONICS CORP | 93 | 93 | 5,090 | 19,837 | 半導体・半導体製造装置 |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 310 | 465 | 2,488 | 9,696 | 不動産管理・開発 |
| RUENTEX INDUSTRIES LTD | 202 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 548 | 548 | 3,630 | 14,146 | 電子装置・機器・部品 |
| STANDARD FOODS CORP | 270 | — | — | — | 食品 |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 775 | 775 | 4,351 | 16,958 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN CEMENT | 3,293 | 3,342 | 17,483 | 68,135 | 建設資材 |
| TATUNG CO LTD | 1,300 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR | 15,810 | 17,560 | 1,051,844 | 4,099,141 | 半導体・半導体製造装置 |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 7,045 | 8,495 | 45,873 | 178,771 | 半導体・半導体製造装置 |
| WINBOND ELECTRONICS CORPORATION | 2,420 | 2,420 | 8,203 | 31,971 | 半導体・半導体製造装置 |
| YAGEO CORPORATION | 143 | 253 | 13,576 | 52,909 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 1,430 | 1,430 | 4,433 | 17,275 | 運送インフラ |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | | 業種等 | |
|--|---------|---------|---------|-----------|-------------------------|--|
| | | 株数 | 期末 | | | |
| | | | 評価額 | 額 | | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千新台幣ドル | 千円 | | |
| INNOLUX CORP | 5,053 | 6,603 | 17,663 | 68,836 | 電子装置・機器・部品 | |
| WPG HOLDINGS CO LTD | 1,203 | 1,203 | 6,127 | 23,880 | 電子装置・機器・部品 | |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION | — | 160 | 5,088 | 19,828 | 電子装置・機器・部品 | |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 132 | 180 | 6,714 | 26,167 | 機械 | |
| PEGATRON CORP | 1,216 | 1,596 | 11,354 | 44,248 | コンピュータ・周辺機器 | |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 80 | 80 | 8,560 | 33,359 | 機械 | |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP | 210 | 240 | 8,100 | 31,566 | 半導体・半導体製造装置 | |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 730 | 839 | 17,088 | 66,595 | 各種金融サービス | |
| ONENESS BIOTECH CO LTD | — | 130 | 3,055 | 11,905 | 医薬品 | |
| ASMEDIA TECHNOLOGY INC | — | 20 | 2,150 | 8,378 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 364 | 364 | 3,633 | 14,160 | 電子装置・機器・部品 | |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 5,713 | 7,284 | 15,661 | 61,035 | 銀行 | |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK | 2,205 | 2,205 | 9,716 | 37,865 | 銀行 | |
| WIWYNN CORP | 50 | 50 | 4,720 | 18,394 | コンピュータ・周辺機器 | |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 2,176 | 2,206 | 24,934 | 97,171 | 半導体・半導体製造装置 | |
| SILERGY CORP | — | 50 | 16,500 | 64,302 | 半導体・半導体製造装置 | |
| GLOBALWAFERS CO LTD | 130 | 150 | 11,490 | 44,777 | 半導体・半導体製造装置 | |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 100 | 100 | 3,795 | 14,789 | 家庭用耐久財 | |
| 小計 | 株数・金額 | 212,666 | 233,245 | 2,363,379 | 9,210,326 | |
| | 銘柄数<比率> | 88 | 87 | — | <13.9%> | |
| (インド) | | | 千インドルピー | | | |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | 1,823 | 2,051 | 396,201 | 590,340 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 447 | 447 | 19,811 | 29,518 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| EICHER MOTORS LTD | 8 | — | — | — | 自動車 | |
| MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED | 508 | 622 | 47,732 | 71,121 | 自動車 | |
| SHREE CEMENT LIMITED | 4 | 8 | 24,499 | 36,503 | 建設資材 | |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 343 | 343 | 8,644 | 12,880 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| LIC HOUSING FINANCE | 180 | — | — | — | 貯蓄・抵当・不動産金融 | |
| TATA STEEL LIMITED | 186 | 496 | 58,644 | 87,380 | 金属・鉱業 | |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | — | 453 | 28,493 | 42,455 | 食品 | |
| NESTLE INDIA LIMITED | 15 | 23 | 39,556 | 58,939 | 食品 | |
| GAIL INDIA LTD | 946 | 946 | 14,213 | 21,178 | ガス | |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | — | 370 | 65,872 | 98,150 | 銀行 | |
| VEDANTA LTD | 1,260 | 1,260 | 35,664 | 53,139 | 金属・鉱業 | |
| TITAN CO LTD | 210 | 269 | 38,910 | 57,977 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| OIL&NATURAL GAS CORP LTD | 1,570 | 1,570 | 17,497 | 26,071 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| COLGATE-PALMOLIVE(INDIA) | 29 | 102 | 15,415 | 22,969 | パーソナル用品 | |
| LUPIN LTD | 149 | 149 | 17,828 | 26,564 | 医薬品 | |
| ACC LIMITED | — | 60 | 11,428 | 17,028 | 建設資材 | |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 1,050 | 1,203 | 300,359 | 447,534 | 貯蓄・抵当・不動産金融 | |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | 700 | 700 | 13,037 | 19,425 | メディア | |
| INFOSYS LTD | 2,186 | 2,455 | 332,051 | 494,756 | 情報技術サービス | |
| WIPRO LTD | 804 | 804 | 41,426 | 61,724 | 情報技術サービス | |
| MRF LTD | — | 2 | 15,489 | 23,078 | 自動車部品 | |
| INDIAN OIL CORPORATION LTD | 1,130 | 1,130 | 10,701 | 15,944 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LIMITED | 536 | 582 | 140,331 | 209,094 | 家庭用品 | |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | — | 70 | 23,175 | 34,532 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 696 | 769 | 70,471 | 105,002 | 情報技術サービス | |
| DABUR INDIA LTD | 378 | 378 | 20,207 | 30,109 | パーソナル用品 | |
| HERO MOTOCORP LTD | 62 | 93 | 26,605 | 39,642 | 自動車 | |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | — | 70 | 12,828 | 19,115 | 自動車部品 | |
| DR. REDDYS LABORATORIES | 71 | 91 | 47,296 | 70,472 | 医薬品 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---------------------------------------|---------|-------|---------|---------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インドルピー | 千円 | |
| IPCA LABORATORIES LTD | — | 60 | 12,337 | 18,383 | 医薬品 |
| BHARTI AIRTEL LIMITED | 1,542 | 1,775 | 100,908 | 150,354 | 無線通信サービス |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD | 601 | 617 | 41,922 | 62,463 | 医薬品 |
| DIVIS LABORATORIES LTD | 59 | 97 | 39,082 | 58,232 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 70 | 96 | 64,751 | 96,479 | 自動車 |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 187 | 187 | 18,944 | 28,226 | 医薬品 |
| BIOCON LTD | — | 186 | 7,089 | 10,563 | バイオテクノロジー |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 574 | 1,060 | 23,415 | 34,888 | 自動車部品 |
| SHRIRAM TRANSFUT FINANCE | 52 | 157 | 20,373 | 30,355 | 消費者金融 |
| PETRONET LNG LTD | 349 | 349 | 8,496 | 12,659 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CIPLA LIMITED | 209 | 345 | 30,460 | 45,385 | 医薬品 |
| LARSEN&TOUBRO LIMITED | 311 | 471 | 63,241 | 94,229 | 建設・土木 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 61 | 81 | 52,697 | 78,519 | 建設資材 |
| ASHOK LEYLAND LIMITED | 606 | — | — | — | 機械 |
| BOSCH LTD | 3 | — | — | — | 自動車部品 |
| TATA CONSULTANCY SVS LTD | 591 | 680 | 213,037 | 317,425 | 情報技術サービス |
| NTPC LIMITED | 1,420 | 3,220 | 33,826 | 50,400 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 79 | 79 | 13,235 | 19,720 | 各種金融サービス |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 299 | 570 | 17,798 | 26,519 | 建設資材 |
| BHARAT FORGE LIMITED | 127 | 127 | 8,087 | 12,050 | 自動車部品 |
| HINDALCO INDUSTRIES LIMITED | 717 | 1,170 | 46,928 | 69,923 | 金属・鉱業 |
| ITC LTD | 2,211 | 2,211 | 45,402 | 67,650 | タバコ |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 66 | 124 | 22,520 | 33,556 | 化学 |
| UPL LTD | 321 | 321 | 20,203 | 30,103 | 化学 |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | — | 32 | 8,554 | 12,746 | 医薬品 |
| SIEMENS LIMITED | 31 | 31 | 5,775 | 8,605 | コングロマリット |
| INFO EDGE INDIA LTD | 29 | 48 | 22,731 | 33,870 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 272 | 272 | 19,097 | 28,454 | パーソナル用品 |
| MARICO LIMITED | 263 | 263 | 12,481 | 18,597 | パーソナル用品 |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 3 | 3 | 10,074 | 15,010 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DLF LIMITED | 260 | 260 | 6,706 | 9,992 | 不動産管理・開発 |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 1,270 | 1,270 | 27,247 | 40,599 | 電力 |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 426 | 426 | 32,706 | 48,732 | 運送インフラ |
| REC LTD | 398 | 398 | 5,223 | 7,782 | 各種金融サービス |
| BAJAJ FINSERV LTD | 23 | 23 | 26,258 | 39,125 | 保険 |
| BAJAJ AUTO LIMITED | 55 | 55 | 21,615 | 32,206 | 自動車 |
| JUBILANT FOODWORKS LIMITED | — | 47 | 12,880 | 19,192 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MUTHOOT FINANCE LTD | — | 100 | 12,117 | 18,054 | 消費者金融 |
| COAL INDIA LTD | 769 | 769 | 10,523 | 15,680 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TATA MOTORS LTD | 1,040 | 1,340 | 40,568 | 60,447 | 自動車 |
| TATA POWER COMPANY LIMITED | 638 | — | — | — | 電力 |
| MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS | 151 | — | — | — | 消費者金融 |
| INDUS TOWERS LTD | 165 | 610 | 15,530 | 23,140 | 各種電気通信サービス |
| PI INDUSTRIES LTD | — | 70 | 17,910 | 26,687 | 化学 |
| ASIAN PAINTS LTD | 193 | 262 | 66,853 | 99,611 | 化学 |
| BAJAJ FINANCE LTD | 111 | 200 | 110,095 | 164,042 | 消費者金融 |
| LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD | — | 40 | 15,074 | 22,460 | 情報技術サービス |
| ADANI GREEN ENERGY LTD | — | 280 | 30,881 | 46,012 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| INDRAPRASTHA GAS LTD | — | 135 | 6,953 | 10,361 | ガス |
| TRENT LTD | — | 150 | 11,291 | 16,823 | 複合小売り |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 320 | 617 | 41,502 | 61,838 | 保険 |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 19 | 48 | 13,049 | 19,443 | 資本市場 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|---|--------------|--------|---------|-----------|----------------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インドルピー | 千円 | | |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 123 | 123 | 7,106 | 10,588 | 陸運・鉄道 | |
| BANDHAN BANK LTD | 289 | 560 | 16,651 | 24,810 | 銀行 | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 45 | 80 | 27,828 | 41,464 | 食品 | |
| YES BANK LTD | — | 8,390 | 11,200 | 16,688 | 銀行 | |
| EICHER MOTORS LTD | — | 82 | 19,820 | 29,532 | 自動車 | |
| AXIS BANK LIMITED | 1,404 | 1,627 | 116,615 | 173,756 | 銀行 | |
| HAVELLS INDIA LTD | 177 | 177 | 17,735 | 26,425 | 電気設備 | |
| ICICI BANK LTD | 3,145 | 3,566 | 216,491 | 322,572 | 銀行 | |
| BERGER PAINTS INDIA LTD | 190 | 190 | 13,593 | 20,254 | 化学 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 283 | 442 | 43,357 | 64,603 | 情報技術サービス | |
| GRASIM INDUSTRIES LIMITED | 177 | 177 | 25,657 | 38,230 | 建設資材 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 78 | 115 | 33,298 | 49,614 | 食品・生活必需品小売り | |
| UNITED SPIRITS LTD | 226 | 226 | 12,383 | 18,451 | 飲料 | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY | 102 | 160 | 23,199 | 34,566 | 保険 | |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD | 171 | 171 | 9,605 | 14,312 | 保険 | |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 50 | 50 | 8,219 | 12,246 | 旅客航空輸送業 | |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 196 | 258 | 25,806 | 38,451 | 保険 | |
| JSW STEEL LTD | 530 | 530 | 40,118 | 59,776 | 金属・鉄業 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 39,383 | 56,181 | 4,071,554 | 6,066,616 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 83 | 95 | — | < 9.2% > | |
| (パキスタン) | | | | 千パキスタドルピー | | |
| MCB BANK LIMITED | 340 | 340 | 5,559 | 4,002 | 銀行 | |
| OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD | 510 | 510 | 4,726 | 3,402 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| HABIB BANK LTD | 356 | 356 | 4,523 | 3,257 | 銀行 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,206 | 1,206 | 14,809 | 10,662 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.0% > | |
| (メキシコ) | | | | 千メキシコペソ | | |
| ALFA S. A. B. -A | 1,721 | — | — | — | コングロマリット | |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 1,187 | 1,454 | 23,099 | 126,182 | 飲料 | |
| EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1 | 108 | — | — | — | 複合小売り | |
| GRUPO TELEVISIA SAB - SER CPO | 1,534 | 1,980 | 10,032 | 54,803 | メディア | |
| GRUPO BIMBO SAB-SERIES A | 1,010 | 1,010 | 4,151 | 22,675 | 食品 | |
| GRUMA S. A. B. -B | 134 | 134 | 2,870 | 15,678 | 食品 | |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 129 | 129 | 1,999 | 10,920 | 運送インフラ | |
| GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 349 | 349 | 2,014 | 11,001 | コングロマリット | |
| CEMEX SAB - CPO | 8,619 | 10,799 | 18,500 | 101,057 | 建設資材 | |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 1,673 | 1,839 | 21,988 | 120,114 | 銀行 | |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 84 | 84 | 2,379 | 12,996 | 金属・鉄業 | |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 950 | 950 | 3,337 | 18,230 | 家庭用品 | |
| ALSEA SAB DE CV | 300 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー | |
| GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B | 143 | 143 | 5,154 | 28,153 | 運送インフラ | |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B | 2,299 | 2,169 | 21,743 | 118,775 | 金属・鉄業 | |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 21,710 | 24,740 | 36,491 | 199,334 | 無線通信サービス | |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 1,402 | 1,402 | 2,717 | 14,842 | 銀行 | |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 261 | 261 | 2,843 | 15,530 | 飲料 | |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH | 214 | 304 | 6,553 | 35,799 | 運送インフラ | |
| MEGACABLE HOLDINGS-CPO | 231 | 231 | 1,706 | 9,322 | メディア | |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N | 387 | 387 | 3,390 | 18,518 | ガス | |
| TELESITES SAB DE CV | — | 1,110 | 2,092 | 11,429 | 各種電気通信サービス | |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 604 | 939 | 5,333 | 29,131 | 化学 | |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 324 | 324 | 3,050 | 16,664 | 飲料 | |
| WALMART DE MEXICO-SER V | 3,410 | 3,780 | 24,600 | 134,378 | 食品・生活必需品小売り | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | 業 種 等 | |
|---------------------------------------|---------------------------|--------|---------|---------|----------------|--------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (メキシコ) | 百株 | 百株 | 千メキシコペソ | 千円 | | |
| BECLÉ SAB DE CV | — | 470 | 2,257 | 12,333 | 飲料 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 48,786 | 54,991 | 208,306 | 1,137,874 | |
| (ブラジル) | | 24 | 23 | — | <1.7%> | |
| | | | 千レアル | | | |
| BRF SA | 397 | 397 | 838 | 17,401 | 食品 | |
| VALE SA | 2,022 | 2,667 | 30,792 | 639,390 | 金属・鉱業 | |
| CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | — | 860 | 517 | 10,750 | 電力 | |
| TIM PARTICIPACOES SA | 465 | — | — | — | 無線通信サービス | |
| CENTRAIS ELÉTRICAS BRASILEIRAS-PREF B | 180 | 180 | 699 | 14,516 | 電力 | |
| CENTRAIS ELÉTRICAS BRASILIER | 165 | 165 | 623 | 12,950 | 電力 | |
| BANCO DO BRASIL SA | 536 | 536 | 1,604 | 33,322 | 銀行 | |
| ITAUSA SA | 2,840 | 3,360 | 3,474 | 72,143 | 銀行 | |
| LOJAS AMERICANAS SA-PREF | 504 | 729 | 1,496 | 31,071 | 複合小売り | |
| GERDAU SA PFD NPV | 745 | 745 | 2,709 | 56,261 | 金属・鉱業 | |
| CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICIAO | 111 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り | |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 2,333 | 2,780 | 6,652 | 138,134 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 436 | 436 | 1,030 | 21,392 | 専門小売り | |
| PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR | 2,790 | 3,320 | 8,094 | 168,068 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| CCR SA | 756 | 756 | 1,016 | 21,113 | 運送インフラ | |
| WEG SA | 519 | 1,174 | 3,925 | 81,501 | 電気設備 | |
| BANCO BRADESCO SA - PREF | 2,873 | 3,476 | 8,364 | 173,675 | 銀行 | |
| BANCO BRADESCO S.A. | 937 | 1,110 | 2,330 | 48,399 | 銀行 | |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 462 | 462 | 2,339 | 48,569 | 金属・鉱業 | |
| BRADESCAR SA -PREF | — | 150 | 1,112 | 23,107 | 金属・鉱業 | |
| SUZANO SA | 329 | 529 | 3,570 | 74,139 | 紙製品・林産品 | |
| CPFL ENERGIA SA | — | 193 | 541 | 11,241 | 電力 | |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF | 3,121 | 3,559 | 9,836 | 204,237 | 銀行 | |
| PORTO SEGURO SA | 70 | — | — | — | 保険 | |
| BRASKEM SA-PREF A | 121 | — | — | — | 化学 | |
| ALPARGATAS SA-PREF | — | 120 | 563 | 11,696 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| LOCALIZA RENT A CAR | 377 | 456 | 2,886 | 59,928 | 陸運・鉄道 | |
| LOJAS RENNER S.A. | 495 | 627 | 2,735 | 56,797 | 複合小売り | |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES | 480 | 480 | 976 | 20,272 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| COSAN SA | 91 | 868 | 1,928 | 40,047 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| TOTVS SA | — | 400 | 1,359 | 28,222 | ソフトウェア | |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 500 | 700 | 1,715 | 35,625 | 電力 | |
| EMBRAER SA | 410 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 | |
| B2W CIA DIGITAL | 135 | 135 | 843 | 17,514 | インターネット販売・通信販売 | |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | 467 | — | — | — | 不動産管理・開発 | |
| JBS SA | 746 | 746 | 2,326 | 48,298 | 食品 | |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF | 600 | 696 | 836 | 17,377 | 電力 | |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 213 | 213 | 892 | 18,527 | 水道 | |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS | 176 | — | — | — | 不動産管理・開発 | |
| SUL AMERICA SA - UNITS | 181 | 196 | 678 | 14,082 | 保険 | |
| HYPERA SA | 239 | 239 | 829 | 17,230 | 医薬品 | |
| TELEFONICA BRASIL-PREF | 268 | — | — | — | 各種電気通信サービス | |
| MAGAZINE LUIZA SA | 460 | 2,030 | 4,037 | 83,838 | 複合小売り | |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) SA | 244 | 244 | 953 | 19,799 | 銀行 | |
| ENERGISA SA-UNITS | 102 | 102 | 454 | 9,429 | 電力 | |
| CIELO SA | 737 | — | — | — | 情報技術サービス | |
| TELEFONICA BRASIL S.A. | — | 416 | 1,811 | 37,605 | 各種電気通信サービス | |
| RAIA DROGASIL SA | 157 | 782 | 2,110 | 43,825 | 食品・生活必需品小売り | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|---------------------------------------|---------|---------|---------|---------|-------------------------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千レアル | 千円 | | |
| VIA VAREJO SA | — | 920 | 1,118 | 23,229 | 専門小売り | |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 441 | 441 | 1,014 | 21,061 | 保険 | |
| ENGIE BRASIL SA | 120 | 120 | 482 | 10,011 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| NOTRE DAME INTERMED PAR SA | 303 | 373 | 3,174 | 65,910 | ヘルスクア・プロバイダー/ヘルスクア・サービス | |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS | 139 | 695 | 1,064 | 22,108 | ヘルスクア・プロバイダー/ヘルスクア・サービス | |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC | 296 | 296 | 636 | 13,208 | 食品・生活必需品小売り | |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 1,361 | 1,436 | 7,661 | 159,082 | 資本市場 | |
| AMBEV SA | 3,089 | 3,239 | 5,251 | 109,039 | 飲料 | |
| COGNA EDUCACAO | 1,039 | — | — | — | 各種消費者サービス | |
| KLABIN SA-UNIT | 427 | 610 | 1,701 | 35,338 | 容器・包装 | |
| NATURA &CO HOLDING SA | 409 | 625 | 3,131 | 65,017 | パーソナル用品 | |
| BANCO INTER SA-UNITS | — | 91 | 1,910 | 39,676 | 銀行 | |
| TIM SA | — | 465 | 575 | 11,947 | 無線通信サービス | |
| RUMO SA | 706 | 960 | 2,048 | 42,538 | 陸運・鉄道 | |
| IRB BRASIL RESSEGUROS SA | 447 | — | — | — | 保険 | |
| BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT | 161 | 161 | 1,801 | 37,408 | 資本市場 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 38,736 | 47,474 | 151,081 | 3,137,088 |
| | 銘柄 数 | < 比 率 > | 55 | 53 | — | < 4.7% > |
| (チリ) | | | | | 千チリペソ | |
| BANCO DE CREDITO E INVERSTON | 30 | 32 | 109,766 | 17,175 | 銀行 | |
| EMPRESAS CMPC SA | 719 | 719 | 143,571 | 22,465 | 紙製品・林産品 | |
| EMPRESAS COPEC SA | 259 | 259 | 204,159 | 31,946 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| EMPRESA NACIONAL DE TELECOM | 89 | — | — | — | 無線通信サービス | |
| COLBUN SA | 4,710 | 4,710 | 55,860 | 8,740 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| AGUAS ANDINAS SA-A | 2,160 | — | — | — | 水道 | |
| EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B | 288 | 288 | 47,520 | 7,435 | 飲料 | |
| S. A. C. I. FALABELLA | 502 | 502 | 167,668 | 26,236 | 複合小売り | |
| CENCOSUD SA | 807 | 1,260 | 186,606 | 29,199 | 食品・生活必需品小売り | |
| CENCOSUD SHOPPING SA | — | 230 | 30,500 | 4,772 | 不動産管理・開発 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 9,566 | 8,000 | 945,651 | 147,971 |
| | 銘柄 数 | < 比 率 > | 9 | 8 | — | < 0.2% > |
| (コロンビア) | | | | | 千コロンビアペソ | |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA | 338 | 338 | 717,912 | 20,750 | 電力 | |
| GRUPO AVAL ACCIONES-PFD | 2,057 | — | — | — | 銀行 | |
| GRUPO ARGOS SA | 156 | — | — | — | 建設資材 | |
| BANCOLOMBIA SA | 159 | 159 | 460,146 | 13,300 | 銀行 | |
| GRUPO DE INV SURAMERICANA | 130 | 130 | 269,100 | 7,778 | 各種金融サービス | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 2,840 | 627 | 1,447,158 | 41,828 |
| | 銘柄 数 | < 比 率 > | 5 | 3 | — | < 0.1% > |
| (アラブ首長国連邦) | | | | | 千UAEディルハム | |
| ABU DHABI ISLAMIC BANK | — | 1,280 | 645 | 19,082 | 銀行 | |
| DUBAI ISLAMIC BANK | 1,020 | 1,020 | 463 | 13,701 | 銀行 | |
| EMIRATES TELECOM CORPORATION | 1,125 | 1,182 | 2,548 | 75,381 | 各種電気通信サービス | |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK | 1,738 | 1,738 | 1,088 | 32,195 | 銀行 | |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 1,732 | 2,040 | 2,998 | 88,704 | 銀行 | |
| EMAAR PROPERTIES PJSC | 2,620 | 2,900 | 1,160 | 34,312 | 不動産管理・開発 | |
| ALDAR PROPERTIES PJSC | 2,770 | 2,770 | 997 | 29,497 | 不動産管理・開発 | |
| EMIRATES NBD PJSC | — | 1,610 | 2,004 | 59,291 | 銀行 | |
| EMAAR MALLS PJSC | 2,110 | 2,110 | 413 | 12,233 | 不動産管理・開発 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 13,115 | 16,650 | 12,319 | 364,400 |
| | 銘柄 数 | < 比 率 > | 7 | 9 | — | < 0.6% > |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|---------------------------------------|------------------|-------|----------|---------|--------|-------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (エジプト) | 百株 | 百株 | 千エジプトポンド | 千円 | | |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK | 913 | 913 | 5,468 | 37,949 | | 銀行 |
| EASTERN TOBACCO | 515 | 515 | 617 | 4,286 | | タバコ |
| ELSWEDY ELECTRIC CO | 415 | 415 | 349 | 2,424 | | 電気設備 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,843 | 1,843 | 6,436 | 44,661 | |
| | | 3 | 3 | — | <0.1%> | |
| (南アフリカ) | | | 千ランド | | | |
| AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | — | 70 | 2,006 | 15,532 | | 金属・鉱業 |
| BIDVEST GROUP LTD | 172 | 172 | 2,982 | 23,081 | | コングロマリット |
| CLICKS GROUP LTD | 183 | 183 | 4,521 | 34,996 | | 食品・生活必需品小売り |
| DISCOVERY LTD | 258 | 258 | 3,726 | 28,839 | | 保険 |
| GOLD FIELDS LTD | 517 | 596 | 8,746 | 67,700 | | 金属・鉱業 |
| REMGRO LTD | 332 | 332 | 3,662 | 28,346 | | 各種金融サービス |
| THE FOSCHINI GROUP LTD | 139 | — | — | — | | 専門小売り |
| NORTHAM PLATINUM LTD | 179 | 267 | 6,578 | 50,916 | | 金属・鉱業 |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD | — | 408 | 2,891 | 22,383 | | 金属・鉱業 |
| EXXARO RESOURCES LTD | 150 | 150 | 2,448 | 18,947 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 31 | 54 | 8,422 | 65,189 | | 銀行 |
| LIBERTY HOLDINGS LTD | 63 | — | — | — | | 保険 |
| MTN GROUP LTD | 1,097 | 1,300 | 12,541 | 97,068 | | 無線通信サービス |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 264 | 310 | 10,054 | 77,822 | | 金属・鉱業 |
| TELKOM SA SOC LTD | 159 | — | — | — | | 各種電気通信サービス |
| FIRSTSTRAND LTD | 2,163 | 3,290 | 17,519 | 135,598 | | 各種金融サービス |
| PSG GROUP LTD | 86 | — | — | — | | 各種金融サービス |
| NASPERS LTD-N SHS | 287 | 312 | 104,334 | 807,552 | | インターネット販売・通信販売 |
| NEDBANK GROUP LTD | 213 | 319 | 4,718 | 36,524 | | 銀行 |
| PICKN PAY STORES LTD | 267 | — | — | — | | 食品・生活必需品小売り |
| RMB HOLDINGS LTD | 548 | — | — | — | | 各種金融サービス |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 29 | 41 | 7,948 | 61,523 | | 金属・鉱業 |
| SASOL LTD | 362 | 438 | 10,542 | 81,596 | | 化学 |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 292 | 396 | 5,905 | 45,712 | | 食品・生活必需品小売り |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 881 | 911 | 11,044 | 85,488 | | 銀行 |
| SPAR GROUP LIMITED/THE | 153 | 153 | 2,910 | 22,528 | | 食品・生活必需品小売り |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 616 | 616 | 3,115 | 24,114 | | 複合小売り |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 216 | 315 | 5,166 | 39,989 | | 医薬品 |
| TIGER BRANDS LTD | 128 | 128 | 2,640 | 20,437 | | 食品 |
| SANLAM LIMITED | 1,193 | 1,193 | 7,026 | 54,387 | | 保険 |
| INVESTEC LTD | 156 | — | — | — | | 資本市場 |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 458 | 557 | 15,031 | 116,341 | | 金属・鉱業 |
| KUMBA IRON ORE LTD | 39 | 39 | 2,692 | 20,837 | | 金属・鉱業 |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN | 1,020 | — | — | — | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VODACOM GROUP | 398 | 517 | 6,521 | 50,479 | | 無線通信サービス |
| NEPI ROCKCASTLE PLC | 252 | 262 | 2,553 | 19,763 | | 不動産管理・開発 |
| OLD MUTUAL LTD | 2,940 | 2,940 | 3,889 | 30,105 | | 保険 |
| REINET INVESTMENTS SCA | 87 | 87 | 2,445 | 18,926 | | 資本市場 |
| ABSA GROUP LTD | 423 | 552 | 6,789 | 52,551 | | 銀行 |
| PEPKOR HOLDINGS LTD | 380 | — | — | — | | 専門小売り |
| MULTICHOICE GROUP LTD | 266 | 266 | 3,425 | 26,513 | | メディア |
| MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS | 564 | — | — | — | | 保険 |
| SIBANYE STILLWATER LTD | 1,610 | 2,050 | 13,755 | 106,467 | | 金属・鉱業 |
| RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD | 403 | 403 | 1,286 | 9,956 | | 保険 |
| MR PRICE GROUP LTD | 167 | 167 | 3,235 | 25,041 | | 専門小売り |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | | 業種等 | |
|-----------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|---------------------|-------------------------|
| | | 株数 | 期末 | | | |
| | | | 評価額 | 業種等 | | |
| | | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (南アフリカ) | | 百株 | 百株 | 千ランド | 千円 | |
| BID CORP LTD | | 228 | | 6,471 | 50,086 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 20,376 44 | 20,283 36 | 319,554 — | 2,473,351 <3.7%> | |
| (クウェート) | | | | 千クウェートディナール | | |
| KUWAIT FINANCE HOUSE | | — | 3,432 | 250 | 90,559 | 銀行 |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | | — | 1,390 | 83 | 30,187 | 無線通信サービス |
| GULF BANK | | — | 980 | 22 | 8,087 | 銀行 |
| NATIONAL BANK OF KUWAIT | | — | 4,983 | 412 | 149,341 | 銀行 |
| AGILITY | | — | 720 | 77 | 28,198 | 航空貨物・物流サービス |
| MABANEE CO SAKC | | — | 381 | 28 | 10,428 | 不動産管理・開発 |
| BOUBAYAN BANK K. S. C | | — | 714 | 47 | 17,134 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | — — | 12,600 7 | 922 — | 333,937 <0.5%> | |
| (サウジアラビア) | | | | 千サウジアラビアリアル | | |
| YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | | 143 | 199 | 1,408 | 40,915 | 化学 |
| JARIR MARKETING CO | | 37 | 37 | 757 | 21,988 | 専門小売り |
| CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | | 27 | 27 | 209 | 6,084 | 保険 |
| ETIHAD ETISALAT CO | | 239 | 239 | 754 | 21,897 | 無線通信サービス |
| SAUDI BRITISH BANK | | 416 | 611 | 1,765 | 51,278 | 銀行 |
| AL RAJHI BANK | | 806 | 868 | 8,610 | 250,050 | 銀行 |
| ARAB NATIONAL BANK | | 328 | 478 | 1,042 | 30,260 | 銀行 |
| BANK ALBILAD | | 233 | 233 | 846 | 24,595 | 銀行 |
| BANK AL - JAZIRA | | 341 | 341 | 618 | 17,963 | 銀行 |
| BANQUE SAUDI FRANSI | | 374 | 374 | 1,353 | 39,316 | 銀行 |
| RIYAD BANK | | 803 | 975 | 2,369 | 68,803 | 銀行 |
| SAMBA FINANCIAL GROUP | | 658 | — | — | — | 銀行 |
| SAUDI TELECOM CO | | 264 | 436 | 5,275 | 153,203 | 各種電気通信サービス |
| SABIC AGRI-NUTRIENTS CO | | 119 | 166 | 1,689 | 49,074 | 化学 |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | | 458 | 659 | 7,894 | 229,265 | 化学 |
| SAUDI CEMENT | | 64 | 64 | 413 | 12,006 | 建設資材 |
| SAUDI ELECTRICITY CO | | 582 | 582 | 1,375 | 39,954 | 電力 |
| SAUDI IND INVESTMENT GROUP | | 187 | 187 | 664 | 19,305 | 化学 |
| SAVOLA | | 166 | 166 | 660 | 19,186 | 食品 |
| NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | | 100 | 280 | 529 | 15,367 | 化学 |
| ALMARAI CO | | 180 | 180 | 979 | 28,435 | 食品 |
| EMAAR ECONOMIC CITY | | 120 | 350 | 373 | 10,855 | 不動産管理・開発 |
| SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | | 293 | 293 | 791 | 22,973 | 化学 |
| ADVANCED PETROCHEMICALS CO | | 90 | 90 | 723 | 21,007 | 化学 |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | | 470 | 470 | 814 | 23,639 | 化学 |
| DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | | 230 | 230 | 243 | 7,066 | 不動産管理・開発 |
| RABIGH REFINING AND PETROCHE | | 96 | 96 | 203 | 5,921 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY | | — | 290 | 421 | 12,245 | 無線通信サービス |
| BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE | | 8 | 39 | 436 | 12,684 | 保険 |
| ALINMA BANK | | 610 | 800 | 1,535 | 44,595 | 銀行 |
| ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS | | — | 37 | 477 | 13,860 | 食品・生活必需品小売り |
| SAUDI ARABIAN MINING CO | | 282 | 282 | 1,553 | 45,122 | 金属・鉱業 |
| SAUDI AIRLINES CATERING CO | | 12 | 12 | 94 | 2,742 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SAUDI ARABIAN OIL CO | | 748 | 1,569 | 5,601 | 162,662 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HEL SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | | — | 30 | 448 | 13,033 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 当期末 | | 業種等 |
|--------------------------------------|--------------------|-------------|----------------------|---------------|-----|
| | | | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (サウジアラビア) THE SAUDI NATIONAL BANK | 百株 727 | 百株 1,572 | 千サウジアラビアリアル 8,490 | 千円 246,555 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 10,212 | 13,263 | 61,429 | 1,783,920 | |
| | 銘柄数<比率> 33 | 35 | — | <2.7%> | |
| 合計 | 株数・金額 1,449,628 | 1,569,465 | — | 61,094,051 | |
| | 銘柄数<比率> 937 | 922 | — | <92.4%> | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国新株予約権証券

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 当期末 | | 業種等 |
|--|--------------|-------------|-----------|---------|-----|
| | | | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (タイ) MINOR INTL PCL(R)-CW23 MINOR INTL PCL(R)-CW24 | 証券 — | 証券 9,344 | 千バーツ — | 千円 — | |
| | 証券 — | 8,468 | — | — | |
| 合計 | 証券数・金額 — | 17,812 | — | — | |
| | 銘柄数<比率> — | 2 | — | <—%> | |

外国投資信託証券

| 銘柄 | 口数 | 口数 | 当期末 | | 比率 |
|---|--------------------|--------------|------------------|-----------|--------|
| | | | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF | 口 512,300 | 口 — | 千米ドル — | 千円 — | % — |
| | 口 — | 3,674,400 | 22,703 | 2,469,426 | 3.7 |
| 小計 | 口数・金額 512,300 | 3,674,400 | 22,703 | 2,469,426 | |
| | 銘柄数<比率> 1 | 1 | — | <3.7%> | |
| (メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 口 208,100 | 口 208,100 | 千メキシコペソ 5,023 | 27,441 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 208,100 | 208,100 | 5,023 | 27,441 | |
| | 銘柄数<比率> 1 | 1 | — | <0.0%> | |
| (南アフリカ) GROWTHPOINT PROPERTIES LTD FORTRESS REIT LTD-A REDEFINE PROPERTIES LTD | 口 191,000 | 口 191,000 | 千ランド 2,738 | 21,199 | 0.0 |
| | 口 100,000 | — | — | — | — |
| | 口 328,000 | — | — | — | — |
| 小計 | 口数・金額 619,000 | 191,000 | 2,738 | 21,199 | |
| | 銘柄数<比率> 3 | 1 | — | <0.0%> | |
| 合計 | 口数・金額 1,339,400 | 4,073,500 | — | 2,518,067 | |
| | 銘柄数<比率> 5 | 3 | — | <3.8%> | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | 当 期 | |
|-----|--------|-------|------------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国 | 株式先物取引 | CHA50 | 百万円 431 | 百万円 — |
| | | MSCIN | 1,997 | — |
| | | | | |

*単位未満は切り捨て。

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2021年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 61,094,051 | % 92.4 |
| 投資信託受益証券 | 2,469,426 | 3.7 |
| 投資証券 | 48,640 | 0.1 |
| コール・ローン等、その他 | 2,527,119 | 3.8 |
| 投資信託財産総額 | 66,139,236 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（65,966,546千円）の投資信託財産総額（66,139,236千円）に対する比率は99.7%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1カターリヤル=29.55円、1米ドル=108.77円、1英ポンド=152.65円、1トルコリラ=13.2126円、1ユーロ=132.32円、1チェココルナ=5.161円、1フォリント=0.369224円、1ズロチ=29.0558円、1香港ドル=14.01円、1リンギ=26.5249円、1バーツ=3.49円、1フィリピンペソ=2.2709円、1ルピア=0.0077円、1ウォン=0.0977円、1新台湾ドル=3.8971円、1インドルピー=1.49円、1パキスタンルピー=0.72円、1メキシコペソ=5.4625円、1レアル=20.7642円、1チリペソ=0.156476円、1コロンビアペソ=0.028904円、1UAEディルハム=29.58円、1エジプトポンド=6.9392円、1ランド=7.74円、1クウェートディナール=361.96円、1サウジアラビアリヤル=29.04円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月10日現在)

| 項目 | 当期末 | 円 |
|-----------------|-----------------|---|
| (A) 資産 | 66,241,399,195 | |
| コール・ローン等 | 1,677,359,800 | |
| 株式(評価額) | 61,094,051,228 | |
| 投資信託受益証券(評価額) | 2,469,426,955 | |
| 投資証券(評価額) | 48,640,449 | |
| 未収入金 | 139,180,089 | |
| 未収配当金 | 61,675,614 | |
| 差入委託証拠金 | 751,065,060 | |
| (B) 負債 | 131,139,837 | |
| 未払金 | 113,541,274 | |
| 未払解約金 | 14,893,483 | |
| 未払利息 | 80 | |
| その他未払費用 | 2,705,000 | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 66,110,259,358 | |
| 元本 | 39,964,682,518 | |
| 次期繰越損益金 | 26,145,576,840 | |
| (D) 受益権総口数 | 39,964,682,518口 | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,542円 | |

(注) 期首元本額は34,347,374,593円、期中追加設定元本額は10,635,188,172円、期中一部解約元本額は5,017,880,247円、1口当たり純資産額は1.6542円です。

○損益の状況 (2020年5月12日～2021年5月10日)

| 項目 | 当期 | 円 |
|--------------------|-----------------|---|
| (A) 配当等収益 | 973,426,312 | |
| 受取配当金 | 973,453,140 | |
| 受取利息 | 12,800 | |
| その他収益金 | 8,578 | |
| 支払利息 | △ 48,206 | |
| (B) 有価証券売買損益 | 18,987,090,336 | |
| 売買益 | 20,347,152,296 | |
| 売買損 | △ 1,360,061,960 | |
| (C) 先物取引等取引損益 | 763,196,034 | |
| 取引益 | 992,581,141 | |
| 取引損 | △ 229,385,107 | |
| (D) 保管費用等 | △ 32,797,910 | |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 20,690,914,772 | |
| (F) 前期繰越損益金 | 2,621,924,182 | |
| (G) 追加信託差損益金 | 4,636,180,545 | |
| (H) 解約差損益金 | △ 1,803,442,659 | |
| (I) 計(E+F+G+H) | 26,145,576,840 | |
| 次期繰越損益金(I) | 26,145,576,840 | |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

