

【表紙】

| | |
|---|--|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 平成24年7月27日提出 |
| 【発行者名】 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | CEO兼執行役会長 岩崎 俊博 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都中央区日本橋一丁目12番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 松井 秀仁 連絡場所 東京都中央区日本橋一丁目12番1号 |
| 【電話番号】 | 03-3241-9511 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | バランスセレクト70 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 | 継続募集額(平成24年7月28日から平成25年7月26日まで) 5,000億円を上限とします。 * なお、継続申込期間（以下「申込期間」といいます。）は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新され ます。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

バランスセレクト70

(以下「ファンド」といいます。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

なお、当初元本は1口当り1円です。

信用格付

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(5) 【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.05%（税抜1.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

(6) 【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

平成24年7月28日から平成25年7月26日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(9) 【払込期日】

取得申込日から起算して5営業日目までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に取得申込代金をお支払いいただく場合があります。

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

(10) 【払込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込みの方法

受益権の取得申込に際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と、分配金が税引き後無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。

受益権の申込みを行なう投資者は、取得申込をする際に、「一般コース」か「自動けいぞく投資コース」か、どちらかのコースを申し出ます。（原則として、お買付け後のコース変更はできません。）

なお、販売会社や申込形態によっては、どちらか一方のコースのみのお取り扱いとなる場合や、買付単位が異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

取得申込みの受付けの中止、既に受付けた取得申込みの受付けの取り消し

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

振替受益権について

ファンドの受益権は、投資信託振替制度（「振替制度」と称する場合があります。）に移行したため、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

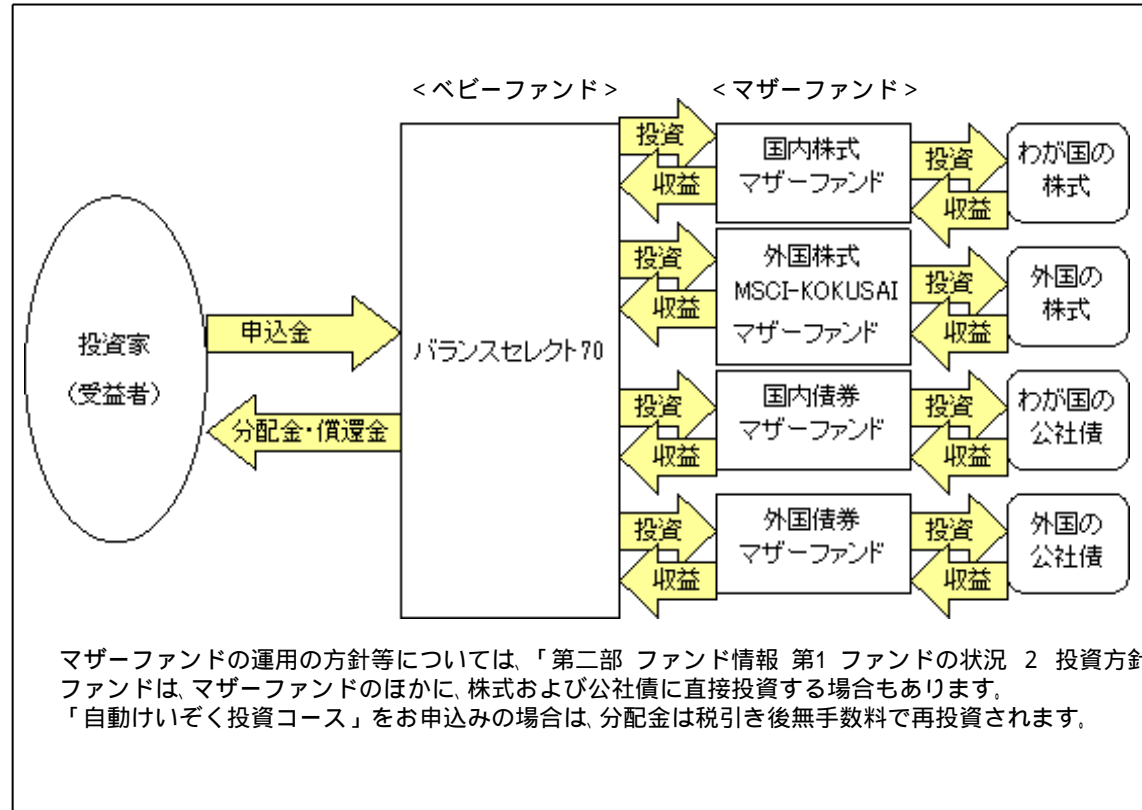
(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

ファミリーファンド方式について

ファンドは、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



信託金の限度額

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

<商品分類>

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

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

（バランスセレクト70）

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

| | | | | | |
|---|---|---|-----------------------------|-----------|--------------------------------|
| 株式 一般 大型株 中小型株 | 年1回 年2回 年4回 | グローバル (日本を含む) 日本 | | | |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () | 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 | 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 | ファミリーファン ド | あり () | 日経225 T O P I X |
| 不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産配 分固定型)) | その他 () | アフリカ 中近東 (中東) エマージング | ファンド・オブ ・ ファンズ | なし | その他 (合成指数) |
| 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | | | | | |

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（平成22年7月1日現在）

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

- (1) 一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- (2) 公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (3) 社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

(4)その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

(5)格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

(1)資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

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

[決算頻度による属性区分]

(1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

(1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

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

(2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

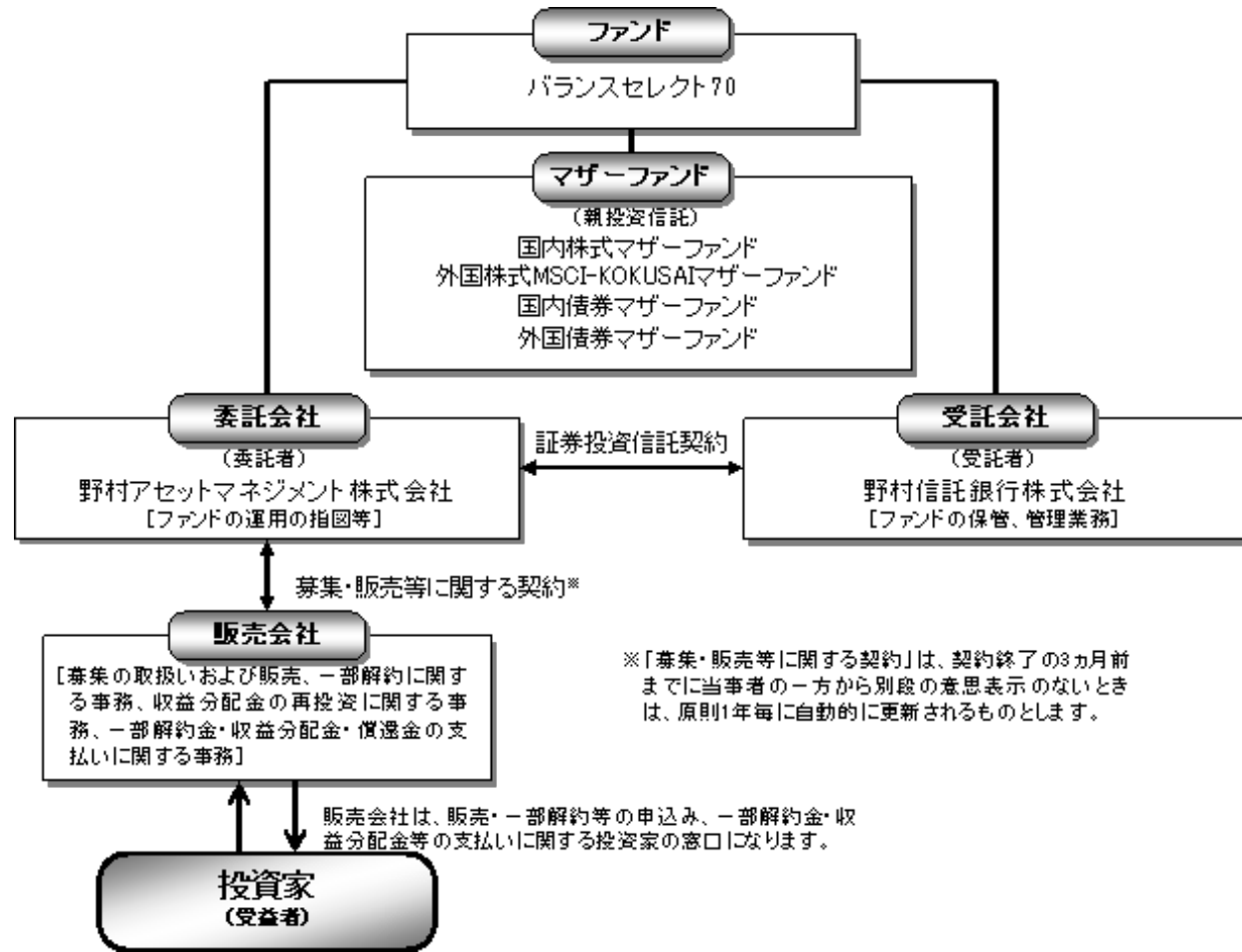
[特殊型]

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成13年5月11日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

委託会社

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・資本金の額

平成24年6月末現在、17,180百万円

・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村證券投資信託委託株式会社として設立

平成9年(1997年)10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村ア
セット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

平成12年(2000年)11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

・大株主の状況(平成24年6月末現在)

| 名称 | 住所 | 所有株式数 | 比率 |
|----------------|------------------|------------|------|
| 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区日本橋一丁目9番1号 | 5,150,693株 | 100% |

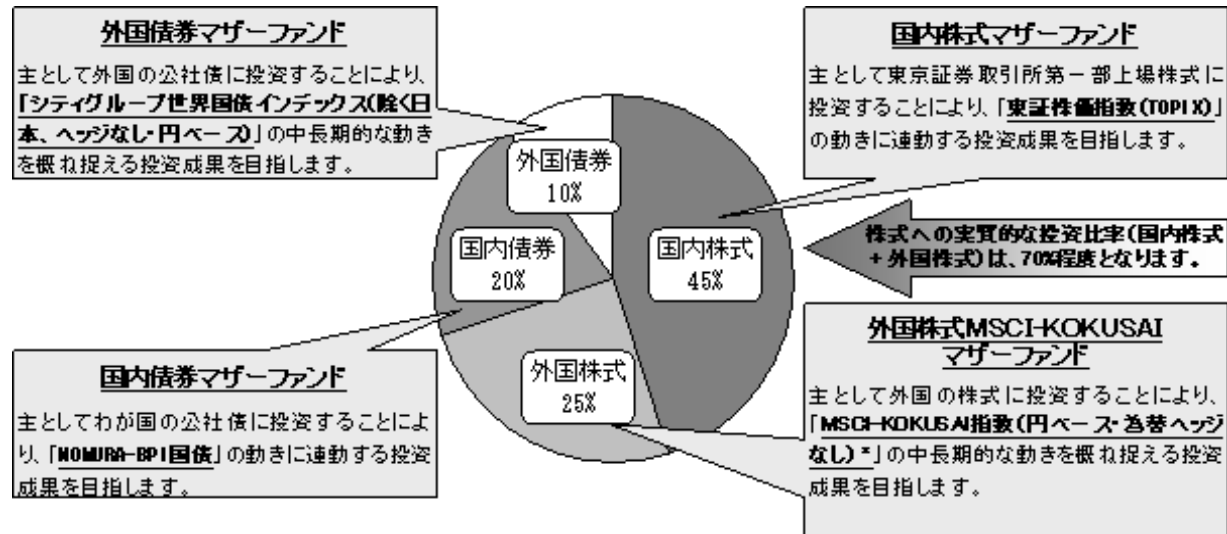
2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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

運用にあたっては、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券に投資を行ないます。

各マザーファンドへの投資比率は以下を基本とし、原則として3ヵ月毎にリバランスを行ないます。



* MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

各マザーファンドが対象とするインデックスについて

国内株式マザーファンド：東証株価指数(TOPIX)

東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした指数です。新規上場銘柄や有償増資などに対しては、修正を加えることで指数の連続性を維持しています。

東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(以下「(株)東京証券取引所」という。)の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行なう権利を有しています。

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)

MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

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

国内債券マザーファンド：NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村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、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

外国債券マザーファンド：シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行わない円ベースの指数)です。

シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが有しています。

[2] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

外貨建資産に投資するマザーファンドにおいても、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とします。

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

各マザーファンドの主要投資対象

[1] 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。

[2] 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

外国の株式を主要投資対象とします。

[3] 国内債券マザーファンド

わが国の公社債を主要投資対象とします。

[4] 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。

なお、デリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定します。

投資の対象とする資産の種類(約款第20条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ 有価証券

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

ハ 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ 金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

有価証券の指図範囲(約款第21条第1項)

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

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

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

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

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

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

- 1 株券または新株引受権証書
- 2 国債証券
- 3 地方債証券
- 4 特別の法律により法人の発行する債券(金融商品取引法第2条第1項第3号で定めるものをいいます。)
- 5 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10 コマーシャル・ペーパー

- 11 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 12 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 17 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 18 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
- 20 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 21 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

金融商品の指図範囲(約款第21条第2項)

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

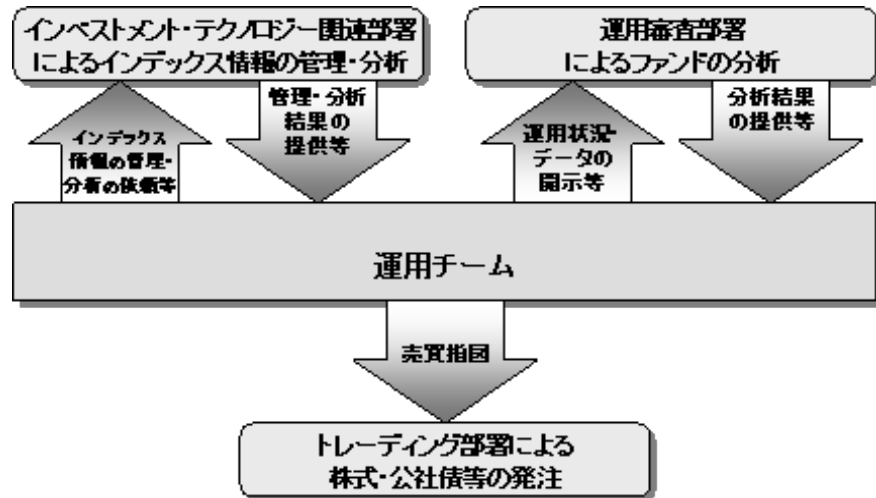
- 1 預金
- 2 指定金銭信託（上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。）
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

- 1 先物取引等
- 2 スワップ取引

(3) 【運用体制】

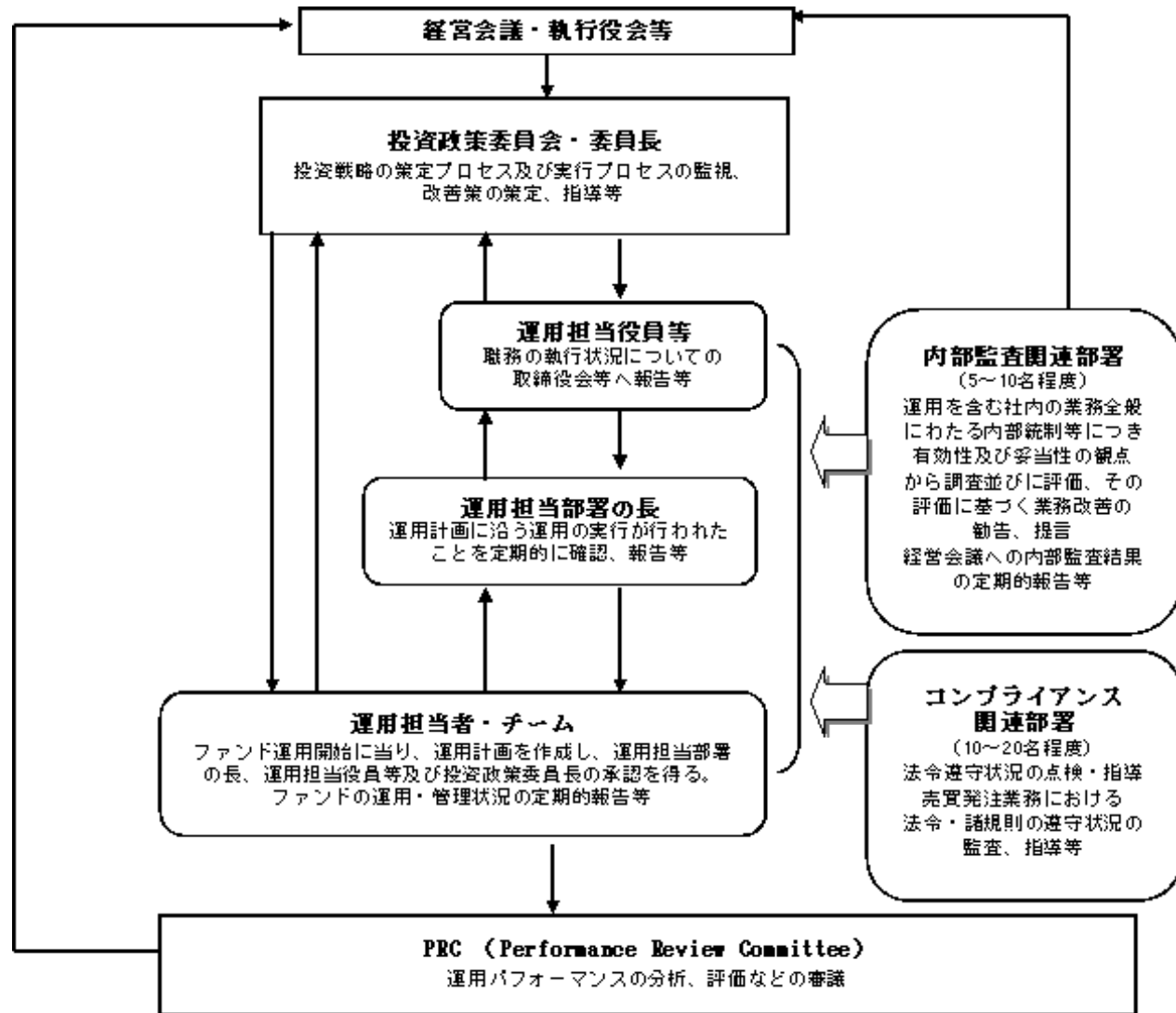
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、SAS70（受託業務にかかわる内部統制について評価する監査人の業務に関する基準）に基づく受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

ファンドの運用体制等は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

年1回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。

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

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

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

毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

* 委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

ファンドの決算日

原則として毎年5月10日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

分配金のお支払い

分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

株式への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

デリバティブの使用はヘッジ目的に限定します。

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第27条)

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

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

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

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

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

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

- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 - 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ()委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額、以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 - 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第28条)

- ()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(「スワップ取引」)を行なうことの指図をすることができます。
- ()スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ()スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額と各マザーファンド(国内株式マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、国内債券マザーファンドおよび外国債券マザーファンドをいいます。以下本項において同じ。)の信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引

の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

()スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

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

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

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

投資信託証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第23条)

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

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

同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

同一銘柄の転換社債等への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

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

信用取引の指図範囲(約款第26条)

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

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

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第30条)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- 1 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないこととします。
 - 2 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ()上記()に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ()委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第32条)

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

外国為替予約の指図(約款第33条)

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

資金の借入れ(約款第42条)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ()一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ()収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ()借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

- ()委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数
- ()当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

(参考)各マザーファンドの概要

(国内株式マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

(外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行いません。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行いません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

（国内債券マザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行いません。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行いません。

(外国債券マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

この投資信託は、シティグループ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せん。

2．運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

3 【投資リスク】

基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様には帰属します。したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

[株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

[為替変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますのでこれらの影響を受けます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。

ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。

有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

算日の基準価額と比べて下落することになります。

外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドについて

「MSCI」の著作権等について

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

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

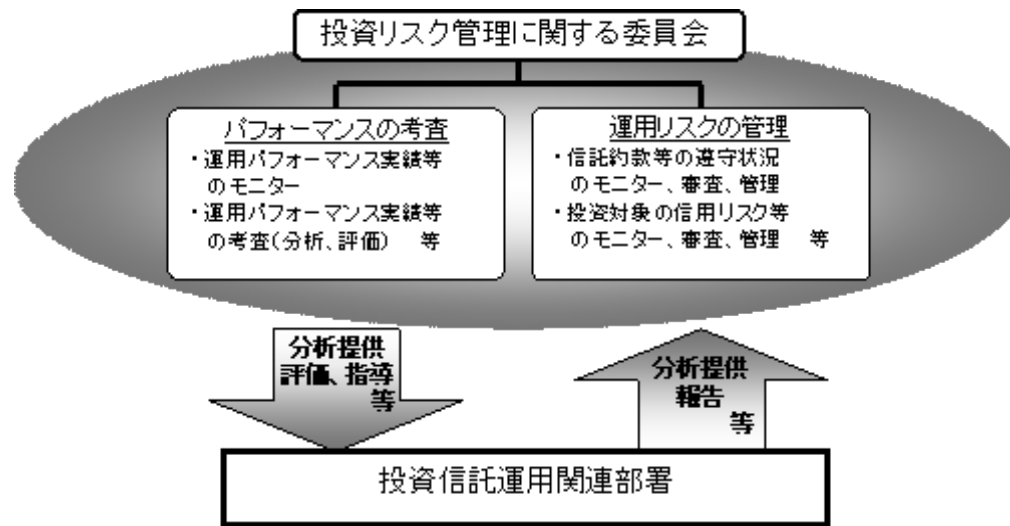
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.05%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜1.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせ下さい。なお、販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。
収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の75.6(税抜年10,000分の72)の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

| | | |
|-------------|-------------|------------|
| < 委託会社 > | < 販売会社 > | < 受託会社 > |
| 年10,000分の29 | 年10,000分の38 | 年10,000分の5 |

上記の信託報酬の総額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。

(4) 【その他の手数料等】

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

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産から支払われます。

ファンドに係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときに信託財産中から支払われます。

これらの費用等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

[平成24年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10.147%（国税（所得税及び復興特別所得税）7.147%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%（国税15.315%および地方税5%）となる予定です。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

[平成24年12月31日までの間]

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10%の税率により源泉徴収が行なわれます。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により10.147%（国税7.147%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10.147%の税率により源泉徴収が行なわれます。なお、上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%（国税15.315%および地方税5%）となる予定です。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との通算が可能です。

法人の投資家に対する課税

[平成24年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（国税7.147%）の税率で源泉徴収

が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7.147%の税率は平成26年1月1日以後、15.315%(国税15.315%)となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

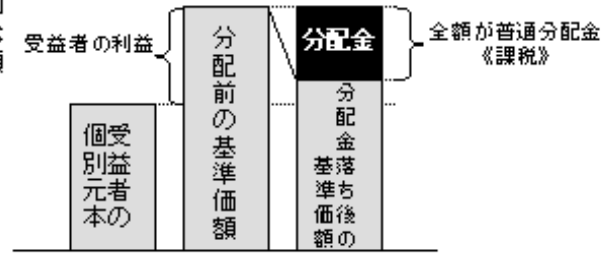
追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

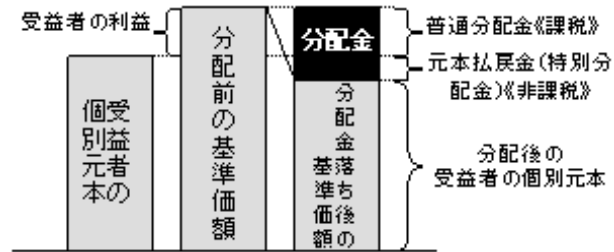
分配金の課税について

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

①分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額の場合または受益者の個別元本を上回っている場合には分配金の全額が普通分配金となります。



②分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。



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

(ご参考)

お客様に直接ご負担いただく費用・税金

| 時期 | 項目 | 費用 | 税金 |
|----------------|---------|--------------------------------|---------|
| 買付時 | 申込手数料 | 1.05% (税抜1.0%) 以内 ¹ | 消費税等相当額 |
| 換金時 (解約請求制) | 信託財産留保額 | 0.3% ² | |

¹ 基準価額に、1.05% (税抜1.0%) 以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

² 基準価額に0.3%を乗じて得た額とします。

| 時期 | 項目 | 費用 | 税金 |
|----------------|-----------|----|---|
| 分配時 | 所得税および地方税 | | 普通分配金 × 10% ¹ |
| 換金時 (解約請求制) | 所得税および地方税 | | 換金時の差益 (譲渡益) ² に対して10% ¹ |
| 償還時 | 所得税および地方税 | | 償還時の差益 (譲渡益) ² に対して10% ¹ |

¹ 個人の投資家の場合の税率です。法人の投資家の場合は税率等が異なります。詳しくは前述の「法人の投資家に対する課税」をご覧ください。

平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間は10.147%、平成26年1月1日以後は20.315%となる予定です。

² 詳しくは前述の「換金 (解約) 時および償還時の課税について」をご覧ください。

税法が改正された場合等は、上記「(5) 課税上の取扱い」の内容が変更となる場合があります。

5 【運用状況】

以下は平成24年5月31日現在の運用状況であります。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 1,017,578,457 | 99.90 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 995,495 | 0.09 |
| 合計(純資産総額) | | 1,018,573,952 | 100.00 |

<ご参考>

「国内株式マザーファンド」

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 126,016,716,818 | 96.57 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 4,472,331,165 | 3.42 |
| 合計(純資産総額) | | 130,489,047,983 | 100.00 |

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。評価にあたっては取引所の発表する清算値段を用いております。

| 名称 | 取引所 | 種類 | 買建 /売建 | 通貨 | 枚数 | 簿価 | 評価額 (時価) | 投資比率 (%) |
|-------------------|---------|--------|-----------|----|-----|---------------|---------------|-------------|
| TOPIX先物(2012年6月限) | 東京証券取引所 | 株価指数先物 | 買建 | 円 | 605 | 4,616,039,020 | 4,337,850,000 | 3.32 |

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|-------------|-----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 109,832,164,156 | 57.71 |
| | カナダ | 10,114,059,703 | 5.31 |
| | イギリス | 18,893,938,891 | 9.92 |
| | スイス | 7,191,329,280 | 3.77 |
| | スウェーデン | 2,551,710,143 | 1.34 |
| | ノルウェー | 757,048,079 | 0.39 |
| | デンマーク | 984,192,345 | 0.51 |
| | ドイツ | 6,765,447,941 | 3.55 |
| | イタリア | 1,673,974,313 | 0.87 |
| | フランス | 6,930,989,089 | 3.64 |
| | オランダ | 2,072,638,933 | 1.08 |
| | スペイン | 1,946,716,901 | 1.02 |
| | ベルギー | 864,579,771 | 0.45 |
| | オーストリア | 186,999,922 | 0.09 |
| | フィンランド | 634,417,380 | 0.33 |
| | アイルランド | 247,413,935 | 0.13 |
| | ギリシャ | 39,745,005 | 0.02 |
| | ポルトガル | 150,436,828 | 0.07 |
| | 香港 | 2,409,969,686 | 1.26 |
| | シンガポール | 1,451,736,898 | 0.76 |
| | オーストラリア | 6,622,198,987 | 3.47 |
| ニュージーランド | 107,179,455 | 0.05 | |
| イスラエル | 517,985,383 | 0.27 | |
| 小計 | | 182,946,873,024 | 96.12 |
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 34,566,960 | 0.01 |
| 投資証券 | アメリカ | 2,771,763,418 | 1.45 |
| | カナダ | 44,810,593 | 0.02 |
| | イギリス | 226,946,329 | 0.11 |
| | フランス | 225,002,007 | 0.11 |
| | オランダ | 21,856,950 | 0.01 |
| | 香港 | 77,616,812 | 0.04 |
| | シンガポール | 52,274,524 | 0.02 |
| | オーストラリア | 555,817,135 | 0.29 |
| 小計 | | 3,976,087,768 | 2.08 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 3,357,780,517 | 1.76 |
| 合計(純資産総額) | | 190,315,308,269 | 100.00 |

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

| 名称 | 取引所 | 種類 | 買建 / 売 建 | 通貨 | 枚数 | 簿価 (現地通貨) | 評価額(時価 ・ 現地通貨) | 評価額 (時価・円) | 投資 比率 (%) |
|-------------------------------|----------------|--------|----------------|--------|-----|--------------|----------------------|---------------|-----------------|
| E-mini S&P500株価指数先物(2012年6月限) | シカゴ・マーカンタイル取引所 | 株価指数先物 | 買建 | 米ドル | 392 | 26,473,725 | 25,646,600 | 2,024,029,672 | 1.06 |
| S&P TSX60株価指数先物(2012年6月限) | モントリオール取引所 | 株価指数先物 | 買建 | カナダドル | 18 | 2,419,920 | 2,333,520 | 178,794,302 | 0.09 |
| ユーロ50株価指数先物(2012年6月限) | EUREX | 株価指数先物 | 買建 | ユーロ | 191 | 4,200,930 | 4,033,920 | 393,791,270 | 0.20 |
| FT100株価指数先物(2012年6月限) | ロンドン国際金融先物取引所 | 株価指数先物 | 買建 | 英ポンド | 54 | 2,971,235 | 2,855,250 | 348,654,577 | 0.18 |
| SMI株価指数先物(2012年6月限) | EUREX | 株価指数先物 | 買建 | スイスフラン | 27 | 1,615,010 | 1,594,080 | 129,566,822 | 0.06 |

「国内債券マザーファンド」

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 5,496,968,630 | 98.33 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 92,977,228 | 1.66 |
| 合計(純資産総額) | | 5,589,945,858 | 100.00 |

「外国債券マザーファンド」

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|---------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 113,975,989,062 | 42.46 |
| | カナダ | 7,732,994,689 | 2.88 |
| | イギリス | 21,398,901,963 | 7.97 |
| | スイス | 877,762,227 | 0.32 |
| | スウェーデン | 1,563,311,187 | 0.58 |
| | ノルウェー | 857,947,601 | 0.31 |
| | デンマーク | 2,226,619,515 | 0.82 |
| | ドイツ | 22,663,456,443 | 8.44 |
| | イタリア | 22,886,170,928 | 8.52 |
| | フランス | 25,133,470,980 | 9.36 |
| | オランダ | 6,947,413,224 | 2.58 |
| | スペイン | 10,636,654,109 | 3.96 |
| | ベルギー | 6,840,492,731 | 2.54 |
| | オーストリア | 4,624,687,481 | 1.72 |
| | フィンランド | 1,647,067,091 | 0.61 |
| | アイルランド | 1,736,705,326 | 0.64 |
| | ポーランド | 1,763,960,724 | 0.65 |
| | シンガポール | 1,020,064,464 | 0.38 |
| マレーシア | 1,396,504,623 | 0.52 | |
| オーストラリア | 3,907,973,736 | 1.45 | |
| メキシコ | 2,329,709,540 | 0.86 | |
| 小計 | | 262,167,857,644 | 97.67 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 6,249,593,430 | 2.32 |
| 合計(純資産総額) | | 268,417,451,074 | 100.00 |

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|----------|-------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 投資信託受益証券 | 国内株式マザーファンド | 731,773,401 | 0.6580 | 481,537,279 | 0.6187 | 452,748,203 | 44.44 |
| 2 | 日本 | 投資信託受益証券 | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 269,694,149 | 0.9716 | 262,034,835 | 0.9169 | 247,282,565 | 24.27 |
| 3 | 日本 | 投資信託受益証券 | 国内債券マザーファンド | 177,161,120 | 1.1945 | 211,618,958 | 1.1983 | 212,292,170 | 20.84 |
| 4 | 日本 | 投資信託受益証券 | 外国債券マザーファンド | 73,440,915 | 1.4713 | 108,053,619 | 1.4332 | 105,255,519 | 10.33 |

<ご参考>

「国内株式マザーファンド」

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|----|-------------------|--------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 1,663,400 | 3,169.39 | 5,271,970,000 | 3,040.00 | 5,056,736,000 | 3.87 |
| 2 | 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 9,584,600 | 356.94 | 3,421,180,100 | 340.00 | 3,258,764,000 | 2.49 |
| 3 | 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 1,082,300 | 2,709.94 | 2,932,976,500 | 2,512.00 | 2,718,737,600 | 2.08 |
| 4 | 日本 | 株式 | キヤノン | 電気機器 | 796,900 | 3,458.78 | 2,756,302,000 | 3,150.00 | 2,510,235,000 | 1.92 |
| 5 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 961,300 | 2,402.51 | 2,309,535,900 | 2,289.00 | 2,200,415,700 | 1.68 |
| 6 | 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 583,000 | 3,554.09 | 2,072,038,500 | 3,380.00 | 1,970,540,000 | 1.51 |
| 7 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 16,285,100 | 117.99 | 1,921,637,000 | 115.00 | 1,872,786,500 | 1.43 |
| 8 | 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 133,600 | 13,293.97 | 1,776,075,000 | 13,520.00 | 1,806,272,000 | 1.38 |
| 9 | 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 503,200 | 3,409.02 | 1,715,419,000 | 3,275.00 | 1,647,980,000 | 1.26 |
| 10 | 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 922,000 | 1,659.39 | 1,529,962,000 | 1,535.00 | 1,415,270,000 | 1.08 |
| 11 | 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 573,600 | 2,414.48 | 1,384,947,600 | 2,450.00 | 1,405,320,000 | 1.07 |
| 12 | 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 3,186 | 434,088.98 | 1,383,007,500 | 437,000.00 | 1,392,282,000 | 1.06 |
| 13 | 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 2,956,000 | 483.83 | 1,430,204,000 | 449.00 | 1,327,244,000 | 1.01 |
| 14 | 日本 | 株式 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 情報・通信業 | 10,432 | 129,966.65 | 1,355,812,100 | 125,100.00 | 1,305,043,200 | 1.00 |
| 15 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 529,600 | 2,394.85 | 1,268,312,800 | 2,359.00 | 1,249,326,400 | 0.95 |
| 16 | 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 1,632,100 | 777.85 | 1,269,542,800 | 758.00 | 1,237,131,800 | 0.94 |
| 17 | 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 1,092,800 | 1,133.94 | 1,239,176,800 | 1,104.00 | 1,206,451,200 | 0.92 |
| 18 | 日本 | 株式 | 小松製作所 | 機械 | 626,500 | 2,051.32 | 1,285,158,000 | 1,878.00 | 1,176,567,000 | 0.90 |
| 19 | 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 886,000 | 1,281.79 | 1,135,672,000 | 1,219.00 | 1,080,034,000 | 0.82 |
| 20 | 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 223,100 | 4,818.38 | 1,074,982,000 | 4,665.00 | 1,040,761,500 | 0.79 |
| 21 | 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 241,000 | 4,214.01 | 1,015,577,000 | 4,030.00 | 971,230,000 | 0.74 |
| 22 | 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 1,965 | 491,513.23 | 965,823,500 | 484,500.00 | 952,042,500 | 0.72 |
| 23 | 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 298,200 | 3,199.19 | 954,000,000 | 3,080.00 | 918,456,000 | 0.70 |
| 24 | 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 1,010,000 | 874.05 | 882,794,400 | 859.00 | 867,590,000 | 0.66 |
| 25 | 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 800,300 | 1,212.04 | 970,002,500 | 1,050.00 | 840,315,000 | 0.64 |
| 26 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 480,700 | 1,897.12 | 911,949,500 | 1,707.00 | 820,554,900 | 0.62 |
| 27 | 日本 | 株式 | 東芝 | 電気機器 | 2,701,000 | 317.88 | 858,614,000 | 295.00 | 796,795,000 | 0.61 |
| 28 | 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 1,283,000 | 648.83 | 832,460,000 | 617.00 | 791,611,000 | 0.60 |
| 29 | 日本 | 株式 | 国際石油開発帝石 | 鉱業 | 1,747 | 488,842.58 | 854,008,000 | 453,000.00 | 791,391,000 | 0.60 |
| 30 | 日本 | 株式 | 住友商事 | 卸売業 | 747,200 | 1,093.87 | 817,339,900 | 1,053.00 | 786,801,600 | 0.60 |

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|-------------|----|------------------------------------|-------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 株式 | APPLE INC | コンピュータ・周辺 機器 | 107,910 | 47,284.91 | 5,102,515,501 | 45,708.09 | 4,932,360,682 | 2.59 |
| 2 | アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | 石油・ガス・消耗燃 料 | 556,500 | 6,843.15 | 3,808,214,755 | 6,297.02 | 3,504,295,414 | 1.84 |
| 3 | アメリカ | 株式 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 情報技術サービス | 136,780 | 16,462.71 | 2,251,769,747 | 15,352.30 | 2,099,888,633 | 1.10 |
| 4 | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア | 878,600 | 2,543.59 | 2,234,799,579 | 2,315.51 | 2,034,409,546 | 1.06 |
| 5 | アメリカ | 株式 | GENERAL ELEC CO | コングロマリット | 1,225,000 | 1,583.13 | 1,939,340,620 | 1,502.63 | 1,840,730,080 | 0.96 |
| 6 | アメリカ | 株式 | AT & T INC | 各種電気通信サービ ス | 687,600 | 2,465.46 | 1,695,250,846 | 2,670.65 | 1,836,340,865 | 0.96 |
| 7 | アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | 石油・ガス・消耗燃 料 | 231,100 | 8,460.22 | 1,955,157,766 | 7,704.95 | 1,780,616,163 | 0.93 |
| 8 | スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品 | 382,890 | 4,615.07 | 1,767,067,368 | 4,502.91 | 1,724,119,975 | 0.90 |
| 9 | アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品 | 319,200 | 5,301.05 | 1,692,097,202 | 4,918.29 | 1,569,919,572 | 0.82 |
| 10 | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品 | 316,800 | 5,203.98 | 1,648,622,384 | 4,909.61 | 1,555,365,461 | 0.81 |
| 11 | アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品 | 891,800 | 1,787.53 | 1,594,126,388 | 1,739.39 | 1,551,194,066 | 0.81 |
| 12 | アメリカ | 株式 | WELLS FARGO CO | 商業銀行 | 581,100 | 2,692.75 | 1,564,757,257 | 2,501.76 | 1,453,775,060 | 0.76 |
| 13 | アメリカ | 株式 | COCA COLA CO | 飲料 | 237,100 | 5,843.23 | 1,385,431,445 | 5,923.73 | 1,404,517,615 | 0.73 |
| 14 | アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL A | インターネットソフ トウェア | 29,700 | 50,568.77 | 1,501,892,742 | 46,423.11 | 1,378,766,414 | 0.72 |
| 15 | アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | タバコ | 201,500 | 6,993.10 | 1,409,109,891 | 6,698.72 | 1,349,794,014 | 0.70 |
| 16 | イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC | 商業銀行 | 2,072,500 | 676.48 | 1,402,024,281 | 614.82 | 1,274,222,429 | 0.66 |
| 17 | イギリス | 株式 | VODAFONE GROUP PLC | 無線通信サービス | 5,830,600 | 210.02 | 1,224,596,253 | 209.84 | 1,223,528,291 | 0.64 |
| 18 | アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造 装置 | 590,500 | 2,217.65 | 1,309,523,506 | 2,062.17 | 1,217,717,053 | 0.63 |
| 19 | アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 各種金融サービス | 440,600 | 3,624.79 | 1,597,084,941 | 2,601.20 | 1,146,090,129 | 0.60 |
| 20 | アメリカ | 株式 | WAL-MART STORES INC | 食品・生活必需品小 売り | 219,800 | 4,827.53 | 1,061,092,500 | 5,164.52 | 1,135,162,551 | 0.59 |
| 21 | スイス | 株式 | NOVARTIS-REG | 医薬品 | 270,620 | 4,059.93 | 1,098,699,880 | 4,108.70 | 1,111,897,476 | 0.58 |
| 22 | アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS | 各種電気通信サービ ス | 328,300 | 3,018.69 | 991,035,927 | 3,268.86 | 1,073,168,839 | 0.56 |
| 23 | イギリス | 株式 | BP PLC | 石油・ガス・消耗燃 料 | 2,198,900 | 564.14 | 1,240,505,476 | 486.36 | 1,069,466,085 | 0.56 |
| 24 | アメリカ | 株式 | MERCK & CO INC | 医薬品 | 353,400 | 3,030.52 | 1,070,988,595 | 2,951.60 | 1,043,098,267 | 0.54 |
| 25 | イギリス | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 石油・ガス・消耗燃 料 | 422,200 | 2,665.66 | 1,125,442,200 | 2,428.15 | 1,025,168,033 | 0.53 |
| 26 | スイス | 株式 | ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE) | 医薬品 | 81,460 | 12,769.90 | 1,040,236,119 | 12,362.68 | 1,007,064,564 | 0.52 |
| 27 | イギリス | 株式 | GLAXOSMITHKLINE PLC | 医薬品 | 585,300 | 1,704.65 | 997,734,922 | 1,720.52 | 1,007,026,150 | 0.52 |
| 28 | アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 飲料 | 181,200 | 5,236.34 | 948,825,170 | 5,383.92 | 975,566,738 | 0.51 |
| 29 | アメリカ | 株式 | ORACLE CORPORATION | ソフトウェア | 467,800 | 2,300.51 | 1,076,182,320 | 2,065.33 | 966,164,367 | 0.50 |
| 30 | オーストラ リア | 株式 | BHP BILLITON LIMITED | 金属・鉱業 | 372,300 | 2,649.04 | 986,241,091 | 2,462.29 | 916,711,237 | 0.48 |

「国内債券マザーファンド」

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|-------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第87回 | 80,000,000 | 101.01 | 80,809,600 | 101.01 | 80,812,000 | 0.5 | 2014/12/20 | 1.44 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第284回 | 75,000,000 | 106.71 | 80,039,250 | 106.82 | 80,121,000 | 1.7 | 2016/12/20 | 1.43 |
| 3 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第305回 | 70,000,000 | 105.43 | 73,803,800 | 105.77 | 74,044,600 | 1.3 | 2019/12/20 | 1.32 |
| 4 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第90回 | 70,000,000 | 100.54 | 70,378,000 | 100.60 | 70,424,200 | 0.3 | 2015/6/20 | 1.25 |
| 5 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第100回 | 70,000,000 | 100.38 | 70,271,600 | 100.55 | 70,387,800 | 0.3 | 2016/9/20 | 1.25 |
| 6 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第102回 | 70,000,000 | 100.31 | 70,222,600 | 100.49 | 70,346,500 | 0.3 | 2016/12/20 | 1.25 |
| 7 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第288回 | 65,000,000 | 107.43 | 69,830,800 | 107.57 | 69,925,700 | 1.7 | 2017/9/20 | 1.25 |
| 8 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第253回 | 63,000,000 | 102.02 | 64,272,600 | 101.94 | 64,222,830 | 1.6 | 2013/9/20 | 1.14 |
| 9 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第313回 | 60,000,000 | 104.73 | 62,842,800 | 105.09 | 63,059,400 | 1.3 | 2021/3/20 | 1.12 |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第312回 | 60,000,000 | 104.05 | 62,434,200 | 104.45 | 62,671,200 | 1.2 | 2020/12/20 | 1.12 |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第285回 | 58,000,000 | 106.99 | 62,058,840 | 107.09 | 62,114,520 | 1.7 | 2017/3/20 | 1.11 |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第85回 | 60,000,000 | 101.39 | 60,837,600 | 101.37 | 60,824,400 | 0.7 | 2014/9/20 | 1.08 |
| 13 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第84回 | 60,000,000 | 101.24 | 60,748,200 | 101.22 | 60,733,800 | 0.7 | 2014/6/20 | 1.08 |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第97回 | 60,000,000 | 100.85 | 60,512,400 | 101.00 | 60,602,400 | 0.4 | 2016/6/20 | 1.08 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第99回 | 60,000,000 | 100.81 | 60,491,400 | 100.98 | 60,588,000 | 0.4 | 2016/9/20 | 1.08 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第296回 | 55,000,000 | 106.78 | 58,730,100 | 107.01 | 58,859,900 | 1.5 | 2018/9/20 | 1.05 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第282回 | 55,000,000 | 106.45 | 58,547,500 | 106.54 | 58,600,850 | 1.7 | 2016/9/20 | 1.04 |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(20年)第113回 | 50,000,000 | 108.33 | 54,168,000 | 109.06 | 54,531,500 | 2.1 | 2029/9/20 | 0.97 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第287回 | 50,000,000 | 108.25 | 54,128,000 | 108.35 | 54,176,500 | 1.9 | 2017/6/20 | 0.96 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第264回 | 52,000,000 | 103.27 | 53,702,480 | 103.20 | 53,667,120 | 1.5 | 2014/9/20 | 0.96 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第310回 | 50,000,000 | 102.61 | 51,305,000 | 102.99 | 51,499,000 | 1 | 2020/9/20 | 0.92 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(20年)第25回 | 48,000,000 | 107.37 | 51,539,040 | 107.15 | 51,433,920 | 4.1 | 2014/3/20 | 0.92 |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第81回 | 50,000,000 | 101.28 | 50,641,000 | 101.25 | 50,626,000 | 0.8 | 2014/3/20 | 0.90 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(2年)第316回 | 50,000,000 | 100.00 | 50,001,500 | 100.00 | 50,000,000 | 0.1 | 2014/5/15 | 0.89 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第301回 | 45,000,000 | 106.89 | 48,102,300 | 107.16 | 48,225,600 | 1.5 | 2019/6/20 | 0.86 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第303回 | 45,000,000 | 106.23 | 47,804,400 | 106.56 | 47,952,000 | 1.4 | 2019/9/20 | 0.85 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第299回 | 45,000,000 | 105.50 | 47,478,150 | 105.77 | 47,599,200 | 1.3 | 2019/3/20 | 0.85 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第273回 | 45,000,000 | 104.55 | 47,050,200 | 104.58 | 47,061,450 | 1.5 | 2015/9/20 | 0.84 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第269回 | 45,000,000 | 103.36 | 46,514,250 | 103.34 | 46,503,000 | 1.3 | 2015/3/20 | 0.83 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第270回 | 42,000,000 | 103.63 | 43,524,600 | 103.64 | 43,529,220 | 1.3 | 2015/6/20 | 0.77 |

「外国債券マザーファンド」

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|-----------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | イギリス | 国債証券 | UK TREASURY | 13,800,000 | 15,253.98 | 2,105,049,405 | 15,801.03 | 2,180,542,692 | 4.5 | 2042/12/7 | 0.81 |
| 2 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 21,000,000 | 8,851.66 | 1,858,850,112 | 9,006.74 | 1,891,416,450 | 3.125 | 2021/5/15 | 0.70 |
| 3 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 20,000,000 | 9,186.78 | 1,837,356,250 | 9,321.19 | 1,864,238,296 | 3.625 | 2020/2/15 | 0.69 |
| 4 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 19,500,000 | 9,188.65 | 1,791,787,842 | 9,341.53 | 1,821,599,879 | 3.625 | 2021/2/15 | 0.67 |
| 5 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY NOTE | 21,500,000 | 8,368.60 | 1,799,249,562 | 8,351.03 | 1,795,471,511 | 4.25 | 2013/11/15 | 0.66 |
| 6 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 18,000,000 | 9,115.26 | 1,640,746,800 | 9,252.13 | 1,665,384,566 | 3.5 | 2020/5/15 | 0.62 |
| 7 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 20,000,000 | 8,279.81 | 1,655,963,523 | 8,270.56 | 1,654,113,796 | 2.375 | 2014/9/30 | 0.61 |
| 8 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 20,000,000 | 7,969.68 | 1,593,937,296 | 7,965.98 | 1,593,197,500 | 1.125 | 2013/6/15 | 0.59 |
| 9 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 15,700,000 | 9,950.40 | 1,562,213,836 | 9,819.59 | 1,541,676,540 | 4.25 | 2013/8/1 | 0.57 |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 18,550,000 | 8,292.45 | 1,538,250,708 | 8,273.96 | 1,534,819,612 | 4.25 | 2013/8/15 | 0.57 |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 14,000,000 | 10,019.75 | 1,402,765,923 | 10,619.05 | 1,486,667,748 | 4.375 | 2040/5/15 | 0.55 |
| 12 | ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 13,500,000 | 10,903.66 | 1,471,994,896 | 10,935.39 | 1,476,277,974 | 3.5 | 2016/1/4 | 0.54 |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 13,400,000 | 10,020.47 | 1,342,743,301 | 10,612.27 | 1,422,044,682 | 4.375 | 2039/11/15 | 0.52 |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 17,000,000 | 8,188.56 | 1,392,056,282 | 8,176.23 | 1,389,959,969 | 3.125 | 2013/8/31 | 0.51 |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY NOTE | 17,000,000 | 8,164.82 | 1,388,020,897 | 8,148.79 | 1,385,295,623 | 3.625 | 2013/5/15 | 0.51 |
| 16 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A. T | 11,400,000 | 11,326.84 | 1,291,260,740 | 12,080.47 | 1,377,174,150 | 4.5 | 2041/4/25 | 0.51 |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 14,000,000 | 9,236.72 | 1,293,141,166 | 9,807.65 | 1,373,072,273 | 3.875 | 2040/8/15 | 0.51 |
| 18 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 14,500,000 | 9,620.45 | 1,394,965,395 | 9,272.92 | 1,344,573,951 | 3.75 | 2016/8/1 | 0.50 |
| 19 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 14,000,000 | 9,759.07 | 1,366,269,996 | 9,436.92 | 1,321,169,556 | 3.75 | 2015/8/1 | 0.49 |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 12,000,000 | 11,004.40 | 1,320,528,900 | 11,005.64 | 1,320,676,827 | 8.75 | 2017/5/15 | 0.49 |
| 21 | イギリス | 国債証券 | UK TREASURY | 8,500,000 | 14,588.48 | 1,240,020,944 | 15,075.70 | 1,281,434,551 | 4.25 | 2036/3/7 | 0.47 |
| 22 | ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 12,000,000 | 10,628.86 | 1,275,463,872 | 10,625.93 | 1,275,112,440 | 4.25 | 2014/7/4 | 0.47 |
| 23 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY NOTE | 14,700,000 | 8,592.72 | 1,263,130,249 | 8,574.84 | 1,260,501,872 | 4.25 | 2014/8/15 | 0.46 |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 10,000,000 | 12,285.00 | 1,228,500,761 | 12,465.04 | 1,246,504,386 | 8 | 2021/11/15 | 0.46 |
| 25 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A. T | 12,000,000 | 10,262.79 | 1,231,534,872 | 10,262.79 | 1,231,534,872 | 4 | 2013/10/25 | 0.45 |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 15,000,000 | 8,210.14 | 1,231,521,937 | 8,201.20 | 1,230,180,810 | 2.25 | 2014/5/31 | 0.45 |
| 27 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,300,000 | 12,200.54 | 1,256,656,402 | 11,909.64 | 1,226,692,920 | 9 | 2023/11/1 | 0.45 |
| 28 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 14,200,000 | 8,600.73 | 1,221,304,782 | 8,578.54 | 1,218,152,914 | 4.75 | 2014/5/15 | 0.45 |
| 29 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A. T | 10,500,000 | 11,275.11 | 1,183,886,550 | 11,352.22 | 1,191,984,129 | 5 | 2016/10/25 | 0.44 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 15,000,000 | 7,892.61 | 1,183,892,454 | 7,891.38 | 1,183,707,426 | 0.25 | 2013/11/30 | 0.44 |

種類別及び業種別投資比率

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

<ご参考>

「国内株式マザーファンド」

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) | |
|----|--------|------------|-------|
| 株式 | 水産・農林業 | 0.09 | |
| | 鉱業 | 0.68 | |
| | 建設業 | 2.31 | |
| | | 食料品 | 3.83 |
| | | 繊維製品 | 0.90 |
| | | パルプ・紙 | 0.32 |
| | | 化学 | 5.67 |
| | | 医薬品 | 4.91 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.77 |
| | | ゴム製品 | 0.76 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.98 |
| | | 鉄鋼 | 1.66 |
| | | 非鉄金属 | 1.09 |
| | | 金属製品 | 0.66 |
| | | 機械 | 4.88 |
| | | 電気機器 | 12.67 |
| | | 輸送用機器 | 10.32 |
| | | 精密機器 | 1.41 |
| | | その他製品 | 1.43 |
| | | 電気・ガス業 | 2.91 |
| | | 陸運業 | 4.02 |
| | | 海運業 | 0.38 |
| | | 空運業 | 0.28 |
| | | 倉庫・運輸関連業 | 0.22 |
| | | 情報・通信業 | 6.26 |
| | | 卸売業 | 5.47 |
| | | 小売業 | 4.39 |
| | | 銀行業 | 9.05 |
| | | 証券、商品先物取引業 | 0.98 |
| | | 保険業 | 2.04 |
| | | その他金融業 | 0.78 |
| | | 不動産業 | 2.37 |
| | | サービス業 | 1.91 |
| | 小計 | 96.57 | |
| 合計 | | 96.57 | |

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|-----------------|-----------------|---------|
| 株式 | エネルギー設備・サービス | 1.49 |
| | 石油・ガス・消耗燃料 | 9.88 |
| | 化学 | 2.83 |
| | 建設資材 | 0.28 |
| | 容器・包装 | 0.17 |
| | 金属・鉱業 | 3.25 |
| | 紙製品・林産品 | 0.16 |
| | 航空宇宙・防衛 | 1.78 |
| | 建設関連製品 | 0.16 |
| | 建設・土木 | 0.36 |
| | 電気設備 | 0.74 |
| | コングロマリット | 2.17 |
| | 機械 | 1.81 |
| | 商社・流通業 | 0.24 |
| | 商業・専門サービス | 0.42 |
| | 航空貨物・物流サービス | 0.57 |
| | 旅客航空輸送業 | 0.08 |
| | 海運業 | 0.09 |
| | 陸運・鉄道 | 0.88 |
| | 運送インフラ | 0.15 |
| | 自動車部品 | 0.37 |
| | 自動車 | 0.89 |
| | 家庭用耐久財 | 0.18 |
| | レジャー用品 | 0.07 |
| | 繊維・アパレル・贅沢品 | 1.04 |
| | ホテル・レストラン・レジャー | 1.71 |
| | メディア | 2.65 |
| | 販売 | 0.11 |
| | インターネット販売カタログ販売 | 0.60 |
| | 複合小売り | 0.68 |
| | 専門小売り | 1.56 |
| | 食品・生活必需品小売り | 2.33 |
| | 飲料 | 2.48 |
| | 食品 | 2.91 |
| | タバコ | 1.82 |
| | 家庭用品 | 1.55 |
| | パーソナル用品 | 0.28 |
| | ヘルスケア機器・用品 | 1.31 |
| | ヘルスケアプロバイダ・サービス | 1.40 |
| | バイオテクノロジー | 1.01 |
| | 医薬品 | 6.67 |
| | 商業銀行 | 6.81 |
| | 各種金融サービス | 1.98 |
| | 保険 | 3.83 |
| | 不動産管理・開発 | 0.61 |
| | インターネットソフトウェア | 1.10 |
| | 情報技術サービス | 2.42 |
| | ソフトウェア | 2.55 |
| | 通信機器 | 1.27 |
| | コンピュータ・周辺機器 | 3.31 |
| | 電子装置・機器・部品 | 0.32 |
| | 事務用電子機器 | 0.05 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 1.63 |
| | 各種電気通信サービス | 3.09 |
| 無線通信サービス | 0.91 | |
| 電力 | 1.89 | |
| ガス | 0.16 | |
| 総合公益事業 | 1.41 | |
| 水道 | 0.09 | |
| 貯蓄・抵当・不動産金融 | 0.05 | |
| 消費者金融 | 0.52 | |
| 資本市場 | 1.72 | |
| 各種消費者サービス | 0.03 | |
| 独立系発電事業・エネルギー販売 | 0.16 | |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.05 | |
| ライフサイエンスツールサービス | 0.30 | |

| | | |
|----------|--------|-------|
| | 専門サービス | 0.40 |
| | 小計 | 96.12 |
| 投資信託受益証券 | | 0.01 |
| 投資証券 | | 2.08 |
| 合計 | | 98.23 |

