

## 【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26年7月25日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼執行役社長 渡邊 国夫
【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
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）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（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成26年7月26日から平成27年7月30日まで) 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

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口当たり1円です。

信用格付

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

ファンドの受益権は、社債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時までには、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、1.08%（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26年 7月26日から平成27年 7月30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。)の指定する口座を經由して、野村信託銀行株式会社(「受託者」または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座に払い込まれます。

## ( 10 ) 【払込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社  
サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）  
＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時  
インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

（ 1 1 ）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ）【その他】

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ます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、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】

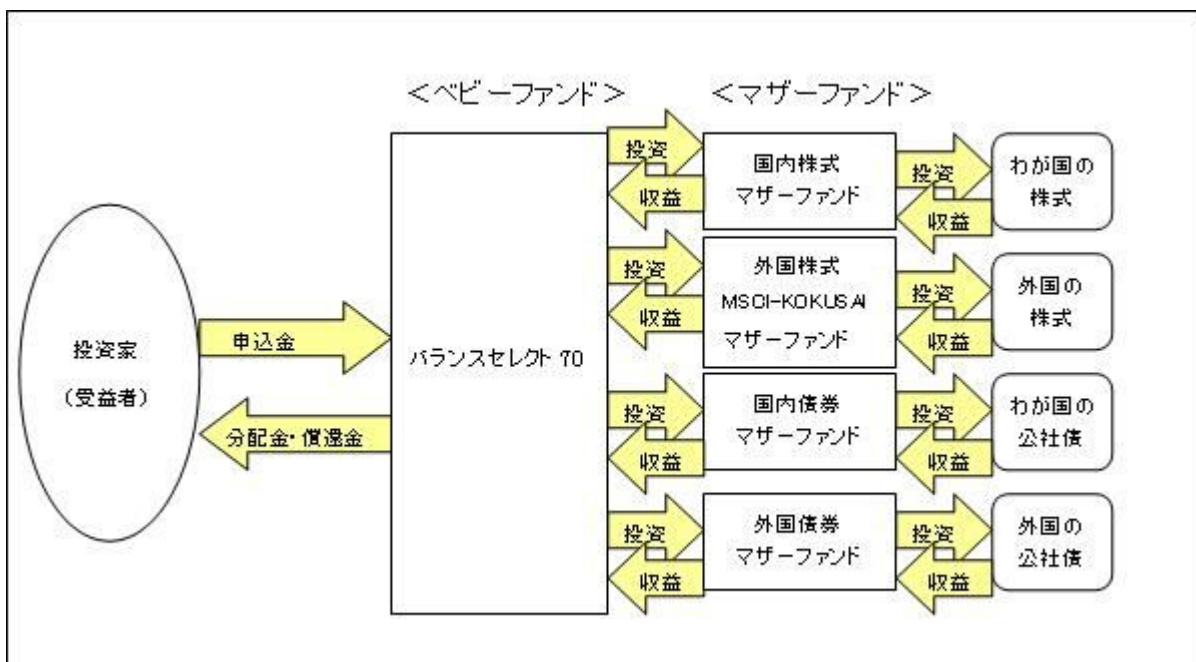
##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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を獲得を目指します。

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。



マザーファンドの運用の方針等については、「第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）各マザーファンドの概要」をご参照ください。

ファンドは、マザーファンドのほかに、株式および公社債に直接投資する場合があります。「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。

#### 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。

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

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

（バランスセレクト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	国内	株式	<b>インデックス型</b>
<b>追加型</b>	海外	債券	特殊型
	<b>内外</b>	不動産投信	
		その他資産 ( )	
		<b>資産複合</b>	

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（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の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」による区別のほか、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使い、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。

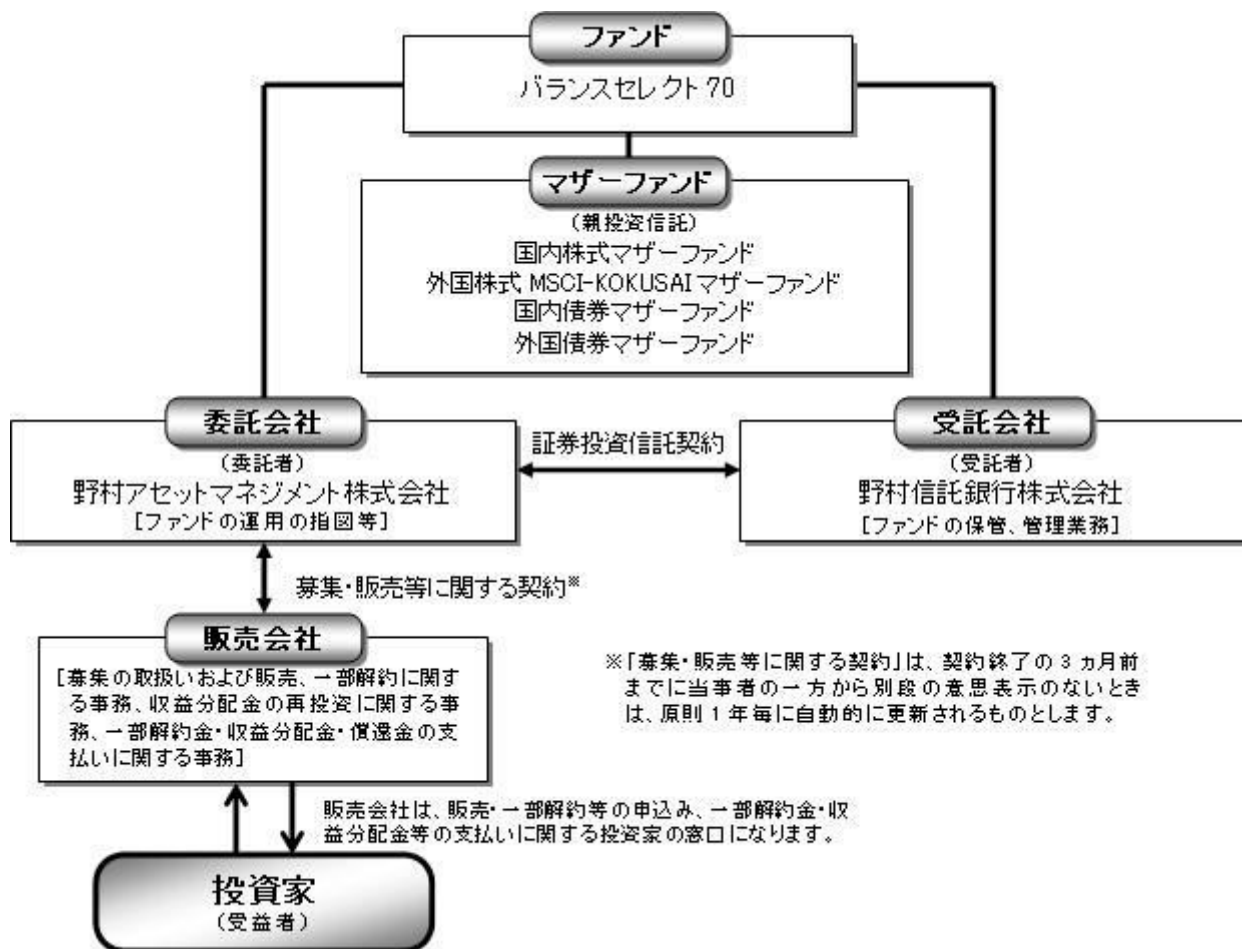
(4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

## (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(平成26年6月末現在)

・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

17,180百万円

・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立  
 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

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%

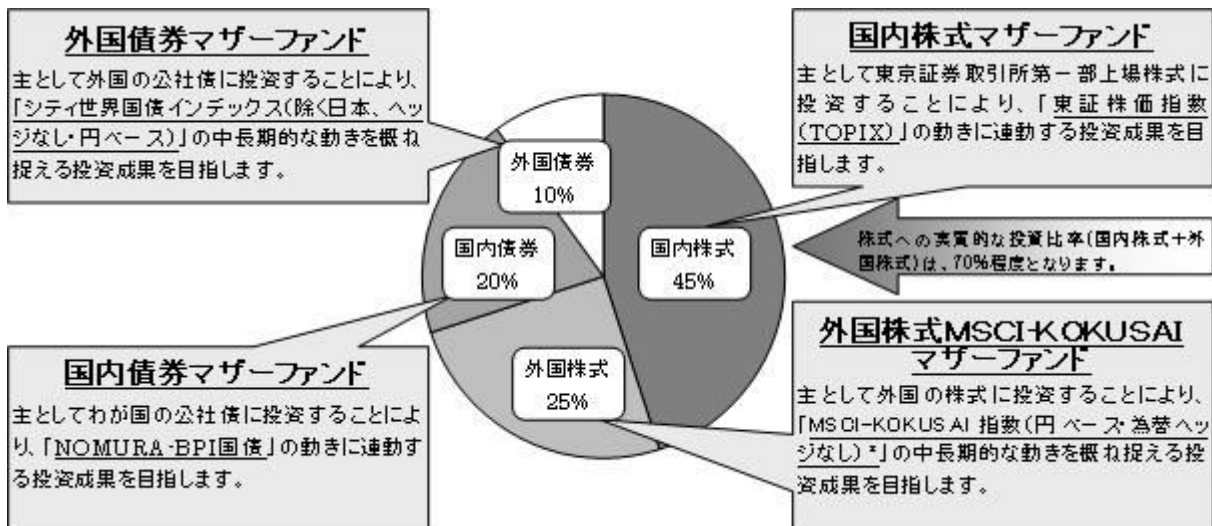
## 2【投資方針】

### (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投資収益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券

2 国債証券

3 地方債証券

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

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

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。

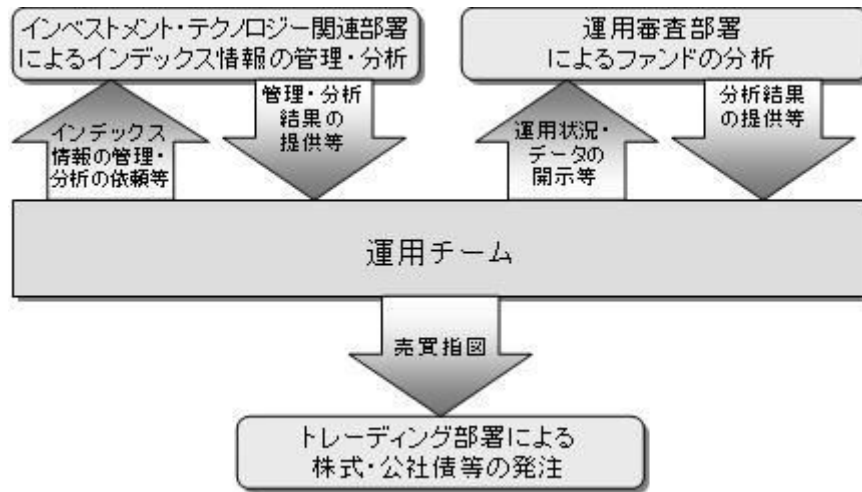
金融商品の指図範囲(約款第21条第2項)

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】

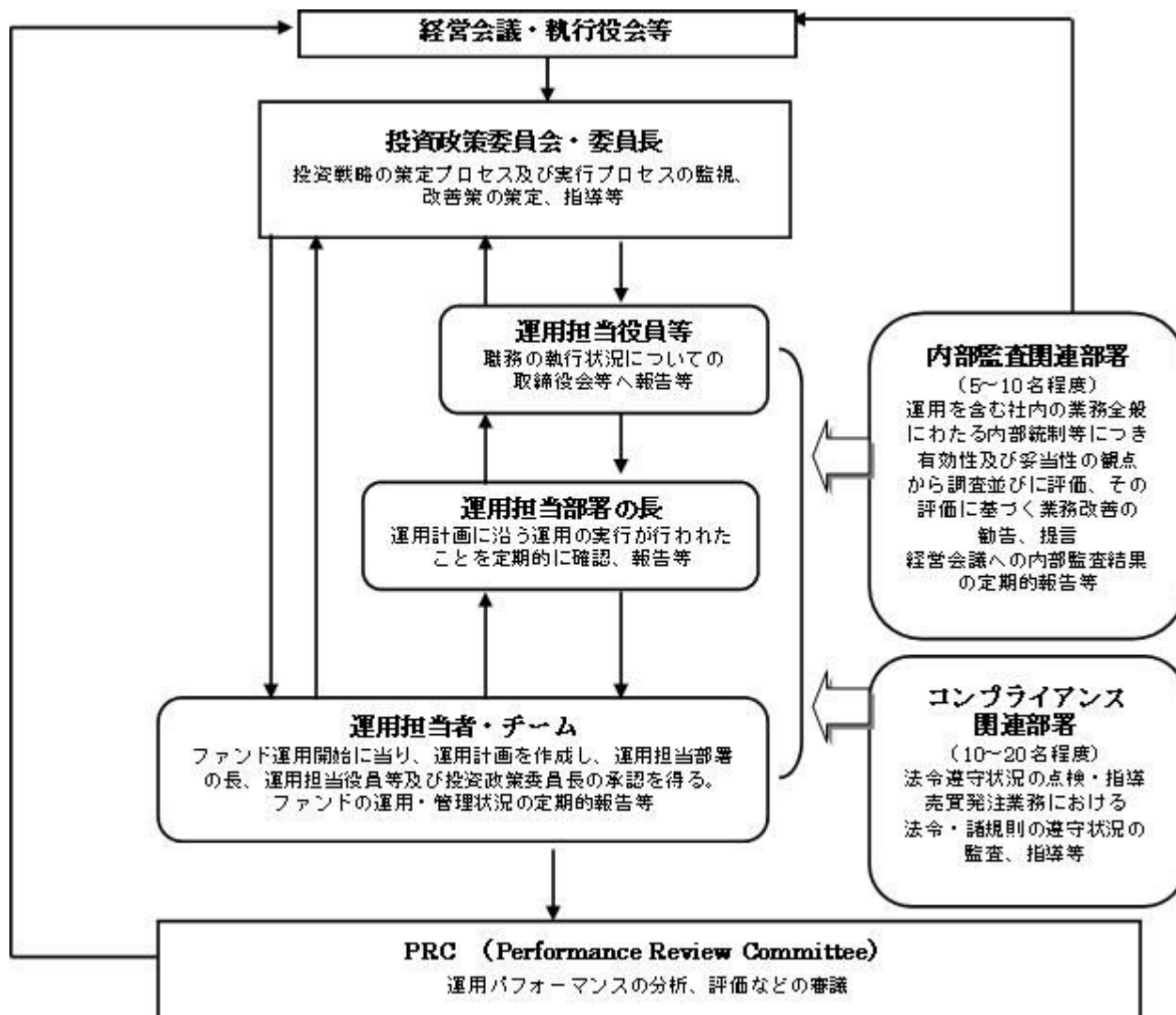
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

年1回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(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ないます。

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な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、）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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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、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せん。)の行使により取得可能な株券

6 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

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ないます。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

主として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ないます。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

(国内債券マザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

### 3 【投資リスク】

#### **基準価額の変動要因**

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

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

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

#### [為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行ないませんので、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、参加もしておりません。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

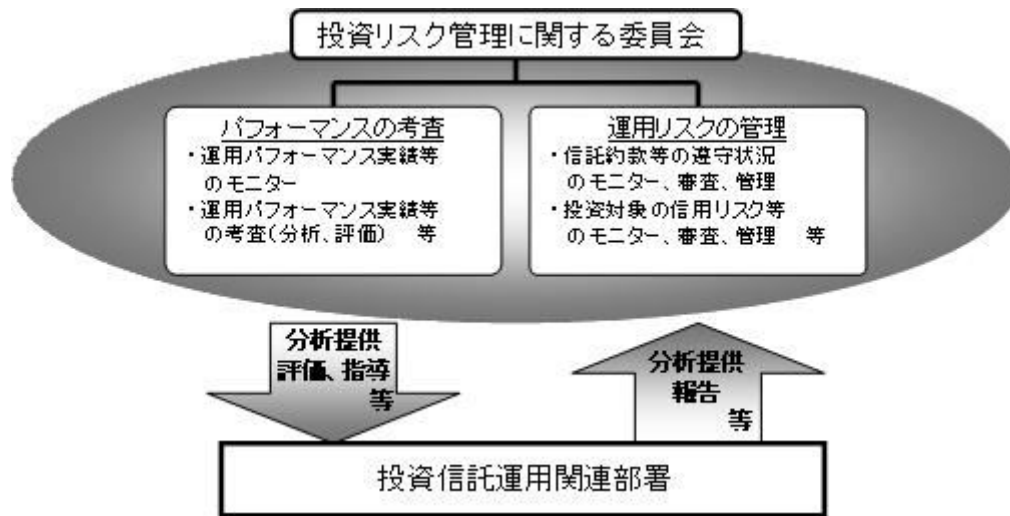
投資信託の信託財産についてパフォーマンスに基づいた定期的な考査（分析、評価）の結果の報告、審議を行ないます。



## 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、1.08%（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77.76（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す。

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、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。

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除の適用があります。

< 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 >

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

[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、)との通算が可能です。

公募株式投資信託は税法上、平成26年1月1日以降の少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額について

は、15.315%（国税15.315%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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。

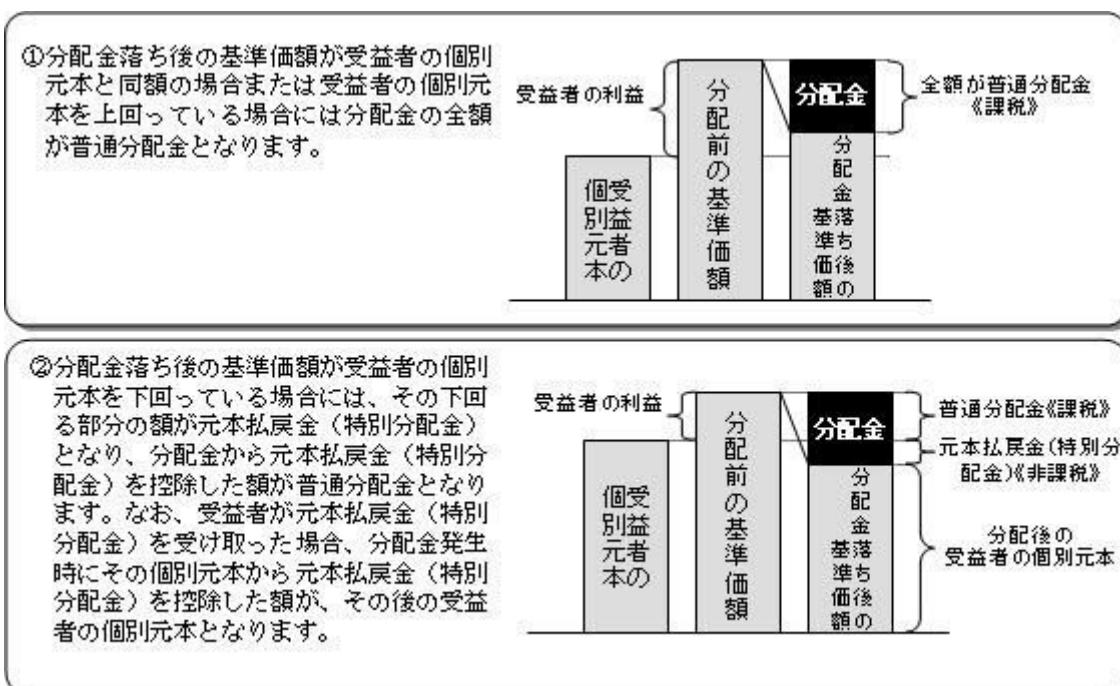
#### 個別元本について

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。



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。

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26年 5月30日現在の運用状況であります。

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

### (1)【投資状況】

#### バランスセレクト70

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,486,115,067	99.90
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,479,130	0.09
合計(純資産総額)		1,487,594,197	100.00

#### (参考)国内株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	174,868,758,630	96.66
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,036,077,815	3.33
合計(純資産総額)		180,904,836,445	100.00

#### その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,121,145,000	2.27

#### (参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	154,740,501,830	57.09
	カナダ	12,016,785,752	4.43
	ドイツ	11,013,687,868	4.06
	イタリア	3,037,542,059	1.12
	フランス	11,817,921,778	4.36

	オランダ	3,244,583,610	1.19
	スペイン	4,311,147,510	1.59
	ベルギー	1,450,579,979	0.53
	オーストリア	312,380,333	0.11
	ルクセンブルグ	38,486,588	0.01
	フィンランド	1,056,496,481	0.38
	アイルランド	376,379,331	0.13
	ポルトガル	218,278,860	0.08
	イギリス	25,338,442,044	9.34
	スイス	10,941,302,227	4.03
	スウェーデン	3,741,614,421	1.38
	ノルウェー	1,036,376,066	0.38
	デンマーク	1,557,501,348	0.57
	オーストラリア	8,766,201,659	3.23
	ニュージーランド	150,271,381	0.05
	香港	3,246,002,345	1.19
	シンガポール	1,621,500,702	0.59
	イスラエル	604,847,733	0.22
	小計	260,638,831,905	96.17
投資信託受益証券	アメリカ	34,996,455	0.01
投資証券	アメリカ	4,208,293,378	1.55
	カナダ	55,030,157	0.02
	フランス	359,274,134	0.13
	オランダ	27,313,397	0.01
	イギリス	364,828,075	0.13
	オーストラリア	675,044,085	0.24
	香港	111,267,192	0.04
	シンガポール	101,403,640	0.03
	小計	5,902,454,058	2.17
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,435,413,993	1.63
合計（純資産総額）		271,011,696,411	100.00

## その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,739,523,514	1.01
	買建	カナダ	203,203,537	0.07
	買建	ドイツ	645,193,247	0.23
	買建	イギリス	443,338,476	0.16
	買建	スイス	187,579,649	0.06

## （参考）国内債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	6,368,954,030	99.06
現金・預金・その他資産（負債控除後）		60,360,738	0.93
合計（純資産総額）		6,429,314,768	100.00

## （参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	110,777,104,425	37.79
	カナダ	6,796,271,662	2.31
	メキシコ	3,239,093,300	1.10
	ドイツ	24,086,684,091	8.21
	イタリア	30,806,639,479	10.51
	フランス	30,243,954,541	10.31
	オランダ	8,059,082,589	2.74
	スペイン	16,849,993,899	5.74
	ベルギー	8,047,946,235	2.74
	オーストリア	5,013,582,610	1.71
	フィンランド	1,973,281,600	0.67
	アイルランド	2,607,030,120	0.88
	イギリス	22,922,074,566	7.82
	スイス	910,149,935	0.31
	スウェーデン	1,651,864,259	0.56
	ノルウェー	1,057,280,883	0.36
	デンマーク	2,375,746,124	0.81
	ポーランド	1,943,673,214	0.66
	オーストラリア	4,714,550,111	1.60
	シンガポール	1,069,220,814	0.36
マレーシア	1,516,564,147	0.51	
南アフリカ	1,468,024,106	0.50	
	小計	288,129,812,710	98.31
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,938,658,156	1.68
合計（純資産総額）		293,068,470,866	100.00

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## バランスセレクト70

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	626,872,610	1.0381	650,756,457	1.0772	675,267,175	45.39
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	203,283,643	1.7909	364,060,677	1.8187	369,711,961	24.85
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド	237,105,051	1.2399	293,986,765	1.2430	294,721,578	19.81
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	70,834,230	2.0704	146,656,432	2.0670	146,414,353	9.84

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

## (参考) 国内株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,419,900	5,514.00	7,829,328,600	5,761.00	8,180,043,900	4.52
2	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	7,627,800	563.00	4,294,451,400	573.00	4,370,729,400	2.41
3	日本	株式	ソフトバンク	情報・通 信業	494,500	7,161.00	3,541,114,500	7,345.00	3,632,102,500	2.00
4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	918,100	3,311.00	3,039,829,100	3,563.00	3,271,190,300	1.80
5	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	761,500	4,119.00	3,136,618,500	4,105.00	3,125,957,500	1.72
6	日本	株式	みずほフィナンシ ャルグループ	銀行業	13,069,500	199.00	2,600,830,500	198.00	2,587,761,000	1.43
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	395,600	5,717.00	2,261,645,200	6,042.00	2,390,215,200	1.32
8	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	633,600	3,400.00	2,154,240,000	3,444.00	2,182,118,400	1.20
9	日本	株式	キヤノン	電気機器	591,500	3,275.00	1,937,162,500	3,338.00	1,974,427,000	1.09
10	日本	株式	ファナック	電気機器	113,800	17,070.00	1,942,566,000	17,320.00	1,971,016,000	1.08
11	日本	株式	KDDI	情報・通 信業	312,600	5,686.00	1,777,443,600	6,053.00	1,892,167,800	1.04
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	400,200	4,557.00	1,823,711,400	4,607.00	1,843,721,400	1.01
13	日本	株式	三菱地所	不動産業	705,000	2,387.00	1,682,835,000	2,471.00	1,742,055,000	0.96
14	日本	株式	セブン&アイ・ホ ールディングス	小売業	421,200	3,994.00	1,682,272,800	4,068.00	1,713,441,600	0.94
15	日本	株式	日立製作所	電気機器	2,455,000	731.00	1,794,605,000	684.00	1,679,220,000	0.92
16	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,230,400	1,186.00	1,459,254,400	1,304.00	1,604,441,600	0.88
17	日本	株式	三菱商事	卸売業	785,700	1,961.00	1,540,757,700	2,009.00	1,578,471,300	0.87
18	日本	株式	三井不動産	不動産業	475,000	3,135.00	1,489,125,000	3,221.00	1,529,975,000	0.84

19	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	187,700	7,581.00	1,422,953,700	7,765.00	1,457,490,500	0.80
20	日本	株式	三井物産	卸売業	910,600	1,528.00	1,391,396,800	1,542.00	1,404,145,200	0.77
21	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	829,700	1,639.00	1,359,878,300	1,690.00	1,402,193,000	0.77
22	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,058,600	600.00	1,235,160,000	669.00	1,377,203,400	0.76
23	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,432,100	869.00	1,244,494,900	919.00	1,316,099,900	0.72
24	日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	4,516,000	273.00	1,232,868,000	287.00	1,296,092,000	0.71
25	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,165,600	1,055.00	1,229,708,000	1,093.00	1,274,000,800	0.70
26	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	390,000	2,983.00	1,163,370,000	3,216.00	1,254,240,000	0.69
27	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	91,400	12,450.00	1,137,930,000	13,480.00	1,232,072,000	0.68
28	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	334,800	3,536.00	1,183,852,800	3,676.00	1,230,724,800	0.68
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,020,000	1,182.00	1,205,640,000	1,181.00	1,204,620,000	0.66
30	日本	株式	デンソー	輸送用機器	252,100	4,297.00	1,083,273,700	4,663.00	1,175,542,300	0.64

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.51
		建設業	2.57
		食料品	3.97
		繊維製品	0.67
		パルプ・紙	0.27
		化学	5.32
		医薬品	4.35
		石油・石炭製品	0.60
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	0.97
		鉄鋼	1.54
		非鉄金属	0.97
		金属製品	0.64
		機械	5.05
		電気機器	11.91
		輸送用機器	11.19
		精密機器	1.34
		その他製品	1.40
		電気・ガス業	2.05
陸運業	3.88		
海運業	0.33		
空運業	0.50		
倉庫・運輸関連業	0.21		
情報・通信業	7.01		



	卸売業	4.49
	小売業	4.15
	銀行業	8.81
	証券、商品先物取引業	1.52
	保険業	2.20
	その他金融業	1.27
	不動産業	3.26
	サービス業	2.53
合 計		96.66

## (参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	77,970	54,577.18	4,255,383,317	64,592.73	5,036,295,220	1.85
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	378,600	9,932.18	3,760,324,106	10,295.10	3,897,727,965	1.43
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	687,000	4,096.89	2,814,568,926	4,100.96	2,817,362,543	1.03
4	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	244,400	9,905.75	2,420,965,398	10,243.26	2,503,453,135	0.92
5	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コングロ マリット	876,300	2,630.96	2,305,510,949	2,718.38	2,382,123,755	0.87
6	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	商業銀行	433,400	5,010.82	2,171,689,995	5,110.44	2,214,868,250	0.81
7	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	279,300	7,515.46	2,099,069,234	7,923.23	2,212,959,954	0.81
8	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	166,600	12,046.71	2,006,981,886	12,435.05	2,071,679,530	0.76
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	235,400	8,108.40	1,908,717,737	8,173.46	1,924,033,426	0.70
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	商業銀行	325,500	6,103.66	1,986,743,414	5,664.49	1,843,793,188	0.68
11	スイス	株式	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	医薬品	60,830	30,095.83	1,830,729,887	30,050.53	1,827,973,801	0.67
12	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	199,200	8,206.41	1,634,717,171	9,152.21	1,823,121,427	0.67
13	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	358,000	4,820.71	1,725,816,758	5,054.53	1,809,523,602	0.66
14	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	商業銀行	1,623,000	1,039.12	1,686,504,257	1,067.86	1,733,152,247	0.63
15	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	561,100	3,240.92	1,818,480,661	3,009.13	1,688,426,210	0.62
16	アメリカ	株式	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	情報技術 サービス	89,310	19,361.14	1,729,144,038	18,681.04	1,668,403,825	0.61
17	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	456,100	3,565.21	1,626,095,109	3,597.74	1,640,932,589	0.60
18	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	252,900	5,690.92	1,439,235,388	5,865.78	1,483,456,268	0.54
19	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	344,000	3,959.65	1,362,122,008	4,133.49	1,421,922,486	0.52
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	商業銀行	923,100	1,726.18	1,593,443,035	1,540.14	1,421,711,542	0.52
21	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	23,950	57,024.14	1,365,728,244	58,003.12	1,389,174,954	0.51

22	イギリス	株式	BP PLC	石油・ガス・消耗燃料	1,614,000	823.13	1,328,546,023	859.87	1,387,836,507	0.51
23	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	インターネットソフトウェア・サービス	23,940	56,849.28	1,360,971,969	56,937.73	1,363,089,323	0.50
24	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア	315,500	4,022.68	1,269,157,496	4,290.05	1,353,511,406	0.49
25	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	石油・ガス・消耗燃料	334,100	3,729.63	1,246,071,087	4,012.80	1,340,677,031	0.49
26	フランス	株式	TOTAL SA	石油・ガス・消耗燃料	185,100	6,643.98	1,229,802,531	7,154.42	1,324,284,549	0.48
27	アメリカ	株式	CITIGROUP	商業銀行	262,400	4,803.43	1,260,421,345	4,806.48	1,261,221,612	0.46
28	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	96,200	12,558.05	1,208,085,353	13,023.66	1,252,876,342	0.46
29	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	138,600	8,236.49	1,141,577,957	8,983.69	1,245,140,016	0.45
30	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	メディア	144,400	8,030.12	1,159,549,819	8,542.48	1,233,535,527	0.45

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー設備・サービス	1.48
		石油・ガス・消耗燃料	8.99
		化学	2.93
		建設資材	0.33
		容器・包装	0.21
		金属・鉱業	2.02
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	2.10
		建設関連製品	0.20
		建設・土木	0.41
		電気設備	0.82
		コングロマリット	2.00
		機械	1.61
		商社・流通業	0.27
		商業サービス・用品	0.43
		航空貨物・物流サービス	0.59
		旅客航空輸送業	0.13
		海運業	0.10
		陸運・鉄道	0.95
		運送インフラ	0.17
自動車部品	0.61		
自動車	1.20		
家庭用耐久財	0.26		
レジャー用品	0.09		

繊維・アパレル・贅沢品	1.18
ホテル・レストラン・レジャー	1.65
メディア	2.93
販売	0.08
インターネット販売・カタログ販売	0.78
複合小売り	0.50
専門小売り	1.47
食品・生活必需品小売り	2.11
飲料	2.15
食品	2.61
タバコ	1.39
家庭用品	1.48
パーソナル用品	0.27
ヘルスケア機器・用品	1.42
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.49
バイオテクノロジー	1.59
医薬品	6.97
商業銀行	9.55
各種金融サービス	1.31
保険	4.14
不動産管理・開発	0.58
インターネットソフトウェア・サービス	1.87
情報技術サービス	2.15
ソフトウェア	2.53
通信機器	1.17
コンピュータ・周辺機器	2.58
電子装置・機器・部品	0.35
半導体・半導体製造装置	1.50
各種電気通信サービス	2.81
無線通信サービス	0.48
電力	1.57
ガス	0.15
総合公益事業	1.32
水道	0.08
貯蓄・抵当・不動産金融	0.06
消費者金融	0.54
資本市場	2.03
各種消費者サービス	0.02
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.35
専門サービス	0.48