* 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 元本額 | 円 |
|--|----------------|---|
| 野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 28,144,624,689 | |
| 野村インデックスファンド・新興国株式 | 3,409,647,423 | |
| 野村つみたて外国株投信 | 2,816,957,054 | |
| 野村外国株(含む新興国)インデックスBコース(野村投資一任口座向け) | 1,601,451,458 | |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式 | 1,119,112,460 | |
| 野村外国株(含む新興国)インデックスAコース(野村投資一任口座向け) | 833,513,333 | |
| NEXT FUNDS 新興国株式・NEXTエマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 680,232,123 | |
| ノムラPOFs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用) | 341,576,977 | |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 297,587,332 | |
| 野村DC運用戦略ファンド | 219,653,215 | |
| 世界6資産分散ファンド | 94,487,381 | |
| 野村資産設計ファンド2040 | 80,973,375 | |
| 野村資産設計ファンド2030 | 51,030,332 | |
| 野村資産設計ファンド2035 | 42,395,475 | |
| 野村資産設計ファンド2025 | 37,360,699 | |
| 野村資産設計ファンド2015 | 20,108,577 | |
| 野村資産設計ファンド2020 | 20,001,164 | |
| 野村資産設計ファンド2050 | 19,859,399 | |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 17,068,017 | |

| ファンド名 | 当期末 元本額 | 円 |
|--|------------|---|
| インデックス・ブレンド(タイプV) | 17,032,625 | |
| 野村資産設計ファンド2045 | 13,379,173 | |
| ネクストコア | 11,358,238 | |
| 野村資産設計ファンド2060 | 9,811,033 | |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 9,248,279 | |
| インデックス・ブレンド(タイプIII) | 8,683,067 | |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040 | 8,032,223 | |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 6,905,708 | |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050 | 6,731,314 | |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 6,692,893 | |
| インデックス・ブレンド(タイプIV) | 4,042,290 | |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060 | 3,924,896 | |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 3,395,975 | |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 2,589,440 | |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 2,071,664 | |
| インデックス・ブレンド(タイプII) | 1,319,370 | |
| インデックス・ブレンド(タイプI) | 1,098,727 | |
| 野村POFs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) | 707,047 | |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 18,073 | |

○お知らせ

該当事項はございません。

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日2021年3月31日）

作成対象期間（2020年4月1日～2021年3月31日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主な投資対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 株式への投資は行いません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|--------------|------|-------|--------|---------|
| | 円 | 騰落率 | NOMURA-BPI総合 | 騰落率 | | | |
| 15期(2017年3月31日) | 12,991 | △1.1 | 378.492 | △1.2 | 99.5 | — | 687,986 |
| 16期(2018年4月2日) | 13,114 | 0.9 | 381.893 | 0.9 | 99.6 | — | 672,515 |
| 17期(2019年4月1日) | 13,342 | 1.7 | 388.518 | 1.7 | 99.3 | — | 663,317 |
| 18期(2020年3月31日) | 13,340 | △0.0 | 388.450 | △0.0 | 98.1 | — | 679,315 |
| 19期(2021年3月31日) | 13,248 | △0.7 | 385.724 | △0.7 | 99.5 | — | 735,829 |

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

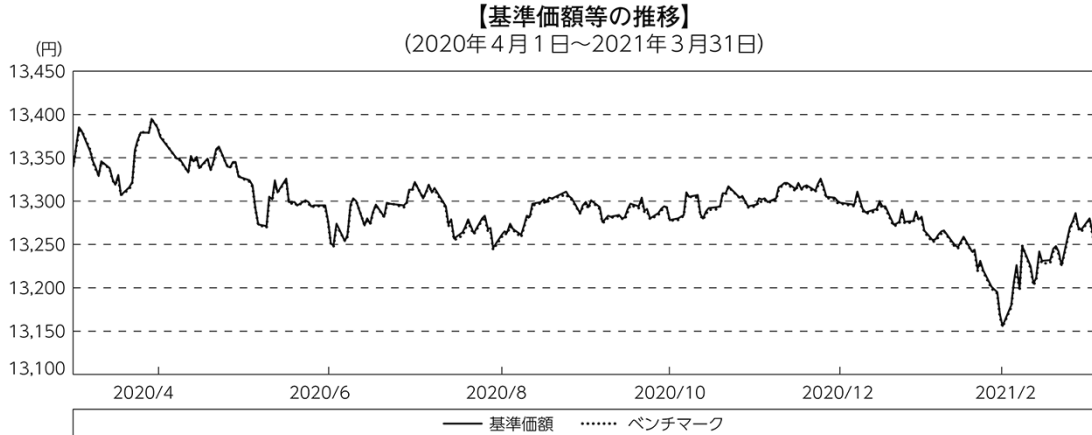
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|------|--------------|------|-------|--------|
| | 円 | 騰落率 | NOMURA-BPI総合 | 騰落率 | | |
| (期首) 2020年3月31日 | 13,340 | — | 388.450 | — | 98.1 | — |
| 4月末 | 13,385 | 0.3 | 389.790 | 0.3 | 98.9 | — |
| 5月末 | 13,328 | △0.1 | 388.127 | △0.1 | 99.5 | — |
| 6月末 | 13,276 | △0.5 | 386.558 | △0.5 | 99.2 | — |
| 7月末 | 13,322 | △0.1 | 387.913 | △0.1 | 99.0 | — |
| 8月末 | 13,261 | △0.6 | 386.087 | △0.6 | 99.0 | — |
| 9月末 | 13,299 | △0.3 | 387.219 | △0.3 | 99.1 | — |
| 10月末 | 13,278 | △0.5 | 386.633 | △0.5 | 99.0 | — |
| 11月末 | 13,296 | △0.3 | 387.118 | △0.3 | 99.4 | — |
| 12月末 | 13,298 | △0.3 | 387.203 | △0.3 | 99.3 | — |
| 2021年1月末 | 13,266 | △0.6 | 386.252 | △0.6 | 99.2 | — |
| 2月末 | 13,156 | △1.4 | 383.056 | △1.4 | 99.6 | — |
| (期末) 2021年3月31日 | 13,248 | △0.7 | 385.724 | △0.7 | 99.5 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

当運用期間では、国内債券利回りが上昇（価格は下落）したことから基準価額は下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

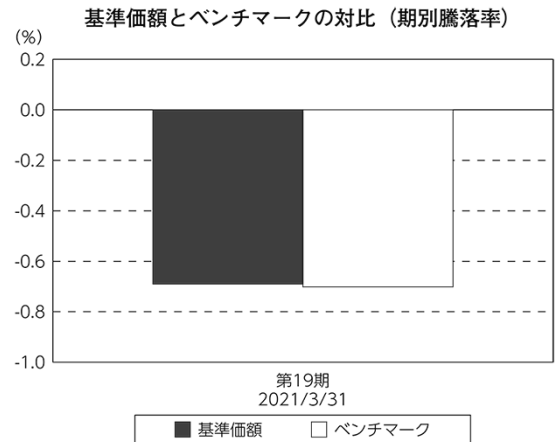
NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間の基準価額の騰落率は-0.7%となり、ベンチマークの-0.7%と同程度となりました。

(その他要因)

ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること。



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、債券組入比率を高位に保ち、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせることで、NOMURA-BPI総合との連動をできる限り高めるように運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2020年4月1日～2021年3月31日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2020年4月1日～2021年3月31日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|----------------|-------------|------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 161,645,022 | 88,808,458 |
| | 地方債証券 | 8,748,076 | 5,511,688 |
| | 特殊債券 | 9,259,092 | 6,363,803 |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | 9,088,695 | (807,197) |
| | | | 10,747,465 |

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2020年4月1日～2021年3月31日)

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 188,740 | 百万円 1,317 | % 0.7 | 百万円 111,431 | 百万円 850 | % 0.8 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021年3月31日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 | | 期 | | 末 | | |
|---------------------|------------------------------|------------------------------|----------------|--------------------|----------------|----------------|----------------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 552,445,000 (2,460,000) | 590,339,899 (3,500,913) | 80.2 (0.5) | — (—) | 53.7 (0.5) | 18.2 (0.0) | 8.3 (—) |
| 地方債証券 | 48,556,100 (48,556,100) | 50,873,297 (50,873,297) | 6.9 (6.9) | — (—) | 3.5 (3.5) | 2.6 (2.6) | 0.9 (0.9) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 58,137,926 (58,137,926) | 60,862,888 (60,862,888) | 8.3 (8.3) | — (—) | 4.2 (4.2) | 2.7 (2.7) | 1.3 (1.3) |
| 金融債券 | 2,500,000 (2,500,000) | 2,506,222 (2,506,222) | 0.3 (0.3) | — (—) | — (—) | 0.2 (0.2) | 0.2 (0.2) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 27,305,000 (27,305,000) | 27,858,685 (27,858,685) | 3.8 (3.8) | — (—) | 2.3 (2.3) | 1.3 (1.3) | 0.2 (0.2) |
| 合 計 | 688,944,026 (138,959,026) | 732,440,992 (145,602,006) | 99.5 (19.8) | — (—) | 63.6 (10.4) | 25.0 (6.8) | 10.9 (2.6) |

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------|----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | | | | | |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第415回 | 0.1 | 3,700,000 | 3,711,359 | 2022/8/1 |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第416回 | 0.1 | 3,000,000 | 3,009,810 | 2022/9/1 |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第417回 | 0.1 | 3,200,000 | 3,211,296 | 2022/10/1 |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第418回 | 0.1 | 4,400,000 | 4,416,412 | 2022/11/1 |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第420回 | 0.1 | 500,000 | 502,065 | 2023/1/1 |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第421回 | 0.1 | 3,500,000 | 3,515,470 | 2023/2/1 |
| 国庫債券 | 利付 (2年) 第422回 | 0.1 | 600,000 | 602,880 | 2023/3/1 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第132回 | 0.1 | 3,000,000 | 3,008,220 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第133回 | 0.1 | 6,200,000 | 6,220,522 | 2022/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第134回 | 0.1 | 2,500,000 | 2,509,900 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第135回 | 0.1 | 8,500,000 | 8,539,355 | 2023/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第136回 | 0.1 | 3,300,000 | 3,317,622 | 2023/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第137回 | 0.1 | 4,000,000 | 4,023,800 | 2023/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第138回 | 0.1 | 5,500,000 | 5,536,795 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第139回 | 0.1 | 5,600,000 | 5,639,200 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第140回 | 0.1 | 3,900,000 | 3,929,601 | 2024/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第141回 | 0.1 | 4,500,000 | 4,536,090 | 2024/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第143回 | 0.1 | 5,570,000 | 5,618,793 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第144回 | 0.1 | 4,500,000 | 4,540,995 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第145回 | 0.1 | 4,900,000 | 4,946,207 | 2025/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (5年) 第146回 | 0.1 | 2,100,000 | 2,119,404 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第1回 | 2.4 | 2,360,000 | 3,401,279 | 2048/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第2回 | 2.2 | 900,000 | 1,259,937 | 2049/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第3回 | 2.2 | 900,000 | 1,266,300 | 2050/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第4回 | 2.2 | 1,130,000 | 1,597,345 | 2051/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第5回 | 2.0 | 1,200,000 | 1,643,016 | 2052/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第6回 | 1.9 | 1,300,000 | 1,755,650 | 2053/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第7回 | 1.7 | 1,400,000 | 1,821,344 | 2054/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第8回 | 1.4 | 1,500,000 | 1,825,710 | 2055/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第9回 | 0.4 | 2,050,000 | 1,871,978 | 2056/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第10回 | 0.9 | 2,010,000 | 2,147,082 | 2057/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第11回 | 0.8 | 1,750,000 | 1,814,715 | 2058/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第12回 | 0.5 | 2,070,000 | 1,939,983 | 2059/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (40年) 第13回 | 0.5 | 5,020,000 | 4,698,218 | 2060/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第323回 | 0.9 | 1,700,000 | 1,721,267 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第324回 | 0.8 | 3,200,000 | 3,236,128 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第325回 | 0.8 | 4,400,000 | 4,459,972 | 2022/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第326回 | 0.7 | 2,100,000 | 2,129,862 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第327回 | 0.8 | 3,100,000 | 3,149,414 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第328回 | 0.6 | 5,250,000 | 5,325,547 | 2023/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第329回 | 0.8 | 6,000,000 | 6,124,860 | 2023/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第330回 | 0.8 | 3,800,000 | 3,888,084 | 2023/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第331回 | 0.6 | 1,900,000 | 1,934,618 | 2023/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第332回 | 0.6 | 5,900,000 | 6,019,180 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第333回 | 0.6 | 3,600,000 | 3,678,804 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第334回 | 0.6 | 6,600,000 | 6,756,816 | 2024/6/20 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---------------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (10年) 第335回 | 0.5 | 4,600,000 | 4,700,188 | 2024/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第336回 | 0.5 | 2,750,000 | 2,813,717 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第337回 | 0.3 | 3,000,000 | 3,047,070 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第338回 | 0.4 | 5,000,000 | 5,103,600 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第339回 | 0.4 | 5,000,000 | 5,109,150 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第340回 | 0.4 | 4,200,000 | 4,296,222 | 2025/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第341回 | 0.3 | 7,300,000 | 7,438,481 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第342回 | 0.1 | 8,350,000 | 8,429,074 | 2026/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第343回 | 0.1 | 5,900,000 | 5,957,171 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第344回 | 0.1 | 5,800,000 | 5,855,738 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第345回 | 0.1 | 5,000,000 | 5,048,800 | 2026/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第346回 | 0.1 | 4,900,000 | 4,946,942 | 2027/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第347回 | 0.1 | 5,400,000 | 5,452,218 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第348回 | 0.1 | 6,800,000 | 6,863,988 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第349回 | 0.1 | 2,800,000 | 2,826,404 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第350回 | 0.1 | 6,150,000 | 6,207,933 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第351回 | 0.1 | 7,700,000 | 7,766,759 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第352回 | 0.1 | 6,600,000 | 6,654,252 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第353回 | 0.1 | 5,100,000 | 5,139,372 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第354回 | 0.1 | 4,350,000 | 4,379,406 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第355回 | 0.1 | 5,100,000 | 5,131,365 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第356回 | 0.1 | 4,800,000 | 4,826,352 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第357回 | 0.1 | 1,900,000 | 1,909,063 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第358回 | 0.1 | 5,470,000 | 5,491,934 | 2030/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第359回 | 0.1 | 5,600,000 | 5,617,920 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第360回 | 0.1 | 7,900,000 | 7,914,852 | 2030/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第361回 | 0.1 | 6,900,000 | 6,906,624 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第1回 | 2.8 | 500,000 | 616,505 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第2回 | 2.4 | 500,000 | 604,265 | 2030/2/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第3回 | 2.3 | 160,000 | 192,644 | 2030/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第4回 | 2.9 | 900,000 | 1,143,288 | 2030/11/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第5回 | 2.2 | 150,000 | 181,602 | 2031/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第6回 | 2.4 | 600,000 | 743,694 | 2031/11/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第7回 | 2.3 | 600,000 | 742,080 | 2032/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第8回 | 1.8 | 100,000 | 118,746 | 2032/11/22 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第9回 | 1.4 | 265,000 | 302,630 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第10回 | 1.1 | 250,000 | 277,105 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第11回 | 1.7 | 160,000 | 188,963 | 2033/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第12回 | 2.1 | 220,000 | 271,189 | 2033/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第13回 | 2.0 | 290,000 | 354,751 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第14回 | 2.4 | 800,000 | 1,021,800 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第15回 | 2.5 | 900,000 | 1,164,339 | 2034/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第16回 | 2.5 | 915,000 | 1,187,944 | 2034/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第17回 | 2.4 | 1,200,000 | 1,546,344 | 2034/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第18回 | 2.3 | 2,200,000 | 2,812,458 | 2035/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第19回 | 2.3 | 2,050,000 | 2,627,034 | 2035/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第20回 | 2.5 | 1,270,000 | 1,667,903 | 2035/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第21回 | 2.3 | 300,000 | 386,493 | 2035/12/20 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | |
|--------------------|-----|-----|-----------|-----------|------------|
| | 利 | 率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (30年) 第22回 | | 2.5 | 600,000 | 792,480 | 2036/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第23回 | | 2.5 | 840,000 | 1,112,202 | 2036/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第24回 | | 2.5 | 700,000 | 929,747 | 2036/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第25回 | | 2.3 | 500,000 | 650,125 | 2036/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第26回 | | 2.4 | 850,000 | 1,121,124 | 2037/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第27回 | | 2.5 | 1,550,000 | 2,078,689 | 2037/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第28回 | | 2.5 | 1,200,000 | 1,617,096 | 2038/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第29回 | | 2.4 | 1,500,000 | 2,004,630 | 2038/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第30回 | | 2.3 | 1,700,000 | 2,250,851 | 2039/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第31回 | | 2.2 | 1,200,000 | 1,572,876 | 2039/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第32回 | | 2.3 | 1,200,000 | 1,599,132 | 2040/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第33回 | | 2.0 | 2,400,000 | 3,079,752 | 2040/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第34回 | | 2.2 | 1,600,000 | 2,120,752 | 2041/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第35回 | | 2.0 | 2,300,000 | 2,971,025 | 2041/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第36回 | | 2.0 | 2,000,000 | 2,591,440 | 2042/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第37回 | | 1.9 | 2,300,000 | 2,944,322 | 2042/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第38回 | | 1.8 | 1,600,000 | 2,021,696 | 2043/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第39回 | | 1.9 | 1,600,000 | 2,058,224 | 2043/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第40回 | | 1.8 | 1,300,000 | 1,646,385 | 2043/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第41回 | | 1.7 | 1,500,000 | 1,871,055 | 2043/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第42回 | | 1.7 | 1,600,000 | 1,997,600 | 2044/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第43回 | | 1.7 | 1,300,000 | 1,626,222 | 2044/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第44回 | | 1.7 | 1,400,000 | 1,752,898 | 2044/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第45回 | | 1.5 | 1,700,000 | 2,056,133 | 2044/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第46回 | | 1.5 | 1,800,000 | 2,178,234 | 2045/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第47回 | | 1.6 | 1,700,000 | 2,097,171 | 2045/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第48回 | | 1.4 | 1,900,000 | 2,258,055 | 2045/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第49回 | | 1.4 | 2,900,000 | 3,447,665 | 2045/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第50回 | | 0.8 | 1,900,000 | 1,995,513 | 2046/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第51回 | | 0.3 | 2,650,000 | 2,473,139 | 2046/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第52回 | | 0.5 | 1,900,000 | 1,860,062 | 2046/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第53回 | | 0.6 | 1,700,000 | 1,701,887 | 2046/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第54回 | | 0.8 | 1,700,000 | 1,782,382 | 2047/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第55回 | | 0.8 | 1,500,000 | 1,571,520 | 2047/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第56回 | | 0.8 | 1,900,000 | 1,989,072 | 2047/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第57回 | | 0.8 | 1,600,000 | 1,673,680 | 2047/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第58回 | | 0.8 | 2,100,000 | 2,194,920 | 2048/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第59回 | | 0.7 | 1,600,000 | 1,631,696 | 2048/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第60回 | | 0.9 | 1,150,000 | 1,228,464 | 2048/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第61回 | | 0.7 | 1,000,000 | 1,016,510 | 2048/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第62回 | | 0.5 | 500,000 | 482,250 | 2049/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第63回 | | 0.4 | 1,400,000 | 1,311,842 | 2049/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第64回 | | 0.4 | 1,500,000 | 1,401,480 | 2049/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第65回 | | 0.4 | 1,200,000 | 1,119,264 | 2049/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第66回 | | 0.4 | 2,600,000 | 2,426,736 | 2050/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第67回 | | 0.6 | 1,300,000 | 1,277,757 | 2050/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第68回 | | 0.6 | 1,950,000 | 1,916,401 | 2050/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第69回 | | 0.7 | 2,350,000 | 2,370,398 | 2050/12/20 |

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | |
|------|----------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第56回 | 2.0 | 120,000 | 123,112 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第57回 | 1.9 | 210,000 | 215,191 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第58回 | 1.9 | 180,000 | 185,371 | 2022/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第59回 | 1.7 | 230,000 | 237,235 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第60回 | 1.4 | 780,000 | 800,506 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第61回 | 1.0 | 300,000 | 306,684 | 2023/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第62回 | 0.8 | 440,000 | 449,156 | 2023/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第63回 | 1.8 | 300,000 | 312,921 | 2023/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第64回 | 1.9 | 400,000 | 420,180 | 2023/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第65回 | 1.9 | 455,000 | 480,348 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第66回 | 1.8 | 300,000 | 315,894 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第67回 | 1.9 | 310,000 | 328,742 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第68回 | 2.2 | 290,000 | 310,126 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第69回 | 2.1 | 560,000 | 597,195 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第70回 | 2.4 | 540,000 | 584,161 | 2024/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第71回 | 2.2 | 200,000 | 215,064 | 2024/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第72回 | 2.1 | 1,470,000 | 1,584,027 | 2024/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第73回 | 2.0 | 1,200,000 | 1,295,064 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第74回 | 2.1 | 800,000 | 866,368 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第75回 | 2.1 | 600,000 | 652,962 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第76回 | 1.9 | 910,000 | 983,073 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第77回 | 2.0 | 700,000 | 758,996 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第78回 | 1.9 | 800,000 | 868,160 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第79回 | 2.0 | 860,000 | 936,909 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第80回 | 2.1 | 1,400,000 | 1,531,138 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第81回 | 2.0 | 360,000 | 394,041 | 2025/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第82回 | 2.1 | 820,000 | 901,221 | 2025/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第83回 | 2.1 | 1,370,000 | 1,512,589 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第84回 | 2.0 | 1,200,000 | 1,319,208 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第85回 | 2.1 | 400,000 | 443,704 | 2026/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第86回 | 2.3 | 1,700,000 | 1,902,708 | 2026/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第87回 | 2.2 | 500,000 | 557,125 | 2026/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第88回 | 2.3 | 1,100,000 | 1,237,533 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第89回 | 2.2 | 470,000 | 526,296 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第90回 | 2.2 | 1,500,000 | 1,687,470 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第91回 | 2.3 | 250,000 | 282,617 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第92回 | 2.1 | 650,000 | 731,009 | 2026/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第93回 | 2.0 | 300,000 | 337,008 | 2027/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第94回 | 2.1 | 200,000 | 225,870 | 2027/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第95回 | 2.3 | 100,000 | 114,696 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第96回 | 2.1 | 400,000 | 453,792 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第97回 | 2.2 | 300,000 | 343,710 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第98回 | 2.1 | 300,000 | 341,763 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第99回 | 2.1 | 1,100,000 | 1,258,620 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第100回 | 2.2 | 820,000 | 947,993 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第101回 | 2.4 | 250,000 | 292,515 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第102回 | 2.4 | 500,000 | 587,475 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第103回 | 2.3 | 600,000 | 700,632 | 2028/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (20年) 第104回 | 2.1 | 400,000 | 461,304 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第105回 | 2.1 | 1,900,000 | 2,199,744 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第106回 | 2.2 | 400,000 | 466,092 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第107回 | 2.1 | 300,000 | 348,639 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第108回 | 1.9 | 1,600,000 | 1,834,704 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第109回 | 1.9 | 900,000 | 1,035,000 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第110回 | 2.1 | 1,100,000 | 1,282,501 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第111回 | 2.2 | 800,000 | 942,720 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第112回 | 2.1 | 1,800,000 | 2,106,342 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第113回 | 2.1 | 2,000,000 | 2,348,820 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第114回 | 2.1 | 1,700,000 | 2,004,317 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第115回 | 2.2 | 1,000,000 | 1,187,700 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第116回 | 2.2 | 1,100,000 | 1,311,123 | 2030/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第117回 | 2.1 | 1,400,000 | 1,656,200 | 2030/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第118回 | 2.0 | 500,000 | 588,930 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第119回 | 1.8 | 800,000 | 927,624 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第120回 | 1.6 | 800,000 | 912,952 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第121回 | 1.9 | 1,200,000 | 1,405,956 | 2030/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第122回 | 1.8 | 900,000 | 1,045,998 | 2030/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第123回 | 2.1 | 500,000 | 597,130 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第124回 | 2.0 | 1,000,000 | 1,184,620 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第125回 | 2.2 | 400,000 | 483,132 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第126回 | 2.0 | 1,200,000 | 1,425,708 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第127回 | 1.9 | 500,000 | 589,105 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第128回 | 1.9 | 1,800,000 | 2,126,664 | 2031/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第129回 | 1.8 | 2,600,000 | 3,045,562 | 2031/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第130回 | 1.8 | 1,400,000 | 1,644,076 | 2031/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第131回 | 1.7 | 800,000 | 931,192 | 2031/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第132回 | 1.7 | 1,300,000 | 1,516,593 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第133回 | 1.8 | 1,400,000 | 1,648,066 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第134回 | 1.8 | 1,400,000 | 1,651,902 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第135回 | 1.7 | 700,000 | 818,391 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第136回 | 1.6 | 700,000 | 810,824 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第137回 | 1.7 | 1,000,000 | 1,171,660 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第138回 | 1.5 | 800,000 | 919,664 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第139回 | 1.6 | 1,000,000 | 1,160,620 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第140回 | 1.7 | 2,300,000 | 2,700,499 | 2032/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第141回 | 1.7 | 2,600,000 | 3,058,874 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第142回 | 1.8 | 950,000 | 1,128,590 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第143回 | 1.6 | 1,300,000 | 1,517,139 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第144回 | 1.5 | 1,300,000 | 1,501,903 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第145回 | 1.7 | 2,300,000 | 2,716,346 | 2033/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第146回 | 1.7 | 2,400,000 | 2,839,752 | 2033/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第147回 | 1.6 | 4,000,000 | 4,691,760 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第148回 | 1.5 | 2,100,000 | 2,440,410 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第149回 | 1.5 | 3,850,000 | 4,480,129 | 2034/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第150回 | 1.4 | 3,330,000 | 3,836,559 | 2034/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第151回 | 1.2 | 2,500,000 | 2,816,900 | 2034/12/20 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------|-----------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第152回 | 1.2 | 2,650,000 | 2,987,742 | 2035/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第153回 | 1.3 | 1,600,000 | 1,828,160 | 2035/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第154回 | 1.2 | 1,220,000 | 1,378,014 | 2035/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第155回 | 1.0 | 5,350,000 | 5,890,403 | 2035/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第156回 | 0.4 | 5,650,000 | 5,726,783 | 2036/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第157回 | 0.2 | 2,990,000 | 2,937,914 | 2036/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第158回 | 0.5 | 2,100,000 | 2,155,713 | 2036/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第159回 | 0.6 | 2,000,000 | 2,080,700 | 2036/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第160回 | 0.7 | 2,300,000 | 2,425,396 | 2037/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第161回 | 0.6 | 2,100,000 | 2,180,556 | 2037/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第162回 | 0.6 | 1,700,000 | 1,763,427 | 2037/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第163回 | 0.6 | 2,600,000 | 2,694,146 | 2037/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第164回 | 0.5 | 2,600,000 | 2,649,712 | 2038/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第165回 | 0.5 | 2,200,000 | 2,239,028 | 2038/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第166回 | 0.7 | 2,300,000 | 2,414,632 | 2038/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第167回 | 0.5 | 2,600,000 | 2,638,636 | 2038/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第168回 | 0.4 | 2,700,000 | 2,688,714 | 2039/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第169回 | 0.3 | 2,530,000 | 2,470,241 | 2039/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第170回 | 0.3 | 2,000,000 | 1,948,820 | 2039/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第171回 | 0.3 | 1,500,000 | 1,458,630 | 2039/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第172回 | 0.4 | 3,840,000 | 3,796,492 | 2040/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第173回 | 0.4 | 3,250,000 | 3,209,895 | 2040/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第174回 | 0.4 | 3,340,000 | 3,295,344 | 2040/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第175回 | 0.5 | 4,600,000 | 4,620,700 | 2040/12/20 |
| メキシコ合衆国 | 第25回円貨社債 (2018) | 0.6 | 100,000 | 99,634 | 2023/4/20 |
| 小 計 | | | 552,445,000 | 590,339,899 | |
| 地方債証券 | | | | | |
| 東京都 | 公募第708回 | 0.89 | 100,000 | 101,068 | 2022/6/20 |
| 東京都 | 公募第710回 | 0.81 | 100,000 | 100,970 | 2022/6/20 |
| 東京都 | 公募第712回 | 0.77 | 100,000 | 101,114 | 2022/9/20 |
| 東京都 | 公募第715回 | 0.76 | 100,000 | 101,283 | 2022/12/20 |
| 東京都 | 公募第716回 | 0.77 | 200,000 | 202,602 | 2022/12/20 |
| 東京都 | 公募第731回 | 0.635 | 100,000 | 101,826 | 2024/3/19 |
| 東京都 | 公募第736回 | 0.505 | 100,000 | 101,680 | 2024/9/20 |
| 東京都 | 公募第745回 | 0.533 | 300,000 | 306,477 | 2025/6/20 |
| 東京都 | 公募第760回 | 0.045 | 100,000 | 99,999 | 2026/9/18 |
| 東京都 | 公募第761回 | 0.075 | 100,000 | 100,163 | 2026/9/18 |
| 東京都 | 公募第769回 | 0.21 | 500,000 | 504,175 | 2027/6/18 |
| 東京都 | 公募第778回 | 0.165 | 100,000 | 100,588 | 2028/3/17 |
| 東京都 | 公募 (30年) 第7回 | 2.51 | 100,000 | 133,930 | 2038/9/17 |
| 東京都 | 公募第10回 | 2.31 | 200,000 | 263,116 | 2039/9/20 |
| 東京都 | 公募第1回 | 1.54 | 300,000 | 310,167 | 2023/6/20 |
| 東京都 | 公募 (20年) 第3回 | 2.26 | 200,000 | 213,292 | 2024/3/19 |
| 東京都 | 公募第7回 | 2.16 | 100,000 | 109,556 | 2025/9/19 |
| 東京都 | 公募 (20年) 第13回 | 2.15 | 100,000 | 113,882 | 2027/12/20 |
| 東京都 | 公募 (20年) 第16回 | 2.01 | 200,000 | 229,210 | 2028/12/20 |
| 東京都 | 公募 (20年) 第17回 | 2.09 | 200,000 | 230,436 | 2028/12/20 |
| 東京都 | 公募第23回 | 2.12 | 100,000 | 118,712 | 2030/12/20 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------|--------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 東京都 | 公募 (20年) 第26回 | 1.74 | 100,000 | 116,509 | 2032/6/18 |
| 東京都 | 公募 (20年) 第29回 | 1.57 | 200,000 | 231,230 | 2033/9/20 |
| 北海道 | 公募平成24年度第6回 | 0.84 | 100,000 | 101,157 | 2022/8/31 |
| 北海道 | 公募平成24年度第9回 | 0.79 | 100,000 | 101,214 | 2022/10/31 |
| 北海道 | 公募平成25年度第1回 | 0.58 | 300,000 | 303,447 | 2023/4/26 |
| 北海道 | 公募平成26年度第13回 | 0.461 | 100,000 | 101,610 | 2024/12/26 |
| 北海道 | 公募平成27年度第7回 | 0.529 | 100,000 | 102,193 | 2025/8/28 |
| 北海道 | 公募平成29年度第5回 | 0.18 | 200,000 | 201,180 | 2027/6/30 |
| 北海道 | 公募平成29年度第6回 | 0.01 | 700,000 | 699,860 | 2022/7/28 |
| 北海道 | 公募平成29年度第7回 | 0.21 | 100,000 | 100,798 | 2027/8/31 |
| 北海道 | 公募平成29年度第9回 | 0.205 | 100,000 | 100,784 | 2027/10/27 |
| 北海道 | 公募平成30年度第15回 | 0.291 | 269,280 | 269,772 | 2038/9/24 |
| 宮城県 | 公募第32回 2号 | 0.105 | 100,000 | 100,328 | 2026/9/28 |
| 神奈川県 | 公募第196回 | 0.678 | 100,000 | 101,305 | 2023/3/20 |
| 神奈川県 | 公募第200回 | 0.825 | 100,000 | 102,004 | 2023/9/20 |
| 神奈川県 | 公募第205回 | 0.664 | 100,000 | 101,913 | 2024/3/19 |
| 神奈川県 | 公募第206回 | 0.654 | 100,000 | 102,041 | 2024/6/20 |
| 神奈川県 | 公募第210回 | 0.451 | 200,000 | 203,206 | 2024/12/20 |
| 神奈川県 | 公募第212回 | 0.42 | 100,000 | 101,585 | 2025/3/19 |
| 神奈川県 | 公募第231回 | 0.22 | 200,000 | 201,940 | 2027/12/20 |
| 神奈川県 | 公募第247回 | 0.12 | 200,000 | 199,090 | 2030/6/20 |
| 神奈川県 | 公募 (30年) 第3回 | 2.62 | 100,000 | 133,750 | 2037/3/19 |
| 神奈川県 | 公募第7回 | 2.22 | 300,000 | 338,433 | 2027/3/19 |
| 神奈川県 | 公募 (20年) 第14回 | 1.969 | 100,000 | 116,586 | 2030/7/19 |
| 神奈川県 | 公募 (20年) 第17回 | 1.975 | 200,000 | 235,998 | 2031/7/11 |
| 神奈川県 | 公募 (20年) 第26回 | 1.477 | 100,000 | 114,891 | 2034/6/20 |
| 大阪府 | 公募第378回 | 0.7 | 104,000 | 105,857 | 2023/11/28 |
| 大阪府 | 公募第381回 | 0.683 | 100,000 | 101,902 | 2024/2/27 |
| 大阪府 | 公募第382回 | 0.674 | 100,000 | 101,927 | 2024/3/28 |
| 大阪府 | 公募第383回 | 0.695 | 100,000 | 102,042 | 2024/4/26 |
| 大阪府 | 公募第384回 | 0.67 | 100,000 | 102,022 | 2024/5/29 |
| 大阪府 | 公募第387回 | 0.521 | 300,000 | 305,010 | 2024/8/28 |
| 大阪府 | 公募第389回 | 0.53 | 100,000 | 101,787 | 2024/10/30 |
| 大阪府 | 公募第396回 | 0.554 | 200,000 | 204,346 | 2025/5/28 |
| 大阪府 | 公募第417回 | 0.248 | 102,000 | 103,037 | 2027/2/26 |
| 大阪府 | 公募第423回 | 0.185 | 100,000 | 100,638 | 2027/8/30 |
| 大阪府 | 公募第429回 | 0.197 | 179,000 | 180,313 | 2028/2/25 |
| 大阪府 | 公募第452回 | 0.062 | 100,000 | 99,102 | 2030/1/30 |
| 大阪府 | 公募第5回 | 2.16 | 100,000 | 117,900 | 2030/5/28 |
| 大阪府 | 公募第8回 | 1.83 | 100,000 | 116,869 | 2031/12/22 |
| 大阪府 | 公募 (5年) 第141回 | 0.001 | 230,000 | 229,921 | 2022/8/30 |
| 大阪府 | 公募 (5年) 第178回 | 0.001 | 400,000 | 399,448 | 2025/12/25 |
| 京都府 | 公募平成24年度第2回 | 0.91 | 100,000 | 101,093 | 2022/6/20 |
| 京都府 | 公募平成24年度第6回 | 0.8 | 100,000 | 101,224 | 2022/10/21 |
| 京都府 | 公募平成25年度第15回 | 0.66 | 200,000 | 203,800 | 2024/3/19 |
| 京都府 | 公募平成26年度第5回 | 1.455 | 100,000 | 114,694 | 2034/8/10 |
| 京都府 | 公募平成26年度第7回 | 0.564 | 200,000 | 203,766 | 2024/9/19 |
| 京都府 | 公募 (20年) 平成27年度第5回 | 1.23 | 200,000 | 224,254 | 2035/8/17 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------|---------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 京都府 | 公募 (15年) 平成27年度第8回 | 0.78 | 100,000 | 105,734 | 2030/10/11 |
| 京都府 | 公募 (20年) 平成28年度第5回 | 0.327 | 100,000 | 98,935 | 2036/8/15 |
| 京都府 | 公募平成29年度第4回 | 0.19 | 100,000 | 100,712 | 2027/6/21 |
| 兵庫県 | 公募平成26年度第17回 | 0.46 | 100,000 | 101,679 | 2025/2/26 |
| 兵庫県 | 公募平成29年度第22回 | 0.19 | 100,000 | 100,676 | 2028/1/21 |
| 兵庫県 | 公募 (30年) 第2回 | 2.36 | 200,000 | 265,950 | 2040/3/19 |
| 兵庫県 | 公募 (15年) 第1回 | 1.66 | 300,000 | 325,584 | 2026/7/29 |
| 兵庫県 | 公募 (15年) 第3回 | 1.35 | 200,000 | 215,838 | 2027/7/16 |
| 兵庫県 | 公募 (12年) 第3回 | 0.56 | 300,000 | 306,417 | 2025/4/16 |
| 兵庫県 | 公募 (15年) 第11回 | 0.718 | 100,000 | 104,917 | 2030/5/10 |
| 兵庫県 | 公募第2回 | 2.37 | 100,000 | 114,695 | 2027/9/17 |
| 兵庫県 | 公募第9回 | 2.25 | 100,000 | 117,864 | 2029/11/19 |
| 兵庫県 | 公募 (20年) 第11回 | 1.84 | 200,000 | 230,522 | 2030/8/16 |
| 兵庫県 | 公募 (20年) 第14回 | 1.72 | 100,000 | 116,067 | 2032/5/24 |
| 兵庫県 | 公募 (20年) 第22回 | 1.4 | 100,000 | 113,851 | 2034/9/8 |
| 静岡県 | 公募平成24年度第5回 | 0.849 | 100,060 | 101,147 | 2022/7/20 |
| 静岡県 | 公募平成24年度第10回 | 0.678 | 100,000 | 101,309 | 2023/3/22 |
| 静岡県 | 公募平成25年度第5回 | 0.926 | 101,000 | 103,134 | 2023/7/25 |
| 静岡県 | 公募平成26年度第3回 | 0.679 | 165,000 | 168,430 | 2024/5/27 |
| 静岡県 | 公募平成26年度第8回 | 0.564 | 100,000 | 101,892 | 2024/9/25 |
| 静岡県 | 公募平成26年度第9回 | 0.554 | 200,000 | 203,802 | 2024/10/24 |
| 静岡県 | 公募平成27年度第11回 | 0.11 | 115,400 | 115,914 | 2026/3/19 |
| 静岡県 | 公募平成28年度第2回 | 0.08 | 300,000 | 300,891 | 2026/3/19 |
| 静岡県 | 公募平成29年度第3回 | 0.17 | 100,000 | 100,624 | 2027/3/19 |
| 静岡県 | 公募 (31年) 第1回 | 0.095 | 174,000 | 173,587 | 2029/3/19 |
| 静岡県 | 公募 (15年) 第5回 | 1.087 | 200,000 | 214,900 | 2028/11/20 |
| 静岡県 | 公募 (15年) 第9回 | 0.739 | 100,000 | 105,208 | 2030/9/20 |
| 静岡県 | 公募 (20年) 第11回 | 1.841 | 100,000 | 115,780 | 2030/10/18 |
| 静岡県 | 公募 (20年) 第14回 | 1.736 | 200,000 | 232,932 | 2032/6/18 |
| 静岡県 | 公募 (20年) 第18回 | 1.473 | 100,000 | 114,902 | 2034/7/10 |
| 静岡県 | 公募 (20年) 第30回 | 0.449 | 200,000 | 197,314 | 2040/9/20 |
| 愛知県 | 公募平成20年度第8回 | 2.04 | 100,000 | 114,835 | 2028/12/20 |
| 愛知県 | 公募 (20年) 平成24年度第4回 | 1.687 | 100,000 | 115,903 | 2032/6/11 |
| 愛知県 | 公募平成24年度第8回 | 0.835 | 150,000 | 151,740 | 2022/8/29 |
| 愛知県 | 公募 (15年) 平成24年度第14回 | 1.314 | 400,000 | 433,064 | 2027/12/13 |
| 愛知県 | 公募平成24年度第17回 | 1.829 | 100,000 | 118,119 | 2033/2/8 |
| 愛知県 | 公募 (30年) 平成25年度第8回 | 2.024 | 120,000 | 155,031 | 2043/6/19 |
| 愛知県 | 公募平成26年度第8回 | 1.814 | 100,000 | 125,505 | 2044/6/20 |
| 愛知県 | 公募平成26年度第13回 | 1.363 | 100,000 | 113,617 | 2034/11/14 |
| 愛知県 | 公募平成26年度第17回 | 0.463 | 300,000 | 305,190 | 2025/2/26 |
| 愛知県 | 公募 (15年) 平成27年度第2回 | 0.74 | 100,000 | 105,187 | 2030/4/26 |
| 愛知県 | 公募平成27年度第15回 | 0.471 | 100,000 | 102,099 | 2025/11/27 |
| 愛知県 | 公募平成29年度第8回 | 0.2 | 100,000 | 100,798 | 2027/8/31 |
| 愛知県 | 公募平成29年度第9回 | 0.15 | 100,000 | 100,482 | 2027/9/15 |
| 広島県 | 公募平成24年度第4回 | 0.81 | 100,000 | 101,322 | 2022/11/28 |
| 広島県 | 公募平成25年度第3回 | 0.8 | 200,000 | 203,904 | 2023/9/25 |
| 広島県 | 公募平成26年度第5回 | 0.33 | 109,650 | 110,949 | 2025/1/27 |
| 広島県 | 公募平成26年度第7回 | 0.46 | 200,000 | 203,502 | 2025/3/25 |