「国内債券マザーファンド」

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|------|----|---------|
| 国債証券 | | 98.33 |
| 合計 | | 98.33 |

「外国債券マザーファンド」

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|------|----|---------|
| 国債証券 | | 97.67 |
| 合計 | | 97.67 |

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<ご参考>

「国内株式マザーファンド」

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。評価にあたっては取引所の発表する清算値段を用いております。

| 名称 | 取引所 | 種類 | 買建 /売建 | 通貨 | 枚数 | 簿価 (現地通貨) | 評価額 (時価) | 投資比率 (%) |
|-------------------|---------|--------|-----------|----|-----|---------------|---------------|-------------|
| TOPIX先物(2012年6月限) | 東京証券取引所 | 株価指数先物 | 買建 | 円 | 605 | 4,616,039,020 | 4,337,850,000 | 3.32 |

「外国株式MSCI-KOKUSA I マザーファンド」

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 名称 | 取引所 | 種類 | 買建 /売建 | 通貨 | 枚数 | 簿価 (現地通貨) | 評価額(時価 ・ 現地通貨) | 評価額 (時価・円) | 投資 比率 (%) |
|-------------------------------|----------------|--------|-----------|--------|-----|--------------|----------------------|---------------|-----------------|
| E-mini S&P500株価指数先物(2012年6月限) | シカゴ・マーカンタイル取引所 | 株価指数先物 | 買建 | 米ドル | 392 | 26,473,725 | 25,646,600 | 2,024,029,672 | 1.06 |
| S&P TSX60株価指数先物(2012年6月限) | モントリオール取引所 | 株価指数先物 | 買建 | カナダドル | 18 | 2,419,920 | 2,333,520 | 178,794,302 | 0.09 |
| ユーロ50株価指数先物(2012年6月限) | EUREX | 株価指数先物 | 買建 | ユーロ | 191 | 4,200,930 | 4,033,920 | 393,791,270 | 0.20 |
| FT100株価指数先物(2012年6月限) | ロンドン国際金融先物取引所 | 株価指数先物 | 買建 | 英ポンド | 54 | 2,971,235 | 2,855,250 | 348,654,577 | 0.18 |
| SMI株価指数先物(2012年6月限) | EUREX | 株価指数先物 | 買建 | スイスフラン | 27 | 1,615,010 | 1,594,080 | 129,566,822 | 0.06 |

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

平成24年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

| 計算期間 | 純資産総額(百万円) | | 1口当たり純資産額(円) | |
|-------------------|------------|-------|--------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第2期 (2003年5月12日) | 896 | 897 | 0.7692 | 0.7702 |
| 第3期 (2004年5月10日) | 1,255 | 1,256 | 0.9050 | 0.9060 |
| 第4期 (2005年5月10日) | 1,538 | 1,540 | 0.9535 | 0.9544 |
| 第5期 (2006年5月10日) | 2,141 | 2,147 | 1.2192 | 1.2225 |
| 第6期 (2007年5月10日) | 2,486 | 2,494 | 1.3284 | 1.3326 |
| 第7期 (2008年5月12日) | 1,076 | 1,078 | 1.1418 | 1.1438 |
| 第8期 (2009年5月11日) | 915 | 916 | 0.8607 | 0.8622 |
| 第9期 (2010年5月10日) | 1,049 | 1,051 | 0.9055 | 0.9070 |
| 第10期 (2011年5月10日) | 1,079 | 1,081 | 0.8936 | 0.8951 |
| 第11期 (2012年5月10日) | 1,067 | 1,068 | 0.8473 | 0.8488 |
| 2011年5月末日 | 1,074 | | 0.8866 | |
| 6月末日 | 1,073 | | 0.8872 | |
| 7月末日 | 1,059 | | 0.8719 | |
| 8月末日 | 993 | | 0.8188 | |
| 9月末日 | 978 | | 0.8031 | |
| 10月末日 | 1,017 | | 0.8324 | |
| 11月末日 | 977 | | 0.7950 | |
| 12月末日 | 993 | | 0.8033 | |
| 2012年1月末日 | 1,024 | | 0.8231 | |
| 2月末日 | 1,121 | | 0.8914 | |
| 3月末日 | 1,142 | | 0.9104 | |
| 4月末日 | 1,106 | | 0.8817 | |
| 5月末日 | 1,018 | | 0.8107 | |

【分配の推移】

| 期 | 1口当たりの分配金 |
|------|-----------|
| 第2期 | 0.0010 円 |
| 第3期 | 0.0010 円 |
| 第4期 | 0.0010 円 |
| 第5期 | 0.0035 円 |
| 第6期 | 0.0045 円 |
| 第7期 | 0.0020 円 |
| 第8期 | 0.0015 円 |
| 第9期 | 0.0015 円 |
| 第10期 | 0.0015 円 |
| 第11期 | 0.0015 円 |

【収益率の推移】

| 期 | 収益率 |
|------|--------|
| 第2期 | 13.8 % |
| 第3期 | 17.8 % |
| 第4期 | 5.5 % |
| 第5期 | 28.2 % |
| 第6期 | 9.3 % |
| 第7期 | 13.9 % |
| 第8期 | 24.5 % |
| 第9期 | 5.4 % |
| 第10期 | 1.1 % |
| 第11期 | 5.0 % |

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

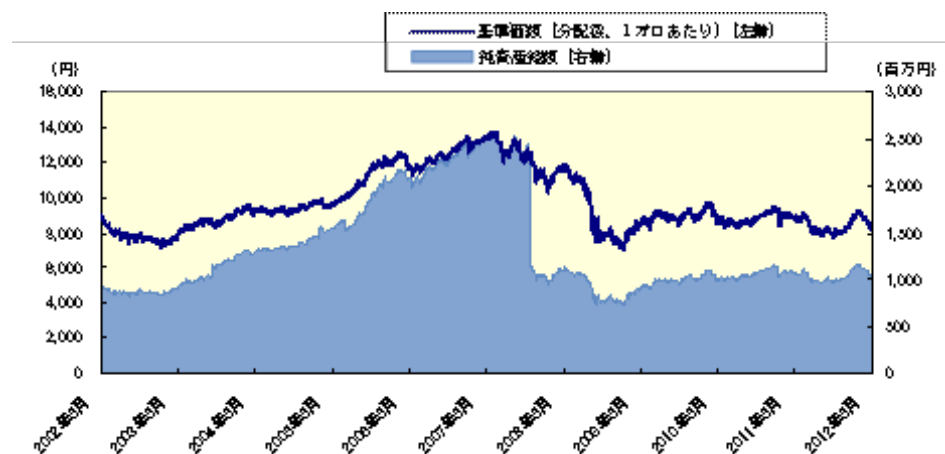
(4)【設定及び解約の実績】

| 期 | 設定口数 | 解約口数 | 発行済み口数 |
|------|-------------|---------------|---------------|
| 第2期 | 142,981,516 | 13,555,472 | 1,165,361,476 |
| 第3期 | 313,671,443 | 91,797,630 | 1,387,235,289 |
| 第4期 | 337,581,280 | 110,901,241 | 1,613,915,328 |
| 第5期 | 419,211,562 | 276,639,718 | 1,756,487,172 |
| 第6期 | 256,972,272 | 141,691,382 | 1,871,768,062 |
| 第7期 | 231,644,818 | 1,160,283,452 | 943,129,428 |
| 第8期 | 182,555,419 | 62,393,677 | 1,063,291,170 |
| 第9期 | 160,277,185 | 64,125,454 | 1,159,442,901 |
| 第10期 | 146,780,906 | 98,117,775 | 1,208,106,032 |
| 第11期 | 139,934,475 | 88,744,330 | 1,259,296,177 |

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

< 参考情報 > 運用実績（2012年5月31日現在）

[基準価額・純資産の推移]（日次）



[分配の推移]（1万口あたり、課税前）

| | |
|---------|-------|
| 2012年5月 | 15 円 |
| 2011年5月 | 15 円 |
| 2010年5月 | 15 円 |
| 2009年5月 | 15 円 |
| 2008年5月 | 20 円 |
| 設定来累計 | 200 円 |

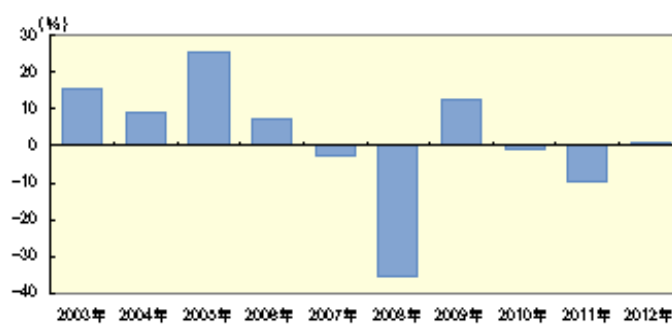
[主要な資産の状況]

| 順位 | 銘柄 | 投資比率(%) |
|----|-------------------------|---------|
| 1 | 国内株式マザーファンド | 44.4 |
| 2 | 外国株式MSCI-KOKUSAJマザーファンド | 24.3 |
| 3 | 国内債券マザーファンド | 20.8 |
| 4 | 外国債券マザーファンド | 10.3 |

| ・「国内株式マザーファンド」を通過しての投資銘柄 | | | | ・「外国株式MSCI-KOKUSAJマザーファンド」を通過しての投資銘柄 | | | |
|--------------------------|-------------------|-------|---------|--------------------------------------|---------------------------------|-------------|---------|
| 順位 | 銘柄 | 業種 | 投資比率(%) | 順位 | 銘柄 | 業種 | 投資比率(%) |
| 1 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 1.7 | 1 | APPLE INC | コンピュータ・周辺機器 | 0.6 |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 1.1 | 2 | EXXON MOBIL CORP | 石油・ガス・精製燃料 | 0.4 |
| 3 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 0.9 | 3 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 情報技術サービス | 0.3 |
| 4 | キャノン | 電気機器 | 0.9 | 4 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア | 0.3 |
| 5 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 0.7 | 5 | GENERAL ELECT CO | コンプロマリット | 0.2 |

| ・「国内債券マザーファンド」を通過しての投資銘柄 | | | | ・「外国債券マザーファンド」を通過しての投資銘柄 | | | |
|--------------------------|-------------------|------|---------|--------------------------|------------------|------|---------|
| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率(%) | 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率(%) |
| 1 | 国庫債券 利付(5年)第87回 | 国債証券 | 0.3 | 1 | UK TREASURY | 国債証券 | 0.1 |
| 2 | 国庫債券 利付(10年)第284回 | 国債証券 | 0.3 | 2 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.1 |
| 3 | 国庫債券 利付(10年)第305回 | 国債証券 | 0.3 | 3 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.1 |
| 4 | 国庫債券 利付(5年)第80回 | 国債証券 | 0.3 | 4 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.1 |
| 5 | 国庫債券 利付(5年)第100回 | 国債証券 | 0.3 | 5 | US TREASURY NOTE | 国債証券 | 0.1 |

[年間収益率の推移] (暦年ベース)



- ・ ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ 2012年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

申込期間中の各営業日に、「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれます。

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

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取扱いとなる場合があります。(原則として、お買付け後のコース変更はできません。)詳細は、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

販売の単位は、「一般コース」の場合は1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。販売会社や申込形態によっては、買付単位が異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

積立方式

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

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

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

<申込手数料>

()取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.05%（税抜1.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

()収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとし、振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2 【換金(解約)手続等】

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

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

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

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

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

信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

換金時の税金につきましては「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、1日1件10億円を超える一部解約はできません。また、大口解約について、1日1件10億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断により一部解約の金額に制限を設ける場合や換金の受付時間に制限を設ける場合があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

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

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

| 対象 | 評価方法 |
|-------|--|
| 株式 | 原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の終値で評価します。 |
| 公社債等 | 原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値) 第一種金融商品取引業者、銀行等の提示する価額 価格情報会社の提供する価額 |
| 外貨建資産 | 原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行います。 |

1 外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日とします。

2 残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)による評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

無期限とします(平成13年5月11日設定)。

(4) 【計算期間】

原則として毎年5月11日から翌年5月10日までとします。

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

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

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

(b) 信託期間の終了

()委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

- ()上記()の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。
- ()委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ()上記()から()までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記()の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
- ()委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ()委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更()」に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。
- ()受託者が委託者の承諾を受けてその任務を辞任する場合、または、委託者または受益者が裁判所に受託者の解任を請求し裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(c) 運用報告書

委託者は、ファンドの決算時および償還時に運用報告書を作成し、知られたる受益者に対して交付します。

(d) 信託約款の変更

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

ときは、原則として、公告を行いません。

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

(e) 公告

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

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

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

(f) 反対者の買取請求権

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

(g) 関係法人との契約の更新に関する手續

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

<自動けいぞく投資契約を結んでいない場合>

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

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

<自動けいぞく投資契約を結んでいる場合>

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

換金(解約)の単位

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

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

換金(解約)代金の支払い開始日

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者にお支払いします。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

第3 【ファンドの経理状況】

バランスセレクト70

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間(平成23年5月11日から平成24年5月10日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第10期 平成23年 5月10日現在 | 第11期 平成24年 5月10日現在 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 8,642,773 | 5,073,930 |
| 親投資信託受益証券 | 1,078,325,928 | 1,065,907,635 |
| 未収入金 | - | 5,125,513 |
| 未収利息 | 21 | 12 |
| 流動資産合計 | 1,086,968,722 | 1,076,107,090 |
| 資産合計 | 1,086,968,722 | 1,076,107,090 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 1,812,159 | 1,888,944 |
| 未払解約金 | 1,531,239 | 3,194,627 |
| 未払受託者報酬 | 284,092 | 276,159 |
| 未払委託者報酬 | 3,806,766 | 3,700,471 |
| その他未払費用 | 16,982 | 16,510 |
| 流動負債合計 | 7,451,238 | 9,076,711 |
| 負債合計 | 7,451,238 | 9,076,711 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,208,106,032 | 1,259,296,177 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 128,588,548 | 192,265,798 |
| （分配準備積立金） | 250,804,213 | 248,428,235 |
| 元本等合計 | 1,079,517,484 | 1,067,030,379 |
| 純資産合計 | 1,079,517,484 | 1,067,030,379 |
| 負債純資産合計 | 1,086,968,722 | 1,076,107,090 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第10期 自平成22年 5月11日 至平成23年 5月10日 | 第11期 自平成23年 5月11日 至平成24年 5月10日 |
|-------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 2,996 | 2,595 |
| 有価証券売買等損益 | 3,178,706 | 45,465,787 |
| その他収益 | - | 2,085 |
| 営業収益合計 | 3,175,710 | 45,461,107 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 553,292 | 546,820 |
| 委託者報酬 | 7,413,995 | 7,327,279 |
| その他費用 | 33,067 | 32,686 |
| 営業費用合計 | 8,000,354 | 7,906,785 |
| 営業利益 | 11,176,064 | 53,367,892 |
| 経常利益 | 11,176,064 | 53,367,892 |
| 当期純利益 | 11,176,064 | 53,367,892 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | 2,410,101 | 3,033,626 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 109,563,244 | 128,588,548 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 9,792,595 | 9,855,898 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 9,792,595 | 9,855,898 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 18,239,777 | 21,309,938 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 18,239,777 | 21,309,938 |
| 分配金 | 1,812,159 | 1,888,944 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 128,588,548 | 192,265,798 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-----------------------|---|
| 1 運用資産の評価基準及び評価方法 | (1) 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 |
| 2 費用・収益の計上基準 | (1) 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 |
| 3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4 その他 | 当ファンドの計算期間は、平成23年5月11日から平成24年5月10日までとなっております。 |

(追加情報)

| | |
|--------------------------------------|--|
| 第11期 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 | |
| 1 | 当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。 |
| 2 | 運用の効率化を可能にするため、平成23年10月5日に主要投資対象の1つである外国株式マザーファンドを、実質的に同一の運用方針を有する外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドに変更する約款の変更を行い、以後同受益証券への投資を行っております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 第10期 平成23年5月10日現在 | 第11期 平成24年5月10日現在 |
|---|---|
| 1 計算期間の末日における受益権の総数 1,208,106,032 口 | 1 計算期間の末日における受益権の総数 1,259,296,177 口 |
| 2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 128,588,548 円 | 2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 192,265,798 円 |
| 3 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.8936 円 (10,000口当たり純資産額 8,936 円) | 3 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.8473 円 (10,000口当たり純資産額 8,473 円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第10期 自 平成22年5月11日 至 平成23年5月10日 | 第11期 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|--|----------------|-------------|--------------|---|-------------|---------------------------|---|---|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-------------|--------------|--------------|---|----------------|-------------------|--------------------|--------|----------------|---|-----|---------|--------------------|------------|---|----|---|-------------|--------------|---|-------------|---------------------------|---|---|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-------------|--------------|--------------|---|----------------|-------------------|--------------------|--------|----------------|---|-----|---------|--------------------|------------|
| 1 分配金の計算過程 計算期末における分配対象金額492,072,382円(10,000口当たり4,073円)のうち、1,812,159円(10,000口当たり15円)を分配金額としております。 | 1 分配金の計算過程 計算期末における分配対象金額528,223,672円(10,000口当たり4,194円)のうち、1,888,944円(10,000口当たり15円)を分配金額としております。 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">14,947,690円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">14,947,690円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">239,456,010円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">237,668,682円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: center;">E = A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">492,072,382円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">1,208,106,032口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: center;">G = E / F × 10,000</td> <td style="text-align: right;">4,073円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">15円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td style="text-align: center;">I = F × H / 10,000</td> <td style="text-align: right;">1,812,159円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | A | 14,947,690円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 14,947,690円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 収益調整金額 | C | 239,456,010円 | 分配準備積立金額 | D | 237,668,682円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E = A+B+C+D | 492,072,382円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,208,106,032口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G = E / F × 10,000 | 4,073円 | 10,000口当たり分配金額 | H | 15円 | 収益分配金金額 | I = F × H / 10,000 | 1,812,159円 | <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">16,739,545円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">16,739,545円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">277,906,493円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">233,577,634円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: center;">E = A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">528,223,672円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">1,259,296,177口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: center;">G = E / F × 10,000</td> <td style="text-align: right;">4,194円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">15円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td style="text-align: center;">I = F × H / 10,000</td> <td style="text-align: right;">1,888,944円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | A | 16,739,545円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 16,739,545円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | 収益調整金額 | C | 277,906,493円 | 分配準備積立金額 | D | 233,577,634円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E = A+B+C+D | 528,223,672円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,259,296,177口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G = E / F × 10,000 | 4,194円 | 10,000口当たり分配金額 | H | 15円 | 収益分配金金額 | I = F × H / 10,000 | 1,888,944円 |
| 項目 | A | 14,947,690円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 14,947,690円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 239,456,010円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 237,668,682円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E = A+B+C+D | 492,072,382円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,208,106,032口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G = E / F × 10,000 | 4,073円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 15円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金金額 | I = F × H / 10,000 | 1,812,159円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | A | 16,739,545円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 16,739,545円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 277,906,493円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 233,577,634円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E = A+B+C+D | 528,223,672円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,259,296,177口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G = E / F × 10,000 | 4,194円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 15円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益分配金金額 | I = F × H / 10,000 | 1,888,944円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 第10期 自 平成22年5月11日 至 平成23年5月10日 | 第11期 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 |
|---|---|
| <p>1 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> | <p>1 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 第10期 平成23年5月10日現在 | 第11期 平成24年5月10日現在 |
|---|---------------------------------|
| <p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> | <p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> |

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

2 時価の算定方法
同左

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第10期 自 平成22年5月11日 至 平成23年5月10日 | 第11期 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 |
|---|--------------------------------------|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、同左 一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。 | |

(その他の注記)

1 元本の移動

| 第10期 自 平成22年5月11日 至 平成23年5月10日 | 第11期 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 |
|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 期首元本額 1,159,442,901 円 | 期首元本額 1,208,106,032 円 |
| 期中追加設定元本額 146,780,906 円 | 期中追加設定元本額 139,934,475 円 |
| 期中一部解約元本額 98,117,775 円 | 期中一部解約元本額 88,744,330 円 |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| | 第10期 自 平成22年5月11日 至 平成23年5月10日 | 第11期 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 |
|-----------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 種類 | 損益に含まれた評価差額(円) | 損益に含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 3,815,727 | 19,635,065 |
| 合計 | 3,815,727 | 19,635,065 |

3 デリバティブ取引関係

第10期(平成23年5月10日現在)

該当事項はございません。

第11期(平成24年5月10日現在)

該当事項はございません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成24年5月10日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券

(平成24年5月10日現在)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|-----------|-------------|---------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式マザーファンド | | 478,807,405 | |

| | | | | |
|------------|-------------------------|--|---------------|--|
| | 国内債券マザーファンド | | 216,294,186 | |
| | 外国債券マザーファンド | | 108,771,209 | |
| | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | | 262,034,835 | |
| 親投資信託受益証券計 | 銘柄数：4 | | 1,065,907,635 | |
| | 組入時価比率：99.9% | | 100.0% | |
| | | | | |
| 合計 | | | 1,065,907,635 | |

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

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

[次へ](#)

参考

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「国内債券マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。
尚、同親投資信託の状況は次の通りです。

1 「国内株式マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1) 貸借対照表

| 科目 | 対象年月日 | 平成24年5月10日現在 金額(円) |
|-----------------|-------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 9,564,147,423 |
| 株式 | | 133,107,281,742 |
| 未収配当金 | | 1,644,861,527 |
| 未収利息 | | 7,843 |
| その他未収収益 | | 606,878 |
| 差入委託証拠金 | | 557,906,000 |
| 流動資産合計 | | 144,874,811,413 |
| 資産合計 | | 144,874,811,413 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 435,917,990 |
| 未払金 | | 1,407,780 |
| 未払解約金 | | 201,295,279 |
| 未払利息 | | 90,908 |
| 有価証券貸借取引受入金 | | 6,597,566,767 |
| 流動負債合計 | | 7,236,278,724 |
| 負債合計 | | 7,236,278,724 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 209,157,357,646 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | | 71,518,824,957 |
| 元本等合計 | | 137,638,532,689 |
| 純資産合計 | | 137,638,532,689 |
| 負債純資産合計 | | 144,874,811,413 |

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

| |
|--|
| 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 |
| 当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|--|----------------------|
| 平成24年5月10日現在 | |
| 1 元本の欠損の額 | 71,518,824,957 円 |
| 2 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) | 0.6581 円 6,581 円) |
| 3 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 6,159,511,844 円 |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 | |
|------------------------------|--|
| 1 | <p>金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としておりません。</p> |
| 2 | <p>金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(3)附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> |
| 3 | <p>金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 平成24年5月10日現在 | |
|--------------|---|
| 1 | <p>貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| 2 | <p>時価の算定方法</p> <p>株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(3)附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(その他の注記)

平成24年5月10日現在

| | |
|------------------------------------|-------------------|
| 1 元本の移動及び期末元本額の内訳 | |
| 期首 | 平成23年5月11日 |
| 期首元本額 | 211,318,590,003 円 |
| 期首より平成24年5月10日までの期中追加設定元本額 | 40,171,875,357 円 |
| 期首より平成24年5月10日までの期中一部解約元本額 | 42,333,107,714 円 |
| 期末元本額 | 209,157,357,646 円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 367,852,614 円 |
| バランスセレクト50 | 865,890,169 円 |
| バランスセレクト70 | 727,560,258 円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 3,180,301,796 円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 17,145,545,234 円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 20,622,862,061 円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 506,740,297 円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 258,953,711 円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 281,319,108 円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 253,569,808 円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 194,305,048 円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 786,155,844 円 |
| 野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け) | 1,362,445,086 円 |
| のむらっぴ・ファンド(保守型) | 971,945,210 円 |
| のむらっぴ・ファンド(普通型) | 1,486,127,637 円 |
| のむらっぴ・ファンド(積極型) | 1,009,977,080 円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 17,974,315 円 |
| 野村インデックスファンド・TOPIX | 129,028,043 円 |
| マイ・ロード | 226,629,071 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) | 11,626,439,600 円 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 2,041,686,185 円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 14,363,883,759 円 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 3,970,187,302 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用) | 26,702,702 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | 94,201,428 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用) | 49,728,166 円 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 16,478,814,054 円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用) | 1,073,252,253 円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 7,386,706,155 円 |
| 野村日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用) | 2,270,075,255 円 |
| 野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 4,945,669,557 円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 1,649,337,343 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 110,622,251 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 799,231,781 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 11,981,360,910 円 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 1,849,101,330 円 |
| ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 1,477,914,219 円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 8,584,077 円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 42,121,463 円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 47,265,295 円 |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け) | 91,765,370 円 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 4,268,796,300 円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 12,022,043,051 円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 16,491,664,713 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) | 34,798,268,653 円 |
| マイバランスDC30 | 1,698,029,813 円 |
| マイバランスDC50 | 2,014,674,792 円 |
| マイバランスDC70 | 1,527,954,836 円 |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX | 3,556,092,643 円 |

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(3) 附属明細表
第1 有価証券明細表

(1) 株式

(平成24年5月10日現在)

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|-----------------|---------|------------|-------------|-------|-----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 極洋 | 56,000 | 180.00 | 10,080,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | 日本水産 | 164,500 | 251.00 | 41,289,500 | | |
| | マルハニチロホールディングス | 282,000 | 132.00 | 37,224,000 | | |
| | サカタのタネ | 21,100 | 1,105.00 | 23,315,500 | | |
| | ホクト | 14,500 | 1,668.00 | 24,186,000 | | |
| | 住石ホールディングス | 41,900 | 82.00 | 3,435,800 | 貸付株式数 | 18,400 |
| | 日鉄鉱業 | 36,000 | 326.00 | 11,736,000 | | |
| | 三井松島産業 | 93,000 | 135.00 | 12,555,000 | 貸付株式数 | 40,000 |
| | 国際石油開発帝石 | 1,736 | 489,000.00 | 848,904,000 | | |
| | 日本海洋掘削 | 3,600 | 2,288.00 | 8,236,800 | 貸付株式数 | 1,500 (300) |
| | 関東天然瓦斯開発 | 14,000 | 407.00 | 5,698,000 | | |
| | 石油資源開発 | 20,400 | 3,300.00 | 67,320,000 | | |
| | ショーボンドホールディングス | 12,700 | 1,986.00 | 25,222,200 | | |
| | ミライト・ホールディングス | 40,500 | 563.00 | 22,801,500 | | |
| | ダイセキ環境ソリューション | 12 | 152,100.00 | 1,825,200 | 貸付株式数 | 4 |
| | 間組 | 51,400 | 195.00 | 10,023,000 | 貸付株式数 | 22,600 |
| | 東急建設 | 50,680 | 179.00 | 9,071,720 | | |
| | コムシスホールディングス | 69,300 | 803.00 | 55,647,900 | | |
| | ミサワホーム | 13,800 | 985.00 | 13,593,000 | | |
| | 高松コンストラクショングループ | 10,800 | 1,317.00 | 14,223,600 | | |
| | 東建コーポレーション | 5,330 | 2,809.00 | 14,971,970 | | |
| | ヤマウラ | 6,500 | 241.00 | 1,566,500 | 貸付株式数 | 2,500 (2,500) |
| | 大成建設 | 722,000 | 189.00 | 136,458,000 | | |
| | 大林組 | 428,000 | 324.00 | 138,672,000 | | |
| | 清水建設 | 437,000 | 281.00 | 122,797,000 | | |
| | 飛島建設 | 87,400 | 81.00 | 7,079,400 | 貸付株式数 | 31,700 |
| | 長谷工コーポレーション | 892,500 | 53.00 | 47,302,500 | | |
| | 松井建設 | 16,000 | 323.00 | 5,168,000 | 貸付株式数 | 6,000 (6,000) |
| | 鹿島建設 | 669,000 | 212.00 | 141,828,000 | | |
| | 不動テトラ | 100,800 | 122.00 | 12,297,600 | 貸付株式数 | 43,600 |
| | 大末建設 | 55,000 | 49.00 | 2,695,000 | 貸付株式数 | 23,000 (23,000) |
| | 鉄建建設 | 81,000 | 108.00 | 8,748,000 | 貸付株式数 | 34,000 |
| | 安藤建設 | 47,000 | 106.00 | 4,982,000 | | |
| | 太平工業 | 25,000 | 376.00 | 9,400,000 | 貸付株式数 | 10,000 |
| | 西松建設 | 187,000 | 150.00 | 28,050,000 | | |
| | 三井住友建設 | 91,500 | 58.00 | 5,307,000 | 貸付株式数 | 39,800 |
| | 大豊建設 | 37,000 | 98.00 | 3,626,000 | | |
| | 前田建設工業 | 88,000 | 319.00 | 28,072,000 | | |
| | 佐田建設 | 49,000 | 64.00 | 3,136,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | ナカノフドー建設 | 11,000 | 151.00 | 1,661,000 | 貸付株式数 | 1,000 |

| | | | | | |
|-----------|---------|----------|-------------|-------|-----------------|
| 奥村組 | 135,000 | 279.00 | 37,665,000 | | |
| 大和小田急建設 | 7,000 | 196.00 | 1,372,000 | | |
| 東鉄工業 | 19,000 | 836.00 | 15,884,000 | | |
| イチケン | 16,000 | 143.00 | 2,288,000 | | |
| 浅沼組 | 43,000 | 60.00 | 2,580,000 | | |
| 戸田建設 | 153,000 | 238.00 | 36,414,000 | | |
| 熊谷組 | 103,000 | 76.00 | 7,828,000 | | |
| 青木あすなろ建設 | 9,500 | 440.00 | 4,180,000 | | |
| 北野建設 | 31,000 | 167.00 | 5,177,000 | | |
| 植木組 | 18,000 | 174.00 | 3,132,000 | 貸付株式数 | 7,000 (7,000) |
| 三井ホーム | 18,000 | 417.00 | 7,506,000 | | |
| 矢作建設工業 | 17,600 | 378.00 | 6,652,800 | | |
| ピーエス三菱 | 9,000 | 342.00 | 3,078,000 | 貸付株式数 | 3,900 |
| 大東建託 | 54,200 | 7,210.00 | 390,782,000 | 貸付株式数 | 1,500 |
| 新日本建設 | 17,000 | 203.00 | 3,451,000 | | |
| N I P P O | 33,000 | 794.00 | 26,202,000 | | |
| 東亜道路工業 | 27,000 | 226.00 | 6,102,000 | | |
| 前田道路 | 41,000 | 913.00 | 37,433,000 | | |
| 日本道路 | 42,000 | 293.00 | 12,306,000 | | |
| 東亜建設工業 | 125,000 | 136.00 | 17,000,000 | | |
| 若築建設 | 77,000 | 85.00 | 6,545,000 | 貸付株式数 | 27,000 |
| 東洋建設 | 222,000 | 70.00 | 15,540,000 | | |
| 五洋建設 | 181,000 | 220.00 | 39,820,000 | 貸付株式数 | 79,500 (78,000) |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|------------|---------|----------|-------------|-------|--------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 大林道路 | 17,000 | 223.00 | 3,791,000 | | |
| | 世紀東急工業 | 37,000 | 58.00 | 2,146,000 | 貸付株式数 | 6,000 |
| | 福田組 | 21,000 | 262.00 | 5,502,000 | 貸付株式数 | 9,000 |
| | 住友林業 | 98,300 | 715.00 | 70,284,500 | | |
| | 日本基礎技術 | 15,900 | 293.00 | 4,658,700 | 貸付株式数 | 800 |
| | 日成ビルド工業 | 42,000 | 174.00 | 7,308,000 | 貸付株式数 | 18,000 |
| | エス・バイ・エル | 73,000 | 167.00 | 12,191,000 | 貸付株式数 | 32,000 |
| | 巴コーポレーション | 17,700 | 301.00 | 5,327,700 | 貸付株式数 | 2,400 |
| | パナホーム | 53,000 | 527.00 | 27,931,000 | | |
| | 大和ハウス工業 | 356,000 | 1,003.00 | 357,068,000 | | |
| | ライト工業 | 29,700 | 407.00 | 12,087,900 | | |
| | 積水ハウス | 402,000 | 711.00 | 285,822,000 | | |
| | 日特建設 | 35,000 | 108.00 | 3,780,000 | 貸付株式数 | 15,000 |
| | 北陸電気工事 | 7,000 | 216.00 | 1,512,000 | | |
| | ユアテック | 19,000 | 344.00 | 6,536,000 | | |
| | 西部電気工業 | 12,000 | 344.00 | 4,128,000 | | |
| | 四電工 | 12,000 | 318.00 | 3,816,000 | | |
| | 中電工 | 20,600 | 829.00 | 17,077,400 | | |
| | 関電工 | 65,000 | 343.00 | 22,295,000 | | |
| | きんでん | 95,000 | 550.00 | 52,250,000 | | |
| | 東京エネシス | 15,000 | 470.00 | 7,050,000 | | |
| | トーエネック | 20,000 | 459.00 | 9,180,000 | | |
| | 住友電設 | 9,900 | 573.00 | 5,672,700 | 貸付株式数 | 1,300 |
| | 日本電設工業 | 26,000 | 767.00 | 19,942,000 | | |
| | 協和エクシオ | 46,600 | 709.00 | 33,039,400 | | |
| | 新日本空調 | 11,000 | 455.00 | 5,005,000 | | |
| | 日本電話施設 | 23,000 | 247.00 | 5,681,000 | | |
| | 九電工 | 26,000 | 466.00 | 12,116,000 | | |
| | 三機工業 | 32,000 | 420.00 | 13,440,000 | | |
| | 日揮 | 133,000 | 2,214.00 | 294,462,000 | | |
| | 中外炉工業 | 46,000 | 261.00 | 12,006,000 | 貸付株式数 | 7,000 |
| | ヤマト | 13,000 | 300.00 | 3,900,000 | | |
| | 太平電業 | 19,000 | 643.00 | 12,217,000 | | |
| | 高砂熱学工業 | 40,700 | 646.00 | 26,292,200 | | |
| | 三晃金属工業 | 16,000 | 248.00 | 3,968,000 | 貸付株式数 | 6,000 |
| | 朝日工業社 | 15,000 | 317.00 | 4,755,000 | | |
| | 大気社 | 21,800 | 1,555.00 | 33,899,000 | | |
| | ダイダン | 19,000 | 499.00 | 9,481,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | 日比谷総合設備 | 17,500 | 858.00 | 15,015,000 | | |
| | 東芝プラントシステム | 23,000 | 894.00 | 20,562,000 | | |
| | 東洋エンジニアリング | 76,000 | 346.00 | 26,296,000 | | |
| | 千代田化工建設 | 113,000 | 931.00 | 105,203,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | 新興プランテック | 29,300 | 624.00 | 18,283,200 | | |
| | 日本製粉 | 88,000 | 343.00 | 30,184,000 | | |
| | 日清製粉グループ本社 | 129,500 | 965.00 | 124,967,500 | 貸付株式数 | 10,000 |
| | 日東富士製粉 | 11,000 | 292.00 | 3,212,000 | | |
| | 昭和産業 | 59,000 | 242.00 | 14,278,000 | | |

| | | | | | | |
|--|------------|---------|----------|-------------|-------|----------------|
| | 鳥越製粉 | 12,400 | 662.00 | 8,208,800 | | |
| | 協同飼料 | 49,000 | 88.00 | 4,312,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | 中部飼料 | 12,600 | 501.00 | 6,312,600 | | |
| | 日本配合飼料 | 44,000 | 102.00 | 4,488,000 | 貸付株式数 | 10,000 |
| | 東洋精糖 | 22,000 | 93.00 | 2,046,000 | | |
| | 日本甜菜製糖 | 79,000 | 164.00 | 12,956,000 | | |
| | 三井製糖 | 50,000 | 246.00 | 12,300,000 | | |
| | 森永製菓 | 139,000 | 183.00 | 25,437,000 | | |
| | 中村屋 | 33,000 | 377.00 | 12,441,000 | | |
| | 江崎グリコ | 52,000 | 925.00 | 48,100,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | 名糖産業 | 6,300 | 1,008.00 | 6,350,400 | 貸付株式数 | 2,700 |
| | 不二家 | 82,000 | 192.00 | 15,744,000 | 貸付株式数 | 35,000 (7,000) |
| | 山崎製パン | 105,000 | 1,155.00 | 121,275,000 | | |
| | 第一屋製パン | 19,000 | 82.00 | 1,558,000 | 貸付株式数 | 4,000 (3,000) |
| | モロゾフ | 22,000 | 274.00 | 6,028,000 | 貸付株式数 | 9,000 (3,000) |
| | カルビー | 10,300 | 4,640.00 | 47,792,000 | 貸付株式数 | 4,500 (1,200) |
| | 森永乳業 | 121,000 | 284.00 | 34,364,000 | | |
| | ヤクルト本社 | 76,600 | 3,005.00 | 230,183,000 | 貸付株式数 | 33,700 (200) |
| | 明治ホールディングス | 42,300 | 3,465.00 | 146,569,500 | | |
| | 雪印メグミルク | 30,800 | 1,427.00 | 43,951,600 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|-----|-------------------|---------|------------|---------------|-----------------------|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 日本円 | プリマハム | 80,000 | 149.00 | 11,920,000 | |
| | 日本ハム | 108,000 | 996.00 | 107,568,000 | |
| | 伊藤ハム | 78,000 | 311.00 | 24,258,000 | |
| | 林兼産業 | 46,000 | 70.00 | 3,220,000 | |
| | 丸大食品 | 68,000 | 309.00 | 21,012,000 | |
| | 米久 | 12,500 | 829.00 | 10,362,500 | |
| | S F o o d s | 9,000 | 699.00 | 6,291,000 | |
| | サッポロホールディングス | 234,000 | 259.00 | 60,606,000 | 貸付株式数 35,000 |
| | アサヒグループホールディングス | 267,800 | 1,736.00 | 464,900,800 | |
| | キリンホールディングス | 573,000 | 944.00 | 540,912,000 | |
| | 宝ホールディングス | 121,000 | 508.00 | 61,468,000 | 貸付株式数 20,000 (14,000) |
| | オエノンホールディングス | 36,000 | 193.00 | 6,948,000 | |
| | 養命酒製造 | 11,000 | 719.00 | 7,909,000 | |
| | 三国コカ・コーラボトリング | 14,800 | 701.00 | 10,374,800 | |
| | コカ・コーラウエスト | 48,400 | 1,409.00 | 68,195,600 | |
| | コカ・コーラ セントラル ジャパン | 16,000 | 1,032.00 | 16,512,000 | |
| | ダイトードリンコ | 6,600 | 3,255.00 | 21,483,000 | |
| | 伊藤園 | 39,700 | 1,411.00 | 56,016,700 | 貸付株式数 12,300 (12,300) |
| | キーコーヒー | 12,400 | 1,474.00 | 18,277,600 | 貸付株式数 5,300 (4,300) |
| | ユニカフェ | 3,300 | 363.00 | 1,197,900 | |
| | ジャパンフーズ | 1,800 | 874.00 | 1,573,200 | |
| | 日清オイリオグループ | 55,000 | 328.00 | 18,040,000 | |
| | 不二製油 | 34,600 | 1,052.00 | 36,399,200 | |
| | J - オイルミルズ | 53,000 | 220.00 | 11,660,000 | |
| | キッコーマン | 117,000 | 964.00 | 112,788,000 | |
| | 味の素 | 376,000 | 1,101.00 | 413,976,000 | |
| | キューピー | 72,600 | 1,201.00 | 87,192,600 | |
| | ハウス食品 | 50,700 | 1,349.00 | 68,394,300 | 貸付株式数 11,400 |
| | カゴメ | 55,200 | 1,604.00 | 88,540,800 | |
| | 焼津水産化学工業 | 6,700 | 752.00 | 5,038,400 | |
| | アリアケジャパン | 13,000 | 1,642.00 | 21,346,000 | 貸付株式数 500 |
| | ニチレイ | 160,000 | 359.00 | 57,440,000 | |
| | 東洋水産 | 61,000 | 2,075.00 | 126,575,000 | |
| | 日清食品ホールディングス | 55,800 | 3,005.00 | 167,679,000 | |
| | 永谷園 | 14,000 | 881.00 | 12,334,000 | 貸付株式数 5,000 |
| | フジッコ | 15,000 | 984.00 | 14,760,000 | |
| | ロック・フィールド | 7,400 | 1,475.00 | 10,915,000 | 貸付株式数 100 (100) |
| | 日本たばこ産業 | 3,165 | 434,000.00 | 1,373,610,000 | |
| | ケンコーマヨネーズ | 4,200 | 656.00 | 2,755,200 | |
| | わらべや日洋 | 7,900 | 1,339.00 | 10,578,100 | 貸付株式数 3,400 |
| | なとり | 6,500 | 856.00 | 5,564,000 | |
| | ミヨシ油脂 | 45,000 | 102.00 | 4,590,000 | |
| | 片倉工業 | 16,700 | 703.00 | 11,740,100 | |
| | グンゼ | 100,000 | 206.00 | 20,600,000 | |
| | 東洋紡績 | 564,000 | 108.00 | 60,912,000 | |
| | ユニチカ | 297,000 | 44.00 | 13,068,000 | |
| | 富士紡ホールディングス | 56,000 | 169.00 | 9,464,000 | 貸付株式数 25,000 |

| | | | | | | |
|--|--------------|---------|--------|-------------|-------|-------|
| | 日清紡ホールディングス | 85,000 | 691.00 | 58,735,000 | | |
| | 倉敷紡績 | 137,000 | 149.00 | 20,413,000 | | |
| | シキボウ | 86,000 | 94.00 | 8,084,000 | | |
| | 日本毛織 | 46,000 | 587.00 | 27,002,000 | | |
| | 大東紡織 | 20,000 | 64.00 | 1,280,000 | | |
| | トーア紡コーポレーション | 60,000 | 54.00 | 3,240,000 | 貸付株式数 | 7,000 |
| | ダイドーリミテッド | 16,400 | 602.00 | 9,872,800 | | |
| | 帝国繊維 | 14,000 | 611.00 | 8,554,000 | | |
| | 帝人 | 545,000 | 247.00 | 134,615,000 | | |
| | 東レ | 968,000 | 579.00 | 560,472,000 | | |
| | サカイオーベックス | 38,000 | 133.00 | 5,054,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | 住江織物 | 33,000 | 148.00 | 4,884,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | 日本フェルト | 7,400 | 400.00 | 2,960,000 | | |
| | イチカワ | 9,000 | 152.00 | 1,368,000 | | |
| | 日本バイリーン | 17,000 | 353.00 | 6,001,000 | | |
| | 日東製網 | 15,000 | 152.00 | 2,280,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | 芦森工業 | 31,000 | 99.00 | 3,069,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | アツギ | 104,000 | 95.00 | 9,880,000 | | |
| | ダイニック | 25,000 | 150.00 | 3,750,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式 数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|---------------|---------|----------|-------------|-------|-----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | セーレン | 33,200 | 545.00 | 18,094,000 | | |
| | 東海染工 | 19,000 | 86.00 | 1,634,000 | 貸付株式数 | 7,000 |
| | 小松精練 | 20,000 | 396.00 | 7,920,000 | | |
| | ワコールホールディングス | 79,000 | 895.00 | 70,705,000 | | |
| | ホギメディカル | 8,400 | 3,700.00 | 31,080,000 | | |
| | レナウン | 28,800 | 120.00 | 3,456,000 | 貸付株式数 | 12,600 |
| | クラウディア | 1,300 | 987.00 | 1,283,100 | | |
| | T S Iホールディングス | 59,500 | 380.00 | 22,610,000 | | |
| | 三陽商会 | 65,000 | 272.00 | 17,680,000 | 貸付株式数 | 25,000 (25,000) |
| | ナイガイ | 37,000 | 48.00 | 1,776,000 | 貸付株式数 | 16,000 (3,000) |
| | オンワードホールディングス | 82,000 | 609.00 | 49,938,000 | | |
| | ルック | 22,000 | 296.00 | 6,512,000 | 貸付株式数 | 9,000 |
| | ゴールドウイン | 30,000 | 494.00 | 14,820,000 | 貸付株式数 | 13,000 |
| | デサント | 33,000 | 442.00 | 14,586,000 | | |
| | ヤマトインターナショナル | 8,000 | 383.00 | 3,064,000 | 貸付株式数 | 3,500 (3,500) |
| | 特種東海製紙 | 84,000 | 207.00 | 17,388,000 | 貸付株式数 | 8,000 (8,000) |
| | 王子製紙 | 590,000 | 351.00 | 207,090,000 | | |
| | 三菱製紙 | 190,000 | 74.00 | 14,060,000 | | |
| | 北越紀州製紙 | 83,000 | 491.00 | 40,753,000 | | |
| | 中越パルプ工業 | 51,000 | 158.00 | 8,058,000 | | |
| | 巴川製紙所 | 23,000 | 166.00 | 3,818,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | 大王製紙 | 56,000 | 438.00 | 24,528,000 | 貸付株式数 | 24,000 |
| | 日本製紙グループ本社 | 64,400 | 1,517.00 | 97,694,800 | 貸付株式数 | 27,800 (26,700) |
| | レンゴー | 107,000 | 591.00 | 63,237,000 | 貸付株式数 | 42,000 |
| | トーモク | 42,000 | 251.00 | 10,542,000 | | |
| | ザ・パック | 7,900 | 1,416.00 | 11,186,400 | | |
| | クラレ | 212,100 | 1,100.00 | 233,310,000 | | |
| | 旭化成 | 777,000 | 475.00 | 369,075,000 | | |
| | 共和レザー | 7,800 | 298.00 | 2,324,400 | | |
| | コープケミカル | 20,000 | 97.00 | 1,940,000 | | |
| | 昭和電工 | 829,000 | 177.00 | 146,733,000 | | |
| | 住友化学 | 917,000 | 302.00 | 276,934,000 | 貸付株式数 | 9,000 |
| | 日本化成 | 25,000 | 119.00 | 2,975,000 | 貸付株式数 | 11,000 |
| | 住友精化 | 25,000 | 330.00 | 8,250,000 | | |
| | 日産化学工業 | 101,500 | 707.00 | 71,760,500 | | |
| | ラサ工業 | 53,000 | 108.00 | 5,724,000 | 貸付株式数 | 23,000 |
| | クレハ | 86,000 | 363.00 | 31,218,000 | | |
| | テイカ | 22,000 | 277.00 | 6,094,000 | | |
| | 石原産業 | 224,000 | 75.00 | 16,800,000 | | |
| | 片倉チッカリン | 9,000 | 202.00 | 1,818,000 | | |
| | 日本曹達 | 79,000 | 318.00 | 25,122,000 | | |
| | 東ソー | 357,000 | 214.00 | 76,398,000 | | |
| | トクヤマ | 208,000 | 266.00 | 55,328,000 | 貸付株式数 | 91,000 |
| | セントラル硝子 | 128,000 | 314.00 | 40,192,000 | | |
| | 東亜合成 | 167,000 | 322.00 | 53,774,000 | | |
| | ダイソー | 53,000 | 235.00 | 12,455,000 | | |

| | | | | | |
|------------|---------|----------|---------------|-------|----------------|
| 関東電化工業 | 30,000 | 242.00 | 7,260,000 | 貸付株式数 | 6,000 |
| 電気化学工業 | 280,000 | 308.00 | 86,240,000 | | |
| 信越化学工業 | 239,300 | 4,215.00 | 1,008,649,500 | | |
| 日本カーバイド工業 | 42,000 | 117.00 | 4,914,000 | 貸付株式数 | 3,000 (3,000) |
| 堺化学工業 | 42,000 | 258.00 | 10,836,000 | | |
| エア・ウォーター | 110,000 | 978.00 | 107,580,000 | | |
| 大陽日酸 | 175,000 | 503.00 | 88,025,000 | | |
| 日本化学工業 | 53,000 | 125.00 | 6,625,000 | | |
| 日本パーカライジング | 31,000 | 1,199.00 | 37,169,000 | | |
| 高压ガス工業 | 20,000 | 490.00 | 9,800,000 | | |
| チタン工業 | 14,000 | 282.00 | 3,948,000 | 貸付株式数 | 6,000 |
| 四国化成工業 | 19,000 | 436.00 | 8,284,000 | | |
| 戸田工業 | 17,000 | 451.00 | 7,667,000 | | |
| ステラ ケミファ | 6,300 | 1,808.00 | 11,390,400 | | |
| 保土谷化学工業 | 27,000 | 230.00 | 6,210,000 | 貸付株式数 | 11,000 (6,000) |
| 日本触媒 | 97,000 | 888.00 | 86,136,000 | | |
| 大日精化工業 | 48,000 | 350.00 | 16,800,000 | | |
| カネカ | 166,000 | 474.00 | 78,684,000 | | |
| 三菱瓦斯化学 | 230,000 | 544.00 | 125,120,000 | | |
| 三井化学 | 566,000 | 221.00 | 125,086,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|--------------------|---------|----------|-------------|-------|---------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | J S R | 121,500 | 1,504.00 | 182,736,000 | | |
| | 東京応化工業 | 24,000 | 1,764.00 | 42,336,000 | | |
| | 大阪有機化学工業 | 8,200 | 400.00 | 3,280,000 | | |
| | 三菱ケミカルホールディングス | 834,500 | 401.00 | 334,634,500 | | |
| | 日本合成化学工業 | 27,000 | 487.00 | 13,149,000 | | |
| | ダイセル | 173,000 | 508.00 | 87,884,000 | | |
| | 住友ベークライト | 114,000 | 400.00 | 45,600,000 | | |
| | 積水化学工業 | 277,000 | 733.00 | 203,041,000 | | |
| | 日本ゼオン | 125,000 | 695.00 | 86,875,000 | | |
| | アイカ工業 | 34,800 | 1,192.00 | 41,481,600 | | |
| | 宇部興産 | 559,000 | 201.00 | 112,359,000 | | |
| | 積水樹脂 | 19,000 | 800.00 | 15,200,000 | | |
| | タキロン | 31,000 | 272.00 | 8,432,000 | | |
| | 旭有機材工業 | 47,000 | 199.00 | 9,353,000 | | |
| | 日立化成工業 | 57,700 | 1,407.00 | 81,183,900 | | |
| | ニチバン | 13,000 | 253.00 | 3,289,000 | | |
| | リケンテクノス | 22,000 | 237.00 | 5,214,000 | | |
| | 大倉工業 | 32,000 | 238.00 | 7,616,000 | 貸付株式数 | 6,000 (6,000) |
| | 積水化成品工業 | 34,000 | 270.00 | 9,180,000 | 貸付株式数 | 8,000 (8,000) |
| | 群栄化学工業 | 36,000 | 203.00 | 7,308,000 | | |
| | タイガースポリマー | 6,600 | 305.00 | 2,013,000 | | |
| | 日本カーリット | 10,600 | 393.00 | 4,165,800 | | |
| | 日本化薬 | 94,000 | 772.00 | 72,568,000 | | |
| | 日本精化 | 11,000 | 527.00 | 5,797,000 | | |
| | A D E K A | 57,400 | 704.00 | 40,409,600 | | |
| | 日油 | 103,000 | 392.00 | 40,376,000 | | |
| | ハリマ化成 | 11,300 | 542.00 | 6,124,600 | | |
| | 花王 | 353,900 | 2,112.00 | 747,436,800 | | |
| | 第一工業製薬 | 24,000 | 240.00 | 5,760,000 | | |
| | 三洋化成工業 | 42,000 | 505.00 | 21,210,000 | | |
| | 大日本塗料 | 76,000 | 85.00 | 6,460,000 | | |
| | 日本ペイント | 126,000 | 649.00 | 81,774,000 | | |
| | 関西ペイント | 151,000 | 861.00 | 130,011,000 | 貸付株式数 | 60,000 |
| | トウペ | 11,000 | 87.00 | 957,000 | 貸付株式数 | 3,000 |
| | 中国塗料 | 41,000 | 435.00 | 17,835,000 | | |
| | 日本特殊塗料 | 10,300 | 335.00 | 3,450,500 | | |
| | 藤倉化成 | 16,800 | 433.00 | 7,274,400 | | |
| | 太陽ホールディングス | 10,900 | 2,054.00 | 22,388,600 | 貸付株式数 | 700 (700) |
| | D I C | 509,000 | 161.00 | 81,949,000 | | |
| | サカタインクス | 25,000 | 387.00 | 9,675,000 | | |
| | 東洋インキ S C ホールディングス | 120,000 | 306.00 | 36,720,000 | | |
| | 富士フイルムホールディングス | 285,000 | 1,636.00 | 466,260,000 | | |
| | 資生堂 | 221,500 | 1,329.00 | 294,373,500 | | |
| | ライオン | 154,000 | 462.00 | 71,148,000 | | |
| | 高砂香料工業 | 44,000 | 404.00 | 17,776,000 | | |
| | マンダム | 13,400 | 2,137.00 | 28,635,800 | | |

| | | | | | | |
|--|------------------|--------|------------|------------|-------|---------------|
| | ミルボン | 7,100 | 2,347.00 | 16,663,700 | | |
| | ファンケル | 33,500 | 999.00 | 33,466,500 | 貸付株式数 | 900 |
| | コーセー | 21,600 | 1,811.00 | 39,117,600 | | |
| | ドクターシーラボ | 90 | 353,000.00 | 31,770,000 | 貸付株式数 | 1 (1) |
| | ポーラ・オルビスホールディングス | 13,600 | 2,455.00 | 33,388,000 | | |
| | エステー | 8,200 | 974.00 | 7,986,800 | 貸付株式数 | 2,900 (2,900) |
| | コニシ | 9,700 | 1,076.00 | 10,437,200 | | |
| | 長谷川香料 | 16,900 | 1,113.00 | 18,809,700 | | |
| | 星光PMC | 5,500 | 307.00 | 1,688,500 | 貸付株式数 | 700 |
| | 小林製薬 | 18,500 | 4,345.00 | 80,382,500 | | |
| | 荒川化学工業 | 10,400 | 674.00 | 7,009,600 | | |
| | メック | 9,500 | 293.00 | 2,783,500 | | |
| | 日本高純度化学 | 37 | 200,500.00 | 7,418,500 | | |
| | 荏原ユージライト | 1,800 | 2,276.00 | 4,096,800 | 貸付株式数 | 100 |
| | アース製薬 | 9,600 | 2,910.00 | 27,936,000 | | |
| | イハラケミカル工業 | 23,000 | 315.00 | 7,245,000 | | |
| | 北興化学工業 | 13,000 | 233.00 | 3,029,000 | | |
| | 大成ラミック | 3,700 | 2,437.00 | 9,016,900 | 貸付株式数 | 1,600 |
| | クミアイ化学工業 | 31,000 | 331.00 | 10,261,000 | 貸付株式数 | 13,000 |
| | 日本農薬 | 30,000 | 357.00 | 10,710,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式 数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|----------|---------|----------|---------------|-------|----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | アキレス | 108,000 | 105.00 | 11,340,000 | | |
| | 有沢製作所 | 22,200 | 277.00 | 6,149,400 | | |
| | 日東電工 | 110,000 | 3,300.00 | 363,000,000 | | |
| | レック | 4,000 | 1,043.00 | 4,172,000 | | |
| | きもと | 10,800 | 458.00 | 4,946,400 | 貸付株式数 | 1,400 |
| | 藤森工業 | 9,600 | 1,365.00 | 13,104,000 | | |
| | 前澤化成工業 | 9,300 | 906.00 | 8,425,800 | | |
| | J S P | 8,700 | 1,108.00 | 9,639,600 | | |
| | エフピコ | 5,900 | 5,040.00 | 29,736,000 | | |
| | 天馬 | 10,600 | 870.00 | 9,222,000 | 貸付株式数 | 3,900 (3,900) |
| | 信越ポリマー | 26,100 | 378.00 | 9,865,800 | 貸付株式数 | 3,300 |
| | 東リ | 34,000 | 152.00 | 5,168,000 | | |
| | ニフコ | 29,800 | 2,100.00 | 62,580,000 | | |
| | 日本バルカー工業 | 52,000 | 220.00 | 11,440,000 | | |
| | ユニ・チャーム | 73,700 | 4,510.00 | 332,387,000 | 貸付株式数 | 32,400 (6,800) |
| | 協和発酵キリン | 182,000 | 837.00 | 152,334,000 | | |
| | 武田薬品工業 | 499,800 | 3,410.00 | 1,704,318,000 | | |
| | アステラス製薬 | 296,200 | 3,200.00 | 947,840,000 | 貸付株式数 | 4,300 |
| | 大日本住友製薬 | 94,400 | 805.00 | 75,992,000 | 貸付株式数 | 400 |
| | 塩野義製薬 | 208,400 | 1,045.00 | 217,778,000 | | |
| | 田辺三菱製薬 | 133,300 | 1,144.00 | 152,495,200 | | |
| | わかもと製薬 | 15,000 | 220.00 | 3,300,000 | 貸付株式数 | 6,000 (6,000) |
| | あすか製薬 | 16,000 | 454.00 | 7,264,000 | | |
| | 日本新薬 | 28,000 | 998.00 | 27,944,000 | | |
| | 中外製薬 | 155,000 | 1,471.00 | 228,005,000 | | |
| | 科研製薬 | 52,000 | 962.00 | 50,024,000 | | |
| | エーザイ | 164,300 | 3,140.00 | 515,902,000 | 貸付株式数 | 33,700 |
| | ロート製薬 | 56,000 | 980.00 | 54,880,000 | | |
| | 小野薬品工業 | 65,300 | 4,440.00 | 289,932,000 | | |
| | 久光製薬 | 41,400 | 3,515.00 | 145,521,000 | 貸付株式数 | 9,100 |
| | 有機合成薬品工業 | 10,000 | 205.00 | 2,050,000 | | |
| | 持田製薬 | 46,000 | 934.00 | 42,964,000 | | |
| | 参天製薬 | 44,800 | 3,005.00 | 134,624,000 | | |
| | 扶桑薬品工業 | 45,000 | 226.00 | 10,170,000 | | |
| | 日本ケミファ | 20,000 | 421.00 | 8,420,000 | 貸付株式数 | 8,000 |
| | ツムラ | 36,400 | 2,110.00 | 76,804,000 | | |
| | 日医工 | 22,600 | 1,640.00 | 37,064,000 | | |
| | キッセイ薬品工業 | 24,800 | 1,418.00 | 35,166,400 | | |
| | 生化学工業 | 25,500 | 830.00 | 21,165,000 | | |
| | 栄研化学 | 10,300 | 1,112.00 | 11,453,600 | | |
| | 日水製薬 | 5,400 | 734.00 | 3,963,600 | 貸付株式数 | 2,300 (2,300) |
| | 鳥居薬品 | 9,100 | 1,528.00 | 13,904,800 | | |
| | 東和薬品 | 6,800 | 3,775.00 | 25,670,000 | | |
| | 沢井製薬 | 8,800 | 8,420.00 | 74,096,000 | 貸付株式数 | 3,700 |
| | ゼリア新薬工業 | 19,000 | 1,444.00 | 27,436,000 | 貸付株式数 | 8,000 |
| | 第一三共 | 448,800 | 1,354.00 | 607,675,200 | | |