投資信託受益証券			0.01
投資証券			2.17
合計			98.36

## (参考) 国内債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 89回	100,000,000	104.96	104,969,000	104.91	104,912,000	1.5	2017/12/20	1.63
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 84回	75,000,000	104.19	78,145,500	104.09	78,069,000	1.7	2016/12/20	1.21
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	70,000,000	106.03	74,224,500	106.03	74,224,500	1.3	2019/12/20	1.15
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	70,000,000	105.89	74,126,500	105.98	74,188,100	1.2	2020/12/20	1.15
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	70,000,000	102.61	71,827,700	102.88	72,017,400	0.8	2022/9/20	1.12
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	70,000,000	102.25	71,578,500	102.55	71,786,400	0.8	2023/6/20	1.11
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 85回	68,000,000	104.56	71,100,800	104.47	71,041,640	1.7	2017/3/20	1.10
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	70,000,000	100.63	70,443,800	100.92	70,648,900	0.6	2023/3/20	1.09
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 2回	70,000,000	100.54	70,381,500	100.52	70,364,700	0.3	2016/12/20	1.09
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 96回	65,000,000	105.81	68,780,400	105.78	68,762,200	1.5	2018/9/20	1.06
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 88回	65,000,000	105.32	68,463,850	105.24	68,407,950	1.7	2017/9/20	1.06
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 13回	60,000,000	106.60	63,962,400	106.72	64,037,400	1.3	2021/3/20	0.99
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第99 回	60,000,000	100.73	60,443,400	100.71	60,426,600	0.4	2016/9/20	0.93
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	60,000,000	100.19	60,116,400	100.21	60,127,800	0.2	2018/9/20	0.93
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	60,000,000	100.13	60,082,200	100.18	60,108,000	0.2	2018/12/20	0.93
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 87回	50,000,000	105.56	52,782,500	105.46	52,733,500	1.9	2017/6/20	0.82
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 90回	50,000,000	104.86	52,432,000	104.81	52,407,500	1.4	2018/3/20	0.81
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 20回	50,000,000	104.38	52,194,000	104.66	52,332,000	1	2021/12/20	0.81

19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 24回	50,000,000	102.69	51,347,500	102.95	51,478,500	0.8	2022/6/20	0.80
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第95 回	50,000,000	100.96	50,484,500	100.93	50,465,500	0.6	2016/3/20	0.78
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第94 回	50,000,000	100.84	50,420,000	100.80	50,401,500	0.6	2015/12/20	0.78
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 3回	50,000,000	100.63	50,315,500	100.64	50,321,500	0.3	2018/6/20	0.78
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 0回	50,000,000	100.50	50,252,000	100.48	50,240,500	0.3	2016/9/20	0.78
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	50,000,000	100.13	50,068,000	100.45	50,226,500	0.6	2023/12/20	0.78
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 5回	50,000,000	100.29	50,146,500	100.30	50,151,500	0.2	2017/6/20	0.78
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 4回	50,000,000	100.29	50,149,000	100.29	50,146,000	0.2	2017/3/20	0.77
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第33 8回	50,000,000	100.03	50,018,000	100.02	50,013,000	0.1	2016/3/15	0.77
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 06回	45,000,000	106.77	48,050,150	106.78	48,051,900	1.4	2020/3/20	0.74
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 01回	45,000,000	106.64	47,990,250	106.60	47,970,450	1.5	2019/6/20	0.74
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 03回	45,000,000	106.38	47,872,800	106.34	47,856,150	1.4	2019/9/20	0.74

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.06
合計	99.06

## (参考)外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	12,500,000	14,345.65	1,793,206,373	14,324.07	1,790,508,938	3.75	2015/8/1	0.61
2	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000	14,712.77	1,618,405,668	14,683.72	1,615,210,245	3.75	2016/8/1	0.55
3	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,700,000	16,852.74	1,466,188,719	17,061.62	1,484,361,131	4.25	2023/10/25	0.50
4	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000	20,898.89	1,462,922,748	20,846.33	1,459,243,170	9	2023/11/1	0.49
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,902.24	1,417,291,202	10,963.39	1,425,241,431	3.125	2019/5/15	0.48
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,816.46	1,406,140,371	10,922.89	1,419,975,728	3.125	2021/5/15	0.48

7	イギリス	国債証券	UK TREASURY	6,800,000	20,433.91	1,389,505,914	20,685.61	1,406,621,759	4.5	2042/12/7	0.47
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,526.97	1,368,506,399	10,621.08	1,380,741,322	2.625	2020/11/15	0.47
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	11,165.92	1,339,910,476	11,246.53	1,349,584,076	3.625	2020/2/15	0.46
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,700,000	15,441.77	1,343,434,678	15,448.69	1,344,036,413	5	2016/10/25	0.45
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,318.09	1,341,352,027	10,313.32	1,340,732,470	1.25	2015/9/30	0.45
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	11,032.49	1,323,899,027	11,106.35	1,332,762,600	3.375	2019/11/15	0.45
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,179.89	1,323,386,732	10,180.69	1,323,490,080	0.25	2015/7/15	0.45
14	イギリス	国債証券	UNITED KINGDOM (GOVERNMENT)	6,400,000	20,340.37	1,301,783,807	20,658.40	1,322,137,785	4.25	2055/12/07	0.45
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,100,000	18,260.25	1,296,477,867	18,605.38	1,320,982,335	4.5	2041/4/25	0.45
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,691.77	1,283,012,677	10,672.31	1,280,677,628	4.25	2015/8/15	0.43
17	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000	19,394.55	1,260,646,248	19,604.81	1,274,313,252	6	2025/10/25	0.43
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,477.73	1,257,327,627	10,470.98	1,256,517,600	2.125	2015/12/31	0.42
19	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,800,000	15,783.45	1,231,109,334	16,015.84	1,249,236,097	3.5	2026/4/25	0.42
20	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000	15,583.56	1,246,685,292	15,604.31	1,248,345,252	4.25	2017/7/4	0.42
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,368.92	1,244,270,701	10,360.18	1,243,222,302	1.875	2015/6/30	0.42
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	11,152.41	1,226,766,110	11,256.46	1,238,210,830	3.625	2021/2/15	0.42
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000	16,199.82	1,214,986,972	16,281.44	1,221,108,075	4.25	2019/4/25	0.41
24	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,700,000	15,651.34	1,205,153,784	15,686.62	1,207,869,894	4.25	2017/10/25	0.41
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,700,000	15,603.62	1,201,479,048	15,577.34	1,199,455,280	5.25	2017/8/1	0.40
26	ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM GOVT	6,300,000	18,612.95	1,172,615,954	18,990.80	1,196,420,403	5	2035/3/28	0.40
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000	19,232.01	1,153,921,194	19,481.70	1,168,902,333	5.5	2029/4/25	0.39
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,500,000	10,921.69	1,146,778,370	10,904.22	1,144,943,671	4.5	2016/2/15	0.39
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000	15,223.21	1,141,741,238	15,237.04	1,142,778,713	3.75	2017/4/25	0.38
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,600,000	10,729.89	1,137,368,849	10,779.53	1,142,630,535	2.75	2019/2/15	0.38

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.31
合 計	98.31

## 【投資不動産物件】

バランスセレクト70

該当事項はありません。

## （参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

## バランスセレクト70

該当事項はありません。

## （参考）国内株式マザーファンド

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2014年06月限)	買建	343	日本円	3,988,680,954	4,121,145,000	2.27

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカント イル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2014 年06月限)	買建	281	米ドル	26,349,812.5	2,678,721,940	26,947,900	2,739,523,514	1.01
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2014年06 月限)	買建	13	カナダド ル	2,157,480	202,350,049	2,166,580	203,203,537	0.07
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指 数先物(2014年06月 限)	買建	144	ユーロ	4,519,940	625,243,299	4,664,160	645,193,247	0.23
	イギリス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2014年06月限)	買建	38	英ポンド	2,547,330	433,224,416	2,606,800	443,338,476	0.16

スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2014年06月限)	買建	19	スイスフラン	1,605,890	181,899,161	1,656,040	187,579,649	0.06
-----	------------------	----------------------	----	----	--------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

## (参考) 国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

## (参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## バランスセレクト70

平成26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。

	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4計算期間 (2005年 5月10日)	1,538	1,540	0.9535	0.9544
第5計算期間 (2006年 5月10日)	2,141	2,147	1.2192	1.2225
第6計算期間 (2007年 5月10日)	2,486	2,494	1.3284	1.3326
第7計算期間 (2008年 5月12日)	1,076	1,078	1.1418	1.1438
第8計算期間 (2009年 5月11日)	915	916	0.8607	0.8622
第9計算期間 (2010年 5月10日)	1,049	1,051	0.9055	0.9070
第10計算期間 (2011年 5月10日)	1,079	1,081	0.8936	0.8951
第11計算期間 (2012年 5月10日)	1,067	1,068	0.8473	0.8488
第12計算期間 (2013年 5月10日)	1,546	1,550	1.2087	1.2117
第13計算期間 (2014年 5月12日)	1,455	1,459	1.2487	1.2527
2013年 5月末日	1,473		1.1744	
6月末日	1,429		1.1495	
7月末日	1,430		1.1630	
8月末日	1,414		1.1480	
9月末日	1,473		1.2060	
10月末日	1,463		1.2253	
11月末日	1,499		1.2755	
12月末日	1,487		1.3122	
2014年 1月末日	1,442		1.2581	
2月末日	1,461		1.2658	



3月末日	1,467		1.2710
4月末日	1,469		1.2563
5月末日	1,487		1.2745

## 【分配の推移】

## バランスセレクト70

	計算期間	1口当たりの分配金
第4計算期間	2004年 5月11日～2005年 5月10日	0.0010円
第5計算期間	2005年 5月11日～2006年 5月10日	0.0035円
第6計算期間	2006年 5月11日～2007年 5月10日	0.0045円
第7計算期間	2007年 5月11日～2008年 5月12日	0.0020円
第8計算期間	2008年 5月13日～2009年 5月11日	0.0015円
第9計算期間	2009年 5月12日～2010年 5月10日	0.0015円
第10計算期間	2010年 5月11日～2011年 5月10日	0.0015円
第11計算期間	2011年 5月11日～2012年 5月10日	0.0015円
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	0.0030円
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	0.0040円

## 【収益率の推移】

## バランスセレクト70

	計算期間	収益率
第4計算期間	2004年 5月11日～2005年 5月10日	5.5%
第5計算期間	2005年 5月11日～2006年 5月10日	28.2%
第6計算期間	2006年 5月11日～2007年 5月10日	9.3%
第7計算期間	2007年 5月11日～2008年 5月12日	13.9%
第8計算期間	2008年 5月13日～2009年 5月11日	24.5%
第9計算期間	2009年 5月12日～2010年 5月10日	5.4%
第10計算期間	2010年 5月11日～2011年 5月10日	1.1%
第11計算期間	2011年 5月11日～2012年 5月10日	5.0%
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	43.0%
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	3.6%

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## バランスセレクト70

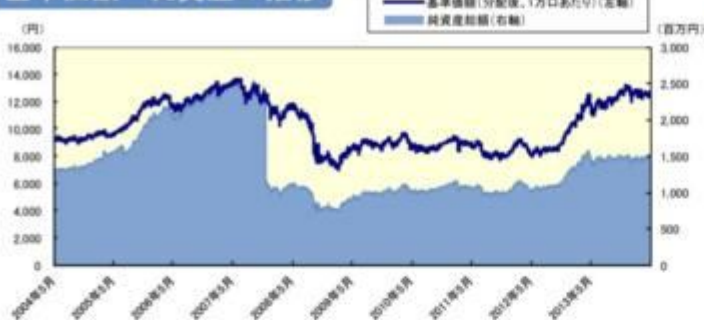
	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第4計算期間	2004年 5月11日～2005年 5月10日	337,581,280	110,901,241	1,613,915,328
第5計算期間	2005年 5月11日～2006年 5月10日	419,211,562	276,639,718	1,756,487,172
第6計算期間	2006年 5月11日～2007年 5月10日	256,972,272	141,691,382	1,871,768,062
第7計算期間	2007年 5月11日～2008年 5月12日	231,644,818	1,160,283,452	943,129,428
第8計算期間	2008年 5月13日～2009年 5月11日	182,555,419	62,393,677	1,063,291,170
第9計算期間	2009年 5月12日～2010年 5月10日	160,277,185	64,125,454	1,159,442,901
第10計算期間	2010年 5月11日～2011年 5月10日	146,780,906	98,117,775	1,208,106,032
第11計算期間	2011年 5月11日～2012年 5月10日	139,934,475	88,744,330	1,259,296,177
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	134,487,166	113,922,703	1,279,860,640
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	120,904,284	235,417,468	1,165,347,456

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 (2014年5月30日現在)

## 基準価額・純資産の推移 (日次)



## 分配の推移 (1万口あたり、課税前)

2014年5月	40 円
2013年5月	30 円
2012年5月	15 円
2011年5月	15 円
2010年5月	15 円
設定来累計	270 円

## 主要な資産の状況

## 銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内株式マザーファンド	45.4
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	24.9
3	国内債券マザーファンド	19.8
4	外国債券マザーファンド	9.9

## 実質的な銘柄別投資比率(上位)

## ・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2.1
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.1
3	ソフトバンク	情報・通信業	0.9
4	本田技研工業	輸送用機器	0.8
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.8

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

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.5
2	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.4
3	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3
4	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.2
5	GENERAL ELEC CO	コングロメリット	0.2

## ・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付(10年)第289回	国債証券	0.3
2	国庫債券 利付(10年)第284回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付(10年)第305回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付(10年)第312回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付(10年)第325回	国債証券	0.2

## ・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.1
2	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.1
3	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	国債証券	0.0
4	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.0
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.0

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2014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、有価証券届出書の「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、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、1.08%(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ます。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。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ます。

一部解約の実行の請求の受け付けについては、午後3時まで、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。

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ます。

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】

## &lt; 基準価額の計算方法 &gt;

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup> 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 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、)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】

(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13期計算期間(平成25年5月11日から平成26年5月12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】

## 【バランスセレクト70】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (平成25年 5月10日現在)	第13期 (平成26年 5月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,399,714	7,019,356
親投資信託受益証券	1,545,281,689	1,453,348,664
未収入金	9,645,790	5,041,045
未収利息	13	12
流動資産合計	1,561,327,206	1,465,409,077
資産合計	1,561,327,206	1,465,409,077
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,839,581	4,661,389
未払解約金	5,651,652	370
未払受託者報酬	337,356	387,050
未払委託者報酬	4,520,622	5,186,437
その他未払費用	20,185	23,163
流動負債合計	14,369,396	10,258,409
負債合計	14,369,396	10,258,409
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,279,860,640	1,165,347,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	267,097,170	289,803,212
(分配準備積立金)	301,988,010	292,102,839
元本等合計	1,546,957,810	1,455,150,668
純資産合計	1,546,957,810	1,455,150,668
負債純資産合計	1,561,327,206	1,465,409,077

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成24年 5月11日 至 平成25年 5月10日	自	平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日
営業収益				
受取利息		2,923		3,286
有価証券売買等損益		476,431,061		63,196,297
営業収益合計		476,433,984		63,199,583
営業費用				
受託者報酬		621,548		775,952
委託者報酬		8,328,784		10,397,680
その他費用		37,169		46,430
営業費用合計		8,987,501		11,220,062
営業利益又は営業損失（ ）		467,446,483		51,979,521
経常利益又は経常損失（ ）		467,446,483		51,979,521
当期純利益又は当期純損失（ ）		467,446,483		51,979,521
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		13,177,758		4,255,956
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		192,265,798		267,097,170
剰余金増加額又は欠損金減少額		17,336,161		28,018,968
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		17,336,161		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		28,018,968
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,402,337		48,375,102
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		48,375,102
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,402,337		-
分配金		3,839,581		4,661,389
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		267,097,170		289,803,212

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、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、信託約款の規定により、平成25年 5月11日から平成26年 5月12日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

第12期 平成25年 5月10日現在	第13期 平成26年 5月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,279,860,640口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,165,347,456口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2087円 (10,000口当たり純資産額) (12,087円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2487円 (10,000口当たり純資産額) (12,487円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第12期 自 平成24年 5月11日 至 平成25年 5月10日	第13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>26,547,717円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>51,853,357円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>307,948,341円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>227,426,517円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>613,775,932円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,279,860,640口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>4,795円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>30円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>3,839,581円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	26,547,717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	51,853,357円	収益調整金額	C	307,948,341円	分配準備積立金額	D	227,426,517円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	613,775,932円	当ファンドの期末残存口数	F	1,279,860,640口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,795円	10,000口当たり分配金額	H	30円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,839,581円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>23,624,172円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>24,099,393円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>307,279,354円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>249,040,663円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>604,043,582円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,165,347,456口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>5,183円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>40円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>4,661,389円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	23,624,172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	24,099,393円	収益調整金額	C	307,279,354円	分配準備積立金額	D	249,040,663円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	604,043,582円	当ファンドの期末残存口数	F	1,165,347,456口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,183円	10,000口当たり分配金額	H	40円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	4,661,389円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	26,547,717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	51,853,357円																																																											
収益調整金額	C	307,948,341円																																																											
分配準備積立金額	D	227,426,517円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	613,775,932円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,279,860,640口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,795円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	30円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,839,581円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	23,624,172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	24,099,393円																																																											
収益調整金額	C	307,279,354円																																																											
分配準備積立金額	D	249,040,663円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	604,043,582円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,165,347,456口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,183円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	40円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	4,661,389円																																																											

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

<p style="text-align: center;">第12期 自 平成24年 5月11日 至 平成25年 5月10日</p>	<p style="text-align: center;">第13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">第12期 平成25年 5月10日現在</p>	<p style="text-align: center;">第13期 平成26年 5月12日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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。	同左
---	----

## （関連当事者との取引に関する注記）

第12期 自 平成24年 5月11日 至 平成25年 5月10日	第13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第12期 自 平成24年 5月11日 至 平成25年 5月10日	第13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日
期首元本額 1,259,296,177円	期首元本額 1,279,860,640円
期中追加設定元本額 134,487,166円	期中追加設定元本額 120,904,284円
期中一部解約元本額 113,922,703円	期中一部解約元本額 235,417,468円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第12期 自 平成24年 5月11日 至 平成25年 5月10日	第13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	443,643,031	53,502,368
合計	443,643,031	53,502,368

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成26年 5月12日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成26年 5月12日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド		652,840,345	
		国内債券マザーファンド		291,069,053	
		外国債券マザーファンド		145,299,597	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド		364,139,669	
	小計	銘柄数: 4 組入時価比率: 99.9%		1,453,348,664 100.0%	
合計			1,453,348,664		

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (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。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成26年 5月12日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,343,250,503
株式	170,574,346,000
派生商品評価勘定	7,368,080
未収入金	454,140,750
未収配当金	1,724,032,989



(平成26年 5月12日現在)

未収利息	4,088
その他未収収益	1,057,470
差入委託証拠金	166,145,000
<b>流動資産合計</b>	<b>182,270,344,880</b>
<b>資産合計</b>	<b>182,270,344,880</b>
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	76,227,449
未払解約金	476,404,373
未払利息	96,907
有価証券貸借取引受入金	7,107,564,764
<b>流動負債合計</b>	<b>7,660,293,493</b>
<b>負債合計</b>	<b>7,660,293,493</b>
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	168,203,176,561
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,406,874,826
<b>元本等合計</b>	<b>174,610,051,387</b>
<b>純資産合計</b>	<b>174,610,051,387</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>182,270,344,880</b>

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、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。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 5月12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	1.0381円
(10,000口当たり純資産額)	(10,381円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	6,715,435,000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25年 5月11日 至 平成26年 5月12日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成26年 5月12日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>    (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>    デリバティブ取引については、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</p> <p>    これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成26年 5月12日現在	
期首	平成25年 5月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	178,653,127,614円
同期中における追加設定元本額	38,791,991,742円
同期中における一部解約元本額	49,241,942,795円
期末元本額	168,203,176,561円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	230,926,517円
バランスセレクト50	580,625,884円
バランスセレクト70	628,880,017円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,851,432,860円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	8,082,763,096円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	13,458,923,054円
野村資産設計ファンド2015	236,140,799円
野村資産設計ファンド2020	179,385,709円
野村資産設計ファンド2025	195,125,720円
野村資産設計ファンド2030	175,343,669円
野村資産設計ファンド2035	137,623,741円
野村資産設計ファンド2040	528,475,217円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	6,595,793,046円
のむらップ・ファンド（保守型）	1,073,418,450円
のむらップ・ファンド（普通型）	1,786,601,724円
のむらップ・ファンド（積極型）	945,908,077円
野村資産設計ファンド2045	24,180,718円
野村インデックスファンド・TOPIX	475,770,545円
マイ・ロード	2,687,733,667円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	43,106,585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）	4,686,022,559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）	1,377,624,733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）	9,332,265,136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）	2,477,829,606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）	21,235,555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）	61,036,450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）	38,804,332円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	11,248,017,452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）	809,657,726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）	5,230,982,118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）	1,728,096,934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）	3,035,398,240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）	922,781,135円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	82,723,011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）	582,828,382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）	8,921,883,230円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,324,054,204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）	1,043,220,476円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	9,298,557円

バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	39,091,942円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	35,926,038円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	91,755,527円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	3,922,274,877円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	11,782,079,587円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,472,388,546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)	30,710,751,043円
マイバランスDC30	1,918,482,638円
マイバランスDC50	2,304,987,794円
マイバランスDC70	1,990,412,912円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	6,083,106,726円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成26年 5月12日現在)

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	極洋	46,000	256.00	11,776,000	貸付株式数	19,000 (19,000)
	日本水産	142,400	235.00	33,464,000		
	マルハニチロ	22,300	1,527.00	34,052,100		
	サカタのタネ	17,100	1,414.00	24,179,400	貸付株式数	7,500
	ホクト	12,900	1,962.00	25,309,800	貸付株式数	1,000 (1,000)
	住石ホールディングス	32,100	120.00	3,852,000	貸付株式数	13,900 (12,600)
	日鉄鉱業	29,000	382.00	11,078,000		
	三井松島産業	76,000	132.00	10,032,000		
	国際石油開発帝石	563,400	1,430.00	805,662,000		
	日本海洋掘削	2,900	3,725.00	10,802,500	貸付株式数	1,200
	石油資源開発	16,500	4,000.00	66,000,000		
	K&Oエナジーグループ	5,700	1,454.00	8,287,800		
	ショーボンドホールディングス	10,300	4,460.00	45,938,000	貸付株式数	800 (700)
	ミライト・ホールディングス	32,900	957.00	31,485,300		
	タマホーム	7,700	756.00	5,821,200	貸付株式数	3,300 (800)
	ダイセキ環境ソリューション	1,000	1,494.00	1,494,000	貸付株式数	200
	安藤・間	77,300	422.00	32,620,600		
	東急建設	41,100	427.00	17,549,700	貸付株式数	17,900
	コムシスホールディングス	56,200	1,671.00	93,910,200		
	ミサワホーム	12,400	1,176.00	14,582,400		
	高松コンストラクショングループ	8,700	1,626.00	14,146,200		
	東建コーポレーション	4,300	4,370.00	18,791,000	貸付株式数	600
	ヤマウラ	5,400	286.00	1,544,400		
	大成建設	586,000	453.00	265,458,000	貸付株式数	240,000 (240,000)
	大林組	347,000	632.00	219,304,000		
	清水建設	354,000	559.00	197,886,000		

飛鳥建設	71,200	145.00	10,324,000	貸付株式数	31,400
長谷工コーポレーション	154,500	665.00	102,742,500		
松井建設	13,000	401.00	5,213,000		
銭高組	17,000	270.00	4,590,000	貸付株式数	5,000 (1,000)
鹿島建設	509,000	378.00	192,402,000		
不動テトラ	81,800	217.00	17,750,600	貸付株式数	35,500 (35,500)
大末建設	44,000	102.00	4,488,000	貸付株式数	19,000
鉄建建設	70,000	271.00	18,970,000	貸付株式数	30,000
日鉄住金テックスエンジ	19,000	431.00	8,189,000		
西松建設	152,000	365.00	55,480,000		
三井住友建設	311,400	103.00	32,074,200	貸付株式数	135,500
大豊建設	36,000	372.00	13,392,000	貸付株式数	15,000
前田建設工業	71,000	737.00	52,327,000		
佐田建設	40,000	111.00	4,440,000	貸付株式数	17,000
ナカノフドー建設	8,900	250.00	2,225,000		
奥村組	103,000	445.00	45,835,000		
大和小田急建設	6,300	290.00	1,827,000	貸付株式数	2,500 (2,500)
東鉄工業	13,900	2,045.00	28,425,500		
イチケン	13,000	163.00	2,119,000		
浅沼組	35,000	126.00	4,410,000	貸付株式数	16,000 (16,000)
戸田建設	135,000	332.00	44,820,000		
熊谷組	125,000	252.00	31,500,000	貸付株式数	3,000
青木あすなろ建設	7,000	577.00	4,039,000		
北野建設	24,000	242.00	5,808,000		
植木組	14,000	199.00	2,786,000		
三井ホーム	15,000	456.00	6,840,000		
矢作建設工業	15,800	867.00	13,698,600		
ピーエス三菱	9,100	447.00	4,067,700	貸付株式数	4,000
大東建託	44,000	10,150.00	446,600,000		
新日本建設	13,800	296.00	4,084,800		
N I P P O	27,000	1,523.00	41,121,000		
東亜道路工業	22,000	433.00	9,526,000		
前田道路	36,000	1,531.00	55,116,000		
日本道路	31,000	491.00	15,221,000		
東亜建設工業	101,000	173.00	17,473,000		
若築建設	62,000	144.00	8,928,000	貸付株式数	22,000
東洋建設	36,000	336.00	12,096,000	貸付株式数	12,900
五洋建設	137,700	314.00	43,237,800	貸付株式数	7,000
大林道路	14,000	531.00	7,434,000		
世紀東急工業	65,000	102.00	6,630,000	貸付株式数	4,000
福田組	17,000	487.00	8,279,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
住友林業	79,700	1,034.00	82,409,800		
日本基礎技術	12,900	324.00	4,179,600	貸付株式数	5,900 (4,400)
日成ビルド工業	30,000	219.00	6,570,000	貸付株式数	7,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	52,000	110.00	5,720,000	貸付株式数	23,000
巴コーポレーション	14,400	418.00	6,019,200	貸付株式数	100
パナホーム	43,000	711.00	30,573,000		
大和ハウス工業	318,000	1,839.00	584,802,000	貸付株式数	2,000 (2,000)
ライト工業	24,100	834.00	20,099,400		

積水ハウス	308,700	1,250.00	385,875,000	貸付株式数	5,800 (5,800)
日特建設	14,100	361.00	5,090,100	貸付株式数	3,700
北陸電気工事	5,000	457.00	2,285,000		
ユアテック	18,000	469.00	8,442,000		
西部電気工業	10,000	451.00	4,510,000		
四電工	10,000	364.00	3,640,000		
中電工	16,700	1,478.00	24,682,600		
関電工	53,000	563.00	29,839,000		
きんでん	77,000	923.00	71,071,000		
東京エネシス	12,000	519.00	6,228,000		
トーエネック	16,000	492.00	7,872,000		
住友電設	8,000	1,056.00	8,448,000		
日本電設工業	18,900	1,407.00	26,592,300		
協和エクシオ	45,400	1,366.00	62,016,400		
新日本空調	9,700	592.00	5,742,400		
N D S	17,000	280.00	4,760,000		
九電工	21,000	877.00	18,417,000		
三機工業	25,000	630.00	15,750,000		
日揮	116,000	3,306.00	383,496,000		
中外炉工業	30,000	211.00	6,330,000	貸付株式数	11,000 (11,000)
ヤマト	10,000	326.00	3,260,000		
太平電業	17,000	723.00	12,291,000		
高砂熱学工業	32,300	1,035.00	33,430,500		
三晃金属工業	13,000	233.00	3,029,000	貸付株式数	3,000
朝日工業社	13,000	367.00	4,771,000		
明星工業	22,000	505.00	11,110,000		
大気社	15,400	2,130.00	32,802,000	貸付株式数	6,500
ダイダン	15,000	541.00	8,115,000		
日比谷総合設備	12,900	1,369.00	17,660,100		
東芝プラントシステム	18,800	1,484.00	27,899,200		
東洋エンジニアリング	62,000	460.00	28,520,000		
千代田化工建設	92,000	1,356.00	124,752,000		
新興ブランテック	23,800	785.00	18,683,000		
日本製粉	71,000	572.00	40,612,000		
日清製粉グループ本社	115,500	1,155.00	133,402,500	貸付株式数	20,900 (20,900)
日東富士製粉	9,000	306.00	2,754,000		
昭和産業	48,000	326.00	15,648,000		
鳥越製粉	9,200	671.00	6,173,200		
協同飼料	40,000	104.00	4,160,000	貸付株式数	4,000
中部飼料	11,100	584.00	6,482,400		
日本配合飼料	35,000	118.00	4,130,000	貸付株式数	14,000
東洋精糖	18,000	97.00	1,746,000		
日本甜菜製糖	59,000	188.00	11,092,000		
三井製糖	45,000	410.00	18,450,000		
塩水港精糖	9,000	264.00	2,376,000	貸付株式数	200
森永製菓	113,000	217.00	24,521,000		
中村屋	27,000	399.00	10,773,000		
江崎グリコ	40,000	1,331.00	53,240,000		
名糖産業	5,100	1,038.00	5,293,800		

不二家	66,000	186.00	12,276,000	貸付株式数	28,000 (16,000)
山崎製パン	85,000	1,177.00	100,045,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
第一屋製パン	16,000	114.00	1,824,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
モロゾフ	18,000	321.00	5,778,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
亀田製菓	6,400	2,911.00	18,630,400	貸付株式数	2,500
カルビー	42,900	2,406.00	103,217,400	貸付株式数	11,300
森永乳業	98,000	376.00	36,848,000		
六甲バター	5,200	871.00	4,529,200	貸付株式数	2,200 (700)
ヤクルト本社	67,800	5,240.00	355,272,000		
明治ホールディングス	34,300	6,160.00	211,288,000		
雪印メグミルク	25,000	1,300.00	32,500,000	貸付株式数	900 (900)
プリマハム	58,000	224.00	12,992,000		
日本ハム	81,000	1,780.00	144,180,000		
伊藤ハム	64,000	459.00	29,376,000	貸付株式数	27,000 (27,000)
林兼産業	37,000	75.00	2,775,000	貸付株式数	16,000 (16,000)
丸大食品	55,000	306.00	16,830,000		
米久	3,700	830.00	3,071,000	貸付株式数	1,200 (1,200)
S Foods	7,300	1,366.00	9,971,800	貸付株式数	3,100 (3,000)
サッポロホールディングス	190,000	432.00	82,080,000		
アサヒグループホールディングス	232,900	2,852.00	664,230,800	貸付株式数	700 (700)
キリンホールディングス	495,700	1,372.00	680,100,400		
宝ホールディングス	91,000	739.00	67,249,000		
オエノンホールディングス	27,000	248.00	6,696,000		
養命酒製造	9,000	921.00	8,289,000		
コカ・コーラウエスト	35,700	1,669.00	59,583,300		
コカ・コーライーストジャパン	23,900	2,186.00	52,245,400		
サントリー食品インターナショナル	79,400	3,660.00	290,604,000		
ダイトードリンク	5,300	4,050.00	21,465,000	貸付株式数	1,300
伊藤園	31,500	2,179.00	68,638,500	貸付株式数	13,700 (1,600)
キーコーヒー	10,900	1,551.00	16,905,900	貸付株式数	4,700 (4,700)
ユニカフェ	3,100	619.00	1,918,900		
ジャパンフーズ	1,500	1,241.00	1,861,500		
日清オイリオグループ	50,000	343.00	17,150,000	貸付株式数	22,000
不二製油	28,100	1,309.00	36,782,900		
かどや製油	1,100	2,602.00	2,862,200	貸付株式数	400
J - オイルミルズ	48,000	287.00	13,776,000	貸付株式数	21,000
キッコーマン	95,000	2,031.00	192,945,000		
味の素	276,000	1,497.00	413,172,000		
キュービー	58,900	1,414.00	83,284,600		
ハウス食品グループ本社	40,700	1,746.00	71,062,200		
カゴメ	44,800	1,675.00	75,040,000	貸付株式数	19,700
焼津水産化学工業	5,000	950.00	4,750,000	貸付株式数	1,900 (1,900)
アリアケジャパン	10,500	2,441.00	25,630,500		
ニチレイ	123,000	490.00	60,270,000		
東洋水産	57,000	3,155.00	179,835,000	貸付株式数	8,000
イートアンド	1,000	1,525.00	1,525,000	貸付株式数	400 (100)
日清食品ホールディングス	45,300	4,650.00	210,645,000	貸付株式数	3,500
永谷園	11,000	954.00	10,494,000		
フジッコ	11,000	1,178.00	12,958,000		