| 銘柄 | | 当期末 | | | |
|--------------|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 広島県 | 公募平成29年度第3回 | 0.15 | 100,000 | 100,484 | 2027/9/27 |
| 広島県 | 公募平成29年度第4回 | 0.22 | 211,300 | 213,326 | 2027/11/24 |
| 広島県 | 公募令和2年度第2回 | 0.165 | 100,000 | 99,907 | 2030/7/22 |
| 埼玉県 | 公募平成24年度第4回 | 0.84 | 300,000 | 303,261 | 2022/7/25 |
| 埼玉県 | 公募平成25年度第4回 | 0.921 | 100,000 | 102,098 | 2023/7/24 |
| 埼玉県 | 公募平成25年度第6回 | 0.806 | 148,000 | 150,917 | 2023/9/27 |
| 埼玉県 | 公募平成25年度第10回 | 0.67 | 100,000 | 101,892 | 2024/2/26 |
| 埼玉県 | 公募平成25年度第11回 | 0.655 | 100,000 | 101,898 | 2024/3/26 |
| 埼玉県 | 公募平成26年度第3回 | 0.67 | 100,000 | 102,038 | 2024/5/20 |
| 埼玉県 | 公募平成26年度第6回 | 0.554 | 200,000 | 203,718 | 2024/9/26 |
| 埼玉県 | 公募平成26年度第7回 | 0.476 | 400,000 | 406,812 | 2024/12/25 |
| 埼玉県 | 公募平成26年度第9回 | 0.429 | 100,000 | 101,596 | 2025/2/25 |
| 埼玉県 | 公募平成27年度第9回 | 0.235 | 100,000 | 101,054 | 2026/2/25 |
| 埼玉県 | 公募平成28年度第5回 | 0.05 | 100,000 | 100,026 | 2026/7/28 |
| 埼玉県 | 公募平成30年度第4回 | 0.205 | 200,000 | 201,580 | 2028/6/26 |
| 埼玉県 | 公募平成30年度第7回 | 0.02 | 200,000 | 200,016 | 2023/10/26 |
| 埼玉県 | 公募(15年)第1回 | 0.941 | 100,000 | 106,817 | 2029/10/19 |
| 埼玉県 | 公募(15年)第2回 | 0.869 | 200,000 | 212,780 | 2030/5/22 |
| 埼玉県 | 公募(15年)第3回 | 0.43 | 100,000 | 102,078 | 2032/1/30 |
| 埼玉県 | 公募(25年)第2回 | 0.781 | 200,000 | 207,964 | 2042/9/19 |
| 埼玉県 | 公募(20年)第6回 | 2.26 | 100,000 | 116,075 | 2028/9/21 |
| 埼玉県 | 公募(20年)第16回 | 1.216 | 100,000 | 111,928 | 2035/8/14 |
| 埼玉県 | 公募(20年)第20回 | 0.626 | 100,000 | 103,185 | 2037/5/15 |
| 福岡県 | 公募平成26年度第1回 | 0.654 | 100,000 | 102,051 | 2024/6/26 |
| 福岡県 | 公募平成27年度第1回 | 0.578 | 300,000 | 307,074 | 2025/6/26 |
| 福岡県 | 公募平成29年度第1回 | 0.2 | 100,000 | 100,775 | 2027/6/23 |
| 福岡県 | 公募平成23年度第1回 | 1.491 | 100,000 | 108,043 | 2026/11/27 |
| 福岡県 | 公募(15年)平成27年度第1回 | 0.784 | 200,000 | 211,638 | 2030/11/25 |
| 福岡県 | 公募(15年)令和元年度第1回 | 0.254 | 100,000 | 99,083 | 2034/6/14 |
| 福岡県 | 公募(30年)平成19年度第1回 | 2.62 | 100,000 | 134,435 | 2037/9/18 |
| 福岡県 | 公募(30年)平成26年度第1回 | 1.827 | 100,000 | 125,772 | 2044/6/20 |
| 福岡県 | 公募(30年・定時償還)平成29年度第2回 | 0.937 | 100,000 | 105,934 | 2047/12/20 |
| 福岡県 | 公募(20年)平成20年度第2回 | 2.05 | 100,000 | 114,911 | 2028/12/20 |
| 福岡県 | 公募(20年)平成22年度第2回 | 2.116 | 300,000 | 357,174 | 2031/2/21 |
| 福岡県 | 公募(20年)平成24年度第2回 | 1.635 | 100,000 | 115,448 | 2032/8/16 |
| 千葉県 | 公募平成24年度第2回 | 0.91 | 100,000 | 101,029 | 2022/5/25 |
| 千葉県 | 公募平成24年度第7回 | 0.74 | 100,000 | 101,253 | 2022/12/22 |
| 千葉県 | 公募平成24年度第8回 | 0.84 | 100,000 | 101,503 | 2023/1/25 |
| 千葉県 | 公募平成25年度第3回 | 0.89 | 100,000 | 101,953 | 2023/6/23 |
| 千葉県 | 公募平成25年度第4回 | 0.92 | 100,000 | 102,099 | 2023/7/25 |
| 千葉県 | 公募平成26年度第1回 | 0.679 | 100,000 | 102,023 | 2024/4/25 |
| 千葉県 | 公募平成26年度第3回 | 0.611 | 200,000 | 203,916 | 2024/7/25 |
| 千葉県 | 公募平成27年度第6回 | 0.469 | 200,000 | 204,250 | 2025/12/25 |
| 千葉県 | 公募平成28年度第4回 | 0.085 | 200,000 | 200,436 | 2026/9/25 |
| 千葉県 | 公募平成29年度第4回 | 0.15 | 100,000 | 100,483 | 2027/9/24 |
| 千葉県 | 公募平成29年度第8回 | 0.2 | 100,000 | 100,798 | 2028/3/24 |
| 千葉県 | 公募(20年)第1回 | 2.06 | 400,000 | 438,484 | 2025/12/19 |
| 千葉県 | 公募(20年)第8回 | 2.18 | 100,000 | 118,136 | 2030/4/19 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | | |
|-----------------------|---|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 千葉県 公募(20年) 第16回 | | 1.555 | 200,000 | 231,632 | 2034/4/14 |
| 千葉県 公募(20年) 第17回 | | 1.403 | 100,000 | 114,131 | 2034/10/13 |
| 群馬県 公募第12回 | | 0.519 | 100,000 | 102,177 | 2025/8/15 |
| 群馬県 公募(20年) 第3回 | | 1.687 | 100,000 | 115,892 | 2032/6/25 |
| 岐阜県 公募平成26年度第1回 | | 0.554 | 186,670 | 190,151 | 2024/9/30 |
| 共同発行市場地方債 公募第110回 | | 0.89 | 200,000 | 202,012 | 2022/5/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第111回 | | 0.89 | 200,000 | 202,156 | 2022/6/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第112回 | | 0.84 | 100,000 | 101,087 | 2022/7/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第113回 | | 0.77 | 800,000 | 808,472 | 2022/8/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第114回 | | 0.82 | 243,700 | 246,604 | 2022/9/22 |
| 共同発行市場地方債 公募第115回 | | 0.8 | 100,000 | 101,233 | 2022/10/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第116回 | | 0.8 | 200,000 | 202,598 | 2022/11/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第118回 | | 0.84 | 100,000 | 101,503 | 2023/1/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第119回 | | 0.8 | 200,000 | 202,988 | 2023/2/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第120回 | | 0.68 | 300,000 | 303,948 | 2023/3/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第121回 | | 0.57 | 100,000 | 101,148 | 2023/4/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第122回 | | 0.62 | 400,000 | 405,208 | 2023/5/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第124回 | | 0.91 | 300,000 | 306,225 | 2023/7/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第126回 | | 0.81 | 100,000 | 101,977 | 2023/9/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第128回 | | 0.66 | 700,000 | 711,900 | 2023/11/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第129回 | | 0.71 | 100,000 | 101,887 | 2023/12/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第130回 | | 0.76 | 100,000 | 102,088 | 2024/1/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第132回 | | 0.66 | 100,000 | 101,911 | 2024/3/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第136回 | | 0.611 | 200,000 | 203,916 | 2024/7/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第137回 | | 0.566 | 500,000 | 509,255 | 2024/8/23 |
| 共同発行市場地方債 公募第139回 | | 0.544 | 155,000 | 157,893 | 2024/10/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第143回 | | 0.448 | 540,000 | 549,018 | 2025/2/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第145回 | | 0.406 | 1,000,000 | 1,015,670 | 2025/4/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第154回 | | 0.405 | 300,000 | 305,556 | 2026/1/23 |
| 共同発行市場地方債 公募第156回 | | 0.1 | 200,000 | 200,796 | 2026/3/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第157回 | | 0.08 | 300,000 | 300,528 | 2026/4/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第161回 | | 0.06 | 300,000 | 300,240 | 2026/8/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第172回 | | 0.225 | 600,000 | 605,652 | 2027/7/23 |
| 共同発行市場地方債 公募第184回 | | 0.175 | 100,000 | 100,581 | 2028/7/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第186回 | | 0.25 | 400,000 | 404,308 | 2028/9/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第188回 | | 0.264 | 300,000 | 303,522 | 2028/11/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第190回 | | 0.16 | 610,000 | 612,055 | 2029/1/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第191回 | | 0.14 | 100,000 | 100,130 | 2029/2/22 |
| 共同発行市場地方債 公募第200回 | | 0.07 | 100,000 | 99,358 | 2029/11/22 |
| 共同発行市場地方債 公募第213回 | | 0.125 | 300,000 | 298,419 | 2030/12/25 |
| 堺市 公募平成22年度第1回 | | 1.97 | 100,000 | 117,055 | 2030/11/19 |
| 堺市 公募平成26年度第1回 | | 1.664 | 100,000 | 122,133 | 2044/9/20 |
| 島根県 公募(30年) 平成29年度第1回 | | 0.919 | 100,000 | 105,531 | 2047/6/20 |
| 佐賀県 公募平成28年度第1回 | | 0.08 | 100,000 | 100,084 | 2026/11/30 |
| 福島県 公募平成26年度第1回 | | 0.495 | 200,000 | 203,474 | 2024/11/28 |
| 滋賀県 公募平成25年度第1回 | | 0.65 | 100,000 | 101,682 | 2023/11/29 |
| 滋賀県 公募平成26年度第1回 | | 0.495 | 142,000 | 144,466 | 2024/11/28 |
| 栃木県 公募平成24年度第1回 | | 0.79 | 100,000 | 101,293 | 2022/11/30 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|-------|-------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 栃木県 | 公募平成25年度第1回 | 0.65 | 100,000 | 101,682 | 2023/11/29 |
| 熊本市 | 公募平成29年度第1回 | 0.19 | 100,000 | 100,763 | 2027/11/30 |
| 新潟市 | 公募平成25年度第1回 | 0.72 | 233,200 | 237,670 | 2023/12/26 |
| 新潟市 | 公募平成29年度第1回 | 0.21 | 100,000 | 100,904 | 2027/12/24 |
| 浜松市 | 公募平成26年度第1回 | 0.335 | 100,000 | 101,201 | 2025/1/23 |
| 大阪市 | 公募平成25年度第6回 | 0.694 | 100,000 | 101,787 | 2023/11/22 |
| 大阪市 | 公募平成26年度第5回 | 0.593 | 100,000 | 101,997 | 2024/9/27 |
| 大阪市 | 公募(15年)第1回 | 1.753 | 100,000 | 109,025 | 2026/7/17 |
| 大阪市 | 公募(20年)第1回 | 2.3 | 300,000 | 344,025 | 2027/11/15 |
| 大阪市 | 公募(20年)第5回 | 2.47 | 100,000 | 117,635 | 2028/9/21 |
| 大阪市 | 公募(20年)第6回 | 2.21 | 100,000 | 116,137 | 2028/12/20 |
| 大阪市 | 公募(20年)第17回 | 1.721 | 100,000 | 116,690 | 2032/12/21 |
| 大阪市 | 公募(20年)第26回 | 0.635 | 100,000 | 103,086 | 2037/10/23 |
| 名古屋市 | 公募第481回 | 0.744 | 100,000 | 101,256 | 2022/12/20 |
| 名古屋市 | 公募第488回 | 0.598 | 300,000 | 306,009 | 2024/9/20 |
| 名古屋市 | 公募第489回 | 0.461 | 100,000 | 101,640 | 2024/12/20 |
| 名古屋市 | 公募第501回 | 0.175 | 200,000 | 201,292 | 2027/9/29 |
| 名古屋市 | 公募第503回 | 0.205 | 100,000 | 100,832 | 2028/3/24 |
| 名古屋市 | 公募第504回 | 0.205 | 200,000 | 201,650 | 2028/6/20 |
| 名古屋市 | 公募第512回 | 0.15 | 300,000 | 299,451 | 2030/6/20 |
| 名古屋市 | 公募(12年)第1回 | 1.033 | 200,000 | 208,538 | 2025/6/20 |
| 名古屋市 | 公募(15年)第2回 | 0.905 | 100,000 | 106,525 | 2029/11/16 |
| 京都市 | 公募平成29年度第1回 | 0.21 | 100,000 | 100,860 | 2027/8/25 |
| 京都市 | 公募平成29年度第4回 | 0.235 | 101,280 | 102,347 | 2028/1/31 |
| 京都市 | 公募(20年)第2回 | 2.12 | 100,000 | 109,377 | 2025/9/19 |
| 京都市 | 公募(20年)第5回 | 2.36 | 200,000 | 226,150 | 2026/12/18 |
| 京都市 | 公募(20年)第6回 | 2.38 | 100,000 | 114,833 | 2027/9/17 |
| 京都市 | 公募(20年)第13回 | 1.359 | 100,000 | 113,589 | 2034/11/24 |
| 京都市 | 公募(20年)第15回 | 0.487 | 200,000 | 202,256 | 2036/11/28 |
| 神戸市 | 公募平成26年度第17回 | 0.28 | 300,000 | 302,982 | 2025/1/27 |
| 神戸市 | 公募平成28年度第1回 | 0.08 | 200,000 | 200,352 | 2026/4/17 |
| 神戸市 | 公募平成30年度第2回 | 0.845 | 200,000 | 207,040 | 2048/3/19 |
| 横浜市 | 公募公債平成24年度2回 | 0.815 | 200,000 | 202,478 | 2022/10/17 |
| 横浜市 | 公募公債平成25年度1回 | 0.664 | 200,000 | 202,772 | 2023/5/19 |
| 横浜市 | 公募公債平成25年度5回 | 0.655 | 200,000 | 203,352 | 2023/11/17 |
| 横浜市 | 公募公債平成26年度5回 | 0.471 | 200,000 | 203,338 | 2024/12/13 |
| 横浜市 | 公募平成28年度第5回 | 0.23 | 300,000 | 302,904 | 2027/2/19 |
| 横浜市 | 公募平成29年度第3回 | 0.22 | 100,000 | 100,919 | 2027/8/13 |
| 横浜市 | 公募(30年)第2回 | 2.49 | 200,000 | 258,222 | 2035/3/20 |
| 横浜市 | 公募(20年)第18回 | 2.21 | 100,000 | 116,923 | 2029/5/25 |
| 横浜市 | 公募(20年)第26回 | 1.776 | 100,000 | 117,466 | 2033/1/28 |
| 横浜市 | 公募(20年)第30回 | 1.376 | 100,000 | 113,798 | 2034/10/20 |
| 札幌市 | 公募(15年)平成23年度第9回 | 1.493 | 200,000 | 216,706 | 2027/2/12 |
| 札幌市 | 公募(20年)平成24年度第1回 | 1.79 | 100,000 | 116,892 | 2032/4/23 |
| 札幌市 | 公募(20年)平成24年度第11回 | 1.794 | 100,000 | 117,727 | 2033/2/28 |
| 札幌市 | 公募平成26年度第4回 | 0.54 | 100,000 | 101,674 | 2024/6/20 |
| 札幌市 | 公募平成26年度第9回 | 0.43 | 200,000 | 203,050 | 2024/12/20 |
| 川崎市 | 公募第85回 | 0.72 | 100,000 | 101,214 | 2022/12/20 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------|-----------------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 川崎市 | 公募 (20年) 第17回 | 1.527 | 100,000 | 114,868 | 2033/5/9 |
| 川崎市 | 公募 (20年) 第19回 | 1.362 | 100,000 | 113,541 | 2034/9/20 |
| 川崎市 | 公募 (30年) 第11回 | 0.817 | 100,000 | 102,882 | 2048/3/19 |
| 北九州市 | 公募 (10年) 令和2年度第2回 | 0.125 | 200,000 | 198,756 | 2030/12/24 |
| 北九州市 | 公募 (20年) 第3回 | 2.33 | 200,000 | 228,924 | 2027/9/21 |
| 北九州市 | 公募 (20年) 第14回 | 1.732 | 100,000 | 116,666 | 2032/11/12 |
| 福岡市 | 公募 (20年) 平成21年度第3回 | 2.14 | 200,000 | 233,684 | 2029/9/18 |
| 福岡市 | 公募 (20年) 平成23年度第4回 | 1.89 | 100,000 | 117,197 | 2031/8/19 |
| 福岡市 | 公募平成26年度第2回 | 1.49 | 100,000 | 115,056 | 2034/6/20 |
| 福岡市 | 公募平成26年度第5回 | 0.539 | 100,000 | 101,853 | 2024/10/28 |
| 福岡市 | 公募平成26年度第8回 | 0.465 | 160,000 | 162,833 | 2025/3/25 |
| 広島市 | 公募平成26年度第2回 | 0.456 | 100,000 | 101,628 | 2024/12/25 |
| 広島市 | 公募平成27年度第2回 | 0.464 | 500,000 | 510,505 | 2025/12/25 |
| 広島市 | 公募 (10年) 平成30年度第6回 | 0.146 | 241,000 | 241,426 | 2029/2/22 |
| 千葉県 | 公募平成26年度第2回 | 0.505 | 200,000 | 203,546 | 2024/11/27 |
| 三重県 | 公募平成24年度第1回 | 0.801 | 140,660 | 142,395 | 2022/10/25 |
| 三重県 | 公募平成28年度第1回 | 0.165 | 155,000 | 155,885 | 2026/12/25 |
| 福井県 | 公募平成24年度第4回 | 0.46 | 100,000 | 100,922 | 2023/4/26 |
| 福井県 | 公募平成27年度第4回 | 0.085 | 200,000 | 200,404 | 2026/4/27 |
| 山梨県 | 公募平成24年度第1回 | 0.8 | 200,000 | 202,478 | 2022/10/28 |
| 岡山県 | 公募平成28年度第2回 | 0.205 | 168,900 | 170,312 | 2027/3/31 |
| 愛知県・名古屋 | 折半保証名古屋高速道路債券 第96回 | 2.34 | 100,000 | 115,540 | 2028/12/20 |
| 愛知県・名古屋 | 折半保証名古屋高速道路債券 第102回 | 2.298 | 300,000 | 351,120 | 2029/12/20 |
| 福岡北九州 | 高速道路債券 第117回 | 2.26 | 100,000 | 115,022 | 2028/12/20 |
| 福岡北九州 | 高速道路債券 第136回 | 0.833 | 100,000 | 104,655 | 2030/3/19 |
| 小 計 | | | 48,556,100 | 50,873,297 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第37回 | 0.895 | 604,000 | 610,662 | 2022/6/17 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第38回 | 0.839 | 194,000 | 196,135 | 2022/7/15 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第39回 | 0.801 | 100,000 | 101,123 | 2022/8/15 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第40回 | 0.819 | 101,000 | 102,233 | 2022/9/16 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第41回 | 0.791 | 102,000 | 103,276 | 2022/10/18 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第42回 | 0.805 | 108,000 | 109,438 | 2022/11/14 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第43回 | 0.734 | 202,000 | 204,589 | 2022/12/16 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第44回 | 0.834 | 145,000 | 147,225 | 2023/1/20 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第45回 | 0.815 | 223,000 | 226,487 | 2023/2/17 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第48回 | 0.605 | 500,000 | 506,390 | 2023/5/16 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第49回 | 0.882 | 13,000 | 13,252 | 2023/6/16 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第50回 | 0.911 | 100,000 | 102,076 | 2023/7/14 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第56回 | 0.747 | 591,000 | 603,221 | 2024/1/19 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第59回 | 0.669 | 116,000 | 118,302 | 2024/4/12 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第64回 | 0.544 | 100,000 | 101,823 | 2024/9/13 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第65回 | 0.539 | 400,000 | 407,416 | 2024/10/16 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第69回 | 0.414 | 320,000 | 324,956 | 2025/2/17 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第72回 | 0.509 | 189,000 | 192,861 | 2025/5/23 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第78回 | 0.381 | 509,000 | 517,622 | 2025/11/18 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回 | 0.173 | 500,000 | 502,310 | 2024/1/29 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第83回 | 0.02 | 116,000 | 115,998 | 2026/4/17 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------|--------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第108回 | 0.145 | 157,000 | 157,891 | 2028/5/19 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第110回 | 0.13 | 100,000 | 100,399 | 2028/7/18 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第113回 | 0.219 | 110,000 | 111,106 | 2028/10/16 |
| 新関西 | 国際空港債券 政府保証第1回 | 0.801 | 151,000 | 152,742 | 2022/8/29 |
| 新関西 | 国際空港債券 政府保証第2回 | 0.882 | 191,000 | 194,760 | 2023/6/27 |
| 新関西 | 国際空港債券 政府保証第5回 | 0.145 | 117,000 | 117,699 | 2027/3/30 |
| 原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 | 政府保証第16回 | 0.001 | 300,000 | 299,937 | 2023/11/27 |
| 日本政策投資銀行債券 | 政府保証第22回 | 2.2 | 100,000 | 104,875 | 2023/6/19 |
| 日本政策投資銀行社債 | 政府保証第16回 | 0.819 | 102,000 | 103,254 | 2022/9/20 |
| 日本政策投資銀行社債 | 政府保証第19回 | 0.668 | 159,000 | 161,124 | 2023/3/15 |
| 日本政策投資銀行社債 | 政府保証第38回 | 0.001 | 1,500,000 | 1,500,450 | 2023/2/17 |
| 日本政策投資銀行社債 | 政府保証第42回 | 0.155 | 300,000 | 302,004 | 2027/12/15 |
| 日本政策投資銀行社債 | 政府保証第55回 | 0.105 | 300,000 | 300,000 | 2029/3/19 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第92回 | 2.1 | 200,000 | 233,766 | 2029/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第97回 | 2.1 | 200,000 | 234,284 | 2029/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第99回 | 2.2 | 200,000 | 236,292 | 2030/1/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第106回 | 2.1 | 200,000 | 235,380 | 2030/4/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第114回 | 1.9 | 200,000 | 232,444 | 2030/7/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第123回 | 2.1 | 100,000 | 129,153 | 2040/11/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第163回 | 0.901 | 1,000,000 | 1,010,680 | 2022/5/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第165回 | 1.83 | 100,000 | 124,971 | 2042/5/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第168回 | 0.839 | 100,000 | 101,134 | 2022/7/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第169回 | 1.634 | 100,000 | 115,503 | 2032/7/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第170回 | 0.801 | 218,000 | 220,524 | 2022/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第171回 | 1.56 | 100,000 | 114,732 | 2032/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第172回 | 1.919 | 300,000 | 380,460 | 2042/8/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第173回 | 0.819 | 200,000 | 202,506 | 2022/9/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第175回 | 0.791 | 200,000 | 202,558 | 2022/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第180回 | 0.734 | 200,000 | 202,614 | 2022/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第182回 | 0.834 | 900,000 | 914,040 | 2023/1/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第183回 | 1.726 | 100,000 | 116,970 | 2033/1/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第189回 | 0.541 | 196,000 | 198,181 | 2023/4/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第190回 | 0.605 | 400,000 | 405,208 | 2023/5/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第193回 | 0.882 | 1,000,000 | 1,019,740 | 2023/6/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第197回 | 0.835 | 272,000 | 277,464 | 2023/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第207回 | 0.693 | 300,000 | 305,625 | 2023/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第211回 | 0.66 | 137,000 | 139,597 | 2024/2/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第213回 | 0.645 | 145,000 | 147,759 | 2024/3/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第216回 | 1.483 | 100,000 | 115,027 | 2034/4/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第217回 | 1.72 | 100,000 | 123,621 | 2044/5/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第219回 | 1.478 | 100,000 | 115,063 | 2034/5/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第220回 | 0.644 | 300,000 | 306,117 | 2024/6/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第224回 | 1.72 | 100,000 | 123,752 | 2044/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第225回 | 0.556 | 190,000 | 193,503 | 2024/8/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第229回 | 0.539 | 630,000 | 641,818 | 2024/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第234回 | 0.466 | 100,000 | 101,686 | 2024/12/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第239回 | 1.16 | 500,000 | 555,540 | 2035/2/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第241回 | 0.45 | 200,000 | 203,476 | 2025/3/31 |

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | 償還年月日 |
|--------------------|------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第261回 | 0.381 | 401,000 | 407,833 | 2025/11/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第271回 | 0.02 | 151,000 | 151,036 | 2026/3/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第297回 | 0.085 | 100,000 | 100,286 | 2026/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第306回 | 0.145 | 403,000 | 405,409 | 2027/3/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第315回 | 0.13 | 100,000 | 100,498 | 2027/6/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第321回 | 0.155 | 600,000 | 604,026 | 2027/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第324回 | 0.09 | 100,000 | 100,226 | 2027/9/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第335回 | 0.84 | 100,000 | 103,735 | 2047/12/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第339回 | 0.195 | 500,000 | 504,645 | 2028/2/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第342回 | 0.145 | 131,000 | 131,729 | 2028/3/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第351回 | 0.145 | 100,000 | 100,504 | 2028/6/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第354回 | 0.13 | 200,000 | 200,802 | 2028/7/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第357回 | 0.209 | 100,000 | 100,951 | 2028/8/31 |
| 民間都市開発推進機構 | 政府保証第16回 | 0.699 | 360,000 | 366,372 | 2023/10/20 |
| 関西国際空港債券 | 政府保証第54回 | 2.4 | 300,000 | 350,292 | 2028/6/23 |
| 中部国際空港債券 | 政府保証第18回 | 0.668 | 368,000 | 372,964 | 2023/3/22 |
| 中部国際空港債券 | 政府保証第22回 | 0.001 | 300,000 | 299,925 | 2024/3/1 |
| 預金保険機構債券 | 政府保証第230回 | 0.1 | 300,000 | 300,846 | 2024/8/6 |
| 預金保険機構債券 | 政府保証第231回 | 0.1 | 300,000 | 300,885 | 2024/10/4 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第6回 | 1.445 | 300,000 | 328,422 | 2028/9/15 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第9回 | 1.231 | 100,000 | 108,097 | 2028/12/20 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第12回 | 1.067 | 100,000 | 107,181 | 2029/9/20 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第22回 | 0.05 | 200,000 | 199,972 | 2023/12/20 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第31回 | 0.781 | 300,000 | 303,414 | 2022/9/20 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第47回 | 1.027 | 100,000 | 107,027 | 2029/9/20 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第78回 | 0.225 | 200,000 | 201,378 | 2027/4/13 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第82回 | 0.27 | 100,000 | 100,935 | 2027/7/13 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第86回 | 0.235 | 300,000 | 302,334 | 2027/10/13 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第96回 | 0.195 | 200,000 | 200,720 | 2028/7/12 |
| 道路債券 | 財投機関債第17回 | 1.54 | 300,000 | 307,911 | 2022/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第4回 | 2.59 | 100,000 | 130,731 | 2035/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第8回 | 2.45 | 200,000 | 223,840 | 2026/3/19 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第17回 | 2.35 | 100,000 | 112,269 | 2026/9/18 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第23回 | 2.39 | 300,000 | 342,612 | 2027/7/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第33回 | 2.91 | 200,000 | 304,988 | 2048/3/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第39回 | 2.37 | 200,000 | 232,906 | 2028/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第47回 | 2.41 | 100,000 | 117,852 | 2029/4/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第89回 | 1.711 | 100,000 | 115,622 | 2032/6/18 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第100回 | 0.784 | 200,000 | 202,666 | 2022/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第102回 | 0.666 | 100,000 | 101,291 | 2023/3/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第103回 | 1.69 | 350,000 | 405,944 | 2033/3/18 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第105回 | 1.853 | 100,000 | 117,936 | 2033/3/18 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第107回 | 0.935 | 100,000 | 102,034 | 2023/6/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第116回 | 0.722 | 400,000 | 406,948 | 2023/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第122回 | 0.704 | 100,000 | 102,016 | 2024/3/19 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第123回 | 0.69 | 100,000 | 101,974 | 2024/3/19 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第130回 | 0.56 | 200,000 | 203,378 | 2024/6/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第134回 | 0.529 | 200,000 | 203,180 | 2024/6/20 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------|-------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第136回 | 0.583 | 200,000 | 203,796 | 2024/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第145回 | 1.523 | 300,000 | 351,960 | 2044/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第149回 | 1.604 | 100,000 | 119,043 | 2045/3/17 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第157回 | 0.857 | 100,000 | 105,902 | 2030/6/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第164回 | 1.149 | 100,000 | 110,176 | 2035/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第173回 | 0.652 | 100,000 | 92,372 | 2056/3/17 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第188回 | 0.614 | 100,000 | 102,117 | 2037/9/18 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第260回 | 0.651 | 200,000 | 195,200 | 2050/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 | 財投機関債第13回 | 2.28 | 130,000 | 134,353 | 2022/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 | 財投機関債第28回 | 2.83 | 400,000 | 523,100 | 2033/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 | 財投機関債第33回 | 2.91 | 100,000 | 132,697 | 2034/6/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 | 財投機関債第38回 | 2.26 | 1,000,000 | 1,077,170 | 2024/9/20 |
| 公営企業債券 | 30年第4回財投機関債 | 2.95 | 100,000 | 132,788 | 2034/3/24 |
| 地方公営企業等金融機構債券(20年) | 第1回 | 2.07 | 100,000 | 114,713 | 2028/12/20 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 20年第4回 | 2.12 | 100,000 | 116,708 | 2029/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F16回 | 2.042 | 100,000 | 111,179 | 2027/1/7 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 20年第6回 | 2.242 | 300,000 | 354,600 | 2030/3/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F24回 | 1.681 | 100,000 | 103,278 | 2023/3/17 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第10回 | 1.752 | 300,000 | 342,864 | 2030/8/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F104回 | 1.314 | 100,000 | 105,046 | 2025/3/7 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F106回 | 1.259 | 100,000 | 103,662 | 2024/3/19 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F122回 | 1.412 | 100,000 | 108,039 | 2027/6/18 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F124回 | 1.418 | 100,000 | 108,027 | 2027/6/4 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第37回 | 0.852 | 400,000 | 404,184 | 2022/6/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F132回 | 1.09 | 500,000 | 522,905 | 2025/7/30 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第41回 | 0.801 | 600,000 | 607,494 | 2022/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F142回 | 1.016 | 100,000 | 103,626 | 2024/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F145回 | 1.059 | 200,000 | 208,154 | 2025/3/19 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F147回 | 1.291 | 100,000 | 107,065 | 2027/3/19 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第42回 | 0.801 | 100,000 | 101,316 | 2022/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第44回 | 0.791 | 100,000 | 101,427 | 2023/1/27 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F160回 | 1.052 | 100,000 | 106,497 | 2028/5/26 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第29回 | 1.725 | 100,000 | 116,689 | 2033/6/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第51回 | 0.841 | 600,000 | 611,880 | 2023/8/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第52回 | 0.801 | 300,000 | 305,880 | 2023/9/15 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (15年) 第2回 | 1.161 | 200,000 | 215,490 | 2028/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第38回 | 1.487 | 100,000 | 114,404 | 2034/7/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F240回 | 1.069 | 300,000 | 322,983 | 2030/2/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第64回 | 0.574 | 100,000 | 101,913 | 2024/9/27 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第39回 | 1.425 | 100,000 | 113,714 | 2034/9/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第74回 | 0.519 | 300,000 | 306,324 | 2025/7/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第77回 | 0.491 | 100,000 | 102,105 | 2025/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第79回 | 0.484 | 400,000 | 408,592 | 2025/12/26 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第95回 | 0.2 | 200,000 | 201,208 | 2027/4/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第101回 | 0.235 | 400,000 | 403,396 | 2027/10/28 |
| 公営企業債券(20年) | 第2回財投機関債 | 1.45 | 100,000 | 102,482 | 2022/12/20 |
| 公営企業債券(20年) | 第5回財投機関債 | 2.11 | 200,000 | 210,338 | 2023/9/20 |
| 公営企業債券(20年) | 第19回財投機関債 | 2.37 | 100,000 | 112,939 | 2026/12/18 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|-----------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 公営企業債券(20年) 第20回財投機関債 | 2.25 | 100,000 | 112,784 | 2027/3/24 |
| 公営企業債券(20年) 第24回財投機関債 | 2.29 | 100,000 | 115,171 | 2028/4/25 |
| 公営企業債券(20年) 第25回財投機関債 | 2.5 | 100,000 | 117,001 | 2028/6/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第96回 | 0.599 | 200,000 | 203,906 | 2024/9/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第97回 | 1.017 | 100,000 | 106,943 | 2029/9/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第101回 | 0.935 | 100,000 | 106,290 | 2029/11/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第109回 | 0.918 | 100,000 | 106,455 | 2030/6/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第113回 | 0.851 | 300,000 | 317,718 | 2030/9/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第121回 | 0.482 | 200,000 | 205,072 | 2031/2/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第127回 | 0.075 | 100,000 | 99,891 | 2026/9/18 |
| 本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回 | 2.26 | 100,000 | 109,238 | 2025/6/20 |
| 東京交通債券 第342回 | 2.4 | 200,000 | 205,826 | 2022/6/21 |
| 東京交通債券 第347回 | 2.05 | 157,000 | 166,261 | 2024/3/8 |
| 福祉医療機構債券 第31回財投機関債 | 0.93 | 100,000 | 101,123 | 2022/6/20 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回 | 2.26 | 400,000 | 450,988 | 2027/3/19 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回 | 2.46 | 200,000 | 228,880 | 2027/6/18 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回 | 2.15 | 100,000 | 105,268 | 2023/9/20 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回 | 1.94 | 100,000 | 107,547 | 2025/3/19 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回 | 2.11 | 100,000 | 117,291 | 2030/6/18 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回 | 1.95 | 100,000 | 116,334 | 2030/10/22 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回 | 2.066 | 100,000 | 118,368 | 2031/6/13 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回 | 1.751 | 300,000 | 325,971 | 2026/6/19 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回 | 2.056 | 100,000 | 118,338 | 2031/7/11 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第85回 | 1.841 | 200,000 | 232,938 | 2031/10/17 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回 | 1.595 | 200,000 | 216,938 | 2026/12/18 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回 | 1.836 | 100,000 | 117,376 | 2032/11/12 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回 | 1.801 | 100,000 | 116,830 | 2032/9/17 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回 | 2.273 | 100,000 | 131,936 | 2042/9/19 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回 | 1.092 | 200,000 | 213,202 | 2028/3/17 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回 | 1.31 | 100,000 | 108,366 | 2028/6/20 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回 | 1.192 | 100,000 | 107,789 | 2028/10/20 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回 | 0.484 | 250,000 | 255,170 | 2025/12/19 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回 | 0.155 | 300,000 | 300,852 | 2026/12/18 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回 | 0.403 | 100,000 | 101,031 | 2032/11/19 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第244回 | 0.274 | 130,000 | 131,176 | 2028/8/18 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第301回 | 0.04 | 300,000 | 299,928 | 2025/12/19 |
| 成田国際空港 第13回一般担保付 | 0.802 | 200,000 | 202,908 | 2023/2/8 |
| 成田国際空港 第17回 | 0.489 | 400,000 | 406,584 | 2025/2/20 |
| 沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第6回 | 2.04 | 200,000 | 216,806 | 2025/6/20 |
| 国際協力機構債券 第6回財投機関債 | 2.098 | 200,000 | 236,022 | 2030/12/13 |
| 東日本高速道路 第61回 | 0.14 | 200,000 | 198,932 | 2029/7/31 |
| 中日本高速道路 第63回 | 0.576 | 100,000 | 102,353 | 2025/11/13 |
| 中日本高速道路 第79回 | 0.04 | 300,000 | 299,940 | 2024/8/19 |
| 西日本高速道路 第20回 | 0.759 | 200,000 | 203,606 | 2023/9/20 |
| 西日本高速道路 第22回 | 0.744 | 400,000 | 408,296 | 2024/3/19 |
| 西日本高速道路 第23回 | 0.602 | 100,000 | 101,792 | 2024/6/20 |
| 西日本高速道路 第30回 | 0.17 | 300,000 | 301,149 | 2026/5/22 |
| 西日本高速道路 第50回 | 0.04 | 200,000 | 199,966 | 2024/6/20 |