| | | | | | | |
|--|-----------------|-----------|----------|-------------|-------|---------|
| | キョーリン製薬ホールディングス | 33,000 | 1,665.00 | 54,945,000 | | |
| | 大幸薬品 | 6,200 | 762.00 | 4,724,400 | 貸付株式数 | 200 |
| | ダイト | 3,700 | 1,198.00 | 4,432,600 | | |
| | 大塚ホールディングス | 264,800 | 2,419.00 | 640,551,200 | | |
| | 大正製薬ホールディングス | 32,100 | 6,600.00 | 211,860,000 | | |
| | 日本コークス工業 | 107,500 | 105.00 | 11,287,500 | 貸付株式数 | 6,500 |
| | 昭和シェル石油 | 119,300 | 475.00 | 56,667,500 | | |
| | コスモ石油 | 369,000 | 215.00 | 79,335,000 | | |
| | ニチレキ | 18,000 | 383.00 | 6,894,000 | | |
| | 東燃ゼネラル石油 | 201,000 | 722.00 | 145,122,000 | | |
| | ユシロ化学工業 | 7,200 | 828.00 | 5,961,600 | | |
| | ビーピー・カストロール | 5,500 | 335.00 | 1,842,500 | | |
| | AOCホールディングス | 30,900 | 413.00 | 12,761,700 | 貸付株式数 | 5,200 |
| | MORESCO | 2,800 | 870.00 | 2,436,000 | 貸付株式数 | 1,200 |
| | 出光興産 | 15,800 | 7,400.00 | 116,920,000 | | |
| | JXホールディングス | 1,480,900 | 431.00 | 638,267,900 | 貸付株式数 | 105,300 |
| | 横浜ゴム | 163,000 | 561.00 | 91,443,000 | | |
| | 東洋ゴム工業 | 101,000 | 249.00 | 25,149,000 | | |
| | ブリヂストン | 418,200 | 1,770.00 | 740,214,000 | | |
| | 住友ゴム工業 | 104,100 | 1,023.00 | 106,494,300 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式 数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|-----------------|-----------|----------|-------------|-------|-----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 藤倉ゴム工業 | 8,300 | 283.00 | 2,348,900 | | |
| | オカモト | 47,000 | 321.00 | 15,087,000 | | |
| | フコク | 5,600 | 861.00 | 4,821,600 | | |
| | ニッタ | 13,200 | 1,446.00 | 19,087,200 | | |
| | 東海ゴム工業 | 24,700 | 864.00 | 21,340,800 | | |
| | 三ツ星ベルト | 35,000 | 427.00 | 14,945,000 | | |
| | バンドー化学 | 46,000 | 278.00 | 12,788,000 | | |
| | 日東紡績 | 98,000 | 286.00 | 28,028,000 | 貸付株式数 | 41,000 (22,000) |
| | 旭硝子 | 657,000 | 587.00 | 385,659,000 | | |
| | 日本板硝子 | 572,000 | 101.00 | 57,772,000 | 貸付株式数 | 258,000 |
| | 石塚硝子 | 17,000 | 136.00 | 2,312,000 | 貸付株式数 | 7,000 (7,000) |
| | 日本山村硝子 | 53,000 | 188.00 | 9,964,000 | | |
| | 日本電気硝子 | 256,000 | 570.00 | 145,920,000 | | |
| | オハラ | 5,000 | 895.00 | 4,475,000 | | |
| | 住友大阪セメント | 271,000 | 235.00 | 63,685,000 | | |
| | 太平洋セメント | 784,000 | 178.00 | 139,552,000 | | |
| | デイ・シイ | 12,300 | 327.00 | 4,022,100 | 貸付株式数 | 5,100 |
| | 日本ヒューム | 13,000 | 329.00 | 4,277,000 | 貸付株式数 | 4,000 |
| | 日本コンクリート工業 | 20,000 | 243.00 | 4,860,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | 東海カーボン | 116,000 | 388.00 | 45,008,000 | 貸付株式数 | 7,000 (7,000) |
| | 日本カーボン | 61,000 | 203.00 | 12,383,000 | | |
| | 東洋炭素 | 6,600 | 2,728.00 | 18,004,800 | 貸付株式数 | 2,800 |
| | ノリタケカンパニーリミテド | 69,000 | 225.00 | 15,525,000 | | |
| | TOTO | 206,000 | 552.00 | 113,712,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | 日本碍子 | 174,000 | 908.00 | 157,992,000 | | |
| | 日本特殊陶業 | 115,000 | 1,061.00 | 122,015,000 | | |
| | ダントーホールディングス | 19,000 | 84.00 | 1,596,000 | 貸付株式数 | 8,000 (8,000) |
| | MARUWA | 3,900 | 2,940.00 | 11,466,000 | 貸付株式数 | 1,700 |
| | 品川リフラクトリーズ | 34,000 | 196.00 | 6,664,000 | | |
| | 黒崎播磨 | 29,000 | 214.00 | 6,206,000 | | |
| | 東京窯業 | 16,000 | 191.00 | 3,056,000 | | |
| | ニッカトー | 4,700 | 479.00 | 2,251,300 | | |
| | フジインコーポレーテッド | 12,100 | 957.00 | 11,579,700 | 貸付株式数 | 4,600 (4,500) |
| | エーアンドエーマテリアル | 28,000 | 80.00 | 2,240,000 | 貸付株式数 | 12,000 |
| | ニチアス | 59,000 | 371.00 | 21,889,000 | | |
| | ニチハ | 14,800 | 970.00 | 14,356,000 | | |
| | 新日本製鐵 | 3,501,000 | 188.00 | 658,188,000 | 貸付株式数 | 235,000 |
| | 住友金属工業 | 2,472,000 | 136.00 | 336,192,000 | | |
| | 神戸製鋼所 | 1,849,000 | 105.00 | 194,145,000 | | |
| | 日新製鋼 | 472,000 | 110.00 | 51,920,000 | | |
| | 中山製鋼所 | 68,000 | 62.00 | 4,216,000 | | |
| | 合同製鐵 | 75,000 | 172.00 | 12,900,000 | | |
| | ジェイエフイーホールディングス | 316,000 | 1,371.00 | 433,236,000 | 貸付株式数 | 800 |
| | 東京製鐵 | 67,500 | 546.00 | 36,855,000 | | |
| | 共英製鋼 | 14,200 | 1,466.00 | 20,817,200 | 貸付株式数 | 6,100 |
| | 大和工業 | 30,400 | 2,138.00 | 64,995,200 | | |

| | | | | | |
|---------|---------|----------|-------------|-------|-----------------|
| 東京鐵鋼 | 26,000 | 250.00 | 6,500,000 | 貸付株式数 | 5,000 |
| 大阪製鐵 | 8,400 | 1,394.00 | 11,709,600 | | |
| 淀川製鋼所 | 95,000 | 304.00 | 28,880,000 | | |
| 東洋鋼鈹 | 32,000 | 273.00 | 8,736,000 | | |
| 住友鋼管 | 7,800 | 732.00 | 5,709,600 | | |
| 丸一鋼管 | 40,900 | 1,728.00 | 70,675,200 | | |
| モリ工業 | 20,000 | 253.00 | 5,060,000 | | |
| 大同特殊鋼 | 223,000 | 519.00 | 115,737,000 | | |
| 日本高周波鋼業 | 52,000 | 90.00 | 4,680,000 | | |
| 日本金属工業 | 103,000 | 62.00 | 6,386,000 | 貸付株式数 | 32,000 |
| 日本冶金工業 | 98,000 | 124.00 | 12,152,000 | 貸付株式数 | 26,500 (16,500) |
| 山陽特殊製鋼 | 66,000 | 338.00 | 22,308,000 | | |
| 愛知製鋼 | 71,000 | 354.00 | 25,134,000 | | |
| 日立金属 | 87,000 | 958.00 | 83,346,000 | 貸付株式数 | 23,000 |
| 日本金属 | 32,000 | 145.00 | 4,640,000 | 貸付株式数 | 13,000 (8,000) |
| 大平洋金属 | 93,000 | 367.00 | 34,131,000 | 貸付株式数 | 8,000 |
| 日本電工 | 48,000 | 328.00 | 15,744,000 | | |
| 栗本鐵工所 | 64,000 | 175.00 | 11,200,000 | 貸付株式数 | 14,000 |
| 旭テック | 27,000 | 33.00 | 891,000 | 貸付株式数 | 11,000 (6,000) |
| 日本鑄鉄管 | 14,000 | 171.00 | 2,394,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式 数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|----------------|---------|----------|-------------|-------|----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 三菱製鋼 | 81,000 | 218.00 | 17,658,000 | | |
| | 日亜鋼業 | 20,000 | 205.00 | 4,100,000 | | |
| | 日本精線 | 9,000 | 382.00 | 3,438,000 | | |
| | シンニッタン | 11,500 | 511.00 | 5,876,500 | 貸付株式数 | 2,200 |
| | 新家工業 | 29,000 | 121.00 | 3,509,000 | | |
| | 日本軽金属 | 302,000 | 112.00 | 33,824,000 | | |
| | 大紀アルミニウム工業所 | 21,000 | 232.00 | 4,872,000 | | |
| | 三井金属鉱業 | 363,000 | 184.00 | 66,792,000 | | |
| | 東邦亜鉛 | 75,000 | 319.00 | 23,925,000 | 貸付株式数 | 6,000 (6,000) |
| | 三菱マテリアル | 832,000 | 229.00 | 190,528,000 | | |
| | 住友金属鉱山 | 345,000 | 990.00 | 341,550,000 | | |
| | DOWAホールディングス | 159,000 | 511.00 | 81,249,000 | 貸付株式数 | 67,000 |
| | 古河機械金属 | 224,000 | 72.00 | 16,128,000 | | |
| | 大阪チタニウムテクノロジーズ | 13,100 | 2,360.00 | 30,916,000 | 貸付株式数 | 5,900 |
| | 東邦チタニウム | 21,600 | 1,023.00 | 22,096,800 | 貸付株式数 | 9,700 |
| | 住友軽金属工業 | 322,000 | 80.00 | 25,760,000 | | |
| | 古河スカイ | 54,000 | 227.00 | 12,258,000 | | |
| | 古河電気工業 | 419,000 | 193.00 | 80,867,000 | | |
| | 住友電気工業 | 471,100 | 1,026.00 | 483,348,600 | | |
| | フジクラ | 200,000 | 227.00 | 45,400,000 | | |
| | 昭和電線ホールディングス | 171,000 | 70.00 | 11,970,000 | 貸付株式数 | 36,000 |
| | 東京特殊電線 | 18,000 | 83.00 | 1,494,000 | 貸付株式数 | 7,000 |
| | タツタ電線 | 25,000 | 457.00 | 11,425,000 | 貸付株式数 | 11,000 (2,000) |
| | 日立電線 | 104,000 | 192.00 | 19,968,000 | | |
| | 沖電線 | 14,000 | 151.00 | 2,114,000 | 貸付株式数 | 6,000 (6,000) |
| | カナレ電気 | 1,700 | 1,380.00 | 2,346,000 | 貸付株式数 | 700 |
| | 平河ヒューテック | 2,600 | 778.00 | 2,022,800 | | |
| | リョービ | 75,000 | 276.00 | 20,700,000 | | |
| | アサヒホールディングス | 18,600 | 1,589.00 | 29,555,400 | | |
| | 稲葉製作所 | 5,700 | 1,018.00 | 5,802,600 | 貸付株式数 | 2,400 |
| | 宮地エンジニアリンググループ | 41,000 | 134.00 | 5,494,000 | 貸付株式数 | 18,000 |
| | 三協・立山ホールディングス | 180,000 | 151.00 | 27,180,000 | | |
| | トーカロ | 7,500 | 1,390.00 | 10,425,000 | | |
| | アルファC o | 4,400 | 988.00 | 4,347,200 | | |
| | SUMCO | 81,600 | 759.00 | 61,934,400 | 貸付株式数 | 17,200 |
| | 川田テクノロジーズ | 3,000 | 1,125.00 | 3,375,000 | | |
| | 東洋製罐 | 94,300 | 1,029.00 | 97,034,700 | | |
| | ホッカンホールディングス | 32,000 | 237.00 | 7,584,000 | | |
| | コロナ | 6,100 | 1,054.00 | 6,429,400 | 貸付株式数 | 200 |
| | 横河ブリッジホールディングス | 27,000 | 527.00 | 14,229,000 | | |
| | 日本橋梁 | 4,850 | 289.00 | 1,401,650 | 貸付株式数 | 2,050 (900) |
| | 駒井ハルテック | 26,000 | 239.00 | 6,214,000 | 貸付株式数 | 10,000 |
| | 高田機工 | 12,000 | 204.00 | 2,448,000 | | |
| | 三和ホールディングス | 133,000 | 299.00 | 39,767,000 | | |
| | 文化シャッター | 34,000 | 338.00 | 11,492,000 | | |
| | 東洋シャッター | 3,800 | 377.00 | 1,432,600 | 貸付株式数 | 1,100 (1,100) |

| | | | | | | |
|--|---------|---------|----------|-------------|-------|---------------|
| | 住生活グループ | 173,400 | 1,491.00 | 258,539,400 | | |
| | 日本フィルコン | 9,600 | 385.00 | 3,696,000 | | |
| | ノーリツ | 26,100 | 1,405.00 | 36,670,500 | | |
| | 長府製作所 | 12,800 | 1,827.00 | 23,385,600 | | |
| | リンナイ | 21,400 | 5,600.00 | 119,840,000 | 貸付株式数 | 800 |
| | ダイニチ工業 | 6,800 | 708.00 | 4,814,400 | | |
| | 日東精工 | 17,000 | 241.00 | 4,097,000 | | |
| | 三洋工業 | 17,000 | 170.00 | 2,890,000 | | |
| | 岡部 | 26,200 | 521.00 | 13,650,200 | 貸付株式数 | 2,300 |
| | 中国工業 | 20,000 | 95.00 | 1,900,000 | 貸付株式数 | 8,000 (8,000) |
| | 東プレ | 25,600 | 734.00 | 18,790,400 | | |
| | 高周波熱錬 | 17,700 | 725.00 | 12,832,500 | | |
| | 東京製綱 | 84,000 | 153.00 | 12,852,000 | 貸付株式数 | 38,000 |
| | パイオラックス | 5,700 | 1,914.00 | 10,909,800 | | |
| | 日本発條 | 96,600 | 810.00 | 78,246,000 | | |
| | 中央発條 | 17,000 | 299.00 | 5,083,000 | | |
| | アドバネクス | 26,000 | 81.00 | 2,106,000 | | |
| | 三益半導体工業 | 11,200 | 707.00 | 7,918,400 | | |
| | アタカ大機 | 9,000 | 250.00 | 2,250,000 | | |
| | 日本製鋼所 | 206,000 | 456.00 | 93,936,000 | 貸付株式数 | 17,000 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|-------------|---------|-----------|---------------|-------|-----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 日立ツール | 7,600 | 793.00 | 6,026,800 | | |
| | 三浦工業 | 19,800 | 2,046.00 | 40,510,800 | | |
| | タクマ | 45,000 | 343.00 | 15,435,000 | 貸付株式数 | 19,000 |
| | ツガミ | 35,000 | 813.00 | 28,455,000 | 貸付株式数 | 15,000 |
| | オークマ | 80,000 | 582.00 | 46,560,000 | | |
| | 東芝機械 | 73,000 | 410.00 | 29,930,000 | | |
| | アマダ | 188,000 | 520.00 | 97,760,000 | | |
| | アイダエンジニアリング | 34,400 | 433.00 | 14,895,200 | 貸付株式数 | 2,500 |
| | 牧野フライス製作所 | 66,000 | 506.00 | 33,396,000 | 貸付株式数 | 29,000 |
| | オーエスジー | 58,700 | 1,180.00 | 69,266,000 | | |
| | ダイジェット工業 | 15,000 | 179.00 | 2,685,000 | | |
| | 旭ダイヤモンド工業 | 32,800 | 826.00 | 27,092,800 | | |
| | 森精機製作所 | 70,300 | 758.00 | 53,287,400 | 貸付株式数 | 30,500 (13,400) |
| | ディスコ | 13,500 | 4,485.00 | 60,547,500 | 貸付株式数 | 5,800 |
| | 日東工器 | 7,800 | 1,790.00 | 13,962,000 | 貸付株式数 | 3,400 (3,400) |
| | 豊和工業 | 69,000 | 87.00 | 6,003,000 | | |
| | 大阪機工 | 52,000 | 111.00 | 5,772,000 | 貸付株式数 | 22,000 (22,000) |
| | 東洋機械金属 | 9,800 | 225.00 | 2,205,000 | 貸付株式数 | 4,400 |
| | 津田駒工業 | 32,000 | 156.00 | 4,992,000 | 貸付株式数 | 14,000 |
| | エンシュウ | 33,000 | 87.00 | 2,871,000 | 貸付株式数 | 14,000 |
| | 島精機製作所 | 17,400 | 1,341.00 | 23,333,400 | 貸付株式数 | 5,700 (4,800) |
| | 日阪製作所 | 17,000 | 846.00 | 14,382,000 | | |
| | やまびこ | 5,200 | 1,214.00 | 6,312,800 | | |
| | ペガサスミシン製造 | 12,200 | 188.00 | 2,293,600 | 貸付株式数 | 3,500 (2,700) |
| | ナブテスコ | 55,400 | 1,623.00 | 89,914,200 | 貸付株式数 | 23,900 |
| | 三井海洋開発 | 11,000 | 1,616.00 | 17,776,000 | 貸付株式数 | 4,700 (4,700) |
| | レオン自動機 | 12,000 | 191.00 | 2,292,000 | | |
| | S M C | 39,800 | 13,060.00 | 519,788,000 | | |
| | 新川 | 10,300 | 398.00 | 4,099,400 | 貸付株式数 | 200 |
| | ホソカワミクロン | 22,000 | 454.00 | 9,988,000 | | |
| | ユニオンツール | 7,300 | 1,363.00 | 9,949,900 | 貸付株式数 | 2,900 |
| | オイレス工業 | 13,900 | 1,684.00 | 23,407,600 | | |
| | サトーホールディングス | 13,900 | 1,192.00 | 16,568,800 | 貸付株式数 | 1,200 |
| | 日本エアテック | 3,900 | 351.00 | 1,368,900 | | |
| | 日精樹脂工業 | 10,600 | 427.00 | 4,526,200 | | |
| | ワイエイシイ | 5,400 | 609.00 | 3,288,600 | 貸付株式数 | 2,000 (1,500) |
| | 小松製作所 | 622,300 | 2,052.00 | 1,276,959,600 | 貸付株式数 | 274,400 |
| | 住友重機械工業 | 340,000 | 387.00 | 131,580,000 | | |
| | 日立建機 | 68,100 | 1,571.00 | 106,985,100 | 貸付株式数 | 28,500 |
| | 日工 | 18,000 | 292.00 | 5,256,000 | | |
| | 巴工業 | 5,000 | 1,789.00 | 8,945,000 | 貸付株式数 | 2,100 |
| | 井関農機 | 136,000 | 186.00 | 25,296,000 | 貸付株式数 | 58,000 (58,000) |
| | T O W A | 11,900 | 422.00 | 5,021,800 | | |
| | 丸山製作所 | 30,000 | 161.00 | 4,830,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | 北川鉄工所 | 61,000 | 144.00 | 8,784,000 | 貸付株式数 | 7,000 |
| | クボタ | 610,000 | 723.00 | 441,030,000 | | |
| | 荏原実業 | 3,200 | 1,253.00 | 4,009,600 | 貸付株式数 | 1,300 (1,300) |

| | | | | | |
|--------------|---------|----------|-------------|-------|--------|
| 三菱化工機 | 41,000 | 154.00 | 6,314,000 | | |
| 月島機械 | 20,000 | 702.00 | 14,040,000 | | |
| 帝国電機製作所 | 4,500 | 1,428.00 | 6,426,000 | | |
| 東京機械製作所 | 43,000 | 51.00 | 2,193,000 | | |
| 新東工業 | 29,100 | 864.00 | 25,142,400 | | |
| 澁谷工業 | 8,400 | 876.00 | 7,358,400 | 貸付株式数 | 3,300 |
| アイチ コーポレーション | 22,000 | 330.00 | 7,260,000 | | |
| 小森コーポレーション | 37,800 | 663.00 | 25,061,400 | | |
| 鶴見製作所 | 10,000 | 665.00 | 6,650,000 | | |
| 住友精密工業 | 19,000 | 386.00 | 7,334,000 | 貸付株式数 | 8,000 |
| 酒井重工業 | 25,000 | 303.00 | 7,575,000 | 貸付株式数 | 11,000 |
| 荏原製作所 | 217,000 | 327.00 | 70,959,000 | | |
| 石井鐵工所 | 19,000 | 168.00 | 3,192,000 | 貸付株式数 | 5,000 |
| 西島製作所 | 15,400 | 947.00 | 14,583,800 | 貸付株式数 | 6,700 |
| ダイキン工業 | 162,300 | 1,965.00 | 318,919,500 | | |
| オルガノ | 25,000 | 488.00 | 12,200,000 | | |
| トーヨーカネツ | 71,000 | 167.00 | 11,857,000 | | |
| 栗田工業 | 73,600 | 1,850.00 | 136,160,000 | | |
| 椿本チエイン | 68,000 | 458.00 | 31,144,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式 数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|---------------|---------|-----------|-------------|-------|---------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 大同工業 | 26,000 | 138.00 | 3,588,000 | | |
| | 日本コンベヤ | 41,000 | 76.00 | 3,116,000 | | |
| | 木村化工機 | 12,200 | 304.00 | 3,708,800 | 貸付株式数 | 3,200 (2,900) |
| | アネスト岩田 | 21,000 | 386.00 | 8,106,000 | | |
| | ダイフク | 58,500 | 401.00 | 23,458,500 | | |
| | 加藤製作所 | 30,000 | 372.00 | 11,160,000 | | |
| | 油研工業 | 23,000 | 166.00 | 3,818,000 | | |
| | タダノ | 61,000 | 552.00 | 33,672,000 | | |
| | フジテック | 37,000 | 499.00 | 18,463,000 | | |
| | シーケーディ | 35,700 | 544.00 | 19,420,800 | | |
| | キトー | 54 | 66,600.00 | 3,596,400 | | |
| | 平和 | 27,600 | 1,622.00 | 44,767,200 | | |
| | 理想科学工業 | 9,200 | 1,166.00 | 10,727,200 | | |
| | SANKYO | 38,600 | 3,965.00 | 153,049,000 | | |
| | 日本金銭機械 | 11,700 | 694.00 | 8,119,800 | 貸付株式数 | 2,800 |
| | マースエンジニアリング | 7,200 | 1,795.00 | 12,924,000 | 貸付株式数 | 2,800 |
| | 福島工業 | 3,500 | 1,137.00 | 3,979,500 | | |
| | オーイズミ | 4,500 | 253.00 | 1,138,500 | 貸付株式数 | 1,900 |
| | ダイコク電機 | 5,800 | 1,138.00 | 6,600,400 | | |
| | アマノ | 38,600 | 693.00 | 26,749,800 | | |
| | JUKI | 77,000 | 143.00 | 11,011,000 | 貸付株式数 | 33,000 |
| | サンデン | 67,000 | 231.00 | 15,477,000 | 貸付株式数 | 29,000 |
| | 蛇の目ミシン工業 | 124,000 | 66.00 | 8,184,000 | | |
| | マックス | 20,000 | 959.00 | 19,180,000 | | |
| | グローリー | 38,000 | 1,647.00 | 62,586,000 | | |
| | 大和冷機工業 | 18,000 | 391.00 | 7,038,000 | | |
| | セガサミーホールディングス | 136,900 | 1,609.00 | 220,272,100 | 貸付株式数 | 300 |
| | 日本ピストンリング | 46,000 | 180.00 | 8,280,000 | | |
| | リケン | 46,000 | 334.00 | 15,364,000 | | |
| | T P R | 14,100 | 1,254.00 | 17,681,400 | 貸付株式数 | 1,800 |
| | ホシザキ電機 | 25,700 | 1,902.00 | 48,881,400 | | |
| | 大豊工業 | 8,900 | 1,003.00 | 8,926,700 | | |
| | 日本精工 | 284,000 | 523.00 | 148,532,000 | | |
| | NTN | 295,000 | 286.00 | 84,370,000 | | |
| | ジェイテクト | 121,800 | 810.00 | 98,658,000 | | |
| | 不二越 | 128,000 | 373.00 | 47,744,000 | | |
| | 日本トムソン | 41,000 | 419.00 | 17,179,000 | | |
| | THK | 84,700 | 1,530.00 | 129,591,000 | | |
| | ユーシン精機 | 6,300 | 1,733.00 | 10,917,900 | | |
| | 前澤給装工業 | 4,800 | 1,062.00 | 5,097,600 | | |
| | イーグル工業 | 16,000 | 734.00 | 11,744,000 | | |
| | 前澤工業 | 9,300 | 233.00 | 2,166,900 | 貸付株式数 | 4,000 (4,000) |
| | 日本ピラー工業 | 13,000 | 666.00 | 8,658,000 | | |
| | キッツ | 52,400 | 336.00 | 17,606,400 | | |
| | 日立工機 | 34,100 | 677.00 | 23,085,700 | | |
| | マキタ | 83,100 | 2,900.00 | 240,990,000 | 貸付株式数 | 1,900 |

| | | | | | | |
|--|-----------------|-----------|----------|---------------|-------|-----------------|
| | 日立造船 | 504,000 | 99.00 | 49,896,000 | | |
| | 三菱重工業 | 2,135,000 | 336.00 | 717,360,000 | | |
| | I H I | 871,000 | 173.00 | 150,683,000 | | |
| | イビデン | 83,600 | 1,527.00 | 127,657,200 | | |
| | コニカミノルタホールディングス | 336,500 | 615.00 | 206,947,500 | | |
| | ブラザー工業 | 164,700 | 980.00 | 161,406,000 | | |
| | ミネベア | 190,000 | 346.00 | 65,740,000 | 貸付株式数 | 21,000 (13,000) |
| | 日立製作所 | 2,936,000 | 484.00 | 1,421,024,000 | 貸付株式数 | 47,000 |
| | 東芝 | 2,682,000 | 318.00 | 852,876,000 | | |
| | 三菱電機 | 1,274,000 | 649.00 | 826,826,000 | | |
| | 富士電機 | 384,000 | 202.00 | 77,568,000 | | |
| | 東洋電機製造 | 25,000 | 295.00 | 7,375,000 | | |
| | 安川電機 | 150,000 | 645.00 | 96,750,000 | 貸付株式数 | 10,000 |
| | シンフォニアテクノロジー | 77,000 | 158.00 | 12,166,000 | | |
| | 明電舎 | 126,000 | 266.00 | 33,516,000 | 貸付株式数 | 27,000 (21,000) |
| | オリジン電気 | 19,000 | 290.00 | 5,510,000 | | |
| | デンヨー | 11,600 | 1,018.00 | 11,808,800 | | |
| | 東芝テック | 80,000 | 316.00 | 25,280,000 | | |
| | 芝浦メカトロニクス | 23,000 | 198.00 | 4,554,000 | | |
| | マブチモーター | 17,400 | 3,315.00 | 57,681,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|-------------------|-----------|------------|-------------|-------|------------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 日本電産 | 68,900 | 6,530.00 | 449,917,000 | 貸付株式数 | 29,100 |
| | 高岳製作所 | 50,000 | 176.00 | 8,800,000 | 貸付株式数 | 22,000 (1,000) |
| | ダイヘン | 75,000 | 250.00 | 18,750,000 | | |
| | ヤーマン | 1,000 | 1,234.00 | 1,234,000 | | |
| | JVCケンウッド | 77,000 | 301.00 | 23,177,000 | 貸付株式数 | 33,300 (6,000) |
| | 第一精工 | 4,000 | 1,880.00 | 7,520,000 | 貸付株式数 | 1,700 |
| | 日新電機 | 26,000 | 428.00 | 11,128,000 | | |
| | 大崎電気工業 | 18,000 | 822.00 | 14,796,000 | 貸付株式数 | 7,000 (7,000) |
| | オムロン | 141,900 | 1,695.00 | 240,520,500 | | |
| | 日東工業 | 18,700 | 1,137.00 | 21,261,900 | | |
| | I D E C | 16,600 | 765.00 | 12,699,000 | | |
| | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 245,000 | 372.00 | 91,140,000 | 貸付株式数 | 106,000 (96,000) |
| | サクサホールディングス | 32,000 | 151.00 | 4,832,000 | 貸付株式数 | 14,000 |
| | メルコホールディングス | 7,000 | 1,837.00 | 12,859,000 | 貸付株式数 | 2,900 |
| | テクノメディカ | 10 | 348,000.00 | 3,480,000 | | |
| | 日本電気 | 1,752,000 | 130.00 | 227,760,000 | 貸付株式数 | 758,000 |
| | 富士通 | 1,228,000 | 372.00 | 456,816,000 | | |
| | 沖電気工業 | 492,000 | 124.00 | 61,008,000 | 貸付株式数 | 212,000 |
| | 岩崎通信機 | 56,000 | 70.00 | 3,920,000 | | |
| | 電気興業 | 39,000 | 353.00 | 13,767,000 | | |
| | サンケン電気 | 65,000 | 329.00 | 21,385,000 | 貸付株式数 | 28,000 (23,000) |
| | ナカヨ通信機 | 12,000 | 341.00 | 4,092,000 | | |
| | アイホン | 7,400 | 1,569.00 | 11,610,600 | 貸付株式数 | 3,200 (3,200) |
| | ルネサスエレクトロニクス | 33,000 | 359.00 | 11,847,000 | 貸付株式数 | 14,800 (8,300) |
| | セイコーエプソン | 87,000 | 930.00 | 80,910,000 | 貸付株式数 | 38,200 |
| | ワコム | 251 | 189,800.00 | 47,639,800 | 貸付株式数 | 46 (46) |
| | アルバック | 25,400 | 515.00 | 13,081,000 | 貸付株式数 | 11,100 |
| | アクセル | 5,900 | 1,598.00 | 9,428,200 | 貸付株式数 | 1,800 (1,800) |
| | ピクセラ | 5,200 | 172.00 | 894,400 | 貸付株式数 | 2,200 |
| | ナナオ | 10,800 | 1,638.00 | 17,690,400 | | |
| | 日本信号 | 29,600 | 514.00 | 15,214,400 | | |
| | 京三製作所 | 27,000 | 340.00 | 9,180,000 | | |
| | 能美防災 | 17,000 | 530.00 | 9,010,000 | | |
| | ホーチキ | 12,000 | 394.00 | 4,728,000 | | |
| | 日本無線 | 27,000 | 182.00 | 4,914,000 | 貸付株式数 | 10,000 |
| | パナソニック | 1,455,700 | 579.00 | 842,850,300 | | |
| | シャープ | 615,000 | 411.00 | 252,765,000 | 貸付株式数 | 270,000 (5,000) |
| | アンリツ | 65,000 | 945.00 | 61,425,000 | 貸付株式数 | 28,000 (16,000) |
| | 富士通ゼネラル | 30,000 | 662.00 | 19,860,000 | 貸付株式数 | 12,000 (11,000) |
| | 日立国際電気 | 29,000 | 759.00 | 22,011,000 | | |
| | ソニー | 794,900 | 1,213.00 | 964,213,700 | | |
| | T D K | 66,600 | 3,740.00 | 249,084,000 | 貸付株式数 | 4,400 |
| | 帝国通信工業 | 30,000 | 125.00 | 3,750,000 | | |
| | ミツミ電機 | 45,000 | 588.00 | 26,460,000 | | |
| | タムラ製作所 | 43,000 | 211.00 | 9,073,000 | | |
| | アルプス電気 | 100,600 | 660.00 | 66,396,000 | | |

| | | | | | |
|--------------|---------|----------|-------------|-------|----------------|
| 池上通信機 | 40,000 | 59.00 | 2,360,000 | 貸付株式数 | 17,000 |
| パイオニア | 180,600 | 369.00 | 66,641,400 | 貸付株式数 | 79,400 |
| 日本電波工業 | 9,900 | 1,005.00 | 9,949,500 | | |
| 日本トリム | 1,450 | 2,026.00 | 2,937,700 | | |
| ローランド ディー・ジー | 5,600 | 887.00 | 4,967,200 | | |
| フォスター電機 | 12,100 | 1,324.00 | 16,020,400 | 貸付株式数 | 5,300 |
| クラリオン | 78,000 | 190.00 | 14,820,000 | 貸付株式数 | 33,000 |
| S M K | 41,000 | 253.00 | 10,373,000 | 貸付株式数 | 16,000 |
| ヨコオ | 9,900 | 443.00 | 4,385,700 | | |
| 東光 | 58,000 | 243.00 | 14,094,000 | 貸付株式数 | 25,000 |
| ティアック | 69,000 | 29.00 | 2,001,000 | 貸付株式数 | 29,000 (1,000) |
| ホシデン | 34,500 | 532.00 | 18,354,000 | | |
| ヒロセ電機 | 22,200 | 7,960.00 | 176,712,000 | 貸付株式数 | 9,500 |
| 日本航空電子工業 | 29,000 | 718.00 | 20,822,000 | | |
| T O A | 14,000 | 622.00 | 8,708,000 | | |
| ユニデン | 37,000 | 264.00 | 9,768,000 | | |
| アルパイン | 24,800 | 955.00 | 23,684,000 | | |
| スミダコーポレーション | 7,900 | 455.00 | 3,594,500 | | |
| アイコム | 7,000 | 1,928.00 | 13,496,000 | 貸付株式数 | 500 |
| リオン | 2,800 | 686.00 | 1,920,800 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式 数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|------------------|---------|-----------|---------------|-------|-----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 船井電機 | 11,400 | 1,455.00 | 16,587,000 | | |
| | 横河電機 | 138,200 | 745.00 | 102,959,000 | | |
| | 新電元工業 | 45,000 | 301.00 | 13,545,000 | | |
| | アズビル | 32,700 | 1,657.00 | 54,183,900 | | |
| | 日本光電工業 | 25,300 | 2,332.00 | 58,999,600 | | |
| | チノー | 23,000 | 212.00 | 4,876,000 | | |
| | 共和電業 | 13,000 | 255.00 | 3,315,000 | | |
| | 日本電子材料 | 5,000 | 384.00 | 1,920,000 | | |
| | 堀場製作所 | 23,600 | 2,917.00 | 68,841,200 | | |
| | アドバンテスト | 94,700 | 1,319.00 | 124,909,300 | 貸付株式数 | 33,200 (2,700) |
| | 小野測器 | 14,000 | 307.00 | 4,298,000 | | |
| | エスペック | 13,200 | 707.00 | 9,332,400 | 貸付株式数 | 1,800 |
| | パナソニック電工SUNX | 11,200 | 381.00 | 4,267,200 | 貸付株式数 | 2,500 |
| | キーエンス | 31,300 | 18,220.00 | 570,286,000 | | |
| | 日置電機 | 6,100 | 1,483.00 | 9,046,300 | | |
| | シスメックス | 44,800 | 3,150.00 | 141,120,000 | 貸付株式数 | 13,300 |
| | メガチップス | 10,500 | 1,697.00 | 17,818,500 | 貸付株式数 | 4,500 (300) |
| | OBARA GROUP | 9,100 | 955.00 | 8,690,500 | | |
| | 日本電産コパル電子 | 13,100 | 450.00 | 5,895,000 | | |
| | ミヤチテクノス | 5,700 | 596.00 | 3,397,200 | | |
| | 東京電波 | 3,700 | 367.00 | 1,357,900 | 貸付株式数 | 1,600 |
| | 澤藤電機 | 7,000 | 224.00 | 1,568,000 | | |
| | コーセル | 18,500 | 1,160.00 | 21,460,000 | | |
| | 日立メディコ | 9,000 | 1,220.00 | 10,980,000 | | |
| | 新日本無線 | 8,000 | 217.00 | 1,736,000 | 貸付株式数 | 3,000 |
| | オプテックス | 8,700 | 1,134.00 | 9,865,800 | | |
| | 千代田インテグレ | 6,100 | 996.00 | 6,075,600 | | |
| | 東光電気 | 8,000 | 329.00 | 2,632,000 | | |
| | スタンレー電気 | 85,500 | 1,237.00 | 105,763,500 | | |
| | 岩崎電気 | 46,000 | 154.00 | 7,084,000 | 貸付株式数 | 12,000 |
| | ウシオ電機 | 77,300 | 992.00 | 76,681,600 | 貸付株式数 | 2,200 |
| | 岡谷電機産業 | 6,800 | 316.00 | 2,148,800 | 貸付株式数 | 2,900 (2,900) |
| | ヘリオス テクノ ホールディング | 10,800 | 136.00 | 1,468,800 | 貸付株式数 | 200 (200) |
| | 日本セラミック | 8,300 | 1,310.00 | 10,873,000 | | |
| | 日本デジタル研究所 | 10,700 | 846.00 | 9,052,200 | | |
| | 古河電池 | 9,000 | 450.00 | 4,050,000 | 貸付株式数 | 3,000 (3,000) |
| | 双信電機 | 6,200 | 322.00 | 1,996,400 | | |
| | 山一電機 | 12,900 | 179.00 | 2,309,100 | 貸付株式数 | 900 |
| | 図研 | 8,300 | 599.00 | 4,971,700 | | |
| | 日本電子 | 47,000 | 234.00 | 10,998,000 | | |
| | カシオ計算機 | 121,400 | 492.00 | 59,728,800 | 貸付株式数 | 52,500 (28,500) |
| | ファナック | 132,700 | 13,290.00 | 1,763,583,000 | | |
| | 日本シイエムケイ | 27,400 | 368.00 | 10,083,200 | | |
| | エンプラス | 6,400 | 2,125.00 | 13,600,000 | | |
| | ローム | 62,800 | 3,515.00 | 220,742,000 | | |
| | 浜松ホトニクス | 49,700 | 2,997.00 | 148,950,900 | 貸付株式数 | 5,900 |

| | | | | | | |
|--|------------|---------|----------|---------------|-------|----------------|
| | 三井ハイテック | 16,800 | 460.00 | 7,728,000 | | |
| | 新光電気工業 | 42,800 | 687.00 | 29,403,600 | 貸付株式数 | 18,800 |
| | 京セラ | 106,000 | 7,450.00 | 789,700,000 | | |
| | 太陽誘電 | 57,200 | 774.00 | 44,272,800 | 貸付株式数 | 24,700 (3,100) |
| | 村田製作所 | 133,700 | 4,390.00 | 586,943,000 | | |
| | ユーシン | 17,700 | 576.00 | 10,195,200 | | |
| | 双葉電子工業 | 21,800 | 1,244.00 | 27,119,200 | | |
| | 北陸電気工業 | 51,000 | 103.00 | 5,253,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | ニチコン | 40,100 | 822.00 | 32,962,200 | 貸付株式数 | 17,600 |
| | 日本ケミコン | 73,000 | 262.00 | 19,126,000 | 貸付株式数 | 32,000 |
| | K O A | 16,000 | 769.00 | 12,304,000 | | |
| | 市光工業 | 30,000 | 146.00 | 4,380,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | 小糸製作所 | 64,000 | 1,159.00 | 74,176,000 | | |
| | ミツバ | 23,000 | 600.00 | 13,800,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | スター精密 | 20,500 | 851.00 | 17,445,500 | 貸付株式数 | 2,300 |
| | 大日本スクリーン製造 | 121,000 | 673.00 | 81,433,000 | 貸付株式数 | 28,000 |
| | キャノン電子 | 11,700 | 1,890.00 | 22,113,000 | | |
| | キャノン | 791,500 | 3,460.00 | 2,738,590,000 | | |
| | リコー | 383,000 | 641.00 | 245,503,000 | 貸付株式数 | 165,000 |
| | 日本電産サンキョー | 30,000 | 444.00 | 13,320,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|---------------|-----------|----------|---------------|-------|-----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | MUTOHホールディングス | 13,000 | 246.00 | 3,198,000 | 貸付株式数 | 5,000 (2,000) |
| | 東京エレクトロン | 107,200 | 3,995.00 | 428,264,000 | | |
| | トヨタ紡織 | 44,500 | 965.00 | 42,942,500 | 貸付株式数 | 19,600 |
| | 鬼怒川ゴム工業 | 29,000 | 544.00 | 15,776,000 | 貸付株式数 | 12,000 |
| | ユニプレス | 20,400 | 2,438.00 | 49,735,200 | | |
| | 豊田自動織機 | 116,000 | 2,239.00 | 259,724,000 | | |
| | モリタホールディングス | 20,000 | 540.00 | 10,800,000 | 貸付株式数 | 8,000 (8,000) |
| | 三櫻工業 | 16,200 | 638.00 | 10,335,600 | | |
| | デンソー | 314,800 | 2,545.00 | 801,166,000 | | |
| | 東海理化電機製作所 | 29,800 | 1,418.00 | 42,256,400 | | |
| | 三井造船 | 493,000 | 115.00 | 56,695,000 | 貸付株式数 | 217,000 |
| | 佐世保重工業 | 83,000 | 112.00 | 9,296,000 | 貸付株式数 | 36,000 (1,000) |
| | 川崎重工業 | 926,000 | 212.00 | 196,312,000 | 貸付株式数 | 200,000 |
| | 日本車輛製造 | 46,000 | 289.00 | 13,294,000 | 貸付株式数 | 16,000 (16,000) |
| | 日本輸送機 | 17,000 | 241.00 | 4,097,000 | | |
| | 近畿車輛 | 19,000 | 318.00 | 6,042,000 | | |
| | 日産自動車 | 1,621,100 | 778.00 | 1,261,215,800 | | |
| | いすゞ自動車 | 806,000 | 445.00 | 358,670,000 | | |
| | トヨタ自動車 | 1,652,200 | 3,170.00 | 5,237,474,000 | | |
| | 日野自動車 | 182,000 | 552.00 | 100,464,000 | | |
| | 三菱自動車工業 | 2,848,000 | 85.00 | 242,080,000 | 貸付株式数 | 1,252,000 |
| | エフテック | 4,400 | 1,465.00 | 6,446,000 | | |
| | 武蔵精密工業 | 12,300 | 1,802.00 | 22,164,600 | | |
| | 日産車体 | 37,000 | 820.00 | 30,340,000 | | |
| | 新明和工業 | 57,000 | 367.00 | 20,919,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | 極東開発工業 | 22,000 | 708.00 | 15,576,000 | | |
| | 日信工業 | 23,300 | 1,252.00 | 29,171,600 | 貸付株式数 | 500 |
| | トピー工業 | 95,000 | 241.00 | 22,895,000 | | |
| | ティラド | 46,000 | 298.00 | 13,708,000 | 貸付株式数 | 20,000 |
| | 曙ブレーキ工業 | 64,600 | 376.00 | 24,289,600 | 貸付株式数 | 27,800 |
| | タチエス | 16,600 | 1,463.00 | 24,285,800 | | |
| | NOK | 61,600 | 1,603.00 | 98,744,800 | | |
| | フタバ産業 | 36,000 | 399.00 | 14,364,000 | | |
| | カヤバ工業 | 88,000 | 417.00 | 36,696,000 | 貸付株式数 | 39,000 (3,000) |
| | シロキ工業 | 28,000 | 249.00 | 6,972,000 | | |
| | 大同メタル工業 | 20,000 | 921.00 | 18,420,000 | | |
| | プレス工業 | 59,000 | 449.00 | 26,491,000 | | |
| | カルソニックカンセイ | 76,000 | 450.00 | 34,200,000 | | |
| | 太平洋工業 | 26,000 | 490.00 | 12,740,000 | | |
| | ケーヒン | 26,300 | 1,355.00 | 35,636,500 | 貸付株式数 | 11,300 |
| | 河西工業 | 16,000 | 474.00 | 7,584,000 | | |
| | アイシン精機 | 104,900 | 2,734.00 | 286,796,600 | | |
| | 富士機工 | 15,000 | 286.00 | 4,290,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | マツダ | 1,709,000 | 115.00 | 196,535,000 | 貸付株式数 | 92,000 |
| | ダイハツ工業 | 118,000 | 1,493.00 | 176,174,000 | 貸付株式数 | 51,000 |
| | 今仙電機製作所 | 9,300 | 1,095.00 | 10,183,500 | | |
| | 本田技研工業 | 1,075,000 | 2,711.00 | 2,914,325,000 | | |

| | | | | | | |
|--|------------|---------|----------|-------------|-------|-----------------|
| | スズキ | 266,400 | 1,773.00 | 472,327,200 | | |
| | 富士重工業 | 403,000 | 641.00 | 258,323,000 | | |
| | ヤマハ発動機 | 207,600 | 920.00 | 190,992,000 | 貸付株式数 | 40,000 (40,000) |
| | ショーワ | 27,100 | 681.00 | 18,455,100 | | |
| | T B K | 13,000 | 516.00 | 6,708,000 | | |
| | エクセディ | 17,300 | 1,987.00 | 34,375,100 | | |
| | 豊田合成 | 36,000 | 1,620.00 | 58,320,000 | | |
| | 愛三工業 | 13,200 | 758.00 | 10,005,600 | | |
| | ヨロズ | 7,600 | 1,571.00 | 11,939,600 | | |
| | エフ・シー・シー | 20,800 | 1,619.00 | 33,675,200 | | |
| | シマノ | 47,700 | 4,920.00 | 234,684,000 | | |
| | タカタ | 23,000 | 1,801.00 | 41,423,000 | 貸付株式数 | 1,900 |
| | テイ・エス テック | 26,900 | 1,581.00 | 42,528,900 | | |
| | 日本電産トーソク | 6,100 | 783.00 | 4,776,300 | | |
| | テルモ | 90,100 | 3,395.00 | 305,889,500 | | |
| | クリエートメディック | 3,800 | 810.00 | 3,078,000 | | |
| | 日機装 | 41,000 | 820.00 | 33,620,000 | | |
| | 島津製作所 | 152,000 | 706.00 | 107,312,000 | | |
| | J M S | 19,000 | 256.00 | 4,864,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|-------------------|---------|------------|-------------|-------|---------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | クボテック | 27 | 19,230.00 | 519,210 | 貸付株式数 | 5 |
| | モリテックス | 2,800 | 288.00 | 806,400 | | |
| | 長野計器 | 9,000 | 707.00 | 6,363,000 | 貸付株式数 | 4,000 (4,000) |
| | ブイ・テクノロジー | 23 | 194,000.00 | 4,462,000 | 貸付株式数 | 10 (3) |
| | 東京計器 | 44,000 | 167.00 | 7,348,000 | | |
| | 愛知時計電機 | 14,000 | 284.00 | 3,976,000 | | |
| | 東京精密 | 22,800 | 1,616.00 | 36,844,800 | | |
| | ニコン | 222,000 | 2,279.00 | 505,938,000 | | |
| | トプコン | 29,300 | 623.00 | 18,253,900 | 貸付株式数 | 12,700 |
| | オリンパス | 150,300 | 1,130.00 | 169,839,000 | 貸付株式数 | 50,500 |
| | 理研計器 | 10,300 | 554.00 | 5,706,200 | | |
| | タムロン | 10,900 | 2,520.00 | 27,468,000 | 貸付株式数 | 1,100 |
| | HOYA | 309,800 | 1,806.00 | 559,498,800 | | |
| | ノーリツ鋼機 | 11,500 | 394.00 | 4,531,000 | | |
| | エー・アンド・デイ | 12,400 | 299.00 | 3,707,600 | 貸付株式数 | 600 |
| | 日本電産コパル | 10,000 | 948.00 | 9,480,000 | 貸付株式数 | 4,300 |
| | シチズンホールディングス | 152,500 | 472.00 | 71,980,000 | | |
| | リズム時計工業 | 58,000 | 130.00 | 7,540,000 | | |
| | 大研医器 | 1,600 | 892.00 | 1,427,200 | 貸付株式数 | 200 |
| | 松風 | 6,200 | 930.00 | 5,766,000 | 貸付株式数 | 2,700 (700) |
| | セイコーホールディングス | 74,000 | 222.00 | 16,428,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| | ニプロ | 66,100 | 524.00 | 34,636,400 | | |
| | パラマウントベッドホールディングス | 10,900 | 2,502.00 | 27,271,800 | 貸付株式数 | 900 |
| | SHO-BI | 2,700 | 495.00 | 1,336,500 | 貸付株式数 | 1,100 |
| | 永大産業 | 17,000 | 333.00 | 5,661,000 | 貸付株式数 | 6,000 (6,000) |
| | ダンロップスポーツ | 8,000 | 951.00 | 7,608,000 | | |
| | バンダイナムコホールディングス | 131,700 | 1,016.00 | 133,807,200 | | |
| | 共立印刷 | 14,800 | 237.00 | 3,507,600 | 貸付株式数 | 1,900 (1,900) |
| | フランスベッドホールディングス | 85,000 | 147.00 | 12,495,000 | 貸付株式数 | 37,000 |
| | パイロットコーポレーション | 111 | 151,700.00 | 16,838,700 | | |
| | トッパン・フォームズ | 27,300 | 675.00 | 18,427,500 | | |
| | フジシールインターナショナル | 14,300 | 1,498.00 | 21,421,400 | | |
| | タカラトミー | 41,900 | 591.00 | 24,762,900 | | |
| | 廣済堂 | 10,800 | 419.00 | 4,525,200 | 貸付株式数 | 2,200 |
| | アーク | 43,100 | 76.00 | 3,275,600 | 貸付株式数 | 15,400 |
| | タカノ | 5,000 | 423.00 | 2,115,000 | 貸付株式数 | 2,200 (2,200) |
| | プロネクサス | 14,000 | 485.00 | 6,790,000 | | |
| | ホクシン | 9,000 | 179.00 | 1,611,000 | | |
| | ウッドワン | 21,000 | 316.00 | 6,636,000 | | |
| | 大建工業 | 52,000 | 250.00 | 13,000,000 | | |
| | 凸版印刷 | 387,000 | 500.00 | 193,500,000 | | |
| | 大日本印刷 | 388,000 | 647.00 | 251,036,000 | | |
| | 図書印刷 | 20,000 | 151.00 | 3,020,000 | | |
| | 共同印刷 | 43,000 | 204.00 | 8,772,000 | | |
| | 日本写真印刷 | 21,400 | 851.00 | 18,211,400 | 貸付株式数 | 9,400 (400) |
| | 光村印刷 | 12,000 | 255.00 | 3,060,000 | 貸付株式数 | 3,000 (3,000) |

| | | | | | | |
|--|-------------|---------|-----------|-------------|-------|-----------------|
| | 宝印刷 | 7,200 | 643.00 | 4,629,600 | 貸付株式数 | 3,100 (100) |
| | アシックス | 118,700 | 838.00 | 99,470,600 | | |
| | ツツミ | 6,400 | 2,216.00 | 14,182,400 | | |
| | ローランド | 13,200 | 707.00 | 9,332,400 | | |
| | 小松ウオール工業 | 4,700 | 984.00 | 4,624,800 | | |
| | ヤマハ | 93,600 | 752.00 | 70,387,200 | 貸付株式数 | 1,300 |
| | 河合楽器製作所 | 47,000 | 201.00 | 9,447,000 | | |
| | クリナップ | 14,900 | 545.00 | 8,120,500 | | |
| | ピジョン | 11,200 | 3,200.00 | 35,840,000 | | |
| | 兼松日産農林 | 20,000 | 146.00 | 2,920,000 | 貸付株式数 | 8,000 |
| | キングジム | 10,600 | 673.00 | 7,133,800 | 貸付株式数 | 4,500 (4,500) |
| | リンテック | 24,200 | 1,491.00 | 36,082,200 | | |
| | T A S A K I | 2,500 | 345.00 | 862,500 | 貸付株式数 | 1,100 (1,100) |
| | イトーキ | 26,800 | 489.00 | 13,105,200 | 貸付株式数 | 11,800 (10,100) |
| | 任天堂 | 72,900 | 10,350.00 | 754,515,000 | | |
| | 三菱鉛筆 | 10,500 | 1,407.00 | 14,773,500 | | |
| | タカラスタANDARD | 59,000 | 574.00 | 33,866,000 | | |
| | コクヨ | 66,200 | 589.00 | 38,991,800 | | |
| | ナカバヤシ | 27,000 | 186.00 | 5,022,000 | | |
| | グローブライド | 62,000 | 94.00 | 5,828,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|------------|-----------|----------|---------------|-------|------------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 岡村製作所 | 44,000 | 590.00 | 25,960,000 | | |
| | 美津濃 | 63,000 | 400.00 | 25,200,000 | | |
| | アデランス | 15,900 | 856.00 | 13,610,400 | 貸付株式数 | 6,800 (6,800) |
| | 東京電力 | 1,017,200 | 196.00 | 199,371,200 | 貸付株式数 | 460,900 |
| | 中部電力 | 419,800 | 1,272.00 | 533,985,600 | | |
| | 関西電力 | 519,900 | 1,090.00 | 566,691,000 | | |
| | 中国電力 | 176,200 | 1,349.00 | 237,693,800 | | |
| | 北陸電力 | 124,800 | 1,333.00 | 166,358,400 | | |
| | 東北電力 | 318,300 | 785.00 | 249,865,500 | | |
| | 四国電力 | 114,700 | 2,009.00 | 230,432,300 | 貸付株式数 | 1,800 |
| | 九州電力 | 281,400 | 997.00 | 280,555,800 | | |
| | 北海道電力 | 119,200 | 1,037.00 | 123,610,400 | | |
| | 沖縄電力 | 7,600 | 3,090.00 | 23,484,000 | | |
| | 電源開発 | 79,100 | 2,173.00 | 171,884,300 | 貸付株式数 | 700 |
| | 東京瓦斯 | 1,537,000 | 387.00 | 594,819,000 | | |
| | 大阪瓦斯 | 1,236,000 | 322.00 | 397,992,000 | | |
| | 東邦瓦斯 | 324,000 | 478.00 | 154,872,000 | 貸付株式数 | 140,000 |
| | 北海道瓦斯 | 23,000 | 254.00 | 5,842,000 | | |
| | 西部瓦斯 | 143,000 | 210.00 | 30,030,000 | | |
| | 静岡瓦斯 | 33,000 | 557.00 | 18,381,000 | | |
| | 東武鉄道 | 723,000 | 402.00 | 290,646,000 | | |
| | 相鉄ホールディングス | 204,000 | 252.00 | 51,408,000 | | |
| | 東京急行電鉄 | 750,000 | 364.00 | 273,000,000 | | |
| | 京浜急行電鉄 | 327,000 | 675.00 | 220,725,000 | 貸付株式数 | 140,000 |
| | 小田急電鉄 | 408,000 | 741.00 | 302,328,000 | 貸付株式数 | 168,000 (37,000) |
| | 京王電鉄 | 356,000 | 567.00 | 201,852,000 | | |
| | 京成電鉄 | 205,000 | 642.00 | 131,610,000 | | |
| | 富士急行 | 35,000 | 478.00 | 16,730,000 | 貸付株式数 | 14,000 |
| | 新京成電鉄 | 16,000 | 352.00 | 5,632,000 | | |
| | 東日本旅客鉄道 | 221,500 | 4,820.00 | 1,067,630,000 | | |