ロック・フィールド	6,000	1,823.00	10,938,000	貸付株式数	2,600 (200)
日本たばこ産業	642,100	3,400.00	2,183,140,000		
ケンコーマヨネーズ	3,800	873.00	3,317,400	貸付株式数	100
わらべや日洋	6,800	1,849.00	12,573,200		
なとり	5,300	1,027.00	5,443,100		
ミヨシ油脂	40,000	133.00	5,320,000	貸付株式数	6,000
片倉工業	12,400	1,241.00	15,388,400	貸付株式数	2,900
グンゼ	88,000	277.00	24,376,000		
東洋紡	457,000	164.00	74,948,000		
ユニチカ	297,000	58.00	17,226,000	貸付株式数	71,000
富士紡ホールディングス	56,000	242.00	13,552,000	貸付株式数	4,000
日清紡ホールディングス	69,000	921.00	63,549,000		
倉敷紡績	111,000	176.00	19,536,000		
シキボウ	62,000	112.00	6,944,000		
日本毛織	34,000	747.00	25,398,000		
大東紡織	16,000	68.00	1,088,000	貸付株式数	6,000
トーア紡コーポレーション	46,000	69.00	3,174,000	貸付株式数	19,000
ガイドーリミテッド	12,100	587.00	7,102,700	貸付株式数	1,600
帝国繊維	11,300	1,420.00	16,046,000		
帝人	443,000	224.00	99,232,000	貸付株式数	88,000
東レ	786,000	643.00	505,398,000		
サカイオーベックス	29,000	174.00	5,046,000	貸付株式数	12,000
住江織物	30,000	305.00	9,150,000		
日本フェルト	6,000	435.00	2,610,000		
イチカワ	7,000	273.00	1,911,000		
日本バイリーン	11,000	554.00	6,094,000		
日東製網	13,000	138.00	1,794,000	貸付株式数	5,000 (1,000)
芦森工業	23,000	123.00	2,829,000		
アツギ	91,000	111.00	10,101,000		
ダイニック	20,000	162.00	3,240,000		
セーレン	29,000	823.00	23,867,000		
東海染工	15,000	112.00	1,680,000	貸付株式数	2,000 (1,000)
小松精練	18,000	521.00	9,378,000		
ワコールホールディングス	64,000	1,014.00	64,896,000		
ホギメディカル	6,800	5,450.00	37,060,000		
レナウン	26,000	116.00	3,016,000	貸付株式数	5,600
クラウドディア	1,200	1,132.00	1,358,400	貸付株式数	300
T S Iホールディングス	52,000	659.00	34,268,000	貸付株式数	6,400 (6,400)
三陽商会	57,000	274.00	15,618,000		
ナイガイ	40,000	73.00	2,920,000	貸付株式数	17,000
オンワードホールディングス	72,000	681.00	49,032,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
ルック	20,000	265.00	5,300,000		
キムラタン	482,000	10.00	4,820,000	貸付株式数	64,000
ゴールドウイン	25,000	503.00	12,575,000		
デサント	25,000	823.00	20,575,000		
キング	5,400	402.00	2,170,800	貸付株式数	2,300 (2,300)
ヤマトインターナショナル	7,000	433.00	3,031,000		
特種東海製紙	63,000	217.00	13,671,000	貸付株式数	12,000 (8,000)
王子ホールディングス	478,000	414.00	197,892,000		



日本製紙	56,000	1,875.00	105,000,000	貸付株式数	14,400
三菱製紙	154,000	87.00	13,398,000	貸付株式数	3,000
北越紀州製紙	73,900	463.00	34,215,700	貸付株式数	19,300 (19,300)
中越パルプ工業	41,000	172.00	7,052,000		
巴川製紙所	17,000	187.00	3,179,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
大王製紙	37,000	1,068.00	39,516,000	貸付株式数	16,000 (16,000)
レンゴー	87,000	456.00	39,672,000		
トーモク	34,000	267.00	9,078,000		
ザ・バック	7,700	1,902.00	14,645,400		
クラレ	172,100	1,138.00	195,849,800		
旭化成	675,000	682.00	460,350,000		
共和レザー	7,100	424.00	3,010,400		
コープケミカル	16,000	112.00	1,792,000	貸付株式数	1,000
昭和電工	721,000	132.00	95,172,000	貸付株式数	275,000 (28,000)
住友化学	797,000	370.00	294,890,000		
日本化成	20,000	129.00	2,580,000	貸付株式数	7,000
住友精化	22,000	667.00	14,674,000	貸付株式数	9,000
日産化学工業	72,400	1,487.00	107,658,800		
ラサ工業	41,000	127.00	5,207,000	貸付株式数	2,000
クレハ	76,000	489.00	37,164,000	貸付株式数	20,000
多木化学	7,000	689.00	4,823,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
テイカ	18,000	278.00	5,004,000		
石原産業	194,000	99.00	19,206,000		
片倉チッカリン	7,000	261.00	1,827,000		
日本曹達	69,000	555.00	38,295,000		
東ソー	289,000	430.00	124,270,000		
トクヤマ	168,000	284.00	47,712,000	貸付株式数	1,000
セントラル硝子	103,000	334.00	34,402,000		
東亜合成	127,000	427.00	54,229,000		
ダイソー	43,000	331.00	14,233,000		
関東電化工業	26,000	240.00	6,240,000	貸付株式数	1,000
電気化学工業	217,000	347.00	75,299,000		
信越化学工業	194,200	5,885.00	1,142,867,000		
日本カーバイド工業	32,000	196.00	6,272,000	貸付株式数	14,000
堺化学工業	44,000	287.00	12,628,000		
エア・ウォーター	89,000	1,377.00	122,553,000		
大陽日酸	139,000	802.00	111,478,000	貸付株式数	9,000
日本化学工業	40,000	132.00	5,280,000	貸付株式数	7,000
日本パーカラライジング	25,500	2,103.00	53,626,500		
高圧ガス工業	16,000	547.00	8,752,000		
チタン工業	13,000	216.00	2,808,000		
四国化成工業	16,000	660.00	10,560,000		
戸田工業	20,000	251.00	5,020,000	貸付株式数	8,000
ステラ ケミファ	5,500	1,306.00	7,183,000	貸付株式数	200 (200)
保土谷化学工業	32,000	193.00	6,176,000	貸付株式数	13,000
日本触媒	92,000	1,213.00	111,596,000		
大日精化工業	42,000	438.00	18,396,000		
カネカ	135,000	602.00	81,270,000		
三菱瓦斯化学	171,000	535.00	91,485,000		

三井化学	492,000	244.00	120,048,000	貸付株式数	213,000
J S R	99,300	1,623.00	161,163,900	貸付株式数	42,200
東京応化工業	20,900	2,112.00	44,140,800		
大阪有機化学工業	7,200	426.00	3,067,200		
三菱ケミカルホールディングス	677,000	403.00	272,831,000		
日本合成化学工業	22,000	687.00	15,114,000		
ダイセル	141,000	868.00	122,388,000		
住友ベークライト	84,000	377.00	31,668,000		
積水化学工業	222,000	1,032.00	229,104,000		
日本ゼオン	85,000	873.00	74,205,000		
アイカ工業	30,400	2,059.00	62,593,600		
宇部興産	546,000	168.00	91,728,000		
積水樹脂	15,200	1,329.00	20,200,800		
タキロン	25,000	460.00	11,500,000		
旭有機材工業	38,000	216.00	8,208,000		
日立化成	46,800	1,551.00	72,586,800		
ニチバン	11,000	335.00	3,685,000		
リケンテクノス	18,000	468.00	8,424,000		
大倉工業	26,000	292.00	7,592,000		
積水化成成品工業	31,000	275.00	8,525,000		
群栄化学工業	29,000	348.00	10,092,000	貸付株式数	13,000
タイガースポリマー	5,300	431.00	2,284,300		
ミライアル	3,600	1,550.00	5,580,000	貸付株式数	1,500
ダイキョーニシカワ	2,600	1,768.00	4,596,800	貸付株式数	100
日本化薬	76,000	1,168.00	88,768,000		
カーリットホールディングス	8,600	467.00	4,016,200		
日本精化	9,000	627.00	5,643,000	貸付株式数	3,900 (3,900)
A D E K A	46,600	1,140.00	53,124,000		
日油	90,000	730.00	65,700,000		
新日本理化	17,100	215.00	3,676,500	貸付株式数	7,500
ハリマ化成グループ	9,200	431.00	3,965,200		
花王	281,600	3,870.00	1,089,792,000	貸付株式数	4,400 (4,400)
第一工業製薬	20,000	318.00	6,360,000	貸付株式数	2,000
三洋化成工業	34,000	617.00	20,978,000		
大日本塗料	62,000	155.00	9,610,000		
日本ペイント	94,000	1,506.00	141,564,000		
関西ペイント	131,000	1,433.00	187,723,000		
神東塗料	8,000	204.00	1,632,000		
中国塗料	31,000	695.00	21,545,000	貸付株式数	3,000
日本特殊塗料	8,300	595.00	4,938,500		
藤倉化成	13,700	480.00	6,576,000		
太陽ホールディングス	8,800	2,927.00	25,757,600		
D I C	384,000	270.00	103,680,000		
サカタインクス	22,100	875.00	19,337,500		
東洋インキ S C ホールディングス	97,000	425.00	41,225,000		
T & K T O K A	3,900	1,889.00	7,367,100		
富士フイルムホールディングス	247,800	2,600.00	644,280,000		
資生堂	192,600	1,731.00	333,390,600	貸付株式数	5,000
ライオン	125,000	561.00	70,125,000	貸付株式数	16,000 (16,000)

高砂香料工業	39,000	493.00	19,227,000		
マンダム	10,800	3,450.00	37,260,000		
ミルボン	6,900	3,305.00	22,804,500		
ファンケル	25,100	1,175.00	29,492,500	貸付株式数	1,100 (600)
コーセー	17,500	3,495.00	61,162,500		
コタ	3,100	1,348.00	4,178,800		
ドクターシーラボ	7,300	3,210.00	23,433,000	貸付株式数	3,100
シーボン	900	2,138.00	1,924,200		
ポーラ・オルビスホールディングス	11,000	3,895.00	42,845,000		
ノエビアホールディングス	7,200	1,923.00	13,845,600	貸付株式数	100
アジュバンコスメジャパン	1,700	902.00	1,533,400	貸付株式数	700 (700)
エステー	6,600	993.00	6,553,800		
コニシ	7,800	1,788.00	13,946,400		
長谷川香料	13,700	1,448.00	19,837,600		
星光PMC	5,900	1,108.00	6,537,200	貸付株式数	2,500 (400)
小林製薬	17,700	6,370.00	112,749,000	貸付株式数	2,100
荒川化学工業	9,100	917.00	8,344,700		
メック	8,400	730.00	6,132,000	貸付株式数	3,500 (3,400)
日本高純度化学	3,000	2,080.00	6,240,000		
JCU	1,600	6,870.00	10,992,000		
新田ゼラチン	6,500	1,026.00	6,669,000	貸付株式数	2,800 (2,000)
アース製薬	7,800	3,630.00	28,314,000		
イハラケミカル工業	16,600	797.00	13,230,200	貸付株式数	7,000 (7,000)
北興化学工業	11,000	343.00	3,773,000		
大成ラミック	2,800	2,453.00	6,868,400	貸付株式数	1,200 (1,100)
クミアイ化学工業	22,000	676.00	14,872,000		
日本農薬	24,700	1,238.00	30,578,600		
アキレス	86,000	133.00	11,438,000		
有沢製作所	18,000	564.00	10,152,000		
日東電工	89,300	4,677.00	417,656,100		
レック	3,400	1,030.00	3,502,000		
きもと	15,800	322.00	5,087,600	貸付株式数	5,700
藤森工業	9,300	3,000.00	27,900,000		
前澤化成工業	7,600	1,041.00	7,911,600	貸付株式数	200
JSP	7,100	1,621.00	11,509,100		
エフビコ	10,700	3,025.00	32,367,500	貸付株式数	2,300
天馬	8,600	1,360.00	11,696,000		
信越ポリマー	21,200	384.00	8,140,800		
東リ	28,000	199.00	5,572,000		
ニフコ	24,200	2,769.00	67,009,800		
日本バルカー工業	45,000	270.00	12,150,000		
ユニ・チャーム	66,400	5,706.00	378,878,400		
協和発酵キリン	130,000	1,194.00	155,220,000		
武田薬品工業	405,600	4,557.00	1,848,319,200	貸付株式数	1,400 (1,400)
アステラス製薬	1,247,000	1,186.00	1,478,942,000		
大日本住友製薬	76,600	1,508.00	115,512,800	貸付株式数	32,000
塩野義製薬	169,100	1,880.00	317,908,000		
田辺三菱製薬	90,100	1,436.00	129,383,600		
わかもと製薬	12,000	257.00	3,084,000		

あすか製薬	12,800	877.00	11,225,600		
日本新薬	25,000	1,910.00	47,750,000		
ピオフェルミン製薬	1,800	2,495.00	4,491,000		
中外製薬	107,800	2,634.00	283,945,200		
科研製薬	39,000	1,794.00	69,966,000		
エーザイ	133,300	3,955.00	527,201,500	貸付株式数	47,700 (500)
ロート製薬	45,400	1,755.00	79,677,000		
小野薬品工業	49,200	8,100.00	398,520,000		
久光製薬	33,600	4,210.00	141,456,000	貸付株式数	4,200
有機合成薬品工業	7,000	261.00	1,827,000		
持田製薬	7,700	7,050.00	54,285,000		
参天製薬	39,800	4,635.00	184,473,000		
扶桑薬品工業	36,000	307.00	11,052,000		
日本ケミファ	15,000	467.00	7,005,000		
ツムラ	31,800	2,419.00	76,924,200		
日医工	25,300	1,567.00	39,645,100		
キッセイ薬品工業	20,100	2,349.00	47,214,900		
生化学工業	22,600	1,218.00	27,526,800		
栄研化学	8,400	1,672.00	14,044,800		
日水製薬	4,300	1,081.00	4,648,300	貸付株式数	2,000 (2,000)
鳥居薬品	7,400	2,912.00	21,548,800		
JCRファーマ	8,300	2,206.00	18,309,800	貸付株式数	3,600 (2,600)
東和薬品	5,500	4,485.00	24,667,500	貸付株式数	2,300 (1,900)
富士製薬工業	3,100	1,922.00	5,958,200	貸付株式数	900
沢井製薬	17,100	6,510.00	111,321,000		
ゼリア新薬工業	17,100	2,235.00	38,218,500		
第一三共	341,400	1,693.00	577,990,200		
キョーリン製薬ホールディングス	28,900	1,911.00	55,227,900		
大幸薬品	5,200	1,457.00	7,576,400	貸付株式数	2,200
ダイト	3,600	1,482.00	5,335,200		
大塚ホールディングス	214,900	2,978.00	639,972,200		
大正製薬ホールディングス	26,000	7,480.00	194,480,000		
日本コークス工業	87,400	112.00	9,788,800		
昭和シェル石油	96,800	1,031.00	99,800,800	貸付株式数	2,300
コスモ石油	299,000	188.00	56,212,000		
ニチレキ	13,000	963.00	12,519,000	貸付株式数	5,000
東燃ゼネラル石油	163,000	962.00	156,806,000	貸付株式数	16,000
ユシロ化学工業	5,900	1,023.00	6,035,700		
ピーピー・カストロール	4,400	564.00	2,481,600		
富士石油	27,600	324.00	8,942,400		
MORESCO	3,400	1,663.00	5,654,200	貸付株式数	1,400
出光興産	51,400	2,063.00	106,038,200		
JXホールディングス	1,201,700	499.00	599,648,300		
横浜ゴム	121,000	864.00	104,544,000		
東洋ゴム工業	90,000	867.00	78,030,000		
ブリヂストン	339,300	3,536.00	1,199,764,800		
住友ゴム工業	84,400	1,360.00	114,784,000		
藤倉ゴム工業	6,800	850.00	5,780,000	貸付株式数	2,800 (2,800)
オカモト	38,000	337.00	12,806,000		

フコク	4,500	913.00	4,108,500		
ニッタ	10,700	2,234.00	23,903,800		
東海ゴム工業	20,000	1,019.00	20,380,000		
三ツ星ベルト	27,000	529.00	14,283,000		
バンドー化学	39,000	379.00	14,781,000		
日東紡績	80,000	406.00	32,480,000		
旭硝子	533,000	550.00	293,150,000		
日本板硝子	522,000	132.00	68,904,000	貸付株式数	11,000 (11,000)
石塚硝子	14,000	184.00	2,576,000		
日本山村硝子	43,000	166.00	7,138,000		
日本電気硝子	224,000	498.00	111,552,000	貸付株式数	75,000
オハラ	4,100	589.00	2,414,900	貸付株式数	1,700
住友大阪セメント	201,000	400.00	80,400,000		
太平洋セメント	636,000	360.00	228,960,000		
デイ・シイ	11,100	541.00	6,005,100		
日本ヒューム	10,000	682.00	6,820,000		
日本コンクリート工業	20,000	389.00	7,780,000	貸付株式数	2,000
三谷セキサン	5,400	1,461.00	7,889,400	貸付株式数	1,600 (1,600)
ジャパンパイル	13,000	826.00	10,738,000		
東海カーボン	101,000	305.00	30,805,000		
日本カーボン	57,000	177.00	10,089,000	貸付株式数	12,000 (8,000)
東洋炭素	6,700	2,256.00	15,115,200	貸付株式数	2,900 (1,000)
ノリタケカンパニーリミテド	61,000	260.00	15,860,000		
TOTO	159,000	1,263.00	200,817,000		
日本碍子	137,000	1,867.00	255,779,000		
日本特殊陶業	93,000	2,566.00	238,638,000	貸付株式数	9,000 (9,000)
ダントーホールディングス	14,000	116.00	1,624,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
MARUWA	2,800	3,585.00	10,038,000		
品川リフラクトリーズ	27,000	202.00	5,454,000		
黒崎播磨	23,000	211.00	4,853,000		
ヨータイ	6,000	294.00	1,764,000	貸付株式数	1,000
イソライト工業	5,300	175.00	927,500	貸付株式数	100
東京窯業	13,000	197.00	2,561,000		
ニッカトー	3,800	397.00	1,508,600		
フジインコーポレーテッド	9,900	1,142.00	11,305,800		
エーアンドエーマテリアル	22,000	112.00	2,464,000	貸付株式数	1,000
ニチアス	52,000	704.00	36,608,000		
ニチハ	13,200	1,111.00	14,665,200		
新日鐵住金	4,576,000	273.00	1,249,248,000		
神戸製鋼所	1,727,000	133.00	229,691,000	貸付株式数	4,000 (4,000)
中山製鋼所	61,000	73.00	4,453,000	貸付株式数	14,000
合同製鐵	55,000	140.00	7,700,000		
ジェイ エフ イー ホールディングス	276,200	1,849.00	510,693,800		
日新製鋼	45,800	1,191.00	54,547,800		
東京製鐵	59,700	474.00	28,297,800		
共英製鋼	10,100	1,684.00	17,008,400		
大和工業	22,400	2,819.00	63,145,600		
東京鐵鋼	23,000	422.00	9,706,000		
大阪製鐵	5,400	1,628.00	8,791,200		

	淀川製鋼所	77,000	408.00	31,416,000		
	東洋鋼板	26,000	479.00	12,454,000		
	丸一鋼管	36,200	2,418.00	87,531,600		
	モリ工業	16,000	361.00	5,776,000		
	大同特殊鋼	181,000	470.00	85,070,000	貸付株式数	79,000 (25,000)
	日本高周波鋼業	42,000	91.00	3,822,000	貸付株式数	2,000
	日本冶金工業	84,600	309.00	26,141,400	貸付株式数	36,500 (1,000)
	山陽特殊製鋼	59,000	410.00	24,190,000	貸付株式数	9,000 (9,000)
	愛知製鋼	57,000	360.00	20,520,000		
	日立金属	96,000	1,396.00	134,016,000		
	日本金属	28,000	128.00	3,584,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
	大平洋金属	75,000	485.00	36,375,000	貸付株式数	9,000
	日本電工	46,000	263.00	12,098,000		
	栗本鐵工所	56,000	229.00	12,824,000		
	虹技	15,000	192.00	2,880,000		
	日本鑄鉄管	12,000	209.00	2,508,000		
	三菱製鋼	65,000	199.00	12,935,000		
	日亜鋼業	15,000	262.00	3,930,000		
	日本精線	8,000	399.00	3,192,000		
	シンニッタン	10,200	403.00	4,110,600		
	新家工業	23,000	156.00	3,588,000		
	大紀アルミニウム工業所	17,000	247.00	4,199,000		
	日本軽金属ホールディングス	245,000	140.00	34,300,000	貸付株式数	7,400
	三井金属鉱業	276,000	243.00	67,068,000		
	東邦亜鉛	61,000	332.00	20,252,000		
	三菱マテリアル	675,000	291.00	196,425,000		
	住友金属鉱山	280,000	1,622.00	454,160,000		
	DOWAホールディングス	119,000	885.00	105,315,000		
	古河機械金属	182,000	191.00	34,762,000		
	大阪チタニウムテクノロジーズ	11,800	2,126.00	25,086,800	貸付株式数	5,100
	東邦チタニウム	18,300	673.00	12,315,900	貸付株式数	8,100
	UACJ	137,000	376.00	51,512,000		
	古河電気工業	340,000	214.00	72,760,000		
	住友電気工業	407,800	1,295.00	528,101,000		
	フジクラ	174,000	420.00	73,080,000		
	昭和電線ホールディングス	139,000	97.00	13,483,000	貸付株式数	57,000
	東京特殊電線	15,000	145.00	2,175,000	貸付株式数	7,000
	タツタ電線	15,800	467.00	7,378,600	貸付株式数	6,800 (6,800)
	沖電線	11,000	170.00	1,870,000	貸付株式数	2,000
	カナレ電気	1,500	1,508.00	2,262,000	貸付株式数	600
	平河ヒューテック	2,300	806.00	1,853,800		
	リョービ	66,000	290.00	19,140,000		
	アーレスティ	9,200	847.00	7,792,400		
	アサヒホールディングス	16,300	1,602.00	26,112,600		
	稲葉製作所	4,600	1,289.00	5,929,400	貸付株式数	400
	宮地エンジニアリンググループ	36,000	200.00	7,200,000	貸付株式数	4,000
	トーカロ	6,600	1,559.00	10,289,400		
	アルファC o	3,600	977.00	3,517,200		
	SUMCO	66,200	743.00	49,186,600	貸付株式数	21,900

川田テクノロジーズ	2,200	3,085.00	6,787,000	貸付株式数	900
東洋製罐グループホールディングス	76,900	1,474.00	113,350,600		
ホッカンホールディングス	26,000	271.00	7,046,000		
コロナ	5,700	1,029.00	5,865,300		
横河ブリッジホールディングス	20,500	1,240.00	25,420,000	貸付株式数	1,100
OSJBホールディングス	23,600	143.00	3,374,800	貸付株式数	10,400
駒井ハルテック	21,000	277.00	5,817,000		
高田機工	9,000	193.00	1,737,000	貸付株式数	2,000 (2,000)
三和ホールディングス	91,000	601.00	54,691,000		
文化シャッター	25,000	581.00	14,525,000		
三協立山	13,200	1,913.00	25,251,600		
東洋シャッター	2,900	672.00	1,948,800		
LIXILグループ	150,800	2,519.00	379,865,200		
日本ファイルコン	7,100	417.00	2,960,700		
ノーリツ	21,200	1,742.00	36,930,400		
長府製作所	11,600	2,467.00	28,617,200	貸付株式数	100
リンナイ	16,800	8,980.00	150,864,000		
ダイニチ工業	5,500	712.00	3,916,000	貸付株式数	2,400
日東精工	15,000	293.00	4,395,000		
三洋工業	14,000	187.00	2,618,000		
岡部	21,300	1,317.00	28,052,100		
中国工業	1,600	725.00	1,160,000	貸付株式数	700
東プレ	20,800	1,129.00	23,483,200	貸付株式数	9,100 (6,000)
高周波熱錬	15,800	642.00	10,143,600		
東京製綱	73,000	148.00	10,804,000	貸付株式数	17,000 (2,000)
サンコール	7,000	581.00	4,067,000		
モリテック スチール	5,400	277.00	1,495,800		
パイオラックス	5,000	3,120.00	15,600,000		
日本発條	86,200	909.00	78,355,800		
中央発條	14,000	302.00	4,228,000		
アドバネクス	21,000	145.00	3,045,000	貸付株式数	8,000
三益半導体工業	9,100	936.00	8,517,600		
日本ドライケミカル	1,000	2,237.00	2,237,000		
日本製鋼所	155,000	379.00	58,745,000	貸付株式数	4,000 (4,000)
三浦工業	16,100	2,904.00	46,754,400	貸付株式数	5,200 (5,200)
タクマ	34,000	786.00	26,724,000		
ツガミ	34,000	552.00	18,768,000	貸付株式数	14,000
オークマ	70,000	867.00	60,690,000		
東芝機械	59,000	405.00	23,895,000		
アマダ	165,000	749.00	123,585,000		
アイダエンジニアリング	25,400	956.00	24,282,400	貸付株式数	400 (400)
滝澤鉄工所	36,000	142.00	5,112,000	貸付株式数	3,000
富士機械製造	33,000	884.00	29,172,000		
牧野フライス製作所	54,000	735.00	39,690,000	貸付株式数	11,000
オーエスジー	44,500	1,641.00	73,024,500		
ダイジェット工業	12,000	146.00	1,752,000	貸付株式数	3,000
旭ダイヤモンド工業	27,800	1,327.00	36,890,600		
DMG森精機	64,000	1,252.00	80,128,000	貸付株式数	7,700 (7,700)
ディスコ	12,000	6,080.00	72,960,000	貸付株式数	4,900

日東工器	6,300	1,889.00	11,900,700		
パンチ工業	1,700	931.00	1,582,700		
豊和工業	6,000	716.00	4,296,000		
大阪機工	42,000	128.00	5,376,000	貸付株式数	18,000
東洋機械金属	8,000	522.00	4,176,000		
津田駒工業	26,000	136.00	3,536,000	貸付株式数	11,000
エンシュウ	27,000	123.00	3,321,000	貸付株式数	11,000 (3,000)
島精機製作所	14,100	1,688.00	23,800,800	貸付株式数	2,800
日阪製作所	14,000	906.00	12,684,000		
やまびこ	4,200	3,610.00	15,162,000		
ベガサスミシン製造	9,900	351.00	3,474,900		
ナプテスコ	49,400	2,157.00	106,555,800		
三井海洋開発	9,500	2,295.00	21,802,500	貸付株式数	3,600
レオン自動機	10,000	542.00	5,420,000		
S M C	31,000	23,780.00	737,180,000		
新川	9,000	568.00	5,112,000	貸付株式数	4,100 (4,100)
ホソカワミクロン	18,000	571.00	10,278,000		
ユニオンツール	4,700	2,377.00	11,171,900	貸付株式数	2,000
オイレス工業	10,200	2,260.00	23,052,000		
日精エー・エス・ビー機械	3,400	1,725.00	5,865,000	貸付株式数	1,200
サトーホールディングス	11,800	2,195.00	25,901,000	貸付株式数	4,700 (4,700)
日本エアータック	3,200	439.00	1,404,800	貸付株式数	100
日精樹脂工業	7,900	527.00	4,163,300		
ワイエイシイ	4,300	602.00	2,588,600		
小松製作所	505,000	2,190.00	1,105,950,000	貸付株式数	219,800
住友重機械工業	296,000	430.00	127,280,000		
日立建機	55,200	1,883.00	103,941,600	貸付株式数	1,000
日工	16,000	427.00	6,832,000		
巴工業	3,700	1,587.00	5,871,900	貸付株式数	1,700 (1,000)
井関農機	111,000	255.00	28,305,000	貸付株式数	34,000 (13,000)
T O W A	8,800	501.00	4,408,800	貸付株式数	2,200
丸山製作所	24,000	229.00	5,496,000	貸付株式数	10,000
北川鉄工所	50,000	162.00	8,100,000		
クボタ	562,000	1,303.00	732,286,000		
荏原実業	2,800	1,423.00	3,984,400	貸付株式数	1,200 (1,200)
三菱化工機	36,000	153.00	5,508,000	貸付株式数	15,000
月島機械	18,000	1,026.00	18,468,000		
帝国電機製作所	3,600	2,741.00	9,867,600	貸付株式数	1,200
東京機械製作所	38,000	83.00	3,154,000	貸付株式数	7,000
新東工業	25,400	711.00	18,059,400		
澁谷工業	9,000	2,562.00	23,058,000	貸付株式数	4,000
アイチ コーポレーション	15,300	420.00	6,426,000		
小森コーポレーション	26,300	1,274.00	33,506,200		
鶴見製作所	8,000	1,251.00	10,008,000		
住友精密工業	17,000	366.00	6,222,000	貸付株式数	2,000 (1,000)
酒井重工業	21,000	356.00	7,476,000	貸付株式数	2,000 (2,000)
荏原製作所	239,000	634.00	151,526,000	貸付株式数	17,000
石井鐵工所	16,000	240.00	3,840,000	貸付株式数	3,000
西島製作所	11,500	1,218.00	14,007,000	貸付株式数	100



北越工業	8,000	573.00	4,584,000		
ダイキン工業	141,200	5,897.00	832,656,400		
オルガノ	17,000	490.00	8,330,000	貸付株式数	5,000
トーヨーカネツ	58,000	238.00	13,804,000		
栗田工業	65,000	2,136.00	138,840,000	貸付株式数	3,400
橋本チエイン	55,000	732.00	40,260,000		
大同工業	21,000	273.00	5,733,000		
日本コンベヤ	34,000	123.00	4,182,000	貸付株式数	14,000
木村化工機	9,900	452.00	4,474,800	貸付株式数	4,300
アネスト岩田	17,500	571.00	9,992,500		
ダイフク	43,800	1,150.00	50,370,000		
サムコ	1,400	1,103.00	1,544,200	貸付株式数	500
加藤製作所	25,000	588.00	14,700,000		
油研工業	20,000	202.00	4,040,000		
タダノ	46,000	1,417.00	65,182,000	貸付株式数	1,000
フジテック	30,100	1,113.00	33,501,300		
C K D	29,000	907.00	26,303,000		
キトー	6,100	1,927.00	11,754,700		
平和	22,400	1,709.00	38,281,600		
理想科学工業	8,000	2,804.00	22,432,000		
S A N K Y O	31,300	3,900.00	122,070,000		
日本金銭機械	9,500	1,695.00	16,102,500	貸付株式数	4,100 (900)
マースエンジニアリング	5,800	1,853.00	10,747,400	貸付株式数	100
福島工業	5,700	1,447.00	8,247,900		
オーイズミ	3,600	863.00	3,106,800	貸付株式数	1,500
ダイコク電機	4,300	1,812.00	7,791,600		
アマノ	29,500	947.00	27,936,500		
J U K I	66,000	219.00	14,454,000		
サンデン	59,000	445.00	26,255,000	貸付株式数	10,000 (10,000)
蛇の目マシン工業	100,000	80.00	8,000,000	貸付株式数	35,000
マックス	16,000	1,085.00	17,360,000	貸付株式数	1,000
グローリー	30,800	2,738.00	84,330,400		
新晃工業	7,200	957.00	6,890,400		
大和冷機工業	17,000	621.00	10,557,000		
セガサミーホールディングス	111,100	2,022.00	224,644,200		
日本ピストンリング	40,000	170.00	6,800,000		
リケン	41,000	378.00	15,498,000		
T P R	11,500	1,475.00	16,962,500		
ホシザキ電機	22,600	4,350.00	98,310,000		
大豊工業	7,400	909.00	6,726,600		
日本精工	230,000	1,145.00	263,350,000		
N T N	239,000	339.00	81,021,000		
ジェイテクト	109,900	1,470.00	161,553,000	貸付株式数	1,200 (1,200)
不二越	96,000	613.00	58,848,000		
日本トムソン	33,000	462.00	15,246,000	貸付株式数	1,000
T H K	64,500	2,082.00	134,289,000		
ユーシン精機	4,600	2,519.00	11,587,400	貸付株式数	1,900 (900)
前澤給装工業	3,900	1,332.00	5,194,800	貸付株式数	1,600 (1,600)
イーグル工業	12,800	1,687.00	21,593,600		