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | |
|------------------------|-----------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 財投機関債第57回 | 0.835 | 300,000 | 305,436 | 2023/6/20 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 財投機関債第62回 | 0.714 | 100,000 | 101,875 | 2023/12/20 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 財投機関債第68回 | 0.586 | 200,000 | 203,682 | 2024/8/5 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 財投機関債第69回 | 1.441 | 100,000 | 113,838 | 2034/8/4 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 財投機関債第71回 | 0.525 | 500,000 | 508,950 | 2024/11/27 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 財投機関債第90回 | 0.2 | 300,000 | 298,827 | 2031/5/30 |
| 貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券 | | 1.69 | 28,431 | 28,443 | 2038/9/10 |
| 貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券 | | 1.8 | 53,635 | 54,249 | 2039/6/10 |
| 貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券 | | 1.76 | 32,019 | 32,288 | 2036/11/10 |
| 貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券 | | 2.34 | 35,682 | 36,687 | 2041/5/10 |
| 貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券 | | 2.25 | 11,122 | 11,308 | 2037/5/10 |
| 貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券 | | 1.84 | 24,136 | 24,688 | 2041/2/10 |
| 貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券 | | 1.93 | 27,768 | 28,921 | 2041/3/10 |
| 貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券 | | 1.69 | 30,945 | 31,126 | 2039/2/10 |
| 貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券 | | 1.69 | 49,964 | 51,152 | 2040/7/10 |
| 貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券 | | 2.12 | 53,820 | 54,582 | 2039/7/10 |
| 貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券 | | 2.3 | 47,976 | 49,247 | 2041/7/10 |
| 貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券 | | 1.99 | 77,898 | 80,140 | 2042/12/10 |
| 貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券 | | 2.14 | 13,391 | 13,884 | 2042/11/10 |
| 貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券 | | 2.28 | 20,661 | 22,122 | 2044/6/10 |
| 貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券 | | 1.98 | 66,873 | 71,174 | 2044/9/10 |
| 貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券 | | 1.64 | 11,720 | 11,842 | 2032/11/10 |
| 貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券 | | 1.43 | 64,656 | 68,016 | 2045/11/10 |
| 貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券 | | 1.71 | 23,604 | 23,869 | 2032/11/10 |
| 貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券 | | 1.79 | 79,515 | 84,157 | 2046/2/10 |
| 貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券 | | 1.51 | 64,354 | 67,856 | 2046/9/10 |
| 貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券 | | 2.34 | 36,752 | 39,169 | 2044/5/10 |
| 貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券 | | 1.89 | 78,813 | 83,495 | 2046/5/10 |
| 貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券 | | 1.36 | 81,531 | 85,186 | 2045/9/10 |
| 貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 124,833 | 130,606 | 2047/7/10 |
| 貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券 | | 1.34 | 120,600 | 126,920 | 2047/5/10 |
| 貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券 | | 1.26 | 78,046 | 81,821 | 2047/6/10 |
| 貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券 | | 1.64 | 29,434 | 31,082 | 2046/8/10 |
| 貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券 | | 1.6 | 64,030 | 67,835 | 2045/12/10 |
| 貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券 | | 1.07 | 40,357 | 41,973 | 2048/12/10 |
| 貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券 | | 1.07 | 87,898 | 91,508 | 2049/2/10 |
| 貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券 | | 1.08 | 39,108 | 40,682 | 2048/5/10 |
| 貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券 | | 1.87 | 22,170 | 22,479 | 2039/9/10 |
| 貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券 | | 1.25 | 117,561 | 123,175 | 2048/3/10 |
| 貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券 | | 1.88 | 25,110 | 26,769 | 2045/2/10 |
| 貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券 | | 1.86 | 27,170 | 28,993 | 2045/3/10 |
| 貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券 | | 1.87 | 25,312 | 26,907 | 2045/4/10 |
| 貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券 | | 1.85 | 27,323 | 29,006 | 2046/3/10 |
| 貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券 | | 1.41 | 78,558 | 82,932 | 2046/12/10 |
| 貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券 | | 1.42 | 111,222 | 117,232 | 2047/1/10 |
| 貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券 | | 1.44 | 37,127 | 39,157 | 2047/2/10 |
| 貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券 | | 1.21 | 76,806 | 80,291 | 2048/9/10 |
| 貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券 | | 1.82 | 10,265 | 10,336 | 2036/5/10 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|------------------------|-------|---------|---------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 |
| 貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券 | 1.7 | 46,550 | 46,574 |
| 貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券 | 1.65 | 18,996 | 19,006 |
| 貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券 | 2.25 | 72,192 | 76,534 |
| 貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券 | 1.82 | 73,071 | 77,611 |
| 貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券 | 1.52 | 134,480 | 141,182 |
| 貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券 | 1.4 | 80,366 | 84,800 |
| 貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券 | 1.16 | 131,952 | 137,893 |
| 貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 115,059 | 119,602 |
| 貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券 | 1.3 | 89,550 | 94,263 |
| 貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券 | 1.26 | 75,868 | 79,505 |
| 貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券 | 1.04 | 184,444 | 191,871 |
| 貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券 | 1.01 | 319,753 | 332,140 |
| 貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券 | 0.93 | 48,694 | 50,402 |
| 貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券 | 0.95 | 50,684 | 52,524 |
| 貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券 | 0.87 | 51,924 | 53,598 |
| 貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 109,014 | 111,802 |
| 貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券 | 0.6 | 114,502 | 116,558 |
| 貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券 | 0.8 | 60,519 | 62,267 |
| 貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 64,313 | 65,976 |
| 貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券 | 0.83 | 191,736 | 197,662 |
| 貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券 | 0.9 | 197,769 | 204,684 |
| 貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券 | 0.88 | 132,800 | 137,297 |
| 貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券 | 0.84 | 64,768 | 66,841 |
| 貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券 | 0.89 | 65,349 | 67,627 |
| 貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券 | 0.41 | 242,898 | 244,250 |
| 貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券 | 0.48 | 162,800 | 164,528 |
| 貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 164,048 | 165,542 |
| 貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券 | 0.47 | 81,986 | 82,793 |
| 貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 163,854 | 165,351 |
| 貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券 | 0.4 | 82,632 | 83,069 |
| 貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券 | 0.43 | 83,037 | 83,628 |
| 貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 84,470 | 85,219 |
| 貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 337,656 | 339,708 |
| 貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券 | 0.43 | 254,952 | 256,637 |
| 貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 170,066 | 171,074 |
| 貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 173,062 | 174,513 |
| 貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券 | 0.39 | 176,570 | 177,163 |
| 貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券 | 0.39 | 88,301 | 88,590 |
| 貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券 | 0.44 | 89,084 | 89,745 |
| 貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券 | 0.38 | 89,671 | 89,933 |
| 貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券 | 0.32 | 273,804 | 273,324 |
| 貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券 | 0.33 | 275,004 | 274,629 |
| 貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券 | 0.21 | 471,440 | 465,938 |
| 貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券 | 0.33 | 190,682 | 190,338 |
| 貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券 | 0.3 | 192,240 | 191,378 |
| 貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券 | 0.33 | 298,476 | 297,744 |
| 貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券 | 0.36 | 199,644 | 199,747 |
| 貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券 | 0.41 | 300,000 | 301,416 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券 | | 0.41 | 200,000 | 200,904 | 2056/4/10 |
| フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014) | | 0.725 | 100,000 | 101,818 | 2024/7/30 |
| 小 計 | | | 58,137,926 | 60,862,888 | |
| 金融債券 | | | | | |
| 商工債券 利付第806回い号 | | 0.1 | 300,000 | 300,258 | 2022/7/27 |
| 商工債券 利付第811回い号 | | 0.17 | 300,000 | 300,705 | 2022/12/27 |
| 商工債券 利付第815回い号 | | 0.17 | 100,000 | 100,270 | 2023/4/27 |
| 商工債券 利付第818回い号 | | 0.17 | 100,000 | 100,291 | 2023/7/27 |
| 商工債券 利付第819回い号 | | 0.18 | 300,000 | 300,975 | 2023/8/25 |
| 商工債券 利付第829回い号 | | 0.13 | 200,000 | 200,354 | 2024/6/27 |
| 商工債券 利付第831回い号 | | 0.08 | 200,000 | 200,028 | 2024/8/27 |
| 商工債券 利付第833回い号 | | 0.05 | 100,000 | 99,855 | 2024/10/25 |
| しんきん中金債券 利付第335回 | | 0.1 | 200,000 | 200,222 | 2022/10/27 |
| 商工債券 利付(3年)第236回 | | 0.02 | 500,000 | 499,890 | 2022/9/27 |
| 商工債券 利付(10年)第15回 | | 0.48 | 200,000 | 203,374 | 2025/9/19 |
| 小 計 | | | 2,500,000 | 2,506,222 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| 東京電力 第548回 | | 2.347 | 100,000 | 111,181 | 2028/9/29 |
| 東京電力 第560回 | | 2.114 | 100,000 | 110,191 | 2029/12/10 |
| 中部電力 第500回 | | 0.875 | 200,000 | 205,122 | 2024/5/24 |
| 中部電力 第524回 | | 0.39 | 100,000 | 101,154 | 2027/5/25 |
| 中部電力 第530回 | | 0.274 | 200,000 | 199,660 | 2029/6/25 |
| 関西電力 第509回 | | 0.47 | 100,000 | 101,424 | 2027/5/25 |
| 関西電力 第511回 | | 0.41 | 100,000 | 100,985 | 2027/9/17 |
| 関西電力 第527回 | | 0.28 | 200,000 | 201,228 | 2024/4/25 |
| 関西電力 第535回 | | 0.18 | 200,000 | 200,374 | 2025/12/19 |
| 中国電力 第377回 | | 1.121 | 100,000 | 102,584 | 2023/8/25 |
| 中国電力 第378回 | | 1.004 | 100,000 | 102,444 | 2023/10/25 |
| 中国電力 第400回 | | 0.34 | 100,000 | 100,767 | 2027/9/24 |
| 中国電力 第402回 | | 0.25 | 100,000 | 100,602 | 2024/10/25 |
| 北陸電力 第301回 | | 1.158 | 100,000 | 102,202 | 2023/3/24 |
| 北陸電力 第307回 | | 1.055 | 100,000 | 104,674 | 2026/6/25 |
| 北陸電力 第308回 | | 0.769 | 100,000 | 102,375 | 2024/9/25 |
| 北陸電力 第326回 | | 0.719 | 100,000 | 101,127 | 2038/4/23 |
| 東北電力 第475回 | | 0.809 | 100,000 | 102,514 | 2024/9/25 |
| 東北電力 第481回 | | 0.803 | 200,000 | 205,814 | 2025/7/25 |
| 東北電力 第484回 | | 0.758 | 100,000 | 102,187 | 2036/5/23 |
| 東北電力 第491回 | | 0.42 | 100,000 | 101,254 | 2027/2/25 |
| 東北電力 第521回 | | 0.45 | 100,000 | 100,975 | 2030/5/24 |
| 四国電力 第281回 | | 1.111 | 100,000 | 102,624 | 2023/9/25 |
| 九州電力 第424回 | | 1.233 | 100,000 | 103,110 | 2023/11/24 |
| 九州電力 第428回 | | 0.936 | 105,000 | 107,972 | 2024/7/25 |
| 九州電力 第449回 | | 0.43 | 200,000 | 202,572 | 2027/4/23 |
| 九州電力 第451回 | | 0.45 | 100,000 | 101,395 | 2027/5/25 |
| 九州電力 第476回 | | 0.43 | 100,000 | 100,873 | 2029/5/25 |
| 九州電力 第484回 | | 0.375 | 200,000 | 200,670 | 2029/11/22 |
| 北海道電力 第321回 | | 0.886 | 100,000 | 102,888 | 2024/12/25 |
| 北海道電力 第323回 | | 1.337 | 100,000 | 108,456 | 2030/3/25 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|------------------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 北海道電力 第338回 | 0.84 | 100,000 | 102,912 | 2036/11/25 |
| 北海道電力 第345回 | 0.27 | 300,000 | 301,761 | 2024/9/25 |
| 東京電力パワーグリッド 第6回 | 0.85 | 100,000 | 101,869 | 2027/8/31 |
| 東京電力パワーグリッド 第11回 | 0.79 | 300,000 | 303,741 | 2028/1/25 |
| 東京電力パワーグリッド 第14回 | 0.43 | 100,000 | 100,677 | 2023/7/24 |
| 東京電力パワーグリッド 第28回 | 1.01 | 100,000 | 102,167 | 2029/7/10 |
| 東京電力パワーグリッド 第35回 | 1.2 | 100,000 | 103,655 | 2030/4/23 |
| 東京電力パワーグリッド 第38回 | 0.58 | 200,000 | 202,422 | 2025/7/16 |
| 東京電力パワーグリッド 第40回 | 1.37 | 400,000 | 418,808 | 2035/7/13 |
| 長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 200,000 | 199,572 | 2030/7/12 |
| 大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付 | 0.69 | 100,000 | 99,996 | 2036/11/28 |
| 日揮ホールディングス 第6回特定社債間限定同順位特約付 | 0.03 | 200,000 | 199,786 | 2023/7/14 |
| 味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付 | 0.19 | 100,000 | 100,280 | 2024/3/8 |
| 日本たばこ産業 第13回 | 0.355 | 100,000 | 100,254 | 2028/9/8 |
| 三越伊勢丹ホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付 | 0.41 | 100,000 | 98,833 | 2027/8/31 |
| トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付 | 0.714 | 100,000 | 101,297 | 2023/9/20 |
| 森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付 | 0.34 | 200,000 | 197,676 | 2026/8/28 |
| 森ビル 第23回社債間限定同順位特約付 | 0.97 | 100,000 | 98,811 | 2038/5/17 |
| セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.06 | 100,000 | 100,034 | 2023/12/20 |
| セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 200,000 | 200,736 | 2027/12/20 |
| 東レ 第30回社債間限定同順位特約付 | 0.375 | 100,000 | 100,153 | 2027/7/16 |
| 東レ 第33回社債間限定同順位特約付 | 0.38 | 100,000 | 99,822 | 2028/7/18 |
| 日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付 | 0.734 | 200,000 | 198,262 | 2028/10/25 |
| 王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付 | 0.425 | 100,000 | 100,737 | 2028/1/26 |
| 住友化学 第56回社債間限定同順位特約付 | 0.38 | 100,000 | 100,039 | 2027/9/13 |
| 三井化学 第48回社債間限定同順位特約付 | 0.39 | 100,000 | 99,821 | 2028/6/19 |
| 三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 100,000 | 99,469 | 2029/5/30 |
| 三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付 | 0.83 | 100,000 | 99,456 | 2040/6/11 |
| 電通 第3回社債間限定同順位特約付 | 0.424 | 100,000 | 100,095 | 2028/10/25 |
| ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付 | 0.23 | 100,000 | 100,084 | 2024/5/31 |
| オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付 | 0.15 | 100,000 | 100,091 | 2025/9/17 |
| ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付 | 0.35 | 100,000 | 99,282 | 2024/12/6 |
| ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.37 | 100,000 | 98,781 | 2026/7/31 |
| 楽天 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.45 | 100,000 | 97,389 | 2029/6/25 |
| ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付 | 0.295 | 100,000 | 100,222 | 2027/4/21 |
| 新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付 | 0.385 | 300,000 | 298,416 | 2028/6/20 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位特約付 | 0.26 | 100,000 | 99,315 | 2026/5/27 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付 | 0.25 | 100,000 | 100,045 | 2025/7/14 |
| 住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付 | 0.3 | 200,000 | 199,624 | 2027/3/1 |
| LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付 | 0.01 | 300,000 | 299,679 | 2023/7/18 |
| 荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付 | 0.19 | 100,000 | 99,889 | 2025/10/22 |
| 日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付 | 1.371 | 200,000 | 215,658 | 2028/12/13 |
| 日本電気 第48回社債間限定同順位特約付 | 0.658 | 100,000 | 100,673 | 2022/7/15 |
| パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 200,000 | 202,196 | 2026/9/18 |
| パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付 | 0.08 | 100,000 | 100,006 | 2023/12/22 |
| パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付 | 0.19 | 100,000 | 100,048 | 2025/12/24 |
| ソニー 第32回 | 0.28 | 100,000 | 100,383 | 2023/9/20 |
| 東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付 | 0.34 | 100,000 | 99,379 | 2027/6/7 |

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | |
|-----------------------|-------------------|-------|---------|--------------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 償還年月日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | % | 千円 | 千円 |
| 三菱重工業 | 第35回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 100,000 | 99,936 2027/8/27 |
| J A 三井リース | 第8回社債間限定同順位特約付 | 0.31 | 100,000 | 100,468 2024/9/13 |
| 三井住友トラスト・バナソニックファイナンス | 第2回社債間限定 | 0.25 | 100,000 | 100,181 2022/10/31 |
| トヨタ自動車 | 第14回社債間限定同等特約付 | 0.963 | 100,000 | 101,806 2023/3/20 |
| 楽天カード | 第3回社債間限定同順位特約付 | 0.42 | 100,000 | 99,299 2026/12/11 |
| ドンキホーテホールディングス | 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.39 | 100,000 | 100,493 2024/3/21 |
| ニコン | 第22回特定社債間限定同順位特約付 | 0.15 | 100,000 | 99,816 2025/12/2 |
| 豊田通商 | 第18回社債間限定同順位特約付 | 1.014 | 100,000 | 103,826 2025/12/5 |
| 豊田通商 | 第19回社債間限定同順位特約付 | 0.954 | 200,000 | 207,542 2026/7/10 |
| 三井物産 | 第71回社債間限定同順位特約付 | 1.187 | 100,000 | 107,172 2029/7/13 |
| 住友商事 | 第49回社債間限定同順位特約付 | 1.286 | 100,000 | 106,882 2029/1/29 |
| 住友商事 | 第53回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 100,000 | 100,165 2027/7/26 |
| 丸井グループ | 第28回社債間限定同順位特約付 | 0.543 | 200,000 | 200,908 2022/6/3 |
| クレディセゾン | 第50回社債間限定同順位特約付 | 0.904 | 100,000 | 102,385 2024/4/24 |
| クレディセゾン | 第65回社債間限定同順位特約付 | 0.38 | 100,000 | 100,476 2027/7/30 |
| イオン | 第20回社債間限定同順位特約付 | 0.82 | 100,000 | 102,086 2024/6/28 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 第1回劣後特約付 | 0.94 | 100,000 | 101,715 2024/6/26 |
| りそなホールディングス | 第20回社債間限定同順位特約付 | 0.27 | 100,000 | 100,152 2025/7/23 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 第2回劣後特約付 | 0.915 | 200,000 | 203,280 2025/6/5 |
| みずほコーポレート銀行 | 第8回特定社債間限定同順位特約付 | 2.54 | 100,000 | 114,270 2027/7/27 |
| 東京三菱銀行 | 第57回特定社債間限定同順位特約付 | 2.22 | 100,000 | 103,384 2022/10/27 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 第1回劣後特約付 | 0.849 | 300,000 | 304,341 2024/9/12 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 第3回劣後特約付 | 0.884 | 100,000 | 101,714 2025/5/29 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 第4回劣後特約付 | 1.328 | 100,000 | 105,283 2030/5/29 |
| 三井住友信託銀行 | 第1回劣後特約付 | 1.389 | 300,000 | 305,148 2022/9/20 |
| 三井住友信託銀行 | 第18回社債間限定同順位特約付 | 0.16 | 200,000 | 199,954 2026/1/27 |
| セブン銀行 | 第10回社債間限定同順位特約付 | 0.803 | 100,000 | 101,380 2023/3/20 |
| セブン銀行 | 第11回社債間限定同順位特約付 | 0.536 | 100,000 | 101,415 2024/12/20 |
| セブン銀行 | 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.39 | 300,000 | 303,276 2027/9/17 |
| みずほフィナンシャルグループ | 第1回劣後特約付 | 0.95 | 200,000 | 202,958 2024/7/16 |
| みずほ銀行 | 第7回劣後特約付 | 2.87 | 100,000 | 112,571 2026/11/6 |
| 芙蓉総合リース | 第26回社債間限定同順位特約付 | 0.03 | 200,000 | 199,378 2023/10/20 |
| みずほリース | 第3回社債間限定同順位特約付 | 0.24 | 300,000 | 300,645 2025/7/15 |
| みずほリース | 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 200,000 | 199,872 2028/1/20 |
| NTTファイナンス | 第2回社債間限定同順位特約付 | 0.26 | 100,000 | 100,471 2026/12/18 |
| NTTファイナンス | 第18回日本電信電話保証付 | 0.38 | 200,000 | 201,210 2030/9/20 |
| トヨタファイナンス | 第81回社債間限定同順位特約付 | 0.265 | 100,000 | 99,806 2027/10/22 |
| リコーリース | 第28回社債間限定同順位特約付 | 0.345 | 100,000 | 99,948 2027/7/20 |
| アコム | 第77回特定社債間限定同順位特約付 | 0.274 | 100,000 | 100,017 2023/8/30 |
| ジャックス | 第19回社債間限定同順位特約付 | 0.25 | 100,000 | 100,205 2023/6/15 |
| 日立キャピタル | 第61回社債間限定同順位特約付 | 0.31 | 100,000 | 100,513 2026/6/19 |
| 日立キャピタル | 第80回社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 100,000 | 99,025 2029/10/19 |
| 三井住友ファイナンス&リース | 第27回社債間限定同順位特約付 | 0.22 | 100,000 | 99,965 2026/10/16 |
| 三菱UFJリース | 第52回社債間限定同順位特約付 | 0.375 | 100,000 | 100,597 2027/7/13 |
| 三菱UFJリース | 第56回社債間限定同順位特約付 | 0.455 | 100,000 | 101,137 2028/1/18 |
| 三菱UFJリース | 第76回社債間限定同順位特約付 | 0.37 | 300,000 | 299,280 2030/1/23 |
| 大和証券グループ本社 | 第23回社債間限定同順位特約付 | 0.909 | 100,000 | 102,100 2025/8/12 |
| 三井不動産 | 第71回社債間限定同順位特約付 | 0.31 | 200,000 | 197,246 2030/4/16 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|----------------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無 | 0.24 | 100,000 | 99,706 | 2027/6/18 |
| 東京建物 第25回社債間限定同順位特約付 | 0.52 | 100,000 | 100,334 | 2027/3/19 |
| ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付 | 0.96 | 100,000 | 96,424 | 2039/7/19 |
| 住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付 | 0.987 | 100,000 | 102,289 | 2024/1/26 |
| 日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位 | 1.168 | 100,000 | 102,005 | 2023/6/26 |
| 野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限 | 2.9 | 100,000 | 115,181 | 2028/3/17 |
| 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債 | 0.871 | 100,000 | 101,695 | 2024/8/30 |
| 東武鉄道 第124回社債間限定同順位特約付 | 0.001 | 100,000 | 99,704 | 2023/11/27 |
| 相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付 | 0.58 | 200,000 | 202,782 | 2025/1/28 |
| 東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付 | 1.307 | 100,000 | 109,243 | 2033/6/3 |
| 東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付 | 0.459 | 200,000 | 202,214 | 2031/4/22 |
| 小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付 | 1.098 | 200,000 | 214,224 | 2030/6/12 |
| 小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付 | 0.756 | 100,000 | 101,619 | 2037/5/29 |
| 東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付 | 2.376 | 200,000 | 232,586 | 2028/12/12 |
| 東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付 | 1.905 | 100,000 | 115,196 | 2030/9/27 |
| 東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付 | 0.981 | 100,000 | 106,415 | 2035/1/29 |
| 東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付 | 1.415 | 100,000 | 113,425 | 2045/1/27 |
| 東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付 | 1.246 | 100,000 | 108,180 | 2058/9/27 |
| 東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付 | 0.771 | 200,000 | 186,832 | 2059/12/23 |
| 西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付 | 2.34 | 100,000 | 112,689 | 2027/2/19 |
| 西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付 | 2.26 | 300,000 | 341,229 | 2027/12/20 |
| 西日本旅客鉄道 第65回社債間限定同順位特約付 | 0.24 | 200,000 | 199,630 | 2030/8/27 |
| 西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付 | 0.629 | 200,000 | 200,138 | 2040/8/27 |
| 東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付 | 2.21 | 200,000 | 214,864 | 2024/9/20 |
| 東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付 | 2.212 | 200,000 | 234,580 | 2030/4/23 |
| 東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付 | 1.309 | 100,000 | 110,048 | 2032/9/30 |
| 東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付 | 1.014 | 300,000 | 320,313 | 2035/1/26 |
| 東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付 | 1.685 | 100,000 | 118,970 | 2045/3/6 |
| 東京地下鉄 第22回 | 0.215 | 100,000 | 100,246 | 2027/6/21 |
| 東京地下鉄 第23回 | 0.661 | 100,000 | 101,343 | 2037/6/19 |
| 東京地下鉄 第24回 | 1.035 | 100,000 | 104,952 | 2047/6/21 |
| 西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付 | 0.758 | 200,000 | 199,832 | 2032/3/17 |
| 西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付 | 0.717 | 100,000 | 102,733 | 2031/3/4 |
| 阪急阪神ホールディングス 第47回 | 1.202 | 400,000 | 429,672 | 2029/7/18 |
| 阪急阪神ホールディングス 第49回 | 0.817 | 100,000 | 102,600 | 2036/12/15 |
| 名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付 | 0.857 | 100,000 | 103,558 | 2027/4/30 |
| 日本通運 第11回社債間限定同順位特約付 | 0.2 | 100,000 | 99,683 | 2026/7/14 |
| 日本通運 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.7 | 100,000 | 99,040 | 2036/7/14 |
| 日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付 | 2.13 | 100,000 | 105,775 | 2031/9/9 |
| 横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付 | 0.455 | 100,000 | 100,535 | 2027/2/23 |
| 九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付 | 0.929 | 200,000 | 200,880 | 2049/3/5 |
| 九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付 | 0.51 | 100,000 | 96,896 | 2039/12/9 |
| A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付 | 0.99 | 100,000 | 91,129 | 2036/6/9 |
| 澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付 | 0.22 | 100,000 | 99,462 | 2023/6/14 |
| K D D I 第20回社債間限定同順位特約付 | 0.803 | 100,000 | 101,805 | 2023/12/20 |
| K D D I 第25回社債間限定同順位特約付 | 0.395 | 100,000 | 99,991 | 2028/11/22 |
| 電源開発 第39回社債間限定同順位特約付 | 0.929 | 100,000 | 102,486 | 2024/2/20 |
| 電源開発 第40回社債間限定同順位特約付 | 0.889 | 100,000 | 102,622 | 2024/6/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 電源開発 第41回社債間限定同順位特約付 | 0.782 | 100,000 | 102,361 | 2024/8/20 |
| 電源開発 第50回社債間限定同順位特約付 | 0.415 | 100,000 | 101,097 | 2027/7/20 |
| 電源開発 第59回社債間限定同順位特約付 | 0.414 | 100,000 | 100,827 | 2028/9/20 |
| 東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付 | 1.984 | 100,000 | 124,669 | 2043/12/17 |
| 東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 100,000 | 94,282 | 2039/9/13 |
| 大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付 | 0.642 | 100,000 | 94,603 | 2049/6/4 |
| 北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付 | 0.25 | 100,000 | 100,344 | 2024/3/14 |
| 北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付 | 0.51 | 100,000 | 98,068 | 2034/12/12 |
| 広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.405 | 100,000 | 100,357 | 2028/9/13 |
| 東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付 | 0.18 | 100,000 | 99,895 | 2023/7/5 |
| ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付 | 0.405 | 100,000 | 101,056 | 2028/6/6 |
| ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付 | 1.569 | 100,000 | 100,924 | 2024/6/12 |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第29回円貨社債 | 0.25 | 200,000 | 199,406 | 2024/10/10 |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第31回円貨社債 | 0.423 | 100,000 | 98,904 | 2029/10/10 |
| ビー・ビー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債 | 0.45 | 100,000 | 100,186 | 2026/6/17 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014) | 0.865 | 100,000 | 102,127 | 2024/11/28 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債(2018) | 0.204 | 100,000 | 99,739 | 2023/6/8 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債(2018) | 0.509 | 100,000 | 99,453 | 2028/6/8 |
| スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015) | 1.043 | 100,000 | 100,595 | 2025/6/5 |
| エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円 | 0.842 | 100,000 | 100,728 | 2023/9/26 |
| エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円 | 1.207 | 100,000 | 100,978 | 2026/9/25 |
| ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第6回円貨社債 | 0.65 | 100,000 | 100,381 | 2023/5/30 |
| ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第7回円貨社債 | 0.968 | 100,000 | 99,262 | 2028/5/30 |
| サンタンデール銀行 第1回円貨社債 | 0.568 | 100,000 | 99,990 | 2023/1/11 |
| フランス電力 第4回円貨社債(2017) | 1.088 | 100,000 | 102,314 | 2027/1/26 |
| 現代キャピタル・サービス・インク 第15回円貨社債 | 0.65 | 200,000 | 196,070 | 2023/8/2 |
| ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債(2017) | 0.967 | 100,000 | 100,823 | 2024/3/1 |
| ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社 | 0.32 | 200,000 | 199,848 | 2023/7/6 |
| オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債 | 0.293 | 200,000 | 200,264 | 2024/1/23 |
| ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債(2017) | 0.448 | 100,000 | 99,983 | 2022/5/26 |
| 小 計 | | 27,305,000 | 27,858,685 | |
| 合 計 | | 688,944,026 | 732,440,992 | |

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年3月31日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 732,440,992 | % 98.8 |
| コール・ローン等、その他 | 9,002,388 | 1.2 |
| 投資信託財産総額 | 741,443,380 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月31日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 741,443,380,268 |
| コール・ローン等 | 6,658,847,151 |
| 公社債(評価額) | 732,440,992,596 |
| 未収入金 | 1,527,665,360 |
| 未収利息 | 798,689,638 |
| 前払費用 | 17,185,523 |
| (B) 負債 | 5,613,526,512 |
| 未払金 | 5,020,835,000 |
| 未払解約金 | 592,685,149 |
| 未払利息 | 6,363 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 735,829,853,756 |
| 元本 | 555,429,500,070 |
| 次期繰越損益金 | 180,400,353,686 |
| (D) 受益権総口数 | 555,429,500,070口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,248円 |

(注) 期首元本額は509,213,794,132円、期中追加設定元本額は109,094,889,019円、期中一部解約元本額は62,879,183,081円、1口当たり純資産額は1.3248円です。

○損益の状況 (2020年4月1日～2021年3月31日)

| 項目 | 当期 |
|----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 5,636,811,966 |
| 受取利息 | 5,639,165,376 |
| 支払利息 | △ 2,353,410 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 10,484,385,273 |
| 売買益 | 397,903,581 |
| 売買損 | △ 10,882,288,854 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 4,847,573,307 |
| (D) 前期繰越損益金 | 170,101,972,795 |
| (E) 追加信託差損益金 | 35,853,917,336 |
| (F) 解約差損益金 | △ 20,707,963,138 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 180,400,353,686 |
| 次期繰越損益金(G) | 180,400,353,686 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

* 損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 |
|---|-----------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け) | 160,072,020,061 |
| 野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け) | 50,684,248,245 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 48,012,057,740 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 41,279,288,281 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 36,957,694,659 |
| マイ・ロード | 33,474,705,153 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 18,180,099,308 |
| 野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け) | 18,055,531,807 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 17,613,590,187 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型 | 16,865,747,649 |
| 野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合 | 13,072,423,854 |
| マイバランスDC30 | 13,048,928,547 |
| のむらっぴ・ファンド(保守型) | 13,035,131,169 |
| マイバランスDC50 | 10,536,432,250 |
| 野村日本債券インデックス(野村SMA向け) | 10,440,101,077 |
| のむらっぴ・ファンド(普通型) | 10,396,404,692 |
| NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信 | 5,996,645,094 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 3,630,888,862 |
| マイバランスDC70 | 3,483,226,048 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 3,101,234,791 |
| 野村6資産均等バランス | 2,647,040,693 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 2,341,271,307 |

| ファンド名 | 当期末 |
|------------------------------------|---------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村インデックスファンド・国内債券 | 2,336,235,916 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 1,889,625,001 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 1,585,821,345 |
| のむらっぴ・ファンド(積極型) | 1,445,869,703 |
| 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) | 1,352,621,530 |
| 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 | 1,303,446,491 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 1,066,154,772 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 963,345,785 |
| 野村日本債券インデックスファンド | 892,862,563 |
| のむらっぴ・ファンド(やや保守型) | 890,461,251 |
| 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) | 883,874,195 |
| 野村円債投資インデックスファンド | 870,238,879 |
| ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 690,877,988 |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け) | 677,187,339 |
| 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) | 570,588,956 |
| 野村国内債券インデックスファンド | 412,178,214 |
| 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) | 369,436,143 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 349,341,186 |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け) | 349,283,317 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 347,706,914 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 326,485,501 |
| 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) | 324,043,679 |

| ファンド名 | 当期末 |
|-------------------------------------|-------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券 (適格機関投資家専用) | 313,430,101 |
| のむらっぴ・ファンド (やや積極型) | 293,178,353 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 257,830,546 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 187,640,575 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 177,555,444 |
| マイターゲート2060 (確定拠出年金向け) | 154,432,605 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 150,612,897 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 135,243,787 |
| マイターゲート2055 (確定拠出年金向け) | 122,979,708 |
| 世界6資産分散ファンド | 118,151,164 |
| 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) | 87,956,063 |
| 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) | 82,252,473 |
| インデックス・ブレンド (タイプⅢ) | 75,337,676 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用) | 68,486,483 |
| インデックス・ブレンド (タイプⅠ) | 48,855,898 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2030 | 44,498,366 |
| インデックス・ブレンド (タイプⅡ) | 28,563,778 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 26,270,204 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 24,962,651 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 24,925,840 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 21,680,129 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 18,534,637 |
| 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) | 18,435,781 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2040 | 17,498,696 |
| インデックス・ブレンド (タイプⅣ) | 14,641,420 |
| マイターゲート2065 (確定拠出年金向け) | 14,051,378 |
| 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) | 13,844,948 |
| インデックス・ブレンド (タイプⅤ) | 12,579,673 |
| 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) | 10,912,684 |
| 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) | 10,272,001 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 7,884,577 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2050 | 7,173,206 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 6,735,994 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 3,747,903 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてN I S A) 2060 | 2,996,018 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 2,261,041 |
| 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) | 498,750 |
| 多資産分散投資ファンド (バランス10) (確定拠出年金向け) | 188,480 |

〇お知らせ

該当事項はございません。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日2021年5月10日）

作成対象期間（2020年5月12日～2021年5月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 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います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主な投資対象 | 外国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-----|--------|-----|-------|--------|---------|
| | 円 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| 16期(2017年5月10日) | 22,009 | 1.3 | 223.71 | 1.6 | 99.0 | — | 664,754 |
| 17期(2018年5月10日) | 22,325 | 1.4 | 226.02 | 1.0 | 99.0 | — | 616,573 |
| 18期(2019年5月10日) | 22,598 | 1.2 | 228.62 | 1.1 | 99.0 | — | 605,827 |
| 19期(2020年5月11日) | 23,625 | 4.5 | 238.73 | 4.4 | 98.9 | — | 564,663 |
| 20期(2021年5月10日) | 25,182 | 6.6 | 254.51 | 6.6 | 99.0 | — | 577,343 |

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマーク（＝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、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。
 *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。
 (出所) FTSE Fixed Income LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

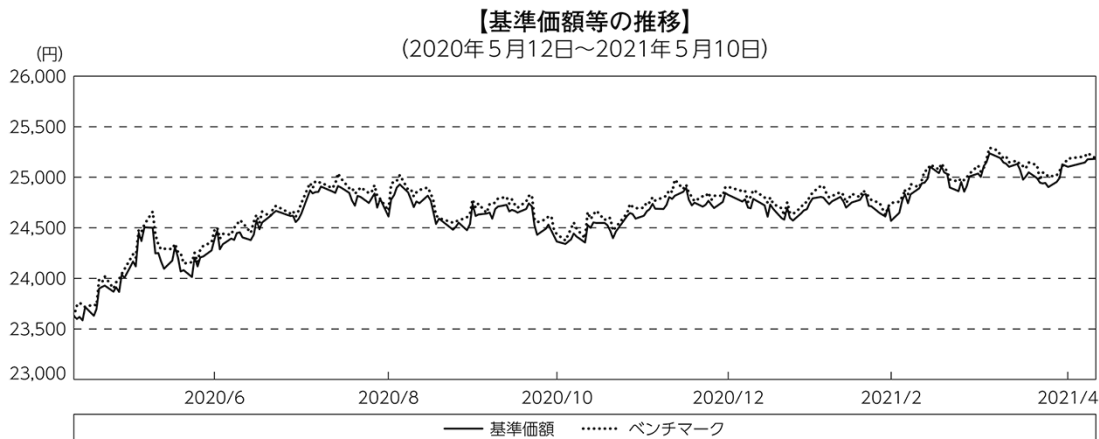
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|-----|--------|-----|-------|--------|
| | 円 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | |
| (期首) 2020年5月11日 | 23,625 | — | 238.73 | — | 98.9 | — |
| 5月末 | 24,005 | 1.6 | 243.42 | 2.0 | 99.1 | — |
| 6月末 | 24,391 | 3.2 | 247.35 | 3.6 | 99.0 | — |
| 7月末 | 24,640 | 4.3 | 250.04 | 4.7 | 98.9 | — |
| 8月末 | 24,613 | 4.2 | 249.29 | 4.4 | 99.0 | — |
| 9月末 | 24,733 | 4.7 | 250.42 | 4.9 | 98.7 | — |
| 10月末 | 24,365 | 3.1 | 246.96 | 3.4 | 98.9 | — |
| 11月末 | 24,620 | 4.2 | 249.57 | 4.5 | 99.1 | — |
| 12月末 | 24,827 | 5.1 | 251.66 | 5.4 | 99.0 | — |
| 2021年1月末 | 24,792 | 4.9 | 251.09 | 5.2 | 98.8 | — |
| 2月末 | 24,570 | 4.0 | 250.05 | 4.7 | 99.1 | — |
| 3月末 | 25,111 | 6.3 | 253.57 | 6.2 | 99.0 | — |
| 4月末 | 25,102 | 6.3 | 254.49 | 6.6 | 98.9 | — |
| (期末) 2021年5月10日 | 25,182 | 6.6 | 254.51 | 6.6 | 99.0 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが米国を中心に上昇（価格は下落）したことはマイナスに影響しましたが、主要通貨が対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

○投資環境

当運用期間では、米国の追加経済対策に伴う国債増発懸念や新型コロナウイルスのワクチン普及による景気回復期待などを背景に、外国債券利回りは米国を中心に上昇（価格は下落）しました。

為替市場は、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

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ため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

○当ファンドのベンチマークとの差異

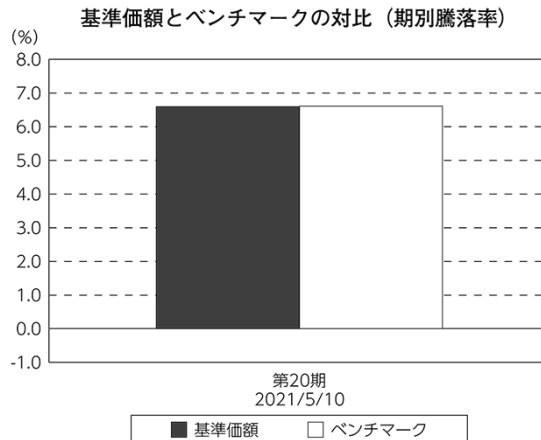
当運用期間の基準価額の騰落率は+6.6%となり、ベンチマークの+6.6%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること



（注）ベンチマークは、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで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運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年5月12日～2021年5月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 | % | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (2) | (0.007) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (そ の 他) | (2) | (0.009) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 4 | 0.016 | |
| 期中の平均基準価額は、24,647円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2020年5月12日～2021年5月10日)

公 社 債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|--------|------|-----------------------|-----------------------|
| 外 | アメリカ | 国債証券 | 千米ドル 755,747 | 千米ドル 727,190 |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダドル 40,503 | 千カナダドル 42,042 |
| | イギリス | 国債証券 | 千英ポンド 47,777 | 千英ポンド 57,711 |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデンクローナ 30,108 | 千スウェーデンクローナ 11,394 |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェークローネ 20,909 | 千ノルウェークローネ 33,964 |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーククローネ 17,819 | 千デンマーククローネ 28,625 |
| 国 | ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ドイツ | 国債証券 | 73,148 | 55,052 |
| | イタリア | 国債証券 | 80,406 | 134,479 |
| | フランス | 国債証券 | 79,129 | 86,885 |
| | オランダ | 国債証券 | 23,173 | 15,459 |
| | スペイン | 国債証券 | 45,772 | 84,929 |

| | | 買付額 | | 売付額 | |
|---|---------|------|--------------------|-----|--------------------|
| 外 | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ベルギー | 国債証券 | 20,291 | | 25,461 |
| | オーストリア | 国債証券 | 10,588 | | 9,497 |
| | フィンランド | 国債証券 | 1,989 | | 502 |
| | アイルランド | 国債証券 | 28,828 | | 15,560 |
| 国 | ポーランド | 国債証券 | 千ズロチ 279,663 | | 千ズロチ 283,094 |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル 5,653 | | 千シンガポールドル 7,430 |
| | マレーシア | 国債証券 | 千リンギ 27,109 | | 千リンギ 23,803 |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千豪ドル 66,000 | | 千豪ドル 67,847 |
| | イスラエル | 国債証券 | 千新シエケル 15,053 | | 千新シエケル 6,617 |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコペソ 209,236 | | 千メキシコペソ 298,993 |

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年5月12日～2021年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

(2021年5月10日現在)