| | | | | | |
|--------------|-----------|------------|-------------|-------|-------------------|
| 西日本旅客鉄道 | 110,800 | 3,235.00 | 358,438,000 | | |
| 東海旅客鉄道 | 1,106 | 650,000.00 | 718,900,000 | | |
| 西日本鉄道 | 165,000 | 371.00 | 61,215,000 | | |
| ハマキョウレックス | 3,600 | 2,742.00 | 9,871,200 | | |
| サカイ引越センター | 2,300 | 1,666.00 | 3,831,800 | | |
| 近畿日本鉄道 | 1,151,000 | 277.00 | 318,827,000 | 貸付株式数 | 499,000 (145,000) |
| 阪急阪神ホールディングス | 855,000 | 372.00 | 318,060,000 | | |
| 南海電気鉄道 | 266,000 | 334.00 | 88,844,000 | 貸付株式数 | 26,000 |
| 京阪電気鉄道 | 285,000 | 369.00 | 105,165,000 | | |
| 名糖運輸 | 5,200 | 595.00 | 3,094,000 | | |
| 名古屋鉄道 | 445,000 | 214.00 | 95,230,000 | 貸付株式数 | 6,000 |
| 日本通運 | 504,000 | 308.00 | 155,232,000 | | |
| ヤマトホールディングス | 259,200 | 1,249.00 | 323,740,800 | | |
| 山九 | 155,000 | 300.00 | 46,500,000 | | |
| 丸運 | 6,900 | 203.00 | 1,400,700 | | |
| 丸全昭和運輸 | 43,000 | 247.00 | 10,621,000 | | |
| センコー | 51,000 | 352.00 | 17,952,000 | | |
| トナミホールディングス | 26,000 | 168.00 | 4,368,000 | | |
| 日本梱包運輸倉庫 | 38,200 | 1,023.00 | 39,078,600 | | |
| 日本石油輸送 | 14,000 | 195.00 | 2,730,000 | | |
| 福山通運 | 77,000 | 434.00 | 33,418,000 | 貸付株式数 | 22,000 |
| セイノーホールディングス | 99,000 | 536.00 | 53,064,000 | | |
| 神奈川中央交通 | 15,000 | 424.00 | 6,360,000 | | |
| 日立物流 | 26,500 | 1,474.00 | 39,061,000 | | |
| 日本郵船 | 1,009,000 | 208.00 | 209,872,000 | | |
| 商船三井 | 668,000 | 282.00 | 188,376,000 | 貸付株式数 | 249,000 |
| 川崎汽船 | 394,000 | 142.00 | 55,948,000 | 貸付株式数 | 170,000 |
| NSユニテッド海運 | 55,000 | 113.00 | 6,215,000 | 貸付株式数 | 18,000 |
| 乾汽船 | 14,000 | 280.00 | 3,920,000 | 貸付株式数 | 6,000 |
| 明治海運 | 11,400 | 303.00 | 3,454,200 | 貸付株式数 | 5,000 (500) |
| 飯野海運 | 61,500 | 382.00 | 23,493,000 | | |
| 共栄タンカー | 11,000 | 196.00 | 2,156,000 | 貸付株式数 | 4,000 |
| 第一中央汽船 | 83,000 | 100.00 | 8,300,000 | 貸付株式数 | 27,000 |

| | | | | | | |
|--|-------|-----------|--------|-------------|-------|------------------|
| | 全日本空輸 | 1,698,000 | 220.00 | 373,560,000 | 貸付株式数 | 770,000 (79,000) |
| | パスコ | 12,000 | 258.00 | 3,096,000 | 貸付株式数 | 5,000 |
| | 日新 | 48,000 | 210.00 | 10,080,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|-----------------|---------|------------|------------|-------|-----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 三菱倉庫 | 90,000 | 824.00 | 74,160,000 | | |
| | 三井倉庫 | 59,000 | 328.00 | 19,352,000 | | |
| | 住友倉庫 | 93,000 | 367.00 | 34,131,000 | | |
| | 澁澤倉庫 | 30,000 | 233.00 | 6,990,000 | 貸付株式数 | 13,000 (13,000) |
| | 東陽倉庫 | 20,000 | 179.00 | 3,580,000 | | |
| | 日本トランスシティ | 27,000 | 282.00 | 7,614,000 | | |
| | ケイヒン | 23,000 | 102.00 | 2,346,000 | | |
| | 安田倉庫 | 9,900 | 485.00 | 4,801,500 | | |
| | 東洋埠頭 | 37,000 | 135.00 | 4,995,000 | | |
| | 宇徳 | 8,600 | 253.00 | 2,175,800 | | |
| | 上組 | 141,000 | 636.00 | 89,676,000 | | |
| | サンリツ | 3,300 | 510.00 | 1,683,000 | | |
| | キムラユニティー | 2,900 | 728.00 | 2,111,200 | 貸付株式数 | 1,200 (1,200) |
| | キューソー流通システム | 4,000 | 870.00 | 3,480,000 | | |
| | 郵船ロジスティクス | 10,000 | 1,138.00 | 11,380,000 | | |
| | 近鉄エクスプレス | 11,400 | 2,723.00 | 31,042,200 | | |
| | 東海運 | 8,000 | 224.00 | 1,792,000 | 貸付株式数 | 3,500 (3,500) |
| | エーアイティー | 1,000 | 1,179.00 | 1,179,000 | 貸付株式数 | 100 |
| | NEC ネットエスアイ | 11,800 | 1,253.00 | 14,785,400 | | |
| | システナ | 134 | 58,500.00 | 7,839,000 | | |
| | 新日鉄ソリューションズ | 8,400 | 1,534.00 | 12,885,600 | | |
| | コア | 4,700 | 680.00 | 3,196,000 | 貸付株式数 | 1,900 (1,900) |
| | ソフトクリエイト | 1,300 | 1,143.00 | 1,485,900 | 貸付株式数 | 500 |
| | デジタルハーツ | 14 | 174,000.00 | 2,436,000 | 貸付株式数 | 3 |
| | ITホールディングス | 38,200 | 1,014.00 | 38,734,800 | | |
| | プライムワークス | 28 | 62,000.00 | 1,736,000 | 貸付株式数 | 11 (9) |
| | グリー | 64,500 | 1,527.00 | 98,491,500 | 貸付株式数 | 28,400 |
| | コーエーテクモホールディングス | 24,900 | 653.00 | 16,259,700 | | |
| | 三菱総合研究所 | 4,900 | 1,665.00 | 8,158,500 | 貸付株式数 | 2,100 (2,100) |
| | ボルテージ | 2,000 | 967.00 | 1,934,000 | 貸付株式数 | 800 (600) |

| | | | | | |
|------------------------|--------|------------|-------------|-------|---------------|
| ネクソン | 85,500 | 1,475.00 | 126,112,500 | 貸付株式数 | 27,700 |
| ダウンゴ | 65 | 114,200.00 | 7,423,000 | 貸付株式数 | 27 |
| ベリサーブ | 7 | 125,900.00 | 881,300 | | |
| マクロミル | 12,200 | 782.00 | 9,540,400 | 貸付株式数 | 3,800 |
| ティーガイア | 81 | 137,500.00 | 11,137,500 | | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 20 | 277,100.00 | 5,542,000 | | |
| ザッパラス | 69 | 77,500.00 | 5,347,500 | | |
| インターネットイニシアティブ | 74 | 303,000.00 | 22,422,000 | | |
| ソネットエンタテインメント | 71 | 329,000.00 | 23,359,000 | | |
| SRAホールディングス | 6,600 | 896.00 | 5,913,600 | | |
| JBISホールディングス | 7,800 | 308.00 | 2,402,400 | 貸付株式数 | 1,400 (1,000) |
| 朝日ネット | 10,000 | 367.00 | 3,670,000 | | |
| パナソニック電工インフォメーションシステムズ | 3,000 | 2,009.00 | 6,027,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| フェイス | 426 | 8,980.00 | 3,825,480 | | |
| 野村総合研究所 | 71,200 | 1,759.00 | 125,240,800 | | |
| サイバネットシステム | 103 | 20,410.00 | 2,102,230 | | |
| インテージ | 3,700 | 1,664.00 | 6,156,800 | | |
| シンプレクス・ホールディングス | 210 | 28,120.00 | 5,905,200 | | |
| クレスコ | 2,800 | 640.00 | 1,792,000 | | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 1,310 | 133,600.00 | 175,016,000 | | |
| オービック | 3,940 | 16,250.00 | 64,025,000 | | |
| ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング | 2,500 | 731.00 | 1,827,500 | | |
| ヤフー | 9,207 | 24,080.00 | 221,704,560 | | |
| トレンドマイクロ | 55,500 | 2,244.00 | 124,542,000 | 貸付株式数 | 12,300 |
| 日本オラクル | 25,100 | 3,035.00 | 76,178,500 | | |
| アルファシステムズ | 4,100 | 1,166.00 | 4,780,600 | 貸付株式数 | 1,800 (1,800) |
| フューチャーアーキテクト | 151 | 34,500.00 | 5,209,500 | | |
| シーエーシー | 8,500 | 677.00 | 5,754,500 | | |
| ソフトバンク・テクノロジー | 2,900 | 838.00 | 2,430,200 | 貸付株式数 | 1,300 |
| トーセ | 3,100 | 555.00 | 1,720,500 | | |
| オービックビジネスコンサルタント | 3,200 | 3,850.00 | 12,320,000 | | |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 14,800 | 3,905.00 | 57,794,000 | | |
| アイティフォー | 14,000 | 294.00 | 4,116,000 | | |

| | | | | | | |
|--|---------|-------|------------|-----------|-------|-----------|
| | 東計電算 | 2,200 | 1,050.00 | 2,310,000 | 貸付株式数 | 900 (900) |
| | エックスネット | 11 | 117,500.00 | 1,292,500 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|----------------------|---------|------------|---------------|-------|---------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 大塚商会 | 10,000 | 6,770.00 | 67,700,000 | | |
| | サイボウズ | 230 | 24,510.00 | 5,637,300 | 貸付株式数 | 101 |
| | ソフトブレーン | 184 | 8,520.00 | 1,567,680 | | |
| | アグレックス | 3,300 | 744.00 | 2,455,200 | 貸付株式数 | 1,200 |
| | 電通国際情報サービス | 7,700 | 597.00 | 4,596,900 | | |
| | ウェザーニューズ | 3,300 | 2,569.00 | 8,477,700 | 貸付株式数 | 1,400 (1,300) |
| | C I J | 12,500 | 339.00 | 4,237,500 | | |
| | WOWOW | 39 | 166,500.00 | 6,493,500 | | |
| | 日本コロムビア | 125,000 | 28.00 | 3,500,000 | | |
| | ネットワンシステムズ | 56,800 | 1,174.00 | 66,683,200 | | |
| | アルゴグラフィックス | 4,500 | 1,127.00 | 5,071,500 | | |
| | エイベックス・グループ・ホールディングス | 23,700 | 870.00 | 20,619,000 | | |
| | 日本ユニシス | 30,400 | 586.00 | 17,814,400 | | |
| | 兼松エレクトロニクス | 7,900 | 871.00 | 6,880,900 | | |
| | 東京放送ホールディングス | 75,300 | 1,025.00 | 77,182,500 | | |
| | 日本テレビ放送網 | 11,040 | 11,920.00 | 131,596,800 | | |
| | テレビ朝日 | 318 | 116,600.00 | 37,078,800 | | |
| | スカパーJ S A Tホールディングス | 954 | 33,850.00 | 32,292,900 | | |
| | テレビ東京ホールディングス | 8,000 | 1,014.00 | 8,112,000 | | |
| | アイ・ティー・シーネットワーク | 10,600 | 526.00 | 5,575,600 | | |
| | イー・アクセス | 960 | 14,920.00 | 14,323,200 | 貸付株式数 | 422 |
| | NECモバイルリング | 4,600 | 2,944.00 | 13,542,400 | | |
| | 日本電信電話 | 579,100 | 3,555.00 | 2,058,700,500 | | |
| | K D D I | 1,952 | 491,500.00 | 959,408,000 | | |
| | 光通信 | 11,500 | 2,519.00 | 28,968,500 | 貸付株式数 | 1,900 |
| | エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 10,361 | 130,000.00 | 1,346,930,000 | | |
| | GMOインターネット | 37,300 | 429.00 | 16,001,700 | | |
| | 学研ホールディングス | 38,000 | 176.00 | 6,688,000 | | |
| | ゼンリン | 18,100 | 793.00 | 14,353,300 | | |
| | 昭文社 | 6,800 | 575.00 | 3,910,000 | 貸付株式数 | 2,900 (2,900) |

| | | | | | |
|----------------------|---------|------------|---------------|-------|-----------------|
| 角川グループホールディングス | 11,900 | 2,118.00 | 25,204,200 | 貸付株式数 | 5,100 |
| インプレスホールディングス | 10,300 | 118.00 | 1,215,400 | 貸付株式数 | 4,500 |
| アイネット | 5,400 | 505.00 | 2,727,000 | | |
| 松竹 | 83,000 | 760.00 | 63,080,000 | 貸付株式数 | 36,000 (32,000) |
| 東宝 | 89,700 | 1,370.00 | 122,889,000 | | |
| 東映 | 53,000 | 401.00 | 21,253,000 | | |
| 葵プロモーション | 6,000 | 512.00 | 3,072,000 | | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 777 | 244,500.00 | 189,976,500 | | |
| D T S | 13,000 | 1,051.00 | 13,663,000 | | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 41,100 | 1,501.00 | 61,691,100 | 貸付株式数 | 9,700 |
| シーイーシー | 7,400 | 414.00 | 3,063,600 | | |
| カプコン | 24,100 | 1,851.00 | 44,609,100 | | |
| ジャステック | 8,000 | 487.00 | 3,896,000 | | |
| S C S K | 25,600 | 1,202.00 | 30,771,200 | 貸付株式数 | 700 |
| 日本システムウエア | 4,100 | 313.00 | 1,283,300 | | |
| アイネス | 15,200 | 593.00 | 9,013,600 | | |
| T K C | 11,600 | 1,668.00 | 19,348,800 | 貸付株式数 | 4,500 (4,500) |
| 富士ソフト | 16,500 | 1,416.00 | 23,364,000 | | |
| N S D | 22,900 | 658.00 | 15,068,200 | | |
| コナミ | 56,800 | 1,976.00 | 112,236,800 | 貸付株式数 | 24,900 |
| 福井コンピュータ | 1,700 | 411.00 | 698,700 | | |
| J B C Cホールディングス | 9,800 | 537.00 | 5,262,600 | | |
| ソフトバンク | 569,700 | 2,415.00 | 1,375,825,500 | | |
| ハウスイ | 10,000 | 102.00 | 1,020,000 | 貸付株式数 | 4,000 |
| インターニックス | 5,100 | 349.00 | 1,779,900 | | |
| 高千穂交易 | 5,200 | 864.00 | 4,492,800 | 貸付株式数 | 2,300 (2,300) |
| 伊藤忠食品 | 3,100 | 2,979.00 | 9,234,900 | | |
| エレマテック | 8,400 | 1,109.00 | 9,315,600 | | |
| J A L U X | 3,500 | 837.00 | 2,929,500 | 貸付株式数 | 1,500 (1,500) |
| あらた | 28,000 | 441.00 | 12,348,000 | 貸付株式数 | 12,000 (3,000) |
| トーメンデバイス | 1,900 | 2,000.00 | 3,800,000 | 貸付株式数 | 100 (100) |
| 東京エレクトロン デバイス | 25 | 142,500.00 | 3,562,500 | | |
| 双日 | 841,700 | 124.00 | 104,370,800 | | |

| | | | | | | |
|--|-----------------|--------|----------|-------------|-------|---------------|
| | アルフレッサ ホールディングス | 32,900 | 3,910.00 | 128,639,000 | | |
| | 横浜冷凍 | 31,100 | 604.00 | 18,784,400 | | |
| | 神栄 | 16,000 | 131.00 | 2,096,000 | 貸付株式数 | 6,000 (6,000) |
| | 山下医科器械 | 1,000 | 1,008.00 | 1,008,000 | 貸付株式数 | 400 (400) |

| 通貨 | 銘柄 | 株式 数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|---------------------|---------|----------|-------------|-------|-----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | ラサ商事 | 5,400 | 434.00 | 2,343,600 | 貸付株式数 | 700 |
| | アルコニックス | 3,300 | 1,682.00 | 5,550,600 | | |
| | あい ホールディングス | 20,100 | 499.00 | 10,029,900 | | |
| | ダイワボウホールディングス | 122,000 | 152.00 | 18,544,000 | 貸付株式数 | 22,000 |
| | バイタルケーエスケー・ホールディングス | 23,600 | 668.00 | 15,764,800 | 貸付株式数 | 10,400 (10,400) |
| | 八洲電機 | 8,300 | 351.00 | 2,913,300 | 貸付株式数 | 3,600 |
| | UKCホールディングス | 7,500 | 1,138.00 | 8,535,000 | | |
| | TOKAIホールディングス | 61,400 | 364.00 | 22,349,600 | | |
| | ミタチ産業 | 2,900 | 411.00 | 1,191,900 | | |
| | シップヘルスケアホールディングス | 16,300 | 2,090.00 | 34,067,000 | | |
| | 富士興産 | 45,000 | 65.00 | 2,925,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | 協栄産業 | 15,000 | 137.00 | 2,055,000 | | |
| | 小野建 | 10,900 | 632.00 | 6,888,800 | | |
| | 佐鳥電機 | 9,200 | 486.00 | 4,471,200 | | |
| | エコートレーディング | 3,100 | 701.00 | 2,173,100 | 貸付株式数 | 1,300 (1,300) |
| | 伯東 | 7,600 | 763.00 | 5,798,800 | | |
| | コンドーテック | 8,800 | 526.00 | 4,628,800 | | |
| | 中山福 | 7,200 | 601.00 | 4,327,200 | | |
| | ナガイレーベン | 16,600 | 1,213.00 | 20,135,800 | 貸付株式数 | 1,100 |
| | 三菱食品 | 11,500 | 1,955.00 | 22,482,500 | | |
| | 松田産業 | 9,100 | 1,204.00 | 10,956,400 | | |
| | メディパルホールディングス | 135,400 | 1,041.00 | 140,951,400 | | |
| | アドヴァン | 7,500 | 824.00 | 6,180,000 | | |
| | SPK | 2,900 | 1,376.00 | 3,990,400 | | |
| | アズワン | 8,200 | 1,692.00 | 13,874,400 | | |
| | スズデン | 4,000 | 501.00 | 2,004,000 | | |
| | 尾家産業 | 4,000 | 811.00 | 3,244,000 | | |
| | シモジマ | 7,700 | 994.00 | 7,653,800 | 貸付株式数 | 3,300 (1,600) |
| | ドウシシャ | 5,900 | 2,279.00 | 13,446,100 | 貸付株式数 | 2,500 |
| | 高速 | 7,500 | 676.00 | 5,070,000 | | |
| | 黒田電気 | 15,500 | 810.00 | 12,555,000 | | |
| | 丸文 | 10,000 | 373.00 | 3,730,000 | | |
| | ハピネット | 6,700 | 815.00 | 5,460,500 | 貸付株式数 | 2,900 (2,900) |
| | トーメンエレクトロニクス | 5,800 | 1,173.00 | 6,803,400 | | |
| | エクセル | 5,800 | 746.00 | 4,326,800 | | |
| | マルカキカイ | 4,100 | 896.00 | 3,673,600 | 貸付株式数 | 300 (300) |
| | ガリバーインターナショナル | 3,810 | 2,801.00 | 10,671,810 | 貸付株式数 | 980 (500) |
| | 日本エム・ディ・エム | 10,500 | 252.00 | 2,646,000 | 貸付株式数 | 1,400 |
| | 進和 | 7,400 | 924.00 | 6,837,600 | | |
| | エスケイジャパン | 3,000 | 252.00 | 756,000 | 貸付株式数 | 1,200 (1,200) |
| | ダイトエレクトロン | 5,700 | 387.00 | 2,205,900 | | |
| | シークス | 8,000 | 1,230.00 | 9,840,000 | 貸付株式数 | 3,500 (3,500) |
| | 田中商事 | 3,800 | 420.00 | 1,596,000 | 貸付株式数 | 1,700 |
| | オーハシテクニカ | 7,000 | 554.00 | 3,878,000 | | |
| | マクニカ | 6,400 | 1,884.00 | 12,057,600 | | |
| | 白銅 | 4,100 | 728.00 | 2,984,800 | | |

| | | | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|-------|-----------------|
| 伊藤忠商事 | 1,003,200 | 874.00 | 876,796,800 | | |
| 丸紅 | 1,100,000 | 537.00 | 590,700,000 | | |
| 高島 | 22,000 | 257.00 | 5,654,000 | 貸付株式数 | 9,000 (6,000) |
| F & A アクアホールディングス | 9,600 | 840.00 | 8,064,000 | 貸付株式数 | 4,300 (4,300) |
| 長瀬産業 | 71,200 | 981.00 | 69,847,200 | | |
| 蝶理 | 79,000 | 108.00 | 8,532,000 | 貸付株式数 | 16,000 (16,000) |
| 豊田通商 | 140,100 | 1,542.00 | 216,034,200 | | |
| 三共生興 | 21,400 | 261.00 | 5,585,400 | | |
| 兼松 | 267,000 | 91.00 | 24,297,000 | | |
| ツカモトコーポレーション | 23,000 | 155.00 | 3,565,000 | 貸付株式数 | 8,000 (8,000) |
| 三井物産 | 1,085,500 | 1,134.00 | 1,230,957,000 | | |
| 日本紙パルプ商事 | 65,000 | 278.00 | 18,070,000 | 貸付株式数 | 20,000 (20,000) |
| 日立ハイテクノロジーズ | 38,100 | 1,923.00 | 73,266,300 | | |
| カメイ | 16,000 | 827.00 | 13,232,000 | | |
| 東都水産 | 21,000 | 134.00 | 2,814,000 | 貸付株式数 | 8,000 |
| スターゼン | 42,000 | 235.00 | 9,870,000 | | |
| 山善 | 48,300 | 707.00 | 34,148,100 | | |
| 椿本興業 | 13,000 | 242.00 | 3,146,000 | | |
| 住友商事 | 742,100 | 1,094.00 | 811,857,400 | | |
| 内田洋行 | 27,000 | 246.00 | 6,642,000 | 貸付株式数 | 11,000 (11,000) |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-------------|-------------------|----------|------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 三菱商事 | 915,800 | 1,660.00 | 1,520,228,000 | | |
| | 第一実業 | 26,000 | 405.00 | 10,530,000 | | |
| | キャノンマーケティングジャパン | 41,800 | 987.00 | 41,256,600 | | |
| | 西華産業 | 45,000 | 223.00 | 10,035,000 | | |
| | 佐藤商事 | 11,200 | 581.00 | 6,507,200 | | |
| | 菱洋エレクトロ | 13,700 | 896.00 | 12,275,200 | | |
| | 東京産業 | 12,500 | 302.00 | 3,775,000 | | |
| | ユアサ商事 | 128,000 | 132.00 | 16,896,000 | | |
| | 神鋼商事 | 32,000 | 177.00 | 5,664,000 | | |
| | 阪和興業 | 126,000 | 319.00 | 40,194,000 | | |
| | カナデン | 12,000 | 500.00 | 6,000,000 | | |
| | 菱電商事 | 18,000 | 463.00 | 8,334,000 | | |
| | フルサト工業 | 7,400 | 760.00 | 5,624,000 | | |
| | 岩谷産業 | 139,000 | 291.00 | 40,449,000 | | |
| | すてきナイスグループ | 55,000 | 228.00 | 12,540,000 | | |
| | 昭光通商 | 45,000 | 126.00 | 5,670,000 | 貸付株式数 | 4,000 |
| | 二チモウ | 18,000 | 238.00 | 4,284,000 | 貸付株式数 | 7,000 (7,000) |
| | 極東貿易 | 14,000 | 170.00 | 2,380,000 | 貸付株式数 | 6,000 |
| | イワキ | 19,000 | 189.00 | 3,591,000 | | |
| | 三愛石油 | 30,000 | 375.00 | 11,250,000 | | |
| | 稲畑産業 | 33,500 | 505.00 | 16,917,500 | | |
| | G S Iクレオス | 31,000 | 109.00 | 3,379,000 | | |
| | 明和産業 | 9,900 | 740.00 | 7,326,000 | 貸付株式数 | 4,300 (1,200) |
| | J F E 商事 | 84,300 | 386.00 | 32,539,800 | | |
| | 東邦ホールディングス | 40,300 | 1,535.00 | 61,860,500 | | |
| | サンゲツ | 22,300 | 1,990.00 | 44,377,000 | | |
| | ミツウロコグループホールディングス | 20,200 | 524.00 | 10,584,800 | 貸付株式数 | 4,000 (4,000) |
| | シナネン | 27,000 | 339.00 | 9,153,000 | | |
| | 伊藤忠エネクス | 27,700 | 467.00 | 12,935,900 | | |
| | サンリオ | 31,700 | 3,260.00 | 103,342,000 | 貸付株式数 | 13,700 (100) |
| | サンワテクノス | 6,100 | 720.00 | 4,392,000 | | |
| | リョーサン | 20,500 | 1,479.00 | 30,319,500 | | |
| | 新光商事 | 13,800 | 658.00 | 9,080,400 | | |
| トーホー | 26,000 | 310.00 | 8,060,000 | | | |
| 三信電気 | 18,000 | 567.00 | 10,206,000 | | | |
| 東陽テクニカ | 18,200 | 887.00 | 16,143,400 | | | |
| モスフードサービス | 16,500 | 1,556.00 | 25,674,000 | | | |
| 加賀電子 | 13,600 | 833.00 | 11,328,800 | | | |
| ソーダニッカ | 13,000 | 338.00 | 4,394,000 | 貸付株式数 | 5,000 (5,000) | |
| 立花エレクトック | 7,600 | 691.00 | 5,251,600 | | | |
| P a l t a c | 13,300 | 1,169.00 | 15,547,700 | | | |
| 太平洋興発 | 43,000 | 86.00 | 3,698,000 | 貸付株式数 | 13,000 | |
| ヤマタネ | 63,000 | 112.00 | 7,056,000 | | | |
| 丸紅建材リース | 12,000 | 154.00 | 1,848,000 | 貸付株式数 | 5,000 (5,000) | |
| 日鐵商事 | 28,000 | 231.00 | 6,468,000 | | | |
| トラスコ中山 | 15,700 | 1,797.00 | 28,212,900 | | | |

| | | | | | | |
|--|-------------|--------|----------|-------------|-------|---------------|
| | オートバックスセブン | 14,900 | 3,945.00 | 58,780,500 | | |
| | 加藤産業 | 18,100 | 1,663.00 | 30,100,300 | | |
| | イノテック | 10,100 | 465.00 | 4,696,500 | 貸付株式数 | 600 |
| | イエローハット | 11,900 | 1,326.00 | 15,779,400 | | |
| | 富士エレクトロニクス | 6,500 | 1,151.00 | 7,481,500 | 貸付株式数 | 2,900 (2,900) |
| | J Kホールディングス | 10,500 | 373.00 | 3,916,500 | | |
| | 日伝 | 5,200 | 2,101.00 | 10,925,200 | 貸付株式数 | 400 (200) |
| | 北沢産業 | 10,500 | 172.00 | 1,806,000 | | |
| | 杉本商事 | 6,800 | 750.00 | 5,100,000 | | |
| | 因幡電機産業 | 14,800 | 2,323.00 | 34,380,400 | | |
| | 住金物産 | 59,000 | 203.00 | 11,977,000 | | |
| | ミスミグループ本社 | 46,600 | 1,892.00 | 88,167,200 | 貸付株式数 | 1,400 |
| | 江守商事 | 2,500 | 996.00 | 2,490,000 | | |
| | アルテック | 6,100 | 232.00 | 1,415,200 | 貸付株式数 | 2,200 |
| | タキヒヨー | 19,000 | 452.00 | 8,588,000 | | |
| | スズケン | 48,300 | 2,464.00 | 119,011,200 | | |
| | ジェコス | 8,600 | 381.00 | 3,276,600 | | |
| | ローソン | 39,700 | 5,370.00 | 213,189,000 | 貸付株式数 | 17,200 |
| | サンエー | 4,300 | 3,220.00 | 13,846,000 | | |
| | キリン堂 | 5,400 | 577.00 | 3,115,800 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|------------------|---------|------------|---------------|-------|---------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | ダイユーエイト | 2,300 | 627.00 | 1,442,100 | | |
| | カワチ薬品 | 8,800 | 1,833.00 | 16,130,400 | | |
| | エービーシー・マート | 17,900 | 2,870.00 | 51,373,000 | 貸付株式数 | 3,500 |
| | ハードオフコーポレーション | 6,100 | 567.00 | 3,458,700 | 貸付株式数 | 2,600 (2,600) |
| | アスクル | 8,600 | 1,120.00 | 9,632,000 | 貸付株式数 | 3,800 |
| | ゲオホールディングス | 194 | 95,400.00 | 18,507,600 | | |
| | ポイント | 10,620 | 2,982.00 | 31,668,840 | 貸付株式数 | 2,600 |
| | シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 8,000 | 197.00 | 1,576,000 | 貸付株式数 | 3,000 |
| | くらコーポレーション | 6,600 | 1,101.00 | 7,266,600 | 貸付株式数 | 2,700 (2,700) |
| | キャンドゥ | 66 | 104,400.00 | 6,890,400 | 貸付株式数 | 30 (11) |
| | パル | 3,650 | 3,675.00 | 13,413,750 | | |
| | エディオン | 50,200 | 437.00 | 21,937,400 | | |
| | サーラコーポレーション | 11,000 | 508.00 | 5,588,000 | 貸付株式数 | 4,500 (4,500) |
| | あみやき亭 | 19 | 217,000.00 | 4,123,000 | 貸付株式数 | 8 |
| | ひらまつ | 43 | 72,600.00 | 3,121,800 | | |
| | ゲンキー | 1,200 | 2,146.00 | 2,575,200 | | |
| | ハニーズ | 11,040 | 1,585.00 | 17,498,400 | 貸付株式数 | 900 (880) |
| | アルペン | 9,600 | 1,625.00 | 15,600,000 | | |
| | ビックカメラ | 477 | 38,500.00 | 18,364,500 | 貸付株式数 | 209 |
| | D C Mホールディングス | 65,100 | 585.00 | 38,083,500 | 貸付株式数 | 29,100 |
| | MonotaRO | 7,100 | 1,293.00 | 9,180,300 | 貸付株式数 | 3,100 (3,000) |
| | J・フロントリテイリング | 297,000 | 394.00 | 117,018,000 | | |
| | ドトール・日レスホールディングス | 20,000 | 1,047.00 | 20,940,000 | | |
| | マツモトキヨシホールディングス | 23,300 | 1,723.00 | 40,145,900 | | |
| | スタートトゥデイ | 22,800 | 1,199.00 | 27,337,200 | 貸付株式数 | 9,900 (1,600) |
| | 物語コーポレーション | 1,600 | 1,490.00 | 2,384,000 | 貸付株式数 | 600 |
| | ココカラファイン | 13,100 | 2,580.00 | 33,798,000 | | |
| | 三越伊勢丹ホールディングス | 249,900 | 843.00 | 210,665,700 | | |
| | クリエイトSDホールディングス | 5,300 | 2,220.00 | 11,766,000 | 貸付株式数 | 2,300 (200) |
| | 丸善CHIホールディングス | 3,700 | 204.00 | 754,800 | 貸付株式数 | 1,600 |
| | ブックオフコーポレーション | 6,900 | 691.00 | 4,767,900 | 貸付株式数 | 1,500 (1,500) |
| | あさひ | 7,300 | 1,600.00 | 11,680,000 | 貸付株式数 | 3,100 |
| | サークルKサンクス | 3,400 | 1,766.00 | 6,004,400 | | |
| | 日本調剤 | 1,580 | 3,225.00 | 5,095,500 | | |
| | コスモス薬品 | 5,500 | 4,695.00 | 25,822,500 | | |
| | セブン&アイ・ホールディングス | 526,000 | 2,395.00 | 1,259,770,000 | | |
| | ツルハホールディングス | 10,300 | 4,835.00 | 49,800,500 | 貸付株式数 | 4,500 |
| | サンマルクホールディングス | 3,600 | 3,025.00 | 10,890,000 | 貸付株式数 | 1,500 (1,500) |
| | フェリシモ | 3,600 | 1,080.00 | 3,888,000 | | |
| | トリドール | 10,900 | 1,019.00 | 11,107,100 | 貸付株式数 | 1,300 |
| | クスリのアオキ | 1,800 | 2,050.00 | 3,690,000 | 貸付株式数 | 700 |
| | メディカルシステムネットワーク | 3,900 | 1,336.00 | 5,210,400 | 貸付株式数 | 1,700 |
| | 総合メディカル | 3,000 | 3,150.00 | 9,450,000 | 貸付株式数 | 1,100 (1,100) |
| | はるやま商事 | 5,200 | 541.00 | 2,813,200 | | |
| | カッパ・クリエイト | 9,250 | 1,704.00 | 15,762,000 | 貸付株式数 | 3,650 |
| | ライトオン | 9,400 | 676.00 | 6,354,400 | 貸付株式数 | 4,000 |

| | | | | | | |
|--|---------------|--------|----------|------------|-------|---------------|
| | ジーンズメイト | 4,000 | 203.00 | 812,000 | 貸付株式数 | 500 |
| | 良品計画 | 13,300 | 4,210.00 | 55,993,000 | 貸付株式数 | 5,800 |
| | 三城ホールディングス | 15,500 | 468.00 | 7,254,000 | 貸付株式数 | 6,800 |
| | コナカ | 14,800 | 837.00 | 12,387,600 | 貸付株式数 | 6,500 |
| | ハウス オブ ローゼ | 1,400 | 1,245.00 | 1,743,000 | 貸付株式数 | 600 (100) |
| | G - 7ホールディングス | 3,700 | 408.00 | 1,509,600 | | |
| | イオン北海道 | 7,900 | 359.00 | 2,836,100 | | |
| | コジマ | 16,900 | 362.00 | 6,117,800 | 貸付株式数 | 7,300 |
| | コーナン商事 | 13,700 | 1,107.00 | 15,165,900 | 貸付株式数 | 6,000 |
| | エコス | 4,200 | 505.00 | 2,121,000 | | |
| | ワタミ | 14,800 | 1,686.00 | 24,952,800 | 貸付株式数 | 6,300 (6,200) |
| | マルシェ | 3,000 | 730.00 | 2,190,000 | 貸付株式数 | 1,300 |
| | ドン・キホーテ | 33,600 | 2,923.00 | 98,212,800 | 貸付株式数 | 13,300 |
| | メガネトップ | 18,000 | 937.00 | 16,866,000 | | |
| | 西松屋チェーン | 27,500 | 654.00 | 17,985,000 | | |
| | ゼンショーホールディングス | 47,900 | 1,012.00 | 48,474,800 | 貸付株式数 | 21,100 |
| | 幸楽苑 | 7,700 | 1,225.00 | 9,432,500 | 貸付株式数 | 3,000 (100) |
| | ハークスレイ | 3,100 | 503.00 | 1,559,300 | 貸付株式数 | 1,300 (1,300) |
| | サイゼリヤ | 18,600 | 1,219.00 | 22,673,400 | 貸付株式数 | 8,100 |
| | ポプラ | 3,200 | 492.00 | 1,574,400 | 貸付株式数 | 100 (100) |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|------------------|---------|----------|-------------|-------|-------------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | ユニテッドアローズ | 13,500 | 1,843.00 | 24,880,500 | 貸付株式数 | 5,900 (5,900) |
| | ハイデイ日高 | 6,600 | 1,230.00 | 8,118,000 | | |
| | 京都きもの友禅 | 8,300 | 955.00 | 7,926,500 | 貸付株式数 | 2,900 |
| | コロワイド | 41,500 | 589.00 | 24,443,500 | 貸付株式数 | 19,000 (500) |
| | 壱番屋 | 5,100 | 2,484.00 | 12,668,400 | 貸付株式数 | 2,200 |
| | トップカルチャー | 4,500 | 372.00 | 1,674,000 | | |
| | スギホールディングス | 22,500 | 2,543.00 | 57,217,500 | 貸付株式数 | 6,500 (6,500) |
| | スクロール | 16,300 | 306.00 | 4,987,800 | | |
| | ファミリーマート | 38,600 | 3,540.00 | 136,644,000 | 貸付株式数 | 300 |
| | 木曽路 | 14,400 | 1,554.00 | 22,377,600 | | |
| | 千趣会 | 22,600 | 539.00 | 12,181,400 | 貸付株式数 | 10,200 (10,200) |
| | タカキュー | 9,500 | 180.00 | 1,710,000 | 貸付株式数 | 4,000 (4,000) |
| | ケーヨー | 23,500 | 478.00 | 11,233,000 | 貸付株式数 | 10,200 (400) |
| | 上新電機 | 27,000 | 767.00 | 20,709,000 | | |
| | 日本瓦斯 | 12,000 | 1,204.00 | 14,448,000 | | |
| | ベスト電器 | 39,500 | 176.00 | 6,952,000 | 貸付株式数 | 1,500 |
| | マルエツ | 25,000 | 295.00 | 7,375,000 | 貸付株式数 | 3,000 |
| | ロイヤルホールディングス | 21,000 | 944.00 | 19,824,000 | 貸付株式数 | 9,200 (200) |
| | 東天紅 | 9,000 | 145.00 | 1,305,000 | 貸付株式数 | 3,000 (3,000) |
| | いなげや | 14,000 | 925.00 | 12,950,000 | 貸付株式数 | 400 |
| | 島忠 | 28,500 | 1,728.00 | 49,248,000 | | |
| | チヨダ | 16,500 | 1,819.00 | 30,013,500 | | |
| | ライフコーポレーション | 7,900 | 1,410.00 | 11,139,000 | 貸付株式数 | 3,500 (3,500) |
| | カスミ | 25,700 | 573.00 | 14,726,100 | | |
| | リンガーハット | 11,300 | 1,060.00 | 11,978,000 | 貸付株式数 | 4,600 |
| | さが美 | 10,000 | 114.00 | 1,140,000 | 貸付株式数 | 4,000 (4,000) |
| | MrMax | 12,500 | 316.00 | 3,950,000 | | |
| | テナライド | 9,500 | 263.00 | 2,498,500 | 貸付株式数 | 4,300 |
| | AOKIホールディングス | 11,100 | 1,668.00 | 18,514,800 | | |
| | オークワ | 18,000 | 1,080.00 | 19,440,000 | | |
| | コメリ | 17,200 | 2,195.00 | 37,754,000 | | |
| | 青山商事 | 34,700 | 1,672.00 | 58,018,400 | | |
| | しまむら | 14,600 | 9,160.00 | 133,736,000 | | |
| | CFSコーポレーション | 8,200 | 376.00 | 3,083,200 | | |
| | 高島屋 | 170,000 | 581.00 | 98,770,000 | | |
| | 松屋 | 25,300 | 642.00 | 16,242,600 | 貸付株式数 | 11,100 (1,900) |
| | エイチ・ツー・オー リテイリング | 65,000 | 673.00 | 43,745,000 | | |
| | 丸栄 | 21,000 | 99.00 | 2,079,000 | 貸付株式数 | 8,000 |
| | ニッセンホールディングス | 25,100 | 387.00 | 9,713,700 | | |
| | パルコ | 22,800 | 772.00 | 17,601,600 | | |
| | 丸井グループ | 163,900 | 605.00 | 99,159,500 | | |
| | 原信ナルスホールディングス | 6,900 | 1,362.00 | 9,397,800 | 貸付株式数 | 3,000 (3,000) |
| | 井筒屋 | 68,000 | 48.00 | 3,264,000 | 貸付株式数 | 29,000 (29,000) |
| | ダイエー | 77,600 | 251.00 | 19,477,600 | 貸付株式数 | 33,600 (33,600) |
| | イズミヤ | 44,000 | 416.00 | 18,304,000 | 貸付株式数 | 3,000 |
| | イオン | 443,300 | 1,003.00 | 444,629,900 | 貸付株式数 | 191,900 (163,900) |

| | | | | | | |
|--|----------------|--------|------------|-------------|-------|---------------|
| | ユニー | 94,300 | 893.00 | 84,209,900 | | |
| | イズミ | 37,700 | 1,667.00 | 62,845,900 | | |
| | 東武ストア | 16,000 | 266.00 | 4,256,000 | | |
| | 平和堂 | 23,200 | 1,125.00 | 26,100,000 | 貸付株式数 | 9,900 (9,900) |
| | フジ | 14,000 | 1,793.00 | 25,102,000 | | |
| | ヤオコー | 5,500 | 2,734.00 | 15,037,000 | | |
| | ゼビオ | 15,200 | 2,116.00 | 32,163,200 | | |
| | ケースホールディングス | 31,400 | 2,210.00 | 69,394,000 | 貸付株式数 | 200 |
| | O l y m p i c | 8,300 | 822.00 | 6,822,600 | 貸付株式数 | 3,700 (3,700) |
| | 日産東京販売ホールディングス | 18,000 | 236.00 | 4,248,000 | 貸付株式数 | 7,000 (2,000) |
| | アインファーマシーズ | 6,900 | 4,305.00 | 29,704,500 | 貸付株式数 | 2,800 (2,800) |
| | 元気寿司 | 3,900 | 986.00 | 3,845,400 | | |
| | ヤマダ電機 | 61,180 | 4,455.00 | 272,556,900 | | |
| | アークランドサカモト | 8,200 | 1,201.00 | 9,848,200 | | |
| | ニトリホールディングス | 24,900 | 7,210.00 | 179,529,000 | | |
| | グルメ杵屋 | 9,000 | 452.00 | 4,068,000 | 貸付株式数 | 2,000 (2,000) |
| | 愛眼 | 10,000 | 340.00 | 3,400,000 | 貸付株式数 | 3,900 (3,900) |
| | 吉野家ホールディングス | 341 | 103,600.00 | 35,327,600 | 貸付株式数 | 86 |
| | 松屋フーズ | 6,000 | 1,510.00 | 9,060,000 | | |
| | サガミチェーン | 15,000 | 641.00 | 9,615,000 | 貸付株式数 | 6,000 (4,000) |

| 通貨 | 銘柄 | 株式 数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|-------------------|-----------|-----------|---------------|-------|---------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | プレナス | 14,100 | 1,529.00 | 21,558,900 | | |
| | ミニストップ | 9,300 | 1,413.00 | 13,140,900 | 貸付株式数 | 4,200 (4,200) |
| | アークス | 17,300 | 1,696.00 | 29,340,800 | | |
| | パロー | 25,000 | 1,428.00 | 35,700,000 | 貸付株式数 | 7,300 |
| | ベルク | 6,200 | 1,175.00 | 7,285,000 | | |
| | 大庄 | 5,900 | 1,032.00 | 6,088,800 | 貸付株式数 | 2,500 |
| | ファーストリテイリング | 25,200 | 16,640.00 | 419,328,000 | | |
| | サンドラッグ | 23,900 | 2,462.00 | 58,841,800 | | |
| | 東京デリカ | 4,100 | 815.00 | 3,341,500 | 貸付株式数 | 1,800 (1,200) |
| | ヤマザワ | 3,300 | 1,393.00 | 4,596,900 | | |
| | やまや | 2,100 | 1,381.00 | 2,900,100 | 貸付株式数 | 900 (900) |
| | ベルーナ | 15,650 | 600.00 | 9,390,000 | | |
| | 島根銀行 | 2,800 | 1,134.00 | 3,175,200 | 貸付株式数 | 1,200 (300) |
| | 新生銀行 | 979,000 | 99.00 | 96,921,000 | 貸付株式数 | 113,000 |
| | あおぞら銀行 | 392,000 | 197.00 | 77,224,000 | 貸付株式数 | 169,000 |
| | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 9,519,600 | 357.00 | 3,398,497,200 | | |
| | りそなホールディングス | 1,094,500 | 330.00 | 361,185,000 | | |
| | 三井住友トラスト・ホールディングス | 2,465,000 | 231.00 | 569,415,000 | | |
| | 三井住友フィナンシャルグループ | 954,800 | 2,403.00 | 2,294,384,400 | | |
| | 第四銀行 | 162,000 | 246.00 | 39,852,000 | | |
| | 北越銀行 | 129,000 | 156.00 | 20,124,000 | | |
| | 西日本シティ銀行 | 441,000 | 202.00 | 89,082,000 | | |
| | 札幌北洋ホールディングス | 189,600 | 261.00 | 49,485,600 | | |
| | 千葉銀行 | 496,000 | 469.00 | 232,624,000 | | |
| | 横浜銀行 | 808,000 | 375.00 | 303,000,000 | | |
| | 常陽銀行 | 481,000 | 339.00 | 163,059,000 | | |
| | 群馬銀行 | 284,000 | 392.00 | 111,328,000 | | |
| | 武蔵野銀行 | 20,300 | 2,552.00 | 51,805,600 | | |
| | 千葉興業銀行 | 24,100 | 403.00 | 9,712,300 | | |
| | 筑波銀行 | 52,300 | 243.00 | 12,708,900 | | |

| | | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|-------|---------|
| 東京都民銀行 | 23,800 | 886.00 | 21,086,800 | | |
| 七十七銀行 | 197,000 | 311.00 | 61,267,000 | | |
| 青森銀行 | 94,000 | 234.00 | 21,996,000 | | |
| 秋田銀行 | 86,000 | 248.00 | 21,328,000 | | |
| 山形銀行 | 77,000 | 353.00 | 27,181,000 | | |
| 岩手銀行 | 8,500 | 3,455.00 | 29,367,500 | | |
| 東邦銀行 | 106,000 | 252.00 | 26,712,000 | | |
| 東北銀行 | 68,000 | 120.00 | 8,160,000 | | |
| みちのく銀行 | 63,000 | 146.00 | 9,198,000 | | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 510,000 | 318.00 | 162,180,000 | | |
| 静岡銀行 | 379,000 | 828.00 | 313,812,000 | | |
| 十六銀行 | 158,000 | 242.00 | 38,236,000 | | |
| スルガ銀行 | 123,000 | 784.00 | 96,432,000 | | |
| 八十二銀行 | 232,000 | 415.00 | 96,280,000 | | |
| 山梨中央銀行 | 77,000 | 317.00 | 24,409,000 | | |
| 大垣共立銀行 | 168,000 | 268.00 | 45,024,000 | | |
| 福井銀行 | 108,000 | 239.00 | 25,812,000 | | |
| 北國銀行 | 146,000 | 275.00 | 40,150,000 | | |
| 清水銀行 | 4,300 | 2,830.00 | 12,169,000 | | |
| 滋賀銀行 | 118,000 | 444.00 | 52,392,000 | | |
| 南都銀行 | 117,000 | 348.00 | 40,716,000 | | |
| 百五銀行 | 114,000 | 317.00 | 36,138,000 | | |
| 京都銀行 | 225,000 | 657.00 | 147,825,000 | | |
| 三重銀行 | 52,000 | 178.00 | 9,256,000 | | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 881,000 | 134.00 | 118,054,000 | | |
| 広島銀行 | 371,000 | 309.00 | 114,639,000 | 貸付株式数 | 160,000 |
| 山陰合同銀行 | 74,000 | 556.00 | 41,144,000 | | |
| 中国銀行 | 97,000 | 1,006.00 | 97,582,000 | | |
| 鳥取銀行 | 40,000 | 150.00 | 6,000,000 | | |
| 伊予銀行 | 134,000 | 629.00 | 84,286,000 | | |
| 百十四銀行 | 138,000 | 324.00 | 44,712,000 | | |
| 四国銀行 | 91,000 | 265.00 | 24,115,000 | | |
| 阿波銀行 | 110,000 | 460.00 | 50,600,000 | | |

| | | | | | | |
|--|-------|--------|--------|------------|--|--|
| | 鹿児島銀行 | 81,000 | 467.00 | 37,827,000 | | |
| | 大分銀行 | 81,000 | 222.00 | 17,982,000 | | |
| | 宮崎銀行 | 84,000 | 193.00 | 16,212,000 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|----------------|------------|----------|---------------|-------|-------------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | 肥後銀行 | 97,000 | 430.00 | 41,710,000 | | |
| | 佐賀銀行 | 76,000 | 202.00 | 15,352,000 | | |
| | 十八銀行 | 80,000 | 204.00 | 16,320,000 | | |
| | 沖縄銀行 | 9,500 | 3,285.00 | 31,207,500 | | |
| | 琉球銀行 | 26,400 | 1,036.00 | 27,350,400 | | |
| | 八千代銀行 | 6,400 | 1,737.00 | 11,116,800 | | |
| | セブン銀行 | 471,100 | 193.00 | 90,922,300 | | |
| | みずほフィナンシャルグループ | 16,173,600 | 118.00 | 1,908,484,800 | | |
| | 紀陽ホールディングス | 501,000 | 113.00 | 56,613,000 | | |
| | 山口フィナンシャルグループ | 125,000 | 658.00 | 82,250,000 | | |
| | 長野銀行 | 41,000 | 147.00 | 6,027,000 | | |
| | 名古屋銀行 | 114,000 | 244.00 | 27,816,000 | | |
| | 愛知銀行 | 4,500 | 4,185.00 | 18,832,500 | | |
| | 第三銀行 | 71,000 | 155.00 | 11,005,000 | | |
| | 中京銀行 | 52,000 | 190.00 | 9,880,000 | | |
| | 東日本銀行 | 60,000 | 167.00 | 10,020,000 | | |
| | 大光銀行 | 45,000 | 216.00 | 9,720,000 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | 愛媛銀行 | 79,000 | 224.00 | 17,696,000 | | |
| | トマト銀行 | 49,000 | 135.00 | 6,615,000 | | |
| | みなと銀行 | 114,000 | 148.00 | 16,872,000 | | |
| | 京葉銀行 | 104,000 | 371.00 | 38,584,000 | | |
| | 関西アーバン銀行 | 175,000 | 110.00 | 19,250,000 | | |
| | 栃木銀行 | 63,000 | 274.00 | 17,262,000 | | |
| | 北日本銀行 | 3,900 | 2,008.00 | 7,831,200 | | |
| | 東和銀行 | 126,000 | 84.00 | 10,584,000 | | |
| | 福島銀行 | 146,000 | 62.00 | 9,052,000 | 貸付株式数 | 45,000 |
| | 大東銀行 | 80,000 | 64.00 | 5,120,000 | 貸付株式数 | 28,000 |
| | トモニホールディングス | 96,500 | 350.00 | 33,775,000 | | |
| | フィデアホールディングス | 72,400 | 179.00 | 12,959,600 | | |
| | 池田泉州ホールディングス | 518,900 | 108.00 | 56,041,200 | 貸付株式数 | 183,400 (183,400) |
| | S B Iホールディングス | 13,323 | 5,830.00 | 77,673,090 | | |

| | | | | | |
|--------------------------------|-----------|-----------|-------------|-------|----------------|
| 日本アジア投資 | 90,000 | 60.00 | 5,400,000 | 貸付株式数 | 38,000 |
| ジャフコ | 15,300 | 1,638.00 | 25,061,400 | | |
| 大和証券グループ本社 | 1,246,000 | 274.00 | 341,404,000 | | |
| 野村ホールディングス | 2,722,100 | 284.00 | 773,076,400 | | |
| 岡三証券グループ | 107,000 | 292.00 | 31,244,000 | | |
| 丸三証券 | 42,400 | 278.00 | 11,787,200 | | |
| 東洋証券 | 47,000 | 166.00 | 7,802,000 | | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 144,000 | 262.00 | 37,728,000 | | |
| 光世証券 | 30,000 | 75.00 | 2,250,000 | | |
| 水戸証券 | 37,000 | 181.00 | 6,697,000 | 貸付株式数 | 16,000 |
| いちよし証券 | 28,100 | 419.00 | 11,773,900 | | |
| 松井証券 | 74,600 | 442.00 | 32,973,200 | 貸付株式数 | 32,200 (1,900) |
| だいこう証券ビジネス | 7,100 | 276.00 | 1,959,600 | | |
| マネックスグループ | 948 | 14,690.00 | 13,926,120 | 貸付株式数 | 103 |
| カブドットコム証券 | 51,300 | 229.00 | 11,747,700 | | |
| 極東証券 | 16,900 | 652.00 | 11,018,800 | | |
| 岩井コスモホールディングス | 11,900 | 315.00 | 3,748,500 | | |
| 小林洋行 | 3,200 | 181.00 | 579,200 | 貸付株式数 | 1,400 |
| NK S Jホールディングス | 262,900 | 1,530.00 | 402,237,000 | | |
| M S & A D インシュアランスグループホールディングス | 375,800 | 1,389.00 | 521,986,200 | | |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 120,500 | 1,164.00 | 140,262,000 | | |
| 第一生命保険 | 6,726 | 88,700.00 | 596,596,200 | | |
| 東京海上ホールディングス | 477,400 | 1,898.00 | 906,105,200 | | |
| T & Dホールディングス | 458,300 | 784.00 | 359,307,200 | | |
| クレディセゾン | 102,700 | 1,605.00 | 164,833,500 | | |
| フィデック | 69 | 11,470.00 | 791,430 | | |
| 芙蓉総合リース | 12,000 | 2,457.00 | 29,484,000 | | |
| 興銀リース | 17,500 | 1,989.00 | 34,807,500 | | |
| 東京センチュリーリース | 33,700 | 1,557.00 | 52,470,900 | | |
| 日本証券金融 | 51,900 | 381.00 | 19,773,900 | | |
| 大阪証券金融 | 14,600 | 165.00 | 2,409,000 | 貸付株式数 | 6,400 (6,400) |
| ポケットカード | 12,600 | 353.00 | 4,447,800 | 貸付株式数 | 5,100 |
| リコーリース | 8,700 | 1,891.00 | 16,451,700 | | |