前澤工業	7,600	301.00	2,287,600		
日本ビラー工業	11,300	704.00	7,955,200		
キッツ	46,400	456.00	21,158,400		
日立工機	27,700	793.00	21,966,100	貸付株式数	10,000
マキタ	67,400	5,460.00	368,004,000		
日立造船	81,300	502.00	40,812,600	貸付株式数	8,000
三菱重工業	1,841,000	556.00	1,023,596,000		
I H I	745,000	405.00	301,725,000		
イビデン	63,000	1,797.00	113,211,000	貸付株式数	4,900
コニカミノルタ	273,100	842.00	229,950,200		
ブラザー工業	133,600	1,528.00	204,140,800		
ミネベア	141,000	919.00	129,579,000		
日立製作所	2,488,000	731.00	1,818,728,000		
東芝	2,041,000	394.00	804,154,000		
三菱電機	1,034,000	1,182.00	1,222,188,000		
富士電機	288,000	448.00	129,024,000		
東洋電機製造	22,000	363.00	7,986,000	貸付株式数	3,000
安川電機	113,400	1,137.00	128,935,800	貸付株式数	10,900
シンフォニアテクノロジー	62,000	154.00	9,548,000		
明電舎	95,000	427.00	40,565,000		
オリジン電気	15,000	276.00	4,140,000		
山洋電気	21,000	665.00	13,965,000		
デンヨー	10,200	1,619.00	16,513,800		
東芝テック	65,000	663.00	43,095,000		
芝浦メカトロニクス	18,000	242.00	4,356,000	貸付株式数	1,000
マブチモーター	14,600	6,980.00	101,908,000		
日本電産	111,800	5,593.00	625,297,400	貸付株式数	42,000
東光高岳	5,700	1,396.00	7,957,200	貸付株式数	1,900
ダイヘン	61,000	402.00	24,522,000		
ヤーマン	1,300	1,300.00	1,690,000	貸付株式数	500 (400)
J V C ケンウッド	71,400	199.00	14,208,600	貸付株式数	31,400 (500)
第一精工	4,300	1,339.00	5,757,700	貸付株式数	1,800 (500)
日新電機	21,000	548.00	11,508,000		
大崎電気工業	16,000	609.00	9,744,000	貸付株式数	7,000 (4,000)
オムロン	116,700	3,660.00	427,122,000		
日東工業	15,200	1,978.00	30,065,600		
I D E C	13,500	887.00	11,974,500		
ジーエス・ユアサ コーポレーション	199,000	566.00	112,634,000	貸付株式数	84,000
サクサホールディングス	26,000	155.00	4,030,000		
メルコホールディングス	5,000	1,449.00	7,245,000	貸付株式数	2,000
テクノメディカ	2,300	1,961.00	4,510,300		
日本電気	1,422,000	284.00	403,848,000		
富士通	997,000	649.00	647,053,000		
沖電気工業	399,000	200.00	79,800,000		
岩崎通信機	49,000	91.00	4,459,000		
電気興業	29,000	615.00	17,835,000		
サンケン電気	56,000	750.00	42,000,000		
ナカヨ通信機	10,000	337.00	3,370,000		
アイホン	6,000	1,746.00	10,476,000	貸付株式数	2,700 (2,700)

ルネサスエレクトロニクス	53,500	714.00	38,199,000	貸付株式数	23,600 (300)
セイコーエプソン	70,600	3,160.00	223,096,000	貸付株式数	500
ワコム	81,400	538.00	43,793,200	貸付株式数	35,400
アルバック	19,000	1,848.00	35,112,000		
アクセル	5,200	1,501.00	7,805,200		
E I Z O	9,500	2,664.00	25,308,000		
ジャパンディスプレイ	173,800	603.00	104,801,400		
日本信号	28,500	838.00	23,883,000		
京三製作所	24,000	347.00	8,328,000		
能美防災	14,000	1,295.00	18,130,000		
ホーチキ	7,000	597.00	4,179,000		
エレコム	3,800	1,687.00	6,410,600		
日本無線	27,000	471.00	12,717,000	貸付株式数	11,000
パナソニック	1,181,300	1,055.00	1,246,271,500		
シャープ	746,000	259.00	193,214,000	貸付株式数	325,000 (1,000)
アンリツ	60,100	1,063.00	63,886,300		
富士通ゼネラル	25,000	1,152.00	28,800,000		
日立国際電気	20,000	1,183.00	23,660,000		
ソニー	570,200	1,754.00	1,000,130,800	貸付株式数	247,500 (500)
T D K	62,400	4,110.00	256,464,000		
帝国通信工業	24,000	166.00	3,984,000		
ミツミ電機	39,300	687.00	26,999,100		
タムラ製作所	40,000	289.00	11,560,000		
アルプス電気	75,800	1,191.00	90,277,800	貸付株式数	900 (900)
池上通信機	33,000	105.00	3,465,000	貸付株式数	14,000 (2,000)
パイオニア	143,400	217.00	31,117,800		
日本電波工業	9,300	804.00	7,477,200	貸付株式数	1,500 (900)
日本トリム	2,200	3,335.00	7,337,000	貸付株式数	900 (300)
ローランド ディー . ジー .	4,600	3,260.00	14,996,000	貸付株式数	1,200 (1,200)
フォスター電機	10,600	1,169.00	12,391,400		
クラリオン	64,000	207.00	13,248,000	貸付株式数	27,000
S M K	30,000	386.00	11,580,000	貸付株式数	13,000 (2,000)
ヨコオ	8,700	512.00	4,454,400		
東光	24,000	300.00	7,200,000		
ティアック	56,000	66.00	3,696,000	貸付株式数	24,000
ホシデン	30,300	505.00	15,301,500	貸付株式数	13,300
ヒロセ電機	18,000	14,290.00	257,220,000	貸付株式数	3,100 (1,600)
日本航空電子工業	27,000	1,682.00	45,414,000		
T O A	11,100	1,117.00	12,398,700		
日立マクセル	18,000	1,813.00	32,634,000	貸付株式数	5,700
古野電気	13,300	712.00	9,469,600	貸付株式数	5,200 (4,200)
ユニデン	32,000	236.00	7,552,000		
アルパイン	22,400	1,190.00	26,656,000		
スミダコーポレーション	8,500	632.00	5,372,000		
アイコム	5,700	2,275.00	12,967,500		
リオン	2,900	1,520.00	4,408,000	貸付株式数	1,200 (1,100)
船井電機	10,400	1,035.00	10,764,000	貸付株式数	4,500 (4,100)
横河電機	112,100	1,354.00	151,783,400		
新電元工業	33,000	395.00	13,035,000	貸付株式数	4,000

アズビル	31,300	2,331.00	72,960,300		
東亜ディーケーケー	3,800	492.00	1,869,600		
日本光電工業	22,000	4,665.00	102,630,000		
チノー	18,000	217.00	3,906,000		
共和電業	12,000	507.00	6,084,000		
日本電子材料	4,400	417.00	1,834,800	貸付株式数	1,800
堀場製作所	19,100	3,160.00	60,356,000		
アドバンテスト	70,500	1,069.00	75,364,500	貸付株式数	20,100 (8,100)
小野測器	10,000	468.00	4,680,000		
エスベック	10,700	768.00	8,217,600		
パナソニック デバイスSUNX	9,100	453.00	4,122,300		
キーエンス	23,400	37,165.00	869,661,000		
日置電機	5,400	1,592.00	8,596,800	貸付株式数	1,300
シスメックス	86,600	3,320.00	287,512,000		
メガチップス	9,300	1,101.00	10,239,300	貸付株式数	3,400
OBARA GROUP	6,700	3,600.00	24,120,000		
日本電産コバル電子	10,700	778.00	8,324,600		
澤藤電機	6,000	214.00	1,284,000	貸付株式数	2,000
コーセル	15,000	1,161.00	17,415,000		
新日本無線	8,000	379.00	3,032,000	貸付株式数	3,000 (2,000)
オブテックス	6,500	1,678.00	10,907,000		
千代田インテグレ	4,500	1,401.00	6,304,500		
レーザーテック	10,600	983.00	10,419,800	貸付株式数	100
スタンレー電気	74,500	2,184.00	162,708,000		
岩崎電気	38,000	233.00	8,854,000		
ウシオ電機	62,800	1,203.00	75,548,400		
岡谷電機産業	5,500	376.00	2,068,000	貸付株式数	2,300 (2,300)
ヘリオス テクノ ホールディング	8,800	290.00	2,552,000		
日本セラミック	5,900	1,643.00	9,693,700	貸付株式数	2,500 (2,500)
遠藤照明	5,700	1,400.00	7,980,000	貸付株式数	2,500
日本デジタル研究所	7,600	1,506.00	11,445,600		
古河電池	7,000	681.00	4,767,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
双信電機	5,000	355.00	1,775,000		
山一電機	11,200	412.00	4,614,400	貸付株式数	4,500
図研	6,700	795.00	5,326,500		
日本電子	40,000	380.00	15,200,000	貸付株式数	9,000
カシオ計算機	107,500	1,230.00	132,225,000		
ファナック	115,300	17,070.00	1,968,171,000		
日本シイエムケイ	24,300	248.00	6,026,400	貸付株式数	10,600 (300)
エンプラス	3,900	6,270.00	24,453,000		
大真空	19,000	397.00	7,543,000		
ローム	54,600	5,490.00	299,754,000		
浜松ホトニクス	43,000	4,455.00	191,565,000		
三井ハイテック	13,600	641.00	8,717,600		
新光電気工業	34,700	771.00	26,753,700	貸付株式数	14,900
京セラ	181,800	4,509.00	819,736,200		
太陽誘電	50,300	1,207.00	60,712,100	貸付株式数	22,100 (100)
村田製作所	108,500	8,628.00	936,138,000		
コーシン	14,400	605.00	8,712,000	貸付株式数	6,600

双葉電子工業	19,200	1,530.00	29,376,000		
北陸電気工業	42,000	144.00	6,048,000	貸付株式数	3,000
ニチコン	32,600	775.00	25,265,000		
日本ケミコン	72,000	326.00	23,472,000	貸付株式数	31,000 (4,000)
K O A	13,000	940.00	12,220,000		
市光工業	25,000	137.00	3,425,000	貸付株式数	4,000
小糸製作所	56,800	2,097.00	119,109,600		
ミツバ	19,000	1,528.00	29,032,000		
スター精密	19,600	1,266.00	24,813,600	貸付株式数	8,300 (8,300)
大日本スクリーン製造	98,000	422.00	41,356,000		
キャノン電子	9,500	1,716.00	16,302,000		
キャノン	599,500	3,275.00	1,963,362,500		
リコー	310,900	1,174.00	364,996,600		
M U T O Hホールディングス	14,000	455.00	6,370,000	貸付株式数	6,000
東京エレクトロン	92,800	6,001.00	556,892,800		
トヨタ紡織	36,100	1,024.00	36,966,400	貸付株式数	15,900 (100)
鬼怒川ゴム工業	19,000	463.00	8,797,000		
ユニプレス	16,700	1,882.00	31,429,400	貸付株式数	1,100 (1,100)
豊田自動織機	94,100	4,485.00	422,038,500		
モリタホールディングス	18,000	841.00	15,138,000		
三櫻工業	13,100	617.00	8,082,700		
デンソー	255,400	4,297.00	1,097,453,800		
東海理化電機製作所	27,200	1,684.00	45,804,800		
三井造船	400,000	188.00	75,200,000		
佐世保重工業	73,000	104.00	7,592,000	貸付株式数	32,000 (24,000)
川崎重工業	805,000	371.00	298,655,000	貸付株式数	84,000
名村造船所	20,200	868.00	17,533,600	貸付株式数	8,700 (3,500)
サノヤスホールディングス	12,600	225.00	2,835,000	貸付株式数	5,500 (200)
日本車輛製造	38,000	353.00	13,414,000	貸付株式数	15,000 (8,000)
ニチユ三菱フォークリフト	12,000	677.00	8,124,000		
近畿車輛	18,000	294.00	5,292,000		
日産自動車	1,451,300	869.00	1,261,179,700	貸付株式数	105,000 (8,800)
いすゞ自動車	599,000	565.00	338,435,000		
トヨタ自動車	1,439,000	5,514.00	7,934,646,000		
日野自動車	129,100	1,216.00	156,985,600		
三菱自動車工業	370,000	1,046.00	387,020,000		
エフテック	4,300	1,138.00	4,893,400	貸付株式数	1,800 (100)
レシップホールディングス	3,400	781.00	2,655,400	貸付株式数	1,400 (100)
G M B	1,300	1,337.00	1,738,100		
武蔵精密工業	11,000	2,105.00	23,155,000	貸付株式数	4,400 (1,800)
日産車体	50,500	1,519.00	76,709,500		
新明和工業	42,000	854.00	35,868,000		
極東開発工業	17,800	1,307.00	23,264,600		
日信工業	21,000	1,805.00	37,905,000		
トビー工業	85,000	182.00	15,470,000		
ティラド	40,000	277.00	11,080,000		
曙ブレーキ工業	48,000	486.00	23,328,000	貸付株式数	20,900 (500)
タチエス	15,200	1,584.00	24,076,800	貸付株式数	6,600 (500)
N O K	50,000	1,637.00	81,850,000		

フタバ産業	31,500	457.00	14,395,500		
カヤバ工業	97,000	391.00	37,927,000	貸付株式数	1,000
シロキ工業	23,000	195.00	4,485,000		
大同メタル工業	14,000	1,054.00	14,756,000		
プレス工業	40,000	357.00	14,280,000	貸付株式数	17,000
カルソニックカンセイ	70,000	478.00	33,460,000		
太平洋工業	21,100	694.00	14,643,400		
ケーヒン	23,800	1,464.00	34,843,200		
河西工業	14,000	702.00	9,828,000		
アイシン精機	94,600	3,450.00	326,370,000		
富士機工	12,000	375.00	4,500,000		
マツダ	1,541,000	432.00	665,712,000		
ダイハツ工業	109,700	1,699.00	186,380,300		
今仙電機製作所	7,600	1,271.00	9,659,600	貸付株式数	3,300 (3,100)
本田技研工業	930,500	3,311.00	3,080,885,500		
スズキ	216,100	2,651.00	572,881,100		
富士重工業	351,900	2,465.00	867,433,500		
ヤマハ発動機	157,200	1,558.00	244,917,600		
ショーワ	24,400	1,088.00	26,547,200		
T B K	11,000	469.00	5,159,000		
エクセディ	12,500	2,571.00	32,137,500		
豊田合成	33,400	1,843.00	61,556,200	貸付株式数	2,000
愛三工業	12,500	773.00	9,662,500		
ヨロズ	7,600	1,913.00	14,538,800		
エフ・シー・シー	16,900	1,651.00	27,901,900	貸付株式数	4,500
シマノ	44,600	10,090.00	450,014,000	貸付株式数	3,000
タカタ	18,700	1,955.00	36,558,500		
テイ・エス テック	21,800	2,628.00	57,290,400		
テルモ	158,500	2,002.00	317,317,000		
クリエートメディック	3,400	951.00	3,233,400		
日機装	33,500	1,180.00	39,530,000	貸付株式数	200
島津製作所	133,000	851.00	113,183,000		
J M S	19,000	284.00	5,396,000		
クボテック	2,700	275.00	742,500	貸付株式数	1,100 (800)
ショットモリテックス	2,200	272.00	598,400		
長野計器	6,600	652.00	4,303,200	貸付株式数	1,600 (1,600)
ブイ・テクノロジー	2,100	3,140.00	6,594,000	貸付株式数	300 (200)
東京計器	36,000	270.00	9,720,000	貸付株式数	1,000
愛知時計電機	14,000	287.00	4,018,000		
東京精密	18,600	1,648.00	30,652,800		
マニ	2,900	4,390.00	12,731,000	貸付株式数	500 (500)
ニコン	193,000	1,603.00	309,379,000	貸付株式数	82,400 (200)
トプコン	27,800	1,882.00	52,319,600	貸付株式数	4,300
オリンパス	154,000	3,185.00	490,490,000		
理研計器	9,100	1,013.00	9,218,300		
タムロン	7,900	2,383.00	18,825,700	貸付株式数	1,800 (1,400)
H O Y A	251,400	3,149.00	791,658,600		
ノーリツ鋼機	9,300	843.00	7,839,900		
エー・アンド・デイ	9,400	504.00	4,737,600		

シチズンホールディングス	127,300	751.00	95,602,300		
リズム時計工業	47,000	143.00	6,721,000		
大研医器	3,600	1,581.00	5,691,600	貸付株式数	1,300
松風	5,000	845.00	4,225,000	貸付株式数	2,300
セイコーホールディングス	66,000	381.00	25,146,000		
ニプロ	55,000	867.00	47,685,000	貸付株式数	24,500
パラマウントベッドホールディングス	9,900	3,050.00	30,195,000		
S H O - B I	3,400	404.00	1,373,600	貸付株式数	800
前田工織	9,400	1,387.00	13,037,800	貸付株式数	2,600
永大産業	14,000	543.00	7,602,000		
アートネイチャー	3,300	2,895.00	9,553,500		
ダンロップスポーツ	5,600	1,216.00	6,809,600		
バンダイナムコホールディングス	114,000	2,216.00	252,624,000		
共立印刷	18,700	266.00	4,974,200		
フランスベッドホールディングス	65,000	183.00	11,895,000	貸付株式数	10,000 (10,000)
パイロットコーポレーション	9,000	3,970.00	35,730,000		
トッパン・フォームズ	18,500	937.00	17,334,500		
フジシールインターナショナル	12,600	2,973.00	37,459,800		
タカラトミー	34,000	482.00	16,388,000	貸付株式数	14,500 (3,800)
廣済堂	9,600	434.00	4,166,400	貸付株式数	2,400 (2,400)
アーク	30,600	189.00	5,783,400	貸付株式数	12,700
タカノ	4,500	520.00	2,340,000	貸付株式数	2,000 (2,000)
プロネクサス	10,500	763.00	8,011,500		
ホクシン	7,300	132.00	963,600	貸付株式数	3,200 (3,200)
ウッドワン	17,000	294.00	4,998,000		
大建工業	42,000	270.00	11,340,000		
凸版印刷	292,000	716.00	209,072,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
大日本印刷	315,000	935.00	294,525,000	貸付株式数	140,000 (140,000)
図書印刷	17,000	395.00	6,715,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
共同印刷	32,000	270.00	8,640,000		
日本写真印刷	17,300	1,393.00	24,098,900	貸付株式数	7,500 (300)
光村印刷	10,000	258.00	2,580,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
宝印刷	5,800	789.00	4,576,200	貸付株式数	2,500 (2,500)
アシックス	102,700	2,018.00	207,248,600	貸付株式数	16,700 (16,700)
ツツミ	5,200	2,243.00	11,663,600		
ローランド	9,900	1,586.00	15,701,400		
小松ウオール工業	3,500	2,211.00	7,738,500		
ヤマハ	76,000	1,524.00	115,824,000		
河合楽器製作所	36,000	179.00	6,444,000		
クリナップ	10,500	873.00	9,166,500		
ビジョン	16,900	4,490.00	75,881,000	貸付株式数	2,400
兼松日産農林	16,000	142.00	2,272,000	貸付株式数	7,000
キングジム	8,600	735.00	6,321,000		
リンテック	24,600	1,854.00	45,608,400		
T A S A K I	2,100	666.00	1,398,600	貸付株式数	900
イトーキ	21,800	761.00	16,589,800		
任天堂	63,700	10,715.00	682,545,500	貸付株式数	27,800
三菱鉛筆	8,500	2,914.00	24,769,000		
タカラスタンダード	43,000	723.00	31,089,000		

コクヨ	53,700	747.00	40,113,900	貸付株式数	9,300 (9,300)
ナカバヤシ	22,000	197.00	4,334,000		
グローブライド	54,000	119.00	6,426,000		
岡村製作所	40,000	830.00	33,200,000		
美津濃	51,000	568.00	28,968,000		
アデランス	12,900	1,485.00	19,156,500	貸付株式数	3,300
東京電力	877,000	389.00	341,153,000		
中部電力	340,700	1,174.00	399,981,800		
関西電力	421,900	916.00	386,460,400	貸付株式数	10,800
中国電力	142,900	1,360.00	194,344,000		
北陸電力	101,300	1,245.00	126,118,500		
東北電力	258,300	1,013.00	261,657,900		
四国電力	93,100	1,312.00	122,147,200	貸付株式数	40,600
九州電力	228,300	1,134.00	258,892,200	貸付株式数	53,300 (53,300)
北海道電力	96,800	717.00	69,405,600	貸付株式数	40,900
沖縄電力	6,800	3,350.00	22,780,000		
電源開発	64,200	2,680.00	172,056,000		
東京瓦斯	1,212,000	550.00	666,600,000		
大阪瓦斯	1,070,000	372.00	398,040,000		
東邦瓦斯	263,000	501.00	131,763,000		
北海道瓦斯	20,000	272.00	5,440,000	貸付株式数	8,000
西部瓦斯	116,000	250.00	29,000,000	貸付株式数	2,000
静岡瓦斯	26,900	610.00	16,409,000		
SBSホールディングス	2,200	1,760.00	3,872,000		
東武鉄道	587,000	486.00	285,282,000	貸付株式数	47,000
相鉄ホールディングス	177,000	356.00	63,012,000	貸付株式数	11,000
東京急行電鉄	608,000	646.00	392,768,000		
京浜急行電鉄	266,000	819.00	217,854,000		
小田急電鉄	331,000	883.00	292,273,000		
京王電鉄	289,000	710.00	205,190,000	貸付株式数	5,000 (5,000)
京成電鉄	155,000	875.00	135,625,000	貸付株式数	5,000 (5,000)
富士急行	28,000	1,000.00	28,000,000	貸付株式数	12,000 (1,000)
新京成電鉄	13,000	368.00	4,784,000		
東日本旅客鉄道	190,200	7,581.00	1,441,906,200		
西日本旅客鉄道	93,300	4,103.00	382,809,900		
東海旅客鉄道	92,600	12,450.00	1,152,870,000		
鴻池運輸	7,300	1,659.00	12,110,700	貸付株式数	300
西日本鉄道	134,000	382.00	51,188,000	貸付株式数	44,000 (44,000)
ハマキョウレックス	3,000	2,929.00	8,787,000		
サカイ引越センター	1,700	3,365.00	5,720,500		
近畿日本鉄道	1,041,000	356.00	370,596,000	貸付株式数	309,000 (217,000)
阪急阪神ホールディングス	694,000	548.00	380,312,000		
南海電気鉄道	215,000	395.00	84,925,000	貸付株式数	18,000
京阪電気鉄道	218,000	401.00	87,418,000		
神戸電鉄	25,000	332.00	8,300,000	貸付株式数	4,000 (4,000)
名糖運輸	4,200	651.00	2,734,200		
名古屋鉄道	364,000	327.00	119,028,000		
山陽電気鉄道	38,000	456.00	17,328,000	貸付株式数	11,000 (11,000)
日本通運	409,000	483.00	197,547,000		



ヤマトホールディングス	189,800	2,244.00	425,911,200	貸付株式数	28,300
山九	126,000	422.00	53,172,000		
丸運	6,500	242.00	1,573,000		
丸全昭和運輸	35,000	330.00	11,550,000	貸付株式数	14,000 (13,000)
センコー	41,000	496.00	20,336,000		
トナミホールディングス	21,000	200.00	4,200,000		
日本梱包運輸倉庫	31,600	1,677.00	52,993,200		
日本石油輸送	12,000	223.00	2,676,000		
福山通運	63,000	582.00	36,666,000	貸付株式数	1,000
セイノーホールディングス	73,000	1,015.00	74,095,000		
神奈川中央交通	12,000	499.00	5,988,000	貸付株式数	5,000 (5,000)
日立物流	21,500	1,647.00	35,410,500	貸付株式数	2,000 (2,000)
日本郵船	874,000	289.00	252,586,000		
商船三井	581,000	347.00	201,607,000		
川崎汽船	452,000	208.00	94,016,000		
N S ユナイテッド海運	44,000	241.00	10,604,000	貸付株式数	14,000
乾汽船	12,300	314.00	3,862,200	貸付株式数	5,500 (100)
明治海運	9,200	388.00	3,569,600		
飯野海運	42,800	492.00	21,057,600		
共栄タンカー	9,000	201.00	1,809,000	貸付株式数	3,000
第一中央汽船	76,000	92.00	6,992,000	貸付株式数	33,000
日本航空	87,300	5,110.00	446,103,000		
A N A ホールディングス	2,032,000	226.00	459,232,000	貸付株式数	884,000 (38,000)
スカイマーク	29,300	304.00	8,907,200	貸付株式数	9,300
パスコ	9,000	408.00	3,672,000	貸付株式数	4,000
トランコム	3,000	3,730.00	11,190,000	貸付株式数	400
日新	39,000	290.00	11,310,000		
三菱倉庫	68,000	1,419.00	96,492,000		
三井倉庫	52,000	387.00	20,124,000		
住友倉庫	69,000	485.00	33,465,000		
澁澤倉庫	24,000	328.00	7,872,000		
東陽倉庫	18,000	238.00	4,284,000		
日本トランスシティ	22,000	309.00	6,798,000		
ケイヒン	19,000	147.00	2,793,000		
中央倉庫	6,000	832.00	4,992,000	貸付株式数	500
安田倉庫	8,000	1,005.00	8,040,000	貸付株式数	3,500
東洋埠頭	30,000	199.00	5,970,000	貸付株式数	1,000
宇徳	8,400	339.00	2,847,600		
上組	123,000	965.00	118,695,000		
サンリツ	2,500	515.00	1,287,500		
キムラユニティー	2,300	912.00	2,097,600		
キューソー流通システム	3,300	1,002.00	3,306,600	貸付株式数	1,400 (1,400)
郵船ロジスティクス	9,500	1,127.00	10,706,500		
近鉄エクスプレス	9,200	4,015.00	36,938,000		
東海運	5,600	256.00	1,433,600		
エーアイティー	3,800	752.00	2,857,600	貸付株式数	1,600 (400)
N E C ネットズエスアイ	11,200	2,220.00	24,864,000		
システナ	10,000	719.00	7,190,000		
デジタルアーツ	3,600	759.00	2,732,400	貸付株式数	1,000

新日鉄住金ソリューションズ	8,500	2,459.00	20,901,500		
キューブシステム	2,200	830.00	1,826,000		
コア	3,800	697.00	2,648,600	貸付株式数	1,600 (1,600)
ソフトクリエイティブホールディングス	3,300	833.00	2,748,900	貸付株式数	1,400 (1,400)
ITホールディングス	36,600	1,558.00	57,022,800		
ネオス	2,100	740.00	1,554,000	貸付株式数	900 (800)
電算システム	3,200	1,244.00	3,980,800	貸付株式数	1,300 (500)
グリー	61,400	835.00	51,269,000	貸付株式数	26,700 (1,300)
コーエーテクモホールディングス	20,200	1,231.00	24,866,200		
三菱総合研究所	4,000	2,303.00	9,212,000		
ボルテージ	1,800	1,138.00	2,048,400	貸付株式数	700
電算	900	2,044.00	1,839,600	貸付株式数	300
AGS	2,100	882.00	1,852,200	貸付株式数	100
ヒト・コミュニケーションズ	1,400	1,692.00	2,368,800		
ブレインパッド	1,100	1,532.00	1,685,200	貸付株式数	400
KLab	7,100	553.00	3,926,300	貸付株式数	3,100
ポルトゥウィン・ビットクルーホールディ	6,100	1,056.00	6,441,600	貸付株式数	2,600 (2,500)
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	989.00	1,978,000	貸付株式数	600 (600)
ネクソン	84,700	802.00	67,929,400		
アイスタイル	3,300	485.00	1,600,500	貸付株式数	1,400
エムアップ	2,500	610.00	1,525,000	貸付株式数	1,000 (700)
エイチーム	1,200	4,010.00	4,812,000	貸付株式数	400
enish	1,900	1,374.00	2,610,600	貸付株式数	800
モバイルクリエイティブ	1,100	3,210.00	3,531,000		
オルトプラス	1,800	1,077.00	1,938,600	貸付株式数	100
ブロードリーフ	13,400	1,661.00	22,257,400	貸付株式数	5,900 (4,200)
ハーツユナイテッドグループ	2,300	2,265.00	5,209,500		
ダウンゴ	11,800	2,503.00	29,535,400	貸付株式数	5,100 (700)
ベリサーブ	600	1,656.00	993,600		
ティーガイア	10,100	900.00	9,090,000		
豆蔵ホールディングス	7,900	394.00	3,112,600		
テクマトリックス	4,400	581.00	2,556,400	貸付株式数	1,800
GMOペイメントゲートウェイ	4,400	3,110.00	13,684,000	貸付株式数	800 (800)
ザッパラス	5,700	676.00	3,853,200	貸付株式数	2,600
インターネットイニシアティブ	15,000	2,255.00	33,825,000		
ビットアイル	11,400	649.00	7,398,600	貸付株式数	5,000
SRAホールディングス	4,900	1,452.00	7,114,800		
システムインテグレータ	1,100	750.00	825,000		
朝日ネット	9,400	467.00	4,389,800		
コムチュア	1,200	1,702.00	2,042,400	貸付株式数	300
パナソニック インフォメーションシステム	2,100	2,603.00	5,466,300		
フェイス	3,100	1,002.00	3,106,200		
野村総合研究所	57,800	3,095.00	178,891,000		
サイバネットシステム	8,300	343.00	2,846,900	貸付株式数	200
インテージホールディングス	5,500	1,266.00	6,963,000		
東邦システムサイエンス	1,700	809.00	1,375,300	貸付株式数	200
ソースネクスト	5,100	555.00	2,830,500	貸付株式数	2,100 (1,200)
ティー・ワイ・オー	9,800	165.00	1,617,000		
クレスコ	2,300	1,091.00	2,509,300		

フジ・メディア・ホールディングス	98,700	1,603.00	158,216,100		
オービック	35,200	2,967.00	104,438,400		
ジャストシステム	13,900	651.00	9,048,900	貸付株式数	1,500
TDCソフトウェアエンジニアリング	2,200	808.00	1,777,600		
ヤフー	731,300	431.00	315,190,300		
トレンドマイクロ	45,000	3,315.00	149,175,000		
日本オラクル	16,300	4,630.00	75,469,000		
アルファシステムズ	3,300	1,475.00	4,867,500	貸付株式数	1,500 (1,500)
フューチャーアーキテクト	12,200	582.00	7,100,400		
CAC Holdings	6,200	955.00	5,921,000	貸付株式数	900
ソフトバンク・テクノロジー	2,400	1,411.00	3,386,400	貸付株式数	1,000
トーセ	2,500	693.00	1,732,500		
オービックビジネスコンサルタント	5,200	3,155.00	16,406,000	貸付株式数	1,600
伊藤忠テクノソリューションズ	11,600	4,255.00	49,358,000	貸付株式数	1,800 (1,800)
アイティフォー	11,300	412.00	4,655,600		
東計電算	1,800	1,331.00	2,395,800		
エクスネット	900	1,351.00	1,215,900		
大塚商会	9,100	12,320.00	112,112,000	貸付株式数	1,500
サイボウズ	15,200	351.00	5,335,200	貸付株式数	6,600 (6,600)
ソフトブレーン	13,900	123.00	1,709,700	貸付株式数	6,400 (6,400)
アグレックス	2,400	1,012.00	2,428,800		
電通国際情報サービス	6,300	1,238.00	7,799,400		
EMシステムズ	1,400	1,988.00	2,783,200	貸付株式数	100 (100)
ウェザーニューズ	3,000	2,709.00	8,127,000		
C I J	9,400	404.00	3,797,600	貸付株式数	3,800 (3,800)
日本エンタープライズ	6,400	265.00	1,696,000	貸付株式数	700
WOWOW	3,100	3,440.00	10,664,000		
日本コロムビア	5,100	603.00	3,075,300	貸付株式数	500
ネットワンシステムズ	40,000	785.00	31,400,000	貸付株式数	7,600
アルゴグラフィックス	3,800	1,606.00	6,102,800		
マーベラスAQL	15,500	654.00	10,137,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
エイベックス・グループ・ホールディングス	18,800	1,846.00	34,704,800		
日本ユニシス	24,600	899.00	22,115,400		
兼松エレクトロニクス	6,400	1,372.00	8,780,800		
東京放送ホールディングス	55,000	1,059.00	58,245,000	貸付株式数	3,400
日本テレビホールディングス	101,600	1,461.00	148,437,600		
テレビ朝日ホールディングス	25,800	1,651.00	42,595,800	貸付株式数	3,700
スカパーJ S A Tホールディングス	77,400	500.00	38,700,000		
テレビ東京ホールディングス	8,300	1,545.00	12,823,500	貸付株式数	3,200 (800)
コネクシオ	9,000	851.00	7,659,000	貸付株式数	1,500
クロップス	700	491.00	343,700		
日本電信電話	400,900	5,717.00	2,291,945,300		
KDDI	316,800	5,686.00	1,801,324,800		
光通信	9,200	8,570.00	78,844,000		
NTTドコモ	840,800	1,639.00	1,378,071,200	貸付株式数	14,400 (14,400)
GMOインターネット	34,000	938.00	31,892,000	貸付株式数	900 (800)
学研ホールディングス	34,000	274.00	9,316,000		
ゼンリン	13,500	1,057.00	14,269,500	貸付株式数	6,100 (6,100)
昭文社	6,100	623.00	3,800,300	貸付株式数	2,600 (2,600)