○組入資産の明細

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|-------------|-------------|-------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 2,114,460 | 2,319,241 | 252,263,901 | 43.7 | — | 19.9 | 17.5 | 6.3 |
| | 千カナダドル | 千カナダドル | | | | | | |
| カナダ | 112,940 | 131,371 | 11,788,003 | 2.0 | — | 1.1 | 0.5 | 0.4 |
| | 千英ポンド | 千英ポンド | | | | | | |
| イギリス | 187,300 | 245,691 | 37,504,731 | 6.5 | — | 5.2 | 1.2 | 0.1 |
| | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | | | | | | |
| スウェーデン | 142,900 | 160,294 | 2,099,858 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | | | | | |
| ノルウェー | 108,800 | 113,726 | 1,508,013 | 0.3 | — | 0.1 | 0.1 | — |
| | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | | | | | |
| デンマーク | 131,770 | 165,425 | 2,942,923 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 228,750 | 305,535 | 40,428,481 | 7.0 | — | 4.7 | 2.3 | 0.0 |
| イタリア | 327,760 | 422,562 | 55,913,474 | 9.7 | — | 6.4 | 2.4 | 0.9 |
| フランス | 342,170 | 439,968 | 58,216,657 | 10.1 | — | 6.5 | 2.7 | 0.8 |
| オランダ | 57,700 | 76,236 | 10,087,621 | 1.7 | — | 1.4 | 0.2 | 0.1 |
| スペイン | 216,350 | 283,413 | 37,501,318 | 6.5 | — | 4.5 | 1.5 | 0.5 |
| ベルギー | 80,800 | 104,775 | 13,863,837 | 2.4 | — | 1.9 | 0.5 | 0.0 |
| オーストリア | 49,800 | 62,287 | 8,241,932 | 1.4 | — | 1.2 | 0.3 | 0.0 |
| フィンランド | 18,400 | 20,320 | 2,688,839 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| アイルランド | 52,780 | 59,511 | 7,874,579 | 1.4 | — | 0.8 | 0.3 | 0.3 |
| | 千ズロチ | 千ズロチ | | | | | | |
| ポーランド | 117,600 | 124,821 | 3,626,776 | 0.6 | — | 0.2 | 0.2 | 0.3 |
| | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | | | | | |
| シンガポール | 28,270 | 30,764 | 2,525,149 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| | 千リンギ | 千リンギ | | | | | | |
| マレーシア | 97,080 | 102,943 | 2,730,575 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| | 千豪ドル | 千豪ドル | | | | | | |
| オーストラリア | 133,930 | 150,495 | 12,858,309 | 2.2 | — | 1.6 | 0.5 | 0.2 |
| | 千新シェケル | 千新シェケル | | | | | | |
| イスラエル | 68,700 | 77,862 | 2,605,943 | 0.5 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | | | | |
| メキシコ | 776,400 | 835,537 | 4,564,125 | 0.8 | — | 0.4 | 0.3 | 0.1 |
| 合 計 | — | — | 571,835,057 | 99.0 | — | 57.3 | 31.5 | 10.3 |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | | 償還年月日 |
|------|------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY BOND | 6.25 | 38,800 | 44,136 | 4,800,728 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.375 | 45,100 | 48,061 | 5,227,643 | 2024/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.0 | 62,100 | 77,547 | 8,434,827 | 2026/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.125 | 14,800 | 19,486 | 2,119,522 | 2027/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.5 | 48,600 | 63,016 | 6,854,330 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 48,000 | 61,687 | 6,709,749 | 2028/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 28,200 | 36,417 | 3,961,148 | 2029/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 4.375 | 100 | 134 | 14,643 | 2038/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.875 | 500 | 560 | 60,928 | 2043/5/15 |
| | US TREASURY BOND | 3.75 | 4,100 | 5,246 | 570,702 | 2043/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 16,300 | 16,564 | 1,801,761 | 2022/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 20,000 | 20,352 | 2,213,766 | 2022/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 8,300 | 8,441 | 918,201 | 2022/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 200 | 204 | 22,207 | 2022/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 200 | 203 | 22,169 | 2022/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 900 | 916 | 99,634 | 2022/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 33,400 | 34,014 | 3,699,757 | 2022/6/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 17,700 | 18,113 | 1,970,238 | 2022/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 100 | 101 | 11,084 | 2022/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 200 | 203 | 22,186 | 2022/7/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 100 | 102 | 11,135 | 2022/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,000 | 1,022 | 111,187 | 2022/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 900 | 917 | 99,847 | 2022/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 400 | 407 | 44,296 | 2022/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 32,400 | 33,161 | 3,607,020 | 2022/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 8,200 | 8,365 | 909,961 | 2022/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 100 | 101 | 11,084 | 2022/9/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 900 | 920 | 100,145 | 2022/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,600 | 1,639 | 178,369 | 2022/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 600 | 610 | 66,457 | 2022/10/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 100 | 102 | 11,162 | 2022/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 1,500 | 1,542 | 167,743 | 2022/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 7,100 | 7,265 | 790,246 | 2022/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 100 | 102 | 11,199 | 2022/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 20,000 | 20,660 | 2,247,205 | 2022/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 1,600 | 1,637 | 178,083 | 2023/1/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 50,900 | 52,335 | 5,692,536 | 2023/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 100 | 103 | 11,301 | 2023/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 400 | 413 | 44,957 | 2023/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 64,800 | 66,417 | 7,224,227 | 2023/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 17,900 | 18,707 | 2,034,825 | 2023/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 400 | 410 | 44,636 | 2023/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 100 | 104 | 11,365 | 2023/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 15,000 | 15,437 | 1,679,157 | 2023/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 400 | 420 | 45,741 | 2023/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 40,500 | 41,806 | 4,547,320 | 2023/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 9,200 | 9,476 | 1,030,704 | 2023/5/31 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,100 | 9,585 | 1,042,583 | 2023/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 800 | 820 | 89,238 | 2023/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 100 | 105 | 11,448 | 2023/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 4,300 | 4,401 | 478,764 | 2023/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 37,100 | 39,212 | 4,265,193 | 2023/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 6,500 | 6,841 | 744,150 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 10,900 | 11,198 | 1,218,011 | 2023/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 1,000 | 1,059 | 115,198 | 2023/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 35,200 | 36,190 | 3,936,386 | 2023/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,000 | 1,063 | 115,712 | 2023/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 10,600 | 10,971 | 1,193,315 | 2023/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,000 | 1,065 | 115,933 | 2023/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 42,600 | 45,305 | 4,927,908 | 2023/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 9,200 | 9,645 | 1,049,115 | 2023/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 29,300 | 31,280 | 3,402,329 | 2023/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 43,000 | 45,275 | 4,924,667 | 2023/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 800 | 850 | 92,488 | 2023/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 4,300 | 4,533 | 493,106 | 2024/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 1,300 | 1,379 | 150,089 | 2024/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 800 | 855 | 93,032 | 2024/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 500 | 526 | 57,235 | 2024/2/29 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 400 | 423 | 46,081 | 2024/2/29 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 1,700 | 1,789 | 194,688 | 2024/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 500 | 525 | 57,112 | 2024/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 700 | 740 | 80,537 | 2024/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 20,900 | 22,286 | 2,424,076 | 2024/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 2,200 | 2,313 | 251,604 | 2024/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 17,700 | 18,629 | 2,026,378 | 2024/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 500 | 522 | 56,783 | 2024/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 3,800 | 4,018 | 437,059 | 2024/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 300 | 314 | 34,242 | 2024/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 42,700 | 45,211 | 4,917,704 | 2024/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 2,400 | 2,552 | 277,598 | 2024/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 500 | 518 | 56,396 | 2024/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 34,200 | 36,378 | 3,956,934 | 2024/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 2,300 | 2,437 | 265,073 | 2024/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,900 | 2,024 | 220,217 | 2024/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 1,000 | 1,074 | 116,893 | 2025/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 18,100 | 19,120 | 2,079,785 | 2025/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 1,900 | 2,062 | 224,310 | 2025/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 17,300 | 17,707 | 1,926,044 | 2025/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 32,700 | 35,363 | 3,846,461 | 2025/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 34,500 | 37,703 | 4,100,996 | 2025/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 8,050 | 8,559 | 930,973 | 2025/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,000 | 1,093 | 118,928 | 2025/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 4,100 | 4,465 | 485,675 | 2025/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 5,200 | 5,697 | 619,734 | 2025/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 27,000 | 28,597 | 3,110,588 | 2025/8/15 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | | | |
|------|-----------------|-------|--------|---------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.75 | 700 | 763 | 83,048 | 2025/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 29,200 | 32,210 | 3,503,493 | 2025/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 100 | 110 | 12,003 | 2025/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 50,600 | 54,193 | 5,894,614 | 2025/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 10,000 | 10,992 | 1,195,705 | 2025/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 10,000 | 10,883 | 1,183,850 | 2025/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 17,200 | 18,728 | 2,037,100 | 2026/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 2,000 | 2,083 | 226,649 | 2026/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 1,000 | 1,083 | 117,841 | 2026/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 5,000 | 5,360 | 583,109 | 2026/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 8,600 | 9,277 | 1,009,159 | 2026/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 1,800 | 1,874 | 203,938 | 2026/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 300 | 319 | 34,803 | 2026/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 3,000 | 3,161 | 343,836 | 2026/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 21,100 | 21,804 | 2,371,697 | 2026/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 12,000 | 12,320 | 1,340,114 | 2026/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 10,000 | 10,394 | 1,130,655 | 2026/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 5,600 | 5,814 | 632,477 | 2026/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 13,000 | 13,765 | 1,497,303 | 2026/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 30,000 | 31,142 | 3,387,378 | 2026/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 100 | 104 | 11,365 | 2026/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 200 | 206 | 22,410 | 2027/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 11,300 | 12,116 | 1,317,874 | 2027/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 1,400 | 1,411 | 153,527 | 2027/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 0.5 | 17,000 | 16,476 | 1,792,172 | 2027/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 38,000 | 41,013 | 4,461,014 | 2027/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 8,700 | 9,321 | 1,013,907 | 2027/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,000 | 1,070 | 116,460 | 2027/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 25,500 | 28,102 | 3,056,740 | 2028/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 40,600 | 45,107 | 4,906,313 | 2028/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 9,900 | 11,007 | 1,197,292 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 1,200 | 1,356 | 147,558 | 2028/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 500 | 547 | 59,526 | 2029/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 1,100 | 1,183 | 128,713 | 2029/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 300 | 305 | 33,184 | 2029/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 2,100 | 2,153 | 234,288 | 2029/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 1,700 | 1,702 | 185,212 | 2030/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 6.25 | 13,000 | 18,305 | 1,991,102 | 2030/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 16,600 | 15,351 | 1,669,740 | 2030/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 600 | 563 | 61,328 | 2030/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 5.375 | 75,400 | 101,925 | 11,086,434 | 2031/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 1,000 | 959 | 104,334 | 2031/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 16,300 | 21,900 | 2,382,125 | 2036/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 5.0 | 6,200 | 8,849 | 962,563 | 2037/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 100 | 136 | 14,861 | 2038/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 100 | 122 | 13,298 | 2039/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 100 | 133 | 14,556 | 2039/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 100 | 138 | 15,011 | 2039/8/15 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | |
|------|------|---------------------|--------|--------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 国債証券 | US TREASURY N/B | 100 | 136 | 14,813 | 2039/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 140 | 15,288 | 2040/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 136 | 14,870 | 2040/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 128 | 13,994 | 2040/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 134 | 14,680 | 2040/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 300 | 430 | 46,858 | 2041/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 137 | 14,959 | 2041/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 127 | 13,825 | 2041/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 116 | 12,666 | 2041/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 116 | 12,688 | 2042/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 114 | 12,439 | 2042/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 200 | 219 | 23,915 | 2042/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 109 | 11,945 | 2042/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 290 | 337 | 36,747 | 2043/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 125 | 13,660 | 2043/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4,300 | 5,410 | 588,493 | 2044/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 15,200 | 18,422 | 2,003,791 | 2044/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 25,000 | 29,142 | 3,169,838 | 2044/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 35,100 | 40,092 | 4,360,823 | 2044/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 39,900 | 41,821 | 4,548,951 | 2045/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 23,400 | 26,746 | 2,909,204 | 2045/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 17,500 | 19,591 | 2,130,999 | 2045/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3,700 | 4,236 | 460,851 | 2045/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 51,500 | 53,916 | 5,864,451 | 2046/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 28,200 | 29,524 | 3,211,333 | 2046/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 34,500 | 34,423 | 3,744,209 | 2046/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 14,200 | 15,926 | 1,732,351 | 2046/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2,000 | 2,295 | 249,678 | 2047/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1,700 | 1,951 | 212,305 | 2047/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 11,400 | 12,514 | 1,361,214 | 2047/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 9,300 | 10,216 | 1,111,254 | 2047/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 9,500 | 10,930 | 1,188,877 | 2048/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 5,100 | 6,004 | 653,104 | 2048/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 10,500 | 12,098 | 1,315,940 | 2048/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 6,100 | 7,520 | 818,019 | 2048/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2,470 | 2,850 | 310,063 | 2049/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 100 | 112 | 12,265 | 2049/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 11,250 | 11,199 | 1,218,117 | 2049/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 300 | 306 | 33,390 | 2049/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1,000 | 942 | 102,494 | 2050/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2,200 | 1,716 | 186,677 | 2050/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 9,100 | 7,330 | 797,297 | 2050/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 6,900 | 5,929 | 645,001 | 2050/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 12,900 | 11,785 | 1,281,893 | 2051/2/15 |
| 小 | 計 | | | | 252,263,901 | |
| カナダ | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| | 国債証券 | CANADA GOVERNMENT | 14,350 | 14,740 | 1,322,692 | 2022/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 200 | 202 | 18,176 | 2022/5/1 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|------|---------------------|-------|--------|--------|------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| カナダ | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | 千円 | |
| 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 0.25 | 300 | 300 | 26,934 | 2022/8/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0 | 12,000 | 12,124 | 1,087,967 | 2022/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 1,300 | 1,334 | 119,783 | 2023/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 4,460 | 4,571 | 410,156 | 2023/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 1,100 | 1,141 | 102,467 | 2023/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 500 | 525 | 47,158 | 2024/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5 | 6,800 | 7,217 | 647,650 | 2024/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 17,000 | 17,406 | 1,561,848 | 2025/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 3,700 | 3,935 | 353,143 | 2025/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 300 | 309 | 27,726 | 2026/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0 | 1,400 | 1,401 | 125,776 | 2026/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 8.0 | 6,700 | 9,425 | 845,778 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0 | 200 | 199 | 17,898 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 800 | 844 | 75,793 | 2028/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 11,380 | 15,252 | 1,368,649 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 1,000 | 1,074 | 96,386 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 10,200 | 14,695 | 1,318,669 | 2033/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0 | 2,600 | 3,763 | 337,686 | 2037/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0 | 3,400 | 4,586 | 411,576 | 2041/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 9,950 | 12,837 | 1,151,925 | 2045/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,300 | 1,493 | 134,005 | 2048/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 1,900 | 1,867 | 167,557 | 2051/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 100 | 118 | 10,590 | 2064/12/1 |
| 小計 | | | | | 11,788,003 | |
| イギリス | | | 千英ポンド | 千英ポンド | | |
| 国債証券 | UK TREASURY | 1.75 | 500 | 511 | 78,090 | 2022/9/7 |
| | UK TREASURY | 0.125 | 3,000 | 3,005 | 458,772 | 2023/1/31 |
| | UK TREASURY | 0.75 | 16,700 | 16,970 | 2,590,539 | 2023/7/22 |
| | UK TREASURY | 2.25 | 2,300 | 2,419 | 369,289 | 2023/9/7 |
| | UK TREASURY | 1.0 | 1,600 | 1,642 | 250,803 | 2024/4/22 |
| | UK TREASURY | 2.75 | 7,450 | 8,102 | 1,236,860 | 2024/9/7 |
| | UK TREASURY | 5.0 | 14,750 | 17,470 | 2,666,912 | 2025/3/7 |
| | UK TREASURY | 0.625 | 200 | 203 | 31,072 | 2025/6/7 |
| | UK TREASURY | 2.0 | 200 | 215 | 32,897 | 2025/9/7 |
| | UK TREASURY | 1.5 | 510 | 540 | 82,532 | 2026/7/22 |
| | UK TREASURY | 1.25 | 400 | 419 | 64,045 | 2027/7/22 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 12,730 | 15,846 | 2,418,993 | 2027/12/7 |
| | UK TREASURY | 1.625 | 200 | 215 | 32,891 | 2028/10/22 |
| | UK TREASURY | 6.0 | 4,800 | 6,717 | 1,025,442 | 2028/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 7,700 | 10,527 | 1,607,091 | 2030/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 7,500 | 10,146 | 1,548,834 | 2032/6/7 |
| | UK TREASURY | 4.5 | 12,300 | 17,623 | 2,690,236 | 2034/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 750 | 1,073 | 163,940 | 2036/3/7 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 100 | 157 | 24,008 | 2038/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 600 | 903 | 137,889 | 2039/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 500 | 763 | 116,604 | 2040/12/7 |
| | UK TREASURY | 4.5 | 570 | 919 | 140,344 | 2042/12/7 |
| | UK TREASURY | 3.5 | 18,440 | 26,794 | 4,090,112 | 2045/1/22 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | | |
|--------|---------------------------|-----------------|-------------|-------------|------------|------------|-----------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| イギリス | | % | 千英ポンド | 千英ポンド | 千円 | | |
| 国債証券 | UK TREASURY | 4.25 | 5,900 | 9,691 | 1,479,338 | 2046/12/7 | |
| | UK TREASURY | 1.5 | 8,200 | 8,555 | 1,306,034 | 2047/7/22 | |
| | UK TREASURY | 1.75 | 16,100 | 17,788 | 2,715,375 | 2049/1/22 | |
| | UK TREASURY | 4.25 | 5,350 | 9,137 | 1,394,901 | 2049/12/7 | |
| | UK TREASURY | 3.75 | 6,750 | 11,029 | 1,683,611 | 2052/7/22 | |
| | UK TREASURY | 1.625 | 1,000 | 1,092 | 166,736 | 2054/10/22 | |
| | UK TREASURY | 1.75 | 700 | 803 | 122,595 | 2057/7/22 | |
| | UK TREASURY | 4.0 | 1,200 | 2,233 | 340,880 | 2060/1/22 | |
| | UK TREASURY | 2.5 | 100 | 145 | 22,139 | 2065/7/22 | |
| | UK TREASURY | 3.5 | 200 | 369 | 56,398 | 2068/7/22 | |
| | UK TSY 3 1/4% 2044 | 3.25 | 21,800 | 30,249 | 4,617,580 | 2044/1/22 | |
| | UNITED KINGDOM(GOVERNEMEN | 4.25 | 6,200 | 11,404 | 1,740,929 | 2055/12/7 | |
| 小計 | | | | | 37,504,731 | | |
| スウェーデン | | | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | | | |
| 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 32,050 | 33,350 | 436,892 | 2022/6/1 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.5 | 7,900 | 8,255 | 108,145 | 2023/11/13 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.5 | 33,950 | 37,548 | 491,887 | 2025/5/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.0 | 12,000 | 12,667 | 165,944 | 2026/11/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.75 | 16,800 | 17,504 | 229,307 | 2028/5/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.75 | 18,900 | 19,670 | 257,679 | 2029/11/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 21,300 | 31,297 | 410,002 | 2039/3/30 | |
| 小計 | | | | | 2,099,858 | | |
| ノルウェー | | | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | | |
| 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 5,300 | 5,465 | 72,468 | 2023/5/24 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0 | 37,800 | 40,312 | 534,543 | 2024/3/14 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 12,500 | 12,940 | 171,591 | 2025/3/13 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.5 | 5,700 | 5,849 | 77,562 | 2026/2/19 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 9,600 | 9,945 | 131,878 | 2027/2/17 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 9,400 | 9,903 | 131,324 | 2028/4/26 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 22,000 | 22,792 | 302,229 | 2029/9/6 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.375 | 6,500 | 6,516 | 86,414 | 2030/8/19 | |
| 小計 | | | | | 1,508,013 | | |
| デンマーク | | | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | | |
| 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK | 0.25 | 400 | 404 | 7,192 | 2022/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 1.5 | 24,270 | 25,495 | 453,567 | 2023/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 1.75 | 29,300 | 32,212 | 573,058 | 2025/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 15,700 | 16,488 | 293,324 | 2027/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 26,300 | 27,659 | 492,066 | 2029/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 4.5 | 35,800 | 63,165 | 1,123,714 | 2039/11/15 | |
| 小計 | | | | | 2,942,923 | | |
| ユーロ | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESBLIGATION | — | 250 | 252 | 33,404 | 2022/10/7 |
| | BUNDESBLIGATION | — | 500 | 506 | 67,076 | 2023/4/14 | |
| | BUNDESBLIGATION | — | 2,000 | 2,047 | 270,893 | 2024/10/18 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 400 | 411 | 54,417 | 2022/7/4 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 300 | 308 | 40,855 | 2022/9/4 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 390 | 405 | 53,638 | 2023/2/15 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,400 | 5,643 | 746,738 | 2023/5/15 | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|--------------------------|------|--------------------------|--------|-----------|------------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 2,580 | 2,740 | 362,670 | 2023/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 25,600 | 30,402 | 4,022,866 | 2024/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 1,700 | 1,817 | 240,435 | 2024/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 10,800 | 11,525 | 1,525,088 | 2024/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 7,700 | 8,132 | 1,076,154 | 2024/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 2,700 | 2,821 | 373,358 | 2025/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 9,100 | 9,751 | 1,290,326 | 2025/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 23,200 | 24,462 | 3,236,883 | 2026/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 1,000 | 1,031 | 136,473 | 2026/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25 | 700 | 733 | 96,991 | 2027/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5 | 20,200 | 29,130 | 3,854,537 | 2027/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 200 | 213 | 28,185 | 2027/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.625 | 18,200 | 25,783 | 3,411,706 | 2028/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 600 | 640 | 84,737 | 2028/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 8,200 | 11,326 | 1,498,787 | 2028/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 18,600 | 29,486 | 3,901,713 | 2030/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5 | 8,400 | 13,190 | 1,745,391 | 2031/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 9,400 | 15,484 | 2,048,968 | 2034/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0 | 10,700 | 17,401 | 2,302,505 | 2037/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25 | 3,800 | 6,676 | 883,382 | 2039/7/4 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 4,000 | 7,552 | 999,329 | 2040/7/4 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 1,130 | 1,863 | 246,516 | 2042/7/4 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 5,800 | 8,833 | 1,168,837 | 2044/7/4 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 11,600 | 17,995 | 2,381,170 | 2046/8/15 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.25 | 13,600 | 16,962 | 2,244,437 | 2048/8/15 | | |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.0 | 900 | 914 | 121,052 | 2022/7/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9 | 400 | 406 | 53,753 | 2022/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 1,200 | 1,291 | 170,915 | 2022/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 1,500 | 1,536 | 203,270 | 2022/9/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 23,160 | 25,146 | 3,327,376 | 2022/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.05 | 2,800 | 2,817 | 372,830 | 2023/1/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95 | 4,700 | 4,806 | 636,021 | 2023/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95 | 100 | 102 | 13,531 | 2023/3/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 1,800 | 1,970 | 260,785 | 2023/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 500 | 556 | 73,569 | 2023/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45 | 1,000 | 1,063 | 140,748 | 2023/10/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0 | 18,700 | 22,965 | 3,038,790 | 2023/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 16,200 | 18,318 | 2,423,964 | 2024/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.85 | 300 | 317 | 42,042 | 2024/5/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.75 | 600 | 634 | 83,972 | 2024/7/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 5,800 | 6,533 | 864,462 | 2024/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 4,700 | 4,942 | 653,932 | 2024/11/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 1,000 | 1,089 | 144,175 | 2024/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 16,800 | 19,989 | 2,645,062 | 2025/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 800 | 844 | 111,773 | 2025/5/15 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5 | 3,000 | 3,175 | 420,141 | 2025/6/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 7,000 | 7,749 | 1,025,440 | 2025/11/15 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0 | 3,000 | 3,255 | 430,701 | 2025/12/1 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|--------------------------|------|--------------------------|--------|-----------|------------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 11,900 | 14,362 | 1,900,394 | 2026/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1 | 2,000 | 2,190 | 289,780 | 2026/7/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.25 | 18,100 | 24,938 | 3,299,819 | 2026/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.05 | 200 | 219 | 29,097 | 2027/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5 | 22,500 | 31,171 | 4,124,612 | 2027/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 8,000 | 10,371 | 1,372,317 | 2028/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 29,900 | 41,019 | 5,427,741 | 2029/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65 | 1,000 | 1,070 | 141,704 | 2030/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0 | 16,000 | 23,790 | 3,147,945 | 2031/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65 | 500 | 532 | 70,493 | 2032/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75 | 10,900 | 16,480 | 2,180,739 | 2033/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45 | 1,400 | 1,607 | 212,720 | 2033/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 20,400 | 29,688 | 3,928,332 | 2034/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.35 | 13,200 | 16,639 | 2,201,794 | 2035/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 2,700 | 3,669 | 485,521 | 2037/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95 | 500 | 612 | 80,979 | 2038/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 5,000 | 7,763 | 1,027,266 | 2039/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1 | 200 | 248 | 32,945 | 2040/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 11,200 | 17,508 | 2,316,785 | 2040/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 8,800 | 13,826 | 1,829,530 | 2044/9/1 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 5,500 | 7,073 | 935,899 | 2046/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45 | 2,800 | 3,747 | 495,871 | 2048/3/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85 | 7,000 | 9,999 | 1,323,133 | 2049/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45 | 9,100 | 10,139 | 1,341,621 | 2050/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8 | 3,000 | 3,462 | 458,111 | 2067/3/1 | | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | — | 4,200 | 4,248 | 562,179 | 2023/2/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 2,600 | 2,631 | 348,170 | 2023/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.75 | 1,570 | 1,647 | 217,954 | 2023/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 100 | 101 | 13,459 | 2024/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.25 | 10,100 | 10,981 | 1,453,047 | 2024/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 1,800 | 1,836 | 242,939 | 2025/3/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 13,000 | 13,538 | 1,791,371 | 2025/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 1,800 | 1,883 | 249,256 | 2026/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.25 | 13,300 | 13,753 | 1,819,851 | 2026/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.0 | 8,000 | 8,640 | 1,143,253 | 2027/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 4,900 | 5,231 | 692,294 | 2028/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 11,600 | 12,393 | 1,639,936 | 2028/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 2,000 | 2,095 | 277,234 | 2029/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 9,400 | 11,534 | 1,526,214 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 10,100 | 11,276 | 1,492,094 | 2034/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 100 | 111 | 14,772 | 2036/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.75 | 100 | 120 | 15,956 | 2039/6/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.0 | 10,400 | 13,264 | 1,755,134 | 2048/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.5 | 2,000 | 2,301 | 304,510 | 2050/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 500 | 471 | 62,401 | 2052/5/25 |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | — | 200 | 201 | 26,642 | 2022/5/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.25 | 16,000 | 16,683 | 2,207,573 | 2022/10/25 | | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 11,100 | 13,111 | 1,734,889 | 2023/4/25 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|--------------------------|------|--------------------------|--------|-----------|------------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 25,600 | 28,696 | 3,797,097 | 2023/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.75 | 3,000 | 3,248 | 429,782 | 2024/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6.0 | 9,500 | 12,283 | 1,625,352 | 2025/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.0 | 6,000 | 6,402 | 847,192 | 2025/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 33,800 | 40,487 | 5,357,283 | 2026/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.75 | 3,700 | 4,434 | 586,717 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.5 | 27,000 | 39,188 | 5,185,447 | 2029/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.5 | 13,000 | 14,827 | 1,961,966 | 2031/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.75 | 20,400 | 33,351 | 4,413,007 | 2032/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.75 | 18,300 | 29,321 | 3,879,855 | 2035/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 300 | 474 | 62,779 | 2038/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.5 | 5,800 | 10,026 | 1,326,662 | 2041/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 25,550 | 39,508 | 5,227,704 | 2045/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 5,650 | 10,617 | 1,404,928 | 2055/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 9,700 | 19,042 | 2,519,740 | 2060/4/25 |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.25 | 100 | 103 | 13,691 | 2022/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 200 | 215 | 28,459 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 7.5 | 3,500 | 4,041 | 534,810 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.75 | 400 | 421 | 55,812 | 2023/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 100 | 101 | 13,486 | 2024/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0 | 7,700 | 8,360 | 1,106,293 | 2024/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 1,500 | 1,553 | 205,522 | 2025/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 1,900 | 1,999 | 264,594 | 2026/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.75 | 2,500 | 2,681 | 354,761 | 2027/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5 | 12,300 | 17,192 | 2,274,969 | 2028/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.75 | 1,000 | 1,077 | 142,627 | 2028/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 2,400 | 2,503 | 331,255 | 2029/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 8,900 | 11,524 | 1,524,869 | 2033/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 3,700 | 5,926 | 784,256 | 2037/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 500 | 523 | 69,203 | 2040/1/15 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 4,100 | 6,993 | 925,409 | 2042/1/15 | | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.75 | 6,900 | 11,015 | 1,457,597 | 2047/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.45 | 5,400 | 5,464 | 723,102 | 2022/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4 | 14,800 | 16,323 | 2,159,863 | 2023/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.35 | 4,200 | 4,281 | 566,512 | 2023/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4 | 7,300 | 8,194 | 1,084,290 | 2023/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8 | 15,600 | 17,861 | 2,363,380 | 2024/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8 | 6,900 | 7,780 | 1,029,462 | 2024/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75 | 450 | 499 | 66,099 | 2024/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.6 | 900 | 969 | 128,295 | 2025/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65 | 12,900 | 15,624 | 2,067,373 | 2025/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.15 | 5,000 | 5,547 | 734,061 | 2025/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95 | 4,000 | 4,431 | 586,407 | 2026/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9 | 22,400 | 29,545 | 3,909,448 | 2026/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45 | 7,600 | 8,314 | 1,100,161 | 2027/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4 | 2,000 | 2,183 | 288,910 | 2028/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4 | 5,000 | 5,460 | 722,533 | 2028/7/30 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 11,500 | 15,799 | 2,090,636 | 2028/10/31 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|----------------------|------|--------------------------|--------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.95 | 2,000 | 2,286 | 302,578 | 2030/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.35 | 5,400 | 6,439 | 852,074 | 2033/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.85 | 1,000 | 1,135 | 150,274 | 2035/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9 | 1,900 | 3,161 | 418,355 | 2040/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7 | 4,700 | 7,718 | 1,021,341 | 2041/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 10,000 | 17,925 | 2,371,911 | 2044/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9 | 3,200 | 4,281 | 566,489 | 2046/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7 | 10,500 | 13,636 | 1,804,321 | 2048/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.45 | 3,700 | 5,632 | 745,313 | 2066/7/30 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 6.0 | 16,000 | 23,155 | 3,063,973 | 2029/1/31 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 27,800 | 43,523 | 5,759,053 | 2032/7/30 |
| SPANISH GOVERNMENT | 4.2 | 4,200 | 6,235 | 825,091 | 2037/1/31 | | |
| ベルギー | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 600 | 641 | 84,830 | 2022/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 3,800 | 4,035 | 534,040 | 2023/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.2 | 1,900 | 1,939 | 256,674 | 2023/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.6 | 4,000 | 4,403 | 582,631 | 2024/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.5 | 1,000 | 1,037 | 137,315 | 2024/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 1,700 | 1,794 | 237,434 | 2025/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.5 | 6,700 | 8,348 | 1,104,668 | 2026/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.0 | 3,300 | 3,544 | 469,051 | 2026/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 2,000 | 2,139 | 283,107 | 2027/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.8 | 1,000 | 1,074 | 142,124 | 2028/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.9 | 6,500 | 7,038 | 931,283 | 2029/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.0 | 5,200 | 5,688 | 752,686 | 2031/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 1,700 | 2,413 | 319,409 | 2032/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.25 | 100 | 112 | 14,862 | 2033/4/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.45 | 500 | 572 | 75,783 | 2037/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.9 | 100 | 121 | 16,137 | 2038/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 4,600 | 7,677 | 1,015,844 | 2041/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 4,000 | 6,587 | 871,627 | 2045/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.6 | 5,200 | 6,077 | 804,132 | 2047/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.7 | 2,700 | 3,229 | 427,336 | 2050/6/22 |
| BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 1,200 | 1,653 | 218,844 | 2057/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM | 2.15 | 1,000 | 1,377 | 182,226 | 2066/6/22 | | |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 11,500 | 16,137 | 2,135,281 | 2028/3/28 | | |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.0 | 10,500 | 17,128 | 2,266,502 | 2035/3/28 | | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 100 | 100 | 13,352 | 2022/9/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4 | 200 | 212 | 28,125 | 2022/11/22 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 900 | 912 | 120,743 | 2023/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.75 | 150 | 158 | 21,020 | 2023/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 1,300 | 1,324 | 175,318 | 2024/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.65 | 700 | 755 | 99,934 | 2024/10/21 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.2 | 1,300 | 1,400 | 185,366 | 2025/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.85 | 5,400 | 6,824 | 903,020 | 2026/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.75 | 2,000 | 2,130 | 281,957 | 2026/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.25 | 7,600 | 10,758 | 1,423,525 | 2027/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5 | 9,600 | 10,115 | 1,338,485 | 2029/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.4 | 7,600 | 9,771 | 1,292,956 | 2034/5/23 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|--------|------|------------------------|-------|-----------|-----------|-------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.15 | 400 | 639 | 84,650 | 2037/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.15 | 3,200 | 5,067 | 670,529 | 2044/6/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5 | 5,600 | 6,806 | 900,601 | 2047/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.75 | 2,000 | 2,045 | 270,646 | 2051/3/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.8 | 950 | 1,959 | 259,342 | 2062/1/26 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.1 | 800 | 1,302 | 172,354 | 2117/9/20 |
| フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 1.625 | 100 | 103 | 13,645 | 2022/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.5 | 100 | 104 | 13,791 | 2023/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | — | 400 | 406 | 53,758 | 2023/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.0 | 700 | 754 | 99,890 | 2024/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 4.0 | 3,600 | 4,288 | 567,501 | 2025/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.875 | 100 | 106 | 14,052 | 2025/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 2,000 | 2,098 | 277,668 | 2026/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.75 | 3,300 | 4,026 | 532,724 | 2028/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 2,400 | 2,527 | 334,472 | 2029/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.75 | 800 | 858 | 113,628 | 2031/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.125 | 200 | 223 | 29,577 | 2034/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.125 | 4,000 | 3,884 | 514,026 | 2036/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.625 | 400 | 576 | 76,243 | 2042/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.375 | 300 | 361 | 47,857 | 2047/4/15 |
| アイルランド | 国債証券 | IRISH GOVERNMENT | 5.4 | 4,630 | 5,686 | 752,503 | 2025/3/13 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 0.9 | 6,500 | 6,993 | 925,363 | 2028/5/15 |
| | | IRISH TSY 1% 2026 | 1.0 | 4,600 | 4,923 | 651,415 | 2026/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.10% 2029 | 1.1 | 600 | 655 | 86,728 | 2029/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.3% 2033 | 1.3 | 3,200 | 3,581 | 473,941 | 2033/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.35% 2031 | 1.35 | 2,000 | 2,244 | 296,967 | 2031/3/18 |
| | | IRISH TSY 1.5% 2050 | 1.5 | 2,600 | 2,985 | 395,083 | 2050/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.7% 2037 | 1.7 | 2,900 | 3,432 | 454,218 | 2037/5/15 |
| | | IRISH TSY 2% 2045 | 2.0 | 1,600 | 2,031 | 268,806 | 2045/2/18 |
| | | IRISH TSY 2.4% 2030 | 2.4 | 6,000 | 7,284 | 963,900 | 2030/5/15 |
| | | IRISH TSY 2022 | — | 2,200 | 2,219 | 293,682 | 2022/10/18 |
| | | IRISH TSY 3.4% 2024 | 3.4 | 6,100 | 6,793 | 898,930 | 2024/3/18 |
| | | REPUBLIC OF IRELAND | 3.9 | 9,850 | 10,678 | 1,413,038 | 2023/3/20 |
| 小 計 | | | | | | 234,816,743 | |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 49,800 | 51,856 | 1,506,739 | 2023/1/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.25 | 33,000 | 35,032 | 1,017,892 | 2024/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 34,800 | 37,932 | 1,102,144 | 2029/10/25 |
| 小 計 | | | | | | 3,626,776 | |
| シンガポール | | | | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | |
| | 国債証券 | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.125 | 2,700 | 2,796 | 229,572 | 2022/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.75 | 500 | 511 | 41,993 | 2023/2/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 4,100 | 4,298 | 352,849 | 2023/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.0 | 1,450 | 1,506 | 123,669 | 2024/2/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 2,300 | 2,478 | 203,471 | 2024/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.375 | 1,100 | 1,174 | 96,364 | 2025/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.125 | 700 | 741 | 60,857 | 2026/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 3,900 | 4,426 | 363,327 | 2027/3/1 |

| 銘柄 | | 当期末 | | | | |
|---------|-----------------------|-------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| シンガポール | | % | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | 千円 | |
| 国債証券 | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.625 | 500 | 545 | 44,754 | 2028/5/1 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 300 | 334 | 27,418 | 2029/7/1 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 2,850 | 3,191 | 261,992 | 2030/9/1 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.375 | 1,200 | 1,419 | 116,471 | 2033/9/1 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 1,920 | 2,025 | 166,247 | 2036/8/1 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,750 | 3,150 | 258,562 | 2042/4/1 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 1,000 | 1,161 | 95,335 | 2046/3/1 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.875 | 1,000 | 1,002 | 82,262 | 2050/3/1 |
| 小計 | | | | | 2,525,149 | |
| マレーシア | | | 千リンギ | 千リンギ | | |
| 国債証券 | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.059 | 400 | 422 | 11,195 | 2024/9/30 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.642 | 2,600 | 2,815 | 74,687 | 2033/11/7 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.828 | 2,700 | 2,693 | 71,452 | 2034/7/5 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.762 | 400 | 431 | 11,436 | 2037/4/7 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.418 | 500 | 509 | 13,512 | 2022/8/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.795 | 500 | 512 | 13,597 | 2022/9/30 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 13,500 | 13,842 | 367,173 | 2023/3/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.757 | 3,900 | 4,023 | 106,712 | 2023/4/20 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.8 | 2,200 | 2,280 | 60,477 | 2023/8/17 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 5,800 | 6,121 | 162,373 | 2024/7/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.955 | 600 | 634 | 16,842 | 2025/9/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.392 | 15,600 | 16,862 | 447,280 | 2026/4/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.892 | 4,600 | 4,888 | 129,662 | 2027/3/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.502 | 7,000 | 7,256 | 192,465 | 2027/5/31 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 2,200 | 2,310 | 61,299 | 2028/6/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.885 | 280 | 294 | 7,822 | 2029/8/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.498 | 12,700 | 13,919 | 369,215 | 2030/4/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.232 | 4,400 | 4,689 | 124,382 | 2031/6/30 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.844 | 800 | 804 | 21,348 | 2033/4/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.254 | 2,300 | 2,397 | 63,594 | 2035/5/31 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.935 | 9,700 | 10,581 | 280,673 | 2043/9/30 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.736 | 4,100 | 4,325 | 114,742 | 2046/3/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.921 | 300 | 325 | 8,625 | 2048/7/6 |
| 小計 | | | | | 2,730,575 | |
| オーストラリア | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 7,520 | 8,023 | 685,492 | 2022/7/15 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.25 | 80 | 82 | 7,061 | 2022/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 3,900 | 4,310 | 368,288 | 2023/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 5,100 | 5,496 | 469,623 | 2024/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 9,400 | 10,434 | 891,515 | 2025/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 12,780 | 15,014 | 1,282,833 | 2026/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 12,400 | 15,176 | 1,296,702 | 2027/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 2,200 | 2,440 | 208,524 | 2027/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,100 | 1,221 | 104,391 | 2028/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 10,100 | 11,597 | 990,875 | 2029/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 13,300 | 14,745 | 1,259,873 | 2029/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.5 | 22,200 | 24,135 | 2,062,170 | 2030/5/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0 | 5,700 | 5,407 | 462,041 | 2030/12/21 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|---------|------|--------------------------|---------|---------|---------|-------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| オーストラリア | | % | 千豪ドル | 千豪ドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.5 | 800 | 790 | 67,581 | 2031/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 7,700 | 9,993 | 853,860 | 2033/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,300 | 1,422 | 121,541 | 2035/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.75 | 8,250 | 10,065 | 859,958 | 2037/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 700 | 798 | 68,246 | 2039/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,500 | 1,584 | 135,374 | 2041/5/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0 | 4,900 | 5,298 | 452,734 | 2047/3/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 3,000 | 2,453 | 209,618 | 2051/6/21 |
| 小 | 計 | | | | | 12,858,309 | |
| イスラエル | | | 千新シエケル | 千新シエケル | | | |
| | 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND | 0.75 | 9,800 | 9,884 | 330,807 | 2022/7/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.25 | 5,000 | 5,088 | 170,293 | 2022/11/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 4.25 | 5,000 | 5,386 | 180,285 | 2023/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.5 | 5,000 | 5,164 | 172,836 | 2023/11/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 5,900 | 6,492 | 217,297 | 2024/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.75 | 5,000 | 5,274 | 176,540 | 2025/8/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 6.25 | 6,500 | 8,478 | 283,749 | 2026/10/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 2.0 | 5,000 | 5,382 | 180,128 | 2027/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 2.25 | 5,000 | 5,477 | 183,317 | 2028/9/28 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.0 | 5,500 | 5,430 | 181,739 | 2030/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 5.5 | 6,000 | 9,452 | 316,364 | 2042/1/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 5,000 | 6,351 | 212,581 | 2047/3/31 |
| 小 | 計 | | | | | 2,605,943 | |
| メキシコ | | | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | |
| | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 44,400 | 45,246 | 247,159 | 2022/6/9 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.75 | 17,300 | 17,876 | 97,647 | 2023/3/9 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 87,300 | 94,049 | 513,746 | 2024/9/5 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 65,000 | 74,475 | 406,819 | 2024/12/5 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.75 | 66,300 | 65,985 | 360,443 | 2026/3/5 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 112,300 | 120,144 | 656,290 | 2027/6/3 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 45,300 | 51,061 | 278,924 | 2029/5/31 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 68,100 | 73,203 | 399,875 | 2031/5/29 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 400 | 425 | 2,322 | 2034/11/23 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 41,300 | 52,028 | 284,205 | 2036/11/20 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 25,800 | 28,405 | 155,162 | 2038/11/18 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 52,200 | 52,875 | 288,834 | 2042/11/13 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 43,000 | 44,398 | 242,528 | 2047/11/7 |
| | | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 107,700 | 115,361 | 630,163 | 2023/12/7 |
| 小 | 計 | | | | | 4,564,125 | |
| 合 | 計 | | | | | 571,835,057 | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2021年5月10日現在)

| 区 分 | 当 期 末 |
|----------------|----------------------|
| | 数 量 |
| 貸付有価証券<債券>券面総額 | 米ドル 1,341,077,000 |
| 貸付有価証券<債券>券面総額 | ユーロ 202,365,708 |
| 貸付有価証券<債券>券面総額 | 豪ドル 10,500,000 |
| 貸付有価証券<債券>券面総額 | 新シユケル 21,508,000 |