| | | | | | | | |
|--|--------------|--------|----------|------------|-------|--------|----------|
| | イオンクレジットサービス | 55,900 | 1,323.00 | 73,955,700 | 貸付株式数 | 24,200 | (8,600) |
| | アコム | 25,260 | 1,580.00 | 39,910,800 | 貸付株式数 | 10,890 | (10,890) |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|-----------------|---------|-----------|---------------|-------|----------------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | ジャックス | 76,000 | 260.00 | 19,760,000 | | |
| | オリエントコーポレーション | 243,000 | 91.00 | 22,113,000 | 貸付株式数 | 105,000 |
| | 日立キャピタル | 24,700 | 1,261.00 | 31,146,700 | | |
| | オリックス | 65,430 | 7,000.00 | 458,010,000 | 貸付株式数 | 28,320 |
| | 三菱UFJリース | 31,900 | 3,215.00 | 102,558,500 | | |
| | アサックス | 17 | 85,300.00 | 1,450,100 | 貸付株式数 | 7 |
| | NECキャピタルソリューション | 4,300 | 1,035.00 | 4,450,500 | | |
| | 日本駐車場開発 | 1,363 | 4,140.00 | 5,642,820 | | |
| | 昭栄 | 22,900 | 276.00 | 6,320,400 | 貸付株式数 | 10,000 (3,100) |
| | 東京建物不動産販売 | 4,900 | 243.00 | 1,190,700 | | |
| | 野村不動産ホールディングス | 60,300 | 1,307.00 | 78,812,100 | | |
| | 常和ホールディングス | 2,200 | 1,348.00 | 2,965,600 | | |
| | ヒューリック | 40,700 | 846.00 | 34,432,200 | 貸付株式数 | 17,400 |
| | パーク24 | 65,400 | 1,174.00 | 76,779,600 | | |
| | 三井不動産 | 558,000 | 1,330.00 | 742,140,000 | | |
| | 三菱地所 | 880,000 | 1,282.00 | 1,128,160,000 | | |
| | 平和不動産 | 119,000 | 188.00 | 22,372,000 | | |
| | 東京建物 | 240,000 | 270.00 | 64,800,000 | | |
| | ダイビル | 37,000 | 599.00 | 22,163,000 | | |
| | サンケイビル | 2,700 | 737.00 | 1,989,900 | 貸付株式数 | 700 |
| | 東急不動産 | 253,000 | 366.00 | 92,598,000 | | |
| | 京阪神ビルディング | 15,000 | 361.00 | 5,415,000 | | |
| | 住友不動産 | 301,000 | 1,743.00 | 524,643,000 | | |
| | 東宝不動産 | 13,200 | 419.00 | 5,530,800 | | |
| | 大京 | 194,000 | 185.00 | 35,890,000 | | |
| | テーオーシー | 48,700 | 449.00 | 21,866,300 | | |
| | 東京楽天地 | 21,000 | 306.00 | 6,426,000 | | |
| | レオパレス21 | 97,200 | 225.00 | 21,870,000 | 貸付株式数 | 40,200 (200) |
| | フジ住宅 | 16,000 | 399.00 | 6,384,000 | | |
| | 空港施設 | 13,000 | 346.00 | 4,498,000 | | |

| | | | | | |
|----------------|--------|------------|------------|-------|---------------|
| 明和地所 | 6,200 | 392.00 | 2,430,400 | 貸付株式数 | 2,000 |
| 住友不動産販売 | 4,530 | 3,695.00 | 16,738,350 | 貸付株式数 | 1,990 (1,990) |
| ゴールドクレスト | 11,330 | 1,252.00 | 14,185,160 | | |
| 東栄住宅 | 8,500 | 785.00 | 6,672,500 | | |
| リロ・ホールディング | 4,100 | 2,273.00 | 9,319,300 | | |
| 日本エスリード | 4,900 | 709.00 | 3,474,100 | | |
| 東急リバブル | 11,400 | 820.00 | 9,348,000 | | |
| 飯田産業 | 11,900 | 611.00 | 7,270,900 | 貸付株式数 | 3,000 |
| 日神不動産 | 7,400 | 497.00 | 3,677,800 | 貸付株式数 | 2,100 (2,100) |
| アーネストワン | 20,800 | 865.00 | 17,992,000 | | |
| タカラレーベン | 14,500 | 674.00 | 9,773,000 | | |
| サンヨーハウジング名古屋 | 65 | 76,400.00 | 4,966,000 | | |
| イオンモール | 57,300 | 1,616.00 | 92,596,800 | | |
| フージャースコーポレーション | 194 | 59,600.00 | 11,562,400 | 貸付株式数 | 87 |
| タクトホーム | 67 | 74,000.00 | 4,958,000 | 貸付株式数 | 29 |
| トーセイ | 163 | 30,850.00 | 5,028,550 | | |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 781 | 60,100.00 | 46,938,100 | | |
| サンフロンティア不動産 | 103 | 15,810.00 | 1,628,430 | 貸付株式数 | 24 |
| ランドビジネス | 85 | 15,370.00 | 1,306,450 | 貸付株式数 | 3 |
| グランディハウス | 2,700 | 544.00 | 1,468,800 | 貸付株式数 | 1,200 |
| 日本空港ビルデング | 40,100 | 1,052.00 | 42,185,200 | | |
| 日本工営 | 45,000 | 287.00 | 12,915,000 | | |
| ネクスト | 5,200 | 377.00 | 1,960,400 | 貸付株式数 | 1,800 (300) |
| 日本M&Aセンター | 5,300 | 2,406.00 | 12,751,800 | | |
| ノバレーゼ | 34 | 53,000.00 | 1,802,000 | 貸付株式数 | 11 (11) |
| アコーディア・ゴルフ | 542 | 57,000.00 | 30,894,000 | 貸付株式数 | 234 (234) |
| パソナグループ | 132 | 70,300.00 | 9,279,600 | | |
| リンクアンドモチベーション | 27 | 69,400.00 | 1,873,800 | 貸付株式数 | 11 (11) |
| エス・エム・エス | 25 | 117,600.00 | 2,940,000 | 貸付株式数 | 8 |
| テンプホールディングス | 18,100 | 806.00 | 14,588,600 | 貸付株式数 | 7,900 (5,200) |
| クックパッド | 2,600 | 2,273.00 | 5,909,800 | 貸付株式数 | 1,100 |
| 学情 | 4,300 | 401.00 | 1,724,300 | 貸付株式数 | 1,800 (1,800) |
| スタジオアリス | 6,100 | 1,349.00 | 8,228,900 | | |

| | | | | | | |
|--|--------------|--------|----------|------------|--|--|
| | シミックホールディングス | 5,000 | 1,305.00 | 6,525,000 | | |
| | NECフィールドディング | 10,800 | 989.00 | 10,681,200 | | |
| | 総合警備保障 | 48,400 | 978.00 | 47,335,200 | | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|-----|------------------|---------|------------|-------------|---------------------|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 日本円 | カカクコム | 20,700 | 2,292.00 | 47,444,400 | 貸付株式数 9,100 |
| | ルネサンス | 5,900 | 448.00 | 2,643,200 | 貸付株式数 2,500 |
| | 新日本科学 | 8,200 | 215.00 | 1,763,000 | 貸付株式数 3,700 |
| | ツクイ | 4,000 | 1,063.00 | 4,252,000 | 貸付株式数 400 (400) |
| | エムスリー | 105 | 370,000.00 | 38,850,000 | 貸付株式数 45 |
| | ベストプライダル | 29 | 87,100.00 | 2,525,900 | |
| | ディー・エヌ・エー | 59,700 | 2,072.00 | 123,698,400 | |
| | 博報堂D Yホールディングス | 16,910 | 4,855.00 | 82,098,050 | |
| | ぐるなび | 9,300 | 873.00 | 8,118,900 | |
| | 一休 | 94 | 35,150.00 | 3,304,100 | 貸付株式数 16 |
| | ジャパンベストレスキューシステム | 16 | 73,800.00 | 1,180,800 | |
| | ジェイコムホールディングス | 2,300 | 731.00 | 1,681,300 | 貸付株式数 100 (100) |
| | P G Mホールディングス | 187 | 60,000.00 | 11,220,000 | 貸付株式数 82 |
| | J Pホールディングス | 4,000 | 770.00 | 3,080,000 | 貸付株式数 600 (600) |
| | イーピーエス | 79 | 197,900.00 | 15,634,100 | |
| | アミューズ | 3,700 | 1,028.00 | 3,803,600 | |
| | ドリームインキュベータ | 42 | 81,000.00 | 3,402,000 | |
| | T A C | 7,300 | 160.00 | 1,168,000 | 貸付株式数 3,300 |
| | ケネディクス | 1,450 | 11,690.00 | 16,950,500 | |
| | 電通 | 121,100 | 2,378.00 | 287,975,800 | |
| | テイクアンドギヴ・ニーズ | 568 | 9,540.00 | 5,418,720 | 貸付株式数 235 |
| | ぴあ | 3,900 | 875.00 | 3,412,500 | 貸付株式数 1,500 (1,400) |
| | イオンファンタジー | 4,300 | 1,214.00 | 5,220,200 | |
| | ネクシィーズ | 478 | 1,874.00 | 895,772 | 貸付株式数 206 (9) |
| | みらかホールディングス | 34,700 | 3,160.00 | 109,652,000 | |
| | アルプス技研 | 5,800 | 614.00 | 3,561,200 | |
| | ダイオーズ | 2,400 | 502.00 | 1,204,800 | |
| | 日本空調サービス | 3,200 | 728.00 | 2,329,600 | |
| | オリエンタルランド | 36,000 | 8,980.00 | 323,280,000 | |
| | ダスキン | 39,300 | 1,553.00 | 61,032,900 | |

| | | | | | |
|----------------|---------|-----------|-------------|-------|-----------------|
| 明光ネットワークジャパン | 12,100 | 775.00 | 9,377,500 | | |
| ファルコSDホールディングス | 7,200 | 895.00 | 6,444,000 | | |
| 秀英予備校 | 2,400 | 306.00 | 734,400 | | |
| 田谷 | 2,000 | 672.00 | 1,344,000 | | |
| ラウンドワン | 41,500 | 478.00 | 19,837,000 | | |
| リゾートトラスト | 20,500 | 1,312.00 | 26,896,000 | | |
| ビー・エム・エル | 8,700 | 2,103.00 | 18,296,100 | | |
| ワタベウェディング | 3,900 | 706.00 | 2,753,400 | | |
| もしもしホットライン | 22,000 | 807.00 | 17,754,000 | | |
| 東急コミュニティー | 3,400 | 2,589.00 | 8,802,600 | | |
| リソー教育 | 1,350 | 5,260.00 | 7,101,000 | | |
| ウェアハウス | 2,100 | 234.00 | 491,400 | | |
| ユー・エス・エス | 17,350 | 8,400.00 | 145,740,000 | | |
| 東京個別指導学院 | 6,400 | 165.00 | 1,056,000 | 貸付株式数 | 2,700 |
| テー・オー・ダブリュー | 4,400 | 525.00 | 2,310,000 | | |
| セントラルスポーツ | 4,100 | 1,058.00 | 4,337,800 | | |
| フルキャストホールディングス | 125 | 16,200.00 | 2,025,000 | 貸付株式数 | 47 (41) |
| リゾートソリューション | 11,000 | 159.00 | 1,749,000 | 貸付株式数 | 2,000 |
| エイチ・アイ・エス | 13,600 | 2,708.00 | 36,828,800 | | |
| 共立メンテナンス | 6,600 | 1,679.00 | 11,081,400 | 貸付株式数 | 100 |
| イチネンホールディングス | 13,900 | 419.00 | 5,824,100 | 貸付株式数 | 6,300 (6,300) |
| 建設技術研究所 | 7,300 | 507.00 | 3,701,100 | | |
| 燦ホールディングス | 2,900 | 1,575.00 | 4,567,500 | | |
| スバル興業 | 9,000 | 253.00 | 2,277,000 | | |
| 東京テアトル | 51,000 | 110.00 | 5,610,000 | | |
| よみうりランド | 26,000 | 253.00 | 6,578,000 | | |
| 東京都競馬 | 102,000 | 114.00 | 11,628,000 | | |
| 常磐興産 | 41,000 | 90.00 | 3,690,000 | 貸付株式数 | 17,000 |
| カナモト | 17,000 | 841.00 | 14,297,000 | | |
| 東京ドーム | 106,000 | 245.00 | 25,970,000 | 貸付株式数 | 45,000 (45,000) |
| トランス・コスモス | 17,400 | 1,235.00 | 21,489,000 | | |
| 乃村工藝社 | 26,000 | 276.00 | 7,176,000 | | |
| 藤田観光 | 34,000 | 290.00 | 9,860,000 | | |

| | | | | | | |
|--|------|--------|----------|-----------|-------|-------|
| | 日本管財 | 4,900 | 1,485.00 | 7,276,500 | | |
| | トーカイ | 5,300 | 1,751.00 | 9,280,300 | 貸付株式数 | 100 |
| | 白洋舎 | 14,000 | 214.00 | 2,996,000 | 貸付株式数 | 5,000 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----|--------------|---------|----------|-----------------|-------|-------|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 日本円 | セコム | 129,200 | 3,560.00 | 459,952,000 | | |
| | セントラル警備保障 | 5,900 | 781.00 | 4,607,900 | | |
| | 丹青社 | 13,000 | 232.00 | 3,016,000 | | |
| | メイテック | 20,600 | 1,578.00 | 32,506,800 | 貸付株式数 | 1,000 |
| | アサツー ディ・ケイ | 21,900 | 2,269.00 | 49,691,100 | 貸付株式数 | 9,500 |
| | 応用地質 | 14,000 | 868.00 | 12,152,000 | 貸付株式数 | 500 |
| | 船井総合研究所 | 13,600 | 552.00 | 7,507,200 | | |
| | 進学会 | 6,300 | 282.00 | 1,776,600 | | |
| | ベネッセホールディングス | 41,200 | 3,750.00 | 154,500,000 | | |
| | イオンディライト | 15,000 | 1,833.00 | 27,495,000 | | |
| | ナック | 3,300 | 1,625.00 | 5,362,500 | | |
| | ニチイ学館 | 26,000 | 1,058.00 | 27,508,000 | | |
| | ダイセキ | 21,400 | 1,337.00 | 28,611,800 | 貸付株式数 | 8,600 |
| 計 | 銘柄数： | 1,661 | | 133,107,281,742 | | |
| | 組入時価比率： | 96.7% | | 100.0% | | |
| | | | | | | |
| 合計 | | | | 133,107,281,742 | | |

- (注) 1 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。
- 2 貸付株式の()内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成24年5月10日現在)

該当事項はございません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 平成24年5月10日現在 | | | |
|--------------------------------|---------------|--|---------------|-------------|
| | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | うち1年超 | | | |
| 市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建 | | | 4,389,180,000 | 435,917,990 |
| 合計 | 4,824,737,000 | | 4,389,180,000 | 435,917,990 |

(注)時価の算定方法

先物取引

先物取引の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2 「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」の状況
以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1) 貸借対照表

| 科目 | 対象年月日 | 平成24年5月10日現在 金額(円) |
|-----------------|-------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 3,211,998,377 |
| コール・ローン | | 340,543,456 |
| 株式 | | 195,552,462,627 |
| 投資信託受益証券 | | 35,634,840 |
| 投資証券 | | 4,233,507,893 |
| 派生商品評価勘定 | | 107,250 |
| 未収入金 | | 23,144,676 |
| 未収配当金 | | 468,850,401 |
| 未収利息 | | 871 |
| 差入委託証拠金 | | 602,404,461 |
| 流動資産合計 | | 204,468,654,852 |
| 資産合計 | | |
| 204,468,654,852 | | |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 85,352,533 |
| 未払金 | | 1,457,405,531 |
| 未払解約金 | | 427,001,406 |
| その他未払費用 | | 2,792,100 |
| 流動負債合計 | | 1,972,551,570 |
| 負債合計 | | |
| 1,972,551,570 | | |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 208,422,541,085 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | | 5,926,437,803 |
| 元本等合計 | | 202,496,103,282 |
| 純資産合計 | | |
| 202,496,103,282 | | |
| 負債純資産合計 | | |
| 204,468,654,852 | | |

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

| |
|---|
| <p style="text-align: center;">自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日</p> |
| <p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|---------------------------|-----------------|
| 平成24年5月10日現在 | |
| 1 元本の欠損の額 | 5,926,437,803 円 |
| 2 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 0.9716 円 |
| (10,000口当たり純資産額) | 9,716 円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 | |
|------------------------------|--|
| 1 | <p>金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> |
| 2 | <p>金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(3)附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 また、当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行なうことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> |
| 3 | <p>金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 平成24年5月10日現在 | |
|--------------|---|
| 1 | <p>貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| 2 | <p>時価の算定方法 株式、投資信託受益証券及び投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(3)附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(その他の注記)

平成24年5月10日現在

| | |
|---|-------------------|
| 1 元本の移動及び期末元本額の内訳 | |
| 期首 | 平成23年5月11日 |
| 期首元本額 | 208,899,887,092 円 |
| 期首より平成24年5月10日までの期中追加設定元本額 | 52,933,939,997 円 |
| 期首より平成24年5月10日までの期中一部解約元本額 | 53,411,286,004 円 |
| 期末元本額 | 208,422,541,085 円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 122,745,417 円 |
| バランスセレクト50 | 385,096,100 円 |
| バランスセレクト70 | 269,694,149 円 |
| 野村外国株式インデックスファンド | 615,262,608 円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 6,417,569,809 円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 34,598,204,208 円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 13,871,707,996 円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 224,037,552 円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 114,593,260 円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 124,715,694 円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 112,082,630 円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 86,079,794 円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 348,683,678 円 |
| 野村外国株インデックス(野村投資一任口座向け) | 655,759,270 円 |
| のむらップ・ファンド(保守型) | 425,150,884 円 |
| のむらップ・ファンド(普通型) | 1,813,315,717 円 |
| のむらップ・ファンド(積極型) | 2,597,819,224 円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 7,954,999 円 |
| 野村インデックスファンド・外国株式 | 380,319,727 円 |
| マイ・ロード | 117,457,018 円 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 7,822,192,157 円 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 1,373,633,951 円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 29,451,278,794 円 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 13,567,250,559 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用) | 17,960,601 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | 77,441,415 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用) | 73,562,476 円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用) | 288,664,412 円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 3,311,242,011 円 |
| 野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用) | 1,056,602,316 円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 832,204,690 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 49,617,284 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 537,717,946 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 9,210,411,987 円 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 1,250,592,008 円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 2,882,681 円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 18,860,367 円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 17,580,794 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) | 54,779,203,454 円 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 1,430,930,994 円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 5,414,942,431 円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 6,225,539,466 円 |
| マイバランスDC30 | 568,400,702 円 |
| マイバランスDC50 | 898,263,654 円 |
| マイバランスDC70 | 570,422,418 円 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI | 6,286,891,783 円 |

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(3) 附属明細表
第1 有価証券明細表

(1) 株式

(平成24年5月10日現在)

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|------------------------------|---------|--------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | BAKER HUGHES | 51,600 | 41.35 | 2,133,660.00 | |
| | CAMERON INTERNATIONAL CORP | 28,900 | 47.41 | 1,370,149.00 | |
| | DIAMOND OFFSHORE DRILLING | 8,600 | 64.38 | 553,668.00 | |
| | FMC TECHNOLOGIES INC | 27,500 | 44.33 | 1,219,075.00 | |
| | HALLIBURTON CO | 106,600 | 32.42 | 3,455,972.00 | |
| | HELMERICH & PAYNE | 12,600 | 46.99 | 592,074.00 | |
| | NABORS INDUSTRIES INC | 33,200 | 15.25 | 506,300.00 | |
| | NATIONAL OILWELL VARCO INC | 49,500 | 67.76 | 3,354,120.00 | |
| | NOBLE CORP | 31,000 | 34.62 | 1,073,220.00 | |
| | ROWAN COMPANIES INC | 14,900 | 31.97 | 476,353.00 | |
| | SCHLUMBERGER LTD | 157,100 | 69.64 | 10,940,444.00 | |
| | SUPERIOR ENERGY SERVICES INC | 18,900 | 23.88 | 451,332.00 | |
| | WEATHERFORD INTL LTD | 87,500 | 13.38 | 1,170,750.00 | |
| | ALPHA NATURAL RESOURCES INC | 24,500 | 13.93 | 341,285.00 | |
| | ANADARKO PETE | 58,200 | 68.62 | 3,993,684.00 | |
| | APACHE CORPORATION | 45,100 | 87.17 | 3,931,367.00 | |
| | ARCH COAL INC | 25,500 | 8.34 | 212,670.00 | |
| | CABOT OIL & GAS CORP | 24,300 | 35.98 | 874,314.00 | |
| | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 77,000 | 17.48 | 1,345,960.00 | |
| | CHEVRON CORP | 232,800 | 101.78 | 23,694,384.00 | |
| | CIMAREX ENERGY CO | 9,600 | 65.81 | 631,776.00 | |
| | COBALT INTERNATIONAL ENERGY | 20,700 | 22.47 | 465,129.00 | |
| | CONCHO RESOURCES INC | 11,700 | 90.07 | 1,053,819.00 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 147,800 | 53.47 | 7,902,866.00 | |
| | CONSOL ENERGY INC | 25,900 | 35.13 | 909,867.00 | |
| | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 5,500 | 76.36 | 419,980.00 | |
| | DENBURY RESOURCES INC | 47,500 | 17.12 | 813,200.00 | |
| | DEVON ENERGY CORP | 44,700 | 64.03 | 2,862,141.00 | |
| | EL PASO CORPORATION | 90,900 | 29.33 | 2,666,097.00 | |
| | ENERGEN CORP | 8,100 | 46.72 | 378,432.00 | |
| | EOG RESOURCES INC | 31,100 | 105.10 | 3,268,610.00 | |
| | EQT CORP | 17,100 | 49.89 | 853,119.00 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 560,000 | 83.31 | 46,653,600.00 | |
| | HESS CORP | 35,700 | 48.65 | 1,736,805.00 | |
| | HOLLYFRONTIER CORP | 24,900 | 30.11 | 749,739.00 | |
| | KINDER MORGAN INC | 13,400 | 34.08 | 456,672.00 | |
| | KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC | 10,465 | 71.39 | 747,096.35 | |
| | MARATHON OIL CORP | 81,900 | 26.44 | 2,165,436.00 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 41,300 | 38.21 | 1,578,073.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|--------|--------------|
| MURPHY OIL CORP | 20,800 | 49.36 | 1,026,688.00 |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 14,800 | 33.04 | 488,992.00 |
| NOBLE ENERGY INC | 20,600 | 90.13 | 1,856,678.00 |
| OCCIDENTAL PETE CORP | 94,500 | 84.28 | 7,964,460.00 |
| PEABODY ENERGY CO | 31,200 | 29.29 | 913,848.00 |
| PHILLIPS 66 | 72,950 | 32.49 | 2,370,145.50 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 12,500 | 102.19 | 1,277,375.00 |
| PLAINS EXPLORATION & PRODUCT | 17,000 | 39.00 | 663,000.00 |
| QEP RESOURCES INC | 21,600 | 30.04 | 648,864.00 |
| RANGE RESOURCES CORP | 19,100 | 67.83 | 1,295,553.00 |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 41,400 | 30.81 | 1,275,534.00 |
| SPECTRA ENERGY CORP | 76,000 | 29.82 | 2,266,320.00 |
| SUNOCO INC | 11,900 | 48.27 | 574,413.00 |
| ULTRA PETROLEUM CORP | 16,700 | 21.12 | 352,704.00 |
| VALERO ENERGY CORP | 64,700 | 22.48 | 1,454,456.00 |
| WHITING PETROLEUM CORP | 14,300 | 49.30 | 704,990.00 |
| WILLIAMS COS | 68,700 | 32.23 | 2,214,201.00 |
| AIR PRODUCTS | 24,300 | 83.48 | 2,028,564.00 |
| AIRGAS INC | 8,800 | 91.32 | 803,616.00 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 18,500 | 44.80 | 828,800.00 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 7,550 | 175.19 | 1,322,684.50 |
| DOW CHEM CO | 138,800 | 32.13 | 4,459,644.00 |
| DU PONT E I DE NEMOURS | 108,400 | 52.09 | 5,646,556.00 |
| EASTMAN CHEMICAL CO. | 15,400 | 50.14 | 772,156.00 |
| ECOLAB INC | 34,600 | 64.65 | 2,236,890.00 |
| FMC CORP | 8,400 | 105.34 | 884,856.00 |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 9,400 | 58.42 | 549,148.00 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 34,100 | 40.10 | 1,367,410.00 |
| MONSANTO CO | 62,900 | 71.90 | 4,522,510.00 |
| MOSAIC CO/THE | 35,700 | 49.49 | 1,766,793.00 |
| PPG INDUSTRIES | 18,300 | 105.94 | 1,938,702.00 |
| PRAXAIR INC | 35,200 | 112.27 | 3,951,904.00 |
| SHERWIN-WILLIAMS | 10,100 | 124.00 | 1,252,400.00 |
| SIGMA-ALDRICH | 14,300 | 69.64 | 995,852.00 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|------------------------|---------------------------------|---------|---------------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | MARTIN MARIETTA MATERIALS | 5,200 | 77.62 | 403,624.00 | |
| | VULCAN MATERIALS CO | 14,900 | 40.01 | 596,149.00 | |
| | BALL CORP | 18,600 | 40.91 | 760,926.00 | |
| | CROWN HOLDINGS INC | 17,600 | 36.44 | 641,344.00 | |
| | OWENS-ILLINOIS INC | 19,400 | 22.13 | 429,322.00 | |
| | ROCK-TENN COMPANY CL-A | 8,100 | 57.76 | 467,856.00 | |
| | SEALED AIR CORP | 20,900 | 18.15 | 379,335.00 | |
| | ALCOA INC | 126,700 | 9.15 | 1,159,305.00 | |
| | ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC | 11,900 | 39.97 | 475,643.00 | |
| | CLIFFS NATURAL RESOURCES INC | 16,400 | 56.80 | 931,520.00 | |
| | FREEMONT-MCMORAN COPPER & GOLD | 110,800 | 35.53 | 3,936,724.00 | |
| | NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO | 57,300 | 46.54 | 2,666,742.00 | |
| | NUCOR CORP | 37,300 | 37.26 | 1,389,798.00 | |
| | UNITED STATES STEEL CORP | 17,000 | 26.33 | 447,610.00 | |
| | WALTER ENERGY INC | 7,300 | 63.53 | 463,769.00 | |
| | IP(INTERNATIONAL PAPER CO) | 48,900 | 31.35 | 1,533,015.00 | |
| | MEADWESTVACO CORP | 19,100 | 27.61 | 527,351.00 | |
| | BOEING CO | 82,800 | 74.05 | 6,131,340.00 | |
| | GENERAL DYNAMICS | 35,200 | 66.40 | 2,337,280.00 | |
| | GOODRICH BF | 14,600 | 124.85 | 1,822,810.00 | |
| | HONEYWELL INTERNATIONAL | 86,200 | 58.37 | 5,031,494.00 | |
| | L-3 COMMUNICATIONS HLDGS | 11,200 | 70.46 | 789,152.00 | |
| | LOCKHEED MARTIN | 32,000 | 85.95 | 2,750,400.00 | |
| | NORTHROP GRUMMAN CORP | 28,700 | 60.68 | 1,741,516.00 | |
| | PRECISION CASTPARTS CORP | 16,680 | 169.24 | 2,822,923.20 | |
| | RAYTHEON COMPANY | 39,900 | 52.66 | 2,101,134.00 | |
| | ROCKWELL COLLINS INC | 17,200 | 53.07 | 912,804.00 | |
| | TEXTRON INC | 32,700 | 24.19 | 791,013.00 | |
| | UNITED TECHNOLOGIES | 100,100 | 77.01 | 7,708,701.00 | |
| | MASCO CORP | 41,900 | 14.01 | 587,019.00 | |
| | FLUOR CORP | 19,500 | 54.42 | 1,061,190.00 | |
| | JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 14,700 | 39.29 | 577,563.00 | |
| | KBR INC | 16,500 | 30.09 | 496,485.00 | |
| | QUANTA SERVICES INC | 23,600 | 23.11 | 545,396.00 | |
| | URS CORP | 9,000 | 39.77 | 357,930.00 | |
| | AMETEK INC | 19,000 | 50.16 | 953,040.00 | |
| | COOPER INDUSTRIES PLC-CL A | 18,100 | 60.84 | 1,101,204.00 | |
| | EMERSON ELEC | 85,900 | 48.16 | 4,136,944.00 | |
| | ROCKWELL AUTOMATION INC | 16,800 | 77.55 | 1,302,840.00 | |
| | ROPER INDUSTRIES | 11,200 | 100.83 | 1,129,296.00 | |
| 3M CORP | 78,000 | 87.27 | 6,807,060.00 | | |
| DANAHER CORP | 67,600 | 53.86 | 3,640,936.00 | | |
| GENERAL ELEC CO | 1,234,100 | 18.91 | 23,336,831.00 | | |
| TYCO INTERNATIONAL LTD | 53,400 | 54.91 | 2,932,194.00 | | |
| AGCO CORP | 11,000 | 43.24 | 475,640.00 | | |

| | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|--------------|
| CATERPILLAR INC DEL | 75,200 | 95.99 | 7,218,448.00 |
| CUMMINS INC | 21,200 | 106.74 | 2,262,888.00 |
| DEERE & COMPANY | 48,700 | 79.05 | 3,849,735.00 |
| DOVER CORP | 21,900 | 58.29 | 1,276,551.00 |
| EATON CORP | 37,600 | 45.07 | 1,694,632.00 |
| FLOWSERVE CORP | 6,800 | 111.01 | 754,868.00 |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 50,300 | 55.78 | 2,805,734.00 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 36,000 | 44.54 | 1,603,440.00 |
| JOY GLOBAL INC | 12,500 | 64.68 | 808,500.00 |
| PACCAR | 37,100 | 40.48 | 1,501,808.00 |
| PALL CORP | 13,800 | 57.65 | 795,570.00 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 17,500 | 85.54 | 1,496,950.00 |
| PENTAIR INC | 11,300 | 42.66 | 482,058.00 |
| SPX CORP | 5,800 | 77.14 | 447,412.00 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 18,500 | 71.24 | 1,317,940.00 |
| XYLEM INC | 20,000 | 26.13 | 522,600.00 |
| FASTENAL CO | 33,100 | 43.14 | 1,427,934.00 |
| GRAINGER(W.W.) INC | 7,050 | 201.76 | 1,422,408.00 |
| AVERY DENNISON CORP | 11,400 | 30.78 | 350,892.00 |
| CINTAS CORP | 13,900 | 38.56 | 535,984.00 |
| IRON MOUNTAIN INC | 15,500 | 30.99 | 480,345.00 |
| PITNEY BOWES INC. | 25,100 | 15.25 | 382,775.00 |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A | 33,700 | 26.49 | 892,713.00 |
| STERICYCLE INC | 9,200 | 83.19 | 765,348.00 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 50,600 | 33.79 | 1,709,774.00 |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC | 19,600 | 60.67 | 1,189,132.00 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC | 24,300 | 38.61 | 938,223.00 |
| FEDEX CORPORATION | 34,900 | 87.13 | 3,040,837.00 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 84,800 | 77.15 | 6,542,320.00 |
| DELTA AIR LINES INC | 23,778 | 10.91 | 259,417.98 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 19,900 | 8.20 | 163,180.00 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|---------------------------------|---------|--------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 9,100 | 23.47 | 213,577.00 | |
| | CSX CORP | 122,200 | 21.66 | 2,646,852.00 | |
| | HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC | 32,400 | 14.90 | 482,760.00 | |
| | HUNT J B TRANSPORT SVCS INC | 11,000 | 55.50 | 610,500.00 | |
| | KANSAS CITY SOUTHERN | 12,800 | 73.76 | 944,128.00 | |
| | NORFOLK SOUTHERN CORP | 41,500 | 68.39 | 2,838,185.00 | |
| | UNION PAC CORP | 56,600 | 111.89 | 6,332,974.00 | |
| | AUTOLIV INC | 10,400 | 59.89 | 622,856.00 | |
| | BORGWARNER INC | 13,100 | 77.25 | 1,011,975.00 | |
| | GOODYEAR TIRE & RUBR | 29,200 | 10.41 | 303,972.00 | |
| | JOHNSON CONTROLS INC | 80,300 | 31.61 | 2,538,283.00 | |
| | TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP | 12,000 | 42.43 | 509,160.00 | |
| | FORD MOTOR COMPANY | 416,100 | 10.69 | 4,448,109.00 | |
| | GENERAL MOTORS CO | 91,200 | 22.44 | 2,046,528.00 | |
| | HARLEY-DAVIDSON INC | 27,400 | 50.48 | 1,383,152.00 | |
| | DR HORTON INC | 31,300 | 17.23 | 539,299.00 | |
| | GARMIN LTD | 13,400 | 45.38 | 608,092.00 | |
| | LEGGETT & PLATT INC | 17,100 | 20.73 | 354,483.00 | |
| | MOHAWK INDUSTRIES | 6,600 | 71.95 | 474,870.00 | |
| | NEWELL RUBBERMAID INC | 34,100 | 18.27 | 623,007.00 | |
| | TOLL BROTHERS INC | 17,300 | 26.96 | 466,408.00 | |
| | WHIRLPOOL CORP | 9,300 | 61.11 | 568,323.00 | |
| | HASBRO INC | 14,300 | 35.34 | 505,362.00 | |
| | MATTEL INC | 39,000 | 32.09 | 1,251,510.00 | |
| | COACH INC | 34,300 | 69.58 | 2,386,594.00 | |
| | FOSSIL INC | 6,100 | 78.78 | 480,558.00 | |
| | LULULEMON ATHLETICA INC | 11,800 | 74.06 | 873,908.00 | |
| | NIKE INC-B | 41,200 | 108.15 | 4,455,780.00 | |
| | RALPH LAUREN CORPORATION | 7,230 | 160.94 | 1,163,596.20 | |
| | V F CORP | 10,500 | 139.97 | 1,469,685.00 | |
| | CARNIVAL CORP | 51,600 | 31.34 | 1,617,144.00 | |
| | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 3,610 | 401.78 | 1,450,425.80 | |
| | DARDEN RESTAURANTS INC | 15,000 | 50.18 | 752,700.00 | |
| | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY | 33,200 | 14.87 | 493,684.00 | |
| | LAS VEGAS SANDS CORP | 42,600 | 51.45 | 2,191,770.00 | |
| | MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA | 30,800 | 39.18 | 1,206,744.00 | |
| | MCDONALD'S CORP | 119,700 | 91.93 | 11,004,021.00 | |
| | MGM RESORTS INTERNATIONAL | 41,900 | 11.65 | 488,135.00 | |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 16,500 | 26.11 | 430,815.00 | |
| | STARBUCKS CORP | 87,500 | 54.10 | 4,733,750.00 | |
| | STARWOOD HOTELS & RESORTS | 22,900 | 57.04 | 1,306,216.00 | |
| | WYNN RESORTS LTD | 9,300 | 115.37 | 1,072,941.00 | |
| | YUM BRANDS INC | 53,400 | 70.44 | 3,761,496.00 | |
| | CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 25,100 | 12.53 | 314,503.00 | |
| | CBS CORP-CL B | 70,500 | 32.94 | 2,322,270.00 | |

| | | | |
|---------------------------------|---------|--------|--------------|
| COMCAST CORP SPECIAL CL-A | 75,000 | 28.85 | 2,163,750.00 |
| COMCAST CORP-CL A | 243,300 | 29.17 | 7,097,061.00 |
| DIRECTV | 82,300 | 47.64 | 3,920,772.00 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC | 16,300 | 50.47 | 822,661.00 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 13,100 | 47.22 | 618,582.00 |
| DISH NETWORK CORP-A | 23,600 | 30.29 | 714,844.00 |
| DISNEY (WALT) CO | 199,900 | 45.02 | 8,999,498.00 |
| INTERPUBRIC GROUP | 56,600 | 11.38 | 644,108.00 |
| LIBERTY GLOBAL INC | 16,700 | 49.16 | 820,972.00 |
| LIBERTY GLOBAL INC -SERIES C | 12,800 | 47.26 | 604,928.00 |
| LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A | 12,900 | 86.86 | 1,120,494.00 |
| MCGRAW-HILL COMPANIES | 34,800 | 47.22 | 1,643,256.00 |
| NEWS CORP-CLASS B | 52,000 | 19.60 | 1,019,200.00 |
| NEWS CORP-INC CL A | 201,000 | 19.38 | 3,895,380.00 |
| OMNICOM GROUP | 32,500 | 50.65 | 1,646,125.00 |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A | 10,900 | 54.77 | 596,993.00 |
| SIRIUS XM RADIO INC | 442,800 | 2.18 | 965,304.00 |
| TIME WARNER CABLE-A | 36,900 | 77.05 | 2,843,145.00 |
| TIME WARNER INC | 116,900 | 35.64 | 4,166,316.00 |
| VIACOM INC-CLASS B | 58,300 | 47.11 | 2,746,513.00 |
| VIRGIN MEDIA INC | 32,500 | 22.45 | 729,625.00 |
| WASHINGTON POST-CL B | 560 | 338.93 | 189,800.80 |
| GENUINE PARTS CO | 17,700 | 64.54 | 1,142,358.00 |
| AMAZON.COM INC | 42,600 | 222.98 | 9,498,948.00 |
| EXPEDIA INC | 11,700 | 41.14 | 481,338.00 |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP | 66,200 | 18.32 | 1,212,784.00 |
| NETFLIX INC | 6,200 | 74.35 | 460,970.00 |
| PRICELINE.COM INC | 5,770 | 718.95 | 4,148,341.50 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 21,800 | 46.84 | 1,021,112.00 |
| DOLLAR TREE INC | 13,700 | 101.87 | 1,395,619.00 |
| FAMILY DOLLAR STORES | 11,200 | 68.80 | 770,560.00 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|------------------------------|---------|--------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | J.C.PENNEY COMPANY INC | 18,800 | 33.71 | 633,748.00 | |
| | KOHL'S CORP | 27,800 | 50.86 | 1,413,908.00 | |
| | MACYS INC | 48,400 | 38.05 | 1,841,620.00 | |
| | NORDSTROM INC | 19,300 | 53.92 | 1,040,656.00 | |
| | SEARS HOLDINGS CORP | 5,400 | 54.97 | 296,838.00 | |
| | TARGET CORP | 74,500 | 55.28 | 4,118,360.00 | |
| | ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A | 10,400 | 46.86 | 487,344.00 | |
| | ADVANCE AUTO PARTS | 8,400 | 88.61 | 744,324.00 | |
| | AUTOZONE | 2,740 | 382.88 | 1,049,091.20 | |
| | BED BATH & BEYOND | 28,900 | 68.02 | 1,965,778.00 | |
| | BEST BUY COMPANY INC | 34,700 | 20.10 | 697,470.00 | |
| | CARMAX INC | 26,600 | 29.42 | 782,572.00 | |
| | GAMESTOP CORP-CLASS A | 15,000 | 20.91 | 313,650.00 | |
| | GAP INC | 36,200 | 27.91 | 1,010,342.00 | |
| | HOME DEPOT | 180,500 | 50.11 | 9,044,855.00 | |
| | LIMITED BRANDS | 29,200 | 48.46 | 1,415,032.00 | |
| | LOWES COS INC | 148,000 | 30.34 | 4,490,320.00 | |
| | OREILLY AUTOMOTIVE INC, | 14,800 | 102.39 | 1,515,372.00 | |
| | PETSMART | 13,400 | 56.59 | 758,306.00 | |
| | ROSS STORES INC | 26,700 | 61.17 | 1,633,239.00 | |
| | STAPLES INC | 80,500 | 14.93 | 1,201,865.00 | |
| | TIFFANY & CO | 14,100 | 64.14 | 904,374.00 | |
| | TJX COS INC | 87,900 | 41.27 | 3,627,633.00 | |
| | URBAN OUTFITTERS INC | 14,800 | 27.84 | 412,032.00 | |
| | COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 50,300 | 82.62 | 4,155,786.00 | |
| | CVS CAREMARK CORP | 152,600 | 45.23 | 6,902,098.00 | |
| | KROGER CO | 66,800 | 22.80 | 1,523,040.00 | |
| | SAFEWAY INC | 41,300 | 19.09 | 788,417.00 | |
| | SYSCO CORP | 69,100 | 27.72 | 1,915,452.00 | |
| | WAL-MART STORES INC | 221,800 | 59.03 | 13,092,854.00 | |
| | WALGREEN | 102,400 | 33.93 | 3,474,432.00 | |
| | WHOLE FOODS MARKET INC | 17,900 | 88.10 | 1,576,990.00 | |
| | BEAM INC | 16,400 | 58.43 | 958,252.00 | |
| | BROWN-FORMAN CORP-CL B | 10,000 | 85.78 | 857,800.00 | |
| | COCA COLA CO | 239,000 | 76.78 | 18,350,420.00 | |
| | COCA COLA ENTERPRISES | 35,700 | 29.07 | 1,037,799.00 | |
| | CONSTELLATION BRANDS INC-A | 19,800 | 20.28 | 401,544.00 | |
| | DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 25,300 | 40.95 | 1,036,035.00 | |
| | MOLSON COORS BREWING CO-B | 17,800 | 40.98 | 729,444.00 | |
| | MONSTER BEVERAGE CORP | 17,700 | 65.31 | 1,155,987.00 | |
| | PEPSICO INC | 182,900 | 65.94 | 12,060,426.00 | |
| | ARCHER DANIELS MIDLAND | 77,700 | 32.66 | 2,537,682.00 | |
| | BUNGE LIMITED | 16,700 | 64.76 | 1,081,492.00 | |
| | CAMPBELL SOUP CO | 21,600 | 34.03 | 735,048.00 | |
| | CONAGRA INC | 49,400 | 25.54 | 1,261,676.00 | |
| | GENERAL MILLS | 74,400 | 38.91 | 2,894,904.00 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE | 15,200 | 26.27 | 399,304.00 | |
| HEINZ HJ CO. | 37,400 | 53.94 | 2,017,356.00 | |
| HERSHEY CO/THE | 19,600 | 67.94 | 1,331,624.00 | |
| HORMEL FOODS CORP | 16,700 | 29.29 | 489,143.00 | |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 13,000 | 75.79 | 985,270.00 | |
| KELLOGG CO | 29,800 | 50.76 | 1,512,648.00 | |
| KRAFT FOODS INC-A | 195,200 | 38.87 | 7,587,424.00 | |
| MCCORMICK & CO INC. | 14,200 | 56.31 | 799,602.00 | |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO | 23,400 | 82.77 | 1,936,818.00 | |
| RALCORP HOLDINGS INC | 6,500 | 71.50 | 464,750.00 | |
| SARA LEE CO | 64,800 | 21.63 | 1,401,624.00 | |
| TYSON FOODS INC-CL A | 36,800 | 19.50 | 717,600.00 | |
| ALTRIA GROUP INC | 240,900 | 31.75 | 7,648,575.00 | |
| LORILLARD INC | 15,700 | 127.49 | 2,001,593.00 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 203,100 | 85.64 | 17,393,484.00 | |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 40,500 | 40.04 | 1,621,620.00 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 16,300 | 53.03 | 864,389.00 | |
| CLOROX CO | 14,900 | 68.36 | 1,018,564.00 | |
| COLGATE PALMOLIVE CO. | 56,800 | 99.08 | 5,627,744.00 | |
| ENERGIZER HOLDINGS INC | 7,800 | 74.14 | 578,292.00 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 45,900 | 79.54 | 3,650,886.00 | |
| PROCTER & GAMBLE CO | 321,700 | 63.67 | 20,482,639.00 | |
| AVON PRODUCTS INC | 50,900 | 21.60 | 1,099,440.00 | |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 27,000 | 59.22 | 1,598,940.00 | |
| HERBALIFE LTD | 13,800 | 47.17 | 650,946.00 | |
| BARD (C R) | 9,700 | 100.42 | 974,074.00 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC. | 65,400 | 54.26 | 3,548,604.00 | |
| BECTON,DICKINSON | 25,300 | 76.02 | 1,923,306.00 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 168,500 | 6.17 | 1,039,645.00 | |
| CAREFUSION CORP | 25,400 | 25.95 | 659,130.00 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|---------------------------------------|---------|--------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | COVIDIEN PLC | 56,200 | 54.23 | 3,047,726.00 | |
| | DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 17,400 | 38.90 | 676,860.00 | |
| | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 13,600 | 85.45 | 1,162,120.00 | |
| | HOLOGIC INC | 30,100 | 17.01 | 512,001.00 | |
| | INTUITIVE SURGICAL INC | 4,570 | 549.59 | 2,511,626.30 | |
| | MEDTRONIC INC | 122,600 | 38.03 | 4,662,478.00 | |
| | ST JUDE MEDICAL INC | 36,900 | 39.23 | 1,447,587.00 | |
| | STRYKER CORP | 33,900 | 53.25 | 1,805,175.00 | |
| | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 12,800 | 63.70 | 815,360.00 | |
| | ZIMMER HOLDINGS INC | 20,600 | 62.08 | 1,278,848.00 | |
| | AETNA INC | 42,000 | 42.08 | 1,767,360.00 | |
| | AMERISOURCEBERGEN CORP | 29,700 | 36.01 | 1,069,497.00 | |
| | CARDINAL HEALTH INC | 40,100 | 42.23 | 1,693,423.00 | |
| | CIGNA CORP | 33,900 | 44.99 | 1,525,161.00 | |
| | COVENTRY HEALTH CARE INC | 17,000 | 29.98 | 509,660.00 | |
| | DAVITA INC | 11,200 | 85.51 | 957,712.00 | |
| | EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON | 93,800 | 53.90 | 5,055,820.00 | |
| | HCA HOLDINGS INC | 20,200 | 26.44 | 534,088.00 | |
| | HENRY SCHEIN INC | 10,600 | 76.56 | 811,536.00 | |
| | HUMANA INC | 19,400 | 79.11 | 1,534,734.00 | |
| | LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 11,200 | 85.88 | 961,856.00 | |
| | MCKESSON CORP | 28,500 | 89.46 | 2,549,610.00 | |
| | OMNICARE INC | 13,100 | 34.22 | 448,282.00 | |
| | PATTERSON COS INC | 11,100 | 33.69 | 373,959.00 | |
| | QUEST DIAGNOSTICS INC | 18,200 | 57.17 | 1,040,494.00 | |
| | UNITEDHEALTH GROUP INC | 124,900 | 55.22 | 6,896,978.00 | |
| | WELLPOINT INC | 40,500 | 65.77 | 2,663,685.00 | |
| | ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 21,500 | 84.34 | 1,813,310.00 | |
| | AMGEN INC | 92,200 | 69.62 | 6,418,964.00 | |
| | BIOGEN IDEC INC | 26,700 | 132.51 | 3,538,017.00 | |
| | CELGENE CORP | 51,800 | 70.42 | 3,647,756.00 | |
| | GILEAD SCIENCES INC | 87,700 | 50.64 | 4,441,128.00 | |
| | VERTEX PHARMACEUTICALS | 25,100 | 60.35 | 1,514,785.00 | |
| | ABBOTT LABS | 182,300 | 61.23 | 11,162,229.00 | |
| | ALLERGAN INC | 35,500 | 92.63 | 3,288,365.00 | |
| | BRISTOL MYERS SQUIBB | 198,600 | 32.81 | 6,516,066.00 | |
| | ELI LILLY & CO. | 122,300 | 41.30 | 5,050,990.00 | |
| | FOREST LABS INC. | 30,600 | 33.95 | 1,038,870.00 | |
| | HOSPIRA INC | 18,700 | 33.90 | 633,930.00 | |
| | JOHNSON & JOHNSON | 319,300 | 64.28 | 20,524,604.00 | |
| | MERCK & CO INC | 356,600 | 38.09 | 13,582,894.00 | |
| | MYLAN INC | 49,000 | 20.64 | 1,011,360.00 | |
| | PERRIGO CO. | 9,900 | 99.08 | 980,892.00 | |
| | PFIZER INC | 898,700 | 22.45 | 20,175,815.00 | |
| | WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A | 16,900 | 21.61 | 365,209.00 | |

| | | | |
|---------------------------------|-----------|--------|---------------|
| WATSON PHARMACEUTICALS INC | 14,500 | 72.44 | 1,050,380.00 |
| BB&T CORPORATION | 81,500 | 31.23 | 2,545,245.00 |
| CIT GROUP INC | 22,700 | 36.84 | 836,268.00 |
| COMERICA INC | 24,300 | 31.37 | 762,291.00 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 106,100 | 13.99 | 1,484,339.00 |
| KEYCORP | 112,500 | 7.87 | 885,375.00 |
| M & T BANK CORP | 13,500 | 84.54 | 1,141,290.00 |
| PNC FINANCIAL | 61,800 | 64.63 | 3,994,134.00 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 168,800 | 6.56 | 1,107,328.00 |
| SUNTRUST BKS INC. | 61,600 | 23.08 | 1,421,728.00 |
| US BANCORP | 223,700 | 31.47 | 7,039,839.00 |
| WELLS FARGO CO | 585,800 | 32.63 | 19,114,654.00 |
| BANK OF AMERICA CORP | 1,186,900 | 7.73 | 9,174,737.00 |
| CITIGROUP | 342,200 | 30.45 | 10,419,990.00 |
| CME GROUP INC | 7,410 | 260.00 | 1,926,600.00 |
| INTERCONTINENTALEXCHANGE INC | 8,500 | 124.92 | 1,061,820.00 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 444,300 | 40.64 | 18,056,352.00 |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 24,000 | 23.69 | 568,560.00 |
| MOODYS CORP | 22,500 | 38.35 | 862,875.00 |
| NASDAQ OMX GROUP/THE | 14,600 | 24.06 | 351,276.00 |
| NYSE EURONEXT | 30,500 | 25.55 | 779,275.00 |
| ACE LTD | 39,000 | 75.27 | 2,935,530.00 |
| AFLAC INC | 55,100 | 42.77 | 2,356,627.00 |
| ALLEGHANY CORP | 1,500 | 339.30 | 508,950.00 |
| ALLSTATE CORP | 59,800 | 34.31 | 2,051,738.00 |
| AMERICAN INTL GROUP | 70,600 | 31.83 | 2,247,198.00 |
| AON PLC | 34,200 | 48.09 | 1,644,678.00 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 15,700 | 38.58 | 605,706.00 |
| ASSURANT INC | 10,100 | 37.68 | 380,568.00 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 14,200 | 34.36 | 487,912.00 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 106,200 | 81.43 | 8,647,866.00 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|---------------------------------|---------|--------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | CHUBB CORP | 32,300 | 72.89 | 2,354,347.00 | |
| | CINCINNATI FINANCIAL CORP | 18,000 | 35.74 | 643,320.00 | |
| | EVEREST RE GROUP LTD | 6,000 | 102.29 | 613,740.00 | |
| | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC | 23,900 | 19.25 | 460,075.00 | |
| | GENWORTH FINANCIAL INC-CL A | 55,900 | 5.61 | 313,599.00 | |
| | HARTFORD FINANCIAL SERVICES | 48,700 | 19.72 | 960,364.00 | |
| | LINCOLN NATIONAL CORP | 34,400 | 22.89 | 787,416.00 | |
| | LOEWS CORP | 37,500 | 40.76 | 1,528,500.00 | |
| | MARSH & MCLENNAN COS | 63,600 | 33.36 | 2,121,696.00 | |
| | METLIFE INC | 124,200 | 33.92 | 4,212,864.00 | |
| | PARTNERRE LTD | 7,800 | 72.97 | 569,166.00 | |
| | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 34,900 | 25.41 | 886,809.00 | |
| | PROGRESSIVE CO | 67,600 | 21.95 | 1,483,820.00 | |
| | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 54,800 | 51.06 | 2,798,088.00 | |
| | RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 6,000 | 79.06 | 474,360.00 | |
| | TORCHMARK CORP | 12,000 | 47.61 | 571,320.00 | |
| | TRAVELERS COS INC/THE | 48,100 | 63.92 | 3,074,552.00 | |
| | UNUM GROUP | 35,200 | 21.78 | 766,656.00 | |
| | WILLIS GROUP HOLDINGS PLC | 19,300 | 36.20 | 698,660.00 | |
| | WR BERKLEY CORP | 14,600 | 38.60 | 563,560.00 | |
| | XL GROUP PLC | 36,500 | 22.25 | 812,125.00 | |
| | CBRE GROUP INC | 34,200 | 17.33 | 592,686.00 | |
| | AKAMAI TECHNOLOGIES | 20,400 | 31.93 | 651,372.00 | |
| | EBAY INC | 136,300 | 40.56 | 5,528,328.00 | |
| | GOOGLE INC-CL A | 29,940 | 609.15 | 18,237,951.00 | |
| | VERISIGN INC | 18,000 | 40.50 | 729,000.00 | |
| | YAHOO! INC | 139,300 | 15.30 | 2,131,290.00 | |
| | ACCENTURE PLC-CL A | 74,400 | 59.22 | 4,405,968.00 | |
| | ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 6,000 | 124.65 | 747,900.00 | |
| | AUTOMATIC DATA PROCESS | 57,500 | 53.28 | 3,063,600.00 | |
| | COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 35,500 | 60.59 | 2,150,945.00 | |
| | COMPUTER SCIENCE | 18,100 | 27.18 | 491,958.00 | |
| | FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 27,000 | 32.24 | 870,480.00 | |
| | FISERV INC | 16,100 | 66.28 | 1,067,108.00 | |
| | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 137,750 | 201.23 | 27,719,432.50 | |
| | MASTERCARD INC-CLASS A | 12,810 | 422.83 | 5,416,452.30 | |
| | PAYCHEX INC | 37,500 | 29.91 | 1,121,625.00 | |
| | SAIC INC | 31,900 | 11.20 | 357,280.00 | |
| | TERADATA CORP | 19,100 | 72.35 | 1,381,885.00 | |
| | TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 20,700 | 22.84 | 472,788.00 | |
| | VISA INC-CLASS A SHARES | 61,100 | 117.42 | 7,174,362.00 | |
| | WESTERN UNION CO | 71,300 | 17.21 | 1,227,073.00 | |
| | ACTIVISION BLIZZARD INC | 58,500 | 12.40 | 725,400.00 | |
| | ADOBE SYSTEMS INC. | 58,100 | 32.52 | 1,889,412.00 | |
| | AUTODESK INC. | 25,600 | 36.80 | 942,080.00 | |