KADOKAWA	10,300	3,100.00	31,930,000	貸付株式数	4,400 (100)
インプレスホールディングス	7,200	127.00	914,400	貸付株式数	2,900
アイネット	4,300	715.00	3,074,500	貸付株式数	1,900 (1,900)
松竹	67,000	819.00	54,873,000	貸付株式数	28,000
東宝	72,800	1,986.00	144,580,800		
東映	43,000	560.00	24,080,000	貸付株式数	19,000 (19,000)
AOI Pro.	4,700	604.00	2,838,800		
エヌ・ティ・ティ・データ	72,000	3,825.00	275,400,000		
DTS	9,700	1,683.00	16,325,100		
スクウェア・エニックス・ホールディングス	37,100	1,423.00	52,793,300	貸付株式数	15,400
シーイーシー	6,000	601.00	3,606,000		
カブコン	26,100	1,679.00	43,821,900	貸付株式数	11,400
ジャステック	6,500	706.00	4,589,000		
SCSK	24,300	2,630.00	63,909,000		
日本システムウエア	3,800	479.00	1,820,200		
アイネス	13,900	651.00	9,048,900	貸付株式数	900
TKC	8,600	2,080.00	17,888,000		
富士ソフト	13,000	2,017.00	26,221,000		
NSD	21,700	1,263.00	27,407,100		
コナミ	46,100	2,220.00	102,342,000	貸付株式数	1,800
福井コンピュータホールディングス	1,400	792.00	1,108,800		
JBCCHホールディングス	8,500	740.00	6,290,000	貸付株式数	1,800
ミロク情報サービス	6,700	404.00	2,706,800		
ソフトバンク	501,100	7,161.00	3,588,377,100		
ハウスイ	8,000	126.00	1,008,000	貸付株式数	3,000
高千穂交易	4,200	985.00	4,137,000	貸付株式数	1,800 (1,800)
伊藤忠食品	2,500	3,425.00	8,562,500		
エレマテック	4,800	1,715.00	8,232,000	貸付株式数	1,900
JALUX	2,900	1,061.00	3,076,900	貸付株式数	1,300 (1,300)
あらた	23,000	320.00	7,360,000		
トーメンデバイス	1,500	1,686.00	2,529,000		
東京エレクトロン デバイス	2,000	1,330.00	2,660,000	貸付株式数	500
双日	683,000	162.00	110,646,000		
アルフレッサ ホールディングス	30,200	6,110.00	184,522,000		
横浜冷凍	25,300	823.00	20,821,900	貸付株式数	5,400
神栄	14,000	183.00	2,562,000		
山下医科器械	800	1,785.00	1,428,000		
ラサ商事	4,400	460.00	2,024,000		
アルコニックス	3,100	2,074.00	6,429,400		
神戸物産	1,400	3,345.00	4,683,000	貸付株式数	400
あい ホールディングス	16,400	1,581.00	25,928,400		
ダイワボウホールディングス	93,000	176.00	16,368,000		
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,200	706.00	13,555,200		
八洲電機	7,900	442.00	3,491,800		
UKCホールディングス	6,600	1,525.00	10,065,000		
TOKAIホールディングス	49,800	356.00	17,728,800		
三洋貿易	6,100	1,055.00	6,435,500	貸付株式数	800
ミタチ産業	2,400	550.00	1,320,000		
シップヘルスケアホールディングス	14,600	3,415.00	49,859,000		

スターティア	900	1,516.00	1,364,400	貸付株式数	300
富士興産	3,600	643.00	2,314,800		
協栄産業	12,000	177.00	2,124,000		
小野建	8,900	1,103.00	9,816,700		
佐島電機	8,100	644.00	5,216,400		
エコートレーディング	2,500	698.00	1,745,000	貸付株式数	1,000
伯東	6,200	950.00	5,890,000		
コンドーテック	8,300	684.00	5,677,200		
中山福	5,800	857.00	4,970,600		
ナガイレーベン	14,700	2,017.00	29,649,900	貸付株式数	900
三菱食品	11,200	2,287.00	25,614,400		
松田産業	7,400	1,129.00	8,354,600		
メディバルホールディングス	102,100	1,469.00	149,984,900		
アドヴァン	5,200	1,064.00	5,532,800		
S P K	2,300	1,872.00	4,305,600		
アズワン	6,600	2,670.00	17,622,000		
スズデン	3,600	581.00	2,091,600	貸付株式数	1,500 (1,500)
尾家産業	3,300	815.00	2,689,500		
シモジマ	7,000	1,042.00	7,294,000	貸付株式数	700
ドウシシャ	10,800	1,545.00	16,686,000	貸付株式数	300
高速	6,100	911.00	5,557,100		
黒田電気	16,300	1,572.00	25,623,600	貸付株式数	2,300
丸文	9,000	575.00	5,175,000		
ハビネット	6,200	1,061.00	6,578,200	貸付株式数	2,700 (2,700)
トーメンエレクトロニクス	5,200	1,643.00	8,543,600		
エクセル	4,700	1,060.00	4,982,000		
マルカキカイ	3,300	1,343.00	4,431,900		
ガリバーインターナショナル	34,300	835.00	28,640,500	貸付株式数	100
日本エム・ディ・エム	8,500	280.00	2,380,000		
進和	6,000	1,169.00	7,014,000		
エスケイジャパン	2,400	241.00	578,400	貸付株式数	1,100 (1,100)
ダイトエレクトロン	4,700	395.00	1,856,500		
シークス	6,500	1,600.00	10,400,000		
田中商事	3,100	604.00	1,872,400		
オーハシテクニカ	5,200	794.00	4,128,800	貸付株式数	2,300 (2,300)
マクニカ	5,200	2,935.00	15,262,000		
白銅	3,300	903.00	2,979,900		
伊藤忠商事	814,100	1,141.00	928,888,100		
丸紅	893,000	678.00	605,454,000		
高島	19,000	233.00	4,427,000	貸付株式数	4,000
長瀬産業	57,800	1,234.00	71,325,200		
蝶理	6,500	1,124.00	7,306,000		
豊田通商	113,700	2,560.00	291,072,000	貸付株式数	2,000
三共生興	17,300	347.00	6,003,100		
兼松	217,000	159.00	34,503,000		
ツカモトコーポレーション	18,000	129.00	2,322,000	貸付株式数	1,000
三井物産	939,600	1,528.00	1,435,708,800		
日本紙バルブ商事	53,000	350.00	18,550,000		
日立ハイテクノロジーズ	31,000	2,175.00	67,425,000		

カメイ	13,300	719.00	9,562,700		
東都水産	18,000	194.00	3,492,000		
OUGホールディングス	15,000	203.00	3,045,000		
スターゼン	37,000	264.00	9,768,000		
山善	39,200	664.00	26,028,800		
椿本興業	11,000	272.00	2,992,000		
住友商事	602,200	1,287.00	775,031,400		
内田洋行	25,000	285.00	7,125,000		
三菱商事	796,300	1,961.00	1,561,544,300		
第一実業	23,000	447.00	10,281,000		
キャノンマーケティングジャパン	29,100	1,657.00	48,218,700		
西華産業	34,000	238.00	8,092,000		
佐藤商事	9,100	635.00	5,778,500		
菱洋エレクトロ	11,800	1,212.00	14,301,600		
東京産業	10,100	398.00	4,019,800		
ユアサ商事	104,000	192.00	19,968,000		
神鋼商事	26,000	219.00	5,694,000		
小林産業	6,700	293.00	1,963,100		
阪和興業	102,000	406.00	41,412,000		
カナデン	10,000	692.00	6,920,000		
菱電商事	15,000	685.00	10,275,000		
フルサト工業	5,600	1,200.00	6,720,000	貸付株式数	200
岩谷産業	113,000	575.00	64,975,000		
すてきなイスグループ	43,000	211.00	9,073,000		
昭光通商	33,000	135.00	4,455,000		
ニチモウ	16,000	170.00	2,720,000		
極東貿易	12,000	199.00	2,388,000		
イワキ	15,000	198.00	2,970,000		
三愛石油	24,000	708.00	16,992,000		
稲畑産業	25,100	902.00	22,640,200		
G S イクレオス	27,000	133.00	3,591,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
明和産業	9,400	435.00	4,089,000	貸付株式数	1,400
ワキタ	20,000	1,199.00	23,980,000	貸付株式数	1,800
東邦ホールディングス	32,700	1,861.00	60,854,700		
サンゲツ	18,100	2,514.00	45,503,400		
ミツウロコグループホールディングス	16,400	527.00	8,642,800		
シナネン	22,000	389.00	8,558,000	貸付株式数	4,000
伊藤忠エネクス	22,500	608.00	13,680,000		
サンリオ	25,700	3,315.00	85,195,500	貸付株式数	11,300
サンワテクノス	5,500	922.00	5,071,000		
リョーサン	15,200	2,027.00	30,810,400		
新光商事	11,200	927.00	10,382,400		
トーホー	21,000	364.00	7,644,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
三信電気	12,200	642.00	7,832,400		
東陽テクニカ	14,900	1,139.00	16,971,100		
モスフードサービス	13,400	2,027.00	27,161,800		
加賀電子	9,200	1,123.00	10,331,600		
ソーダニッカ	11,000	430.00	4,730,000	貸付株式数	4,000 (4,000)
立花エレテック	6,200	1,215.00	7,533,000	貸付株式数	600 (600)

	P a l t a c	14,300	1,273.00	18,203,900		
	太平洋興発	41,000	95.00	3,895,000	貸付株式数	17,000
	ヤマタネ	51,000	150.00	7,650,000		
	丸紅建材リース	9,000	205.00	1,845,000		
	日鉄住金物産	67,000	351.00	23,517,000		
	トラスコ中山	11,700	2,266.00	26,512,200		
	オートバックスセブン	35,800	1,629.00	58,318,200		
	加藤産業	14,700	2,026.00	29,782,200		
	イノテック	9,400	435.00	4,089,000		
	イエローハット	8,800	2,100.00	18,480,000		
	富士エレクトロニクス	5,200	1,221.00	6,349,200		
	JKホールディングス	9,200	522.00	4,802,400	貸付株式数	1,300 (1,200)
	日伝	4,600	2,362.00	10,865,200	貸付株式数	2,100 (2,100)
	北沢産業	8,400	174.00	1,461,600		
	杉本商事	5,500	970.00	5,335,000		
	因幡電機産業	14,100	3,100.00	43,710,000		
	バイテック	3,500	782.00	2,737,000	貸付株式数	100
	ミスミグループ本社	40,900	2,499.00	102,209,100	貸付株式数	4,300 (4,300)
	江守グループホールディングス	4,400	1,612.00	7,092,800	貸付株式数	200
	アルテック	5,000	218.00	1,090,000	貸付株式数	2,300 (100)
	タキヒヨー	17,000	407.00	6,919,000		
	スズケン	42,200	3,645.00	153,819,000		
	ジェコス	7,000	961.00	6,727,000		
	ローソン	41,900	7,230.00	302,937,000		
	サンエー	7,700	2,933.00	22,584,100		
	キリン堂	3,600	640.00	2,304,000		
	ダイユーエイト	2,000	632.00	1,264,000		
	カワチ薬品	7,100	1,897.00	13,468,700		
	エービーシー・マート	14,500	4,855.00	70,397,500		
	ハードオフコーポレーション	4,900	781.00	3,826,900		
	アスクル	10,600	2,500.00	26,500,000	貸付株式数	4,600 (100)
	ゲオホールディングス	17,500	863.00	15,102,500	貸付株式数	300
	アダストリアホールディングス	7,800	2,231.00	17,401,800	貸付株式数	3,400 (300)
	シー・ヴィー・エス・ベイエリア	13,000	181.00	2,353,000	貸付株式数	5,000
	くらコーポレーション	6,000	1,996.00	11,976,000	貸付株式数	100 (100)
	キャンドゥ	4,800	1,607.00	7,713,600	貸付株式数	2,100 (1,600)
	パル	5,900	2,214.00	13,062,600	貸付株式数	2,500
	エディオン	46,700	624.00	29,140,800	貸付株式数	13,800
	サーラコーポレーション	8,700	507.00	4,410,900		
	ワッツ	4,000	968.00	3,872,000	貸付株式数	900
	あみやき亭	1,800	3,095.00	5,571,000	貸付株式数	700 (700)
	ひらまつ	12,500	680.00	8,500,000	貸付株式数	4,400
	ゲンキー	1,000	2,506.00	2,506,000	貸付株式数	400 (400)
	大黒天物産	2,400	2,631.00	6,314,400		
	ハニーズ	8,100	954.00	7,727,400	貸付株式数	3,600 (1,400)
	アルペン	9,100	1,791.00	16,298,100	貸付株式数	2,800
	クオール	7,400	619.00	4,580,600	貸付株式数	3,200
	ジェイアイエヌ	6,900	3,235.00	22,321,500	貸付株式数	3,000 (500)
	ビックカメラ	44,300	716.00	31,718,800	貸付株式数	18,100

DCMホールディングス	49,400	678.00	33,493,200		
Monotaro	15,800	2,165.00	34,207,000	貸付株式数	6,900 (6,600)
J・フロントリテイリング	241,000	692.00	166,772,000		
ドトール・日レスホールディングス	17,900	1,786.00	31,969,400	貸付株式数	6,600
マツモトキヨシホールディングス	21,000	3,140.00	65,940,000		
ブロンコビリー	1,600	2,226.00	3,561,600	貸付株式数	700 (500)
スタートトゥデイ	31,800	2,311.00	73,489,800		
物語コーポレーション	2,500	3,285.00	8,212,500	貸付株式数	300 (300)
ココカラファイン	10,600	2,913.00	30,877,800		
三越伊勢丹ホールディングス	202,800	1,327.00	269,115,600		
ウエルシアホールディングス	4,600	6,280.00	28,888,000	貸付株式数	1,200 (800)
クリエイティブSDホールディングス	4,300	3,460.00	14,878,000	貸付株式数	1,800
丸善CHIホールディングス	8,900	315.00	2,803,500	貸付株式数	3,900 (2,500)
エー・ピーカンパニー	1,200	1,676.00	2,011,200	貸付株式数	200
チムニー	3,700	2,112.00	7,814,400	貸付株式数	1,600 (1,600)
ブックオフコーポレーション	5,600	768.00	4,300,800	貸付株式数	2,400 (1,600)
あさひ	5,900	1,258.00	7,422,200	貸付株式数	900
日本調剤	1,290	2,660.00	3,431,400	貸付株式数	580 (80)
コスモス薬品	5,800	10,780.00	62,524,000	貸付株式数	2,500 (500)
トーエル	5,400	542.00	2,926,800	貸付株式数	2,200 (2,200)
一六堂	2,100	456.00	957,600		
セブン&アイ・ホールディングス	426,900	3,994.00	1,705,038,600	貸付株式数	1,100 (1,100)
クリエイティブ・レストランズ・ホールディング	1,700	2,810.00	4,777,000	貸付株式数	600
ツルハホールディングス	10,000	10,320.00	103,200,000		
サンマルクホールディングス	3,300	4,820.00	15,906,000		
フェリシモ	2,900	1,003.00	2,908,700	貸付株式数	1,300 (1,300)
トリドール	8,800	961.00	8,456,800		
クスリのアオキ	2,300	6,970.00	16,031,000	貸付株式数	700
メディカルシステムネットワーク	8,300	350.00	2,905,000	貸付株式数	3,600 (1,100)
総合メディカル	2,500	4,050.00	10,125,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
はるやま商事	4,200	703.00	2,952,600		
カップ・クリエイティブホールディングス	15,000	975.00	14,625,000	貸付株式数	5,800
ライトオン	7,600	721.00	5,479,600		
ジーンズメイト	3,200	201.00	643,200	貸付株式数	1,400
良品計画	10,800	11,150.00	120,420,000		
三城ホールディングス	12,600	500.00	6,300,000		
コナカ	12,000	695.00	8,340,000		
ハウスオブローゼ	1,100	1,366.00	1,502,600	貸付株式数	400
G-7ホールディングス	3,000	744.00	2,232,000		
イオン北海道	6,100	609.00	3,714,900		
コジマ	15,000	321.00	4,815,000		
ヒマラヤ	2,400	1,074.00	2,577,600		
コーナン商事	13,400	1,036.00	13,882,400	貸付株式数	5,900
エコス	3,500	670.00	2,345,000		
ワタミ	12,000	1,341.00	16,092,000	貸付株式数	5,400 (5,400)
マルシェ	2,500	823.00	2,057,500	貸付株式数	1,100
ドンキホーテホールディングス	35,200	5,630.00	198,176,000		
西松屋チェーン	20,100	764.00	15,356,400		
ゼンショーホールディングス	46,800	1,005.00	47,034,000	貸付株式数	20,600



幸楽苑	6,300	1,340.00	8,442,000	貸付株式数	2,600
ハークスレイ	2,800	742.00	2,077,600		
サイゼリヤ	15,100	1,214.00	18,331,400	貸付株式数	1,400
ポプラ	2,500	530.00	1,325,000		
ユニテッドアローズ	13,300	4,040.00	53,732,000		
ハイデイ日高	6,400	2,304.00	14,745,600		
京都きもの友禅	6,700	1,008.00	6,753,600	貸付株式数	200
コロワイド	33,800	1,016.00	34,340,800	貸付株式数	15,500
壱番屋	4,100	4,140.00	16,974,000	貸付株式数	1,800 (800)
トップカルチャー	3,700	456.00	1,687,200	貸付株式数	1,600 (1,600)
P L A N T	2,600	984.00	2,558,400	貸付株式数	600
スギホールディングス	18,300	4,600.00	84,180,000	貸付株式数	8,000 (5,300)
スクロール	13,200	244.00	3,220,800	貸付株式数	6,000 (6,000)
ヨンドシーホールディングス	7,800	1,774.00	13,837,200	貸付株式数	500
ファミリーマート	34,500	4,245.00	146,452,500	貸付株式数	15,200
木曽路	12,500	1,831.00	22,887,500	貸付株式数	4,500 (4,500)
サトレストラシシステムズ	9,500	756.00	7,182,000		
千趣会	18,300	853.00	15,609,900	貸付株式数	7,100 (1,800)
タカキュー	7,900	212.00	1,674,800	貸付株式数	3,000 (3,000)
ケーヨー	17,200	467.00	8,032,400	貸付株式数	7,800
上新電機	22,000	829.00	18,238,000	貸付株式数	9,000 (9,000)
日本瓦斯	15,200	1,673.00	25,429,600		
ベスト電器	32,900	156.00	5,132,400	貸付株式数	14,100 (14,100)
マルエツ	21,000	328.00	6,888,000		
ロイヤルホールディングス	17,000	1,518.00	25,806,000	貸付株式数	7,400
東天紅	7,000	178.00	1,246,000		
いなげや	11,400	991.00	11,297,400		
島忠	24,700	2,213.00	54,661,100		
チヨダ	12,000	2,370.00	28,440,000		
ライフコーポレーション	7,700	1,496.00	11,519,200	貸付株式数	2,900 (2,900)
カスミ	20,900	709.00	14,818,100		
リンガーハット	9,900	1,518.00	15,028,200	貸付株式数	1,200 (300)
さが美	8,000	96.00	768,000		
M r M a x	10,200	314.00	3,202,800		
テナアライド	7,700	302.00	2,325,400	貸付株式数	3,400
A O K Iホールディングス	17,600	1,445.00	25,432,000		
オークワ	16,000	904.00	14,464,000		
コメリ	15,700	2,835.00	44,509,500		
青山商事	25,600	2,736.00	70,041,600		
しまむら	11,900	9,830.00	116,977,000	貸付株式数	4,700 (3,500)
C F S コーポレーション	6,700	443.00	2,968,100		
はせがわ	3,500	640.00	2,240,000	貸付株式数	200 (200)
高島屋	138,000	984.00	135,792,000	貸付株式数	55,000 (11,000)
松屋	20,500	937.00	19,208,500	貸付株式数	9,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	60,000	765.00	45,900,000		
近鉄百貨店	39,000	357.00	13,923,000	貸付株式数	17,000
丸栄	17,000	135.00	2,295,000	貸付株式数	7,000
ニッセンホールディングス	20,400	411.00	8,384,400	貸付株式数	6,300 (5,900)
パルコ	9,800	804.00	7,879,200	貸付株式数	4,200

丸井グループ	133,000	939.00	124,887,000		
アクシアル リテイリング	5,600	1,632.00	9,139,200		
井筒屋	55,000	68.00	3,740,000	貸付株式数	23,000
ダイエー	63,000	282.00	17,766,000		
イズミヤ	38,000	481.00	18,278,000		
イオン	407,600	1,176.00	479,337,600		
ユニーグループ・ホールディングス	97,700	651.00	63,602,700	貸付株式数	14,100 (14,000)
イズミ	22,800	2,988.00	68,126,400		
東武ストア	13,000	263.00	3,419,000		
平和堂	20,700	1,436.00	29,725,200		
フジ	11,300	1,932.00	21,831,600	貸付株式数	5,100 (5,100)
ヤオコー	5,100	4,595.00	23,434,500		
ゼビオ	12,300	1,921.00	23,628,300		
ケースホールディングス	21,600	3,000.00	64,800,000	貸付株式数	9,200
Olympicグループ	6,000	912.00	5,472,000	貸付株式数	2,600 (2,600)
日産東京販売ホールディングス	15,000	329.00	4,935,000		
アインファーマシーズ	5,600	4,420.00	24,752,000		
元気寿司	3,100	1,620.00	5,022,000		
ヤマダ電機	403,400	368.00	148,451,200	貸付株式数	176,100
アークランドサカモト	6,600	2,028.00	13,384,800		
ニトリホールディングス	40,400	4,870.00	196,748,000		
グルメ軒屋	7,000	739.00	5,173,000	貸付株式数	3,000 (2,000)
愛眼	8,100	264.00	2,138,400	貸付株式数	3,500 (3,500)
ケーユーホールディングス	2,100	1,106.00	2,322,600		
吉野家ホールディングス	27,600	1,264.00	34,886,400	貸付株式数	12,000 (200)
松屋フーズ	4,900	1,780.00	8,722,000	貸付株式数	2,200
サガミチェーン	13,000	933.00	12,129,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
関西スーパーマーケット	7,600	799.00	6,072,400	貸付株式数	1,100
王将フードサービス	6,700	3,845.00	25,761,500		
ブレナス	11,400	2,257.00	25,729,800		
ミニストップ	7,500	1,537.00	11,527,500		
アークス	17,400	2,012.00	35,008,800		
パロー	22,000	1,459.00	32,098,000		
藤久	800	1,643.00	1,314,400		
ベルク	5,000	2,117.00	10,585,000		
大庄	5,400	1,256.00	6,782,400	貸付株式数	800
ファーストリテイリング	20,400	31,580.00	644,232,000	貸付株式数	800
サンドラッグ	21,600	4,285.00	92,556,000	貸付株式数	900 (900)
東京デリカ	5,100	1,522.00	7,762,200	貸付株式数	1,400
ヤマザワ	2,400	1,511.00	3,626,400		
やまや	2,100	1,917.00	4,025,700		
ペルーナ	25,400	489.00	12,420,600		
島根銀行	2,100	1,281.00	2,690,100	貸付株式数	700
じもとホールディングス	73,200	199.00	14,566,800	貸付株式数	27,200 (27,200)
足利ホールディングス	53,500	453.00	24,235,500	貸付株式数	9,200 (9,200)
新生銀行	883,000	216.00	190,728,000		
あおぞら銀行	530,000	303.00	160,590,000	貸付株式数	61,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,730,200	563.00	4,352,102,600		
りそなホールディングス	970,000	527.00	511,190,000		

	三井住友トラスト・ホールディングス	2,005,000	417.00	836,085,000		
	三井住友フィナンシャルグループ	771,700	4,119.00	3,178,632,300		
	第四銀行	129,000	351.00	45,279,000	貸付株式数	8,000
	北越銀行	110,000	200.00	22,000,000		
	西日本シティ銀行	358,000	225.00	80,550,000		
	千葉銀行	394,000	625.00	246,250,000		
	横浜銀行	664,000	515.00	341,960,000		
	常陽銀行	380,000	488.00	185,440,000	貸付株式数	69,000 (54,000)
	群馬銀行	229,000	525.00	120,225,000		
	武蔵野銀行	16,300	3,250.00	52,975,000		
	千葉興業銀行	21,200	672.00	14,246,400		
	筑波銀行	42,400	360.00	15,264,000	貸付株式数	6,600 (6,600)
	東京都民銀行	18,000	1,084.00	19,512,000	貸付株式数	7,700
	七十七銀行	160,000	443.00	70,880,000		
	青森銀行	75,000	272.00	20,400,000		
	秋田銀行	70,000	265.00	18,550,000	貸付株式数	5,000
	山形銀行	62,000	452.00	28,024,000	貸付株式数	27,000 (8,000)
	岩手銀行	6,700	4,465.00	29,915,500		
	東邦銀行	91,000	332.00	30,212,000		
	東北銀行	52,000	145.00	7,540,000		
	みちのく銀行	54,000	210.00	11,340,000	貸付株式数	23,000
	ふくおかフィナンシャルグループ	414,000	425.00	175,950,000		
	静岡銀行	299,000	943.00	281,957,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
	十六銀行	128,000	336.00	43,008,000		
	スルガ銀行	99,000	1,687.00	167,013,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
	八十二銀行	188,000	543.00	102,084,000		
	山梨中央銀行	65,000	425.00	27,625,000		
	大垣共立銀行	128,000	267.00	34,176,000		
	福井銀行	87,000	230.00	20,010,000	貸付株式数	2,000
	北國銀行	114,000	328.00	37,392,000		
	清水銀行	3,500	2,428.00	8,498,000		
	滋賀銀行	96,000	551.00	52,896,000	貸付株式数	3,000
	南都銀行	99,000	374.00	37,026,000		
	百五銀行	92,000	397.00	36,524,000		
	京都銀行	195,000	795.00	155,025,000		
	紀陽銀行	40,100	1,177.00	47,197,700		
	三重銀行	42,000	212.00	8,904,000		
	ほくほくフィナンシャルグループ	694,000	186.00	129,084,000		
	広島銀行	301,000	411.00	123,711,000	貸付株式数	36,000
	山陰合同銀行	62,000	666.00	41,292,000		
	中国銀行	73,400	1,321.00	96,961,400	貸付株式数	6,700 (6,700)
	鳥取銀行	32,000	177.00	5,664,000		
	伊予銀行	109,100	900.00	98,190,000		
	百十四銀行	112,000	333.00	37,296,000		
	四国銀行	74,000	206.00	15,244,000		
	阿波銀行	83,000	542.00	44,986,000	貸付株式数	4,000
	鹿児島銀行	71,000	620.00	44,020,000		
	大分銀行	63,000	363.00	22,869,000		
	宮崎銀行	68,000	310.00	21,080,000		

	肥後銀行	83,000	515.00	42,745,000		
	佐賀銀行	62,000	210.00	13,020,000		
	十八銀行	63,000	222.00	13,986,000		
	沖縄銀行	7,600	4,135.00	31,426,000	貸付株式数	3,400 (3,400)
	琉球銀行	19,800	1,324.00	26,215,200		
	八千代銀行	4,900	2,934.00	14,376,600		
	セブン銀行	382,300	372.00	142,215,600	貸付株式数	21,800
	みずほフィナンシャルグループ	13,242,300	199.00	2,635,217,700		
	高知銀行	39,000	148.00	5,772,000	貸付株式数	5,000
	山口フィナンシャルグループ	102,000	910.00	92,820,000		
	長野銀行	33,000	176.00	5,808,000		
	名古屋銀行	92,000	377.00	34,684,000		
	北洋銀行	153,700	403.00	61,941,100	貸付株式数	7,100
	愛知銀行	3,700	4,800.00	17,760,000		
	第三銀行	58,000	172.00	9,976,000	貸付株式数	1,000
	中京銀行	42,000	172.00	7,224,000		
	東日本銀行	44,000	250.00	11,000,000		
	大光銀行	36,000	207.00	7,452,000		
	愛媛銀行	60,000	219.00	13,140,000	貸付株式数	9,000 (9,000)
	トマト銀行	39,000	165.00	6,435,000		
	みなと銀行	92,000	174.00	16,008,000		
	京葉銀行	84,000	434.00	36,456,000		
	関西アーバン銀行	142,000	126.00	17,892,000		
	栃木銀行	51,000	411.00	20,961,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
	北日本銀行	3,200	2,555.00	8,176,000		
	東和銀行	124,000	94.00	11,656,000	貸付株式数	52,000 (52,000)
	福島銀行	126,000	82.00	10,332,000		
	大東銀行	65,000	109.00	7,085,000		
	トモニホールディングス	78,300	416.00	32,572,800		
	フィデアホールディングス	58,700	186.00	10,918,200		
	池田泉州ホールディングス	76,600	458.00	35,082,800		
	F P G	7,500	993.00	7,447,500	貸付株式数	3,300
	S B Iホールディングス	122,600	1,112.00	136,331,200		
	日本アジア投資	69,000	89.00	6,141,000	貸付株式数	30,000
	ジャフコ	14,000	3,735.00	52,290,000	貸付株式数	2,000 (1,600)
	大和証券グループ本社	1,011,000	754.00	762,294,000		
	野村ホールディングス	2,086,200	600.00	1,251,720,000		
	岡三証券グループ	80,000	708.00	56,640,000		
	丸三証券	30,300	692.00	20,967,600		
	東洋証券	41,000	268.00	10,988,000	貸付株式数	4,000
	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	108,100	673.00	72,751,300		
	光世証券	24,000	179.00	4,296,000	貸付株式数	11,000 (10,000)
	水戸証券	29,800	338.00	10,072,400	貸付株式数	12,000
	いちよし証券	20,000	1,189.00	23,780,000		
	松井証券	51,900	929.00	48,215,100	貸付株式数	4,400
	だいこう証券ビジネス	4,900	549.00	2,690,100		
	マネックスグループ	110,800	336.00	37,228,800	貸付株式数	48,800
	カブドットコム証券	39,600	434.00	17,186,400	貸付株式数	17,100
	極東証券	12,600	1,538.00	19,378,800	貸付株式数	5,500 (1,200)

岩井コスモホールディングス	9,600	957.00	9,187,200	貸付株式数	1,600
マネースクウェア・ジャパン	2,600	1,273.00	3,309,800	貸付株式数	200
マネーパートナーズグループ	10,300	227.00	2,338,100	貸付株式数	100
小林洋行	2,900	244.00	707,600		
N K S Jホールディングス	226,700	2,646.00	599,848,200		
M S & A Dインシュアランスグループホール	305,000	2,361.00	720,105,000		
ソニーフィナンシャルホールディングス	97,800	1,683.00	164,597,400		
第一生命保険	513,700	1,468.00	754,111,600		
東京海上ホールディングス	395,300	2,983.00	1,179,179,900	貸付株式数	3,400 (3,400)
T & Dホールディングス	350,000	1,251.00	437,850,000		
全国保証	24,300	2,484.00	60,361,200		
クレディセゾン	83,300	2,235.00	186,175,500		
アクリーティブ	7,000	193.00	1,351,000	貸付株式数	2,900 (2,400)
芙蓉総合リース	10,700	3,800.00	40,660,000		
興銀リース	17,800	2,318.00	41,260,400	貸付株式数	7,600 (7,600)
東京センチュリーリース	24,000	3,105.00	74,520,000		
日本証券金融	44,800	624.00	27,955,200		
ポケットカード	10,200	710.00	7,242,000	貸付株式数	1,000
リコーリース	7,000	2,604.00	18,228,000	貸付株式数	3,000
イオンフィナンシャルサービス	59,700	2,552.00	152,354,400	貸付株式数	25,900 (3,100)
アコム	205,000	374.00	76,670,000	貸付株式数	89,300 (1,700)
ジャックス	62,000	432.00	26,784,000		
オリエントコーポレーション	228,000	220.00	50,160,000	貸付株式数	101,800
日立キャピタル	20,000	2,490.00	49,800,000		
アプラスフィナンシャル	48,900	133.00	6,503,700	貸付株式数	21,600
オリックス	637,000	1,583.00	1,008,371,000		
三菱UFJリース	258,800	489.00	126,553,200		
日本取引所グループ	149,800	2,085.00	312,333,000		
イー・ギャランティ	3,000	2,050.00	6,150,000	貸付株式数	1,300
アサックス	1,800	1,166.00	2,098,800	貸付株式数	400
N E Cキャピタルソリューション	3,500	1,700.00	5,950,000	貸付株式数	1,400 (200)
日本駐車場開発	110,800	107.00	11,855,600	貸付株式数	48,200 (300)
ヒューリック	172,200	1,328.00	228,681,600	貸付株式数	64,500 (22,400)
東京建物不動産販売	5,300	381.00	2,019,300	貸付株式数	2,400 (2,400)
三栄建築設計	4,100	814.00	3,337,400		
野村不動産ホールディングス	67,400	1,845.00	124,353,000		
プレサンスコーポレーション	2,500	2,676.00	6,690,000	貸付株式数	1,000
常和ホールディングス	3,600	3,440.00	12,384,000		
フージャースホールディングス	15,200	555.00	8,436,000	貸付株式数	6,600 (100)
オープンハウス	6,300	1,856.00	11,692,800	貸付株式数	100
東急不動産ホールディングス	226,300	733.00	165,877,900		
飯田グループホールディングス	44,700	1,592.00	71,162,400		
パーク24	53,600	1,862.00	99,803,200		
バラカ	3,700	722.00	2,671,400		
三井不動産	481,000	3,135.00	1,507,935,000		
三菱地所	714,000	2,387.00	1,704,318,000		
平和不動産	20,600	1,548.00	31,888,800		
東京建物	209,000	879.00	183,711,000		
ダイビル	30,000	993.00	29,790,000		