○投資信託財産の構成

(2021年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 571,835,057 | % 70.7 |
| コール・ローン等、その他 | 237,015,002 | 29.3 |
| 投資信託財産総額 | 808,850,059 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（587,191,776千円）の投資信託財産総額（808,850,059千円）に対する比率は72.6%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.77円、1カナダドル=89.73円、1英ポンド=152.65円、1スウェーデンクローナ=13.10円、1ノルウェークローネ=13.26円、1デンマーククローネ=17.79円、1ユーロ=132.32円、1ズロチ=29.0558円、1シンガポールドル=82.08円、1リンギ=26.5249円、1豪ドル=85.44円、1新シユケル=33.4685円、1メキシコペソ=5.4625円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月10日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 818,730,540,720 |
| コール・ローン等 | 3,368,503,059 |
| 公社債(評価額) | 571,835,057,567 |
| 未収入金 | 24,978,090,700 |
| 未収利息 | 5,025,696,316 |
| 前払費用 | 197,043,726 |
| その他未収収益 | 16,169,413 |
| 受入担保代用有価証券 | 213,309,979,939 |
| (B) 負債 | 241,387,316,580 |
| 未払金 | 16,692,931,483 |
| 未払解約金 | 11,376,973,565 |
| 未払利息 | 769 |
| 受入担保金 | 213,309,979,939 |
| その他未払費用 | 7,430,824 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 577,343,224,140 |
| 元本 | 229,270,699,136 |
| 次期繰越損益金 | 348,072,525,004 |
| (D) 受益権総口数 | 229,270,699,136口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 25,182円 |

(注) 期首元本額は239,006,740,496円、期中追加設定元本額は35,351,538,325円、期中一部解約元本額は45,087,579,685円、1口当たり純資産額は2.5182円です。

(注) 2021年5月10日現在、有価証券の貸付などに係る受入担保代用有価証券として担保に受け入れている資産は以下の通りです。
・有価証券 213,309,979,938円

○損益の状況 (2020年5月12日～2021年5月10日)

| 項目 | 当期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 16,281,004,505 |
| 受取利息 | 16,105,080,462 |
| その他収益金 | 177,963,772 |
| 支払利息 | △ 2,039,729 |
| (B) 有価証券売買損益 | 20,790,838,290 |
| 売買益 | 51,615,142,918 |
| 売買損 | △ 30,824,304,628 |
| (C) 保管費用等 | △ 94,485,758 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 36,977,357,037 |
| (E) 前期繰越損益金 | 325,656,344,897 |
| (F) 追加信託差損益金 | 51,569,954,030 |
| (G) 解約差損益金 | △ 66,131,130,960 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 348,072,525,004 |
| 次期繰越損益金(H) | 348,072,525,004 |

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

* 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 |
|---|----------------|
| | 元本額 |
| | 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) | 74,818,812,732 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 23,740,455,752 |
| 野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 18,011,444,164 |
| のむらップ・ファンド(普通型) | 13,938,678,094 |
| マイ・ロード | 8,939,154,926 |
| 野村外国債券インデックス Bコース(野村SMA・EW向け) | 8,623,483,999 |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 7,108,981,810 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 6,293,193,627 |
| 野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 6,088,822,869 |
| NET FUND 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 | 5,667,170,120 |
| のむらップ・ファンド(保守型) | 5,645,802,658 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 5,323,230,922 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 4,770,974,663 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 4,296,569,976 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 3,670,865,990 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 3,284,276,560 |
| のむらップ・ファンド(積極型) | 3,147,958,870 |

| ファンド名 | 当期末 |
|------------------------------------|---------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券 | 2,461,786,806 |
| 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) | 1,934,128,760 |
| マイバランスDC30 | 1,883,999,929 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 1,707,978,192 |
| 野村6資産均等バランス | 1,541,574,583 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 1,425,155,305 |
| マイバランスDC50 | 1,391,309,022 |
| 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) | 1,378,405,093 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 1,255,060,309 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 1,218,245,982 |
| 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) | 1,146,434,164 |
| 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) | 1,042,220,964 |
| マイバランスDC70 | 921,800,996 |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 848,053,397 |
| 野村外国債券バッシブファンド(確定拠出年金向け) | 588,329,497 |
| のむらップ・ファンド(やや保守型) | 573,888,162 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 527,656,307 |

| ファンド名 | 当期末 |
|------------------------------------|-------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA向け） | 521,149,202 |
| のむらっぴ・ファンド（やや積極型） | 486,962,000 |
| マイターゲット2030（確定拠出年金向け） | 341,008,805 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 278,297,835 |
| ネクストコア | 219,365,979 |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け） | 216,375,190 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 198,495,983 |
| 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） | 190,957,541 |
| 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） | 178,098,999 |
| マイターゲット2040（確定拠出年金向け） | 170,058,001 |
| 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） | 164,472,969 |
| マイターゲット2035（確定拠出年金向け） | 96,385,078 |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用） | 94,875,236 |
| バランスセレクト50 | 83,147,612 |
| バランスセレクト30 | 82,860,900 |
| バランスセレクト70 | 77,285,302 |
| マイターゲット2045（確定拠出年金向け） | 65,416,645 |
| 世界6資産分散ファンド | 63,024,121 |
| 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） | 59,766,492 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 49,424,312 |
| マイターゲット2060（確定拠出年金向け） | 44,502,358 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 38,843,108 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 37,769,319 |
| マイターゲット2055（確定拠出年金向け） | 35,130,230 |
| 野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース | 34,607,691 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 28,572,800 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 20,274,883 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 20,166,589 |
| 野村世界6資産分散投信（DC）成長コース | 15,062,740 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村世界6資産分散投信（DC）安定コース | 14,191,473 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 13,818,490 |
| 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） | 11,670,049 |
| 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） | 8,948,189 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 7,775,081 |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け） | 7,290,687 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてN I S A）2030 | 7,039,590 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 6,762,765 |
| 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） | 6,372,815 |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け） | 6,214,458 |
| インデックス・ブレンド（タイプIII） | 5,749,920 |
| 野村HPOs用・ターゲット・リターン・資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用） | 5,659,288 |
| マイターゲット2065（確定拠出年金向け） | 5,310,864 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてN I S A）2040 | 4,902,707 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 4,854,845 |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け） | 3,592,551 |
| インデックス・ブレンド（タイプV） | 3,492,360 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 2,854,794 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用） | 2,704,530 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてN I S A）2050 | 2,635,355 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 2,051,455 |
| インデックス・ブレンド（タイプI） | 1,931,676 |
| インデックス・ブレンド（タイプII） | 1,401,384 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,396,139 |
| インデックス・ブレンド（タイプIV） | 1,341,811 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてN I S A）2060 | 1,142,063 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 1,031,054 |
| 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） | 279,596 |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け） | 20,027 |

〇お知らせ

該当事項はございません。

新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド

運用報告書

第11期（決算日2021年2月18日）

作成対象期間（2020年2月19日～2021年2月18日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。 |
| 主な投資対象 | 現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・ インデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円換算ベース) | | 債組入比率 | 債先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|--|-------|-------|-------|-------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | | |
| 7期(2017年2月20日) | 12,644 | 10.1 | 131.55 | 10.7 | 96.4 | — | 4,218 |
| 8期(2018年2月19日) | 13,772 | 8.9 | 144.15 | 9.6 | 97.8 | — | 7,008 |
| 9期(2019年2月18日) | 13,261 | △ 3.7 | 139.01 | △ 3.6 | 97.4 | — | 7,946 |
| 10期(2020年2月18日) | 14,226 | 7.3 | 150.17 | 8.0 | 97.7 | — | 8,023 |
| 11期(2021年2月18日) | 14,036 | △ 1.3 | 147.86 | △ 1.5 | 97.7 | — | 9,139 |

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*ベンチマーク（＝JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース））は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。（設定時を100として指数化しています。）

*JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数です（ただし、国別の組入比率には上限が設定されています）。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ エマージング・マーケット・グローバル・ ディバーシファイド(円換算ベース) | | 債組入比率 | 債先物比率 |
|--------------------|--------|--------|--|--------|-------|-------|
| | 円 | 騰落率 | 円 | 騰落率 | | |
| (期首) 2020年2月18日 | 14,226 | — | 150.17 | — | 97.7 | — |
| 2月末 | 13,869 | △ 2.5 | 146.11 | △ 2.7 | 97.7 | — |
| 3月末 | 11,966 | △ 15.9 | 126.37 | △ 15.8 | 96.6 | — |
| 4月末 | 12,226 | △ 14.1 | 128.84 | △ 14.2 | 96.2 | — |
| 5月末 | 13,005 | △ 8.6 | 137.29 | △ 8.6 | 96.7 | — |
| 6月末 | 13,155 | △ 7.5 | 138.68 | △ 7.7 | 97.3 | — |
| 7月末 | 13,157 | △ 7.5 | 138.46 | △ 7.8 | 97.5 | — |
| 8月末 | 13,195 | △ 7.2 | 138.85 | △ 7.5 | 97.9 | — |
| 9月末 | 12,884 | △ 9.4 | 135.87 | △ 9.5 | 97.7 | — |
| 10月末 | 12,859 | △ 9.6 | 135.69 | △ 9.6 | 97.6 | — |
| 11月末 | 13,520 | △ 5.0 | 142.59 | △ 5.0 | 98.1 | — |
| 12月末 | 13,869 | △ 2.5 | 146.38 | △ 2.5 | 98.2 | — |
| 2021年1月末 | 13,795 | △ 3.0 | 145.78 | △ 2.9 | 98.1 | — |
| (期末) 2021年2月18日 | 14,036 | △ 1.3 | 147.86 | △ 1.5 | 97.7 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

新興国債券のリターンは利子収入などからプラスとなりましたが、新興国通貨が概ね対円で下落（円高）したことがマイナスに影響し、基準価額は下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債などに分散投資しました。毎月の指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

○当ファンドのベンチマークとの差異

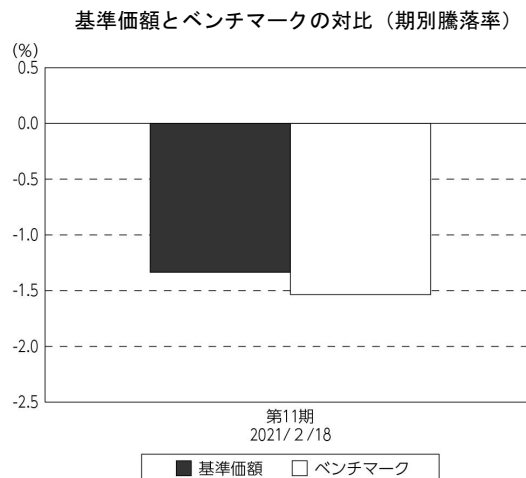
今期の基準価額の騰落率は-1.3%となり、ベンチマークの-1.5%を0.2ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用や利金に対する課税などのコスト）が生じること。

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること。



（注）ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）です。

◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、新興国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

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

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

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

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

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

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

○1万口当たりの費用明細

（2020年2月19日～2021年2月18日）

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-----------------------|------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| | 円 | % | |
| (a) その他費用 | 16 | 0.122 | (a) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 |
| （保管費用） | (13) | (0.096) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （その他） | (3) | (0.027) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合計 | 16 | 0.122 | |
| 期中の平均基準価額は、13,125円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年2月19日～2021年2月18日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|-------|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 外 | トルコ | 千トルコリラ 4,218 | 千トルコリラ 7,035 |
| | チェコ | 千チェココルナ 29,469 | 千チェココルナ 30,297 |
| | ハンガリー | 千フォリント 352,939 | 千フォリント 160,797 |
| | ポーランド | 千ズロチ 36,966 | 千ズロチ 36,696 |
| | ロシア | 千ルーブル 261,371 | 千ルーブル 208,690 |
| | ルーマニア | 千レイ 3,656 | 千レイ 2,292 |
| | マレーシア | 千リンギ 12,394 | 千リンギ 6,343 |
| | タイ | 千バーツ 90,033 | 千バーツ 83,084 |
| | フィリピン | 千フィリピンペソ 12,550 | 千フィリピンペソ 10,050 |
| | インドネシア | 千ルピア 41,845,232 | 千ルピア 29,508,928 |
| | 中国オフショア | 千オフショア人民元 55,348 | 千オフショア人民元 - |
| | メキシコ | 千メキシコペソ 78,662 | 千メキシコペソ 58,396 |
| | ブラジル | 千レアル 20,790 | 千レアル 13,737 |
| | チリ | 千チリペソ 646,896 | 千チリペソ 512,300 |
| | コロンビア | 千コロンビアペソ 8,946,120 | 千コロンビアペソ 7,577,234 |
| | ペルー | 千ソル 2,679 | 千ソル 3,671 |
| 南アフリカ | 千ランド 27,465 | 千ランド 30,988 | |

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年2月19日～2021年2月18日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 9,754 | 百万円 1,571 | % 16.1 | 百万円 8,652 | 百万円 1,571 | % 18.2 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年2月18日現在)

外国公社債

(A) 外国（外貨建）公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|------------------------|------------------------|---------------|----------|--------------------|-----------|----------|----------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| トルコ | 千トルコリラ 12,610 | 千トルコリラ 11,736 | 千円 178,048 | % 1.9 | % 1.9 | % 0.6 | % 0.6 | % 0.8 |
| チェコ | 千チェココナ 70,800 | 千チェココナ 69,377 | 342,029 | 3.7 | — | 3.0 | 0.8 | — |
| ハンガリー | 千フォリント 910,000 | 千フォリント 994,273 | 353,464 | 3.9 | — | 2.0 | 1.5 | 0.4 |
| ポーランド | 千ズロチ 23,700 | 千ズロチ 25,680 | 728,033 | 8.0 | — | 3.1 | 3.7 | 1.2 |
| ロシア | 千ルーブル 412,200 | 千ルーブル 439,864 | 629,005 | 6.9 | — | 4.6 | 1.4 | 0.9 |
| ドミニカ共和国 | 千ドミニカペソ 8,000 | 千ドミニカペソ 8,764 | 15,950 | 0.2 | 0.2 | 0.2 | — | — |
| ルーマニア | 千レイ 9,530 | 千レイ 10,234 | 267,436 | 2.9 | — | 1.0 | 1.3 | 0.6 |
| マレーシア | 千リンギ 23,100 | 千リンギ 24,491 | 641,915 | 7.0 | — | 3.7 | 3.3 | — |
| タイ | 千バーツ 197,800 | 千バーツ 215,729 | 759,368 | 8.3 | — | 5.2 | 2.3 | 0.8 |
| フィリピン | 千フィリピンペソ 10,000 | 千フィリピンペソ 12,985 | 28,437 | 0.3 | — | 0.3 | — | — |
| インドネシア | 千ルピア 102,160,000 | 千ルピア 111,997,224 | 851,178 | 9.3 | — | 6.6 | 2.2 | 0.5 |
| 中国オフショア | 千オフショア人民元 53,000 | 千オフショア人民元 54,593 | 897,510 | 9.8 | — | 5.4 | 4.4 | — |
| メキシコ | 千メキシコペソ 142,050 | 千メキシコペソ 161,695 | 847,282 | 9.3 | — | 5.4 | 3.2 | 0.7 |
| ブラジル | 千リアル 22,821 | 千リアル 37,717 | 736,631 | 8.1 | 8.1 | 1.6 | 4.1 | 2.4 |
| チリ | 千チリペソ 1,460,000 | 千チリペソ 1,714,208 | 253,531 | 2.8 | — | 2.1 | 0.7 | — |
| コロンビア | 千コロンビアペソ 13,660,000 | 千コロンビアペソ 15,846,820 | 473,819 | 5.2 | — | 3.7 | 1.1 | 0.4 |
| ペルー | 千ソル 6,920 | 千ソル 8,271 | 239,472 | 2.6 | — | 2.5 | 0.1 | — |
| ウルグアイ | 千ウルグアイペソ 4,000 | 千ウルグアイペソ 4,278 | 10,568 | 0.1 | — | 0.1 | — | — |

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|-------|-----------------|----------------|---------------|----------|-----------------|-----------|----------|--------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 南アフリカ | 千ランド 101,910 | 千ランド 92,840 | 千円 671,234 | % 7.3 | % 7.3 | % 6.8 | % 0.5 | % — |
| 合 計 | — | — | 8,924,920 | 97.7 | 17.5 | 58.0 | 31.1 | 8.6 |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

* S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

(B) 外国（外貨建）公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-------|------|-------------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| トルコ | | | % | 千トルコリラ | 千トルコリラ | 千円 | |
| | 国債証券 | TURKEY GOVERNMENT BOND | 11.0 | 1,200 | 1,156 | 17,539 | 2022/3/2 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 10.7 | 1,100 | 1,048 | 15,905 | 2022/8/17 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 8.5 | 790 | 729 | 11,073 | 2022/9/14 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 12.2 | 2,000 | 1,945 | 29,505 | 2023/1/18 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 7.1 | 770 | 677 | 10,273 | 2023/3/8 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 10.4 | 520 | 481 | 7,298 | 2024/3/20 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 9.0 | 1,110 | 981 | 14,885 | 2024/7/24 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 8.0 | 1,020 | 855 | 12,982 | 2025/3/12 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 10.6 | 400 | 365 | 5,540 | 2026/2/11 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 11.0 | 1,200 | 1,100 | 16,693 | 2027/2/24 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 10.5 | 700 | 631 | 9,578 | 2027/8/11 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 12.4 | 1,800 | 1,764 | 26,773 | 2028/3/8 |
| 小 | 計 | | | | | 178,048 | |
| チェコ | | | | 千チェココルナ | 千チェココルナ | | |
| | 国債証券 | CZECH REPUBLIC | 0.45 | 14,000 | 13,938 | 68,714 | 2023/10/25 |
| | | CZECH REPUBLIC | 1.0 | 19,600 | 19,368 | 95,488 | 2026/6/26 |
| | | CZECH REPUBLIC | 0.25 | 12,500 | 11,777 | 58,060 | 2027/2/10 |
| | | CZECH REPUBLIC | 0.95 | 13,200 | 12,614 | 62,191 | 2030/5/15 |
| | | CZECH REPUBLIC | 1.2 | 5,000 | 4,854 | 23,934 | 2031/3/13 |
| | | CZECH REPUBLIC | 2.0 | 6,500 | 6,823 | 33,639 | 2033/10/13 |
| 小 | 計 | | | | | 342,029 | |
| ハンガリー | | | | 千フォロント | 千フォロント | | |
| | 国債証券 | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 7.0 | 17,000 | 18,445 | 6,557 | 2022/6/24 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 1.75 | 93,000 | 94,649 | 33,648 | 2022/10/26 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 1.5 | 62,000 | 62,820 | 22,332 | 2023/8/23 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 6.0 | 77,000 | 87,618 | 31,148 | 2023/11/24 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.0 | 68,000 | 72,134 | 25,643 | 2024/6/26 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 2.5 | 75,000 | 78,357 | 27,856 | 2024/10/24 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 5.5 | 63,000 | 73,968 | 26,295 | 2025/6/24 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 2.75 | 86,000 | 91,439 | 32,506 | 2026/12/22 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.0 | 82,000 | 88,639 | 31,511 | 2027/10/27 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 6.75 | 57,000 | 76,727 | 27,276 | 2028/10/22 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.0 | 60,000 | 64,215 | 22,828 | 2030/8/21 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.25 | 170,000 | 185,256 | 65,858 | 2031/10/22 |
| 小 | 計 | | | | | 353,464 | |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.25 | 3,700 | 3,800 | 107,731 | 2022/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 4,000 | 4,283 | 121,427 | 2024/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.25 | 3,200 | 3,418 | 96,917 | 2024/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 3,800 | 4,257 | 120,708 | 2025/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 6,700 | 7,339 | 208,084 | 2027/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 1,700 | 1,907 | 54,077 | 2028/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 600 | 673 | 19,085 | 2029/10/25 |
| 小 | 計 | | | | | 728,033 | |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 | |
|---------|------|------------------------|---------|---------|--------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| ロシア | | % | 千ルーブル | 千ルーブル | 千円 | | |
| | 国債証券 | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.6 | 13,500 | 14,037 | 20,073 | 2022/7/20 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.4 | 12,000 | 12,497 | 17,872 | 2022/12/7 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.0 | 29,000 | 30,061 | 42,987 | 2023/1/25 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 6.5 | 28,000 | 28,783 | 41,160 | 2024/2/28 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.4 | 28,300 | 29,883 | 42,733 | 2024/7/17 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.15 | 27,000 | 28,417 | 40,636 | 2025/11/12 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.75 | 27,000 | 29,242 | 41,817 | 2026/9/16 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.95 | 47,700 | 51,991 | 74,348 | 2026/10/7 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 8.15 | 29,000 | 31,921 | 45,647 | 2027/2/3 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 6.0 | 12,000 | 11,856 | 16,955 | 2027/10/6 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.05 | 18,700 | 19,474 | 27,848 | 2028/1/19 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 6.9 | 10,000 | 10,290 | 14,714 | 2029/5/23 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.65 | 48,000 | 51,863 | 74,164 | 2030/4/10 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 8.5 | 26,500 | 30,280 | 43,300 | 2031/9/17 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.7 | 27,500 | 29,459 | 42,126 | 2033/3/23 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.25 | 10,000 | 10,345 | 14,793 | 2034/5/10 |
| | | RUSSIA GOVT BOND - OFZ | 7.7 | 18,000 | 19,458 | 27,825 | 2039/3/16 |
| 小 計 | | | | | | 629,005 | |
| ドミニカ共和国 | | | 千ドミニカペソ | 千ドミニカペソ | | | |
| | 国債証券 | DOMINICAN REPUBLIC | 9.75 | 8,000 | 8,764 | 15,950 | 2026/6/5 |
| 小 計 | | | | | | 15,950 | |
| ルーマニア | | | 千レイ | 千レイ | | | |
| | 国債証券 | ROMANIA | 3.4 | 900 | 914 | 23,886 | 2022/3/8 |
| | | ROMANIA | 3.5 | 1,000 | 1,027 | 26,854 | 2022/12/19 |
| | | ROMANIA | 5.85 | 550 | 594 | 15,539 | 2023/4/26 |
| | | ROMANIA | 4.4 | 400 | 423 | 11,059 | 2023/9/25 |
| | | ROMANIA | 4.0 | 500 | 524 | 13,701 | 2023/10/25 |
| | | ROMANIA | 3.25 | 500 | 515 | 13,482 | 2024/4/29 |
| | | ROMANIA | 4.5 | 1,000 | 1,073 | 28,042 | 2024/6/17 |
| | | ROMANIA | 4.75 | 920 | 1,008 | 26,360 | 2025/2/24 |
| | | ROMANIA | 3.65 | 500 | 529 | 13,830 | 2025/7/28 |
| | | ROMANIA | 4.85 | 500 | 561 | 14,684 | 2026/4/22 |
| | | ROMANIA | 5.8 | 760 | 901 | 23,564 | 2027/7/26 |
| | | ROMANIA | 5.0 | 800 | 919 | 24,024 | 2029/2/12 |
| | | ROMANIA | 3.65 | 1,200 | 1,240 | 32,405 | 2031/9/24 |
| 小 計 | | | | | | 267,436 | |
| マレーシア | | | 千リンギ | 千リンギ | | | |
| | 国債証券 | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.059 | 800 | 853 | 22,372 | 2024/9/30 |
| | | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.899 | 2,000 | 2,146 | 56,266 | 2027/11/16 |
| | | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.828 | 800 | 822 | 21,561 | 2034/7/5 |
| | | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.762 | 1,000 | 1,132 | 29,671 | 2037/4/7 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 800 | 825 | 21,630 | 2023/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.757 | 1,800 | 1,869 | 49,006 | 2023/4/20 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.478 | 1,200 | 1,253 | 32,842 | 2024/6/14 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 2,600 | 2,776 | 72,779 | 2024/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.955 | 3,700 | 3,970 | 104,073 | 2025/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.906 | 600 | 645 | 16,910 | 2026/7/15 |

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------|--------------------------|-------|------------|------------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| マレーシア | | % | 千リンギ | 千リンギ | 千円 | |
| 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.9 | 1,400 | 1,505 | 39,462 | 2026/11/30 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 2,900 | 3,097 | 81,190 | 2028/6/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.885 | 2,000 | 2,136 | 55,995 | 2029/8/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2.632 | 700 | 678 | 17,782 | 2031/4/15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.757 | 800 | 777 | 20,369 | 2040/5/22 |
| 小 計 | | | | | 641,915 | |
| タイ | | | 千バーツ | 千バーツ | | |
| 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 1.875 | 15,000 | 15,273 | 53,762 | 2022/6/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.0 | 5,000 | 5,134 | 18,074 | 2022/12/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.625 | 16,700 | 17,879 | 62,934 | 2023/6/16 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.4 | 12,200 | 12,811 | 45,097 | 2023/12/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 1.45 | 23,900 | 24,548 | 86,409 | 2024/12/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.85 | 4,000 | 4,564 | 16,068 | 2025/12/12 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.125 | 10,700 | 11,403 | 40,141 | 2026/12/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.875 | 12,900 | 14,401 | 50,693 | 2028/12/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 4.875 | 10,200 | 13,024 | 45,844 | 2029/6/22 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 1.6 | 28,300 | 28,774 | 101,284 | 2029/12/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.65 | 6,000 | 7,246 | 25,506 | 2031/6/20 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.775 | 8,200 | 10,063 | 35,425 | 2032/6/25 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 1.6 | 13,000 | 12,816 | 45,112 | 2035/6/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.4 | 12,500 | 15,271 | 53,754 | 2036/6/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.3 | 5,900 | 7,063 | 24,865 | 2038/6/17 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.875 | 13,300 | 15,452 | 54,391 | 2046/6/17 |
| 小 計 | | | | | 759,368 | |
| フィリピン | | | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | | |
| 国債証券 | REPUBLIC OF PHILIPPINES | 6.25 | 10,000 | 12,985 | 28,437 | 2036/1/14 |
| 小 計 | | | | | 28,437 | |
| インドネシア | | | 千ルピア | 千ルピア | | |
| 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT | 7.0 | 5,380,000 | 5,577,069 | 42,385 | 2022/5/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 5.625 | 2,700,000 | 2,762,478 | 20,994 | 2023/5/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 8.375 | 7,730,000 | 8,466,669 | 64,346 | 2024/3/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 8.125 | 8,800,000 | 9,607,224 | 73,014 | 2024/5/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 6.5 | 3,700,000 | 3,870,903 | 29,418 | 2025/6/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 11.0 | 1,580,000 | 1,930,207 | 14,669 | 2025/9/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 7.0 | 6,250,000 | 6,661,000 | 50,623 | 2027/5/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 6.125 | 5,000,000 | 5,036,750 | 38,279 | 2028/5/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 9.0 | 12,230,000 | 14,374,652 | 109,247 | 2029/3/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 8.25 | 6,400,000 | 7,225,344 | 54,912 | 2029/5/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 10.5 | 1,110,000 | 1,439,792 | 10,942 | 2030/8/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 7.0 | 11,100,000 | 11,654,556 | 88,574 | 2030/9/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 9.5 | 2,400,000 | 2,933,280 | 22,292 | 2031/7/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 8.25 | 1,600,000 | 1,808,336 | 13,743 | 2032/6/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 7.5 | 3,200,000 | 3,417,152 | 25,970 | 2032/8/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 6.625 | 4,900,000 | 4,929,645 | 37,465 | 2033/5/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 8.375 | 7,180,000 | 8,181,681 | 62,180 | 2034/3/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 8.25 | 5,000,000 | 5,668,850 | 43,083 | 2036/5/15 |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 7.5 | 3,400,000 | 3,581,934 | 27,222 | 2038/5/15 |

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|---------|--------------------------|-------|-----------|-----------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| インドネシア | | % | 千ルピア | 千ルピア | 千円 | |
| 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT | 8.375 | 2,500,000 | 2,869,700 | 21,809 | 2039/4/15 |
| 小 計 | | | | | 851,178 | |
| 中国オフショア | | | 千オフショア人民元 | 千オフショア人民元 | | |
| 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.03 | 7,500 | 7,612 | 125,156 | 2024/6/24 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2 | 15,500 | 15,190 | 249,723 | 2025/7/27 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.31 | 1,500 | 1,542 | 25,365 | 2025/11/30 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.48 | 10,000 | 10,441 | 171,660 | 2027/6/29 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 4.15 | 6,000 | 6,540 | 107,522 | 2027/12/4 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.6 | 2,500 | 2,632 | 43,275 | 2028/6/27 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.6 | 10,000 | 10,632 | 174,805 | 2030/5/21 |
| 小 計 | | | | | 897,510 | |
| メキシコ | | | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | |
| 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 11,000 | 11,345 | 59,451 | 2022/6/9 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.75 | 8,500 | 8,936 | 46,828 | 2023/3/9 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 14,700 | 16,419 | 86,039 | 2024/9/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 14,100 | 16,830 | 88,189 | 2024/12/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.75 | 7,900 | 8,238 | 43,171 | 2026/3/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 15,550 | 17,636 | 92,414 | 2027/6/3 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 17,100 | 20,662 | 108,268 | 2029/5/31 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 6,600 | 7,649 | 40,083 | 2031/5/29 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 4,200 | 4,861 | 25,474 | 2034/11/23 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 2,700 | 3,707 | 19,424 | 2036/11/20 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 11,600 | 14,023 | 73,485 | 2038/11/18 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 6,700 | 7,495 | 39,277 | 2042/11/13 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 8,500 | 9,723 | 50,949 | 2047/11/7 |
| | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 12,900 | 14,164 | 74,223 | 2023/12/7 |
| 小 計 | | | | | 847,282 | |
| ブラジル | | | 千リアル | 千リアル | | |
| 国債証券 | LETRA TESOIRO NACIONAL | — | 4,900 | 4,615 | 90,145 | 2022/7/1 |
| | LETRA TESOIRO NACIONAL | — | 3,900 | 3,404 | 66,487 | 2023/7/1 |
| | LETRA TESOIRO NACIONAL | — | 12,300 | 10,314 | 201,444 | 2024/1/1 |
| | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0 | 610 | 6,685 | 130,567 | 2023/1/1 |
| | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0 | 481 | 5,435 | 106,159 | 2025/1/1 |
| | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0 | 320 | 3,684 | 71,956 | 2027/1/1 |
| | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0 | 250 | 2,884 | 56,327 | 2029/1/1 |
| | NOTA DO TESOIRO NACIONAL | 10.0 | 60 | 693 | 13,541 | 2031/1/1 |
| 小 計 | | | | | 736,631 | |
| チリ | | | 千チリペソ | 千チリペソ | | |
| 国債証券 | BONOS TESORERIA PESOS | 4.0 | 100,000 | 109,065 | 16,130 | 2023/3/1 |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 2.5 | 310,000 | 329,948 | 48,799 | 2025/3/1 |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 4.5 | 300,000 | 349,935 | 51,755 | 2026/3/1 |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 4.7 | 295,000 | 349,147 | 51,638 | 2030/9/1 |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 5.0 | 240,000 | 289,808 | 42,862 | 2035/3/1 |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 6.0 | 215,000 | 286,304 | 42,344 | 2043/1/1 |
| 小 計 | | | | | 253,531 | |
| コロンビア | | | 千コロンビアペソ | 千コロンビアペソ | | |
| 国債証券 | REPUBLIC OF COLOMBIA | 9.85 | 3,610,000 | 4,690,148 | 140,235 | 2027/6/28 |

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-------|--------------------------|-------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| コロンビア | | % | 千コロンビアペソ | 千コロンビアペソ | 千円 | |
| 国債証券 | TITULOS DE TESORERIA | 7.0 | 1,100,000 | 1,166,249 | 34,870 | 2022/5/4 |
| | TITULOS DE TESORERIA | 10.0 | 950,000 | 1,154,042 | 34,505 | 2024/7/24 |
| | TITULOS DE TESORERIA | 6.25 | 1,900,000 | 2,091,940 | 62,549 | 2025/11/26 |
| | TITULOS DE TESORERIA | 6.0 | 900,000 | 955,391 | 28,566 | 2028/4/28 |
| | TITULOS DE TESORERIA | 7.75 | 1,750,000 | 2,025,882 | 60,573 | 2030/9/18 |
| | TITULOS DE TESORERIA | 7.0 | 1,600,000 | 1,734,931 | 51,874 | 2032/6/30 |
| | TITULOS DE TESORERIA | 7.25 | 1,850,000 | 2,028,235 | 60,644 | 2034/10/18 |
| 小 計 | | | | | 473,819 | |
| ペルー | | | 千ソル | 千ソル | | |
| 国債証券 | BONOS DE TESORERIA | 5.7 | 200 | 232 | 6,721 | 2024/8/12 |
| | BONOS DE TESORERIA | 5.94 | 600 | 730 | 21,142 | 2029/2/12 |
| | BONOS DE TESORERIA | 6.15 | 600 | 706 | 20,456 | 2032/8/12 |
| | BONOS DE TESORERIA | 5.4 | 700 | 748 | 21,658 | 2034/8/12 |
| | BONOS DE TESORERIA | 5.35 | 700 | 699 | 20,252 | 2040/8/12 |
| | PERU BONO SOBERANO | 8.2 | 700 | 934 | 27,048 | 2026/8/12 |
| | PERU BONO SOBERANO | 6.95 | 1,300 | 1,639 | 47,450 | 2031/8/12 |
| | PERU BONO SOBERANO | 6.9 | 1,020 | 1,208 | 34,985 | 2037/8/12 |
| | REPUBLIC OF PERU | 6.35 | 1,100 | 1,373 | 39,755 | 2028/8/12 |
| 小 計 | | | | | 239,472 | |
| ウルグアイ | | | 千ウルグアイペソ | 千ウルグアイペソ | | |
| 国債証券 | REPUBLICA ORIENT URUGUAY | 8.5 | 4,000 | 4,278 | 10,568 | 2028/3/15 |
| 小 計 | | | | | 10,568 | |
| 南アフリカ | | | 千ランド | 千ランド | | |
| 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.75 | 6,000 | 6,333 | 45,790 | 2023/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10.5 | 14,900 | 17,346 | 125,416 | 2026/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 14,700 | 14,051 | 101,591 | 2030/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.0 | 4,460 | 3,835 | 27,728 | 2031/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25 | 7,000 | 6,391 | 46,211 | 2032/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.875 | 4,000 | 3,592 | 25,977 | 2035/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.25 | 4,800 | 3,364 | 24,326 | 2036/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.5 | 11,200 | 9,480 | 68,546 | 2037/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 9.0 | 7,100 | 6,138 | 44,379 | 2040/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.5 | 4,450 | 2,942 | 21,275 | 2041/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 11,800 | 9,798 | 70,841 | 2044/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 11,500 | 9,564 | 69,150 | 2048/2/28 |
| | 小 計 | | | | | 671,234 |
| 合 計 | | | | | 8,924,920 | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年2月18日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 8,924,920 | % 97.6 |
| コール・ローン等、その他 | 217,055 | 2.4 |
| 投資信託財産総額 | 9,141,975 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（9,121,997千円）の投資信託財産総額（9,141,975千円）に対する比率は99.8%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=105.74円、1トルコリラ=15.17円、1チェココルナ=4.93円、1フォロント=0.3555円、1ズロチ=28.35円、1ルーブル=1.43円、1ドミニカペソ=1.82円、1レイ=26.13円、1リンギ=26.21円、1パーツ=3.52円、1フィリピンペソ=2.19円、1ルピア=0.0076円、1オフショア人民元=16.44円、1メキシコペソ=5.24円、1リアル=19.53円、1チリペソ=0.1479円、1コロンビアペソ=0.0299円、1ソル=28.95円、1ウルグアイペソ=2.47円、1ランド=7.23円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年2月18日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 9,156,777,310 |
| コール・ローン等 | 103,719,268 |
| 公社債(評価額) | 8,924,920,520 |
| 未収入金 | 14,802,200 |
| 未収利息 | 104,838,032 |
| 前払費用 | 8,497,290 |
| (B) 負債 | 17,317,253 |
| 未払金 | 14,830,838 |
| 未払解約金 | 2,088,397 |
| 未払利息 | 18 |
| その他未払費用 | 398,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 9,139,460,057 |
| 元本 | 6,511,390,712 |
| 次期繰越損益金 | 2,628,069,345 |
| (D) 受益権総口数 | 6,511,390,712口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,036円 |

(注) 期首元本額は5,640,119,763円、期中追加設定元本額は2,837,219,021円、期中一部解約元本額は1,965,948,072円、1口当たり純資産額は1.4036円です。

○損益の状況 (2020年2月19日～2021年2月18日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 408,769,350 |
| 受取利息 | 408,769,006 |
| その他収益金 | 7,766 |
| 支払利息 | △ 7,422 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 393,475,824 |
| 売買益 | 308,801,002 |
| 売買損 | △ 702,276,826 |
| (C) 保管費用等 | △ 9,385,949 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 5,907,577 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,383,712,383 |
| (F) 追加信託差損益金 | 896,964,157 |
| (G) 解約差損益金 | △ 658,514,772 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 2,628,069,345 |
| 次期繰越損益金(H) | 2,628,069,345 |

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 |
|---------------------------------------|---------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| ノムラPOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用） | 3,515,175,837 |
| 野村インデックスファンド・新興国債券 | 870,100,530 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 827,647,635 |
| 野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド | 376,963,613 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 318,456,568 |
| オールウェザー・ファクターアロケーションオープン投信（適格機関投資家専用） | 144,599,668 |
| 世界6資産分散ファンド | 112,800,187 |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド） | 77,563,992 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 46,511,859 |
| ネクストコア | 44,426,750 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 36,736,074 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 36,285,655 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 26,448,465 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 19,639,346 |

| ファンド名 | 当期末 |
|--|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 19,469,436 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 7,364,607 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 5,962,103 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030 | 5,861,256 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 4,863,528 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040 | 3,962,360 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 2,469,060 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050 | 2,205,273 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 1,986,538 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,300,572 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 921,913 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060 | 838,875 |
| 野村POFs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） | 829,012 |

○お知らせ

該当事項はございません。

J-REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日2021年6月10日）

作成対象期間（2020年6月11日～2021年6月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | わが国のREIT（不動産投資信託証券）（「J-REIT」といいます。）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主な投資対象 | J-REITを主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への直接投資は行いません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 投資信託 組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|--------------------|-------|--------------|--------|
| | 期騰落 | 中率 | 東証REIT指数 (配当込み) | 期騰落中率 | | |
| | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 12期(2017年6月12日) | 19,362 | △ 4.3 | 3,254.14 | △ 4.3 | 98.2 | 28,442 |
| 13期(2018年6月11日) | 20,182 | 4.2 | 3,387.54 | 4.1 | 97.8 | 33,180 |
| 14期(2019年6月10日) | 23,229 | 15.1 | 3,896.50 | 15.0 | 97.7 | 40,406 |
| 15期(2020年6月10日) | 22,155 | △ 4.6 | 3,713.86 | △ 4.7 | 96.6 | 37,084 |
| 16期(2021年6月10日) | 28,259 | 27.6 | 4,732.62 | 27.4 | 97.0 | 48,024 |

東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 投資信託 組入比率 |
|--------------------|--------|-------|--------------------|-------|--------------|
| | 騰落 | 率 | 東証REIT指数 (配当込み) | 騰落率 | |
| (期首) 2020年6月10日 | 円 | % | | % | % |
| | 22,155 | — | 3,713.86 | — | 96.6 |
| 6月末 | 21,030 | △ 5.1 | 3,525.99 | △ 5.1 | 96.6 |
| 7月末 | 21,087 | △ 4.8 | 3,535.10 | △ 4.8 | 96.6 |
| 8月末 | 22,282 | 0.6 | 3,735.15 | 0.6 | 95.9 |
| 9月末 | 22,060 | △ 0.4 | 3,698.94 | △ 0.4 | 96.8 |
| 10月末 | 20,958 | △ 5.4 | 3,512.43 | △ 5.4 | 97.0 |
| 11月末 | 21,696 | △ 2.1 | 3,635.82 | △ 2.1 | 97.0 |
| 12月末 | 23,005 | 3.8 | 3,854.76 | 3.8 | 95.9 |
| 2021年1月末 | 23,898 | 7.9 | 4,004.00 | 7.8 | 96.0 |
| 2月末 | 25,130 | 13.4 | 4,207.24 | 13.3 | 95.6 |
| 3月末 | 26,268 | 18.6 | 4,399.26 | 18.5 | 95.9 |
| 4月末 | 26,984 | 21.8 | 4,518.99 | 21.7 | 96.8 |
| 5月末 | 27,174 | 22.7 | 4,551.00 | 22.5 | 96.9 |
| (期末) 2021年6月10日 | 28,259 | 27.6 | 4,732.62 | 27.4 | 97.0 |