| | | | |
|----------------------------|---------|--------|---------------|
| BMC SOFTWARE | 19,100 | 39.71 | 758,461.00 |
| CA INC | 45,100 | 26.35 | 1,188,385.00 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 22,100 | 81.86 | 1,809,106.00 |
| ELECTRONIC ARTS | 39,800 | 14.12 | 561,976.00 |
| INTUIT INC | 33,500 | 56.52 | 1,893,420.00 |
| MICROSOFT CORP | 884,900 | 30.76 | 27,219,524.00 |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 28,800 | 23.40 | 673,920.00 |
| ORACLE CORPORATION | 472,100 | 27.78 | 13,114,938.00 |
| RED HAT INC | 22,900 | 57.90 | 1,325,910.00 |
| SALESFORCE.COM INC | 15,000 | 148.98 | 2,234,700.00 |
| SYMANTEC CORP | 87,300 | 15.82 | 1,381,086.00 |
| SYNOPSYS INC | 16,900 | 29.12 | 492,128.00 |
| VMWARE INC - CLASS A | 9,700 | 105.33 | 1,021,701.00 |
| CISCO SYSTEMS | 629,100 | 18.78 | 11,814,498.00 |
| F5 NETWORKS INC | 9,500 | 129.39 | 1,229,205.00 |
| HARRIS CORP | 13,000 | 41.40 | 538,200.00 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 62,700 | 19.01 | 1,191,927.00 |
| MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS | 32,500 | 39.32 | 1,277,900.00 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 32,000 | 49.71 | 1,590,720.00 |
| QUALCOMM INC | 196,700 | 62.01 | 12,197,367.00 |
| APPLE INC | 108,570 | 569.18 | 61,795,872.60 |
| DELL INC | 187,200 | 15.67 | 2,933,424.00 |
| EMC CORP | 239,100 | 27.47 | 6,568,077.00 |
| HEWLETT PACKARD CO | 233,100 | 23.33 | 5,438,223.00 |
| NETAPP INC | 42,900 | 37.78 | 1,620,762.00 |
| SAN DISK CORPORATION | 28,500 | 36.01 | 1,026,285.00 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 49,200 | 30.57 | 1,504,044.00 |
| WESTERN DIGITAL | 27,300 | 39.95 | 1,090,635.00 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 19,000 | 54.75 | 1,040,250.00 |
| ARROW ELECTRS INC | 13,100 | 37.31 | 488,761.00 |
| AVNET | 17,800 | 33.87 | 602,886.00 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|------------------------------|---------|-------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | CORNING INC | 185,400 | 13.38 | 2,480,652.00 | |
| | DOLBY LABORATORIES INC-CL A | 5,800 | 44.50 | 258,100.00 | |
| | FLEXTRONICS INTL LTD | 79,100 | 6.66 | 526,806.00 | |
| | FLIR SYSTEMS INC | 17,300 | 21.55 | 372,815.00 | |
| | TE CONNECTIVITY LTD | 48,800 | 33.81 | 1,649,928.00 | |
| | XEROX CORP | 162,600 | 7.64 | 1,242,264.00 | |
| | ADVANCED MICRO DEVICES | 65,800 | 6.86 | 451,388.00 | |
| | ALTERA CORP. | 38,100 | 33.63 | 1,281,303.00 | |
| | ANALOG DEVICES INC | 35,200 | 37.09 | 1,305,568.00 | |
| | APPLIED MATERIALS | 153,500 | 11.08 | 1,700,780.00 | |
| | AVAGO TECHNOLOGIES LTD | 26,500 | 31.07 | 823,355.00 | |
| | BROADCOM CORP-CL A | 56,100 | 33.64 | 1,887,204.00 | |
| | CREE INC | 12,100 | 32.66 | 395,186.00 | |
| | FIRST SOLAR INC | 6,700 | 16.92 | 113,364.00 | |
| | INTEL CORP | 595,500 | 27.19 | 16,191,645.00 | |
| | KLA TENCOR CORP | 18,800 | 50.03 | 940,564.00 | |
| | LAM RESEARCH | 14,600 | 40.57 | 592,322.00 | |
| | LINEAR TECHNOLOGY CORP | 26,900 | 30.87 | 830,403.00 | |
| | LSI CORP | 63,100 | 7.74 | 488,394.00 | |
| | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 61,500 | 13.66 | 840,090.00 | |
| | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 32,900 | 27.06 | 890,274.00 | |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY | 21,800 | 32.00 | 697,600.00 | |
| | MICRON TECHNOLOGY | 106,300 | 6.36 | 676,068.00 | |
| | NVIDIA CORP | 71,600 | 12.51 | 895,716.00 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 133,500 | 30.60 | 4,085,100.00 | |
| | XILINX INC | 29,900 | 33.80 | 1,010,620.00 | |
| | AT & T INC | 692,800 | 32.81 | 22,730,768.00 | |
| | CENTURYLINK INC | 72,800 | 38.12 | 2,775,136.00 | |
| | FRONTIER COMMUNICATIONS CO | 111,200 | 3.35 | 372,520.00 | |
| | LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 17,100 | 24.60 | 420,660.00 | |
| | VERIZON COMMUNICATIONS | 331,200 | 40.25 | 13,330,800.00 | |
| | WINDSTREAM CORP | 66,000 | 11.26 | 743,160.00 | |
| | CROWN CASTLE INTL CORP | 33,300 | 55.37 | 1,843,821.00 | |
| | METROPCS COMMUNICATIONS INC | 30,300 | 7.50 | 227,250.00 | |
| | NII HOLDINGS INC | 22,000 | 12.61 | 277,420.00 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 13,200 | 53.23 | 702,636.00 | |
| | SPRINT NEXTEL CORP | 346,300 | 2.40 | 831,120.00 | |
| | AMERICAN ELECTRIC POWER | 56,300 | 38.22 | 2,151,786.00 | |
| | DUKE ENERGY CORP | 156,000 | 21.60 | 3,369,600.00 | |
| | EDISON INTERNATIONAL | 35,900 | 43.96 | 1,578,164.00 | |
| | ENTERGY CORP | 20,300 | 64.32 | 1,305,696.00 | |
| | EXELON CORPORATION | 100,100 | 38.32 | 3,835,832.00 | |
| | FIRSTENERGY CORP | 48,800 | 47.11 | 2,298,968.00 | |
| | NEXTERA ENERGY INC | 46,400 | 64.15 | 2,976,560.00 | |
| | NORTHEAST UTILITIES | 36,706 | 36.18 | 1,328,023.08 | |
| | PEPCO HOLDINGS INC | 26,500 | 18.86 | 499,790.00 | |

| | | | |
|--|---------|-------|--------------|
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 12,500 | 48.06 | 600,750.00 |
| PPL CORPORATION | 67,300 | 27.45 | 1,847,385.00 |
| PROGRESS ENERGY INC | 34,300 | 54.66 | 1,874,838.00 |
| SOUTHERN CO. | 100,700 | 45.37 | 4,568,759.00 |
| ONEOK INC | 11,200 | 85.25 | 954,800.00 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 13,700 | 43.90 | 601,430.00 |
| AMEREN CORPORATION | 28,500 | 32.53 | 927,105.00 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 45,800 | 19.77 | 905,466.00 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 34,100 | 59.47 | 2,027,927.00 |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 66,700 | 51.67 | 3,446,389.00 |
| DTE ENERGY COMPANY | 20,100 | 55.58 | 1,117,158.00 |
| INTEGRYS ENERGY GROUP INC | 8,600 | 53.41 | 459,326.00 |
| MDU RESOURCES GROUP INC | 23,100 | 22.79 | 526,449.00 |
| NISOURCE INC | 32,500 | 24.94 | 810,550.00 |
| PG&E CORP | 46,900 | 44.11 | 2,068,759.00 |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE | 58,900 | 31.51 | 1,855,939.00 |
| SCANA CORP | 14,100 | 45.81 | 645,921.00 |
| SEMPRA ENERGY | 26,300 | 64.19 | 1,688,197.00 |
| WISCONSIN ENERGY CORP | 26,100 | 36.70 | 957,870.00 |
| XCEL ENERGY INC | 55,600 | 27.18 | 1,511,208.00 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 20,700 | 34.03 | 704,421.00 |
| HUDSON CITY BANCORP INC | 53,400 | 6.64 | 354,576.00 |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 51,300 | 12.85 | 659,205.00 |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL IN AMERICAN EXPRESS CO | 40,300 | 12.01 | 484,003.00 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 122,500 | 59.46 | 7,283,850.00 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 58,000 | 53.53 | 3,104,740.00 |
| SLM CORPORATION | 63,600 | 33.38 | 2,122,968.00 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 57,800 | 13.86 | 801,108.00 |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP | 26,100 | 50.60 | 1,320,660.00 |
| | 141,300 | 22.19 | 3,135,447.00 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----------------------------|--------------------------------|---------|--------------|-------------------|------------------|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | BLACKROCK INC | 12,120 | 180.27 | 2,184,872.40 | |
| | EATON VANCE CORP | 13,500 | 25.36 | 342,360.00 | |
| | FRANKLIN RESOURCES INC | 18,000 | 114.79 | 2,066,220.00 | |
| | GOLDMAN SACHS GROUP | 54,800 | 107.29 | 5,879,492.00 | |
| | INVESCO LTD | 52,200 | 23.23 | 1,212,606.00 | |
| | LEGG MASON INC | 14,600 | 23.39 | 341,494.00 | |
| | MORGAN STANLEY | 167,400 | 15.49 | 2,593,026.00 | |
| | NORTHERN TRUST CORP | 24,600 | 45.16 | 1,110,936.00 | |
| | SCHWAB(CHARLES)CORP | 124,900 | 13.15 | 1,642,435.00 | |
| | SEI INVESTMENTS COMPANY | 18,300 | 18.93 | 346,419.00 | |
| | STATE STREET CORP | 57,200 | 43.66 | 2,497,352.00 | |
| | T ROWE PRICE GROUP INC | 29,100 | 59.73 | 1,738,143.00 | |
| | TD AMERITRADE HOLDING CORP | 26,200 | 17.81 | 466,622.00 | |
| | APOLLO GROUP-A | 13,100 | 33.25 | 435,575.00 | |
| | H & R BLOCK INC | 34,300 | 14.52 | 498,036.00 | |
| | AES CORP | 78,700 | 12.03 | 946,761.00 | |
| | CALPINE CORP | 36,800 | 18.19 | 669,392.00 | |
| | NRG ENERGY INC | 28,200 | 15.42 | 434,844.00 | |
| | CERNER CORP | 17,000 | 78.90 | 1,341,300.00 | |
| | AGILENT TECHNOLOGIES INC | 41,100 | 39.93 | 1,641,123.00 | |
| | COVANCE INC | 7,500 | 45.51 | 341,325.00 | |
| | ILLUMINA INC | 13,600 | 44.71 | 608,056.00 | |
| | LIFE TECHNOLOGIES CORP | 20,800 | 44.03 | 915,824.00 | |
| | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 44,600 | 53.34 | 2,378,964.00 | |
| | WATERS CORP | 10,800 | 84.35 | 910,980.00 | |
| | DUN & BRADSTREET CORP | 5,700 | 63.34 | 361,038.00 | |
| | EQUIFAX INC | 14,900 | 45.38 | 676,162.00 | |
| | IHS INC-CLASS A | 4,800 | 96.03 | 460,944.00 | |
| | MANPOWER GROUP | 9,500 | 38.50 | 365,750.00 | |
| | NIELSEN HOLDINGS NV | 15,600 | 28.94 | 451,464.00 | |
| | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 16,500 | 28.71 | 473,715.00 | |
| | VERISK ANALYTICS INC-CLASS A | 15,700 | 48.19 | 756,583.00 | |
| | 計 | 銘柄数：561 | | | 1,444,136,221.21 |
| | | | | (115,126,539,554) | |
| | 組入時価比率：56.9% | | | 59.0% | |
| カナダドル | PRECISION DRILLING CORP | 24,900 | 8.41 | 209,409.00 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 34,300 | 19.66 | 674,338.00 | |
| | ATHABASCA OIL SANDS CORP | 36,600 | 10.75 | 393,450.00 | |
| | BAYTEX ENERGY CORP | 14,100 | 49.57 | 698,937.00 | |
| | BONAVISTA ENERGY CORP | 17,000 | 18.15 | 308,550.00 | |
| | CAMECO CORP | 47,200 | 21.71 | 1,024,712.00 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 128,600 | 30.68 | 3,945,448.00 | |
| | CANADIAN OIL SANDS LTD | 56,900 | 21.53 | 1,225,057.00 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 88,800 | 32.55 | 2,890,440.00 | |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 33,000 | 40.92 | 1,350,360.00 | | |

| | | | |
|------------------------------|---------|-------|--------------|
| ENBRIDGE INC | 86,200 | 39.77 | 3,428,174.00 |
| ENCANA CORP | 85,600 | 22.28 | 1,907,168.00 |
| ENERPLUS CORP | 23,500 | 16.82 | 395,270.00 |
| HUSKY ENERGY INC | 39,200 | 24.33 | 953,736.00 |
| IMPERIAL OIL | 34,500 | 43.44 | 1,498,680.00 |
| MEG ENERGY CORP | 14,400 | 39.60 | 570,240.00 |
| NEXEN INC | 62,600 | 16.81 | 1,052,306.00 |
| NIKO RESOURCES LTD | 5,500 | 38.52 | 211,860.00 |
| PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP | 30,300 | 28.17 | 853,551.00 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 33,000 | 30.35 | 1,001,550.00 |
| PENGROWTH ENERGY CORP | 43,200 | 8.41 | 363,312.00 |
| PENN WEST PETROLEUM LTD | 53,700 | 14.80 | 794,760.00 |
| PROGRESS ENERGY RESOURCES CO | 23,300 | 11.31 | 263,523.00 |
| SUNCOR ENERGY INC | 182,900 | 29.07 | 5,316,903.00 |
| TALISMAN ENERGY | 119,900 | 11.17 | 1,339,283.00 |
| TOURMALINE OIL CORP | 15,500 | 24.72 | 383,160.00 |
| TRANSCANADA CORP | 82,700 | 42.81 | 3,540,387.00 |
| VERMILION ENERGY INC | 10,400 | 45.96 | 477,984.00 |
| AGRIUM INC | 18,200 | 82.99 | 1,510,418.00 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 100,600 | 41.62 | 4,186,972.00 |
| AGNICO EAGLE MINES | 19,500 | 38.24 | 745,680.00 |
| BARRICK GOLD | 116,100 | 37.65 | 4,371,165.00 |
| CENTERRA GOLD INC | 18,900 | 10.21 | 192,969.00 |
| ELDORADO GOLD CORPORATION | 76,700 | 11.84 | 908,128.00 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 56,700 | 18.19 | 1,031,373.00 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 15,000 | 42.83 | 642,450.00 |
| GOLDCORP INC | 95,200 | 35.60 | 3,389,120.00 |
| IAMGOLD CORP | 44,000 | 10.80 | 475,200.00 |
| INMET MINING CORPORATION | 6,000 | 46.43 | 278,580.00 |
| IVANHOE MINES LTD | 32,500 | 9.82 | 319,150.00 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|------------------------------|---------------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| カナダドル | KINROSS GOLD CORP | 131,300 | 7.67 | 1,007,071.00 | |
| | NEW GOLD INC | 48,300 | 8.69 | 419,727.00 | |
| | OSISKO MINING CORP | 38,100 | 8.39 | 319,659.00 | |
| | PAN AMERICAN SILVER CORP | 19,400 | 16.88 | 327,472.00 | |
| | SILVER WHEATON CORP | 41,600 | 26.94 | 1,120,704.00 | |
| | TECK RESOURCES LTD | 67,100 | 33.24 | 2,230,404.00 | |
| | YAMANA GOLD INC | 87,800 | 13.75 | 1,207,250.00 | |
| | SINO-FOREST CORP | 28,000 | | | |
| | BOMBARDIER B SHEARS | 164,400 | 3.69 | 606,636.00 | |
| | CAE INC | 32,500 | 10.12 | 328,900.00 | |
| | SNC-LAVALIN GROUP INC | 17,500 | 36.73 | 642,775.00 | |
| | FINNING INTERNATIONAL INC | 20,000 | 25.83 | 516,600.00 | |
| | RITCHIE BROS. AUCTIONEERS | 12,100 | 20.82 | 251,922.00 | |
| | CANADIAN NATL RAILWAY CO | 51,900 | 80.82 | 4,194,558.00 | |
| | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 19,700 | 73.25 | 1,443,025.00 | |
| | MAGNA INTERNATIONAL INC | 24,200 | 42.68 | 1,032,856.00 | |
| | GILDAN ACTIVEWEAR INC | 14,400 | 25.87 | 372,528.00 | |
| | TIM HORTONS INC | 18,700 | 55.83 | 1,044,021.00 | |
| | SHAW COMMUNICATIONS-B | 43,900 | 19.50 | 856,050.00 | |
| | THOMSON REUTERS CORP | 42,800 | 29.64 | 1,268,592.00 | |
| | CANADIAN TIRE CORP LTD A | 9,200 | 67.42 | 620,264.00 | |
| | ALIMENTATION COUCHE-TARD-B | 14,300 | 42.39 | 606,177.00 | |
| | EMPIRE CO LTD A | 3,800 | 56.57 | 214,966.00 | |
| | LOBLAW COMPANIES | 13,100 | 32.46 | 425,226.00 | |
| | METRO INC | 12,100 | 53.45 | 646,745.00 | |
| | SHOPPERS DRUG MART CORP | 25,000 | 41.29 | 1,032,250.00 | |
| | WESTON(GEORGE)LTD | 5,900 | 59.28 | 349,752.00 | |
| | SAPUTO INC | 16,400 | 43.72 | 717,008.00 | |
| | VITERRA INC | 41,700 | 15.98 | 666,366.00 | |
| | VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 33,200 | 52.33 | 1,737,356.00 | |
| | BANK OF MONTREAL | 75,100 | 56.01 | 4,206,351.00 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX | 126,700 | 52.56 | 6,659,352.00 | |
| | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 47,100 | 72.82 | 3,429,822.00 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 19,100 | 74.45 | 1,421,995.00 | |
| | ROYAL BANK OF CANADA | 168,400 | 53.37 | 8,987,508.00 | |
| | TORONTO DOMINION BANK | 105,700 | 79.61 | 8,414,777.00 | |
| | ONEX CORP | 10,900 | 38.53 | 419,977.00 | |
| | TMX GROUP INC | 9,100 | 47.00 | 427,700.00 | |
| | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 2,250 | 411.41 | 925,672.50 | |
| | GREAT-WEST LIFECO INC | 32,200 | 22.06 | 710,332.00 | |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 9,600 | 29.38 | 282,048.00 | | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 15,300 | 64.50 | 986,850.00 | | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 207,400 | 12.19 | 2,528,206.00 | | |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 40,200 | 24.41 | 981,282.00 | | |

| | | | | | |
|------|------------------------------|-----------|-------|------------------|--|
| | POWER FINANCIAL CORP | 29,500 | 26.95 | 795,025.00 | |
| | SUN LIFE FINANCIAL INC | 67,100 | 22.13 | 1,484,923.00 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 66,100 | 32.30 | 2,135,030.00 | |
| | BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES | 29,100 | 18.25 | 531,075.00 | |
| | OPEN TEXT CORP | 6,900 | 50.30 | 347,070.00 | |
| | CGI GROUP INC - CLASS A | 25,500 | 21.29 | 542,895.00 | |
| | RESEARCH IN MOTION | 53,200 | 11.94 | 635,208.00 | |
| | BCE INC | 29,600 | 40.33 | 1,193,768.00 | |
| | BELL ALIANT INC | 9,500 | 26.11 | 248,045.00 | |
| | TELUS CORP | 5,500 | 58.13 | 319,715.00 | |
| | TELUS CORPORATION-NON VOTE | 19,000 | 56.15 | 1,066,850.00 | |
| | ROGERS COMMUNICATIONS-CL B | 46,100 | 35.68 | 1,644,848.00 | |
| | FORTIS INC | 22,500 | 33.79 | 760,275.00 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD A | 10,500 | 71.59 | 751,695.00 | |
| | CI FINANCIAL CORP | 18,100 | 22.38 | 405,078.00 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 14,000 | 43.97 | 615,580.00 | |
| | TRANSALTA CORP | 23,200 | 16.40 | 380,480.00 | |
| 計 | 銘柄数：101 | | | 135,570,045.50 | |
| | | | | (10,791,375,621) | |
| | 組入時価比率：5.3% | | | 5.5% | |
| | | | | | |
| 英ポンド | AMEC PLC | 38,500 | 10.17 | 391,545.00 | |
| | PETROFAC LTD | 31,200 | 15.74 | 491,088.00 | |
| | BG GROUP PLC | 395,000 | 13.14 | 5,190,300.00 | |
| | BP PLC | 2,218,100 | 4.04 | 8,961,124.00 | |
| | ESSAR ENERGY PLC | 35,700 | 1.23 | 44,089.50 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 425,900 | 20.47 | 8,718,173.00 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B | 311,600 | 21.22 | 6,612,152.00 | |
| | TULLOW OIL PLC | 105,700 | 14.44 | 1,526,308.00 | |
| | JOHNSON MATTHEY | 25,700 | 22.46 | 577,222.00 | |
| | REXAM PLC | 102,200 | 4.02 | 411,661.60 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 153,800 | 21.78 | 3,350,533.00 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|------------------------------|-----------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 英ポンド | ANTOFAGASTA PLC | 46,700 | 10.49 | 489,883.00 | |
| | BHP BILLITON PLC | 245,600 | 18.64 | 4,577,984.00 | |
| | EURASIAN NATURAL RESOURCES | 30,900 | 5.23 | 161,761.50 | |
| | FRESNILLO PLC | 21,100 | 13.76 | 290,336.00 | |
| | GLENCORE INTERNATIONAL | 162,500 | 3.97 | 646,668.75 | |
| | KAZAKHMYS PLC | 26,400 | 7.59 | 200,376.00 | |
| | LONMIN PLC | 18,300 | 9.40 | 172,111.50 | |
| | RANDGOLD RESOURCES LTD | 11,000 | 48.07 | 528,770.00 | |
| | RIO TINTO PLC-REG | 160,700 | 31.27 | 5,025,089.00 | |
| | VEDANTA RESOURCES PLC | 13,400 | 10.89 | 145,926.00 | |
| | XSTRATA PLC | 244,500 | 10.97 | 2,682,165.00 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 375,600 | 2.79 | 1,047,924.00 | |
| | COBHAM PLC | 131,200 | 2.21 | 289,952.00 | |
| | MEGGITT PLC | 88,700 | 3.86 | 342,825.50 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 216,500 | 8.45 | 1,829,425.00 | |
| | BALFOUR BEATTY PLC | 76,500 | 2.68 | 205,479.00 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 46,600 | 10.30 | 479,980.00 | |
| | INVENSYS PLC | 98,700 | 2.00 | 197,400.00 | |
| | WEIR GROUP PLC | 24,200 | 15.14 | 366,388.00 | |
| | BUNZLE | 37,100 | 10.11 | 375,081.00 | |
| | WOLSELEY PLC | 33,400 | 22.16 | 740,144.00 | |
| | AGGREKO PLC | 31,500 | 21.57 | 679,455.00 | |
| | BABCOCK INTL GROUP PLC | 44,500 | 8.16 | 363,342.50 | |
| | G4S PLC | 167,100 | 2.62 | 439,138.80 | |
| | SERCO GROUP PLC | 54,900 | 5.50 | 301,950.00 | |
| | GKN PLC | 175,000 | 1.89 | 330,925.00 | |
| | BURBERRY GROUP PLC | 52,000 | 14.62 | 760,240.00 | |
| | CARNIVAL PLC | 20,300 | 19.44 | 394,632.00 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 221,500 | 6.36 | 1,409,847.50 | |
| | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 33,600 | 14.75 | 495,600.00 | |
| | TUI TRAVEL PLC | 50,000 | 1.83 | 91,600.00 | |
| | WHITBREAD PLC | 20,200 | 19.34 | 390,668.00 | |
| | BRITISH SKY BROADCASTING PLC | 135,200 | 6.83 | 924,092.00 | |
| | ITV PLC | 421,000 | 0.82 | 347,325.00 | |
| | PEARSON | 94,500 | 11.63 | 1,099,035.00 | |
| | REED ELSEVIER PLC | 140,700 | 5.12 | 720,384.00 | |
| | WPP PLC | 148,900 | 8.08 | 1,203,856.50 | |
| | MARKS & SPENCER PLC | 185,000 | 3.46 | 641,025.00 | |
| | NEXT PLC | 20,700 | 29.69 | 614,583.00 | |
| | KINGFISHER PLC | 281,600 | 2.85 | 803,686.40 | |
| MORRISON SUPERMARKETS | 249,100 | 2.74 | 684,526.80 | | |
| SAINSBURY | 144,600 | 3.05 | 441,463.80 | | |
| TESCO PLC | 941,200 | 3.20 | 3,016,546.00 | | |
| DIAGEO PLC | 290,500 | 15.57 | 4,523,085.00 | | |
| SABMILLER PLC | 112,000 | 24.84 | 2,782,640.00 | | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 41,300 | 12.10 | 499,730.00 | | |

| | | | |
|----------------------------------|-----------|-------|---------------|
| TATE & LYLE ORD. | 53,500 | 6.92 | 370,220.00 |
| UNILEVER PLC | 150,600 | 20.78 | 3,129,468.00 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 230,500 | 31.19 | 7,189,295.00 |
| IMPERIAL TABACCO GROUP | 117,000 | 25.33 | 2,963,610.00 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 72,300 | 35.66 | 2,578,218.00 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 105,700 | 6.11 | 646,355.50 |
| ASTRAZENECA PLC | 152,700 | 26.90 | 4,107,630.00 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 590,600 | 14.10 | 8,327,460.00 |
| SHIRE PLC | 65,700 | 19.91 | 1,308,087.00 |
| BARCLAYS PLC | 1,360,500 | 2.02 | 2,752,971.75 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 2,089,300 | 5.51 | 11,516,221.60 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 4,823,000 | 0.29 | 1,442,559.30 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 2,097,000 | 0.22 | 474,551.10 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 276,900 | 13.73 | 3,803,221.50 |
| LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC | 17,800 | 9.84 | 175,241.00 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 22,100 | 11.50 | 254,150.00 |
| AVIVA PLC | 343,000 | 2.97 | 1,021,797.00 |
| LEGAL & GENERAL | 672,900 | 1.11 | 748,937.70 |
| OLD MUTUAL PLC | 558,862 | 1.43 | 804,202.41 |
| PRUDENTIAL PLC | 295,200 | 7.10 | 2,095,920.00 |
| RESOLUTION LTD | 155,500 | 2.11 | 329,504.50 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 399,700 | 1.03 | 412,890.10 |
| STANDARD LIFE PLC | 271,500 | 2.07 | 564,177.00 |
| SAGE GROUP PLC (THE) | 153,000 | 2.63 | 402,390.00 |
| ARM HOLDINGS PLC | 153,900 | 4.87 | 750,262.50 |
| BT GROUP PLC | 899,600 | 2.17 | 1,953,931.20 |
| INMARSAT PLC | 48,300 | 4.68 | 226,285.50 |
| VODAFONE GROUP PLC | 5,879,800 | 1.71 | 10,057,397.90 |
| SSE PLC | 109,400 | 13.24 | 1,448,456.00 |
| CENTRICA PLC | 598,400 | 3.11 | 1,864,614.40 |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|--------|-------------------------------------|---------|-----------|------------------|----------------|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 英ポンド | NATIONAL GRID PLC | 418,000 | 6.72 | 2,811,050.00 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 27,300 | 16.46 | 449,358.00 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 78,800 | 6.31 | 497,622.00 | |
| | 3I GROUP PLC | 118,200 | 1.84 | 217,724.40 | |
| | ICAP PLC | 67,900 | 3.45 | 234,798.20 | |
| | INVESTEC PLC | 64,200 | 3.39 | 217,702.20 | |
| | MAN GROUP PLC | 204,700 | 0.84 | 172,766.80 | |
| | SCHRODERS PLC | 12,800 | 12.98 | 166,144.00 | |
| | INTERNATIONAL POWER | 180,500 | 4.17 | 753,768.00 | |
| | CAPITA PLC | 73,300 | 6.61 | 484,879.50 | |
| | EXPERIAN PLC | 116,800 | 9.51 | 1,110,768.00 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 18,700 | 24.23 | 453,101.00 | |
| | 計 | 銘柄数：99 | | | 162,318,950.71 |
| | | | | (20,887,202,577) | |
| | 組入時価比率：10.3% | | | 10.7% | |
| スイスフラン | TRANSOCEAN LTD | 40,370 | 43.16 | 1,742,369.20 | |
| | GIVAUDAN-REG | 1,000 | 880.00 | 880,000.00 | |
| | SIKA AG-BR | 250 | 1,825.00 | 456,250.00 | |
| | SYNGENTA AG | 11,040 | 312.00 | 3,444,480.00 | |
| | HOLCIM LTD-REG | 28,240 | 54.20 | 1,530,608.00 | |
| | GEBERIT AG-REG | 4,630 | 189.50 | 877,385.00 | |
| | ABB LTD | 257,400 | 15.98 | 4,113,252.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 2,410 | 111.20 | 267,992.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 5,530 | 112.30 | 621,019.00 | |
| | SULZER AG-REG | 2,880 | 121.60 | 350,208.00 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 6,180 | 105.30 | 650,754.00 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A | 60,910 | 54.85 | 3,340,913.50 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 3,570 | 407.50 | 1,454,775.00 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 5,000 | 70.60 | 353,000.00 | |
| | ARYZTA AG | 10,420 | 44.75 | 466,295.00 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG | 180 | 852.00 | 153,360.00 | |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 97 | 2,906.00 | 281,882.00 | |
| | LINDT&SPRUENGLI AG-REG | 13 | 34,485.00 | 448,305.00 | |
| | NESTLE SA-REG | 385,760 | 54.90 | 21,178,224.00 | |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 5,810 | 96.80 | 562,408.00 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 860 | 147.80 | 127,108.00 | |
| | SYNTHES INC | 7,560 | 156.70 | 1,184,652.00 | |
| | ACTELION LTD | 13,440 | 37.69 | 506,553.60 | |
| | NOVARTIS-REG | 272,980 | 49.42 | 13,490,671.60 | |
| | ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE) | 82,180 | 157.00 | 12,902,260.00 | |
| | PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES | 3,430 | 56.85 | 194,995.50 | |
| | BALOISE HOLDING AG | 5,530 | 64.45 | 356,408.50 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 3,410 | 85.80 | 292,578.00 | |
| | SWISS RE LTD | 40,710 | 57.00 | 2,320,470.00 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 17,210 | 217.80 | 3,748,338.00 | |

| | | | | | |
|----------------|----------------------------|---------|----------|-----------------|--|
| | SWISSCOM AG-REG | 2,760 | 361.20 | 996,912.00 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 132,260 | 19.32 | 2,555,263.20 | |
| | GAM HOLDING AG | 21,540 | 10.65 | 229,401.00 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 24,830 | 32.98 | 818,893.40 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,410 | 160.60 | 226,446.00 | |
| | UBS AG-REG | 422,890 | 11.05 | 4,672,934.50 | |
| | LONZA AG-REG | 5,350 | 39.89 | 213,411.50 | |
| | ADECCO SA-REG | 15,540 | 38.84 | 603,573.60 | |
| | SGS SA-REG | 621 | 1,717.00 | 1,066,257.00 | |
| 計 | 銘柄数：39 | | | 89,680,607.10 | |
| | | | | (7,706,254,568) | |
| | 組入時価比率：3.8% | | | 3.9% | |
| | | | | | |
| スウェーデン クローナ | LUNDIN PETROLEUM AB | 25,500 | 141.50 | 3,608,250.00 | |
| | BOLIDEN AB | 30,000 | 98.60 | 2,958,000.00 | |
| | SSAB AB-A SHARES | 19,400 | 63.50 | 1,231,900.00 | |
| | HOLMEN AB-B SHARES | 7,100 | 183.80 | 1,304,980.00 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB-B | 66,500 | 105.00 | 6,982,500.00 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 37,200 | 192.50 | 7,161,000.00 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 48,300 | 109.30 | 5,279,190.00 | |
| | ALFA LAVAL AB | 40,200 | 129.60 | 5,209,920.00 | |
| | ATLAS COPCO AB-A | 78,300 | 149.50 | 11,705,850.00 | |
| | ATLAS COPCO AB-B | 45,600 | 132.20 | 6,028,320.00 | |
| | SANDVIK AB | 115,400 | 96.35 | 11,118,790.00 | |
| | SCANIA AB-B | 37,900 | 125.50 | 4,756,450.00 | |
| | SKF AB-B SHARES | 46,400 | 148.20 | 6,876,480.00 | |
| | VOLVO AB-B | 162,200 | 85.80 | 13,916,760.00 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 36,600 | 52.65 | 1,926,990.00 | |
| | ELECTROLUX AB-B | 27,800 | 137.60 | 3,825,280.00 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 49,500 | 35.71 | 1,767,645.00 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----------------|--|---------|--------------|-----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| スウェーデン クローナ | MODERN TIMES GROUP-B SHS | 5,500 | 312.60 | 1,719,300.00 | |
| | HENNES&MAURITZ AB-B | 120,200 | 223.30 | 26,840,660.00 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 25,100 | 268.30 | 6,734,330.00 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 23,000 | 180.20 | 4,144,600.00 | |
| | NORDEA BANK AB | 304,300 | 57.05 | 17,360,315.00 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 165,300 | 43.38 | 7,170,714.00 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A | 56,800 | 218.10 | 12,388,080.00 | |
| | SWEDBANK AB | 94,100 | 107.60 | 10,125,160.00 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 15,600 | 91.60 | 1,428,960.00 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 52,600 | 131.30 | 6,906,380.00 | |
| | KINNEVIK INVESTMENT AB-B | 23,700 | 126.50 | 2,998,050.00 | |
| | ERICSSON LM-B | 354,400 | 62.35 | 22,096,840.00 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 30,300 | 125.40 | 3,799,620.00 | |
| | TELE 2 AB-B SHS | 36,600 | 115.00 | 4,209,000.00 | |
| | TELIA AB | 252,100 | 46.19 | 11,644,499.00 | |
| | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR | 8,700 | 666.00 | 5,794,200.00 | |
| RATOS AB-B SHS | 20,900 | 70.05 | 1,464,045.00 | | |
| 計 | 銘柄数：34 | | | 242,483,058.00 | |
| | | | | (2,810,378,642) | |
| | 組入時価比率：1.4% | | | 1.4% | |
| ノルウェー クローネ | AKER SOLUTIONS ASA | 17,600 | 86.45 | 1,521,520.00 | |
| | SEADRILL LTD | 38,700 | 208.50 | 8,068,950.00 | |
| | SUBSEA 7 SA | 32,900 | 135.40 | 4,454,660.00 | |
| | STATOIL ASA | 131,300 | 148.60 | 19,511,180.00 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 21,400 | 261.40 | 5,593,960.00 | |
| | NORSK HYDRO | 109,700 | 25.50 | 2,797,350.00 | |
| | ORKLA ASA | 91,700 | 39.86 | 3,655,162.00 | |
| | DNB ASA | 113,300 | 58.20 | 6,594,060.00 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 24,900 | 68.15 | 1,696,935.00 | |
| | TELENOR ASA | 82,500 | 105.70 | 8,720,250.00 | |
| 計 | 銘柄数：10 | | | 62,614,027.00 | |
| | | | | (855,933,749) | |
| | 組入時価比率：0.4% | | | 0.4% | |
| デンマーク クローネ | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 27,100 | 147.70 | 4,002,670.00 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 26,700 | 42.94 | 1,146,498.00 | |
| | A P MOLLER - MAERSK A/S-A | 64 | 39,520.00 | 2,529,280.00 | |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S | 155 | 41,400.00 | 6,417,000.00 | |
| | DSV A/S | 21,000 | 122.00 | 2,562,000.00 | |
| | CARLSBERG B | 12,100 | 490.00 | 5,929,000.00 | |
| | COLOPLAST-B | 2,500 | 1,027.00 | 2,567,500.00 | |
| | WILLIAM DEMANT HOLDING | 2,830 | 520.00 | 1,471,600.00 | |

| | | | | | |
|-----|-----------------------------|---------|--------|-----------------|--|
| | NOVO NORDISK A/S-B | 49,800 | 826.00 | 41,134,800.00 | |
| | DANSKE BANK AS | 75,500 | 88.40 | 6,674,200.00 | |
| | TRYG A/S | 3,260 | 325.10 | 1,059,826.00 | |
| | TDC A/S | 54,900 | 40.30 | 2,212,470.00 | |
| 計 | 銘柄数：12 | | | 77,706,844.00 | |
| | | | | (1,078,570,994) | |
| | 組入時価比率：0.5% | | | 0.6% | |
| | | | | | |
| ユ一ロ | CIE GENERALE GEOPHYSIQUE | 17,030 | 19.44 | 331,063.20 | |
| | FUGRO NV CVA | 7,800 | 50.25 | 391,950.00 | |
| | SAIPEM | 30,400 | 33.62 | 1,022,048.00 | |
| | SBM OFFSHORE NV | 20,100 | 12.10 | 243,210.00 | |
| | TECHNIP SA | 11,400 | 77.01 | 877,914.00 | |
| | TENARIS SA | 56,500 | 13.84 | 781,960.00 | |
| | ENI SPA | 279,400 | 16.56 | 4,626,864.00 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 26,500 | 10.68 | 283,152.50 | |
| | NESTE OIL OYJ | 14,100 | 8.03 | 113,293.50 | |
| | OMV AG | 19,100 | 24.00 | 458,400.00 | |
| | REPSOL YPF SA | 92,800 | 13.13 | 1,218,464.00 | |
| | TOTAL SA | 248,400 | 34.48 | 8,566,074.00 | |
| | AIR LIQUIDE | 33,300 | 97.00 | 3,230,100.00 | |
| | AKZO NOBEL | 27,600 | 38.37 | 1,059,012.00 | |
| | ARKEMA | 6,600 | 65.30 | 430,980.00 | |
| | BASF SE | 107,600 | 57.57 | 6,194,532.00 | |
| | K+S AG | 19,800 | 36.35 | 719,829.00 | |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 18,200 | 42.24 | 768,768.00 | |
| | LANXESS | 9,700 | 61.83 | 599,751.00 | |
| | LINDE AG | 19,910 | 123.45 | 2,457,889.50 | |
| | SOLVAY SA | 6,900 | 94.42 | 651,498.00 | |
| | WACKER CHEMIE AG | 1,890 | 61.00 | 115,290.00 | |
| | CIMPOR CIMENTOS DE PORTUGAL | 24,400 | 5.51 | 134,444.00 | |
| | CRH PLC | 84,500 | 14.29 | 1,207,505.00 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------------------------------|----------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| ユ-口 | HEIDELBERGCEMENT AG | 16,560 | 37.87 | 627,210.00 | |
| | IMERYS | 3,970 | 38.30 | 152,070.85 | |
| | LAFARGE SA | 23,790 | 30.02 | 714,294.75 | |
| | ACERINOX SA | 10,000 | 8.61 | 86,170.00 | |
| | ARCELORMITTAL | 100,200 | 12.40 | 1,242,981.00 | |
| | SALZGITTER AG | 4,630 | 36.46 | 168,832.95 | |
| | THYSSENKRUPP AG | 44,600 | 16.37 | 730,325.00 | |
| | UMICORE | 13,800 | 38.20 | 527,160.00 | |
| | VOESTALPINE AG | 12,300 | 22.99 | 282,777.00 | |
| | STORA ENSO OYJ-R | 65,200 | 4.83 | 315,176.80 | |
| | UPM-KYMMENE OYJ | 61,700 | 9.15 | 564,555.00 | |
| | EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE | 48,400 | 29.09 | 1,407,956.00 | |
| | FINMECCANICA SPA | 49,300 | 2.82 | 139,420.40 | |
| | SAFRAN SA | 18,800 | 27.32 | 513,616.00 | |
| | THALES (EX THOMSON-CSF) | 11,530 | 25.16 | 290,152.45 | |
| | COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD) | 46,900 | 30.90 | 1,449,444.50 | |
| | ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV | 16,760 | 13.10 | 219,556.00 | |
| | BOSKALIS WESTMINSTER-CVA | 8,400 | 26.88 | 225,834.00 | |
| | BOUYGUES | 21,800 | 21.36 | 465,757.00 | |
| | EIFFAGE | 4,940 | 27.70 | 136,838.00 | |
| | FERROVIAL SA | 44,240 | 8.45 | 374,137.68 | |
| | FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA | 7,190 | 12.24 | 88,041.55 | |
| | HOCHTIEF AG | 5,140 | 42.92 | 220,608.80 | |
| | VINCI | 53,300 | 34.75 | 1,852,175.00 | |
| | ALSTOM | 24,350 | 24.54 | 597,670.75 | |
| | BEKAERT NV | 4,300 | 23.66 | 101,738.00 | |
| | LEGRAND SA | 26,420 | 25.76 | 680,579.20 | |
| | PRYSMIAN SPA | 23,000 | 11.63 | 267,490.00 | |
| | SCHNEIDER SA | 57,100 | 44.49 | 2,540,379.00 | |
| | PHILIPS ELECTRONICS NV | 116,500 | 14.32 | 1,668,862.50 | |
| | SIEMENS AG | 96,400 | 66.90 | 6,449,160.00 | |
| | WENDEL | 3,970 | 57.55 | 228,473.50 | |
| | FIAT INDUSTRIAL | 89,100 | 7.85 | 699,435.00 | |
| | GEA GROUP AG | 20,570 | 21.66 | 445,546.20 | |
| | KONE OYJ | 18,000 | 46.17 | 831,060.00 | |
| | MAN SE | 7,460 | 82.42 | 614,853.20 | |
| | METSO OYJ | 14,900 | 28.74 | 428,226.00 | |
| | VALLOUREC | 13,360 | 42.25 | 564,460.00 | |
| | WARTSILA OYJ | 20,300 | 29.69 | 602,707.00 | |
| | ZARDOYA OTIS S.A | 18,960 | 8.84 | 167,606.40 | |
| BRENNTAG AG | 5,200 | 90.95 | 472,940.00 | | |
| BIC | 3,580 | 82.44 | 295,135.20 | | |
| EDENRED | 18,570 | 23.33 | 433,330.95 | | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 98,500 | 14.47 | 1,425,787.50 | | |
| TNT EXPRESS NV - W/I | 41,800 | 9.08 | 379,544.00 | | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD) | 25,000 | 9.02 | 225,675.00 | | |

| | | | | |
|---|---------|--------|--------------|--|
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP | 108,000 | 2.05 | 221,400.00 | |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA | 44,900 | 11.56 | 519,268.50 | |
| ADP | 4,230 | 62.06 | 262,513.80 | |
| ATLANTIA SPA | 38,100 | 11.29 | 430,149.00 | |
| FRAPORT AG | 3,800 | 45.23 | 171,874.00 | |
| GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR | 62,200 | 6.06 | 377,429.60 | |
| VOPAK | 8,100 | 46.75 | 378,675.00 | |
| CONTINENTAL AG | 9,300 | 70.17 | 652,581.00 | |
| MICHELIN B | 20,900 | 54.03 | 1,129,227.00 | |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 12,900 | 35.73 | 460,917.00 | |
| PIRELLI&CO | 26,200 | 9.42 | 246,804.00 | |
| BAYER MOTOREN WERK | 38,600 | 67.70 | 2,613,220.00 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 6,550 | 44.29 | 290,099.50 | |
| DAIMLER AG | 106,300 | 38.35 | 4,076,605.00 | |
| FIAT SPA-ORD | 88,400 | 3.39 | 299,676.00 | |
| PEUGEOT CITROEN | 29,300 | 8.14 | 238,560.60 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 17,900 | 44.40 | 794,760.00 | |
| RENAULT | 21,800 | 31.50 | 686,700.00 | |
| VOLKSWAGEN AG | 3,310 | 126.00 | 417,060.00 | |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 16,730 | 135.95 | 2,274,443.50 | |
| ADIDAS AG | 24,400 | 61.48 | 1,500,112.00 | |
| CHRISTIAN DIOR SA | 6,440 | 113.10 | 728,364.00 | |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 13,800 | 27.43 | 378,534.00 | |
| LVMH | 29,800 | 124.55 | 3,711,590.00 | |
| ACCOR SA | 16,700 | 25.13 | 419,754.50 | |
| AUTOGRILL SPA | 15,600 | 7.63 | 119,028.00 | |
| OPAP SA | 25,700 | 6.00 | 154,200.00 | |
| SODEXO | 10,900 | 60.01 | 654,109.00 | |
| AXEL SPRINGER AG | 4,800 | 35.48 | 170,328.00 | |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 14,800 | 26.48 | 391,978.00 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|------------------------------|---------|--------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| ユーロ | JC DECAUX INTERNATIONAL | 6,900 | 20.98 | 144,762.00 | |
| | KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG | 10,100 | 45.32 | 457,732.00 | |
| | LAGARDERE S.C.A | 13,580 | 21.73 | 295,161.30 | |
| | MEDIASET SPA-ORD | 83,500 | 1.45 | 121,242.00 | |
| | PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG | 8,620 | 18.57 | 160,073.40 | |
| | PUBLICIS GROUPE | 16,950 | 37.57 | 636,811.50 | |
| | REED ELSEVIER NV | 78,700 | 8.99 | 708,221.30 | |
| | SANOMA OYJ | 9,000 | 7.07 | 63,675.00 | |
| | SES FDR | 35,900 | 18.90 | 678,510.00 | |
| | TELEVISION FRANCAISE (T.F.1) | 14,350 | 7.24 | 103,922.70 | |
| | WOLTERS KLUWER | 34,700 | 12.49 | 433,576.50 | |
| | PPR | 8,830 | 122.30 | 1,079,909.00 | |
| | INDITEX | 25,800 | 67.56 | 1,743,048.00 | |
| | CARREFOUR SUPERMARCHE | 65,800 | 14.17 | 932,715.00 | |
| | CASINO GUICHARD | 6,540 | 72.35 | 473,169.00 | |
| | COLRUYT SA | 8,700 | 30.67 | 266,829.00 | |
| | DELHAIZE GROUP | 11,500 | 31.39 | 360,985.00 | |
| | DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL | 65,510 | 3.53 | 231,774.38 | |
| | JERONIMO MARTINS | 24,500 | 14.10 | 345,450.00 | |
| | KESKO OYJ | 8,200 | 20.23 | 165,886.00 | |
| | KONINKLIJKE AHOLD NV | 135,400 | 9.72 | 1,317,035.80 | |
| | METRO AG | 14,800 | 22.69 | 335,886.00 | |
| | ANHEUSER-BUSCH INBEV NV | 94,100 | 55.53 | 5,225,373.00 | |
| | COCA-COLA HELLENIC BOTTLING | 20,800 | 13.82 | 287,456.00 | |
| | HEINEKEN HOLDING NV | 13,200 | 34.82 | 459,690.00 | |
| | HEINEKEN NV | 30,100 | 41.04 | 1,235,304.00 | |
| | PERNOD-RICARD | 23,200 | 78.85 | 1,829,320.00 | |
| | DANONE | 68,500 | 52.09 | 3,568,165.00 | |
| | KERRY GROUP PLC-A | 17,400 | 33.95 | 590,730.00 | |
| | SUEDZUCKER AG | 8,530 | 23.15 | 197,512.15 | |
| | UNILEVER NV-CVA | 191,000 | 25.86 | 4,940,215.00 | |
| | HENKEL AG & CO KGAA | 15,490 | 46.04 | 713,237.05 | |
| | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 20,500 | 55.64 | 1,140,620.00 | |
| | BEIERSDORF AG | 11,970 | 52.27 | 625,671.90 | |
| | LOREAL-ORD | 28,300 | 91.21 | 2,581,243.00 | |
| | ESSILOR INTERNATIONAL | 23,400 | 67.45 | 1,578,330.00 | |
| | CELESIO AG | 10,830 | 12.50 | 135,375.00 | |
| | FRESENIUS MEDICAL CARE | 24,300 | 52.94 | 1,286,442.00 | |
| | FRESENIUS SE & CO KGAA | 13,400 | 77.14 | 1,033,676.00 | |
| | GRIFOLS SA | 16,510 | 18.69 | 308,654.45 | |
| | BAYER AG | 96,100 | 52.56 | 5,051,016.00 | |
| | ELAN CORPORATION PLC | 63,600 | 9.87 | 627,732.00 | |
| | MERCK KGAA | 7,710 | 79.99 | 616,722.90 | |
| | ORION OYJ | 11,900 | 15.15 | 180,285.00 | |
| | SANOFI | 133,400 | 58.10 | 7,750,540.00 | |
| | U.C.B. SA | 11,800 | 38.63 | 455,893.00 | |

| | | | | | |
|--|-------------------------------------|-----------|-------|--------------|--|
| | BANCA CARIGE SPA | 90,300 | 0.77 | 70,343.70 | |
| | BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 534,900 | 0.23 | 124,845.66 | |
| | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA | 548,017 | 5.01 | 2,745,565.17 | |
| | BANCO DE SABADELL SA | 243,900 | 1.61 | 392,679.00 | |
| | BANCO ESPIRITO SANTO-REG | 160,000 | 0.60 | 96,960.00 | |
| | BANCO POPOLARE SPA | 200,000 | 0.98 | 197,300.00 | |
| | BANCO SANTANDER SA | 1,006,500 | 4.64 | 4,672,173.00 | |
| | BANKIA SA | 94,400 | 2.13 | 201,072.00 | |
| | BANKINTER S.A. | 23,090 | 3.23 | 74,696.15 | |
| | BCO POPULAR ESPANOL | 124,962 | 2.15 | 268,918.22 | |
| | BNP PARIBAS | 112,200 | 28.37 | 3,183,675.00 | |
| | CAIXABANK | 86,820 | 2.41 | 209,496.66 | |
| | COMMERZBANK AG | 424,830 | 1.55 | 658,911.33 | |
| | CREDIT AGRICOLE SA | 115,600 | 3.34 | 386,566.40 | |
| | ERSTE GROUP BANK AG | 22,700 | 16.10 | 365,470.00 | |
| | INTESA SANPAOLO | 1,195,000 | 1.02 | 1,222,485.00 | |
| | INTESA SANPAOLO-RNC | 105,400 | 0.89 | 94,649.20 | |
| | IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD | 139,810 | | | |
| | KBC GROUPE NV | 18,100 | 13.20 | 238,920.00 | |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 121,800 | 1.40 | 170,520.00 | |
| | NATIXIS | 102,100 | 2.14 | 219,208.70 | |
| | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 4,900 | 24.50 | 120,050.00 | |
| | SOCIETE GENERALE | 76,700 | 16.75 | 1,284,725.00 | |
| | UNICREDIT SPA | 467,500 | 2.66 | 1,244,485.00 | |
| | UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA | 97,200 | 2.44 | 237,168.00 | |
| | DEUTSCHE BOERSE AG | 23,200 | 43.72 | 1,014,304.00 | |
| | EURAZEO | 3,140 | 35.17 | 110,433.80 | |
| | EXOR SPA | 6,500 | 16.45 | 106,925.00 | |
| | GROUPE BRUXELLES LAM | 9,600 | 50.66 | 486,336.00 | |
| | ING GROEP NV | 451,100 | 5.08 | 2,292,941.30 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|--------------|---------------------------------------|-----------|------------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| ユーロ | POHJOLA BANK PLC | 14,200 | 8.86 | 125,812.00 | |
| | AEGON NV | 206,300 | 3.31 | 682,853.00 | |
| | AGEAS | 249,100 | 1.28 | 320,840.80 | |
| | ALLIANZ SE | 52,800 | 83.69 | 4,418,832.00 | |
| | ASSICURAZIONI GENERALI | 136,300 | 9.34 | 1,273,042.00 | |
| | AXA | 201,600 | 9.38 | 1,892,016.00 | |
| | CNP ASSURANCES | 16,400 | 9.60 | 157,554.80 | |
| | DELTA LLOYD NV | 12,600 | 11.75 | 148,050.00 | |
| | HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG | 6,820 | 44.55 | 303,831.00 | |
| | MAPFRE SA | 85,780 | 1.94 | 166,584.76 | |
| | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG) | 20,760 | 104.40 | 2,167,344.00 | |
| | SAMPO OYJ-A | 48,100 | 20.00 | 962,000.00 | |
| | SCOR SE | 19,700 | 18.55 | 365,533.50 | |
| | VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN | 4,300 | 30.41 | 130,784.50 | |
| | IMMOEAST AG-RIGHTS | 50,000 | | | |
| | IMMOFINANZ AG | 116,500 | 2.64 | 307,909.50 | |
| | UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 13,340 | 14.29 | 190,628.60 | |
| | AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS | 36,100 | 15.57 | 562,077.00 | |
| | ATOS | 5,300 | 45.28 | 239,984.00 | |
| | CAP GEMINI SA | 17,990 | 28.95 | 520,810.50 | |
| | INDRA SISTEMAS SA | 12,950 | 7.63 | 98,886.20 | |
| | DASSAULT SYSTEMES SA | 6,800 | 72.77 | 494,836.00 | |
| | SAP AG | 107,000 | 48.01 | 5,137,605.00 | |
| | ALCATEL-LUCENT | 267,000 | 1.17 | 313,725.00 | |
| | NOKIA OYJ | 445,400 | 2.42 | 1,081,431.20 | |
| | NEOPOST SA | 4,120 | 41.74 | 171,989.40 | |
| | ASML HOLDING NV | 50,900 | 36.81 | 1,873,629.00 | |
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 129,600 | 6.63 | 860,414.40 | |
| | STMICROELECTRONICS NV | 73,790 | 4.04 | 298,332.97 | |
| | BELGACOM SA | 16,800 | 22.20 | 373,044.00 | |
| | DEUTSCHE TELEKOM-REG | 330,300 | 8.54 | 2,821,752.90 | |
| | ELISA CORPORATION | 17,800 | 16.55 | 294,590.00 | |
| | FRANCE TELECOM SA | 217,400 | 10.42 | 2,266,395.00 | |
| | HELLENIC TELECOM | 30,100 | 2.02 | 60,802.00 | |
| | ILIAD SA | 2,040 | 98.21 | 200,348.40 | |
| | KONINKLIJKE KPN NV | 170,100 | 7.72 | 1,314,022.50 | |
| | PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG | 85,100 | 4.22 | 359,887.90 | |
| | TELECOM ITALIA SPA | 1,087,000 | 0.84 | 920,145.50 | |
| | TELECOM ITALIA-RNC | 692,000 | 0.69 | 482,670.00 | |
| | TELEFONICA SA | 477,800 | 11.00 | 5,255,800.00 | |
| | TELEKOM AUSTRIA AG | 38,300 | 8.10 | 310,230.00 | |
| | VIVENDI SA | 148,903 | 12.82 | 1,908,936.46 | |
| MOBISTAR SA | 3,800 | 29.64 | 112,651.00 | | |
| ACCIONA S.A. | 3,100 | 46.00 | 142,600.00 | | |