京阪神ビルディング	16,900	517.00	8,737,300	貸付株式数	200
住友不動産	245,000	4,001.00	980,245,000		
大京	172,000	194.00	33,368,000	貸付株式数	23,000
テーオーシー	35,200	665.00	23,408,000		
東京楽天地	17,000	469.00	7,973,000		
レオパレス21	117,300	460.00	53,958,000		
フジ住宅	13,000	560.00	7,280,000		
空港施設	12,300	701.00	8,622,300		
明和地所	5,000	437.00	2,185,000	貸付株式数	2,100 (900)
住友不動産販売	7,300	3,000.00	21,900,000	貸付株式数	100
ゴールドクレスト	8,000	2,096.00	16,768,000		
日本エスリード	4,000	1,027.00	4,108,000	貸付株式数	1,700 (1,700)
日神不動産	13,600	350.00	4,760,000		
タカラレーベン	33,400	286.00	9,552,400	貸付株式数	14,700
サンヨーハウジング名古屋	5,700	956.00	5,449,200		
イオンモール	65,800	2,431.00	159,959,800	貸付株式数	10,300
ファースト住建	3,800	1,425.00	5,415,000	貸付株式数	300
トーセイ	14,000	639.00	8,946,000		
穴吹興産	9,000	341.00	3,069,000		
エヌ・ティ・ティ都市開発	63,400	836.00	53,002,400		
サンフロンティア不動産	9,600	989.00	9,494,400	貸付株式数	2,200
エフ・ジェー・ネクスト	5,400	446.00	2,408,400	貸付株式数	1,800 (1,800)
ランドビジネス	5,200	387.00	2,012,400		
グランディハウス	7,900	324.00	2,559,600		
日本空港ビルディング	35,300	2,393.00	84,472,900		
日本工営	36,000	509.00	18,324,000		
ネクスト	9,100	847.00	7,707,700	貸付株式数	1,700 (1,700)
日本M&Aセンター	16,700	2,593.00	43,303,100		
ノバレーゼ	2,800	884.00	2,475,200	貸付株式数	1,000 (1,000)
アコーディア・ゴルフ	44,000	1,255.00	55,220,000	貸付株式数	19,300 (200)
タケエイ	7,500	967.00	7,252,500	貸付株式数	2,200
トラスト・テック	1,800	1,477.00	2,658,600		
パソナグループ	8,000	511.00	4,088,000	貸付株式数	1,700
CDS	2,200	944.00	2,076,800		
リンクアンドモチベーション	13,900	188.00	2,613,200	貸付株式数	5,000
GCAサヴィアン	6,400	763.00	4,883,200	貸付株式数	2,100
エス・エム・エス	6,000	2,102.00	12,612,000	貸付株式数	2,600
テンプホールディングス	23,600	2,538.00	59,896,800	貸付株式数	400
リニカル	2,800	878.00	2,458,400	貸付株式数	800
クックパッド	5,300	1,968.00	10,430,400	貸付株式数	2,300
エスクリ	3,700	916.00	3,389,200	貸付株式数	500
アイ・ケイ・ケイ	2,400	801.00	1,922,400	貸付株式数	1,000 (1,000)
学情	3,500	670.00	2,345,000	貸付株式数	1,600
スタジオアリス	4,400	1,457.00	6,410,800	貸付株式数	500
シミックホールディングス	4,100	1,474.00	6,043,400	貸付株式数	1,600 (1,500)
NECフィールディング	1,800	1,569.00	2,824,200		
総合警備保障	39,300	2,471.00	97,110,300		
カカコム	65,500	1,375.00	90,062,500		
ルネサンス	4,800	811.00	3,892,800	貸付株式数	2,200

ディップ	2,400	2,296.00	5,510,400	貸付株式数	1,000	(900)
オプト	5,800	725.00	4,205,000	貸付株式数	1,800	
新日本科学	8,900	766.00	6,817,400	貸付株式数	3,900	(200)
ツクイ	11,600	1,108.00	12,852,800	貸付株式数	1,500	
総合臨床ホールディングス	4,800	492.00	2,361,600	貸付株式数	100	
キャリアデザインセンター	3,200	912.00	2,918,400	貸付株式数	900	
エムスリー	72,600	1,323.00	96,049,800			
ベストプライダグ	6,300	604.00	3,805,200	貸付株式数	1,000	(400)
アウトソーシング	4,500	1,243.00	5,593,500	貸付株式数	1,900	(500)
ディー・エヌ・エー	58,100	1,302.00	75,646,200	貸付株式数	24,500	
博報堂DYホールディングス	149,700	853.00	127,694,100			
ぐるなび	15,000	1,311.00	19,665,000			
一休	7,700	1,068.00	8,223,600	貸付株式数	3,300	(3,200)
ジャパンベストレスキューシステム	8,900	234.00	2,082,600	貸付株式数	3,900	
ファンコミュニケーションズ	18,400	1,309.00	24,085,600			
ジェイコムホールディングス	2,200	758.00	1,667,600	貸付株式数	900	(100)
PGMホールディングス	15,200	1,011.00	15,367,200	貸付株式数	6,400	
WDBホールディングス	1,300	1,318.00	1,713,400	貸付株式数	500	
バリューコマース	6,600	845.00	5,577,000	貸付株式数	2,900	(200)
J Pホールディングス	24,100	453.00	10,917,300	貸付株式数	10,600	(100)
イービーエス	12,800	1,132.00	14,489,600	貸付株式数	400	(100)
プレステージ・インターナショナル	7,400	956.00	7,074,400			
アミューズ	3,000	1,693.00	5,079,000			
ドリームインキュベータ	2,800	1,300.00	3,640,000	貸付株式数	1,100	
TAC	6,500	277.00	1,800,500			
ケネディクス	127,300	350.00	44,555,000			
電通	101,800	4,110.00	418,398,000			
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,469.00	6,757,400			
びあ	3,200	1,718.00	5,497,600	貸付株式数	1,300	
イオンファンタジー	3,500	1,264.00	4,424,000	貸付株式数	1,500	
ネクシィーズ	3,900	828.00	3,229,200	貸付株式数	1,600	
みらかホールディングス	28,400	4,655.00	132,202,000			
アルプス技研	4,300	969.00	4,166,700	貸付株式数	1,800	
ダイオース	1,900	846.00	1,607,400			
日本空調サービス	5,300	691.00	3,662,300			
オリエンタルランド	29,200	15,465.00	451,578,000			
ダスキン	28,500	1,862.00	53,067,000	貸付株式数	100	
明光ネットワークジャパン	10,700	1,093.00	11,695,100			
ファルコSDホールディングス	5,500	1,079.00	5,934,500			
秀英予備校	1,700	321.00	545,700			
田谷	1,600	747.00	1,195,200			
ラウンドワン	30,600	604.00	18,482,400	貸付株式数	600	
リゾートトラスト	36,500	1,582.00	57,743,000			
ビー・エム・エル	7,100	3,925.00	27,867,500			
ワタベウェディング	3,500	669.00	2,341,500			
もしもしホットライン	20,100	986.00	19,818,600	貸付株式数	8,700	(8,700)
リソー教育	12,100	208.00	2,516,800	貸付株式数	5,500	(1,600)
早稲田アカデミー	1,600	766.00	1,225,600			
ユー・エス・エス	130,700	1,540.00	201,278,000			

	東京個別指導学院	5,200	316.00	1,643,200	貸付株式数	2,200
	楽天	468,400	1,220.00	571,448,000	貸付株式数	53,500
	テー・オー・ダブリュー	3,500	686.00	2,401,000	貸付株式数	1,400
	セントラルスポーツ	3,300	1,515.00	4,999,500	貸付株式数	1,500
	フルキャストホールディングス	9,900	320.00	3,168,000	貸付株式数	4,400 (3,900)
	リゾートソリューション	9,000	221.00	1,989,000		
	リブセンス	5,300	901.00	4,775,300	貸付株式数	2,300 (2,200)
	ジャパンマテリアル	1,200	2,181.00	2,617,200	貸付株式数	300
	E R Iホールディングス	2,500	1,225.00	3,062,500	貸付株式数	1,000
	リロ・ホールディング	4,100	5,640.00	23,124,000		
	東祥	2,300	1,806.00	4,153,800		
	エイチ・アイ・エス	17,600	2,730.00	48,048,000	貸付株式数	6,500
	共立メンテナンス	5,300	3,485.00	18,470,500	貸付株式数	2,200
	イチネンホールディングス	11,300	729.00	8,237,700		
	建設技術研究所	6,400	1,055.00	6,752,000		
	スペース	5,200	1,004.00	5,220,800		
	燦ホールディングス	2,100	1,331.00	2,795,100		
	スバル興業	8,000	331.00	2,648,000		
	東京テアトル	41,000	136.00	5,576,000		
	よみうりランド	21,000	384.00	8,064,000	貸付株式数	9,000
	東京都競馬	83,000	263.00	21,829,000	貸付株式数	35,000 (30,000)
	常磐興産	37,000	140.00	5,180,000	貸付株式数	1,000
	カナモト	13,700	3,420.00	46,854,000		
	東京ドーム	80,000	448.00	35,840,000		
	西尾レントオール	8,700	3,955.00	34,408,500		
	トランス・コスモス	14,100	1,883.00	26,550,300		
	乃村工藝社	21,200	693.00	14,691,600		
	藤田観光	27,000	343.00	9,261,000	貸付株式数	12,000 (3,000)
	日本管財	4,600	2,100.00	9,660,000		
	トーカイ	4,800	2,533.00	12,158,400		
	白洋舎	11,000	241.00	2,651,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
	セコム	112,300	6,021.00	676,158,300	貸付株式数	600 (600)
	セントラル警備保障	4,800	1,008.00	4,838,400		
	丹青社	13,500	360.00	4,860,000		
	メイテック	14,600	3,040.00	44,384,000	貸付株式数	6,200
	アサツー ディ・ケイ	18,900	2,374.00	44,868,600		
	応用地質	10,300	1,466.00	15,099,800		
	船井総合研究所	11,000	820.00	9,020,000	貸付株式数	3,200 (3,200)
	進学会	4,500	378.00	1,701,000		
	ベネッセホールディングス	36,200	4,075.00	147,515,000	貸付株式数	15,900 (4,400)
	イオンディライト	10,400	2,282.00	23,732,800		
	ナック	5,400	1,401.00	7,565,400		
	ニチイ学館	23,400	907.00	21,223,800	貸付株式数	1,300
	ダイセキ	15,900	1,629.00	25,901,100		
	ステップ	3,600	742.00	2,671,200		
計	銘柄数：1,786			170,574,346,000		
	組入時価比率：97.7%			100.0%		
合計				170,574,346,000		



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

(注2)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26年 5月12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26年 5月12日現在			評価損益(円)
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建	4,020,845,000		3,952,190,000	68,859,369
合計	4,020,845,000		3,952,190,000	68,859,369

(注)時価の算定方法

国内先物取引について  
先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。  
上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成26年 5月12日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,803,587,056
コール・ローン	89,110,268
株式	257,335,568,632
投資信託受益証券	31,842,482
投資証券	5,913,623,686
派生商品評価勘定	33,373,884
未収入金	2,049,454,736
未収配当金	526,225,212
未収利息	162
差入委託証拠金	853,321,070
流動資産合計	268,636,107,188
資産合計	268,636,107,188
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,377,839
未払解約金	962,762,317
その他未払費用	3,325,100
流動負債合計	968,465,256
負債合計	968,465,256
純資産の部	
元本等	
元本	149,456,306,918
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	118,211,335,014
元本等合計	267,667,641,932
純資産合計	267,667,641,932
負債純資産合計	268,636,107,188

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 5月12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	1.7909円
(10,000口当たり純資産額)	(17,909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25年 5月11日

至 平成26年 5月12日

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成26年 5月12日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

## 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成26年 5月12日現在

期首	平成25年 5月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	178,452,610,132円
同期中における追加設定元本額	16,630,227,612円
同期中における一部解約元本額	45,626,530,826円
期末元本額	149,456,306,918円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	66,898,115円
バランスセレクト50	224,885,305円
バランスセレクト70	203,327,751円
野村外国株式インデックスファンド	611,329,509円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,217,664,328円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	14,047,292,645円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	7,796,897,704円
野村資産設計ファンド2015	84,350,592円
野村資産設計ファンド2020	64,185,907円
野村資産設計ファンド2025	69,951,712円
野村資産設計ファンド2030	63,105,092円
野村資産設計ファンド2035	49,301,444円
野村資産設計ファンド2040	189,615,882円
野村外国株インデックス（野村投資一任口座向け）	1,477,036,318円
のむラップ・ファンド（保守型）	448,715,752円
のむラップ・ファンド（普通型）	1,736,225,434円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,287,033,322円
野村資産設計ファンド2045	8,697,595円
野村インデックスファンド・外国株式	899,668,363円
マイ・ロード	1,085,302,672円
ネクストコア	45,052,706円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	13,730,243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）	2,714,659,698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）	798,072,639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）	16,260,827,900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）	7,195,747,656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）	12,301,975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）	43,216,614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）	49,455,443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）	187,607,983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）	2,020,141,707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）	670,065,558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）	400,932,704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）	31,946,621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）	337,621,857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）	5,906,902,745円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	770,006,043円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,692,341円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	15,329,116円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	11,567,325円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I（確定拠出年金向け）	54,859,600,629円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,151,030,395円

マイバランス50(確定拠出年金向け)	4,611,644,265円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,361,926,286円
マイバランスDC30	559,572,801円
マイバランスDC50	896,585,113円
マイバランスDC70	642,531,617円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I	9,204,881,598円
野村DC運用戦略ファンド	49,121,665円
野村DC運用戦略ファンドM	48,233円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成26年 5月12日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES	38,300	68.88	2,638,104.00	
		CAMERON INTERNATIONAL CORP	20,400	63.40	1,293,360.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	3,830	189.10	724,253.00	
		DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,500	51.02	331,630.00	
		ENSCO PLC-CL A	19,900	50.66	1,008,134.00	
		FMC TECHNOLOGIES INC	20,800	55.96	1,163,968.00	
		HALLIBURTON CO	73,700	63.50	4,679,950.00	
		HELMERICH & PAYNE	9,100	106.37	967,967.00	
		NABORS INDUSTRIES INC	25,000	25.18	629,500.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,600	80.01	3,008,376.00	
		NOBLE CORP PLC	21,100	30.48	643,128.00	
		OCEANEERING INTL INC	9,400	71.65	673,510.00	
		ROWAN COMPANIES INC	11,100	30.86	342,546.00	
		SCHLUMBERGER LTD	113,900	100.22	11,415,058.00	
		SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	13,200	31.86	420,552.00	
		WEATHERFORD INTL LTD	66,400	21.09	1,400,376.00	
		ANADARKO PETE	43,400	100.58	4,365,172.00	
		APACHE CORPORATION	35,000	88.89	3,111,150.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	36,700	36.91	1,354,597.00	
CHENIERE ENERGY INC	17,600	55.46	976,096.00			

CHESAPEAKE ENERGY CORP	46,300	29.81	1,380,203.00
CHEVRON CORP	166,600	125.03	20,829,998.00
CIMAREX ENERGY CO	7,300	128.33	936,809.00
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	23,600	17.32	408,752.00
CONCHO RESOURCES INC	9,400	134.48	1,264,112.00
CONOCOPHILLIPS	101,300	77.64	7,864,932.00
CONSOL ENERGY INC	19,800	43.28	856,944.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,000	132.07	528,280.00
DENBURY RESOURCES INC	31,300	16.90	528,970.00
DEVON ENERGY CORP	33,300	70.73	2,355,309.00
ENERGEN CORP	6,000	82.88	497,280.00
EOG RESOURCES INC	47,100	102.28	4,817,388.00
EQT CORP	13,300	105.04	1,397,032.00
EXXON MOBIL CORP	378,600	101.95	38,598,270.00
HESS CORP	26,500	87.61	2,321,665.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	49.40	820,040.00
KINDER MORGAN INC	59,400	32.15	1,909,710.00
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,128	71.14	720,505.92
MARATHON OIL CORP	60,700	35.91	2,179,737.00
MARATHON PETROLEUM CORP	26,300	91.29	2,400,927.00
MURPHY OIL CORP	15,900	60.00	954,000.00
NOBLE ENERGY INC	31,700	70.72	2,241,824.00
OCCIDENTAL PETE CORP	69,600	96.11	6,689,256.00
ONEOK INC	18,300	61.89	1,132,587.00
PEABODY ENERGY CO	24,500	18.66	457,170.00
PHILLIPS 66	49,100	81.91	4,021,781.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11,980	201.03	2,408,339.40
QEP RESOURCES INC	14,700	31.00	455,700.00
RANGE RESOURCES CORP	14,300	88.38	1,263,834.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	31,200	44.90	1,400,880.00
SPECTRA ENERGY CORP	57,400	39.42	2,262,708.00
TESORO CORP	11,800	53.06	626,108.00
VALERO ENERGY CORP	46,700	55.93	2,611,931.00
WHITING PETROLEUM CORP	10,300	69.92	720,176.00
WILLIAMS COS	59,100	43.69	2,582,079.00

AIR PRODUCTS	18,600	118.72	2,208,192.00
AIRGAS INC	5,900	105.26	621,034.00
ALBEMARLE CORP	7,000	68.27	477,890.00
ASHLAND INC	6,300	102.99	648,837.00
CELANESE CORP-SERIES A	13,900	59.52	827,328.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,080	235.66	1,197,152.80
DOW CHEM CO	104,600	49.27	5,153,642.00
DU PONT E I DE NEMOURS	79,900	67.78	5,415,622.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	13,600	85.82	1,167,152.00
ECOLAB INC	23,500	104.75	2,461,625.00
FMC CORP	11,800	72.93	860,574.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	6,800	98.31	668,508.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	40,500	95.45	3,865,725.00
MONSANTO CO	45,400	115.66	5,250,964.00
MOSAIC CO/THE	25,800	48.46	1,250,268.00
PPG INDUSTRIES	12,270	196.62	2,412,527.40
PRAXAIR INC	25,330	130.10	3,295,433.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,470	199.80	1,492,506.00
SIGMA-ALDRICH	10,700	96.86	1,036,402.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,000	118.91	475,640.00
VULCAN MATERIALS CO	11,800	59.92	707,056.00
AVERY DENNISON CORP	8,300	48.62	403,546.00
BALL CORP	11,900	58.64	697,816.00
CROWN HOLDINGS INC	12,700	48.45	615,315.00
MEADWESTVACO CORP	15,300	39.62	606,186.00
OWENS-ILLINOIS INC	14,000	32.48	454,720.00
ROCK-TENN COMPANY CL-A	6,600	98.28	648,648.00
SEALED AIR CORP	16,000	33.40	534,400.00
ALCOA INC	92,000	13.25	1,219,000.00
FREEMONT-MCMORAN COPPER & GOLD	89,300	33.91	3,028,163.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	42,400	24.02	1,018,448.00
NUCOR CORP	28,000	51.66	1,446,480.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	36,000	46.74	1,682,640.00
B/E AEROSPACE INC	9,000	99.31	893,790.00

BOEING CO	62,200	131.10	8,154,420.00
GENERAL DYNAMICS	25,700	112.79	2,898,703.00
HONEYWELL INTERNATIONAL	64,400	92.80	5,976,320.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	7,500	114.55	859,125.00
LOCKHEED MARTIN	23,450	165.18	3,873,471.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	18,400	121.06	2,227,504.00
PRECISION CASTPARTS CORP	12,710	255.28	3,244,608.80
RAYTHEON COMPANY	27,900	97.17	2,711,043.00
ROCKWELL COLLINS INC	11,200	78.98	884,576.00
TEXTRON INC	25,000	38.46	961,500.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,350	180.00	783,000.00
UNITED TECHNOLOGIES	75,900	116.99	8,879,541.00
MASCO CORP	31,000	19.99	619,690.00
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	8,400	78.85	662,340.00
FLUOR CORP	13,800	75.10	1,036,380.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,000	56.13	673,560.00
KBR INC	12,300	23.82	292,986.00
QUANTA SERVICES INC	18,600	33.55	624,030.00
AMETEK INC	21,300	52.97	1,128,261.00
EATON CORP PLC	41,100	71.62	2,943,582.00
EMERSON ELEC	60,700	67.12	4,074,184.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,900	117.89	1,402,891.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,100	41.70	504,570.00
3M CORP	55,690	141.34	7,871,224.60
DANAHER CORP	51,400	74.03	3,805,142.00
GENERAL ELEC CO	876,300	26.42	23,151,846.00
ROPER INDUSTRIES	8,670	139.18	1,206,690.60
AGCO CORP	8,600	55.15	474,290.00
CATERPILLAR INC DEL	54,900	105.06	5,767,794.00
CUMMINS INC	15,380	149.94	2,306,077.20
DEERE & COMPANY	31,500	94.34	2,971,710.00
DOVER CORP	15,100	85.26	1,287,426.00
FLOWSERVE CORP	12,300	74.88	921,024.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	36,900	86.23	3,181,887.00
INGERSOLL-RAND PLC	24,800	58.17	1,442,616.00



JOY GLOBAL INC	9,100	58.96	536,536.00
PACCAR	30,600	62.57	1,914,642.00
PALL CORP	9,700	83.67	811,599.00
PARKER HANNIFIN CORP	13,200	124.20	1,639,440.00
PENTAIR LTD	17,400	74.97	1,304,478.00
SPX CORP	3,800	101.23	384,674.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,700	86.33	1,096,391.00
XYLEM INC	15,400	37.19	572,726.00
FASTENAL CO	24,900	48.25	1,201,425.00
GRAINGER(W.W.) INC	5,050	250.89	1,266,994.50
ADT CORP/THE	17,500	31.21	546,175.00
CINTAS CORP	9,500	59.80	568,100.00
IRON MOUNTAIN INC	12,300	26.98	331,854.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	25,500	35.04	893,520.00
STERICYCLE INC	7,500	113.90	854,250.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	40,400	41.59	1,680,236.00
WASTE MANAGEMENT INC	38,100	43.92	1,673,352.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,700	58.30	798,710.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	18,700	43.32	810,084.00
FEDEX CORPORATION	25,900	137.52	3,561,768.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	61,800	99.76	6,165,168.00
DELTA AIR LINES INC	17,900	37.67	674,293.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	24.36	372,708.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	8,600	40.16	345,376.00
CSX CORP	87,700	28.69	2,516,113.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	38,700	27.96	1,082,052.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,000	75.76	606,080.00
KANSAS CITY SOUTHERN	9,800	99.55	975,590.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,700	95.30	2,544,510.00
UNION PAC CORP	40,100	189.32	7,591,732.00
AUTOLIV INC	8,700	101.39	882,093.00
BORGWARNER INC	19,500	59.12	1,152,840.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	25,200	66.84	1,684,368.00
JOHNSON CONTROLS INC	60,200	44.50	2,678,900.00

TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	9,800	78.91	773,318.00
FORD MOTOR COMPANY	317,400	15.77	5,005,398.00
GENERAL MOTORS CO	107,000	34.23	3,662,610.00
HARLEY-DAVIDSON INC	19,300	72.12	1,391,916.00
TESLA MOTORS INC	7,310	182.26	1,332,320.60
DR HORTON INC	25,400	22.01	559,054.00
GARMIN LTD	10,200	55.83	569,466.00
LEGGETT & PLATT INC	12,300	33.41	410,943.00
LENNAR CORP-A	13,500	38.40	518,400.00
MOHAWK INDUSTRIES	5,410	135.73	734,299.30
NEWELL RUBBERMAID INC	26,000	29.26	760,760.00
PULTEGROUP INC	29,500	18.32	540,440.00
TOLL BROTHERS INC	13,500	34.09	460,215.00
WHIRLPOOL CORP	6,870	151.53	1,041,011.10
HASBRO INC	10,700	55.42	592,994.00
MATTEL INC	30,000	39.43	1,182,900.00
POLARIS INDUSTRIES INC	5,620	132.34	743,750.80
COACH INC	24,600	42.12	1,036,152.00
FOSSIL GROUP INC	4,100	110.57	453,337.00
LULULEMON ATHLETICA INC	8,900	43.77	389,553.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,800	91.82	1,542,576.00
NIKE INC-B	61,300	73.45	4,502,485.00
PVH CORP	7,160	130.25	932,590.00
RALPH LAUREN CORPORATION	5,230	148.81	778,276.30
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,400	46.79	673,776.00
V F CORP	30,100	61.76	1,858,976.00
CARNIVAL CORP	32,900	39.13	1,287,377.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,660	507.68	1,350,428.80
DARDEN RESTAURANTS INC	11,300	49.73	561,949.00
INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY	23,900	12.22	292,058.00
LAS VEGAS SANDS CORP	35,800	74.68	2,673,544.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	21,300	58.17	1,239,021.00
MCDONALD'S CORP	86,000	102.93	8,851,980.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,600	24.34	817,824.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,200	51.37	678,084.00

STARBUCKS CORP	65,000	70.29	4,568,850.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	16,300	78.99	1,287,537.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,600	71.75	832,300.00
WYNN RESORTS LTD	6,950	200.35	1,392,432.50
YUM BRANDS INC	38,300	76.33	2,923,439.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	16,700	16.82	280,894.00
CBS CORP-CL B	49,100	56.74	2,785,934.00
CHARTER COMMUNICATION-A	5,500	137.95	758,725.00
COMCAST CORP SPECIAL CL-A	40,900	50.36	2,059,724.00
COMCAST CORP-CL A	184,700	51.00	9,419,700.00
DIRECTV	43,700	88.07	3,848,659.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	12,500	73.06	913,250.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	7,700	66.98	515,746.00
DISH NETWORK CORP-A	18,800	60.63	1,139,844.00
DISNEY (WALT) CO	144,400	81.95	11,833,580.00
INTERPUBRIC GROUP	34,900	17.84	622,616.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	45,700	41.49	1,896,093.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	18,600	43.37	806,682.00
LIBERTY MEDIA CORP	8,170	129.35	1,056,789.50
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	33,600	18.00	604,800.00
OMNICOM GROUP	22,800	67.66	1,542,648.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,700	75.41	580,657.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	275,000	3.16	869,000.00
TIME WARNER CABLE-A	24,440	138.88	3,394,227.20
TIME WARNER INC	78,100	68.37	5,339,697.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	127,800	34.15	4,364,370.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	37,900	33.45	1,267,755.00
VIACOM INC-CLASS B	34,500	83.38	2,876,610.00
GENUINE PARTS CO	13,700	85.14	1,166,418.00
LKQ CORP	26,300	28.78	756,914.00
AMAZON.COM INC	31,660	292.27	9,253,268.20
EXPEDIA INC	8,900	68.65	610,985.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP	42,700	28.08	1,199,016.00
NETFLIX INC	4,590	328.55	1,508,044.50

PRICELINE GROUP INC/THE	4,440	1,135.91	5,043,440.40
TRIPADVISOR INC	10,300	84.62	871,586.00
DOLLAR GENERAL CORP	26,400	56.74	1,497,936.00
DOLLAR TREE INC	17,900	52.77	944,583.00
FAMILY DOLLAR STORES	9,000	57.84	520,560.00
KOHL'S CORP	17,600	54.75	963,600.00
MACYS INC	31,800	56.35	1,791,930.00
NORDSTROM INC	13,500	61.47	829,845.00
SEARS HOLDINGS CORP	3,800	42.94	163,172.00
TARGET CORP	51,600	59.13	3,051,108.00
ADVANCE AUTO PARTS	6,600	124.56	822,096.00
AUTOZONE	2,930	535.92	1,570,245.60
BED BATH & BEYOND	18,400	61.31	1,128,104.00
BEST BUY COMPANY INC	24,900	25.92	645,408.00
CARMAX INC	19,800	44.98	890,604.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	9,100	52.64	479,024.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	11,000	36.56	402,160.00
GAP INC	21,200	40.52	859,024.00
HOME DEPOT	121,800	77.71	9,465,078.00
L BRANDS, INC	21,900	56.28	1,232,532.00
LOWES COS INC	90,500	45.71	4,136,755.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,130	148.61	1,356,809.30
PETSMART	8,700	65.32	568,284.00
ROSS STORES INC	18,400	69.15	1,272,360.00
STAPLES INC	55,000	13.05	717,750.00
TIFFANY & CO	11,200	89.36	1,000,832.00
TJX COS INC	62,700	58.47	3,666,069.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,800	65.44	772,192.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,700	87.87	500,859.00
URBAN OUTFITTERS INC	10,700	36.32	388,624.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	37,700	115.39	4,350,203.00
CVS CAREMARK CORP	103,600	76.28	7,902,608.00
KROGER CO	42,300	46.36	1,961,028.00
SAFeway INC	20,400	34.29	699,516.00
SYSCO CORP	50,600	36.82	1,863,092.00

WAL-MART STORES INC	140,800	79.20	11,151,360.00
WALGREEN	78,400	68.66	5,382,944.00
WHOLE FOODS MARKET INC	30,900	39.32	1,214,988.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	10,700	90.46	967,922.00
COCA COLA CO	344,000	40.87	14,059,280.00
COCA COLA ENTERPRISES	21,800	46.95	1,023,510.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,800	79.32	1,173,936.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,500	56.91	995,925.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	13,500	63.81	861,435.00
MONSTER BEVERAGE CORP	12,200	66.99	817,278.00
PEPSICO INC	132,700	87.17	11,567,459.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	56,900	44.39	2,525,791.00
BUNGE LIMITED	12,800	76.94	984,832.00
CAMPBELL SOUP CO	18,300	45.40	830,820.00
CONAGRA INC	37,700	30.77	1,160,029.00
GENERAL MILLS	55,400	54.40	3,013,760.00
HERSHEY CO/THE	13,500	96.03	1,296,405.00
HORMEL FOODS CORP	13,200	48.72	643,104.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,300	100.15	931,395.00
KELLOGG CO	22,300	67.21	1,498,783.00
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	10,600	108.50	1,150,100.00
KRAFT FOODS GROUP INC	51,200	57.24	2,930,688.00
MCCORMICK & CO INC.	10,100	71.15	718,615.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,300	86.13	1,490,049.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	143,800	37.96	5,458,648.00
TYSON FOODS INC-CL A	24,300	39.43	958,149.00
ALTRIA GROUP INC	172,800	40.20	6,946,560.00
LORILLARD INC	31,700	58.59	1,857,303.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	138,600	86.40	11,975,040.00
REYNOLDS AMERICAN INC	28,700	56.32	1,616,384.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,700	68.10	796,770.00
CLOROX CO	11,600	88.51	1,026,716.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	79,800	67.65	5,398,470.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,500	115.62	635,910.00
KIMBERLY-CLARK CORP	33,400	110.81	3,701,054.00

PROCTER & GAMBLE CO	235,400	82.39	19,394,606.00
AVON PRODUCTS INC	40,000	13.60	544,000.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,000	73.24	1,538,040.00
HERBALIFE LTD	8,000	61.70	493,600.00
ABBOTT LABORATORIES	133,400	38.99	5,201,266.00
BARD (C R)	6,290	144.08	906,263.20
BAXTER INTERNATIONAL INC.	47,500	75.06	3,565,350.00
BECTON,DICKINSON	16,700	117.37	1,960,079.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	114,700	12.73	1,460,131.00
CAREFUSION CORP	18,700	41.00	766,700.00
COVIDIEN PLC	39,200	72.05	2,824,360.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	12,400	46.15	572,260.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,600	85.39	819,744.00
HOLOGIC INC	24,100	24.40	588,040.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,300	353.06	1,165,098.00
MEDTRONIC INC	86,100	60.17	5,180,637.00
RESMED INC	12,200	50.65	617,930.00
ST JUDE MEDICAL INC	24,900	63.11	1,571,439.00
STRYKER CORP	25,900	80.62	2,088,058.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,800	81.95	721,160.00
ZIMMER HOLDINGS INC	14,700	99.98	1,469,706.00
AETNA INC	32,100	74.47	2,390,487.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,500	65.58	1,278,810.00
CARDINAL HEALTH INC	29,500	64.41	1,900,095.00
CIGNA CORP	24,100	86.49	2,084,409.00
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	16,100	67.75	1,090,775.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	69,500	67.80	4,712,100.00
HCA HOLDINGS INC	27,200	51.51	1,401,072.00
HENRY SCHEIN INC	7,500	115.17	863,775.00
HUMANA INC	13,600	120.04	1,632,544.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,900	100.18	791,422.00
MCKESSON CORP	19,920	171.00	3,406,320.00
OMNICARE INC	8,600	60.75	522,450.00
PATTERSON COS INC	7,500	41.35	310,125.00