*騰落率は期首比です。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

○投資環境

国内REIT市場は、期首から新型コロナウイルスの感染再拡大への警戒感から、保有施設の利用低迷が懸念されたことなどを背景に下落しました。その後は、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大に対する警戒感が高まる一方、国内REITの分配金利回りの相対的な高さなどが好感されたことや、新型コロナウイルスのワクチン開発進展への期待感などから、一進一退の展開となりました。

2020年12月以降は、新型コロナウイルスのワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどを受けて上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・REIT組入比率

REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

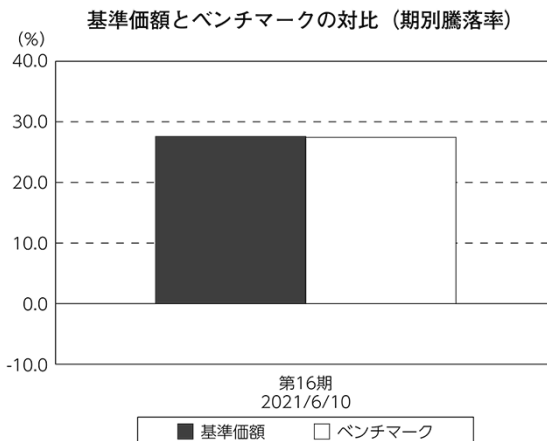
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果を目指すため、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証REIT指数でほぼ同水準になるよう銘柄間の投資比率調整を行なってまいりました。なお、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+27.6%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の+27.4%を0.2ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

- ・ベンチマークの変更に起因する売買などの影響
- ・実質REIT組入比率が100%に満たないことの影響が、指数の上昇時にはマイナスに、下落時にはプラスに作用したこと



(注) ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

◎今後の運用方針

引き続き、REITの実質組入比率を高位に維持し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2020年6月11日～2021年6月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (投 資 信 託 証 券) | 1 | 0.002 | |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | (0) | (0.001) | |
| | (0) | (0.002) | |
| 合 計 | 1 | 0.002 | |
| 期中の平均基準価額は、23,464円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年6月11日～2021年6月10日)

投資信託証券

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | | |
|-----|------------------------------|-----------|-------------|-------|---------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 | |
| | 口 | 千円 | 口 | 千円 | |
| 国 | エスコンジャパンリート投資法人 投資証券 | 334 | 36,353 | 158 | 18,220 |
| | サンケイリアルエステート投資法人 投資証券 | 647 | 61,768 | 238 | 24,035 |
| | S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券 | 420 | 54,208 | 244 | 32,917 |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 419 | 253,983 | 347 | 213,521 |
| | MCUBS MidCity投資法人 投資証券 | 1,058 | 84,981 | 1,147 | 92,375 |
| | | (△ 4,958) | (△ 447,304) | | |
| | 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 1,365 | 189,668 | 1,190 | 167,818 |
| | 産業ファンド投資法人 投資証券 | 2,000 | 369,010 | 1,409 | 260,622 |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 1,033 | 325,657 | 962 | 305,260 |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 834 | 158,069 | 672 | 127,316 |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 541 | 222,727 | 507 | 214,592 |
| 内 | GLP投資法人 投資証券 | 5,668 | 940,472 | 2,959 | 493,799 |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 533 | 165,652 | 447 | 141,069 |
| | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 1,937 | 658,792 | 1,529 | 519,383 |
| | 星野リゾート・リート投資法人 投資証券 | 171 | 89,379 | 161 | 84,304 |
| | Oneリート投資法人 投資証券 | 174 | 45,145 | 163 | 43,092 |
| | イオンリート投資法人 投資証券 | 1,096 | 137,404 | 1,282 | 158,840 |
| | ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 972 | 144,638 | 999 | 145,208 |
| | 日本リート投資法人 投資証券 | 353 | 128,862 | 331 | 123,051 |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|----|---------------------|--------------------|--------------------|--------|-----------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | 大和証券リビング投資法人 投資証券 | 1,692 | 172,722 | 1,282 | 132,378 |
| | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券 | 1,006 | 128,115 | 931 | 119,706 |
| | 合 計 | 74,263 (9,611) | 11,999,582 (-) | 64,473 | 9,967,138 |

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

* () 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

| 種類別 | | 買建 | | 売建 | |
|-----|----------|--------------|--------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 国内 | REIT先物取引 | 百万円 5,187 | 百万円 5,339 | 百万円 - | 百万円 - |

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年6月11日～2021年6月10日)

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項目 | 当期 |
|------------------|-------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 898千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 9千円 |
| (B) / (A) | 1.0% |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021年6月10日現在)

国内投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|-------------------------------|---------|--------|-----------|-------|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 口 | 口 | 千円 | % |
| エスコンジャパンリート投資法人 投資証券 | 478 | 654 | 92,148 | 0.2 |
| サンケイリアルエステート投資法人 投資証券 | 570 | 979 | 125,507 | 0.3 |
| S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券 | 876 | 1,052 | 158,641 | 0.3 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 1,307 | 1,379 | 897,729 | 1.9 |
| MCUBS M i d C i t y 投資法人 投資証券 | 5,047 | — | — | — |
| 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 4,526 | 4,701 | 772,844 | 1.6 |
| 産業ファンド投資法人 投資証券 | 5,066 | 5,657 | 1,163,644 | 2.4 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 3,731 | 3,802 | 1,395,334 | 2.9 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 2,566 | 2,728 | 636,442 | 1.3 |
| アクティビア・プロバティーズ投資法人 投資証券 | 1,971 | 2,005 | 1,020,545 | 2.1 |
| GLP 投資法人 投資証券 | 9,797 | 12,506 | 2,349,877 | 4.9 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 1,713 | 1,799 | 642,243 | 1.3 |
| 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 5,919 | 6,327 | 2,246,085 | 4.7 |
| 星野リゾート・リート投資法人 投資証券 | 599 | 609 | 427,518 | 0.9 |
| O n e リート投資法人 投資証券 | 613 | 624 | 201,240 | 0.4 |
| イオンリート投資法人 投資証券 | 4,245 | 4,059 | 645,381 | 1.3 |
| ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 3,345 | 3,318 | 612,502 | 1.3 |
| 日本リート投資法人 投資証券 | 1,278 | 1,300 | 591,500 | 1.2 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券 | 25,272 | 25,434 | 572,773 | 1.2 |
| 積水ハウス・リート投資法人 投資証券 | 11,502 | 11,772 | 1,091,264 | 2.3 |
| トーセイ・リート投資法人 投資証券 | 856 | 885 | 123,280 | 0.3 |
| ケネディクス商業リート投資法人 投資証券 | 1,519 | 1,592 | 474,734 | 1.0 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券 | 839 | 854 | 124,342 | 0.3 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 787 | 770 | 97,636 | 0.2 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 12,699 | 12,943 | 2,367,274 | 4.9 |
| いちごホテルリート投資法人 投資証券 | 652 | 700 | 71,820 | 0.1 |
| ラサールロジポート投資法人 投資証券 | 3,657 | 4,841 | 874,768 | 1.8 |
| スターアジア不動産投資法人 投資証券 | 1,305 | 4,112 | 250,832 | 0.5 |
| マリモ地方創生リート投資法人 投資証券 | 388 | 375 | 52,012 | 0.1 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券 | 1,119 | 1,397 | 820,039 | 1.7 |
| 大江戸温泉リート投資法人 投資証券 | 668 | 646 | 55,556 | 0.1 |
| さくら総合リート投資法人 投資証券 | 851 | — | — | — |
| 投資法人みらい 投資証券 | 4,473 | 4,323 | 224,796 | 0.5 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券 | 923 | 867 | 124,587 | 0.3 |
| 三菱地所物流リート投資法人 投資証券 | 774 | 1,007 | 485,374 | 1.0 |
| CRE ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 740 | 1,281 | 239,418 | 0.5 |
| ザイマックス・リート投資法人 投資証券 | 571 | 613 | 75,766 | 0.2 |
| タカラレーベン不動産投資法人 投資証券 | 1,116 | 1,203 | 147,608 | 0.3 |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券 | 819 | 1,552 | 232,024 | 0.5 |
| 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 3,809 | 4,504 | 3,283,416 | 6.8 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 3,934 | 4,002 | 2,749,374 | 5.7 |
| 日本都市ファンド投資法人 投資証券 | 7,435 | 19,935 | 2,302,492 | 4.8 |
| オリックス不動産投資法人 投資証券 | 7,838 | 7,975 | 1,706,650 | 3.6 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券 | 2,585 | 2,492 | 1,122,646 | 2.3 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | |
|------------------------|---------------|---------|-----------|------------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 | |
| | 口 | 口 | 千円 | % | |
| NTT都市開発リート投資法人 | 3,553 | 3,615 | 601,174 | 1.3 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 投資証券 | 2,637 | 2,683 | 543,844 | 1.1 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券 | 2,732 | 2,779 | 354,044 | 0.7 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 8,832 | 8,559 | 1,377,999 | 2.9 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 投資証券 | 2,811 | 2,860 | 457,886 | 1.0 | |
| インヴェンシブル投資法人 投資証券 | 17,255 | 16,735 | 779,851 | 1.6 | |
| フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 1,397 | 1,328 | 693,216 | 1.4 | |
| 平和不動産リート投資法人 投資証券 | 2,450 | 2,586 | 446,602 | 0.9 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 2,570 | 2,615 | 843,337 | 1.8 | |
| 福岡リート投資法人 投資証券 | 2,034 | 2,070 | 380,673 | 0.8 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 1,217 | 1,238 | 1,000,304 | 2.1 | |
| いちごオフィスリート投資法人 投資証券 | 3,046 | 3,279 | 331,506 | 0.7 | |
| 大和証券オフィス投資法人 投資証券 | 908 | 853 | 678,135 | 1.4 | |
| 阪急阪神リート投資法人 投資証券 | 1,777 | 1,808 | 287,291 | 0.6 | |
| スターツプロシード投資法人 投資証券 | 613 | 623 | 151,139 | 0.3 | |
| 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 5,612 | 5,711 | 1,867,497 | 3.9 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 12,672 | 12,894 | 907,737 | 1.9 | |
| 大和証券リビング投資法人 投資証券 | 4,816 | 5,226 | 624,507 | 1.3 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 投資証券 | 3,639 | 3,714 | 606,496 | 1.3 | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 231,349 | 250,750 | 46,582,915 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 63 | 61 | < 97.0% > | |

*評価額の単位未満は切り捨て。

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 | 当 期 末 | |
|----------------------|--------------|----------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 REIT先物取引 東証REIT指数 | 百万円 1,437 | 百万円 — |

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年6月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資証券 | 46,582,915 | 96.9 |
| コール・ローン等、その他 | 1,507,227 | 3.1 |
| 投資信託財産総額 | 48,090,142 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 48,090,142,541 |
| コール・ローン等 | 1,120,371,368 |
| 投資証券(評価額) | 46,582,915,980 |
| 未収入金 | 52,628,126 |
| 未収配当金 | 267,568,467 |
| 差入委託証拠金 | 66,658,600 |
| (B) 負債 | 66,050,917 |
| 未払解約金 | 66,049,836 |
| 未払利息 | 1,081 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 48,024,091,624 |
| 元本 | 16,994,222,275 |
| 次期繰越損益金 | 31,029,869,349 |
| (D) 受益権総口数 | 16,994,222,275口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 28,259円 |

(注) 期首元本額は16,738,803,506円、期中追加設定元本額は5,226,115,786円、期中一部解約元本額は4,970,697,017円、1口当たり純資産額は2.8259円です。

○損益の状況 (2020年6月11日～2021年6月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,569,241,079 |
| 受取配当金 | 1,552,236,004 |
| その他収益金 | 17,253,170 |
| 支払利息 | △ 248,095 |
| (B) 有価証券売買損益 | 8,741,909,999 |
| 売買益 | 9,099,183,373 |
| 売買損 | △ 357,273,374 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 315,395,930 |
| 取引益 | 341,409,510 |
| 取引損 | △ 26,013,580 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 10,626,547,008 |
| (E) 前期繰越損益金 | 20,346,107,097 |
| (F) 追加信託差損益金 | 6,662,931,189 |
| (G) 解約差損益金 | △ 6,605,715,945 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 31,029,869,349 |
| 次期繰越損益金(H) | 31,029,869,349 |

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 |
|--------------------------------------|---------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村インデックスファンド・J-REIT | 3,358,422,990 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 2,212,034,160 |
| 野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け) | 2,173,190,580 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 1,712,108,774 |
| J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用) | 1,704,770,108 |
| 野村6資産均等バランス | 1,489,985,949 |
| 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 | 995,602,736 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 844,896,999 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 801,797,475 |
| 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) | 540,233,168 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 422,144,431 |
| 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) | 188,337,138 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT | 146,674,229 |
| 野村世界REITインデックスAコース(野村投資一任口座向け) | 90,621,998 |
| ノムラFOfs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用) | 85,140,380 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 36,224,951 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 35,771,156 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 20,768,515 |
| ネクストコア | 20,474,065 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 18,617,496 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 18,099,489 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 14,455,177 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 14,376,678 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース | 7,233,824 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース | 6,860,202 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 4,487,175 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040 | 3,713,802 |
| インデックス・ブレンド(タイプIII) | 3,672,458 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 3,557,597 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 3,521,491 |
| インデックス・ブレンド(タイプV) | 3,395,978 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース | 3,159,129 |
| オールウェザー・ファクター・アロケーションオープン投信(適格機関投資家専用) | 2,107,611 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 1,969,610 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050 | 1,582,128 |
| インデックス・ブレンド(タイプIV) | 1,066,887 |
| インデックス・ブレンド(タイプII) | 974,275 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060 | 872,180 |
| インデックス・ブレンド(タイプI) | 838,577 |
| 野村FOfs用・ターゲット・リターン・資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用) | 449,484 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 11,225 |

○お知らせ

該当事項はございません。

海外REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日2021年6月10日）

作成対象期間（2020年6月11日～2021年6月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 日本を除く世界各国のREIT（不動産投資信託証券）を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 |

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 投資信託 組入比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|-------|--------|-------|--------------|-----------|
| | 期騰落 | 中率 | 期騰落 | 中率 | | |
| | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 12期(2017年6月12日) | 21,472 | 4.6 | 226.73 | 5.1 | 99.4 | 20,175 |
| 13期(2018年6月11日) | 22,049 | 2.7 | 234.01 | 3.2 | 98.5 | 20,604 |
| 14期(2019年6月10日) | 24,241 | 9.9 | 259.20 | 10.8 | 99.1 | 26,012 |
| 15期(2020年6月10日) | 22,140 | △ 8.7 | 237.33 | △ 8.4 | 99.4 | 29,052 |
| 16期(2021年6月10日) | 29,050 | 31.2 | 312.73 | 31.8 | 99.4 | 41,524 |

ベンチマーク(=S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)をもとに、当社が独自に円換算した指数です(設定時を100としています)。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で円換算しております。

(出所) スタンダード・アンド・プアーズ、ブルームバーグ

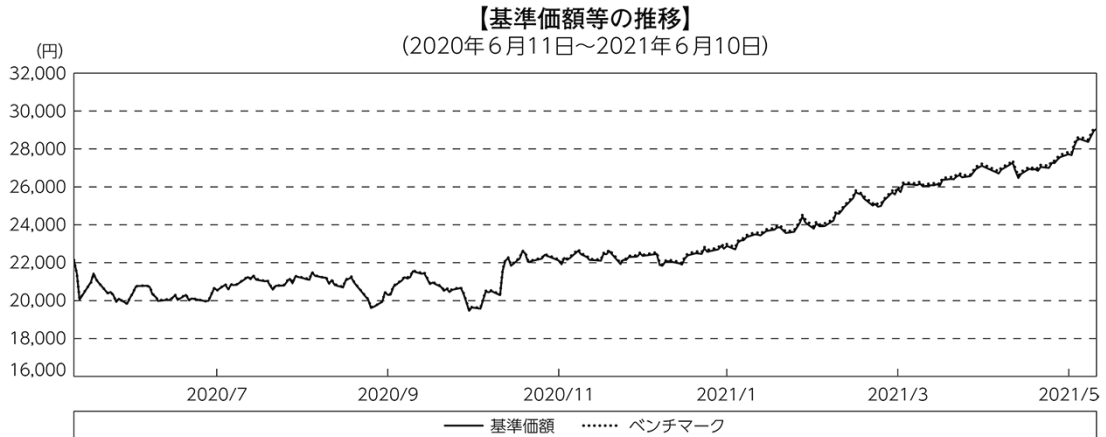
○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 投資信託 組入比率 |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------------|
| | 騰落 | 率 | 騰落 | 率 | |
| (期首) 2020年6月10日 | 円 | % | | % | % |
| | 22,140 | — | 237.33 | — | 99.4 |
| 6月末 | 20,164 | △ 8.9 | 216.22 | △ 8.9 | 99.1 |
| 7月末 | 20,541 | △ 7.2 | 220.08 | △ 7.3 | 99.2 |
| 8月末 | 21,179 | △ 4.3 | 227.27 | △ 4.2 | 99.2 |
| 9月末 | 20,305 | △ 8.3 | 217.92 | △ 8.2 | 99.0 |
| 10月末 | 19,642 | △ 11.3 | 210.77 | △ 11.2 | 99.0 |
| 11月末 | 22,116 | △ 0.1 | 237.66 | 0.1 | 99.1 |
| 12月末 | 22,356 | 1.0 | 240.28 | 1.2 | 99.0 |
| 2021年1月末 | 22,883 | 3.4 | 246.40 | 3.8 | 99.2 |
| 2月末 | 24,110 | 8.9 | 260.12 | 9.6 | 99.2 |
| 3月末 | 25,899 | 17.0 | 278.58 | 17.4 | 99.0 |
| 4月末 | 27,121 | 22.5 | 291.78 | 22.9 | 99.0 |
| 5月末 | 27,731 | 25.3 | 298.48 | 25.8 | 99.0 |
| (期末) 2021年6月10日 | 29,050 | 31.2 | 312.73 | 31.8 | 99.4 |

*騰落率は期首比です。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったことなどを受けて、主要投資国のREIT市場が上昇したことにより基準価額は上昇しました。

○投資環境

当運用期間中のREIT市場は、期首から新型コロナウイルスのワクチン開発への期待や経済活動再開による景気回復への期待が高まる一方で、利益確定の動きや新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大への懸念などから一進一退の展開となりました。2020年11月に入ると、米大手製薬会社が新型コロナウイルスワクチンの臨床試験による高い有効性を発表したことや、米大統領・議会選挙の結果を受けて上昇しました。その後も、新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったこと、欧米の経済指標が市場予想を上回ったことなどをを受けて上昇しました。

為替市場は、期首からFOMC（米連邦公開市場委員会）でゼロ金利政策の維持が表明され、米国の低金利が長期化すると観測や、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大などが懸念される中、主要投資通貨である米ドルは対円で下落（円高）しました。2021年1月以降は、米長期金利が上昇し日米金利差の拡大が意識されたことや、米国で新型コロナウイルスの新規感染者数の減少傾向が見られたことなどから上昇（円安）に転じましたが、4月以降は、米長期金利の上昇一服を背景に日米金利差の拡大観測が後退したことや、新興国を中心とする新型コロナウイルスの感染拡大などから投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどをを受けて下落（円高）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・REIT組入比率

REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の動きをとらえるために、「S&P先進国REIT指数（除く日本）」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の中で各銘柄が占める比率にほぼ一致させました。期中の「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行い、資金流出入に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+31.2%となり、ベンチマークである「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の+31.8%を0.6ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

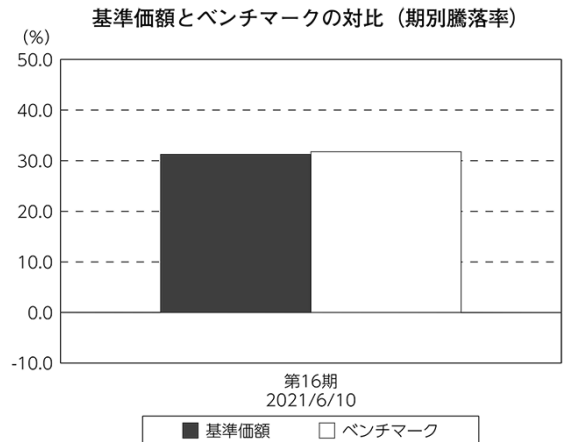
（その他の要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）

◎今後の運用方針

引き続き、「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



（注）ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。

「S&P先進国REIT指数（除く日本）」はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しいかなる意思表示等を行なうものではありません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年6月11日～2021年6月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|--------------------------|----------------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 円 4 (4) (0) | % 0.017 (0.016) (0.001) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券) | 2 (2) | 0.011 (0.011) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 16 (4) (11) | 0.069 (0.019) (0.050) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 22 | 0.097 | |
| 期中の平均基準価額は、22,837円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2020年6月11日～2021年6月10日)

投資信託証券

| 銘柄 | 買付 | | 売付 | |
|--------------------------------------|---------------------|------------------|--------|-------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| アメリカ | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| ACADIA REALTY TRUST | 5,000 | 83 | 3,300 | 55 |
| AGREE REALTY CORP | 5,800 | 376 | 1,300 | 85 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 20,300 | 260 | 3,100 | 52 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 9,470 | 1,580 | 6,300 | 1,037 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 1,000 | 24 | — | — |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 7,300 | 289 | 4,300 | 174 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 3,000 | 22 | — | — |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 19,800 | 601 | 11,800 | 364 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 25,200 | 933 | 7,300 | 261 |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 6,122 (36,357) | 251 (1,779) | 5,679 | 233 |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 5,800 (△ 36,500) | 201 (△ 1,515) | 3,100 | 105 |
| APARTMENT INCOME REIT CO | 2,200 (36,800) | 98 (—) | 2,100 | 89 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 4,700 | 59 | 2,200 | 32 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 15,400 | 136 | 1,200 | 13 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | — (△ 15,600) | — (△ 23) | — | — |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | — (1,560) | — (23) | 1,560 | 3 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 7,420 | 1,196 | 5,090 | 873 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 2,800 | 21 | — | — |
| BOSTON PROPERTIES | 7,650 | 688 | 5,690 | 560 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | — | — | 6,000 | 16 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 9,200 | 103 | 7,200 | 80 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 16,100 | 235 | 10,200 | 172 |
| BROADSTONE NET LEASE INC-A | 9,000 | 167 | — | — |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | 1,500 | 18 | 6,700 | 95 |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES | — | — | 40,000 | 6 |
| CIM COMMERCIAL TRUST CORP | 2,600 | 28 | — | — |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 5,110 | 503 | 3,070 | 312 |
| CARETRUST REIT INC ACQUIRES | 1,500 | 26 | — | — |
| CEDAR REALTY TRUST INC | — | — | 16,000 | 12 |
| CITY OFFICE REIT INC | — | — | 1,900 | 19 |
| COLONY CAPITAL INC | 17,000 | 86 | 4,000 | 24 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 5,800 | 80 | 3,400 | 48 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 600 | 28 | — | — |
| CORESITE REALTY CORP | 3,090 | 377 | 1,630 | 199 |
| CORECIVIC INC | 2,400 | 14 | 30,000 | 195 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 5,400 | 141 | 2,500 | 66 |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|--------------------------------------|----------|-------|-----------|-------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| アメリカ | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| COUSINS PROPERTIES INC | 8,200 | 258 | 4,300 | 144 |
| CTO REALTY GROWTH INC | 1,200 | 53 | — | — |
| CUBESMART | 12,100 | 416 | 7,000 | 240 |
| CYRUSONE INC | 7,250 | 531 | 3,700 | 265 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 10,000 | 82 | 4,000 | 31 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 17,950 | 2,589 | 8,800 | 1,247 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 7,000 | 24 | — | — |
| DOUGLAS EMMETT INC | 9,700 | 273 | 6,700 | 207 |
| DUKE REALTY CORP | 22,500 | 887 | 14,700 | 585 |
| EPR PROPERTIES | 1,900 | 62 | 1,400 | 54 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 2,500 | 57 | — | — |
| EASTGROUP PROPERTIES | 2,160 | 299 | 1,140 | 160 |
| EQUINIX INC | 4,990 | 3,678 | 3,160 | 2,228 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 5,800 | 162 | 3,500 | 100 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 10,200 | 648 | 10,300 | 655 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 19,900 | 1,163 | 15,600 | 962 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 9,200 | 187 | 1,100 | 22 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3,710 | 869 | 2,800 | 698 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 7,910 | 934 | 5,060 | 599 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 1,300 | 14 | — | — |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 3,120 | 279 | 2,230 | 211 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 7,100 | 305 | 4,700 | 204 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 4,100 | 111 | 800 | 22 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | — | — | — | — |
| GEO GROUP INC/THE | 2,500 | 28 | (11,300) | (97) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 16,157 | 648 | 10,957 | 450 |
| | (1,700) | (67) | | |
| GETTY REALTY CORP | 1,000 | 26 | — | — |
| GLADSTONE LAND CORP | 1,600 | 22 | — | — |
| GLOBAL NET LEASE INC | 1,600 | 24 | — | — |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 1,500 | 18 | — | — |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 7,800 | 237 | 3,700 | 110 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 13,900 | 373 | 6,600 | 179 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 37,600 | 1,070 | 18,400 | 552 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 1,800 | 14 | — | — |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 5,700 | 215 | 3,300 | 132 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 213,200 | 2,384 | 202,400 | 2,231 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 7,900 | 181 | 6,500 | 168 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 5,400 | 69 | — | — |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 1,200 | 24 | — | — |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 2,320 | 314 | 370 | 66 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 400 | 28 | — | — |
| INVITATION HOMES INC | 37,700 | 1,115 | 21,000 | 630 |
| IRON MOUNTAIN INC | 17,300 | 535 | 12,300 | 391 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 6,900 | 193 | 6,500 | 194 |

| 銘 | 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|-------------------------------|-------------------------------------|-------------------|--------------------|-----------------|-------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | | 千米ドル | | 千米ドル |
| | KILROY REALTY CORP | 6,900 | 403 | 3,000 | 184 |
| | KIMCO REALTY CORP | 22,300 | 317 | 13,100 | 213 |
| | KITE REALTY GROUP TRUST | 3,800 | 58 | 1,500 | 29 |
| | LTC PROPERTIES INC | 1,300 | 48 | 1,000 | 37 |
| | LEXINGTON REALTY TRUST | 16,600 | 179 | 4,700 | 51 |
| | LIFE STORAGE INC | 3,680 (6,035) | 386 (-) | 1,805 | 185 |
| | MACERICH CO /THE | 2,158 | 31 | - | - |
| | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 42,000 | 841 | 18,600 | 379 |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 6,500 | 822 | 4,460 | 588 |
| | MONMOUTH REIT-CLASS A | 1,800 | 25 | - | - |
| | NATL HEALTH INVESTORS INC | 2,200 | 143 | 1,000 | 67 |
| | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 9,700 | 373 | 4,900 | 201 |
| | NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 2,700 | 97 | - | - |
| | NETSTREIT CORP | 5,800 | 112 | - | - |
| | NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 600 | 26 | 500 | 17 |
| | OFFICE PROPERTIES INCOME | 1,000 | 18 | - | - |
| | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 15,300 | 510 | 7,500 | 268 |
| | ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 749 (51) | 15 (0.88787) | - | - |
| | PS BUSINESS PARKS INC/CA | 580 | 78 | 200 | 31 |
| | PARAMOUNT GROUP INC | - | - | 4,600 | 35 |
| | PARK HOTELS & RESORTS INC | 11,400 | 171 | 6,800 | 117 |
| | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 6,300 | 112 | 3,100 | 65 |
| | PENN REAL ESTATE INVEST TST | - | - | 11,500 | 4 |
| | PHYSICIANS REALTY TRUST | 11,500 | 206 | 4,500 | 79 |
| | PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 4,900 | 74 | 3,400 | 56 |
| | PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 3,000 | 42 | - | - |
| | PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 1,800 | 14 | - | - |
| | PROLOGIS INC | 40,600 | 4,183 | 27,250 | 2,787 |
| | PUBLIC STORAGE | 8,840 | 2,028 | 5,730 | 1,313 |
| | QTS REALTY TRUST INC CL A | 4,100 | 260 | 1,700 | 106 |
| | RLJ LODGING TRUST | 7,000 | 83 | 5,800 | 71 |
| | REALTY INCOME CORP | 27,100 | 1,673 | 13,400 | 833 |
| | REGENCY CENTERS CORP | 9,100 | 421 | 8,700 | 419 |
| | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 9,300 | 131 | 6,800 | 95 |
| | RETAIL PROPERTIES OF AME-A | 9,500 | 76 | 5,500 | 51 |
| RETAIL VALUE INC | 979 (201) | 14 (2) | - | - | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 9,300 | 446 | 3,800 | 186 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 2,000 | 105 | 900 | 64 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 3,400 | 173 | 3,700 (18,600) | 198 (1,045) | |
| SL GREEN REALTY CORP | 1,400 (18,561) | 95 (1,075) | 2,661 | 184 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 11,600 | 174 | 4,800 | 77 | |

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|--|--------------------------|---------------------|-------------------------|---------------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | | 口 数 | 口 数 | 口 数 |
| | MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | (-) | (5) | (-) | (-) |
| | 小 計 | 1,606,495 (196,968) | 56,415 (1,405) | 1,040,352 (45,000) | 34,190 (1,814) |
| | カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 3,400 | 125 | 1,700 | 69 |
| | AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST | 4,000 | 41 | - | - |
| | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 1,700 | 23 | 1,100 | 16 |
| | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 5,000 | 245 | 3,200 | 164 |
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 11,500 | 148 | 5,000 | 65 |
| | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 3,000 | 21 | 2,000 | 18 |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 1,300 | 28 | 1,400 | 29 |
| | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 5,900 | 72 | - | - |
| | FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | 5,800 | 83 | 3,900 | 57 |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 2,500 | 193 | 2,000 | 151 |
| | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 11,700 | 147 | 6,300 | 87 |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 3,600 | 47 | - | - |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 3,100 | 53 | 1,600 | 28 |
| | NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST | - | - | (7,200) | (251) |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 9,700 | 119 | 3,900 | 49 |
| | PLAZA RETAIL REIT | 12,000 | 44 | - | - |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 7,000 | 114 | 3,700 | 68 |
| | SLATE OFFICE REIT | 2,100 | 8 | - | - |
| | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 6,300 | 148 | 3,800 | 94 |
| | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 7,000 | 91 | 2,100 | 27 |
| | WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I | 10,600 (-) | 189 (2) | - | - |
| | 小 計 | 117,200 (-) | 1,948 (2) | 41,700 (7,200) | 926 (251) |
| | イギリス | | 千英ポンド | | 千英ポンド |
| | BRITISH LAND | 44,000 | 181 | 29,000 | 136 |
| | DERWENT LONDON PLC | 7,000 | 203 | 3,300 | 101 |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 4,700 | 50 | - | - |
| | HAMMERSON PLC | (181,000) | (225) | - | - |
| | UNITE GROUP PLC | 29,100 | 280 | 13,900 | 141 |
| | SHAFTESBURY PLC | 24,600 (7,120) | 130 (36) | 7,120 | 35 |
| | SHAFTESBURY PLC RTS | - (7,120) | - (28) | - (7,120) | - (7) |
| | STANDARD LIFE INV PROP INC | 110,000 | 62 | - | - |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST | 50,000 | 16 | - | - |
| | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | - | - | 22,000 | 15 |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 7,200 | 61 | 2,000 | 16 |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 51,000 | 114 | 17,000 | 37 |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|------------------------------|-----------------------------------|------------|-------------|------------|-----------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 国 | イギリス | | 千英ポンド | | 千英ポンド |
| | SEGRO PLC | 86,600 | 817 | 44,700 | 420 |
| | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC | 29,000 | 39 | 11,000 | 18 |
| | WORKSPACE GROUP PLC | 7,500 | 56 | 5,100 | 38 |
| | GCP STUDENT LIVING PLC | 130,000 | 181 | 12,000 | 18 |
| | NEWRIVER REIT PLC | 17,000 | 14 | — | — |
| | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 52,000 | 56 | 36,000 | 37 |
| | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 16,000 | 17 | — | — |
| | TRIPLE POINT SOCIAL HOU-ENT RTS | (—) | (0.21351) | — | — |
| | TRIPLE POINT SOCIAL HOU-ENT RTS | (13,333) | (14) | (13,333) | (0.21351) |
| | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 198,000 | 214 | — | — |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 6,900 | 43 | 3,000 | 19 |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 63,000 | 104 | 25,000 | 43 |
| | RDI REIT PLC | 14,000 | 12 | — | — |
| | RDI REIT PLC | — | — | (70,000) | (57) |
| | CUSTODIAN REIT PLC | 97,000 | 90 | — | — |
| | HOME REIT PLC | 60,000 | 67 | — | — |
| | HAMMERSON PLC | 285,000 | 73 | 170,000 | 42 |
| | HAMMERSON PLC | (905,000) | (557) | — | — |
| | HAMMERSON PLC-NIL PAID RTS | — | — | — | — |
| | HAMMERSON PLC-NIL PAID RTS | (868,800) | (—) | (868,800) | (201) |
| | HAMMERSON PLC-FULL PAID | — | — | — | — |
| | HAMMERSON PLC-FULL PAID | (868,800) | (331) | (868,800) | (331) |
| | ELITE COMMERCIAL REIT | 60,000 | 42 | 60,000 | 36 |
| | CAPITAL & REGIONAL PLC | — | — | 9,300 | 4 |
| | ASSURA PLC | 202,000 | 155 | 94,000 | 70 |
| | LXI REIT PLC | — | — | 11,192 | 14 |
| LXI REIT PLC | (14,192) | (18) | — | — | |
| LXI REIT PLC-ENT RTS | — | — | — | — | |
| LXI REIT PLC-ENT RTS | (14,192) | (17) | (14,192) | (0.37929) | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 91,000 | 136 | 44,000 | 65 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 45,800 | 274 | 34,400 | 225 | |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 74,000 | 76 | — | — | |
| 小計 | 1,862,400 | 3,576 | 654,012 | 1,538 | |
| 小計 | (2,517,557) | (778) | (1,842,245) | (599) | |
| ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ | |
| ドイツ | | | | | |
| HAMBORNER REIT AG | 1,600 | 14 | — | — | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 11,200 | 142 | 3,700 | 50 | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | (—) | (△ 45) | — | — | |
| 小計 | 12,800 | 156 | 3,700 | 50 | |
| 小計 | (—) | (△ 45) | — | — | |
| イタリア | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 4,000 | 12 | — | — | |
| 小計 | 4,000 | 12 | — | — | |

| 銘 | 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|-----------------------------|---------------------------------|-------------------|--------------------|---------------|-----------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | フランス | | | | |
| | ICADE | 2,080 | 116 | 800 | 51 |
| | ALTAREA | 100 (-) | 11 (△ 6) | - | - |
| | KLEPIERRE | 10,100 (-) | 157 (△ 39) | 8,000 | 138 |
| | GECINA SA | 2,760 | 324 | 1,980 | 242 |
| | COVIVIO | 2,800 | 178 | 1,100 | 77 |
| | MERCIALYS | 4,000 | 21 | - | - |
| | CARMILA | 11,400 (-) | 103 (△ 3) | - | - |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 7,900 | 415 | 5,300 | 331 |
| | 小 計 | 41,140 (-) | 1,330 (△ 50) | 17,180 | 841 |
| | オランダ | | | | |
| | EUROCOMMERCIAL PROPTEI-CVA | 2,200 | 32 | 1,800 | 25 |
| | NSI NV | 600 | 16 | - | - |
| | 小 計 | 2,800 | 49 | 1,800 | 25 |
| | スペイン | | | | |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 13,000 (-) | 95 (△ 2) | 6,100 | 49 |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | - (-) | - (△ 1) | - | - |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 17,200 (-) | 125 (△ 24) | 18,700 | 141 |
| | 小 計 | 30,200 (-) | 221 (△ 28) | 24,800 | 191 |
| | ベルギー | | | | |
| | BEFIMMO S. C. A. | 1,900 | 69 | 600 | 22 |
| | COFINIMMO | 2,570 | 320 | 1,280 | 160 |
| | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | 1,600 | 36 | 900 | 19 |
| | MONTEA | 390 | 38 | 460 | 43 |
| | AEDIFICA | 1,362 (1,338) | 132 (121) | 640 | 63 |
| | AEDIFICA RIGHTS | - (6,690) | - (-) | - (6,690) | - (9) |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 7,100 | 207 | 2,600 | 74 |
| | CARE PROPERTY INVEST | 6,000 | 162 | - | - |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 3,400 (680) | 169 (31) | - | - | |
| XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS | - (3,400) | - (-) | - (3,400) | - (2) | |
| 小 計 | 24,322 (12,108) | 1,137 (152) | 6,480 (10,090) | 383 (12) | |
| アイルランド | | | | | |
| HIBERNIA REIT PLC | 17,000 | 17 | 13,000 | 14 | |