| | | | | | |
|------|------------------------------|---------|-------|------------------|--|
| | E.ON AG | 211,500 | 15.42 | 3,261,330.00 | |
| | ELECTRICITE DE FRANCE | 27,900 | 15.91 | 444,028.50 | |
| | ENEL SPA | 771,100 | 2.42 | 1,872,230.80 | |
| | ENERGIAS DE PORTUGAL | 232,600 | 2.24 | 521,954.40 | |
| | FORTUM OYJ | 51,100 | 16.35 | 835,485.00 | |
| | IBERDROLA SA | 444,900 | 3.41 | 1,519,333.50 | |
| | RED ELECTRICA CORPORACION SA | 12,200 | 31.59 | 385,398.00 | |
| | TERNA SPA | 147,800 | 2.74 | 405,563.20 | |
| | VERBUND AG | 8,400 | 19.99 | 167,916.00 | |
| | ENAGAS | 19,500 | 13.14 | 256,230.00 | |
| | GAS NATURAL SDG | 40,000 | 9.99 | 399,640.00 | |
| | SNAM SPA | 189,400 | 3.46 | 656,081.60 | |
| | A2A SPA | 129,900 | 0.44 | 58,390.05 | |
| | GDF SUEZ | 142,500 | 16.85 | 2,401,125.00 | |
| | RWE AG | 56,900 | 32.15 | 1,829,619.50 | |
| | RWE AG-NON VTG PFD | 4,540 | 29.51 | 133,975.40 | |
| | SUEZ ENVIRONNEMENT SA | 33,030 | 9.91 | 327,492.45 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 44,170 | 10.19 | 450,092.30 | |
| | DEUTSCHE BANK AG-REG | 109,200 | 30.41 | 3,321,318.00 | |
| | MEDIOBANCA SPA-ORD | 60,400 | 3.31 | 200,286.40 | |
| | EDP RENOVAVEIS SA | 26,300 | 3.45 | 90,735.00 | |
| | ENEL GREEN POWER SPA | 192,500 | 1.20 | 231,577.50 | |
| | QIAGEN NV | 26,200 | 13.09 | 343,089.00 | |
| | BUREAU VERITAS SA | 6,400 | 68.45 | 438,080.00 | |
| | RANDSTAD HOLDING NV | 14,400 | 23.42 | 337,248.00 | |
| 計 | 銘柄数：245 | | | 233,116,536.84 | |
| | | | | (24,050,633,105) | |
| | 組入時価比率：11.9% | | | 12.3% | |
| | | | | | |
| 香港ドル | HOPEWELL HOLDINGS LTD | 59,500 | 20.60 | 1,225,700.00 | |
| | HUTCHISON WHAMPOA | 246,000 | 72.45 | 17,822,700.00 | |
| | NWS HOLDINGS LTD | 169,500 | 11.64 | 1,972,980.00 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 | |
|----------|------------------------------------|-------------|--------|---------------|-----------------|--|
| | | | 単価 | 金額 | | |
| 香港ドル | CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 138,000 | 13.36 | 1,843,680.00 | | |
| | ORIENT OVERSEAS INTL LTD | 23,800 | 46.85 | 1,115,030.00 | | |
| | MTR CORP | 167,500 | 26.75 | 4,480,625.00 | | |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 82,500 | 25.85 | 2,132,625.00 | | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 153,000 | 22.05 | 3,373,650.00 | | |
| | SANDS CHINA LTD | 282,000 | 28.70 | 8,093,400.00 | | |
| | SHANGRI-LA ASIA LTD | 158,333 | 16.48 | 2,609,327.84 | | |
| | SJM HOLDINGS LIMITED | 198,000 | 16.08 | 3,183,840.00 | | |
| | WYNN MACAU LTD | 186,800 | 22.40 | 4,184,320.00 | | |
| | LI & FUNG LTD | 667,600 | 15.88 | 10,601,488.00 | | |
| | LIFESTYLE INTL HLDGS LTD | 80,000 | 17.50 | 1,400,000.00 | | |
| | BANK OF EAST ASIA | 184,660 | 28.90 | 5,336,674.00 | | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 439,500 | 24.00 | 10,548,000.00 | | |
| | HANG SENG BANK | 90,900 | 106.50 | 9,680,850.00 | | |
| | WING HANG BANK LTD | 19,000 | 82.30 | 1,563,700.00 | | |
| | FIRST PACIFIC CO | 226,000 | 8.05 | 1,819,300.00 | | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 121,400 | 118.90 | 14,434,460.00 | | |
| | AIA GROUP LTD | 991,600 | 27.15 | 26,921,940.00 | | |
| | CHEUNG KONG | 162,000 | 99.35 | 16,094,700.00 | | |
| | HANG LUNG GROUP LTD | 106,000 | 47.50 | 5,035,000.00 | | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 294,000 | 27.05 | 7,952,700.00 | | |
| | HENDERSON LAND | 107,151 | 41.30 | 4,425,336.30 | | |
| | HYSAN DEVELOPMENT | 69,000 | 33.55 | 2,314,950.00 | | |
| | KERRY PROPERTIES | 86,500 | 34.10 | 2,949,650.00 | | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 436,500 | 9.21 | 4,020,165.00 | | |
| | SINO LAND CO.LTD | 332,000 | 12.34 | 4,096,880.00 | | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 165,000 | 89.80 | 14,817,000.00 | | |
| | SWIRE PACIFIC-A | 85,500 | 90.60 | 7,746,300.00 | | |
| | WHARF(HOLDING) | 174,000 | 43.75 | 7,612,500.00 | | |
| | WHELOCK & COMPANY LTD | 102,000 | 25.10 | 2,560,200.00 | | |
| | FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS | 251,000 | 3.43 | 860,930.00 | | |
| | ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 21,900 | 102.50 | 2,244,750.00 | | |
| | HKT TRUST AND HKT LTD | 12,195 | 6.18 | 75,365.10 | | |
| | PCCW LTD | 398,000 | 2.81 | 1,118,380.00 | | |
| | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 55,000 | 45.40 | 2,497,000.00 | | |
| | CLP HLDGS | 221,500 | 65.90 | 14,596,850.00 | | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 165,000 | 58.40 | 9,636,000.00 | | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 549,012 | 19.62 | 10,771,615.44 | | |
| | 計 | 銘柄数：41 | | | 255,770,561.68 | |
| | | | | | (2,626,763,668) | |
| | | 組入時価比率：1.3% | | | 1.3% | |
| シンガポールドル | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 181,000 | 2.97 | 537,570.00 | | |
| | FRASER & NEAVE | 106,500 | 6.80 | 724,200.00 | | |

| | | | | | |
|---|---|---------|-------|-----------------|--|
| | KEPPEL CORP. | 167,700 | 10.50 | 1,760,850.00 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES | 111,040 | 4.86 | 539,654.40 | |
| | COSCO CORP SINGAPORE LTD | 104,000 | 0.97 | 100,880.00 | |
| | SEMBCORP MARINE | 103,600 | 4.78 | 495,208.00 | |
| | YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 237,000 | 1.08 | 255,960.00 | |
| | NOBLE GROUP LTD | 425,481 | 1.19 | 506,322.39 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 65,040 | 10.59 | 688,773.60 | |
| | NEPTUNE ORIENT LINES | 89,750 | 1.16 | 104,110.00 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 252,000 | 1.47 | 371,700.00 | |
| | GENTING SINGAPORE PLC | 691,600 | 1.69 | 1,168,804.00 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 177,000 | 3.83 | 677,910.00 | |
| | JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD | 12,000 | 45.50 | 546,000.00 | |
| | OLAM INTERNATIONAL LTD | 167,600 | 2.16 | 362,016.00 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 756,320 | 0.67 | 510,516.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 227,000 | 4.70 | 1,066,900.00 | |
| | DBS GROUP HLDGS | 208,000 | 13.74 | 2,857,920.00 | |
| | OCBC-ORD | 305,000 | 8.82 | 2,690,100.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK | 149,000 | 18.20 | 2,711,800.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 96,000 | 6.50 | 624,000.00 | |
| | CAPITALAND LIMITED | 304,000 | 2.70 | 820,800.00 | |
| | CAPITAMALLS ASIA LTD | 151,000 | 1.41 | 212,910.00 | |
| | CITY DEVELOPMENT | 55,000 | 10.18 | 559,900.00 | |
| | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 230,000 | 2.02 | 464,600.00 | |
| | KEPPEL LAND LIMITED | 91,000 | 2.89 | 262,990.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 49,700 | 4.52 | 224,644.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 931,000 | 3.16 | 2,941,960.00 | |
| | STARHUB LTD | 63,000 | 3.23 | 203,490.00 | |
| 計 | 銘柄数：29 | | | 24,992,488.39 | |
| | | | | (1,592,021,510) | |
| | 組入時価比率：0.8% | | | 0.8% | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|-------------------------------|---------|-------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 豪ドル | WORLEYPARSONS LTD | 23,500 | 26.78 | 629,330.00 | |
| | CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 15,200 | 13.40 | 203,680.00 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 128,700 | 12.90 | 1,660,230.00 | |
| | SANTOS LTD. | 112,100 | 12.93 | 1,449,453.00 | |
| | WHITEHAVEN COAL LTD | 51,600 | 4.67 | 240,972.00 | |
| | WOODSIDE PETROLEUM | 75,300 | 33.05 | 2,488,665.00 | |
| | INCITEC PIVOT LTD | 187,500 | 3.24 | 607,500.00 | |
| | ORICA LTD | 41,500 | 26.50 | 1,099,750.00 | |
| | BORAL LTD | 83,600 | 3.69 | 308,484.00 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES SE | 49,300 | 7.30 | 359,890.00 | |
| | AMCOR | 139,100 | 7.58 | 1,054,378.00 | |
| | ALUMINA LTD | 297,400 | 0.96 | 286,991.00 | |
| | BHP BILLITON LIMITED | 375,700 | 34.33 | 12,897,781.00 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 146,400 | 5.33 | 780,312.00 | |
| | ILUKA RESOURCES LTD | 50,400 | 12.85 | 647,640.00 | |
| | LYNAS CORPORATION LIMITED | 203,900 | 0.97 | 198,802.50 | |
| | NEWCREST MINING | 88,500 | 23.80 | 2,106,300.00 | |
| | OZ MINERALS LTD | 36,500 | 8.60 | 313,900.00 | |
| | RIO TINTO LTD | 51,300 | 61.23 | 3,141,099.00 | |
| | SIMS METAL MANAGEMENT LTD | 18,300 | 13.32 | 243,756.00 | |
| | LEIGHTON HOLDINGS | 16,900 | 19.18 | 324,142.00 | |
| | BRAMBLES LTD | 171,400 | 7.05 | 1,208,370.00 | |
| | TOLL HLDGS | 79,900 | 5.51 | 440,249.00 | |
| | QANTAS AIRWAYS LIMITED | 127,100 | 1.49 | 190,014.50 | |
| | ASCIANO LTD | 111,600 | 4.65 | 518,940.00 | |
| | QR NATIONAL LTD | 198,200 | 3.43 | 679,826.00 | |
| | SYDNEY AIRPORT | 42,300 | 2.95 | 124,785.00 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 154,100 | 5.90 | 909,190.00 | |
| | CROWN LTD | 44,100 | 9.06 | 399,546.00 | |
| | ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD | 77,800 | 4.51 | 350,878.00 | |
| | TABCORP HOLDINGS | 80,900 | 2.97 | 240,273.00 | |
| | TATTS GROUP LTD | 151,800 | 2.61 | 396,198.00 | |
| | FAIRFAX MEDIA LTD | 285,900 | 0.68 | 194,412.00 | |
| | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 58,200 | 2.00 | 116,400.00 | |
| | METCASH LTD | 96,100 | 4.05 | 389,205.00 | |
| | WESFARMERS LIMITED | 118,300 | 30.15 | 3,566,745.00 | |
| | WOOLWORTHS LIMITED | 142,700 | 26.49 | 3,780,123.00 | |
| | COCA-COLA AMATIL LTD | 66,000 | 12.53 | 826,980.00 | |
| | COCHLEAR LTD | 7,200 | 64.60 | 465,120.00 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 14,000 | 20.43 | 286,020.00 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 43,200 | 12.38 | 534,816.00 | |
| | CSL LIMITED | 61,200 | 37.19 | 2,276,028.00 | |
| | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK | 306,400 | 23.12 | 7,083,968.00 | |
| | BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 45,200 | 7.12 | 321,824.00 | |

| | | | | | |
|------------|--------------------------------|---------|----------|-----------------|--|
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 184,500 | 51.66 | 9,531,270.00 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK | 256,200 | 24.61 | 6,305,082.00 | |
| | WESTPAC BANKING CORP | 352,500 | 22.84 | 8,051,100.00 | |
| | ASX LTD | 20,800 | 30.42 | 632,736.00 | |
| | AMP LIMITED | 339,200 | 4.03 | 1,366,976.00 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | 233,600 | 3.43 | 801,248.00 | |
| | QBE INSURANCE | 132,100 | 13.17 | 1,739,757.00 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 151,100 | 8.22 | 1,242,042.00 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 53,900 | 8.36 | 450,604.00 | |
| | TELSTRA CORP LTD | 506,800 | 3.65 | 1,849,820.00 | |
| | SP AUSNET | 162,028 | 1.10 | 179,040.94 | |
| | APA GROUP | 58,800 | 4.93 | 289,884.00 | |
| | AGL ENERGY LTD | 56,400 | 14.34 | 808,776.00 | |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 40,100 | 27.45 | 1,100,745.00 | |
| | CAMPBELL BROTHERS LTD | 7,700 | 58.00 | 446,600.00 | |
| 計 | 銘柄数：59 | | | 91,138,646.94 | |
| | | | | (7,312,965,030) | |
| | 組入時価比率：3.6% | | | 3.7% | |
| | | | | | |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 80,800 | 6.19 | 500,152.00 | |
| | AUCKLAND INT'L AIRPORT LTD | 97,900 | 2.59 | 253,561.00 | |
| | SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP | 75,800 | 3.92 | 297,136.00 | |
| | TELECOM CORP OF NEW ZEALAND | 224,500 | 2.65 | 594,925.00 | |
| | CONTACT ENERGY LTD | 44,395 | 4.84 | 214,871.80 | |
| 計 | 銘柄数：5 | | | 1,860,645.80 | |
| | | | | (116,495,033) | |
| | 組入時価比率：0.1% | | | 0.1% | |
| | | | | | |
| 新シェケル | ISRAEL CHEMICALS LIMITED | 53,900 | 41.25 | 2,223,375.00 | |
| | ISRAEL CORP LIMITED/THE | 300 | 2,298.00 | 689,400.00 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 2,700 | 135.40 | 365,580.00 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-------|------------------------------|---------|--------|-------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 新シェケル | DELEK GROUP LTD | 500 | 741.60 | 370,800.00 | |
| | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 110,500 | 165.50 | 18,287,750.00 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 119,000 | 13.56 | 1,613,640.00 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 130,200 | 11.22 | 1,460,844.00 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 104,300 | 4.81 | 501,683.00 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 14,200 | 33.00 | 468,600.00 | |
| | NICE SYSTEMS LTD | 6,900 | 144.90 | 999,810.00 | |
| | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP | 207,200 | 5.42 | 1,124,060.00 | |
| | CELLCOM ISRAEL LTD | 5,500 | 44.22 | 243,210.00 | |
| | PARTNER COMMUNICATIONS CO | 9,900 | 27.54 | 272,646.00 | |
| 計 | 銘柄数：13 | | | 28,621,398.00 | |
| | | | | (597,328,576) | |
| | 組入時価比率：0.3% | | | 0.3% | |
| 合計 | | | | 195,552,462,627 | |
| | | | | (195,552,462,627) | |

- (注) 1 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2) 株式以外の有価証券

(平成24年5月10日現在)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 / 口数 | 評価額 | 備考 |
|-----------|-------------------------------|-----------|--------------|----|
| 投資信託受益証券 | HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | | 447,000.00 | |
| 米ドル計 | 銘柄数：1 | | 447,000.00 | |
| | | | (35,634,840) | |
| | 組入時価比率：0.0% | | 0.8% | |
| 投資信託受益証券計 | | | 35,634,840 | |
| | | | (35,634,840) | |
| 投資証券 | AMERICAN TOWER CORP | 45,800 | 3,068,600.00 | |
| | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 112,900 | 1,865,108.00 | |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 11,100 | 1,626,483.00 | |
| | BOSTON PROPERTIES | 17,300 | 1,865,286.00 | |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 12,600 | 925,974.00 | |
| | DUKE REALTY CORP | 28,300 | 421,104.00 | |
| | EQUITY RESIDENTIAL | 34,600 | 2,184,298.00 | |
| | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 7,100 | 719,443.00 | |
| | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 51,200 | 918,016.00 | |

| | | | | |
|--------|---------------------------------------|---------|-----------------|--|
| | HCP INC | 47,400 | 1,945,296.00 | |
| | HEALTH CARE REIT INC | 24,200 | 1,354,958.00 | |
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 84,200 | 1,344,674.00 | |
| | KIMCO REALTY CORP | 48,000 | 937,920.00 | |
| | LIBERTY PROPERTY TRUST | 13,100 | 477,888.00 | |
| | MACERICH CO /THE | 15,500 | 935,735.00 | |
| | PLUM CREEK TIMBER CO | 19,000 | 737,390.00 | |
| | PROLOGIS INC | 54,200 | 1,874,778.00 | |
| | PUBLIC STORAGE | 17,200 | 2,395,616.00 | |
| | RAYONIER INC | 14,400 | 643,392.00 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 9,900 | 469,161.00 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 34,470 | 5,333,198.40 | |
| | VENTAS INC | 33,300 | 1,959,372.00 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 19,600 | 1,721,468.00 | |
| | WEYERHAEUSER CO | 61,800 | 1,240,326.00 | |
| 米ドル計 | 銘柄数：24 | 817,170 | 36,965,484.40 | |
| | | | (2,946,888,416) | |
| | 組入時価比率：1.5% | | 69.1% | |
| | | | | |
| | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 8,300 | 200,943.00 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 14,400 | 393,552.00 | |
| カナダドル計 | 銘柄数：2 | 22,700 | 594,495.00 | |
| | | | (47,321,802) | |
| | 組入時価比率：0.0% | | 1.1% | |
| | | | | |
| | BRITISH LAND | 100,600 | 497,165.20 | |
| | CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC | 67,500 | 212,625.00 | |
| | HAMMERSON PLC | 83,700 | 343,588.50 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 88,500 | 652,687.50 | |
| | SEGRO PLC | 86,700 | 185,971.50 | |
| 英ポンド計 | 銘柄数：5 | 427,000 | 1,892,037.70 | |
| | | | (243,467,411) | |
| | 組入時価比率：0.1% | | 5.7% | |
| | | | | |
| | CORIO NV | 6,500 | 217,522.50 | |
| | FONCIERE DES REGIONS | 3,390 | 177,263.10 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 / 口数 | 評価額 | 備考 |
|-----------|------------------------------|-----------|-----------------|----|
| 投資証券 | GECINA SA | 2,790 | 191,728.80 | |
| | ICADE | 2,830 | 172,347.00 | |
| | KLEPIERRE | 12,790 | 302,483.50 | |
| | UNIBAIL RODAMCO SE | 10,720 | 1,441,840.00 | |
| ユーロ計 | 銘柄数：6 | 39,020 | 2,503,184.90 | |
| | | | (258,253,586) | |
| | 組入時価比率：0.1% | | 6.0% | |
| | LINK REIT | 255,500 | 8,163,225.00 | |
| 香港ドル計 | 銘柄数：1 | 255,500 | 8,163,225.00 | |
| | | | (83,836,320) | |
| | 組入時価比率：0.0% | | 2.0% | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 217,000 | 434,000.00 | |
| | CAPITAMALL TRUST | 236,900 | 420,497.50 | |
| シンガポールドル計 | 銘柄数：2 | 453,900 | 854,497.50 | |
| | | | (54,431,490) | |
| | 組入時価比率：0.0% | | 1.3% | |
| | CFS RETAIL PROPERTY TRUST | 230,600 | 441,599.00 | |
| | DEXUS PROPERTY GROUP | 536,000 | 503,840.00 | |
| | GOODMAN GROUP | 163,200 | 597,312.00 | |
| | GPT GROUP | 207,100 | 675,146.00 | |
| | LEND LEASE GROUP | 61,600 | 468,776.00 | |
| | MIRVAC GROUP | 388,100 | 512,292.00 | |
| | STOCKLAND TRUST GROUP | 278,700 | 900,201.00 | |
| | WESTFIELD GROUP | 256,200 | 2,431,338.00 | |
| | WESTFIELD RETAIL TRUST | 342,500 | 938,450.00 | |
| 豪ドル計 | 銘柄数：9 | 2,464,000 | 7,468,954.00 | |
| | | | (599,308,868) | |
| | 組入時価比率：0.3% | | 14.0% | |
| 投資証券計 | | | 4,233,507,893 | |
| | | | (4,233,507,893) | |
| 合計 | | | 4,269,142,733 | |
| | | | (4,269,142,733) | |

- (注) 1 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 平成24年5月10日現在 | | |
|--------------------------------|---------------|---------------|------------|
| | 契約額等(円) | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | | |
| 市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建 | 2,411,110,478 | 2,325,757,945 | 85,352,533 |

| | | | | |
|---------------------|-------------|--|-------------|------------|
| 市場取引以外の取引 為替予約取引 | | | | |
| 売建 | 110,832,750 | | 110,725,500 | 107,250 |
| 米ドル | 59,816,250 | | 59,782,500 | 33,750 |
| 英ポンド | 25,739,000 | | 25,734,000 | 5,000 |
| スイスフラン | 17,238,000 | | 17,186,000 | 52,000 |
| 豪ドル | 8,039,500 | | 8,023,000 | 16,500 |
| 合計 | | | | 85,245,283 |

(注)時価の算定方法

1 先物取引

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

2 為替予約取引

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のよう評価しております。

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

3 「国内債券マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1)貸借対照表

| 科目 | 対象年月日 | 平成24年5月10日現在 金額(円) |
|-----------------|-------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 44,801,355 |
| 国債証券 | | 5,493,820,780 |
| 未収利息 | | 18,690,307 |
| 前払費用 | | 492,196 |
| 流動資産合計 | | 5,557,804,638 |
| 資産合計 | | |
| | | 5,557,804,638 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | | 20,999,353 |
| 流動負債合計 | | 20,999,353 |
| 負債合計 | | |
| | | 20,999,353 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 4,635,439,601 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | | 901,365,684 |
| 元本等合計 | | 5,536,805,285 |
| 純資産合計 | | |
| | | 5,536,805,285 |
| 負債純資産合計 | | |
| | | 5,557,804,638 |

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-----------------------|---|
| 1 運用資産の評価基準及び評価方法 | (1) 国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 |
| 2 費用・収益の計上基準 | (1) 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 |
| 3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(追加情報)

| |
|--|
| 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 |
| 当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成24年5月10日現在 | |
|---------------------------|-----------|
| 1 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 1,1945 円 |
| (10,000口当たり純資産額) | 11,945 円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 | |
|------------------------------|---|
| 1 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(3)附属明細表に記載しております。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 |
| 3 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。 |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 平成24年5月10日現在 | |
|-------------------|--|
| 1 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 時価の算定方法 | 国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(その他の注記)

| 平成24年5月10日現在 | |
|----------------------------|-----------------|
| 1 元本の移動及び期末元本額の内訳 | |
| 期首 | 平成23年5月11日 |
| 期首元本額 | 5,569,594,770 円 |
| 期首より平成24年5月10日までの期中追加設定元本額 | 967,560,230 円 |
| 期首より平成24年5月10日までの期中一部解約元本額 | 1,901,715,399 円 |
| 期末元本額 | 4,635,439,601 円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 575,183,754 円 |
| バランスセレクト50 | 659,010,505 円 |
| バランスセレクト70 | 181,075,083 円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 13,667,073 円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 32,502,084 円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 11,623,501 円 |
| 野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 3,110,697,420 円 |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け) | 51,680,181 円 |

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成24年5月10日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券

(平成24年5月10日現在)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|------|------------------|------------|------------|----|
| 国債証券 | 国庫債券 利付(2年)第309回 | 30,000,000 | 29,997,600 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第72回 | 50,000,000 | 50,767,000 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第73回 | 50,000,000 | 50,657,000 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第74回 | 45,000,000 | 45,442,800 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第75回 | 35,000,000 | 35,470,400 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第76回 | 20,000,000 | 20,295,800 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第77回 | 25,000,000 | 25,302,250 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第79回 | 10,000,000 | 10,095,200 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第80回 | 30,000,000 | 30,333,600 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第81回 | 50,000,000 | 50,641,000 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第82回 | 20,000,000 | 20,293,400 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第83回 | 30,000,000 | 30,499,800 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第84回 | 60,000,000 | 60,748,200 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第85回 | 60,000,000 | 60,837,600 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第86回 | 30,000,000 | 30,348,600 | |
| | 国庫債券 利付(5年)第87回 | 80,000,000 | 80,809,600 | |

| | | | |
|-----------------------|------------|------------|--|
| 国庫債券 利付（5年）第 89回 | 30,000,000 | 30,254,700 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 90回 | 70,000,000 | 70,378,000 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 91回 | 20,000,000 | 20,176,800 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 92回 | 40,000,000 | 40,220,000 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 94回 | 30,000,000 | 30,483,600 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 95回 | 30,000,000 | 30,493,200 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 97回 | 60,000,000 | 60,512,400 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 98回 | 10,000,000 | 10,044,700 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 99回 | 60,000,000 | 60,491,400 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 100回 | 70,000,000 | 70,271,600 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 101回 | 40,000,000 | 40,309,600 | |
| 国庫債券 利付（5年）第 102回 | 70,000,000 | 70,222,600 | |
| 国庫債券 利付（40年） 第1回 | 10,000,000 | 11,161,400 | |
| 国庫債券 利付（40年） 第2回 | 10,000,000 | 10,592,800 | |
| 国庫債券 利付（40年） 第3回 | 10,000,000 | 10,555,900 | |
| 国庫債券 利付（40年） 第4回 | 15,000,000 | 15,724,500 | |
| 国庫債券 利付（10年） 第250回 | 53,000,000 | 53,233,200 | |
| 国庫債券 利付（10年） 第253回 | 63,000,000 | 64,272,600 | |
| 国庫債券 利付（10年） 第254回 | 10,000,000 | 10,175,000 | |
| 国庫債券 利付（10年） 第255回 | 20,000,000 | 20,377,000 | |
| 国庫債券 利付（10年） 第256回 | 9,000,000 | 9,187,200 | |
| 国庫債券 利付（10年） 第257回 | 2,000,000 | 2,038,240 | |
| 国庫債券 利付（10年） 第258回 | 35,000,000 | 35,771,750 | |
| 国庫債券 利付（10年） 第259回 | 30,000,000 | 30,772,200 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|------|-----------------------|------------|------------|----|
| 国債証券 | 国庫債券 利付（10年） 第260回 | 32,000,000 | 33,002,880 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第261回 | 25,000,000 | 25,888,250 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第262回 | 40,000,000 | 41,505,200 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第263回 | 27,000,000 | 27,947,430 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第264回 | 52,000,000 | 53,702,480 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第265回 | 20,000,000 | 20,721,400 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第266回 | 30,000,000 | 31,004,100 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第267回 | 35,000,000 | 36,080,800 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第268回 | 40,000,000 | 41,573,200 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第269回 | 45,000,000 | 46,514,250 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第270回 | 42,000,000 | 43,524,600 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第271回 | 30,000,000 | 30,996,300 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第272回 | 30,000,000 | 31,266,600 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第273回 | 45,000,000 | 47,050,200 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第274回 | 20,000,000 | 20,967,400 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第275回 | 25,000,000 | 26,119,750 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第277回 | 37,000,000 | 39,023,160 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第278回 | 33,000,000 | 35,056,890 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第280回 | 22,000,000 | 23,535,600 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第281回 | 35,000,000 | 37,585,450 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第282回 | 55,000,000 | 58,547,500 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第283回 | 20,000,000 | 21,376,400 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第284回 | 75,000,000 | 80,039,250 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第285回 | 58,000,000 | 62,058,840 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第286回 | 30,000,000 | 32,325,900 | |
| | 国庫債券 利付（10年） 第287回 | 50,000,000 | 54,128,000 | |

| | | | |
|-----------------------|------------|------------|--|
| 国庫債券 利付(10年) 第288回 | 65,000,000 | 69,830,800 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第290回 | 30,000,000 | 31,814,400 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第292回 | 35,000,000 | 37,729,650 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第293回 | 30,000,000 | 32,559,600 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第295回 | 25,000,000 | 26,677,500 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第296回 | 55,000,000 | 58,730,100 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第297回 | 40,000,000 | 42,477,200 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第298回 | 20,000,000 | 21,110,200 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第299回 | 45,000,000 | 47,478,150 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第300回 | 35,000,000 | 37,404,500 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第301回 | 45,000,000 | 48,102,300 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第303回 | 45,000,000 | 47,804,400 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第304回 | 30,000,000 | 31,657,200 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第305回 | 70,000,000 | 73,803,800 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第306回 | 35,000,000 | 37,126,600 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第307回 | 30,000,000 | 31,597,800 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第308回 | 30,000,000 | 31,549,200 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第309回 | 40,000,000 | 41,432,800 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第310回 | 50,000,000 | 51,305,000 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第311回 | 20,000,000 | 20,197,600 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第312回 | 60,000,000 | 62,434,200 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第313回 | 60,000,000 | 62,842,800 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第314回 | 30,000,000 | 30,909,600 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第315回 | 20,000,000 | 20,749,000 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第316回 | 10,000,000 | 10,285,000 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第317回 | 30,000,000 | 30,796,500 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第318回 | 40,000,000 | 40,696,000 | |

| | | | |
|-----------------------|------------|------------|--|
| 国庫債券 利付(10年) 第319回 | 30,000,000 | 30,733,800 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第320回 | 30,000,000 | 30,453,300 | |
| 国庫債券 利付(10年) 第321回 | 30,000,000 | 30,381,300 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第3回 | 10,000,000 | 11,111,000 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第5回 | 10,000,000 | 10,938,600 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第7回 | 5,000,000 | 5,543,200 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第8回 | 10,000,000 | 10,214,300 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第9回 | 10,000,000 | 9,513,200 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第10回 | 10,000,000 | 8,959,100 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第11回 | 10,000,000 | 10,007,700 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第14回 | 10,000,000 | 11,258,700 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第15回 | 10,000,000 | 11,450,700 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第16回 | 10,000,000 | 11,434,700 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第17回 | 10,000,000 | 11,253,200 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第18回 | 10,000,000 | 11,060,200 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第19回 | 10,000,000 | 11,059,400 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第20回 | 10,000,000 | 11,442,500 | |
| 国庫債券 利付(30年) 第21回 | 10,000,000 | 11,047,800 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|------|----------------------|------------|------------|----|
| 国債証券 | 国庫債券 利付(30年) 第22回 | 10,000,000 | 11,444,900 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第23回 | 10,000,000 | 11,445,900 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第24回 | 11,000,000 | 12,591,480 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第25回 | 10,000,000 | 11,050,400 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第26回 | 20,000,000 | 22,504,600 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第27回 | 20,000,000 | 22,936,200 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第28回 | 10,000,000 | 11,467,500 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第29回 | 20,000,000 | 22,547,800 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第30回 | 20,000,000 | 22,110,200 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第31回 | 20,000,000 | 21,664,800 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第32回 | 20,000,000 | 22,101,000 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第33回 | 30,000,000 | 31,155,300 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第34回 | 30,000,000 | 32,463,300 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第35回 | 32,000,000 | 33,165,440 | |
| | 国庫債券 利付(30年) 第36回 | 5,000,000 | 5,174,050 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第25回 | 48,000,000 | 51,539,040 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第26回 | 10,000,000 | 11,032,800 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第27回 | 10,000,000 | 11,150,500 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第33回 | 20,000,000 | 23,107,400 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第37回 | 30,000,000 | 34,461,900 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第41回 | 30,000,000 | 32,039,700 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第42回 | 10,000,000 | 11,428,500 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第43回 | 10,000,000 | 11,702,200 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第44回 | 10,000,000 | 11,454,300 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第45回 | 10,000,000 | 11,379,100 | |
| | 国庫債券 利付(20年) 第46回 | 5,000,000 | 5,611,950 | |

| | | | |
|----------------------|------------|------------|--|
| 国庫債券 利付（20年） 第47回 | 15,000,000 | 16,855,950 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第49回 | 20,000,000 | 22,343,800 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第52回 | 25,000,000 | 27,914,000 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第53回 | 10,000,000 | 11,169,200 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第54回 | 10,000,000 | 11,263,500 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第55回 | 10,000,000 | 11,080,600 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第56回 | 10,000,000 | 11,074,900 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第57回 | 10,000,000 | 10,971,600 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第58回 | 10,000,000 | 10,978,200 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第59回 | 10,000,000 | 10,769,100 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第60回 | 10,000,000 | 10,463,600 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第61回 | 10,000,000 | 10,034,300 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第62回 | 10,000,000 | 9,795,200 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第63回 | 10,000,000 | 10,853,500 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第64回 | 10,000,000 | 10,945,500 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第65回 | 10,000,000 | 10,935,600 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第66回 | 10,000,000 | 10,826,000 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第67回 | 10,000,000 | 10,924,500 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第68回 | 10,000,000 | 11,259,300 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第69回 | 10,000,000 | 11,147,600 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第70回 | 10,000,000 | 11,480,300 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第71回 | 20,000,000 | 22,505,600 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第72回 | 20,000,000 | 22,259,800 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第73回 | 10,000,000 | 11,002,200 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第74回 | 10,000,000 | 11,119,100 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第75回 | 10,000,000 | 11,107,000 | |
| 国庫債券 利付（20年） 第76回 | 17,000,000 | 18,479,000 | |

| | | | |
|-----------------------|------------|------------|--|
| 国庫債券 利付(20年) 第77回 | 15,000,000 | 16,482,600 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第78回 | 10,000,000 | 10,841,500 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第79回 | 10,000,000 | 10,967,800 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第80回 | 10,000,000 | 11,087,900 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第81回 | 10,000,000 | 10,945,900 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第82回 | 15,000,000 | 16,601,400 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第83回 | 15,000,000 | 16,578,600 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第85回 | 23,000,000 | 25,397,750 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第86回 | 20,000,000 | 22,585,800 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第88回 | 20,000,000 | 22,558,000 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第91回 | 20,000,000 | 22,541,800 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第93回 | 20,000,000 | 21,688,400 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第94回 | 20,000,000 | 21,964,000 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第96回 | 15,000,000 | 16,452,450 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第99回 | 10,000,000 | 10,938,400 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第100回 | 20,000,000 | 22,118,400 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第101回 | 20,000,000 | 22,697,200 | |
| 国庫債券 利付(20年) 第102回 | 20,000,000 | 22,672,400 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|------|-----------------------|------------|------------|----|
| 国債証券 | 国庫債券 利付（20年） 第103回 | 15,000,000 | 16,795,800 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第104回 | 20,000,000 | 21,825,000 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第105回 | 20,000,000 | 21,790,400 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第106回 | 10,000,000 | 11,042,500 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第107回 | 20,000,000 | 21,754,000 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第108回 | 20,000,000 | 21,161,800 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第109回 | 10,000,000 | 10,566,400 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第110回 | 20,000,000 | 21,730,800 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第111回 | 10,000,000 | 10,997,600 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第112回 | 35,000,000 | 37,961,350 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第113回 | 50,000,000 | 54,168,000 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第114回 | 30,000,000 | 32,461,200 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第115回 | 10,000,000 | 10,974,800 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第116回 | 10,000,000 | 10,962,400 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第118回 | 10,000,000 | 10,636,000 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第119回 | 10,000,000 | 10,316,900 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第120回 | 25,000,000 | 25,000,000 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第122回 | 20,000,000 | 20,611,200 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第124回 | 20,000,000 | 21,222,800 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第125回 | 10,000,000 | 10,932,200 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第126回 | 10,000,000 | 10,610,000 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第127回 | 20,000,000 | 20,884,000 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第128回 | 20,000,000 | 20,877,800 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第129回 | 20,000,000 | 20,555,000 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第131回 | 15,000,000 | 15,143,250 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第132回 | 10,000,000 | 10,081,500 | |

| | | | | |
|-------|-----------------------|---------------|---------------|--|
| | 国庫債券 利付（20年） 第133回 | 10,000,000 | 10,252,500 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第134回 | 10,000,000 | 10,247,200 | |
| | 国庫債券 利付（20年） 第135回 | 10,000,000 | 10,082,200 | |
| 国債証券計 | 銘柄数：211 | 5,216,000,000 | 5,493,820,780 | |
| | 組入時価比率：99.2% | | 100.0% | |
| | | | | |
| 合計 | | | 5,493,820,780 | |

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

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

4 「外国債券マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1) 貸借対照表

| 科目 | 対象年月日 | 平成24年5月10日現在 金額(円) |
|-----------------|-------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 2,083,635,184 |
| コール・ローン | | 297,393,312 |
| 国債証券 | | 273,250,442,671 |
| 派生商品評価勘定 | | 2,891,055 |
| 未収入金 | | 315,076,544 |
| 未収利息 | | 3,324,548,030 |
| 前払費用 | | 134,341,110 |
| 流動資産合計 | | 279,408,327,906 |
| 資産合計 | | |
| 279,408,327,906 | | |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | | 1,014,283,287 |
| その他未払費用 | | 3,061,700 |
| 流動負債合計 | | 1,017,344,987 |
| 負債合計 | | |
| 1,017,344,987 | | |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 189,213,673,308 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | | 89,177,309,611 |
| 元本等合計 | | 278,390,982,919 |
| 純資産合計 | | |
| 278,390,982,919 | | |
| 負債純資産合計 | | |
| 279,408,327,906 | | |

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(追加情報)

| |
|--|
| 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 |
| 当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|--|-----------------------|
| 平成24年5月10日現在 | |
| 1 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) | 1.4713 円 14,713 円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| | |
|--|--|
| 自 平成23年5月11日 至 平成24年5月10日 | |
| 1 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | |
| 2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(3)附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 また、当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行なうことを目的として、為替予約取引を利用しております。 | |
| 3 金融商品に係るリスク管理体制 | |

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成24年5月10日現在

- 1 貸借対照表計上額、時価及び差額
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は
ありません。
- 2 時価の算定方法
国債証券
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定
デリバティブ取引については、(3)附属明細表に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価として
しております。

(その他の注記)

平成24年5月10日現在

| | |
|------------------------------------|-------------------|
| 1 元本の移動及び期末元本額の内訳 | |
| 期首 | 平成23年5月11日 |
| 期首元本額 | 220,334,504,999 円 |
| 期首より平成24年5月10日までの期中追加設定元本額 | 16,682,166,480 円 |
| 期首より平成24年5月10日までの期中一部解約元本額 | 47,802,998,171 円 |
| 期末元本額 | 189,213,673,308 円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 126,260,991 円 |
| バランスセレクト50 | 131,892,439 円 |
| バランスセレクト70 | 73,928,641 円 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 287,996,855 円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 2,920,411,337 円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 78,722,147,988 円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 2,705,369,063 円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 189,642,690 円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 76,343,344 円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 71,633,158 円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 57,974,450 円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 37,531,695 円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 119,578,071 円 |
| 野村外国債券インデックス(野村投資一任口座向け) | 2,032,037,867 円 |
| のむらップ・ファンド(保守型) | 1,352,253,573 円 |
| のむらップ・ファンド(普通型) | 1,285,240,371 円 |
| のむらップ・ファンド(積極型) | 658,235,409 円 |
| 野村外国債券インデックス(野村SMA向け) | 135,082,844 円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 2,057,203 円 |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 81,636,709 円 |
| マイ・ロード | 317,589,102 円 |
| 野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 131,919,179 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) | 25,632,494,432 円 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 1,501,351,612 円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 23,082,021,887 円 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 4,557,043,978 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用) | 12,275,224 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | 57,739,152 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用) | 9,142,902 円 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 12,612,333,620 円 |

| | |
|------------------------------------|-----------------|
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用) | 887,958,439 円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 3,395,237,801 円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 568,521,465 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 118,629,135 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 367,320,349 円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 3,143,500,160 円 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 1,717,555,345 円 |
| ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 2,569,632,619 円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 2,969,239 円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 6,476,299 円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 4,711,649 円 |
| 野村外国債券バッシュファンド(確定拠出年金向け) | 452,105,733 円 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 1,475,339,363 円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 1,856,801,992 円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 1,723,946,928 円 |
| 野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 9,708,933,350 円 |
| マイバランスDC30 | 586,715,312 円 |
| マイバランスDC50 | 310,903,773 円 |
| マイバランスDC70 | 158,797,912 円 |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 1,162,125,500 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 14,325,159 円 |

*当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成24年5月10日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券

(平成24年5月10日現在)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | US TREASURY BOND | 9,400,000.00 | 11,883,655.78 | |
| | US TREASURY BOND | 10,000,000.00 | 13,035,937.00 | |
| | US TREASURY BOND | 12,000,000.00 | 16,732,500.00 | |
| | US TREASURY BOND | 6,000,000.00 | 8,509,687.20 | |
| | US TREASURY BOND | 3,700,000.00 | 5,574,281.25 | |
| | US TREASURY BOND | 4,000,000.00 | 5,920,000.00 | |
| | US TREASURY BOND | 5,000,000.00 | 7,844,140.50 | |
| | US TREASURY BOND | 10,000,000.00 | 15,566,406.00 | |
| | US TREASURY BOND | 3,200,000.00 | 4,830,874.88 | |
| | US TREASURY BOND | 3,000,000.00 | 4,527,421.80 | |
| | US TREASURY BOND | 4,500,000.00 | 6,433,945.20 | |
| | US TREASURY BOND | 4,050,000.00 | 6,438,866.98 | |
| | US TREASURY BOND | 2,000,000.00 | 3,065,937.40 | |
| | US TREASURY BOND | 3,000,000.00 | 4,306,875.00 | |
| | US TREASURY BOND | 2,000,000.00 | 3,018,125.00 | |
| | US TREASURY BOND | 1,500,000.00 | 2,294,531.25 | |
| | US TREASURY BOND | 1,700,000.00 | 2,560,625.00 | |
| | US TREASURY BOND | 4,100,000.00 | 6,050,702.92 | |
| | US TREASURY BOND | 4,000,000.00 | 5,611,250.00 | |
| | US TREASURY BOND | 2,700,000.00 | 3,707,437.50 | |
| | US TREASURY BOND | 9,300,000.00 | 11,782,663.83 | |
| | US TREASURY N/B | 11,000,000.00 | 11,381,991.50 | |
| | US TREASURY N/B | 20,000,000.00 | 20,196,874.00 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,091,015.00 | |
| | US TREASURY N/B | 18,550,000.00 | 19,491,265.95 | |
| | US TREASURY N/B | 17,000,000.00 | 17,638,827.70 | |
| | US TREASURY N/B | 13,500,000.00 | 14,040,526.50 | |
| | US TREASURY N/B | 15,000,000.00 | 14,977,147.50 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|-----------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 12,441,561.60 | |
| | US TREASURY N/B | 15,000,000.00 | 15,001,171.50 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,204,296.00 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,124,609.00 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 7,179,375.00 | |
| | US TREASURY N/B | 7,500,000.00 | 7,717,675.50 | |
| | US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 7,999,687.20 | |
| | US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,092,382.50 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,281,250.00 | |
| | US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,093,945.00 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,314,843.00 | |
| | US TREASURY N/B | 14,200,000.00 | 15,475,225.32 | |
| | US TREASURY N/B | 15,000,000.00 | 15,604,687.50 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,501,171.00 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,072,656.00 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 7,360,663.80 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,474,218.00 | |
| | US TREASURY N/B | 13,000,000.00 | 12,981,718.10 | |
| | US TREASURY N/B | 20,000,000.00 | 20,982,812.00 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 7,351,913.80 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 13,176,093.60 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 12,546,093.60 | |
| | US TREASURY N/B | 14,000,000.00 | 14,838,359.20 | |
| | US TREASURY N/B | 9,500,000.00 | 12,337,753.55 | |
| | US TREASURY N/B | 11,000,000.00 | 12,097,850.60 | |
| | US TREASURY N/B | 14,000,000.00 | 14,780,936.80 | |
| | US TREASURY N/B | 11,000,000.00 | 11,670,741.50 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,625,390.00 | |
| | US TREASURY N/B | 9,000,000.00 | 10,003,710.60 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,524,218.00 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 7,319,375.00 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,425,390.00 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 13,482,187.20 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,271,875.00 | |
| | US TREASURY N/B | 9,000,000.00 | 9,242,577.90 | |
| | US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,106,562.40 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 13,676,250.00 | |
| | US TREASURY N/B | 9,000,000.00 | 9,281,250.00 | |
| | US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,164,296.80 | |
| | US TREASURY N/B | 10,500,000.00 | 12,047,928.90 | |
| | US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,391,406.00 | |
| | US TREASURY N/B | 6,000,000.00 | 6,360,702.60 | |
| | US TREASURY N/B | 6,500,000.00 | 6,955,507.65 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 7,462,109.20 | |
| | US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,241,640.40 | |
| | US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 9,441,874.40 | |
| | US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,187,968.40 | |
| | US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 8,862,500.00 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 13,313,437.20 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 11,789,843.00 | |

| | | | | |
|--|-----------------|---------------|---------------|--|
| | US TREASURY N/B | 11,000,000.00 | 12,110,312.50 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 11,013,281.00 | |
| | US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 8,861,874.40 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 11,751,562.00 | |
| | US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 8,737,500.00 | |
| | US TREASURY N/B | 13,000,000.00 | 14,508,202.80 | |
| | US TREASURY N/B | 9,000,000.00 | 10,006,171.20 | |
| | US TREASURY N/B | 7,500,000.00 | 8,295,702.75 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 11,195,312.00 | |
| | US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,228,593.60 | |
| | US TREASURY N/B | 6,000,000.00 | 7,099,452.60 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,969,531.00 | |
| | US TREASURY N/B | 9,000,000.00 | 9,759,023.10 | |
| | US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,312,187.20 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 12,019,531.00 | |
| | US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,261,523.00 | |
| | US TREASURY N/B | 11,000,000.00 | 12,980,000.00 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 13,211,250.00 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 11,426,562.00 | |
| | US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 3,304,687.50 | |
| | US TREASURY N/B | 9,000,000.00 | 10,515,937.50 | |
| | US TREASURY N/B | 6,000,000.00 | 6,476,952.60 | |
| | US TREASURY N/B | 6,000,000.00 | 7,083,750.00 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 12,201,561.60 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 11,677,734.00 | |
| | US TREASURY N/B | 10,600,000.00 | 11,692,710.54 | |
| | US TREASURY N/B | 13,000,000.00 | 14,668,670.90 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------------------|------------------|-------------------|----|
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 9,200,000.00 | 10,701,468.52 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 13,745,624.40 | |
| | US TREASURY N/B | 20,000,000.00 | 23,281,250.00 | |
| | US TREASURY N/B | 19,000,000.00 | 21,945,000.00 | |
| | US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 13,027,500.00 | |
| | US TREASURY N/B | 12,500,000.00 | 13,540,038.75 | |
| | US TREASURY N/B | 20,500,000.00 | 23,869,687.50 | |
| | US TREASURY N/B | 22,000,000.00 | 24,675,233.00 | |
| | US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,130,312.40 | |
| | US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 8,142,187.20 | |
| | US TREASURY N/B | 4,600,000.00 | 7,059,562.50 | |
| | US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,826,250.00 | |
| | US TREASURY N/B | 7,800,000.00 | 10,032,140.04 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 7,704,921.70 | |
| | US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 12,454,687.00 | |
| | US TREASURY N/B | 11,000,000.00 | 14,235,546.60 | |
| | US TREASURY N/B | 14,000,000.00 | 17,776,718.40 | |
| | US TREASURY N/B | 9,000,000.00 | 11,870,858.70 | |
| | US TREASURY N/B | 14,000,000.00 | 17,774,530.20 | |
| | US TREASURY N/B | 14,000,000.00 | 16,385,468.40 | |
| | US TREASURY N/B | 11,300,000.00 | 14,071,147.59 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 9,420,468.40 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 8,894,375.00 | |
| | US TREASURY N/B | 5,500,000.00 | 5,593,671.60 | |
| | US TREASURY NOTE | 17,000,000.00 | 17,587,695.10 | |
| | US TREASURY NOTE | 7,000,000.00 | 7,251,835.50 | |
| | US TREASURY NOTE | 21,500,000.00 | 22,798,397.90 | |
| | US TREASURY NOTE | 8,000,000.00 | 8,217,187.20 | |
| | US TREASURY NOTE | 13,300,000.00 | 14,174,369.93 | |
| | US TREASURY NOTE | 7,000,000.00 | 7,121,952.60 | |
| | US TREASURY NOTE | 14,700,000.00 | 16,005,198.30 | |
| | US TREASURY NOTE | 7,500,000.00 | 8,866,992.00 | |
| 米ドル計 | 銘柄数：137 | 1,278,900,000.00 | 1,440,947,057.18 | |
| | | | (114,872,299,398) | |
| | 組入時価比率：41.3% | | 42.1% | |
| | CANADA GOVERNMENT | 1,000,000.00 | 1,069,050.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1,000,000.00 | 1,042,630.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 7,100,000.00 | 7,272,530.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4,500,000.00 | 4,575,330.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,500,000.00 | 3,514,630.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1,000,000.00 | 1,013,880.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4,570,000.00 | 4,919,010.90 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 6,300,000.00 | 6,525,666.00 | |

| | | | | |
|--------|---------------------|---------------|-----------------|--|
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5,800,000.00 | 5,901,906.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,800,000.00 | 4,157,998.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,500,000.00 | 3,693,305.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5,300,000.00 | 5,832,756.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4,000,000.00 | 4,215,760.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2,900,000.00 | 3,250,262.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2,500,000.00 | 2,880,900.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5,000,000.00 | 5,683,300.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,400,000.00 | 3,835,914.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2,900,000.00 | 3,228,077.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 900,000.00 | 1,596,654.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1,400,000.00 | 2,416,932.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,200,000.00 | 4,719,488.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,600,000.00 | 5,516,028.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 9,600,000.00 | 13,965,792.00 | |
| カナダドル計 | 銘柄数：23 | 86,770,000.00 | 100,827,798.90 | |
| | | | (8,025,892,792) | |
| | 組入時価比率：2.9% | | 2.9% | |
| | | | | |
| | UK TREASURY | 6,500,000.00 | 6,719,050.00 | |
| | UK TREASURY | 6,700,000.00 | 7,410,870.00 | |
| | UK TREASURY | 6,500,000.00 | 6,890,650.00 | |
| | UK TREASURY | 5,000,000.00 | 5,687,500.00 | |
| | UK TREASURY | 1,200,000.00 | 1,515,240.00 | |
| | UK TREASURY | 7,700,000.00 | 8,058,050.00 | |
| | UK TREASURY | 6,500,000.00 | 7,376,850.00 | |
| | UK TREASURY | 3,900,000.00 | 4,044,690.00 | |
| | UK TREASURY | 3,100,000.00 | 4,349,610.00 | |
| | UK TREASURY | 3,700,000.00 | 4,510,670.00 | |
| | UK TREASURY | 4,400,000.00 | 5,314,320.00 | |
| | UK TREASURY | 5,700,000.00 | 6,614,280.00 | |
| | UK TREASURY | 5,300,000.00 | 6,557,160.00 | |
| | UK TREASURY | 5,600,000.00 | 6,510,560.00 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------------|--------------------------------|----------------|------------------|----|
| 国債証券 | UK TREASURY | 3,600,000.00 | 5,505,120.00 | |
| | UK TREASURY | 4,300,000.00 | 5,011,220.00 | |
| | UK TREASURY | 4,000,000.00 | 4,748,000.00 | |
| | UK TREASURY | 4,300,000.00 | 5,608,060.00 | |
| | UK TREASURY | 3,700,000.00 | 4,495,130.00 | |
| | UK TREASURY | 2,800,000.00 | 4,091,640.00 | |
| | UK TREASURY | 4,300,000.00 | 5,493,250.00 | |
| | UK TREASURY | 5,000,000.00 | 5,996,500.00 | |
| | UK TREASURY | 8,500,000.00 | 10,154,950.00 | |
| | UK TREASURY | 5,600,000.00 | 7,220,080.00 | |
| | UK TREASURY | 4,300,000.00 | 5,133,340.00 | |
| | UK TREASURY | 800,000.00 | 955,040.00 | |
| | UK TREASURY | 13,800,000.00 | 17,238,960.00 | |
| | UK TREASURY | 2,300,000.00 | 2,781,850.00 | |
| | UNITED KINGDOM (GOVERNMENT) | 6,300,000.00 | 7,707,420.00 | |
| 英ポンド計 | 銘柄数：29 | 145,400,000.00 | 173,700,060.00 | |
| | | | (22,351,723,720) | |
| | 組入時価比率：8.0% | | 8.2% | |
| | | | | |
| | SWITZERLAND | 2,000,000.00 | 2,186,000.00 | |
| | SWITZERLAND GOVERNMENT | 5,900,000.00 | 7,120,120.00 | |
| | SWITZERLAND GOVERNMENT | 1,000,000.00 | 1,447,700.00 | |
| スイスフラン 計 | 銘柄数：3 | 8,900,000.00 | 10,753,820.00 | |
| | | | (924,075,752) | |
| | 組入時価比率：0.3% | | 0.3% | |
| | | | | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 16,000,000.00 | 17,782,400.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 16,200,000.00 | 17,938,260.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 14,300,000.00 | 15,376,075.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 13,000,000.00 | 14,663,350.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 18,000,000.00 | 21,339,000.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 30,400,000.00 | 38,916,560.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 12,000,000.00 | 15,855,600.00 | |
| スウェーデン クローナ計 | 銘柄数：7 | 119,900,000.00 | 141,871,245.00 | |
| | | | (1,644,287,729) | |
| | 組入時価比率：0.6% | | 0.6% | |
| | | | | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 16,500,000.00 | 17,319,060.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 15,000,000.00 | 16,575,000.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 12,200,000.00 | 13,767,700.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 10,000,000.00 | 11,787,500.00 | |

| | | | | |
|----------------|--------------------------|----------------|-----------------|--|
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 5,800,000.00 | 6,641,464.00 | |
| ノルウェーク ローネ計 | 銘柄数：5 | 59,500,000.00 | 66,090,724.00 | |
| | | | (903,460,197) | |
| | 組入時価比率：0.3% | | 0.3% | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 25,000,000.00 | 26,805,000.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 26,000,000.00 | 29,302,000.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 14,000,000.00 | 16,413,880.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 23,500,000.00 | 28,453,800.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 17,500,000.00 | 19,965,750.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 7,000,000.00 | 11,111,100.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 28,500,000.00 | 42,465,000.00 | |
| デンマークク ローネ計 | 銘柄数：7 | 141,500,000.00 | 174,516,530.00 | |
| | | | (2,422,289,436) | |
| | 組入時価比率：0.9% | | 0.9% | |
| | BELGIUM KINGDOM | 5,300,000.00 | 5,603,175.90 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 2,700,000.00 | 2,930,040.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 5,200,000.00 | 5,529,680.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 700,000.00 | 753,970.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 3,000,000.00 | 3,148,200.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 3,500,000.00 | 3,697,050.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4,200,000.00 | 4,509,120.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 3,500,000.00 | 4,155,725.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5,500,000.00 | 5,898,750.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4,500,000.00 | 4,747,500.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4,000,000.00 | 4,343,600.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 3,000,000.00 | 3,482,250.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 3,000,000.00 | 3,257,400.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 3,000,000.00 | 3,246,600.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4,365,000.00 | 5,329,665.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 7,500,000.00 | 8,863,762.50 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,000,000.00 | 7,095,900.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 300,000.00 | 296,100.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2,000,000.00 | 1,948,100.00 | |

| | | | | |
|--|-----------------------------|---------------|--------------|--|
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 10,000,000.00 | 9,523,000.00 | |
|--|-----------------------------|---------------|--------------|--|