QUEST DIAGNOSTICS INC	13,300	57.18	760,494.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	87,600	76.95	6,740,820.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,900	82.57	652,303.00
WELLPOINT INC	25,600	104.51	2,675,456.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,960	152.87	2,592,675.20
AMGEN INC	65,700	111.55	7,328,835.00
BIOGEN IDEC INC	20,550	286.65	5,890,657.50
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,500	58.54	731,750.00
CELGENE CORP	35,550	146.67	5,214,118.50
GILEAD SCIENCES INC	132,600	79.77	10,577,502.00
PHARMACYCLICS INC	5,400	95.05	513,270.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,720	279.41	1,877,635.20
VERTEX PHARMACEUTICALS	20,100	65.05	1,307,505.00
ABBVIE INC	138,500	52.26	7,238,010.00
ACTAVIS PLC	15,080	196.18	2,958,394.40
ALLERGAN INC	26,000	161.30	4,193,800.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	143,400	51.18	7,339,212.00
ELI LILLY & CO.	87,500	59.36	5,194,000.00
FOREST LABS INC.	20,700	89.50	1,852,650.00
HOSPIRA INC	14,800	47.50	703,000.00
JOHNSON & JOHNSON	244,400	100.91	24,662,404.00
MERCK & CO INC	252,900	55.21	13,962,609.00
MYLAN INC	33,800	46.16	1,560,208.00
PERRIGO CO PLC	11,510	129.51	1,490,660.10
PFIZER INC	561,100	29.03	16,288,733.00
ZOETIS INC	42,800	30.54	1,307,112.00
BANK OF AMERICA CORP	923,100	14.74	13,606,494.00
BB&T CORPORATION	60,400	37.61	2,271,644.00
CIT GROUP INC	16,400	41.70	683,880.00
CITIGROUP	262,400	46.99	12,330,176.00
COMERICA INC	15,900	47.76	759,384.00
FIFTH THIRD BANCORP	76,000	20.55	1,561,800.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,100	50.84	411,804.00
JPMORGAN CHASE & CO	325,500	54.01	17,580,255.00
KEYCORP	76,500	13.60	1,040,400.00

M & T BANK CORP	10,200	121.37	1,237,974.00
PNC FINANCIAL	46,200	84.18	3,889,116.00
REGIONS FINANCIAL CORP	118,000	10.26	1,210,680.00
SUNTRUST BKS INC.	46,200	38.00	1,755,600.00
US BANCORP	159,000	40.32	6,410,880.00
WELLS FARGO CO	433,400	49.08	21,271,272.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	96,200	127.34	12,250,108.00
CME GROUP INC	27,300	69.59	1,899,807.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	10,100	188.23	1,901,123.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	27,200	25.60	696,320.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	22,100	78.69	1,739,049.00
MOODYS CORP	16,600	82.80	1,374,480.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	10,100	36.37	367,337.00
ACE LTD	29,200	102.66	2,997,672.00
AFLAC INC	40,300	62.98	2,538,094.00
ALLEGHANY CORP	1,410	414.62	584,614.20
ALLSTATE CORP	39,700	58.13	2,307,761.00
AMERICAN INTL GROUP	120,800	52.28	6,315,424.00
AON PLC	24,700	85.53	2,112,591.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,400	56.93	649,002.00
ASSURANT INC	6,900	67.64	466,716.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,400	45.24	425,256.00
CHUBB CORP	21,900	92.95	2,035,605.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,700	49.13	673,081.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,250	158.36	673,030.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	21,100	34.02	717,822.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	37,900	35.08	1,329,532.00
LINCOLN NATIONAL CORP	23,500	49.65	1,166,775.00
LOEWS CORP	29,100	43.25	1,258,575.00
MARSH & MCLENNAN COS	47,100	48.93	2,304,603.00
METLIFE INC	82,100	51.30	4,211,730.00
PARTNERRE LTD	4,200	105.86	444,612.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,200	46.58	1,220,396.00
PROGRESSIVE CO	50,100	24.64	1,234,464.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40,400	83.75	3,383,500.00



RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,000	101.39	405,560.00
TORCHMARK CORP	7,500	80.74	605,550.00
TRAVELERS COS INC/THE	31,800	91.30	2,903,340.00
UNUM GROUP	22,800	33.33	759,924.00
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	15,100	41.59	628,009.00
WR BERKLEY CORP	9,800	44.38	434,924.00
XL GROUP PLC	23,700	32.04	759,348.00
CBRE GROUP INC	23,800	28.30	673,540.00
REALOGY HOLDINGS CORP	13,000	36.95	480,350.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,400	52.82	813,428.00
EBAY INC	100,500	50.56	5,081,280.00
EQUINIX INC	4,500	190.60	857,700.00
FACEBOOK INC-A	159,600	57.27	9,140,292.00
GOOGLE INC-CL A	23,950	526.62	12,612,549.00
GOOGLE INC-CL C	23,940	519.03	12,425,578.20
LINKEDIN CORP - A	8,820	148.69	1,311,445.80
RACKSPACE HOSTING INC	11,000	26.28	289,080.00
VERISIGN INC	12,600	47.93	603,918.00
YAHOO! INC	84,300	33.77	2,846,811.00
ACCENTURE PLC-CL A	54,800	78.74	4,314,952.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,320	236.42	1,021,334.40
AUTOMATIC DATA PROCESS	42,100	78.07	3,286,747.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	52,300	47.72	2,495,756.00
COMPUTER SCIENCE	12,900	62.39	804,831.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	25,400	53.75	1,365,250.00
FISERV INC	22,800	61.00	1,390,800.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,100	122.01	744,261.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	89,310	190.08	16,976,044.80
LEIDOS HOLDINGS INC	6,600	37.88	250,008.00
MASTERCARD INC-CLASS A	90,700	74.38	6,746,266.00
PAYCHEX INC	29,000	40.89	1,185,810.00
TERADATA CORP	13,900	39.63	550,857.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	15,300	32.14	491,742.00
VANTIV INC - CL A	10,400	28.92	300,768.00
VISA INC-CLASS A SHARES	43,740	210.81	9,220,829.40

WESTERN UNION CO	46,300	16.35	757,005.00
XEROX CORP	99,000	11.84	1,172,160.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,700	20.79	825,363.00
ADOBE SYSTEMS INC.	41,100	59.58	2,448,738.00
ANSYS INC	7,800	75.14	586,092.00
AUTODESK INC.	19,600	46.85	918,260.00
CA INC	27,500	29.41	808,775.00
CITRIX SYSTEMS INC	16,600	59.94	995,004.00
ELECTRONIC ARTS	27,700	35.12	972,824.00
INTUIT INC	23,500	74.92	1,760,620.00
MICROSOFT CORP	687,000	39.54	27,163,980.00
NETSUITE INC	2,800	72.92	204,176.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	20,900	15.03	314,127.00
ORACLE CORPORATION	315,500	41.04	12,948,120.00
RED HAT INC	16,900	48.74	823,706.00
SALESFORCE.COM INC	49,600	50.28	2,493,888.00
SERVICENOW INC	10,700	46.46	497,122.00
SYMANTEC CORP	61,900	20.79	1,286,901.00
SYNOPSYS INC	13,100	37.60	492,560.00
VMWARE INC - CLASS A	7,400	93.25	690,050.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,100	68.21	484,291.00
CISCO SYSTEMS	462,500	23.02	10,646,750.00
F5 NETWORKS INC	6,500	102.71	667,615.00
HARRIS CORP	9,200	74.84	688,528.00
JUNIPER NETWORKS INC	44,100	24.60	1,084,860.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,900	67.26	1,338,474.00
QUALCOMM INC	146,200	79.50	11,622,900.00
APPLE INC	77,970	585.55	45,655,333.50
EMC CORP	177,400	25.44	4,513,056.00
HEWLETT PACKARD CO	165,800	32.36	5,365,288.00
NETAPP INC	30,200	34.19	1,032,538.00
SAN DISK CORPORATION	19,600	88.84	1,741,264.00
SEAGATE TECHNOLOGY	28,200	49.55	1,397,310.00
WESTERN DIGITAL CORP	18,700	81.95	1,532,465.00
AMPHENOL CORP-CL A	13,800	96.00	1,324,800.00

ARROW ELECTRS INC	8,300	55.08	457,164.00
AVNET	11,800	41.68	491,824.00
CORNING INC	125,200	20.74	2,596,648.00
FLEXTRONICS INTL LTD	51,000	9.52	485,520.00
FLIR SYSTEMS INC	12,600	34.15	430,290.00
TE CONNECTIVITY LTD	35,400	58.10	2,056,740.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,200	35.02	812,464.00
ALTERA CORP.	27,800	32.38	900,164.00
ANALOG DEVICES INC	27,000	51.25	1,383,750.00
APPLIED MATERIALS	103,000	19.30	1,988,415.00
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	21,400	67.42	1,442,788.00
BROADCOM CORP-CL A	44,400	29.74	1,320,456.00
CREE INC	10,700	45.54	487,278.00
INTEL CORP	430,100	26.30	11,311,630.00
KLA TENCOR CORP	14,200	63.11	896,162.00
LAM RESEARCH	14,000	57.19	800,660.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	20,000	44.74	894,800.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	35,800	15.48	554,184.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,900	31.63	755,957.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	18,000	46.88	843,840.00
MICRON TECHNOLOGY	92,300	26.84	2,477,332.00
NVIDIA CORP	48,800	18.05	880,840.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	94,300	45.84	4,322,712.00
XILINX INC	22,900	46.63	1,067,827.00
AT & T INC	456,100	36.44	16,620,284.00
CENTURYLINK INC	50,900	36.56	1,860,904.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	83,000	6.06	502,980.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	13,700	44.02	603,074.00
VERIZON COMMUNICATIONS	358,000	48.48	17,355,840.00
WINDSTREAM HOLDINGS INC	51,000	9.19	468,690.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	11,300	97.22	1,098,586.00
SPRINT CORP	84,000	8.81	740,040.00
T-MOBILE US INC	20,500	31.84	652,720.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,600	52.32	2,228,832.00
DUKE ENERGY CORP	60,900	71.98	4,383,582.00

EDISON INTERNATIONAL	26,900	55.29	1,487,301.00
ENTERGY CORP	15,100	74.61	1,126,611.00
EXELON CORPORATION	73,600	36.20	2,664,320.00
FIRSTENERGY CORP	35,500	33.51	1,189,605.00
NEXTERA ENERGY INC	37,700	96.92	3,653,884.00
NORTHEAST UTILITIES	28,000	45.77	1,281,560.00
OGE ENERGY CORP	16,600	36.15	600,090.00
PEPCO HOLDINGS INC	22,700	27.57	625,839.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	10,000	55.27	552,700.00
PPL CORPORATION	55,200	33.63	1,856,376.00
SOUTHERN CO.	75,900	43.67	3,314,553.00
XCEL ENERGY INC	42,600	30.75	1,309,950.00
ALLIANT ENERGY CORP	9,500	57.50	546,250.00
AMEREN CORPORATION	20,600	39.31	809,786.00
CENTERPOINT ENERGY INC	34,500	23.95	826,275.00
CMS ENERGY CORP	23,700	29.41	697,017.00
CONSOLIDATED EDISON INC	25,100	56.20	1,410,620.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	50,300	69.86	3,513,958.00
DTE ENERGY COMPANY	15,100	76.63	1,157,113.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,500	58.12	435,900.00
MDU RESOURCES GROUP INC	15,100	34.63	522,913.00
NISOURCE INC	27,300	35.94	981,162.00
PG&E CORP	39,200	43.59	1,708,728.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	44,800	38.37	1,718,976.00
SCANA CORP	11,300	51.83	585,679.00
SEMPRA ENERGY	20,000	98.35	1,967,000.00
WISCONSIN ENERGY CORP	19,600	46.33	908,068.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,400	46.26	712,404.00
HUDSON CITY BANCORP INC	39,000	9.87	384,930.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	40,300	15.21	612,963.00
OCWEN FINANCIAL CORP	10,000	31.85	318,500.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL IN	29,800	14.39	428,822.00
AMERICAN EXPRESS CO	83,900	88.84	7,453,676.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	50,500	76.43	3,859,715.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	41,600	57.54	2,393,664.00

NAVIENT CORP	37,100	16.28	603,988.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,530	191.68	868,310.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,900	111.23	1,879,787.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	98,800	34.10	3,369,080.00
BLACKROCK INC	11,600	302.34	3,507,144.00
EATON VANCE CORP	10,000	36.30	363,000.00
FRANKLIN RESOURCES INC	35,300	54.80	1,934,440.00
GOLDMAN SACHS GROUP	37,460	157.20	5,888,712.00
INVESCO LTD	39,400	35.85	1,412,490.00
LEGG MASON INC	10,000	47.77	477,700.00
MORGAN STANLEY	126,000	29.68	3,739,680.00
NORTHERN TRUST CORP	19,800	61.11	1,209,978.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,700	49.30	576,810.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	100,400	26.36	2,646,544.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,900	32.18	415,122.00
STATE STREET CORP	38,000	64.86	2,464,680.00
T ROWE PRICE GROUP INC	23,100	81.16	1,874,796.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	19,900	31.00	616,900.00
H & R BLOCK INC	23,400	27.95	654,030.00
AES CORP	58,200	14.04	817,128.00
CALPINE CORP	29,800	22.77	678,546.00
NRG ENERGY INC	27,500	34.11	938,025.00
CERNER CORP	26,900	50.19	1,350,111.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,200	55.39	1,561,998.00
ILLUMINA INC	10,780	143.33	1,545,097.40
METTLER-TOLEDO INTL	2,610	241.79	631,071.90
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,400	116.60	3,661,240.00
WATERS CORP	7,300	103.46	755,258.00
DUN & BRADSTREET CORP	3,100	107.05	331,855.00
EQUIFAX INC	11,100	71.23	790,653.00
IHS INC-CLASS A	5,300	120.81	640,293.00
MANPOWERGROUP INC	7,000	81.73	572,110.00
NIELSEN NV	23,400	46.85	1,096,290.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	12,300	44.62	548,826.00
TOWERS WATSON & CO-CL A	5,700	106.81	608,817.00

	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	13,000	60.53	786,890.00	
小計	銘柄数：577			1,487,816,318.42	
				(151,787,020,805)	
	組入時価比率：56.7%			59.0%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	10,700	48.31	516,917.00	
	ARC RESOURCES LTD	26,300	30.89	812,407.00	
	ATHABASCA OIL CORP	31,000	7.71	239,010.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	10,900	45.04	490,936.00	
	CAMECO CORP	34,600	22.15	766,390.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	93,500	42.90	4,011,150.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	42,000	22.70	953,400.00	
	CENOVUS ENERGY INC	66,200	31.14	2,061,468.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	33,500	43.35	1,452,225.00	
	ENBRIDGE INC	68,200	52.35	3,570,270.00	
	ENCANA CORP	63,500	24.46	1,553,210.00	
	ENERPLUS CORP	18,700	22.97	429,539.00	
	HUSKY ENERGY INC	30,100	35.94	1,081,794.00	
	IMPERIAL OIL	26,300	52.68	1,385,484.00	
	INTER PIPELINE LTD	26,000	30.37	789,620.00	
	KEYERA CORP	7,200	75.36	542,592.00	
	MEG ENERGY CORP	12,400	36.33	450,492.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	26,300	17.36	456,568.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	26,900	44.07	1,185,483.00	
	PENGROWTH ENERGY CORP	47,500	7.16	340,100.00	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	40,000	9.71	388,400.00	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,900	37.94	489,426.00	
	SUNCOR ENERGY INC	128,400	42.14	5,410,776.00	
	TALISMAN ENERGY	91,000	11.17	1,016,470.00	
	TOURMALINE OIL CORP	14,000	54.35	760,900.00	
	TRANSCANADA CORP	61,200	50.54	3,093,048.00	
	VERMILION ENERGY INC	8,200	70.05	574,410.00	
	AGRIUM INC	12,400	99.29	1,231,196.00	
	METHANEX CORP	8,200	66.16	542,512.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	74,700	39.26	2,932,722.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	14,200	35.38	502,396.00	

BARRICK GOLD	101,500	18.79	1,907,185.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	66,800	6.50	434,200.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,300	21.01	993,773.00
FRANCO-NEVADA CORP	12,300	53.54	658,542.00
GOLDCORP INC	70,900	27.09	1,920,681.00
KINROSS GOLD CORP	104,600	4.41	461,286.00
NEW GOLD INC	43,100	5.39	232,309.00
SILVER WHEATON CORP	30,100	23.64	711,564.00
TECK RESOURCES LTD	49,200	24.38	1,199,496.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	63,000	4.26	268,380.00
YAMANA GOLD INC	68,000	7.87	535,160.00
BOMBARDIER B SHEARS	132,000	4.12	543,840.00
CAE INC	21,200	14.39	305,068.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,800	49.83	637,824.00
FINNING INTERNATIONAL INC	14,900	29.32	436,868.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	72,500	64.13	4,649,425.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	15,140	173.39	2,625,124.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	19,400	106.37	2,063,578.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,600	59.46	570,816.00
TIM HORTONS INC	13,300	59.55	792,015.00
SHAW COMMUNICATIONS-B	33,000	27.04	892,320.00
THOMSON REUTERS CORP	31,800	38.76	1,232,568.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	6,900	111.29	767,901.00
DOLLARAMA INC	6,200	91.54	567,548.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	36,600	29.92	1,095,072.00
EMPIRE CO LTD A	4,600	67.93	312,478.00
LOBLAW COMPANIES	19,287	47.48	915,746.76
METRO INC	7,800	67.28	524,784.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,200	81.74	343,308.00
SAPUTO INC	10,800	59.06	637,848.00
CATAMARAN CORP	17,700	44.94	795,438.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	27,310	142.96	3,904,237.60
BANK OF MONTREAL	55,500	75.17	4,171,935.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	104,400	66.78	6,971,832.00

	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	35,000	96.84	3,389,400.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,600	45.76	1,262,976.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	124,600	73.09	9,107,014.00	
	TORONTO DOMINION BANK	160,500	52.18	8,374,890.00	
	ONEX CORP	8,000	62.54	500,320.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,780	500.60	891,068.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	27,100	30.15	817,065.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,300	44.92	372,836.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	11,100	70.50	782,550.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	159,700	20.31	3,243,507.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	30,400	30.53	928,112.00	
	POWER FINANCIAL CORP	22,500	34.59	778,275.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	53,000	37.59	1,992,270.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	47,600	46.78	2,226,728.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	7,700	18.47	142,219.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	18,900	37.43	707,427.00	
	OPEN TEXT CORP	10,200	51.26	522,852.00	
	BLACKBERRY LTD	43,900	7.95	349,005.00	
	BCE INC	22,700	49.01	1,112,527.00	
	BELL ALIANT INC	7,000	28.16	197,120.00	
	TELUS CORP	19,300	39.67	765,631.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	32,000	44.31	1,417,920.00	
	FORTIS INC	18,900	32.54	615,006.00	
	ATCO LTD CL1	6,800	53.81	365,908.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,600	39.99	423,894.00	
	CI FINANCIAL CORP	13,700	36.58	501,146.00	
	IGM FINANCIAL INC	8,500	54.16	460,360.00	
	TRANSALTA CORP	24,300	12.97	315,171.00	
小計	銘柄数：93			127,674,658.96	
				(11,951,624,825)	
	組入時価比率：4.5%			4.6%	
ユ-口	CGG	14,900	10.34	154,066.00	
	FUGRO NV CVA	6,600	41.11	271,359.00	
	SAIPEM	23,900	19.77	472,503.00	



TECHNIP SA	8,800	78.99	695,112.00
TENARIS SA	41,700	16.09	670,953.00
ENI SPA	219,600	18.92	4,154,832.00
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	31,100	12.80	398,080.00
NESTE OIL OYJ	10,700	15.17	162,319.00
OMV AG	12,500	32.48	406,000.00
REPSOL SA	76,718	19.88	1,525,537.43
TOTAL SA	185,100	52.26	9,673,326.00
VOPAK	6,100	35.76	218,136.00
AIR LIQUIDE	26,870	104.90	2,818,663.00
AKZO NOBEL	20,900	55.01	1,149,709.00
ARKEMA	5,500	75.69	416,295.00
BASF SE	80,000	82.43	6,594,400.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	3,200	70.62	225,984.00
K+S AG	14,200	25.71	365,082.00
KONINKLIJKE DSM NV	13,700	51.61	707,057.00
LANXESS	7,100	53.80	381,980.00
LINDE AG	16,090	147.50	2,373,275.00
SOLVAY SA	5,100	122.00	622,200.00
UMICORE	9,900	34.39	340,461.00
CRH PLC	67,400	20.38	1,373,612.00
HEIDELBERGCEMENT AG	12,300	61.16	752,268.00
IMERYS	3,000	61.07	183,210.00
LAFARGE SA	16,000	63.09	1,009,440.00
ARCELORMITTAL	87,100	11.50	1,001,650.00
THYSSENKRUPP AG	38,600	20.61	795,739.00
VOESTALPINE AG	9,600	33.29	319,632.00
STORA ENSO OYJ-R	49,400	7.53	371,982.00
UPM-KYMMENE OYJ	47,200	12.78	603,216.00
AIRBUS GROUP NV	51,400	48.66	2,501,124.00
FINMECCANICA SPA	33,000	6.05	199,650.00
SAFRAN SA	23,100	47.63	1,100,368.50
THALES (EX THOMSON-CSF)	8,300	45.14	374,703.50
ZODIAC AEROSPACE	15,400	25.46	392,161.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	35,900	42.68	1,532,391.50

ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,514	31.30	422,988.20	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	7,100	42.13	299,123.00	
BOUYGUES	16,000	32.27	516,320.00	
FERROVIAL SA	36,500	15.96	582,540.00	
HOCHTIEF AG	2,900	66.60	193,140.00	
OCI	8,000	29.58	236,680.00	
VINCI	42,100	54.46	2,292,766.00	
ALSTOM	18,700	28.24	528,088.00	
LEGRAND SA	23,200	46.62	1,081,584.00	
OSRAM LICHT AG	7,750	38.88	301,358.75	
PRYSMIAN SPA	17,400	16.09	279,966.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	47,300	68.41	3,235,793.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	82,000	23.13	1,897,070.00	
SIEMENS AG	68,560	96.67	6,627,695.20	
ANDRITZ AG	6,500	42.63	277,127.50	
CNH INDUSTRIAL NV	80,100	7.91	633,591.00	
GEA GROUP AG	15,300	31.70	485,086.50	
KONE OYJ	27,600	30.22	834,072.00	
MAN SE	3,200	93.25	298,400.00	
METSO OYJ	10,400	28.47	296,088.00	
VALLOUREC	9,300	40.45	376,185.00	
WARTSILA OYJ	15,600	40.80	636,480.00	
ZARDOYA OTIS S.A	15,600	13.00	202,800.00	
BRENTAG AG	4,430	132.25	585,867.50	
REXEL SA	18,700	18.49	345,856.50	
BIC	2,500	95.13	237,825.00	
EDENRED	16,900	23.65	399,769.50	
DEUTSCHE POST AG-REG	79,100	27.30	2,159,430.00	
TNT EXPRESS NV	36,000	6.44	232,128.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	19,200	17.69	339,744.00	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	80,000	4.73	378,400.00	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	34,900	16.56	578,118.50	
ADP	2,400	92.58	222,192.00	
ATLANTIA SPA	31,500	18.54	584,010.00	

FRAPORT AG	2,900	54.34	157,586.00
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	48,000	9.55	458,832.00
CONTINENTAL AG	9,500	163.70	1,555,150.00
MICHELIN B	16,000	87.89	1,406,240.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,200	29.75	303,450.00
PIRELLI&CO	21,100	11.92	251,512.00
VALEO	6,600	94.27	622,182.00
BAYER MOTOREN WERK	28,700	88.12	2,529,044.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,700	71.26	334,922.00
DAIMLER AG	83,800	64.52	5,406,776.00
FIAT SPA-ORD	74,000	7.53	557,220.00
PEUGEOT CITROEN	34,200	9.51	325,242.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	13,500	77.52	1,046,520.00
RENAULT	16,900	68.38	1,155,622.00
VOLKSWAGEN AG	2,710	188.45	510,699.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	12,440	190.80	2,373,552.00
ADIDAS AG	17,900	77.27	1,383,133.00
CHRISTIAN DIOR SA	4,780	147.20	703,616.00
HUGO BOSS AG	2,800	100.90	282,520.00
KERING	6,700	156.00	1,045,200.00
LUXOTTICA GROUP SPA	14,800	40.47	598,956.00
LVMH	22,040	141.85	3,126,374.00
ACCOR SA	13,500	35.25	475,875.00
SODEXO	8,000	78.60	628,800.00
AXEL SPRINGER SE	3,500	43.57	152,495.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,000	24.91	323,895.00
JC DECAUX INTERNATIONAL	5,300	28.61	151,633.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,100	101.00	212,100.00
LAGARDERE S.C.A	9,700	24.33	236,001.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	18,700	32.62	610,087.50
PUBLICIS GROUPE	15,900	60.20	957,180.00
REED ELSEVIER NV	59,500	14.90	886,847.50
RTL GROUP	3,300	75.62	249,546.00
SES FDR	26,100	27.09	707,179.50
SKY DEUTSCHLAND AG	37,000	6.33	234,543.00

TELENET GROUP HOLDING NV	4,300	42.08	180,965.50
WOLTERS KLUWER	25,900	20.19	523,050.50
INDITEX	18,740	107.05	2,006,117.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	54,300	26.56	1,442,208.00
CASINO GUICHARD	4,700	89.62	421,214.00
COLRUYT SA	6,700	41.38	277,279.50
DELHAIZE GROUP	8,700	53.89	468,843.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	48,000	6.38	306,288.00
JERONIMO MARTINS	23,400	12.38	289,809.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,300	14.20	1,126,060.00
METRO AG	11,400	28.21	321,594.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	70,000	78.97	5,527,900.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,200	46.59	428,674.00
HEINEKEN NV	19,600	49.98	979,706.00
PERNOD-RICARD	18,700	86.08	1,609,696.00
REMY COINTREAU	2,300	64.68	148,764.00
DANONE	49,700	52.28	2,598,316.00
KERRY GROUP PLC-A	13,700	56.09	768,433.00
SUEDZUCKER AG	8,300	16.33	135,580.50
UNILEVER NV-CVA	141,700	31.10	4,406,870.00
HENKEL AG & CO KGAA	11,000	76.05	836,550.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,200	84.80	1,288,960.00
BEIERSDORF AG	8,700	72.43	630,141.00
LOREAL-ORD	21,180	126.55	2,680,329.00
ESSILOR INTERNATIONAL	18,100	78.32	1,417,592.00
CELESIO AG	3,300	25.07	82,747.50
FRESENIUS MEDICAL CARE	18,500	48.87	904,187.50
FRESENIUS SE & CO KGAA	10,850	110.70	1,201,095.00
GRIFOLS SA	13,200	38.30	505,560.00
BAYER AG	71,520	100.20	7,166,304.00
MERCK KGAA	5,670	122.55	694,858.50
ORION OYJ	7,800	22.77	177,606.00
SANOFI	103,400	78.38	8,104,492.00
U.C.B. SA	9,200	58.85	541,420.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	6,460	22.95	148,257.00

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	509,000	8.94	4,550,460.00
BANCO DE SABADELL SA	298,659	2.50	749,335.43
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	145,000	1.22	177,045.00
BANCO POPOLARE SPA	30,300	13.09	396,627.00
BANCO SANTANDER SA	1,024,000	7.23	7,408,640.00
BANK OF IRELAND	2,050,000	0.27	553,500.00
BANKIA SA	362,000	1.39	505,352.00
BCO POPULAR ESPANOL	142,000	5.02	713,124.00
BNP PARIBAS	86,600	52.98	4,588,068.00
CAIXABANK	153,652	4.40	676,376.10
COMMERZBANK AG	83,100	11.66	968,946.00
CREDIT AGRICOLE SA	87,900	11.83	1,039,857.00
ERSTE GROUP BANK AG	21,800	23.87	520,475.00
INTESA SANPAOLO	1,008,000	2.39	2,415,168.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROUPE NV	21,400	44.50	952,300.00
NATIXIS	77,000	5.04	388,619.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,400	22.75	213,897.00
SOCIETE GENERALE	61,900	44.15	2,732,885.00
UNICREDIT SPA	380,000	6.22	2,365,500.00
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	75,000	6.45	484,125.00
DEUTSCHE BOERSE AG	16,900	55.35	935,415.00
EURAZEO	2,500	64.48	161,200.00
EXOR SPA	8,600	31.47	270,642.00
GROUPE BRUXELLES LAM	7,200	75.23	541,656.00
ING GROEP NV	331,100	10.24	3,392,119.50
WENDEL	2,800	107.75	301,700.00
AEGON NV	159,000	6.46	1,027,776.00
AGEAS	19,400	30.55	592,670.00
ALLIANZ SE	39,730	120.85	4,801,370.50
ASSICURAZIONI GENERALI	102,500	16.57	1,698,425.00
AXA	154,600	17.44	2,696,224.00
CNP ASSURANCES	16,400	15.74	258,136.00
DELTA LLOYD NV	15,900	18.76	298,363.50
HANNOVER RUECK SE	5,300	64.16	340,048.00

MAPFRE SA	91,000	3.00	273,728.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	15,700	156.25	2,453,125.00
SAMPO OYJ-A	38,900	36.12	1,405,068.00
SCOR SE	14,200	26.90	381,980.00
UNIPOLSAI SPA	80,000	2.59	207,200.00
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN	3,100	37.92	117,567.50
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	23,800	15.67	373,065.00
IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00
IMMOFINANZ AG	82,000	2.62	214,840.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,800	31.70	310,660.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	33,600	31.74	1,066,464.00
ATOS	6,000	60.89	365,340.00
CAP GEMINI SA	12,500	50.62	632,750.00
DASSAULT SYSTEMES SA	5,300	90.00	477,000.00
GEMALTO	6,800	77.09	524,212.00
SAP AG	79,600	54.84	4,365,264.00
ALCATEL-LUCENT	246,000	2.85	702,822.00
NOKIA OYJ	324,000	5.27	1,707,480.00
ASML HOLDING NV	31,000	58.57	1,815,670.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	96,000	8.55	820,896.00
STMICROELECTRONICS NV	57,700	6.95	401,015.00
BELGACOM SA	13,800	23.28	321,333.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	249,400	12.66	3,157,404.00
ELISA CORPORATION	12,500	21.99	274,875.00
ILIAD SA	2,190	204.75	448,402.50
KONINKLIJKE KPN NV	271,000	2.58	699,993.00
ORANGE	160,300	12.06	1,934,019.50
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	53,000	2.97	157,834.00
TELECOM ITALIA SPA	860,000	0.93	806,680.00
TELECOM ITALIA-RNC	500,000	0.72	364,250.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	23,800	6.29	149,844.80
TELEFONICA SA	356,200	11.73	4,178,226.00
TELEKOM AUSTRIA AG	22,000	7.11	156,442.00
VIVENDI SA	104,400	18.93	1,976,814.00

	ZIGGO NV	13,600	32.99	448,732.00	
	ELECTRICITE DE FRANCE	20,300	28.15	571,546.50	
	ENEL SPA	571,000	4.19	2,392,490.00	
	ENERGIAS DE PORTUGAL	171,000	3.48	595,935.00	
	FORTUM OYJ	37,400	17.15	641,410.00	
	IBERDROLA SA	417,000	5.16	2,152,137.00	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,600	61.41	589,536.00	
	TERNA SPA	126,000	3.93	495,684.00	
	ENAGAS	16,000	22.08	353,280.00	
	GAS NATURAL SDG	30,500	20.82	635,010.00	
	SNAM SPA	175,000	4.48	784,000.00	
	E.ON SE	156,000	13.42	2,093,520.00	
	GDF SUEZ	114,100	19.31	2,203,271.00	
	RWE AG	42,700	27.69	1,182,363.00	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	24,300	14.16	344,088.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,000	13.08	431,805.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	87,800	30.88	2,711,264.00	
	MEDIOBANCA SPA-ORD	44,000	7.20	316,800.00	
	ENEL GREEN POWER SPA	160,000	2.14	343,360.00	
	QIAGEN NV	20,100	16.10	323,710.50	
	BUREAU VERITAS SA	18,500	22.49	416,065.00	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,000	40.01	440,110.00	
	小計 銘柄数：233			261,639,184.91	
				(36,710,594,034)	
	組入時価比率：13.7%			14.3%	
英債券	AMEC PLC	26,800	12.12	324,816.00	
	PETROFAC LTD	22,700	11.77	267,179.00	
	BG GROUP PLC	294,400	12.64	3,722,688.00	
	BP PLC	1,614,000	5.00	8,084,526.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	334,100	23.70	7,918,170.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	214,400	25.76	5,522,944.00	
	TULLOW OIL PLC	78,200	8.98	702,627.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,500	24.96	287,040.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	17,700	32.98	583,746.00	
	REXAM PLC	67,000	5.02	336,675.00	