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----------------------------------|--|------------------------|-------------------|----------------------|-----------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | アイルランド | | | | |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 10,000 | 13 | — | — |
| | 小 計 | 27,000 | 30 | 13,000 | 14 |
| | シンガポール | | | | |
| | CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE | — (72,000) | — (170) | — | — |
| | CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE | 360,000 (△ 360,000) | 170 (△ 170) | — | — |
| | 小 計 | 360,000 (△ 288,000) | 170 (—) | — | — |
| | ユ ー ロ 計 | 502,262 (△ 275,892) | 3,109 (28) | 66,960 (10,090) | 1,507 (12) |
| | 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| | LINK REIT | 107,300 | 7,092 | 73,700 | 5,032 |
| | PROSPERITY REIT | 40,000 | 97 | — | — |
| | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 40,000 | 141 | — | — |
| | CHAMPION REIT | 40,000 | 158 | — | — |
| | FORTUNE REIT | 50,000 | 358 | 20,000 | 145 |
| | 小 計 | 277,300 | 7,848 | 93,700 | 5,177 |
| | シンガポール | | 千シンガポールドル | | 千シンガポールドル |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 251,000 (450,694) | 497 (966) | 234,000 | 472 |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 220,000 (26,002) | 683 (46) | 152,000 | 471 |
| | ASCENDAS REAL ESTATE-RTS | — (26,002) | — (76) | — (26,002) | — (0.91) |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 50,000 | 84 | 88,000 (625,964) | 151 (1,158) |
| | SUNTEC REIT | 79,000 | 119 | 77,000 | 117 |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 216,000 (12,008) | 432 (16) | 208,000 | 415 |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS | — (12,008) | — (23) | — (12,008) | — (0.06102) |
| | KEPPEL REIT | 178,000 (—) | 205 (△ 0.6645) | 131,000 | 149 |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 154,000 (53,242) | 381 (125) | 54,000 | 129 |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST RTS | — (53,242) | — (124) | — (53,242) | — (1) |
| ESR REIT | 90,000 | 35 | — | — | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | — (—) | — (△ 2) | 20,000 | 24 | |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 39,000 (10,143) | 48 (9) | — | — | |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST RTS | — (10,143) | — (11) | — (10,143) | — (0.77891) | |

| 銘 | 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------|------------------------------------|-----------------------|-------------------|-----------------|----------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | シンガポール | | 口 | | 千シンガポールドル |
| | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 60,000 (176,400) | 25 (38) | — | — |
| | FIRST REAL ESTATE INVT-RTS | — (176,400) | — (35) | — (176,400) | — (8) |
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 16,000 (—) | 64 (△ 2) | 16,000 | 64 |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 400,000 (560,000) | 24 (37) | — | — |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RE-RTS | — (560,000) | — (33) | — (560,000) | — (5) |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 170,000 (—) | 512 (△ 0.4423) | 62,000 | 179 |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST-RIGHTS | — (20,900) | — (55) | — | — |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 126,000 (—) | 251 (△ 5) | 91,000 | 185 |
| | ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 50,000 (20,009) | 30 (11) | — | — |
| | ARA LOGOS LOGISTICS TRUST RTS | — (20,009) | — (11) | — (20,009) | — (0.94077) |
| | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 19,000 (—) | 22 (△ 1) | — | — |
| | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 40,000 (—) | 36 (△ 12) | 30,000 | 27 |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 60,000 | 33 | — | — |
| | SPH REIT | 40,000 | 35 | — | — |
| | SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 60,000 (—) | 30 (△0.80554) | — (221,306) | — (97) |
| | EC WORLD REIT | 60,000 | 40 | — | — |
| | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 37,000 | 28 | — | — |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 87,000 (—) | 81 (△ 4) | 37,000 | 39 |
| | OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | — (—) | — (△0.18306) | — | — |
| | LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 220,000 (—) | 162 (△ 0.8544) | — | — |
| | FRASERS HOSPITALITY TRUST | 60,000 (—) | 25 (△ 0.385) | — | — |
| | IREIT GLOBAL | 80,000 (36,320) | 57 (23) | — | — |
| | IREIT GLOBAL-RIGHTS | — (36,320) | — (17) | — (36,320) | — (5) |
| KEPPEL DC REIT | 59,000 | 170 | 23,000 | 63 | |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|---------|--------------------------------------|---------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| シンガポール | | 口 | 千シンガポールドル | 口 | 千シンガポールドル |
| | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 194,000 (-) | 268 (△ 15) | 63,000 | 86 |
| 小計 | | 3,115,000 (2,259,842) | 4,390 (1,618) | 1,286,000 (1,741,394) | 2,578 (1,279) |
| 韓国 | | | 千ウォン | | 千ウォン |
| | MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | 19,000 | 76,009 | - | - |
| | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 4,454 | 30,204 | - | - |
| | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 7,000 | 33,259 | - | - |
| | LOTTE REIT CO LTD | 20,000 (8,257) | 117,264 (41,855) | - | - |
| | LOTTE REIT CO LTD RTS | - (8,257) | - (40,418) | - (8,257) | - (3,089) |
| | KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 9,000 | 44,327 | - | - |
| | JR REIT XXVII | 28,000 | 149,975 | - | - |
| 小計 | | 87,454 (16,514) | 451,042 (82,273) | - (8,257) | - (3,089) |
| オーストラリア | | | 千豪ドル | | 千豪ドル |
| | BWP TRUST | 8,000 | 32 | - | - |
| | MIRVAC GROUP | 202,000 | 483 | 143,000 | 363 |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 40,000 | 35 | - | - |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 39,000 | 139 | 10,000 | 38 |
| | GPT GROUP | 100,000 | 425 | 55,000 | 252 |
| | CENTURIA CAPITAL GROUP | 113,200 (6,800) | 249 (15) | - | - |
| | CENTURIA CAPITAL GROUP RTS | - (6,800) | - (15) | - (6,800) | - (0.2415) |
| | ABACUS PROPERTY GROUP | 18,000 (-) | 50 (2) | 8,000 | 23 |
| | ABACUS PROPERTY -ASX INTERNAL RTS | - (16,250) | - (47) | - (16,250) | - (2) |
| | STOCKLAND TRUST GROUP | 159,000 | 653 | 133,000 | 559 |
| | DEXUS | 52,000 | 478 | 32,000 | 302 |
| | GOODMAN GROUP | 104,700 | 1,894 | 56,800 | 1,025 |
| | CHARTER HALL GROUP | 16,400 | 213 | 8,500 | 111 |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 8,000 | 25 | 6,000 | 20 |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 15,000 | 69 | - | - |
| | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 81,000 | 186 | 42,000 | 101 |
| | ARENA REIT | 24,000 | 63 | - | - |
| | CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 131,000 | 418 | 12,000 | 35 |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 44,000 (11,610) | 210 (55) | 8,000 | 36 |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT RTS | - (11,610) | - (53) | - (11,610) | - (1) |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 77,000 | 148 | 54,000 | 103 |
| | NATIONAL STORAGE REIT-RTS | - (38,596) | - (77) | - | - |

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|---|-----------|-------------|-----------|-------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 | オーストラリア | | 千豪ドル | | 千豪ドル |
| | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 28,000 | 74 | — | — |
| | APN INDUSTRIA REIT | 8,000 | 24 | — | — |
| | HOME CONSORTIUM | 44,000 | 175 | — | — |
| | IRONGATE GROUP | 125,000 | 170 | — | — |
| | CENTURIA OFFICE REIT | 10,000 | 19 | — | — |
| | WAYPOINT REIT LTD | 34,000 | 93 | — | — |
| | SCENTRE GROUP | 268,000 | 659 | 211,000 | 568 |
| | HOMECO DAILY NEEDS REIT | 66,000 | 81 | — | — |
| | HOMECO DAILY NEEDS REIT -RTS | (14,000) | (—) | — | — |
| | | (33,898) | (43) | (33,898) | (—) |
| | VICINITY CENTRES | 331,000 | 534 | 129,000 | 205 |
| | AVENTUS GROUP | 96,000 | 243 | — | — |
| | 小 計 | 2,242,300 | 7,856 | 908,300 | 3,749 |
| | (139,564) | (311) | (68,558) | (4) | |
| 国 | ニュージーランド | | 千ニュージーランドドル | | 千ニュージーランドドル |
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND | 50,000 | 83 | 40,000 | 67 |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 20,000 | 65 | — | — |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 45,000 | 104 | 34,000 | 76 |
| | ARGOSY PROPERTY LTD | 20,000 | 25 | — | — |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 30,000 | 32 | — | — |
| | 小 計 | 165,000 | 312 | 74,000 | 143 |
| | イスラエル | | 千新シェケル | | 千新シェケル |
| | REIT 1 LTD | 5,000 | 63 | — | — |
| | 小 計 | 5,000 | 63 | — | — |

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* () 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|----------|--------------|--------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外 国 | REIT先物取引 | 百万円 1,831 | 百万円 1,816 | 百万円 — | 百万円 — |

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年6月11日～2021年6月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 為替直物取引 | 百万円 7,958 | 百万円 46 | % 0.6 | 百万円 5,589 | 百万円 46 | % 0.8 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2021年6月10日現在)

外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--------------------------------------|---------|---------|-------|---------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| ACADIA REALTY TRUST | 20,300 | 22,000 | 500 | 54,928 | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | 11,200 | 15,700 | 1,153 | 126,444 | 0.3 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | — | 17,200 | 344 | 37,795 | 0.1 |
| ALEXANDERS INC | 500 | 500 | 142 | 15,582 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 28,130 | 31,300 | 5,960 | 653,530 | 1.6 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 11,200 | 12,200 | 470 | 51,596 | 0.1 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 31,200 | 34,200 | 1,666 | 182,738 | 0.4 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 25,000 | 28,000 | 257 | 28,245 | 0.1 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 57,900 | 65,900 | 2,556 | 280,366 | 0.7 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 44,000 | 61,900 | 2,430 | 266,470 | 0.6 |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | — | 36,800 | 279 | 30,666 | 0.1 |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 33,800 | — | — | — | — |
| APARTMENT INCOME REIT CO | — | 36,900 | 1,845 | 202,344 | 0.5 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 48,800 | 51,300 | 835 | 91,631 | 0.2 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | — | 14,200 | 190 | 20,895 | 0.1 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 15,600 | — | — | — | — |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 32,040 | 34,370 | 7,243 | 794,284 | 1.9 |
| BRT APARTMENTS CORP | 2,400 | 2,400 | 42 | 4,700 | 0.0 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 4,200 | 7,000 | 70 | 7,767 | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES | 32,920 | 34,880 | 4,268 | 468,053 | 1.1 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 6,000 | — | — | — | — |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 41,200 | 43,200 | 647 | 71,005 | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 67,700 | 73,600 | 1,787 | 196,026 | 0.5 |
| BROADSTONE NET LEASE INC-A | — | 9,000 | 221 | 24,286 | 0.1 |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A | 14,400 | 9,200 | 171 | 18,793 | 0.0 |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES | 40,000 | — | — | — | — |
| CIM COMMERCIAL TRUST CORP | — | 2,600 | 26 | 2,950 | 0.0 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 22,130 | 24,170 | 3,210 | 352,031 | 0.8 |
| CARETRUST REIT INC ACQUIRES | 22,300 | 23,800 | 564 | 61,875 | 0.1 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 16,000 | — | — | — | — |
| CENTERSPACE | — | 3,100 | 234 | 25,673 | 0.1 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 10,800 | 10,800 | 150 | 16,496 | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | 12,600 | 10,700 | 137 | 15,076 | 0.0 |
| CLIPPER REALTY INC | 2,400 | 2,400 | 18 | 2,071 | 0.0 |
| COLONY CAPITAL INC | 112,000 | 125,000 | 1,023 | 112,254 | 0.3 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 26,600 | 29,000 | 552 | 60,576 | 0.1 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 4,800 | 5,400 | 272 | 29,919 | 0.1 |
| CORESITE REALTY CORP | 9,260 | 10,720 | 1,452 | 159,308 | 0.4 |
| CORECIVIC INC | 27,600 | — | — | — | — |
| COREPOINT LODGING INC | 8,900 | 8,900 | 93 | 10,256 | 0.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 25,600 | 28,500 | 848 | 93,063 | 0.2 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 33,300 | 37,200 | 1,446 | 158,631 | 0.4 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| CTO REALTY GROWTH INC | — | 1,200 | 66 | 7,338 | 0.0 |
| CUBESMART | 43,900 | 49,000 | 2,255 | 247,366 | 0.6 |
| CYRUSONE INC | 25,950 | 29,500 | 2,398 | 262,946 | 0.6 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 47,000 | 53,000 | 554 | 60,787 | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 60,150 | 69,300 | 11,148 | 1,222,486 | 2.9 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 53,000 | 60,000 | 242 | 26,579 | 0.1 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 38,100 | 41,100 | 1,486 | 162,959 | 0.4 |
| DUKE REALTY CORP | 84,200 | 92,000 | 4,491 | 492,486 | 1.2 |
| EPR PROPERTIES | 17,900 | 18,400 | 986 | 108,121 | 0.3 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 17,300 | 19,800 | 429 | 47,047 | 0.1 |
| EASTGROUP PROPERTIES | 8,830 | 9,850 | 1,650 | 180,973 | 0.4 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN | 34,600 | 34,600 | 442 | 48,561 | 0.1 |
| EQUINIX INC | 20,190 | 22,020 | 17,836 | 1,955,763 | 4.7 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 28,300 | 30,600 | 857 | 94,015 | 0.2 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 41,700 | 41,600 | 3,163 | 346,897 | 0.8 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 80,100 | 84,400 | 6,697 | 734,341 | 1.8 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 20,600 | 28,700 | 814 | 89,279 | 0.2 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 15,090 | 16,000 | 4,960 | 543,934 | 1.3 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 29,650 | 32,500 | 5,153 | 565,084 | 1.4 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 5,500 | 6,800 | 89 | 9,797 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 16,220 | 17,110 | 2,095 | 229,748 | 0.6 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 29,200 | 31,600 | 1,679 | 184,126 | 0.4 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 16,000 | 19,300 | 559 | 61,392 | 0.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 25,000 | 25,000 | 141 | 15,460 | 0.0 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 11,300 | — | — | — | — |
| GEO GROUP INC/THE | 27,600 | 30,100 | 264 | 29,044 | 0.1 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 46,800 | 53,700 | 2,601 | 285,283 | 0.7 |
| GETTY REALTY CORP | 7,900 | 8,900 | 300 | 32,906 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 8,300 | 8,300 | 188 | 20,704 | 0.0 |
| GLADSTONE LAND CORP | 4,200 | 5,800 | 146 | 16,083 | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 20,800 | 22,400 | 444 | 48,754 | 0.1 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 9,200 | 10,700 | 168 | 18,502 | 0.0 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 30,200 | 34,300 | 1,100 | 120,690 | 0.3 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 47,000 | 54,300 | 1,579 | 173,201 | 0.4 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 113,300 | 132,500 | 4,585 | 502,835 | 1.2 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 7,800 | 9,600 | 115 | 12,684 | 0.0 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 23,700 | 26,100 | 1,257 | 137,913 | 0.3 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 163,900 | 174,700 | 3,111 | 341,165 | 0.8 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 35,700 | 37,100 | 1,098 | 120,494 | 0.3 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 20,500 | 25,900 | 474 | 52,056 | 0.1 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 15,200 | 16,400 | 431 | 47,312 | 0.1 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 3,950 | 5,900 | 1,114 | 122,257 | 0.3 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 2,700 | — | — | — | — |
| INVITATION HOMES INC | 122,900 | 139,600 | 5,228 | 573,252 | 1.4 |
| IRON MOUNTAIN INC | 65,900 | 70,900 | 3,333 | 365,542 | 0.9 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 27,400 | 27,800 | 964 | 105,774 | 0.3 |
| KILROY REALTY CORP | 22,400 | 26,300 | 1,909 | 209,392 | 0.5 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|-------------------------------------|---------|---------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| KIMCO REALTY CORP | 96,900 | 106,100 | 2,351 | 257,806 | 0.6 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 19,000 | 21,300 | 490 | 53,764 | 0.1 |
| LTC PROPERTIES INC | 9,200 | 9,500 | 374 | 41,062 | 0.1 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 56,600 | 68,500 | 885 | 97,117 | 0.2 |
| LIFE STORAGE INC | 10,590 | 18,500 | 1,969 | 215,956 | 0.5 |
| MACERICH CO /THE | 27,342 | 29,500 | 531 | 58,256 | 0.1 |
| MACK-CALI REALTY CORP | 20,900 | 20,900 | 370 | 40,654 | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 119,100 | 142,500 | 3,083 | 338,127 | 0.8 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 26,110 | 28,150 | 4,748 | 520,686 | 1.3 |
| MONMOUTH REIT-CLASS A | 22,500 | 24,300 | 470 | 51,557 | 0.1 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 10,200 | 11,400 | 765 | 83,925 | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 39,000 | 43,800 | 2,173 | 238,356 | 0.6 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 13,400 | 16,100 | 784 | 86,008 | 0.2 |
| NETSTREIT CORP | — | 5,800 | 137 | 15,091 | 0.0 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 18,000 | 18,000 | 133 | 14,644 | 0.0 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 5,400 | 5,500 | 310 | 34,007 | 0.1 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME | 11,200 | 12,200 | 381 | 41,804 | 0.1 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 50,100 | 57,900 | 2,163 | 237,252 | 0.6 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 3,400 | 4,200 | 120 | 13,171 | 0.0 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 4,570 | 4,950 | 791 | 86,772 | 0.2 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 45,600 | 41,000 | 472 | 51,834 | 0.1 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 54,700 | 59,300 | 1,266 | 138,887 | 0.3 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 29,700 | 32,900 | 792 | 86,904 | 0.2 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 11,500 | — | — | — | — |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 44,800 | 51,800 | 1,000 | 109,735 | 0.3 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 28,800 | 30,300 | 608 | 66,680 | 0.2 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 3,400 | 6,400 | 129 | 14,182 | 0.0 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 10,600 | 12,400 | 136 | 14,915 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | 169,060 | 182,410 | 22,547 | 2,472,355 | 6.0 |
| PUBLIC STORAGE | 34,370 | 37,480 | 11,013 | 1,207,588 | 2.9 |
| QTS REALTY TRUST INC CL A | 13,400 | 15,800 | 1,236 | 135,531 | 0.3 |
| RLJ LODGING TRUST | 38,900 | 40,100 | 650 | 71,362 | 0.2 |
| RPT REALTY | 19,000 | 19,000 | 264 | 29,021 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 78,300 | 92,000 | 6,528 | 715,830 | 1.7 |
| REGENCY CENTERS CORP | 38,400 | 38,800 | 2,620 | 287,343 | 0.7 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 27,500 | 30,000 | 562 | 61,645 | 0.1 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME-A | 50,000 | 54,000 | 685 | 75,197 | 0.2 |
| RETAIL VALUE INC | 3,221 | 4,401 | 91 | 10,071 | 0.0 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 27,100 | 32,600 | 1,903 | 208,720 | 0.5 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 12,600 | 13,700 | 1,081 | 118,538 | 0.3 |
| SL GREEN REALTY CORP | 18,900 | — | — | — | — |
| SL GREEN REALTY CORP | — | 17,300 | 1,437 | 157,598 | 0.4 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 46,200 | 53,000 | 943 | 103,501 | 0.2 |
| SAFEHOLD INC | 3,100 | 3,500 | 259 | 28,414 | 0.1 |
| SAUL CENTERS INC | 2,700 | 3,400 | 157 | 17,302 | 0.0 |
| SERITAGE GROWTH PROP-A REIT | 7,000 | 9,300 | 177 | 19,507 | 0.0 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 37,000 | 39,900 | 571 | 62,694 | 0.2 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|---------------|-----------|-----------|-----------|------------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 70,400 | 80,970 | 10,978 | 1,203,816 | 2.9 | |
| SITE CENTERS CORP | 34,000 | 40,500 | 638 | 69,987 | 0.2 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 22,700 | 28,100 | 1,412 | 154,859 | 0.4 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 33,600 | 39,700 | 1,515 | 166,158 | 0.4 | |
| STORE CAPITAL CORP | 49,200 | 59,900 | 2,158 | 236,711 | 0.6 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 24,000 | 27,000 | 274 | 30,079 | 0.1 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 21,220 | 27,460 | 4,814 | 527,856 | 1.3 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 51,600 | 54,200 | 719 | 78,923 | 0.2 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 22,000 | 24,100 | 486 | 53,379 | 0.1 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 14,200 | — | — | — | — | |
| TERRENO REALTY CORP | 15,500 | 17,000 | 1,120 | 122,915 | 0.3 | |
| UDR INC | 67,100 | 73,000 | 3,625 | 397,581 | 1.0 | |
| UMH PROPERTIES INC | 8,400 | 9,900 | 227 | 24,923 | 0.1 | |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 2,940 | 3,200 | 234 | 25,666 | 0.1 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 27,100 | 27,400 | 553 | 60,689 | 0.1 | |
| URSTADT BIDDLE-CL A | 6,900 | 6,900 | 136 | 14,934 | 0.0 | |
| VENTAS INC | 85,300 | 92,200 | 5,319 | 583,331 | 1.4 | |
| VEREIT INC | 243,000 | — | — | — | — | |
| VEREIT INC | — | 56,200 | 2,769 | 303,679 | 0.7 | |
| VICI PROPERTIES INC | 105,300 | 132,000 | 4,309 | 472,569 | 1.1 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 36,600 | 38,900 | 1,953 | 214,164 | 0.5 | |
| WP CAREY INC | 39,500 | 43,100 | 3,323 | 364,368 | 0.9 | |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 42,000 | — | — | — | — | |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | — | 4,667 | 31 | 3,443 | 0.0 | |
| WASHINGTON REAL ESTATE INV | 18,600 | 21,100 | 568 | 62,351 | 0.2 | |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 27,400 | 29,400 | 997 | 109,348 | 0.3 | |
| WELLTOWER INC | 93,100 | 102,800 | 8,104 | 888,686 | 2.1 | |
| WHITESTONE REIT | 8,300 | 9,600 | 84 | 9,210 | 0.0 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 26,300 | 28,800 | 588 | 64,516 | 0.2 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | — | 160,000 | 122 | 13,421 | 0.0 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 100,000 | 100,000 | — | — | — | |
| PRIME US REIT | 90,000 | 110,000 | 94 | 10,312 | 0.0 | |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | 107,000 | — | — | — | — | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 343,515 | 343,515 | 261 | 28,626 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 5,756,048 | 6,080,223 | 281,346 | 30,849,593 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 157 | 156 | — | < 74.3% > | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 13,700 | 15,400 | 703 | 63,699 | 0.2 | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 16,000 | 16,000 | 183 | 16,595 | 0.0 | |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST | — | 4,000 | 48 | 4,416 | 0.0 | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 5,600 | 5,600 | 225 | 20,385 | 0.0 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 12,200 | 12,800 | 215 | 19,486 | 0.0 | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 18,700 | 20,500 | 1,167 | 105,649 | 0.3 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 33,600 | 40,100 | 586 | 53,098 | 0.1 | |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 21,000 | 22,000 | 227 | 20,549 | 0.0 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT | 10,900 | 10,900 | 197 | 17,906 | 0.0 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 6,800 | 6,700 | 156 | 14,153 | 0.0 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|---|--------------|---------|---------|---------|----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | 口 | 口 | 千カナダドル | 千円 | % | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 15,700 | 21,600 | 314 | 28,504 | 0.1 | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | 24,900 | 26,800 | 488 | 44,244 | 0.1 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 6,700 | 7,200 | 584 | 52,902 | 0.1 | |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 30,400 | 35,800 | 587 | 53,140 | 0.1 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 13,700 | 17,300 | 279 | 25,256 | 0.1 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 11,400 | 12,900 | 256 | 23,211 | 0.1 | |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 4,000 | 4,000 | 88 | 8,048 | 0.0 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 4,600 | 4,600 | 78 | 7,111 | 0.0 | |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST | 7,200 | — | — | — | — | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 18,200 | 24,000 | 313 | 28,347 | 0.1 | |
| PLAZA RETAIL REIT | — | 12,000 | 54 | 4,930 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 35,400 | 38,700 | 846 | 76,639 | 0.2 | |
| SLATE OFFICE REIT | 5,900 | 8,000 | 42 | 3,837 | 0.0 | |
| SLATE RETAIL REIT | 4,300 | — | — | — | — | |
| SLATE GROCERY REIT | — | 4,300 | 54 | 4,919 | 0.0 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 15,400 | 17,900 | 532 | 48,166 | 0.1 | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 15,000 | 19,900 | 330 | 29,881 | 0.1 | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 10,000 | 10,000 | 75 | 6,851 | 0.0 | |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I | — | 10,600 | 233 | 21,097 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 361,300 | 429,600 | 8,872 | 803,032 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 25 | 27 | — | < 1.9% > | |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | | |
| BRITISH LAND | 218,000 | 233,000 | 1,206 | 186,773 | 0.4 | |
| DERWENT LONDON PLC | 24,200 | 27,900 | 998 | 154,481 | 0.4 | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 36,000 | 40,700 | 534 | 82,697 | 0.2 | |
| HAMMERSON PLC | 181,000 | — | — | — | — | |
| INTU PROPERTIES PLC | 184,000 | 184,000 | 3 | 505 | 0.0 | |
| UNITE GROUP PLC | 82,200 | 97,400 | 1,146 | 177,480 | 0.4 | |
| SHAPTESBURY PLC | 50,400 | 75,000 | 475 | 73,641 | 0.2 | |
| STANDARD LIFE INV PROP INC | — | 110,000 | 79 | 12,273 | 0.0 | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST | 110,000 | 160,000 | 75 | 11,686 | 0.0 | |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 131,000 | 131,000 | 117 | 18,163 | 0.0 | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 198,000 | 176,000 | 142 | 22,033 | 0.1 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 47,700 | 52,900 | 504 | 78,056 | 0.2 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 191,000 | 225,000 | 533 | 82,520 | 0.2 | |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 190,000 | 190,000 | 174 | 27,050 | 0.1 | |
| SEGRO PLC | 251,200 | 293,100 | 3,164 | 489,631 | 1.2 | |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC | 200,000 | 218,000 | 386 | 59,846 | 0.1 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 30,400 | 32,800 | 301 | 46,722 | 0.1 | |
| GCP STUDENT LIVING PLC | — | 118,000 | 209 | 32,357 | 0.1 | |
| NEWRIVER REIT PLC | 63,000 | 80,000 | 75 | 11,711 | 0.0 | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 146,000 | 162,000 | 187 | 29,030 | 0.1 | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 80,000 | 96,000 | 102 | 15,806 | 0.0 | |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | — | 198,000 | 231 | 35,772 | 0.1 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 58,100 | 62,000 | 465 | 72,102 | 0.2 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 386,000 | 424,000 | 854 | 132,277 | 0.3 | |
| RDI REIT PLC | 56,000 | — | — | — | — | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | |
|---------------------------------|--------------|-----------|-----------|--------|-----------|-----|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | | 口 | 口 | 千英ポンド | 千円 | % |
| CUSTODIAN REIT PLC | — | — | 97,000 | 96 | 14,860 | 0.0 |
| HOME REIT PLC | — | — | 60,000 | 65 | 10,120 | 0.0 |
| HAMMERSON PLC | — | — | 1,020,000 | 441 | 68,315 | 0.2 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 9,300 | — | — | — | — | — |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 146,000 | — | 146,000 | 125 | 19,430 | 0.0 |
| ASSURA PLC | 542,000 | — | 650,000 | 498 | 77,200 | 0.2 |
| AEW UK REIT PLC | 32,000 | — | 32,000 | 30 | 4,704 | 0.0 |
| LXI REIT PLC | 123,000 | — | 126,000 | 182 | 28,311 | 0.1 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 283,000 | — | 330,000 | 513 | 79,512 | 0.2 |
| REGIONAL REIT LTD | 100,000 | — | 100,000 | 87 | 13,494 | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 172,600 | — | 184,000 | 1,334 | 206,493 | 0.5 |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | — | — | 74,000 | 82 | 12,711 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 4,322,100 | 6,205,800 | 15,429 | 2,387,779 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 30 | 34 | — | < 5.8% > | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | 千ユーロ | | |
| HAMBORNER REIT AG | 16,000 | — | — | — | — | — |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 35,800 | — | 43,300 | 669 | 89,418 | 0.2 |
| HAMBORNER REIT AG | — | — | 17,600 | 160 | 21,450 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 51,800 | 60,900 | 830 | 110,868 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 2 | — | < 0.3% > | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 10,000 | — | 14,000 | 62 | 8,372 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 10,000 | 14,000 | 62 | 8,372 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| ICADE | 6,420 | — | 7,700 | 585 | 78,118 | 0.2 |
| ALTAREA | 840 | — | 940 | 171 | 22,937 | 0.1 |
| KLEPIERRE | 48,100 | — | 50,200 | 1,293 | 172,622 | 0.4 |
| GECINA SA | 12,520 | — | 13,300 | 1,809 | 241,545 | 0.6 |
| COVIVIO | 10,300 | — | 12,000 | 979 | 130,713 | 0.3 |
| MERCIALYS | 5,200 | — | 9,200 | 100 | 13,423 | 0.0 |
| CARMILA | — | — | 11,400 | 150 | 20,148 | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 31,400 | — | 34,000 | 2,808 | 374,847 | 0.9 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 114,780 | 138,740 | 7,898 | 1,054,357 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 7 | 8 | — | < 2.5% > | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA | 8,800 | — | 9,200 | 226 | 30,260 | 0.1 |
| VASTNED RETAIL NV | 4,600 | — | 4,600 | 122 | 16,395 | 0.0 |
| WERELDHAVE NV | 10,000 | — | 10,000 | 156 | 20,944 | 0.1 |
| NSI NV | 3,700 | — | 4,300 | 150 | 20,147 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 27,100 | 28,100 | 657 | 87,748 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 4 | 4 | — | < 0.2% > | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 55,900 | — | 62,800 | 597 | 79,807 | 0.2 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 14,000 | — | 14,000 | 75 | 10,091 | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|--------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…スペイン) | | 口 | 口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 85,500 | 84,000 | 812 | 108,453 | 0.3 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 155,400 | 160,800 | 1,485 | 198,353 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.5 % > | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| BEFIMMO S. C. A. | | 5,200 | 6,500 | 237 | 31,670 | 0.1 |
| COFINIMMO | | 5,660 | 6,950 | 907 | 121,164 | 0.3 |
| RETAIL ESTATES | | 2,600 | 2,600 | 186 | 24,954 | 0.1 |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | | 5,300 | 6,000 | 147 | 19,623 | 0.0 |
| MONTEA | | 2,610 | 2,540 | 257 | 34,313 | 0.1 |
| AEDIFICA | | 6,160 | 8,220 | 887 | 118,507 | 0.3 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | 29,400 | 33,900 | 1,092 | 145,805 | 0.4 |
| CARE PROPERTY INVEST | | — | 6,000 | 162 | 21,745 | 0.1 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | | — | 4,080 | 202 | 27,068 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 56,930 | 76,790 | 4,081 | 544,853 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 7 | 9 | — | < 1.3 % > | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| HIBERNIA REIT PLC | | 156,000 | 160,000 | 197 | 26,398 | 0.1 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | | 100,000 | 110,000 | 178 | 23,787 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 256,000 | 270,000 | 375 | 50,186 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 2 | — | < 0.1 % > | |
| (ユーロ…シンガポール) | | | | | | |
| CROMWELL REIT EUR | | — | 72,000 | 164 | 22,009 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | — | 72,000 | 164 | 22,009 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | — | 1 | — | < 0.1 % > | |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 | 672,010 | 821,330 | 15,557 | 2,076,749 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 26 | 30 | — | < 5.0 % > | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | | 481,400 | 515,000 | 39,011 | 551,228 | 1.3 |
| PROSPERITY REIT | | 260,000 | 300,000 | 897 | 12,674 | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 340,000 | 380,000 | 1,573 | 22,229 | 0.1 |
| CHAMPION REIT | | 460,000 | 500,000 | 2,290 | 32,357 | 0.1 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | | 240,000 | 240,000 | 1,082 | 15,294 | 0.0 |
| FORTUNE REIT | | 320,000 | 350,000 | 3,006 | 42,481 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 2,101,400 | 2,285,000 | 47,860 | 676,266 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 | 6 | — | < 1.6 % > | |
| (シンガポール) | | | | 千シンガポールドル | | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | | 658,000 | 1,125,694 | 2,420 | 200,323 | 0.5 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | | 687,760 | 781,762 | 2,306 | 190,884 | 0.5 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 663,964 | — | — | — | — |
| SUNTEC REIT | | 532,000 | 534,000 | 795 | 65,856 | 0.2 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 695,000 | 715,008 | 1,444 | 119,546 | 0.3 |
| STARHILL GLOBAL REIT | | 330,000 | 330,000 | 184 | 15,295 | 0.0 |
| KEPPEL REIT | | 443,000 | 490,000 | 583 | 48,263 | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | | 169,596 | 322,838 | 778 | 64,398 | 0.2 |
| ESR REIT | | 509,760 | 599,760 | 245 | 20,353 | 0.0 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | | 200,000 | 180,000 | 226 | 18,772 | 0.0 |
| CAPITALAND CHINA TRUST | | 181,136 | 230,279 | 315 | 26,112 | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--------------------------------------|--------------|------------|------------|---------|-----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (シンガポール) | 口 | 口 | 千シンガポールドル | 千円 | % | |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 120,000 | 356,400 | 96 | 7,964 | 0.0 | |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 91,000 | 91,000 | 404 | 33,442 | 0.1 | |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 350,000 | 1,310,000 | 83 | 6,939 | 0.0 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 343,000 | 451,000 | 1,258 | 104,148 | 0.3 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST-RIGHTS | — | 20,900 | 3 | 259 | 0.0 | |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 495,716 | 530,716 | 1,130 | 93,565 | 0.2 | |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 209,860 | 279,869 | 228 | 18,879 | 0.0 | |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 91,000 | 110,000 | 156 | 12,928 | 0.0 | |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 219,764 | 219,764 | 94 | 7,821 | 0.0 | |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | 490,000 | 500,000 | 535 | 44,281 | 0.1 | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 200,000 | 260,000 | 153 | 12,696 | 0.0 | |
| SPH REIT | 210,000 | 250,000 | 220 | 18,209 | 0.0 | |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 161,306 | — | — | — | — | |
| EC WORLD REIT | — | 60,000 | 49 | 4,072 | 0.0 | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 103,000 | 140,000 | 130 | 10,834 | 0.0 | |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | 429,956 | 479,956 | 499 | 41,314 | 0.1 | |
| QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 610,216 | 610,216 | 247 | 20,455 | 0.0 | |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL | — | 220,000 | 172 | 14,294 | 0.0 | |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 140,000 | 200,000 | 106 | 8,773 | 0.0 | |
| IREIT GLOBAL | — | 116,320 | 76 | 6,354 | 0.0 | |
| KEPPEL DC REIT | 281,211 | 317,211 | 824 | 68,264 | 0.2 | |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 545,746 | 676,746 | 960 | 79,540 | 0.2 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 10,161,991 | 12,509,439 | 16,731 | 1,384,848 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 29 | 31 | — | < 3.3% > | |
| (韓国) | | | 千ウォン | | | |
| MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | — | 19,000 | 96,900 | 9,534 | 0.0 | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 6,546 | 11,000 | 94,050 | 9,254 | 0.0 | |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | — | 7,000 | 39,270 | 3,864 | 0.0 | |
| LOTTE REIT CO LTD | — | 28,257 | 172,650 | 16,988 | 0.0 | |
| KORAMCO ENERGY PLUS REIT | — | 9,000 | 56,250 | 5,535 | 0.0 | |
| JR REIT XXVII | — | 28,000 | 146,440 | 14,409 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 6,546 | 102,257 | 605,560 | 59,587 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 6 | — | < 0.1% > | |
| (オーストラリア) | | | 千豪ドル | | | |
| BWP TRUST | 111,000 | 119,000 | 510 | 43,235 | 0.1 | |
| MIRVAC GROUP | 906,000 | 965,000 | 2,827 | 239,456 | 0.6 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 430,000 | 470,000 | 423 | 35,823 | 0.1 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 101,000 | 130,000 | 495 | 41,946 | 0.1 | |
| GPT GROUP | 438,000 | 483,000 | 2,294 | 194,300 | 0.5 | |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | — | 120,000 | 322 | 27,337 | 0.1 | |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 86,000 | 96,000 | 299 | 25,366 | 0.1 | |
| STOCKLAND TRUST GROUP | 559,000 | 585,000 | 2,755 | 233,350 | 0.6 | |
| DEXUS | 249,000 | 269,000 | 2,859 | 242,168 | 0.6 | |
| GOODMAN GROUP | 366,100 | 414,000 | 8,383 | 709,998 | 1.7 | |
| CHARTER HALL GROUP | 107,000 | 114,900 | 1,677 | 142,070 | 0.3 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 68,000 | 70,000 | 279 | 23,653 | 0.1 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 59,000 | 74,000 | 435 | 36,850 | 0.1 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|---|---------------|------------|-------------|---------|------------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (オーストラリア) | 口 | 口 | 千豪ドル | 千円 | % | |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 234,000 | 273,000 | 682 | 57,800 | 0.1 | |
| ARENA REIT | 63,000 | 87,000 | 297 | 25,198 | 0.1 | |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | — | 119,000 | 437 | 37,087 | 0.1 | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 96,000 | 143,610 | 705 | 59,717 | 0.1 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 219,000 | 242,000 | 491 | 41,604 | 0.1 | |
| NATIONAL STORAGE REIT-RTS | — | 38,596 | 1 | 98 | 0.0 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | 40,000 | 40,000 | 132 | 11,179 | 0.0 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 130,000 | 130,000 | 150 | 12,716 | 0.0 | |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 54,000 | 82,000 | 283 | 24,028 | 0.1 | |
| APN INDUSTRIA REIT | 30,000 | 38,000 | 121 | 10,330 | 0.0 | |
| HOME CONSORTIUM | — | 44,000 | 219 | 18,557 | 0.0 | |
| RURAL FUNDS GROUP | 80,000 | 80,000 | 200 | 16,938 | 0.0 | |
| IRONGATE GROUP | — | 125,000 | 186 | 15,773 | 0.0 | |
| CENTURIA OFFICE REIT | 78,000 | 88,000 | 206 | 17,513 | 0.0 | |
| WAYPOINT REIT LTD | 161,000 | 195,000 | 514 | 43,598 | 0.1 | |
| SCENTRE GROUP | 1,217,000 | 1,274,000 | 3,618 | 306,421 | 0.7 | |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | — | 80,000 | 115 | 9,756 | 0.0 | |
| VICINITY CENTRES | 748,000 | 950,000 | 1,577 | 133,556 | 0.3 | |
| AVENTUS GROUP | — | 96,000 | 288 | 24,390 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 6,630,100 | 8,035,106 | 33,791 | 2,861,826 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 25 | 32 | — | <6.9%> | |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | | |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND | 250,000 | 260,000 | 417 | 32,795 | 0.1 | |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 80,000 | 100,000 | 306 | 24,048 | 0.1 | |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 259,000 | 270,000 | 618 | 48,592 | 0.1 | |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 180,000 | 200,000 | 310 | 24,362 | 0.1 | |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 360,000 | 390,000 | 464 | 36,473 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,129,000 | 1,220,000 | 2,115 | 166,272 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5 | 5 | — | <0.4%> | |
| (イスラエル) | | | 千新シェケル | | | |
| REIT 1 LTD | 40,000 | 45,000 | 777 | 26,288 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 40,000 | 45,000 | 777 | 26,288 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | <0.1%> | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 31,180,495 | 37,733,755 | — | 41,292,245 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 305 | 328 | — | <99.4%> | |

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当 期 末 | |
|-------------|------------|----------|
| | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国 REIT先物取引 | 百万円 223 | 百万円 — |

* 単位未満は切り捨て。

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2021年6月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 41,292,245 | % 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 729,520 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 42,021,765 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産(41,527,344千円)の投資信託財産総額(42,021,765千円)に対する比率は98.8%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=109.65円、1カナダドル=90.51円、1英ポンド=154.75円、1ユーロ=133.49円、1香港ドル=14.13円、1シンガポールドル=82.77円、1ウォン=0.0984円、1豪ドル=84.69円、1ニュージーランドドル=78.59円、1新シェケル=33.8066円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 42,032,710,457 |
| コール・ローン等 | 500,496,533 |
| 投資証券(評価額) | 41,292,245,577 |
| 未収入金 | 64,652,826 |
| 未収配当金 | 28,035,678 |
| 差入委託証拠金 | 147,279,843 |
| (B) 負債 | 508,500,007 |
| 未払金 | 10,964,880 |
| 未払解約金 | 497,494,350 |
| 未払利息 | 477 |
| その他未払費用 | 40,300 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 41,524,210,450 |
| 元本 | 14,294,107,321 |
| 次期繰越損益金 | 27,230,103,129 |
| (D) 受益権総口数 | 14,294,107,321口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 29,050円 |

(注) 期首元本額は13,122,373,854円、期中追加設定元本額は4,619,259,354円、期中一部解約元本額は3,447,525,887円、1口当たり純資産額は2.9050円です。

○損益の状況 (2020年6月11日~2021年6月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,090,305,025 |
| 受取配当金 | 1,068,697,093 |
| 受取利息 | 18 |
| その他収益金 | 21,627,449 |
| 支払利息 | △ 19,535 |
| (B) 有価証券売買損益 | 8,970,978,182 |
| 売買益 | 9,446,598,621 |
| 売買損 | △ 475,620,439 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 58,524,817 |
| 取引益 | 77,667,946 |
| 取引損 | △ 19,143,129 |
| (D) 保管費用等 | △ 23,371,883 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 10,096,436,141 |
| (F) 前期繰越損益金 | 15,930,212,887 |
| (G) 追加信託差損益金 | 5,825,476,637 |
| (H) 解約差損益金 | △ 4,622,022,536 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 27,230,103,129 |
| 次期繰越損益金(I) | 27,230,103,129 |

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

*損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 |
|---|---------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| NEXT FUNDS 外国REIT・SAP先進国REIT指数 (除く日本・為替ヘッジなし) 連動型上場投信 | 2,822,682,462 |
| 野村世界6資産分散投信 (分配コース) | 2,167,758,752 |
| 野村世界6資産分散投信 (安定コース) | 1,677,839,229 |
| 野村インデックスファンド・外国REIT | 1,643,056,599 |
| 野村6資産均等バランス | 1,460,163,971 |
| ファンドラップ (ウエルス・スクエア) REIT | 1,271,383,483 |
| 野村世界6資産分散投信 (配分変更コース) | 850,239,308 |
| 野村世界6資産分散投信 (成長コース) | 785,749,098 |
| ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA (適格機関投資家専用) | 663,146,453 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 375,800,678 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 292,581,430 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT (適格機関投資家専用) | 75,466,885 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 35,053,440 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 23,537,843 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 20,352,814 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 18,244,856 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 17,736,574 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 14,165,849 |
| ネクストコア | 14,155,829 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 14,088,914 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 7,089,037 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 6,722,915 |
| インデックス・ブレンド (タイプV) | 5,489,221 |
| インデックス・ブレンド (タイプIII) | 5,007,817 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 4,397,221 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 3,639,468 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030 | 3,486,391 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 3,450,965 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 3,095,744 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 1,930,192 |
| インデックス・ブレンド (タイプIV) | 1,659,147 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 1,550,462 |
| インデックス・ブレンド (タイプII) | 1,162,594 |
| インデックス・ブレンド (タイプI) | 919,174 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 854,701 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 440,471 |
| 多資産分散投資ファンド (バランス10) (確定拠出年金向け) | 7,334 |

○お知らせ

該当事項はございません。