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|--------------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,000,000.00 | 2,911,650.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 6,500,000.00 | 6,177,275.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,000,000.00 | 3,730,200.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,500,000.00 | 4,243,500.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,500,000.00 | 4,143,600.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,500,000.00 | 4,023,000.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,300,000.00 | 4,966,100.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,800,000.00 | 5,619,620.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 9,200,000.00 | 8,167,760.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,000,000.00 | 3,196,400.00 | |
| | BUNDES OblIGATION | 6,000,000.00 | 6,343,800.00 | |
| | BUNDES OblIGATION | 6,000,000.00 | 6,390,000.00 | |
| | BUNDES OblIGATION | 5,000,000.00 | 5,474,500.00 | |
| | BUNDES OblIGATION | 1,500,000.00 | 1,552,500.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 11,500,000.00 | 11,985,875.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 11,000,000.00 | 11,760,100.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 12,000,000.00 | 13,065,600.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,500,000.00 | 7,118,800.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,000,000.00 | 9,857,700.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 13,500,000.00 | 15,078,825.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,800,000.00 | 8,960,250.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,000,000.00 | 6,899,700.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,000,000.00 | 5,923,000.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,000,000.00 | 8,274,700.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,000,000.00 | 7,236,000.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,600,000.00 | 7,812,420.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,500,000.00 | 7,619,950.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,000,000.00 | 8,121,400.00 | |

| | | | | |
|--|-----------------------------|---------------|---------------|--|
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,000,000.00 | 6,852,000.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,500,000.00 | 6,054,950.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,500,000.00 | 11,051,350.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,600,000.00 | 9,707,280.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,000,000.00 | 4,704,600.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,600,000.00 | 6,686,100.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,000,000.00 | 6,310,000.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,000,000.00 | 10,384,500.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,500,000.00 | 9,291,490.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 8,500,000.00 | 11,264,200.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,100,000.00 | 7,173,150.00 | |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,100,000.00 | 3,197,604.90 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 17,700,000.00 | 18,043,026.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 11,000,000.00 | 11,147,620.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,000,000.00 | 6,027,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,500,000.00 | 10,692,150.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 11,500,000.00 | 11,727,700.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,200,000.00 | 5,096,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 14,000,000.00 | 13,995,800.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,000,000.00 | 1,981,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 14,500,000.00 | 14,289,750.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,500,000.00 | 5,423,550.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,200,000.00 | 7,394,400.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,500,000.00 | 7,411,500.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,000,000.00 | 4,914,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,000,000.00 | 5,766,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,000,000.00 | 5,817,000.00 | |

| | | | | |
|--|--------------------------|---------------|---------------|--|
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,500,000.00 | 6,184,750.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,000,000.00 | 5,751,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,000,000.00 | 5,649,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,000,000.00 | 6,436,500.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,000,000.00 | 4,470,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,300,000.00 | 4,695,270.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,000,000.00 | 5,724,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,200,000.00 | 4,042,920.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,000,000.00 | 5,581,800.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,300,000.00 | 12,872,940.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,500,000.00 | 6,160,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,700,000.00 | 8,005,690.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,250,000.00 | 6,764,250.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9,600,000.00 | 9,523,200.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,400,000.00 | 6,193,920.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,400,000.00 | 4,770,900.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,800,000.00 | 2,943,100.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,700,000.00 | 5,845,080.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,500,000.00 | 2,171,750.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2,500,000.00 | 2,670,500.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1,500,000.00 | 1,677,225.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 3,200,000.00 | 3,650,720.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1,300,000.00 | 1,543,555.00 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|----------------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 2,500,000.00 | 2,797,625.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2,200,000.00 | 2,481,710.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1,500,000.00 | 1,768,350.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 12,000,000.00 | 12,615,600.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,000,000.00 | 9,601,200.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6,800,000.00 | 7,347,400.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8,200,000.00 | 8,822,380.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 10,500,000.00 | 11,174,100.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 10,000,000.00 | 10,750,000.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 10,500,000.00 | 12,127,500.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8,500,000.00 | 9,367,850.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6,500,000.00 | 7,308,275.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6,500,000.00 | 7,264,400.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,800,000.00 | 6,571,400.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 7,200,000.00 | 8,126,640.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3,500,000.00 | 4,964,750.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4,200,000.00 | 4,588,710.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8,000,000.00 | 8,551,200.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8,000,000.00 | 7,961,600.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,000,000.00 | 9,738,900.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,000,000.00 | 9,361,800.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,500,000.00 | 8,343,775.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8,000,000.00 | 8,972,800.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4,500,000.00 | 5,864,400.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6,500,000.00 | 6,672,250.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,000,000.00 | 6,295,750.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,000,000.00 | 6,616,500.00 | |

| | | | | |
|--|-----------------------------|---------------|---------------|--|
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,000,000.00 | 5,937,500.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,100,000.00 | 9,742,915.00 | |
| | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 11,400,000.00 | 13,227,420.00 | |
| | FRENCH TREASURY NOTE | 5,000,000.00 | 5,169,000.00 | |
| | FRENCH TREASURY NOTE | 4,500,000.00 | 4,735,125.00 | |
| | FRENCH TREASURY NOTE | 5,500,000.00 | 5,749,128.00 | |
| | FRENCH TREASURY NOTE | 3,500,000.00 | 3,615,150.00 | |
| | FRENCH TREASURY NOTE | 6,200,000.00 | 6,432,245.80 | |
| | IRELAND(REP OF) | 3,700,000.00 | 3,650,050.00 | |
| | IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4 | 2,600,000.00 | 2,281,604.00 | |
| | IRISH GOVERNMENT | 2,120,000.00 | 2,054,534.40 | |
| | IRISH GOVERNMENT | 3,000,000.00 | 2,695,080.00 | |
| | IRISH GOVERNMENT | 1,000,000.00 | 952,500.00 | |
| | IRISH GOVERNMENT | 3,500,000.00 | 3,031,805.00 | |
| | IRISH GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 1,780,000.00 | |
| | IRISH GOVERNMENT | 2,200,000.00 | 1,957,762.40 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5,000,000.00 | 5,375,000.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,500,000.00 | 4,778,550.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 6,000,000.00 | 6,507,600.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 6,700,000.00 | 7,563,630.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 6,000,000.00 | 6,993,000.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3,800,000.00 | 4,373,420.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,000,000.00 | 4,636,000.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,300,000.00 | 4,838,790.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,000,000.00 | 4,426,400.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2,500,000.00 | 2,865,250.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,470,000.00 | 6,731,820.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2,900,000.00 | 4,002,290.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5,100,000.00 | 6,398,970.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 900,000.00 | 1,120,050.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,000,000.00 | 3,161,250.00 | |

| | | | | |
|--|---------------------|---------------|---------------|--|
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,000,000.00 | 4,325,000.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,000,000.00 | 2,134,000.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,700,000.00 | 4,001,550.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,000,000.00 | 4,452,800.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,500,000.00 | 5,179,014.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,000,000.00 | 3,427,950.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,500,000.00 | 3,899,000.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,500,000.00 | 4,874,400.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,500,000.00 | 1,638,000.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,300,000.00 | 2,779,320.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,700,000.00 | 2,347,785.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,700,000.00 | 4,252,040.00 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 9,200,000.00 | 9,327,880.00 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 7,900,000.00 | 8,080,515.00 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 10,500,000.00 | 10,620,750.00 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 5,000,000.00 | 5,062,500.00 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 6,300,000.00 | 6,016,500.00 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 3,960,000.00 | 3,657,852.00 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------|------------------------|----------------|-------------------|----|
| 国債証券 | SPANISH GOVERNMENT | 6,200,000.00 | 4,522,280.00 | |
| ユーロ計 | 銘柄数：175 | 995,965,000.00 | 1,074,185,444.90 | |
| | | | (110,823,712,350) | |
| | 組入時価比率：39.8% | | 40.6% | |
| | | | | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 10,300,000.00 | 10,341,200.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 11,400,000.00 | 11,616,600.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 5,600,000.00 | 5,712,560.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 13,100,000.00 | 13,705,220.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 3,000,000.00 | 3,008,400.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 10,600,000.00 | 10,721,370.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 9,000,000.00 | 9,153,000.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 6,000,000.00 | 5,994,000.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 9,800,000.00 | 10,069,500.00 | |
| ズロチ計 | 銘柄数：9 | 78,800,000.00 | 80,321,850.00 | |
| | | | (1,955,837,047) | |
| | 組入時価比率：0.7% | | 0.7% | |
| | | | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,700,000.00 | 2,897,999.10 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 2,163,146.00 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,400,000.00 | 2,746,459.20 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,700,000.00 | 3,223,951.20 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3,500,000.00 | 4,005,662.50 | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,900,000.00 | 2,218,215.80 | |
| シンガポールドル計 | 銘柄数：6 | 15,200,000.00 | 17,255,433.80 | |
| | | | (1,099,171,133) | |
| | 組入時価比率：0.4% | | 0.4% | |
| | | | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3,300,000.00 | 3,316,269.00 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 9,500,000.00 | 9,862,368.00 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,200,000.00 | 2,233,418.00 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 14,500,000.00 | 15,087,946.00 | |

| | | | | |
|------|--------------------------|---------------|-----------------|--|
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 8,500,000.00 | 8,881,165.50 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 10,400,000.00 | 11,011,010.40 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,800,000.00 | 2,933,868.00 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,200,000.00 | 4,009,714.80 | |
| リング計 | 銘柄数：8 | 55,400,000.00 | 57,335,759.70 | |
| | | | (1,487,862,964) | |
| | 組入時価比率：0.5% | | 0.5% | |
| | | | | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 6,500,000.00 | 6,729,651.50 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3,400,000.00 | 3,645,721.40 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 8,000,000.00 | 8,805,328.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3,400,000.00 | 3,662,619.40 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5,800,000.00 | 6,626,378.20 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 6,400,000.00 | 7,267,398.40 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3,700,000.00 | 4,044,111.10 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 6,400,000.00 | 7,633,472.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2,800,000.00 | 3,371,760.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1,000,000.00 | 1,120,943.00 | |
| 豪ドル計 | 銘柄数：10 | 47,400,000.00 | 52,907,383.00 | |
| | | | (4,245,288,411) | |
| | 組入時価比率：1.5% | | 1.6% | |
| | | | | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 34,000,000.00 | 35,607,962.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 35,000,000.00 | 38,371,235.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 40,000,000.00 | 44,678,360.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 43,000,000.00 | 48,976,226.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 25,000,000.00 | 25,794,875.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 18,000,000.00 | 23,708,160.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 59,000,000.00 | 62,968,340.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 49,000,000.00 | 63,327,845.00 | |
| | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8,000,000.00 | 8,418,160.00 | |

| | | | | |
|-------------|-----------------------------|----------------|-------------------|--|
| | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 65,000,000.00 | 72,390,630.00 | |
| メキシコペソ 計 | 銘柄数：10 | 376,000,000.00 | 424,241,793.00 | |
| | | | (2,494,541,742) | |
| | 組入時価比率：0.9% | | 0.9% | |
| 国債証券計 | | | 273,250,442,671 | |
| | | | (273,250,442,671) | |
| 合計 | | | 273,250,442,671 | |
| | | | (273,250,442,671) | |

- (注) 1 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
 2 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
 3 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 平成24年5月10日現在 | | | |
|---------------------|--------------|-------|-------------|-----------|
| | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 為替予約取引 | | | | |
| 売建 | 776,531,155 | | 773,640,100 | 2,891,055 |
| 米ドル | 331,223,125 | | 330,796,500 | 426,625 |
| カナダドル | 19,934,634 | | 19,897,500 | 37,134 |
| 英ポンド | 68,294,059 | | 68,195,100 | 98,959 |
| デンマーククローネ | 4,457,859 | | 4,438,400 | 19,459 |
| ユーロ | 321,748,467 | | 319,796,000 | 1,952,467 |
| ズロチ | 9,880,564 | | 9,736,000 | 144,564 |
| 豪ドル | 9,654,975 | | 9,627,600 | 27,375 |
| メキシコペソ | 11,337,472 | | 11,153,000 | 184,472 |
| 合計 | 776,531,155 | | 773,640,100 | 2,891,055 |

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成24年5月31日現在

| | | |
|----------------|---------------|---|
| 資産総額 | 1,019,027,955 | 円 |
| 負債総額 | 454,003 | 円 |
| 純資産総額(-) | 1,018,573,952 | 円 |
| 発行済口数 | 1,256,441,649 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.8107 | 円 |

<ご参考>

「国内株式マザーファンド」

| | | |
|----------------|-----------------|---|
| 資産総額 | 149,049,878,667 | 円 |
| 負債総額 | 18,560,830,684 | 円 |
| 純資産総額(-) | 130,489,047,983 | 円 |
| 発行済口数 | 210,897,763,892 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.6187 | 円 |

「外国株式MSCI-KOKUSA1マザーファンド」

| | | |
|----------------|-----------------|---|
| 資産総額 | 191,125,687,539 | 円 |
| 負債総額 | 810,379,270 | 円 |
| 純資産総額(-) | 190,315,308,269 | 円 |
| 発行済口数 | 207,571,644,132 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.9169 | 円 |

「国内債券マザーファンド」

| | | |
|----------------|---------------|---|
| 資産総額 | 5,742,810,092 | 円 |
| 負債総額 | 152,864,234 | 円 |
| 純資産総額(-) | 5,589,945,858 | 円 |
| 発行済口数 | 4,664,859,865 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.1983 | 円 |

「外国債券マザーファンド」

| | | |
|----------------|-----------------|---|
| 資産総額 | 269,073,919,291 | 円 |
| 負債総額 | 656,468,217 | 円 |
| 純資産総額(-) | 268,417,451,074 | 円 |
| 発行済口数 | 187,281,937,811 | 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.4332 | 円 |

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成24年6月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

当社は委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表執行役ならびに執行役、指名委員会、監査委員会および報酬委員会をおきますが、代表取締役および監査役会は設けません。各機関の権限は以下のとおりであります。

株主総会

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

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また執行役・代表執行役、各委員会の委員等を選任し、取締役および執行役の職務の執行を監督します。

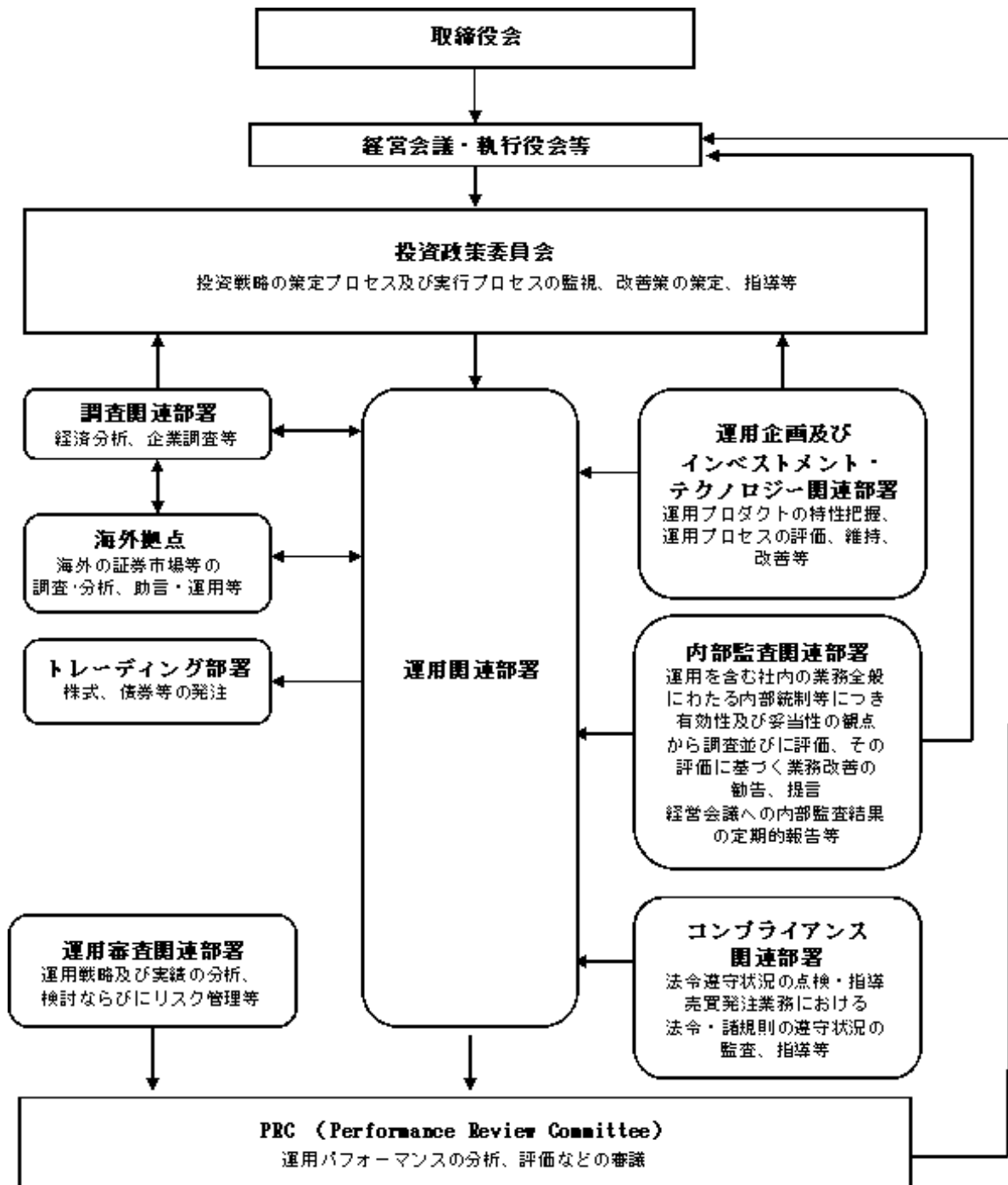
代表執行役・執行役

各執行役は、当社の業務の執行を行います。代表執行役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表執行役および執行役で構成される経営会議および執行役会が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役会で選定された執行役員が含まれます。

委員会

取締役3名以上（但し、各委員につき過半数は社外取締役であって執行役でない者）で構成され、イ）指名委員会は、株主総会に提出する取締役の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定し、ロ）報酬委員会は取締役・執行役が受ける個人別の報酬の決定に関する方針を定め、かつそれに従って各報酬の内容を決定し、ハ）監査委員会は取締役・執行役の職務執行の適法性ならびに妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定します。

(b) 投資信託の運用体制



2 【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成24年5月31日現在次の通りです（ただし、親投資信託を除きます。）。

| 種類 | 本数 | 純資産総額（百万円） |
|------------|-----|------------|
| 追加型株式投資信託 | 765 | 9,242,877 |
| 単位型株式投資信託 | 41 | 217,443 |
| 追加型公社債投資信託 | 18 | 4,682,632 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 合計 | 824 | 14,142,952 |

3 【委託会社等の経理状況】

- 1 . 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
- 2 . 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- 3 . 委託会社の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(平成23年4月1日から平成24年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 | （平成23年 | 当事業年度 | （平成24年 |
|----------|----------|---------|---------|---------|--------|
| | | 3月31日) | | 3月31日) | |
| | | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| (資産の部) | | | | | |
| 流動資産 | | | | | |
| 現金・預金 | | | 538 | | 240 |
| 金銭の信託 | | | 39,575 | | 50,326 |
| 有価証券 | | | 1,400 | | 1,800 |
| 短期貸付金 | | | 166 | | 153 |
| 前払金 | | | 0 | | - |
| 前払費用 | | | 41 | | 37 |
| 未収入金 | | | 171 | | 217 |
| 未収委託者報酬 | | | 10,032 | | 8,149 |
| 未収収益 | | | 3,761 | | 4,200 |
| 繰延税金資産 | | | 1,736 | | 1,402 |
| その他 | | | 12 | | 14 |
| 貸倒引当金 | | | 6 | | 6 |
| 流動資産計 | | | 57,430 | | 66,535 |
| 固定資産 | | | | | |
| 有形固定資産 | | | 1,823 | | 1,677 |
| 建物 | 2 | 576 | | 516 | |
| 器具備品 | 2 | 1,246 | | 1,161 | |
| 無形固定資産 | | | 10,649 | | 9,754 |
| ソフトウェア | | 10,647 | | 9,753 | |
| 電話加入権 | | 1 | | 1 | |
| その他 | | 0 | | 0 | |
| 投資その他の資産 | | | 32,430 | | 21,505 |
| 投資有価証券 | | 8,648 | | 6,691 | |
| 関係会社株式 | | 22,609 | | 14,429 | |
| 従業員長期貸付金 | | 235 | | 29 | |
| 長期差入保証金 | | 64 | | 57 | |
| 長期前払費用 | | 24 | | 23 | |
| 繰延税金資産 | | 582 | | - | |
| その他 | | 265 | | 273 | |
| 貸倒引当金 | | 0 | | 0 | |
| 固定資産計 | | | 44,903 | | 32,937 |
| 資産合計 | | | 102,333 | | 99,472 |

| | | 前事業年度 3月31日 | (平成23年) | 当事業年度 3月31日 | (平成24年) |
|-----------------|----------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 区分 | 注記 番号 | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| (負債の部) | | | | | |
| 流動負債 | | | | | |
| 関係会社短期借入金 | | | 8,000 | | 8,500 |
| 預り金 | | | 87 | | 93 |
| 未払金 | 1 | | 7,645 | | 6,276 |
| 未払収益分配金 | | 4 | | 4 | |
| 未払償還金 | | 79 | | 50 | |
| 未払手数料 | | 4,517 | | 3,610 | |
| その他未払金 | | 3,043 | | 2,610 | |
| 未払費用 | 1 | | 7,373 | | 6,760 |
| 未払法人税等 | | | 800 | | 856 |
| 前受収益 | | | 9 | | 6 |
| 賞与引当金 | | | 2,900 | | 2,816 |
| 流動負債計 | | | 26,818 | | 25,310 |
| 固定負債 | | | | | |
| 退職給付引当金 | | | 4,064 | | 2,437 |
| 時効後支払損引当金 | | | 481 | | 489 |
| 繰延税金負債 | | | - | | 7 |
| その他 | | | 65 | | - |
| 固定負債計 | | | 4,611 | | 2,934 |
| 負債合計 | | | 31,429 | | 28,244 |
| (純資産の部) | | | | | |
| 株主資本 | | | | | |
| 資本金 | | | 68,279 | | 68,521 |
| 資本剰余金 | | | 17,180 | | 17,180 |
| 資本準備金 | | 11,729 | | 11,729 | |
| 利益剰余金 | | | 11,729 | | 11,729 |
| 利益準備金 | | 685 | | 685 | |
| その他利益剰余金 | | 38,684 | | 38,926 | |
| 別途積立金 | | 24,606 | | 24,606 | |
| 繰越利益剰余金 | | 14,077 | | 14,320 | |
| 評価・換算差額等 | | | 2,624 | | 2,705 |
| その他有価証券評価差額金 | | | 2,694 | | 2,693 |
| 繰延ヘッジ損益 | | | 69 | | 12 |
| 純資産合計 | | | 70,903 | | 71,227 |
| 負債・純資産合計 | | | 102,333 | | 99,472 |

(2) 【損益計算書】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) | | 当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日) | |
|-----------|----------|---|--------|---|--------|
| | | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| 営業収益 | | | | | |
| 委託者報酬 | | | 81,230 | | 78,412 |
| 運用受託報酬 | | | 13,165 | | 17,784 |
| その他営業収益 | | | 143 | | 129 |
| 営業収益計 | | | 94,539 | | 96,325 |
| 営業費用 | | | | | |
| 支払手数料 | | | 39,741 | | 40,671 |
| 広告宣伝費 | | | 1,155 | | 952 |
| 公告費 | | | - | | 0 |
| 受益証券発行費 | | | 6 | | 5 |
| 調査費 | | | 20,709 | | 19,308 |
| 調査費 | | 1,310 | | 1,108 | |
| 委託調査費 | | 19,398 | | 18,200 | |
| 委託計算費 | | | 917 | | 931 |
| 営業雑経費 | | | 2,451 | | 2,523 |
| 通信費 | | 207 | | 213 | |
| 印刷費 | | 1,148 | | 1,085 | |
| 協会費 | | 73 | | 76 | |
| 諸経費 | | 1,022 | | 1,147 | |
| 営業費用計 | | | 64,980 | | 64,393 |
| 一般管理費 | | | | | |
| 給料 | | | 10,131 | | 9,635 |
| 役員報酬 | 2 | 322 | | 252 | |
| 給料・手当 | | 6,822 | | 6,602 | |
| 賞与 | | 2,987 | | 2,780 | |
| 交際費 | | | 141 | | 140 |
| 旅費交通費 | | | 484 | | 473 |
| 租税公課 | | | 231 | | 224 |
| 不動産賃借料 | | | 1,452 | | 1,309 |
| 退職給付費用 | | | 1,054 | | 1,039 |
| 固定資産減価償却費 | | | 4,575 | | 4,354 |
| 諸経費 | | | 6,106 | | 6,204 |
| 一般管理費計 | | | 24,176 | | 23,381 |
| 営業利益 | | | 5,382 | | 8,550 |

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) | | 当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日) | |
|---------------|----------|---|--------|---|--------|
| | | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| 営業外収益 | | | | | |
| 受取配当金 | 1 | 4,771 | | 4,116 | |
| 収益分配金 | | 9 | | 9 | |
| 受取利息 | | 6 | | 3 | |
| 金銭の信託運用益 | | 1,222 | | 377 | |
| 為替差益 | | 62 | | 55 | |
| その他 | | 319 | | 360 | |
| 営業外収益計 | | | 6,391 | | 4,924 |
| 営業外費用 | | | | | |
| 支払利息 | 1 | 75 | | 54 | |
| 時効後支払損引当金繰入額 | | 13 | | 38 | |
| その他 | | 9 | | 11 | |
| 営業外費用計 | | | 98 | | 104 |
| 経常利益 | | | 11,676 | | 13,370 |
| 特別利益 | | | | | |
| 投資有価証券等売却益 | | 419 | | 36 | |
| 株式報酬受入益 | | 173 | | 177 | |
| 特別利益計 | | | 593 | | 214 |
| 特別損失 | | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 149 | | 136 | |
| 投資有価証券等評価損 | | 10 | | 1 | |
| 固定資産除却損 | 3 | 412 | | 82 | |
| システム利用契約解約違約金 | | 20 | | - | |
| 特別損失計 | | | 591 | | 221 |
| 税引前当期純利益 | | | 11,677 | | 13,363 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | | 3,759 | | 3,625 |
| 法人税等調整額 | | | 108 | | 1,228 |
| 当期純利益 | | | 7,810 | | 8,509 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

| | 前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日) |
|----------|---|---|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 当期首残高 | 17,180 | 17,180 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 17,180 | 17,180 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | |
| 当期首残高 | 11,729 | 11,729 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 11,729 | 11,729 |
| 資本剰余金合計 | | |
| 当期首残高 | 11,729 | 11,729 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 11,729 | 11,729 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | |
| 当期首残高 | 685 | 685 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 685 | 685 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | | |
| 当期首残高 | 24,606 | 24,606 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 24,606 | 24,606 |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 9,872 | 14,077 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 3,605 | 8,267 |
| 当期純利益 | 7,810 | 8,509 |
| 当期変動額合計 | 4,204 | 242 |
| 当期末残高 | 14,077 | 14,320 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 当期首残高 | 35,164 | 39,369 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 3,605 | 8,267 |
| 当期純利益 | 7,810 | 8,509 |
| 当期変動額合計 | 4,204 | 242 |
| 当期末残高 | 39,369 | 39,611 |

| | | |
|---------------------|--------|--------|
| 株主資本合計 | | |
| 当期首残高 | 64,074 | 68,279 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 3,605 | 8,267 |
| 当期純利益 | 7,810 | 8,509 |
| 当期変動額合計 | 4,204 | 242 |
| 当期末残高 | 68,279 | 68,521 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 当期首残高 | 3,056 | 2,694 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 361 | 0 |
| 当期変動額合計 | 361 | 0 |
| 当期末残高 | 2,694 | 2,693 |
| 繰延ヘッジ損益 | | |
| 当期首残高 | 175 | 69 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 245 | 82 |
| 当期変動額合計 | 245 | 82 |
| 当期末残高 | 69 | 12 |
| 評価・換算差額等合計 | | |
| 当期首残高 | 3,231 | 2,624 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 607 | 81 |
| 当期変動額合計 | 607 | 81 |
| 当期末残高 | 2,624 | 2,705 |
| 純資産合計 | | |
| 当期首残高 | 67,306 | 70,903 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 3,605 | 8,267 |
| 当期純利益 | 7,810 | 8,509 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 607 | 81 |
| 当期変動額合計 | 3,597 | 324 |
| 当期末残高 | 70,903 | 71,227 |

[重要な会計方針]

| | | | | | | | | | |
|-------------------------|--|----|--------|------|-------|-----|-----|------|-------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p> | | | | | | | | |
| 2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法 | 時価法 | | | | | | | | |
| 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 | | | | | | | | |
| 4. 固定資産の減価償却の方法 | <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法によっております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="766 824 1066 958"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間に基づく定額法によっております。</p> | 建物 | 38～50年 | 附属設備 | 8～15年 | 構築物 | 20年 | 器具備品 | 4～15年 |
| 建物 | 38～50年 | | | | | | | | |
| 附属設備 | 8～15年 | | | | | | | | |
| 構築物 | 20年 | | | | | | | | |
| 器具備品 | 4～15年 | | | | | | | | |
| 5. 引当金の計上基準 | <p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> | | | | | | | | |
| 6. リース取引の処理方法 | リース取引開始日が平成20年4月1日より前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。 | | | | | | | | |

| | |
|----------------|---|
| 7. ヘッジ会計 | <p>(1)ヘッジ会計の方法 ヘッジ会計は、原則として、時価評価されているヘッジ手段に係る損益を、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで純資産の部において繰り延べる方法によっております。 また、為替予約が付されている外貨建金銭債権については、振当処理を行っております。</p> <p>(2)ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段 - 為替予約 ヘッジ対象 - 投資有価証券、短期貸付金</p> <p>(3)ヘッジ方針 投資有価証券及び短期貸付金に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4)ヘッジ有効性評価の方法 為替変動リスクのヘッジにつきましては、そのリスク減殺効果を、対応するヘッジ手段ならびにヘッジ対象ごとに定期的に把握し、ヘッジの有効性を確かめております。</p> |
| 8. 消費税等の会計処理方法 | 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。 |
| 9. 連結納税制度の適用 | 連結納税制度を適用しております。 |

[追加情報]

| |
|---|
| 当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日) |
| (会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用) 当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。 |

[注記事項]

貸借対照表関係

| 前事業年度末 (平成23年 3月31日) | 当事業年度末 (平成24年 3月31日) | | | | | | | | | | | | |
|---|-------------------------|----------|------|-------|---|-------|---|------|--------|------|-------|----|-------|
| 1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払金</td> <td style="text-align: right;">2,442百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">762</td> </tr> </table> | 未払金 | 2,442百万円 | 未払費用 | 762 | 1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払金</td> <td style="text-align: right;">2,320百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,267</td> </tr> </table> | 未払金 | 2,320百万円 | 未払費用 | 1,267 | | | | |
| 未払金 | 2,442百万円 | | | | | | | | | | | | |
| 未払費用 | 762 | | | | | | | | | | | | |
| 未払金 | 2,320百万円 | | | | | | | | | | | | |
| 未払費用 | 1,267 | | | | | | | | | | | | |
| 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">437百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,874</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,311</td> </tr> </table> | 建物 | 437百万円 | 器具備品 | 1,874 | 合計 | 2,311 | 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">477百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">2,303</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,780</td> </tr> </table> | 建物 | 477百万円 | 器具備品 | 2,303 | 合計 | 2,780 |
| 建物 | 437百万円 | | | | | | | | | | | | |
| 器具備品 | 1,874 | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | 2,311 | | | | | | | | | | | | |
| 建物 | 477百万円 | | | | | | | | | | | | |
| 器具備品 | 2,303 | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | 2,780 | | | | | | | | | | | | |

損益計算書関係

| 前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日) |
|---|---|
| <p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 4,633百万円 支払利息 75</p> | <p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 3,776百万円 支払利息 54</p> |
| <p>2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。</p> | (同左) |
| <p>3. 固定資産除却損 ソフトウェア 412百万円</p> | <p>3. 固定資産除却損 建物 19百万円 器具備品 9 ソフトウェア 53</p> |
| <p>合計 412</p> | <p>合計 82</p> |

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首株式数 | 当事業年度増加株式数 | 当事業年度減少株式数 | 当事業年度末株式数 |
|-------|------------|------------|------------|------------|
| 普通株式 | 5,150,693株 | - | - | 5,150,693株 |

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成22年 5月27日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 3,605百万円

1株当たり配当額 700円

基準日 平成22年 3月31日

効力発生日 平成22年 6月 1日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首株式数 | 当事業年度増加株式数 | 当事業年度減少株式数 | 当事業年度末株式数 |
|-------|------------|------------|------------|------------|
| 普通株式 | 5,150,693株 | - | - | 5,150,693株 |

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成23年 7 月11日開催の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当財産の種類 野村ホールディングス株式会社株式

配当財産の帳簿価額 8,267百万円

1株当たり配当額 1,605円12銭

基準日 平成23年 7 月19日

効力発生日 平成23年 7 月20日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成24年 5 月16日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 3,090百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 600円

基準日 平成24年 3 月31日

効力発生日 平成24年 6 月 1 日

リース取引関係

| 前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|--|---------|--------|------------|-----|------------|---|---------|----|----------------|--|------|--------|-----|----|----|----|--------|--------|---------------|---|----------|----|---------|---|------|---|------|------|-----|---|----|----|--|------|--|---------|--------|------------|-----|------------|---|---------|----|----------------|--|------|--------|-----|---|----|----|--------|-------|---------------|---|----------|----|---------|---|------|---|------|-------|-----|----|----|----|
| <p>1. ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) 該当事項はありません。</p> <p>(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">器具備品</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">417百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">325</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減損損失累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">91</td> </tr> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額及びリース資産減損勘定期末残高</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">未経過リース料期末残高相当額</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">73 百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> </table> <p>リース資産減損勘定期末残高 - 百万円</p> <p>支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額及び減損損失</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">支払リース料</td> <td style="text-align: right;">103百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">リース資産減損勘定の取崩額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">3</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減損損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については利息法によっております。</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>未経過リース料</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">6百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">4</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">10</td> </tr> </table> | 器具備品 | | 取得価額相当額 | 417百万円 | 減価償却累計額相当額 | 325 | 減損損失累計額相当額 | - | 期末残高相当額 | 91 | 未経過リース料期末残高相当額 | | 1年以内 | 73 百万円 | 1年超 | 22 | 合計 | 96 | 支払リース料 | 103百万円 | リース資産減損勘定の取崩額 | - | 減価償却費相当額 | 96 | 支払利息相当額 | 3 | 減損損失 | - | 1年以内 | 6百万円 | 1年超 | 4 | 合計 | 10 | <p>1. ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) (同左)</p> <p>(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">器具備品</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">184百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">163</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減損損失累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">21</td> </tr> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額及びリース資産減損勘定期末残高</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">未経過リース料期末残高相当額</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">22 百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> </table> <p>リース資産減損勘定期末残高 - 百万円</p> <p>支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額及び減損損失</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">支払リース料</td> <td style="text-align: right;">75百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">リース資産減損勘定の取崩額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">70</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">1</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">減損損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 (同左)</p> <p>利息相当額の算定方法 (同左)</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>未経過リース料</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: right;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">15百万円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">1年超</td> <td style="text-align: right;">24</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">合計</td> <td style="text-align: right;">40</td> </tr> </table> | 器具備品 | | 取得価額相当額 | 184百万円 | 減価償却累計額相当額 | 163 | 減損損失累計額相当額 | - | 期末残高相当額 | 21 | 未経過リース料期末残高相当額 | | 1年以内 | 22 百万円 | 1年超 | - | 合計 | 22 | 支払リース料 | 75百万円 | リース資産減損勘定の取崩額 | - | 減価償却費相当額 | 70 | 支払利息相当額 | 1 | 減損損失 | - | 1年以内 | 15百万円 | 1年超 | 24 | 合計 | 40 |
| 器具備品 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 取得価額相当額 | 417百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減価償却累計額相当額 | 325 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減損損失累計額相当額 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 期末残高相当額 | 91 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未経過リース料期末残高相当額 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1年以内 | 73 百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1年超 | 22 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | 96 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 支払リース料 | 103百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| リース資産減損勘定の取崩額 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減価償却費相当額 | 96 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 支払利息相当額 | 3 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減損損失 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1年以内 | 6百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1年超 | 4 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | 10 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 器具備品 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 取得価額相当額 | 184百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減価償却累計額相当額 | 163 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減損損失累計額相当額 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 期末残高相当額 | 21 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未経過リース料期末残高相当額 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1年以内 | 22 百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1年超 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | 22 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 支払リース料 | 75百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| リース資産減損勘定の取崩額 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減価償却費相当額 | 70 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 支払利息相当額 | 1 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 減損損失 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1年以内 | 15百万円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1年超 | 24 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 合計 | 40 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

金融商品関係

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を投資有価証券として、あるいは特定金銭信託を通じ保有しております。直接または特定金銭信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万

円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|------------------|----------|---------|--------|
| (1)現金・預金 | 538 | 538 | - |
| (2)金銭の信託 | 39,575 | 39,575 | - |
| (3)短期貸付金 | 166 | 166 | - |
| (4)未収委託者報酬 | 10,032 | 10,032 | - |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | | | |
| 其他有価証券 | 9,252 | 9,252 | - |
| (6)関係会社株式 | 3,064 | 79,658 | 76,594 |
| 資産計 | 62,630 | 139,224 | 76,594 |
| (7)関係会社短期借入金 | 8,000 | 8,000 | - |
| (8)未払金 | 7,645 | 7,645 | - |
| 未払収益分配金 | 4 | 4 | - |
| 未払償還金 | 79 | 79 | - |
| 未払手数料 | 4,517 | 4,517 | - |
| 其他未払金 | 3,043 | 3,043 | - |
| (9)未払費用 | 7,373 | 7,373 | - |
| (10)未払法人税等 | 800 | 800 | - |
| 負債計 | 23,819 | 23,819 | - |
| (11)デリバティブ取引(*) | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | - | - | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | 65 | 65 | - |
| デリバティブ取引計 | 65 | 65 | - |

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(3) 短期貸付金、(4)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。ただし、短期貸付金は為替予約等の振当処理の対象とされており、円貨建債権とみて当該帳簿価額を以って時価としております。「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価格、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 関係会社短期借入金、(8) 未払金、(9) 未払費用、(10) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券796百万円、関係会社株式19,545百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|--------------|--------|-------------|--------------|------|
| 預金 | 537 | - | - | - |
| 金銭の信託 | 39,575 | - | - | - |
| 短期貸付金 | 166 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 10,032 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | 1,400 | 0 | 1 | - |
| 合計 | 51,713 | 0 | 1 | - |

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を投資有価証券として、あるいは特定金銭信託を通じ保有しております。直接または特定金銭信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万

円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|------------------|----------|---------|--------|
| (1)現金・預金 | 240 | 240 | - |
| (2)金銭の信託 | 50,326 | 50,326 | - |
| (3)短期貸付金 | 153 | 153 | - |
| (4)未収委託者報酬 | 8,149 | 8,149 | - |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | | | |
| 其他有価証券 | 7,725 | 7,725 | - |
| (6)関係会社株式 | 3,064 | 89,073 | 86,009 |
| 資産計 | 69,658 | 155,667 | 86,009 |
| (7)関係会社短期借入金 | 8,500 | 8,500 | - |
| (8)未払金 | 6,276 | 6,276 | - |
| 未払収益分配金 | 4 | 4 | - |
| 未払償還金 | 50 | 50 | - |
| 未払手数料 | 3,610 | 3,610 | - |
| 其他未払金 | 2,610 | 2,610 | - |
| (9)未払費用 | 6,760 | 6,760 | - |
| (10)未払法人税等 | 856 | 856 | - |
| 負債計 | 22,393 | 22,393 | - |
| (11)デリバティブ取引(*) | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | - | - | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | 10 | 10 | - |
| デリバティブ取引計 | 10 | 10 | - |

(*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(3) 短期貸付金、(4)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。ただし、短期貸付金は為替予約等の振当処理の対象とされており、円貨建債権とみて当該帳簿価額を以って時価としております。「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価格、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 関係会社短期借入金、(8) 未払金、(9) 未払費用、(10) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券766百万円、関係会社株式11,365百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について0百万円減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|--------------|--------|-------------|--------------|------|
| 預金 | 238 | - | - | - |
| 金銭の信託 | 50,326 | - | - | - |
| 短期貸付金 | 153 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 8,149 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | 1,800 | 1 | - | - |
| 合計 | 60,668 | 1 | - | - |

有価証券関係

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 売買目的有価証券(平成23年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(平成23年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(平成23年3月31日)

| 区分 | 貸借対照表 計上額 (百万円) | 時価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|--------|-----------------------|-------------|-------------|
| 関連会社株式 | 3,064 | 79,658 | 76,594 |
| 合計 | 3,064 | 79,658 | 76,594 |

4. その他有価証券(平成23年3月31日)

| 区分 | 貸借対照表 計上額 (百万円) | 取得原価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|----------------------|-----------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| 株式 | 4,930 | 282 | 4,647 |
| 小計 | 4,930 | 282 | 4,647 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| 投資信託(1) | 2,922 | 3,003 | 80 |
| 譲渡性預金 | 1,400 | 1,400 | - |
| 小計 | 4,322 | 4,403 | 80 |
| 合計 | 9,252 | 4,685 | 4,566 |

- (1) 当事業年度末において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ損失は69百万円（税効果会計適用後）であり、貸借対照表に計上しております。

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

| 区分 | 売却額(百万円) | 売却益の合計額(百万円) | 売却損の合計額(百万円) |
|------|----------|--------------|--------------|
| 株式 | 67 | 39 | - |
| 投資信託 | 1,824 | 380 | 149 |
| 合計 | 1,891 | 419 | 149 |

当事業年度(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

1. 売買目的有価証券(平成24年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(平成24年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(平成24年3月31日)

| 区分 | 貸借対照表 計上額 (百万円) | 時価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|--------|-----------------------|-------------|-------------|
| 関連会社株式 | 3,064 | 89,073 | 86,009 |
| 合計 | 3,064 | 89,073 | 86,009 |

4. その他有価証券(平成24年3月31日)

| 区分 | 貸借対照表 計上額 (百万円) | 取得原価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|----------------------|-----------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| 株式 | 4,624 | 282 | 4,341 |
| 小計 | 4,624 | 282 | 4,341 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| 投資信託(1) | 1,300 | 1,431 | 130 |
| 譲渡性預金 | 1,800 | 1,800 | - |
| 小計 | 3,100 | 3,231 | 130 |
| 合計 | 7,725 | 3,514 | 4,210 |

- (1) 当事業年度末において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ利益は12百万円(税効果会計適用後)であり、貸借対照表に計上しております。

5. 事業年度中に売却したその他有価証券(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

| 区分 | 売却額(百万円) | 売却益の合計額(百万円) | 売却損の合計額(百万円) |
|------|----------|--------------|--------------|
| 株式 | 40 | 1 | 26 |
| 投資信託 | 1,343 | - | 110 |
| 合計 | 1,384 | 1 | 136 |

デリバティブ取引関係

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

| ヘッジ会計の方法 | デリバティブ取引の種類等 | 主なヘッジ対象 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超 | 時価 | 当該時価の算定方法 |
|------------|--------------|---------|-------|------------|---------|--------------|
| 原則的処理方法 | 為替予約取引 | 投資信託 | 2,846 | - | 65 | 先物為替相場によっている |
| 為替予約等の振当処理 | 為替予約取引 | 短期貸付金 | 166 | - | (*1) - | - |
| 合 計 | | | 3,013 | - | (*1) 65 | - |

(*1) 為替予約等の振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている短期貸付金と一体として処理されるため、その時価は当該短期貸付金の時価に含めて記載しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

| ヘッジ会計の方法 | デリバティブ取引の種類等 | 主なヘッジ対象 | 契約額等 | 契約額等のうち1年超 | 時価 | 当該時価の算定方法 |
|------------|--------------|---------|-------|------------|---------|--------------|
| 原則的処理方法 | 為替予約取引 | 投資信託 | 1,308 | - | 10 | 先物為替相場によっている |
| 為替予約等の振当処理 | 為替予約取引 | 短期貸付金 | 153 | - | (*1) - | - |
| 合 計 | | | 1,462 | - | (*1) 10 | - |

(*1) 為替予約等の振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている短期貸付金と一体として処理されるため、その時価は当該短期貸付金の時価に含めて記載しております。

退職給付関係

前事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

2. 退職給付債務に関する事項(平成23年 3月31日)

| | |
|------------------------------|-----------|
| イ. 退職給付債務 | 12,965百万円 |
| ロ. 年金資産 | 7,475 |
| ハ. 未積立退職給付債務(イ + ロ) | 5,489 |
| ニ. 会計基準変更時差異の未処理額 | |
| ホ. 未認識数理計算上の差異 | 2,037 |
| ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額) | 613 |
| ト. 貸借対照表計上額純額(ハ + ニ + ホ + ヘ) | 4,064 |
| チ. 前払年金費用 | |
| リ. 退職給付引当金(ト - チ) | 4,064 |

3. 退職給付費用に関する事項(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

| | |
|----------------------------------|--------|
| イ. 勤務費用 | 535百万円 |
| ロ. 利息費用 | 260 |
| ハ. 期待運用収益 | 162 |
| ニ. 会計基準変更時差異の費用処理額 | |
| ホ. 数理計算上の差異の費用処理額 | 254 |
| ヘ. 過去勤務債務の費用処理額 | 40 |
| ト. 退職給付費用(イ + ロ + ハ + ニ + ホ + ヘ) | 848 |
| チ. その他(注) | 206 |
| 計 | 1,054 |

(注) 確定拠出年金への掛金支払額等であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

| | |
|-------------------|---|
| イ. 退職給付見込額の期間配分方法 | 期間定額基準 |
| ロ. 割引率 | 2.1% |
| ハ. 期待運用収益率 | 2.5% |
| ニ. 過去勤務債務の額の処理年数 | 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、費用処理することとしております。) |
| ホ. 数理計算上の差異の処理年数 | (1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、翌期から費用処理することとしております。) |
| ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数 | 該当はありません。 |

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

2. 退職給付債務に関する事項(平成24年 3月31日)

| | |
|------------------------------|-----------|
| イ. 退職給付債務 | 13,948百万円 |
| ロ. 年金資産 | 9,508 |
| ハ. 未積立退職給付債務(イ + ロ) | 4,440 |
| ニ. 会計基準変更時差異の未処理額 | |
| ホ. 未認識数理計算上の差異 | 2,575 |
| ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額) | 572 |
| ト. 貸借対照表計上額純額(ハ + ニ + ホ + ヘ) | 2,437 |
| チ. 前払年金費用 | |
| リ. 退職給付引当金(ト - チ) | 2,437 |

3. 退職給付費用に関する事項(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

| | |
|----------------------------------|--------|
| イ. 勤務費用 | 543百万円 |
| ロ. 利息費用 | 272 |
| ハ. 期待運用収益 | 186 |
| ニ. 会計基準変更時差異の費用処理額 | |
| ホ. 数理計算上の差異の費用処理額 | 280 |
| ヘ. 過去勤務債務の費用処理額 | 40 |
| ト. 退職給付費用(イ + ロ + ハ + ニ + ホ + ヘ) | 869 |
| チ. その他(注) | 170 |
| 計 | 1,039 |

(注) 確定拠出年金への掛金支払額等であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

| | |
|-------------------|---|
| イ. 退職給付見込額の期間配分方法 | 期間定額基準 |
| ロ. 割引率 | 1.8% |
| ハ. 期待運用収益率 | 2.5% |
| ニ. 過去勤務債務の額の処理年数 | 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、費用処理することとしております。) |
| ホ. 数理計算上の差異の処理年数 | (1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、翌期から費用処理することとしております。) |
| ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数 | 該当はありません。 |

税効果会計関係

| 前事業年度末 (平成23年3月31日) | 当事業年度末 (平成24年3月31日) |
|--|--|
| 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 | 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 |
| 繰延税金資産 百万円 | 繰延税金資産 百万円 |
| 賞与引当金 1,189 | 賞与引当金 1,070 |
| 退職給付引当金 1,666 | 退職給付引当金 877 |
| 所有株式税務簿価通算差異 884 | 所有株式税務簿価通算差異 776 |
| 投資有価証券評価減 569 | 投資有価証券評価減 501 |
| ゴルフ会員権評価減 509 | ゴルフ会員権評価減 430 |
| 減価償却超過額 307 | 減価償却超過額 243 |
| 時効後支払損引当金 197 | 時効後支払損引当金 176 |
| 子会社株式売却損 196 | 子会社株式売却損 172 |
| 未払事業税 206 | 未払事業税 166 |
| 未払確定拠出年金掛金 107 | 未払確定拠出年金掛金 - |
| 繰延ヘッジ損失 48 | 繰延ヘッジ損失 - |
| その他 184 | その他 148 |
| 繰延税金資産小計 6,069 | 繰延税金資産小計 4,564 |
| 評価性引当金 1,878 | 評価性引当金 1,650 |
| 繰延税金資産計 4,190 | 繰延税金資産計 2,913 |
| 繰延税金負債 | 繰延税金負債 |
| 有価証券評価差額金 1,872 | 有価証券評価差額金 1,511 |
| 繰延ヘッジ利益 - | 繰延ヘッジ利益 7 |
| 繰延税金負債計 1,872 | 繰延税金負債計 1,518 |
| 繰延税金資産(純額) 2,318 | 繰延税金資産(純額) 1,394 |
| 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 | 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 |
| 法定実効税率 41.0% | 法定実効税率 41.0% |
| (調整) | (調整) |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.8% | 交際費等永久に損金に算入されない項目 0.3% |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 13.2% | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 11.3% |
| 住民税等均等割 0.0% | 住民税等均等割 0.0% |
| タックスハイブン税制 5.8% | タックスハイブン税制 4.2% |
| 外国税額控除 0.6% | 外国税額控除 0.0% |
| 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 - | 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 2.4% |
| その他 0.7% | その他 0.3% |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 33.1% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 36.3% |

税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後開始する事業年度より、法人税率が30%から25.5%に引き下げられました。また、「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が同日に公布され、平成24年4月1日から平成27年3月31日までの期間（指定期間）内に開始する事業年度（3年間）は、各課税事業年度の基準法人税額の10%が復興特別法人税として課税されることになりました。これらの改正により、繰延税金資産および繰延税金負債を計算する法定実効税率は平成24年4月1日から平成27年3月31日までに解消すると見込まれる一時差異等については38%、平成27年4月1日以降に解消すると見込まれる一時差異等については36%となっております。

この改正の影響により、繰延税金資産の純額が108百万円減少し、法人税等調整額は322百万円増加しております。

セグメント情報等

前事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

（追加情報）

当事業年度より「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|----------------|--------|------------------|-----------|-----------------------|------------------|-----------|-----------|-------------------|-----------|
| 親会社 | 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区 | 594,492 (百万円) | 持株会社 | (被所有) 直接 100.0% | 資産の賃貸借等 役員の兼任 | 資金の借入(*1) | 137,500 | 関係会社 短期 借入金 | 8,000 |
| | | | | | | | 資金の返済 | 140,500 | | |
| | | | | | | | 借入金利息の支払 | 75 | 未払費用 | 3 |

(イ) 子会社等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|------|--|-----------|------------------|-----------|----------------------|------------|----------------------|-----------|------|-----------|
| 子会社 | ノムラ・アセット・マネジメント・ストラテジック・インベストメンツ・Pte リミテッド | シンガポール共和国 | 68,275 (千米ドル) | 持株会社 | (所有) 直接 100.0% | 役員の派遣 | 増資の引受(*2) | 5,762 | - | - |
| 関連会社 | 株式会社野村総合研究所 | 東京都千代田区 | 18,600 (百万円) | 情報サービス業 | (所有) 直接 21.6% | サービス・製品の購入 | 自社利用のソフトウェア開発の委託(*3) | 6,794 | 未払費用 | 61 |

(ウ) 兄弟会社等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|---------|------------|--------|-----------------|-----------|----------------|---|-----------------------|-----------|-------|-----------|
| 親会社の子会社 | 野村証券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000 (百万円) | 証券業 | | 当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*4) | 31,596 | 未払手数料 | 3,835 |

| 親会社の子会社 | 野村ファン ド・リサー チ・アンド ・テクノロ ジー株式会 社 | 東京都 中央区 | 400 (百万円) | 投資顧問業 | 当社投資信託 の運用委託 役員の兼任 | 投資信託の 運用に係る 投資顧問料 の支払 (*5) | 有価証券届出書(内国投資信託受益証券) | | |
|---------|--|------------|--------------|-------|--------------------------|--|---------------------|------|-----|
| | | | | | | | 2,657 | 未払費用 | 939 |
| | | | | | | | | | |

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

(*2) 増資の引受けにつきましては、当社が平成22年12月23日及び12月28日に1株1米ドルで引受けております。

(*3) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

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

(*5) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所及び野村土地建物(株)であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

| | (百万円) | |
|----------|------------|-----------|
| | (株)野村総合研究所 | 野村土地建物(株) |
| 流動資産合計 | 167,970 | 7,506 |
| 固定資産合計 | 205,568 | 76,404 |
| 流動負債合計 | 79,436 | 7,926 |
| 固定負債合計 | 80,690 | 9,832 |
| 純資産合計 | 213,412 | 66,152 |
| 売上高 | 312,345 | 2,546 |
| 税引前当期純利益 | 36,149 | 3,289 |
| 当期純利益 | 21,100 | 2,944 |

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|----------------|--------|------------------|-----------|-----------------------|----------------------|-------------|-----------|-------------------|-----------|
| 親会社 | 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区 | 594,492 (百万円) | 持株会社 | (被所有) 直接 100.0% | 資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任 | 資金の借入(*1) | 90,500 | 関係会社 短期 借入金 | 8,500 |
| | | | | | | | 資金の返済 | 90,000 | | |
| | | | | | | | 借入金利息の支払 | 54 | 未払費用 | 2 |
| | | | | | | | 金銭信託の移管(*2) | 9,258 | - | - |
| | | | | | | | 株式交換(*3) | 8,267 | - | - |

(イ) 子会社等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|------|-------------|---------|-----------------|-----------|---------------------|------------|-----------------------|-----------|------|-----------|
| 関連会社 | 株式会社野村総合研究所 | 東京都千代田区 | 18,600 (百万円) | 情報サービス業 | (所有) 直接 21.6% | サービス・製品の購入 | 自社利用のソフトウェア開発の委託等(*4) | 5,887 | 未払費用 | 478 |

(ウ) 兄弟会社等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-------------|----------------------------|--------|-----------------|-----------|----------------|---|------------------------|-----------|-----------|-----------|
| 親会社の 子会社 | 野村証券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000 (百万円) | 証券業 | | 当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*5) | 33,134 | 未払 手数料 | 2,987 |
| 親会社の 子会社 | 野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社 | 東京都中央区 | 400 (百万円) | 投資顧問業 | | 当社投資信託の運用委託 役員の兼任 | 投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*6) | 2,126 | 未払費用 | 787 |

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(* 1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

(* 2) 譲渡代金は、平成24年1月17日における時価評価金額としています。

(* 3) 当社が保有する野村土地建物株式会社株式と引き換えに野村ホールディングス株式会社株式を取得

いたしました。交換は、第三者算定機関の算定による交換比率に基づいております。

(* 4) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

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

(* 6) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

| | (百万円) |
|----------|------------|
| | (株)野村総合研究所 |
| 流動資産合計 | 166,580 |
| 固定資産合計 | 229,654 |
| 流動負債合計 | 72,440 |
| 固定負債合計 | 74,932 |
| 純資産合計 | 248,861 |
| 売上高 | 320,289 |
| 税引前当期純利益 | 62,962 |
| 当期純利益 | 41,340 |

1株当たり情報

| 前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日) | | 当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) | |
|---|------------|---|------------|
| 1株当たり純資産額 | 13,765円90銭 | 1株当たり純資産額 | 13,828円81銭 |
| 1株当たり当期純利益 | 1,516円39銭 | 1株当たり当期純利益 | 1,652円20銭 |
| 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | | 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | |
| 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 | | 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 | |
| 損益計算書上の当期純利益 | 7,810百万円 | 損益計算書上の当期純利益 | 8,509百万円 |
| 普通株式に係る当期純利益 | 7,810百万円 | 普通株式に係る当期純利益 | 8,509百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 | | 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 | |
| 該当事項はありません。 | | 該当事項はありません。 | |
| 普通株式の期中平均株式数 | 5,150,693株 | 普通株式の期中平均株式数 | 5,150,693株 |

4 【利害関係人との取引制限】

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

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等（委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5 【その他】

(1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託者

| (a)名称 | (b)資本金の額 [*] | (c)事業の内容 |
|------------|-----------------------|--|
| 野村信託銀行株式会社 | 30,000百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。 |

* 平成24年5月末現在

(2) 販売会社

| (a)名称 | (b)資本金の額 [*] | (c)事業の内容 |
|-------------|-----------------------|---------------------------------|
| 野村證券株式会社 | 10,000百万円 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社 島根銀行 | 6,636百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社 十八銀行 | 24,404百万円 | |
| スルガ銀行株式会社 | 30,043百万円 | |
| 株式会社 筑波銀行 | 48,868百万円 | |
| 株式会社 トマト銀行 | 14,310百万円 | |
| 株式会社 沖縄海邦銀行 | 4,537百万円 | |

* 平成24年5月末現在

2 【関係業務の概要】

(1) 受託者

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

(2) 販売会社

販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

一般コースのみを取り扱う販売会社は、収益分配金の再投資に関する事務を行ないません。

3 【資本関係】

(1) 受託者(持株比率5.0%以上を記載します。)

該当事項はありません。

(2) 販売会社(持株比率5.0%以上を記載します。)

該当事項はありません。

第3 【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成24年6月29日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 内田 満雄 |
|--------------------|-------|-------|

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 亀井 純子 |
|--------------------|-------|-------|

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 伊藤 志保 |
|--------------------|-------|-------|

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

平成24年6月25日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 内田満雄指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスセレクト70の平成23年5月11日から平成24年5月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスセレクト70の平成24年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)