ANGLO AMERICAN PLC	119,900	16.04	1,923,196.00
ANTOFAGASTA PLC	34,900	7.69	268,381.00
BHP BILLITON PLC	182,300	18.96	3,457,319.50
FRESNILLO PLC	14,200	8.16	115,943.00
GLENCORE XSTRATA PLC	915,000	3.25	2,978,325.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,400	45.39	335,886.00
RIO TINTO PLC-REG	109,800	31.88	3,500,973.00
BAE SYSTEMS PLC	277,000	4.05	1,121,850.00
COBHAM PLC	99,000	3.01	298,782.00
MEGGITT PLC	70,600	4.79	338,174.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	162,800	10.01	1,629,628.00
SMITHS GROUP PLC	33,900	13.19	447,141.00
IMI PLC	24,937	15.27	380,787.99
MELROSE INDUSTRIES PLC	93,076	2.89	269,641.17
WEIR GROUP PLC	18,200	26.65	485,030.00
BUNZLE	30,000	16.47	494,100.00
TRAVIS PERKINS PLC	20,900	17.15	358,435.00
WOLSELEY PLC	23,612	33.89	800,210.68
AGGREKO PLC	24,200	16.42	397,364.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	43,900	12.23	536,897.00
G4S PLC	136,800	2.48	339,537.60
SERCO GROUP PLC	46,300	3.46	160,568.40
ROYAL MAIL PLC	55,000	5.57	306,350.00
EASYJET PLC	14,200	16.85	239,270.00
GKN PLC	148,000	3.77	558,256.00
PERSIMMON PLC	25,400	13.55	344,170.00
BURBERRY GROUP PLC	39,200	15.17	594,664.00
CARNIVAL PLC	16,800	23.99	403,032.00
COMPASS GROUP PLC	155,300	9.71	1,508,739.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	21,800	21.85	476,330.00
TUI TRAVEL PLC	38,000	4.44	168,910.00
WHITBREAD PLC	15,800	40.99	647,642.00
WILLIAM HILL PLC	81,000	3.50	284,229.00
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	89,200	8.90	793,880.00



ITV PLC	323,000	1.89	610,470.00
PEARSON	72,000	11.37	818,640.00
REED ELSEVIER PLC	100,400	8.78	882,014.00
WPP PLC	116,300	12.66	1,472,358.00
ASOS PLC	4,600	41.06	188,876.00
MARKS & SPENCER PLC	141,000	4.58	646,344.00
NEXT PLC	13,300	64.65	859,845.00
KINGFISHER PLC	211,000	4.20	886,622.00
MORRISON SUPERMARKETS	195,000	1.97	385,320.00
SAINSBURY	111,800	3.35	375,424.40
TESCO PLC	696,000	2.96	2,066,076.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	18,800	14.50	272,600.00
DIAGEO PLC	218,500	18.50	4,043,342.50
SABMILLER PLC	83,600	32.11	2,684,814.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,400	29.45	924,730.00
TATE & LYLE ORD.	42,500	6.92	294,100.00
UNILEVER PLC	111,500	26.39	2,942,485.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	163,400	34.17	5,584,195.00
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	83,200	25.91	2,155,712.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,300	48.26	2,717,038.00
SMITH & NEPHEW PLC	76,400	9.11	696,004.00
ASTRAZENECA PLC	109,300	46.00	5,028,346.50
GLAXOSMITHKLINE PLC	420,600	16.13	6,786,381.00
SHIRE PLC	51,400	33.09	1,700,826.00
BARCLAYS PLC	1,320,000	2.60	3,433,980.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,623,000	5.96	9,673,080.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,312,000	0.76	3,293,074.40
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	190,000	3.25	617,880.00
STANDARD CHARTERED PLC	210,800	12.92	2,723,536.00
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	15,800	18.40	290,720.00
ADMIRAL GROUP PLC	17,500	14.26	249,550.00
AVIVA PLC	253,000	5.24	1,326,985.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	95,000	2.48	236,170.00
FRIENDS LIFE GROUP LTD	126,000	3.00	378,000.00
LEGAL & GENERAL	509,000	2.22	1,132,016.00

	OLD MUTUAL PLC	417,000	2.05	858,186.00	
	PRUDENTIAL PLC	220,800	13.69	3,022,752.00	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	453,750	0.96	437,868.75	
	STANDARD LIFE PLC	205,000	3.86	792,325.00	
	SAGE GROUP PLC (THE)	95,000	3.96	376,675.00	
	ARM HOLDINGS PLC	123,600	8.86	1,095,096.00	
	BT GROUP PLC	687,000	3.82	2,627,775.00	
	INMARSAT PLC	41,100	7.26	298,591.50	
	VODAFONE GROUP PLC	2,286,000	2.26	5,183,505.00	
	SSE PLC	83,400	15.11	1,260,174.00	
	CENTRICA PLC	445,000	3.18	1,417,325.00	
	NATIONAL GRID PLC	321,700	8.55	2,750,535.00	
	SEVERN TRENT PLC	20,300	18.65	378,595.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	61,000	8.22	501,725.00	
	3I GROUP PLC	89,000	3.81	339,624.00	
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	83,000	4.42	367,524.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,100	12.09	230,919.00	
	ICAP PLC	46,000	3.87	178,342.00	
	INVESTEC PLC	47,000	5.27	247,690.00	
	SCHRODERS PLC	9,000	26.02	234,180.00	
	CAPITA PLC	58,100	11.02	640,262.00	
	EXPERIAN PLC	86,000	10.49	902,140.00	
	INTERTEK GROUP PLC	13,700	30.27	414,699.00	
小計	銘柄数：102			147,648,116.89	
				(25,386,617,218)	
	組入時価比率：9.5%			9.9%	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	31,500	37.11	1,168,965.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	790	343.25	271,167.50	
	GIVAUDAN-REG	798	1,421.00	1,133,958.00	
	SIKA AG-BR	180	3,542.00	637,560.00	
	SYNGENTA AG	8,070	345.40	2,787,378.00	
	HOLCIM LTD-REG	20,000	77.05	1,541,000.00	
	GEBERIT AG-REG	3,340	300.00	1,002,000.00	
	ABB LTD	189,600	20.64	3,913,344.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	136.20	262,866.00	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,970	137.90	547,463.00	
	SULZER AG-REG	2,000	135.30	270,600.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,530	117.00	530,010.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	45,000	87.95	3,957,750.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,650	545.00	1,444,250.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	3,600	103.70	373,320.00	
	ARYZTA AG	7,910	83.30	658,903.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	190	1,223.00	232,370.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	76	4,420.00	335,920.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	9	52,850.00	475,650.00	
	NESTLE SA-REG	279,300	69.10	19,299,630.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,560	126.00	574,560.00	
	ACTELION LTD	8,900	84.70	753,830.00	
	NOVARTIS-REG	199,200	78.55	15,647,160.00	
	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	60,830	256.10	15,578,563.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	2,440	77.45	188,978.00	
	BALOISE HOLDING AG	4,090	107.90	441,311.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,930	217.30	636,689.00	
	SWISS RE LTD	30,500	78.30	2,388,150.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,920	256.80	3,317,856.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,500	74.35	334,575.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,020	530.50	1,071,610.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	131,600	27.11	3,567,676.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	19,800	41.20	815,760.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,560	237.10	369,876.00	
	UBS AG-REG	315,200	18.25	5,752,400.00	
	LONZA AG-REG	4,600	90.45	416,070.00	
	ADECCO SA-REG	11,200	71.50	800,800.00	
	SGS SA-REG	485	2,196.00	1,065,060.00	
小計	銘柄数：38			94,565,028.50	
				(10,872,141,326)	
	組入時価比率：4.1%			4.2%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	20,100	129.10	2,594,910.00	
	BOLIDEN AB	22,400	91.70	2,054,080.00	

	ASSA ABLOY AB-B	29,600	337.60	9,992,960.00
	SKANSKA AB-B SHS	32,900	148.80	4,895,520.00
	ALFA LAVAL AB	27,000	168.90	4,560,300.00
	ATLAS COPCO AB-A	59,100	191.20	11,299,920.00
	ATLAS COPCO AB-B	34,800	177.30	6,170,040.00
	SANDVIK AB	92,700	93.00	8,621,100.00
	SCANIA AB-B	27,100	199.20	5,398,320.00
	SKF AB-B SHARES	33,600	166.00	5,577,600.00
	VOLVO AB-B	132,600	99.80	13,233,480.00
	SECURITAS AB-B SHS	29,800	73.05	2,176,890.00
	ELECTROLUX AB-B	20,800	175.20	3,644,160.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	32,000	53.35	1,707,200.00
	HENNES&MAURITZ AB-B	81,700	267.90	21,887,430.00
	SWEDISH MATCH AB	17,400	221.60	3,855,840.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	50,400	180.80	9,112,320.00
	ELEKTA AB-B SHS	31,700	91.85	2,911,645.00
	GETINGE AB-B SHS	17,100	194.50	3,325,950.00
	NORDEA BANK AB	261,600	92.70	24,250,320.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	133,700	87.15	11,651,955.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	43,500	322.00	14,007,000.00
	SWEDBANK AB	79,000	166.60	13,161,400.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,700	128.00	1,497,600.00
	INVESTOR AB-B SHS	38,800	248.60	9,645,680.00
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	20,300	245.20	4,977,560.00
	ERICSSON LM-B	266,500	79.10	21,080,150.00
	HEXAGON AB-B SHS	20,000	213.00	4,260,000.00
	TELIA AB	203,000	48.37	9,819,110.00
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR- SDR	5,500	659.00	3,624,500.00
	TELE 2 AB-B SHS	28,400	85.90	2,439,560.00
小計	銘柄数：31			243,434,500.00 (3,775,669,095)
	組入時価比率：1.4%			1.5%
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	14,400	105.50	1,519,200.00
	SEADRILL LTD	33,500	208.70	6,991,450.00

	SUBSEA 7 SA	21,700	117.50	2,549,750.00	
	STATOIL ASA	96,600	185.40	17,909,640.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,700	273.90	4,300,230.00	
	NORSK HYDRO	116,000	32.21	3,736,360.00	
	ORKLA ASA	68,800	50.75	3,491,600.00	
	DNB ASA	84,700	108.00	9,147,600.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,200	112.70	1,938,440.00	
	TELENOR ASA	58,100	145.30	8,441,930.00	
小計	銘柄数：10			60,026,200.00	
				(1,035,451,950)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
デンマーク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	19,700	260.90	5,139,730.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	240	12,160.00	2,918,400.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	565	12,850.00	7,260,250.00	
	DSV A/S	16,200	178.50	2,891,700.00	
	CARLSBERG B	9,300	546.00	5,077,800.00	
	COLOPLAST-B	10,100	476.20	4,809,620.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,100	498.90	1,047,690.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	172,100	234.50	40,357,450.00	
	DANSKE BANK AS	56,400	152.90	8,623,560.00	
	TRYG A/S	2,300	504.00	1,159,200.00	
	TDC A/S	68,800	52.15	3,587,920.00	
小計	銘柄数：11			82,873,320.00	
				(1,558,018,416)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	18,000	16.45	296,100.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,400	22.47	278,628.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	96,900	15.20	1,472,880.00	
	SANTOS LTD.	84,600	14.20	1,201,320.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	56,500	41.25	2,330,625.00	
	INCITEC PIVOT LTD	143,000	2.82	403,260.00	
	ORICA LTD	32,600	22.03	718,178.00	
	BORAL LTD	67,000	5.40	361,800.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,900	13.63	502,947.00	
	AMCOR	107,000	10.45	1,118,150.00	

ALUMINA LTD	237,000	1.33	316,395.00
BHP BILLITON LIMITED	277,700	37.34	10,369,318.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,000	4.81	683,020.00
ILUKA RESOURCES LTD	37,800	8.65	326,970.00
NEWCREST MINING	64,000	10.41	666,240.00
RIO TINTO LTD	37,300	60.95	2,273,435.00
LEIGHTON HOLDINGS	14,300	20.05	286,715.00
BRAMBLES LTD	132,000	9.53	1,257,960.00
TOLL HLDGS	55,000	5.40	297,000.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	78,000	1.23	96,330.00
ASCIANO LTD	85,000	5.72	486,200.00
AURIZON HOLDINGS LTD	173,000	4.87	842,510.00
SYDNEY AIRPORT	97,900	4.30	420,970.00
TRANSURBAN GROUP	123,000	7.17	881,910.00
TRANSURBAN GROUP-RIGHTS	28,604	0.42	12,013.68
CROWN RESORTS LTD	35,100	15.82	555,282.00
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	78,000	2.89	225,420.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	50.39	262,028.00
TABCORP HOLDINGS	62,000	3.74	231,880.00
TATTS GROUP LTD	133,000	3.03	402,990.00
REA GROUP LTD	4,100	45.76	187,616.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,000	3.16	120,080.00
METCASH LTD	78,000	2.78	216,840.00
WESFARMERS LIMITED	98,500	42.86	4,221,710.00
WOOLWORTHS LIMITED	108,800	36.84	4,008,192.00
COCA-COLA AMATIL LTD	52,400	9.15	479,460.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	54,000	3.96	213,840.00
COCHLEAR LTD	5,300	59.12	313,336.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,800	45.67	493,236.00
SONIC HEALTHCARE LTD	33,900	17.90	606,810.00
CSL LIMITED	42,800	69.30	2,966,040.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	238,900	32.72	7,816,808.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	30,115	12.12	364,993.80
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,300	11.41	448,413.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	139,400	79.50	11,082,300.00

	NATIONAL AUSTRALIA BANK	204,500	34.38	7,030,710.00	
	WESTPAC BANKING CORP	268,800	34.94	9,391,872.00	
	ASX LTD	17,700	35.80	633,660.00	
	AMP LIMITED	259,000	5.25	1,359,750.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	196,000	5.79	1,134,840.00	
	QBE INSURANCE	105,100	11.63	1,222,313.00	
	SUNCORP GROUP LTD	113,800	13.00	1,479,400.00	
	COMPUTERSHARE LTD	41,000	12.46	510,860.00	
	TELSTRA CORP LTD	375,000	5.22	1,957,500.00	
	SP AUSNET	163,400	1.36	222,224.00	
	APA GROUP	75,500	6.91	521,705.00	
	AGL ENERGY LTD	47,200	15.94	752,368.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,800	60.12	1,490,976.00	
	ALS LTD	35,236	7.88	277,659.68	
	SEEK LTD	28,800	17.01	489,888.00	
	小計 銘柄数：60			91,593,875.16	
				(8,744,467,261)	
	組入時価比率：3.3%			3.4%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,000	9.32	577,840.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	88,110	4.08	359,488.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	30,000	8.68	260,400.00	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	148,000	2.62	388,500.00	
	CONTACT ENERGY LTD	31,800	5.48	174,264.00	
	小計 銘柄数：5			1,760,492.80	
				(154,870,551)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS LTD	42,500	27.00	1,147,500.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	186,000	97.50	18,135,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	135,500	13.32	1,804,860.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	14.34	1,534,380.00	
	MTR CORP	132,500	28.90	3,829,250.00	
	LI & FUNG LTD	493,600	10.90	5,380,240.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	62,000	22.75	1,410,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	180,000	58.50	10,530,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	78,000	25.65	2,000,700.00	

	SANDS CHINA LTD	208,000	55.60	11,564,800.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	130,333	12.76	1,663,049.08	
	SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	21.10	3,502,600.00	
	WYNN MACAU LTD	132,400	30.00	3,972,000.00	
	BANK OF EAST ASIA	110,860	32.65	3,619,579.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	314,500	22.20	6,981,900.00	
	HANG SENG BANK	67,300	124.60	8,385,580.00	
	FIRST PACIFIC CO	226,000	8.72	1,970,720.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	94,200	139.50	13,140,900.00	
	AIA GROUP LTD	1,039,400	37.50	38,977,500.00	
	CHEUNG KONG	120,000	125.80	15,096,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	192,000	22.30	4,281,600.00	
	HENDERSON LAND	96,866	45.55	4,412,246.30	
	HYSAN DEVELOPMENT	54,000	34.10	1,841,400.00	
	KERRY PROPERTIES	57,000	23.35	1,330,950.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	416,666	7.91	3,295,828.06	
	SINO LAND CO.LTD	256,000	11.06	2,831,360.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	95.80	13,316,200.00	
	SWIRE PACIFIC-A	61,500	90.75	5,581,125.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	100,800	23.25	2,343,600.00	
	WHARF(HOLDING)	134,000	51.05	6,840,700.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	77,000	31.20	2,402,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	89.00	1,949,100.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	220,000	8.42	1,852,400.00	
	PCCW LTD	386,000	4.18	1,613,480.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	56,000	51.95	2,909,200.00	
	CLP HLDGS	150,500	61.65	9,278,325.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	118,000	67.25	7,935,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	502,194	17.48	8,778,351.12	
小計	銘柄数：38			237,440,823.56	
				(3,124,721,238)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	141,000	3.84	541,440.00	
ドル	KEPPEL CORP.	123,700	10.67	1,319,879.00	



	SEMBCORP INDUSTRIES	83,040	5.40	448,416.00	
	SEMBCORP MARINE	72,600	3.97	288,222.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	1.10	179,300.00	
	NOBLE GROUP LTD	352,481	1.25	440,601.25	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	50,040	10.21	510,908.40	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	167,000	2.04	340,680.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	524,600	1.33	697,718.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	146,000	4.20	613,200.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	9,000	43.53	391,770.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	113,000	2.23	251,990.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	615,320	0.59	363,038.80	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	160,000	3.21	513,600.00	
	DBS GROUP HLDGS	148,000	17.08	2,527,840.00	
	OCBC-ORD	220,000	9.75	2,145,000.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	111,000	22.45	2,491,950.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	74,000	6.98	516,520.00	
	CAPITALAND LIMITED	232,000	3.07	712,240.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	118,000	2.20	259,600.00	
	CITY DEVELOPMENT	37,000	10.91	403,670.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	264,000	2.75	726,000.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	54,000	3.43	185,220.00	
	UOL GROUP LIMITED	38,700	6.63	256,581.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	683,000	3.83	2,615,890.00	
	STARHUB LTD	61,000	4.16	253,760.00	
小計	銘柄数：26			19,995,034.45	
				(1,631,594,811)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
新シェケル	DELEK GROUP LTD	300	1,478.00	443,400.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	43,100	30.48	1,313,688.00	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	210	1,973.00	414,330.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	73,900	171.30	12,659,070.00	
	BANK HAPOALIM BM	93,000	19.94	1,854,420.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,000	13.59	1,562,850.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,000	46.40	417,600.00	

	NICE SYSTEMS LTD	5,300	133.30	706,490.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	165,000	6.39	1,054,350.00	
	小計 銘柄数：9			20,426,198.00	
				(602,777,102)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
合計				257,335,568,632	
				(257,335,568,632)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成26年 5月12日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額/口数	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST		312,120.00	
	小計	銘柄数：1		312,120.00	
		組入時価比率：0.0%		(31,842,482)	
				0.5%	
合計			31,842,482		
				(31,842,482)	
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	33,900	783,090.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	65,590	860,540.80	
		AMERICAN TOWER CORP	34,500	3,058,425.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	85,000	987,700.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,540	1,468,538.20	
		BOSTON PROPERTIES	13,400	1,600,362.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,600	541,728.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	28,800	2,224,512.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,800	624,996.00	
		DUKE REALTY CORP	28,600	501,644.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,900	1,847,521.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,400	973,836.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,800	688,924.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	47,100	1,112,973.00	
		HCP INC	40,100	1,688,611.00	

	HEALTH CARE REIT INC	25,600	1,648,384.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	64,400	1,380,092.00	
	KIMCO REALTY CORP	34,800	791,004.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	12,500	474,125.00	
	MACERICH CO /THE	12,200	803,736.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	16,200	713,934.00	
	PROLOGIS INC	43,900	1,808,680.00	
	PUBLIC STORAGE	12,530	2,150,649.20	
	RAYONIER INC	11,800	540,558.00	
	REALTY INCOME CORP	16,900	739,882.00	
	REGENCY CENTERS CORP	8,700	468,321.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	26,760	4,700,394.00	
	SL GREEN REALTY CORP	8,200	889,618.00	
	UDR INC	20,900	565,763.00	
	VENTAS INC	25,800	1,748,208.00	
	VORNADO REALTY TRUST	14,400	1,518,912.00	
	WEYERHAEUSER CO	49,700	1,505,910.00	
小計	銘柄数：32	852,320	41,411,571.20	
			(4,224,808,493)	
	組入時価比率：1.6%		71.2%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	10,500	243,915.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	12,400	338,892.00	
小計	銘柄数：2	22,900	582,807.00	
			(54,556,563)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	
ユーロ	CORIO NV	5,400	193,671.00	
	FONCIERE DES REGIONS	2,500	185,625.00	
	GECINA SA	1,730	173,086.50	
	ICADE	3,000	212,670.00	
	KLEPIERRE	8,900	305,270.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	8,400	1,699,740.00	
小計	銘柄数：6	29,930	2,770,062.50	
			(388,667,469)	
	組入時価比率：0.1%		6.5%	
英ポンド	BRITISH LAND	80,000	570,000.00	

小計	HAMMERSON PLC	59,000	344,855.00	
	INTU PROPERTIES PLC	77,000	232,617.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	68,000	742,560.00	
	SEGRO PLC	70,800	257,499.60	
	銘柄数：5 組入時価比率：0.1%	354,800	2,147,531.60 (369,246,583) 6.2%	
豪ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	199,200	408,360.00	
	DEXUS PROPERTY GROUP	398,000	441,780.00	
	FEDERATION CENTRES	132,200	325,212.00	
	GOODMAN GROUP	143,000	720,720.00	
	GPT GROUP	148,000	586,080.00	
	LEND LEASE GROUP	48,000	630,240.00	
	MIRVAC GROUP	302,000	525,480.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	197,000	754,510.00	
	WESTFIELD GROUP	171,400	1,863,118.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	251,000	808,220.00	
小計	銘柄数：10 組入時価比率：0.3%	1,989,800	7,063,720.00 (674,373,348) 11.3%	
香港ドル	LINK REIT	206,000	7,889,800.00	
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	206,000	7,889,800.00 (103,829,768) 1.7%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	187,000	441,320.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	199,000	319,395.00	
	CAPITAMALL TRUST	219,900	441,999.00	
	小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.0%	605,900	1,202,714.00 (98,141,462) 1.7%
合計			5,913,623,686 (5,913,623,686)	
合計			5,945,466,168 (5,945,466,168)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成26年 5月12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	4,098,798,826	-	4,129,430,303	30,631,477
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	902,617,768	-	902,253,200	364,568
米ドル	520,774,818	-	522,291,200	1,516,382
カナダドル	18,693,460	-	18,720,000	26,540
ユーロ	197,934,680	-	196,420,000	1,514,680
英ポンド	68,939,520	-	68,772,000	167,520
スイスフラン	29,035,025	-	28,740,000	295,025
スウェーデンクローナ	9,346,800	-	9,300,000	46,800
豪ドル	14,311,935	-	14,319,000	7,065
香港ドル	35,434,530	-	35,532,000	97,470
シンガポールドル	8,147,000	-	8,159,000	12,000
合計	-	-	-	30,996,045

### (注) 時価の算定方法

#### 1 先物取引

##### 外国先物取引について

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

#### 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成26年 5月12日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	37,007,853
国債証券	6,290,280,500
未収入金	20,916,200
未収利息	20,312,992
前払費用	487,800
流動資産合計	6,369,005,345
資産合計	6,369,005,345
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	19,523,245
流動負債合計	19,523,245
負債合計	19,523,245
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	5,120,703,874
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,228,778,226
元本等合計	6,349,482,100
純資産合計	6,349,482,100
負債純資産合計	6,369,005,345

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
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。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 5月12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	1,240円
(10,000口当たり純資産額)	(12,400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25年 5月11日 至 平成26年 5月12日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成26年 5月12日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>国債証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成26年 5月12日現在	
期首	平成25年 5月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	5,073,594,490円
同期中における追加設定元本額	677,287,985円
同期中における一部解約元本額	630,178,601円

期末元本額	5,120,703,874円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	532,888,613円
バランスセレクト50	648,933,930円
バランスセレクト70	234,733,108円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	21,481,824円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	44,476,446円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	13,315,201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）	3,541,574,954円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	77,175,084円
野村DC運用戦略ファンドM	6,124,714円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成26年 5月12日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(平成26年 5月12日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第331回	30,000,000	30,007,500	
		国庫債券 利付(2年)第332回	40,000,000	40,013,200	
		国庫債券 利付(2年)第333回	10,000,000	10,003,500	
		国庫債券 利付(2年)第334回	20,000,000	20,007,400	
		国庫債券 利付(2年)第336回	30,000,000	30,012,300	
		国庫債券 利付(2年)第337回	30,000,000	30,010,500	
		国庫債券 利付(2年)第338回	50,000,000	50,018,000	
		国庫債券 利付(5年)第89回	30,000,000	30,107,100	
		国庫債券 利付(5年)第90回	70,000,000	70,172,900	
		国庫債券 利付(5年)第91回	20,000,000	20,087,800	
		国庫債券 利付(5年)第92回	40,000,000	40,121,600	
		国庫債券 利付(5年)第94回	50,000,000	50,420,000	
		国庫債券 利付(5年)第95回	50,000,000	50,484,500	
		国庫債券 利付(5年)第97回	30,000,000	30,201,300	



国庫債券 利付(5年)第98回	10,000,000	10,046,100	
国庫債券 利付(5年)第99回	60,000,000	60,443,400	
国庫債券 利付(5年)第100回	50,000,000	50,252,000	
国庫債券 利付(5年)第101回	40,000,000	40,321,600	
国庫債券 利付(5年)第102回	70,000,000	70,381,500	
国庫債券 利付(5年)第103回	40,000,000	40,232,800	
国庫債券 利付(5年)第104回	50,000,000	50,149,000	
国庫債券 利付(5年)第105回	50,000,000	50,146,500	
国庫債券 利付(5年)第106回	40,000,000	40,113,200	
国庫債券 利付(5年)第107回	40,000,000	40,107,200	
国庫債券 利付(5年)第110回	20,000,000	20,126,200	
国庫債券 利付(5年)第111回	40,000,000	40,405,600	
国庫債券 利付(5年)第113回	50,000,000	50,315,500	
国庫債券 利付(5年)第114回	20,000,000	20,125,400	
国庫債券 利付(5年)第115回	60,000,000	60,116,400	
国庫債券 利付(5年)第116回	60,000,000	60,082,200	
国庫債券 利付(40年)第1回	10,000,000	11,666,900	
国庫債券 利付(40年)第2回	10,000,000	11,155,200	
国庫債券 利付(40年)第3回	10,000,000	11,150,900	
国庫債券 利付(40年)第4回	15,000,000	16,718,100	
国庫債券 利付(40年)第5回	18,000,000	19,046,160	
国庫債券 利付(40年)第6回	20,000,000	20,574,800	
国庫債券 利付(10年)第270回	42,000,000	42,566,160	
国庫債券 利付(10年)第271回	30,000,000	30,371,400	
国庫債券 利付(10年)第272回	30,000,000	30,537,300	
国庫債券 利付(10年)第273回	45,000,000	45,866,700	
国庫債券 利付(10年)第274回	30,000,000	30,684,300	
国庫債券 利付(10年)第275回	25,000,000	25,530,250	
国庫債券 利付(10年)第277回	37,000,000	38,041,920	
国庫債券 利付(10年)第278回	33,000,000	34,051,050	

国庫債券 利付(10年)第280回	22,000,000	22,842,160
国庫債券 利付(10年)第281回	35,000,000	36,413,300
国庫債券 利付(10年)第282回	45,000,000	46,712,250
国庫債券 利付(10年)第283回	20,000,000	20,808,000
国庫債券 利付(10年)第284回	75,000,000	78,145,500
国庫債券 利付(10年)第285回	68,000,000	71,100,800
国庫債券 利付(10年)第286回	30,000,000	31,576,800
国庫債券 利付(10年)第287回	50,000,000	52,782,500
国庫債券 利付(10年)第288回	65,000,000	68,463,850
国庫債券 利付(10年)第289回	100,000,000	104,969,000
国庫債券 利付(10年)第290回	50,000,000	52,432,000
国庫債券 利付(10年)第291回	20,000,000	20,896,200
国庫債券 利付(10年)第292回	45,000,000	47,705,850
国庫債券 利付(10年)第293回	30,000,000	32,030,700
国庫債券 利付(10年)第294回	40,000,000	42,544,400
国庫債券 利付(10年)第295回	25,000,000	26,386,500
国庫債券 利付(10年)第296回	65,000,000	68,780,400
国庫債券 利付(10年)第297回	40,000,000	42,246,800
国庫債券 利付(10年)第298回	20,000,000	21,032,000
国庫債券 利付(10年)第299回	45,000,000	47,422,800
国庫債券 利付(10年)第300回	35,000,000	37,220,750
国庫債券 利付(10年)第301回	45,000,000	47,990,250

回			
国庫債券 利付(10年)第302回	10,000,000	10,614,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	45,000,000	47,872,800	
国庫債券 利付(10年)第304回	30,000,000	31,756,200	
国庫債券 利付(10年)第305回	70,000,000	74,224,500	
国庫債券 利付(10年)第306回	35,000,000	37,374,050	
国庫債券 利付(10年)第307回	30,000,000	31,861,800	
国庫債券 利付(10年)第308回	30,000,000	31,902,600	
国庫債券 利付(10年)第309回	40,000,000	42,055,600	
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	31,377,600	
国庫債券 利付(10年)第311回	20,000,000	20,668,400	
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	74,126,500	
国庫債券 利付(10年)第313回	60,000,000	63,962,400	
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	31,578,900	
国庫債券 利付(10年)第315回	30,000,000	31,766,700	
国庫債券 利付(10年)第316回	10,000,000	10,519,600	
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	31,545,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	40,000,000	41,774,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	30,000,000	31,537,800	
国庫債券 利付(10年)第320回	50,000,000	52,194,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	30,000,000	31,298,400	
国庫債券 利付(10年)第322回	30,000,000	31,070,400	

回			
国庫債券 利付(10年)第323回	20,000,000	20,703,400	
国庫債券 利付(10年)第324回	50,000,000	51,347,500	
国庫債券 利付(10年)第325回	70,000,000	71,827,700	
国庫債券 利付(10年)第326回	40,000,000	40,659,600	
国庫債券 利付(10年)第327回	40,000,000	40,989,600	
国庫債券 利付(10年)第328回	70,000,000	70,443,800	
国庫債券 利付(10年)第329回	70,000,000	71,578,500	
国庫債券 利付(10年)第330回	40,000,000	40,853,200	
国庫債券 利付(10年)第331回	30,000,000	30,093,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	50,000,000	50,068,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	10,000,000	9,995,300	
国庫債券 利付(30年)第3回	10,000,000	11,705,800	
国庫債券 利付(30年)第5回	10,000,000	11,494,300	
国庫債券 利付(30年)第7回	5,000,000	5,784,750	
国庫債券 利付(30年)第8回	10,000,000	10,722,400	
国庫債券 利付(30年)第9回	20,000,000	20,088,800	
国庫債券 利付(30年)第10回	10,000,000	9,502,900	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	10,467,900	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	11,108,200	
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	10,914,400	
国庫債券 利付(30年)第14回	10,000,000	11,580,200	
国庫債券 利付(30年)第15回	10,000,000	11,734,700	
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	11,714,500	
国庫債券 利付(30年)第17回	10,000,000	11,534,400	
国庫債券 利付(30年)第18回	20,000,000	22,703,400	
国庫債券 利付(30年)第19回	10,000,000	11,345,800	
国庫債券 利付(30年)第20回	10,000,000	11,692,900	

国庫債券 利付(30年)第21回	10,000,000	11,323,700
国庫債券 利付(30年)第22回	10,000,000	11,684,000
国庫債券 利付(30年)第23回	10,000,000	11,679,200
国庫債券 利付(30年)第24回	21,000,000	24,515,400
国庫債券 利付(30年)第25回	20,000,000	22,586,200
国庫債券 利付(30年)第26回	20,000,000	22,965,200
国庫債券 利付(30年)第27回	20,000,000	23,358,000
国庫債券 利付(30年)第28回	20,000,000	23,369,400
国庫債券 利付(30年)第29回	20,000,000	23,005,400
国庫債券 利付(30年)第30回	20,000,000	22,630,000
国庫債券 利付(30年)第31回	20,000,000	22,244,600
国庫債券 利付(30年)第32回	30,000,000	34,026,600
国庫債券 利付(30年)第33回	30,000,000	32,135,100
国庫債券 利付(30年)第34回	30,000,000	33,411,900
国庫債券 利付(30年)第35回	32,000,000	34,239,680
国庫債券 利付(30年)第36回	30,000,000	32,095,200
国庫債券 利付(30年)第37回	30,000,000	31,418,100
国庫債券 利付(30年)第38回	20,000,000	20,466,200
国庫債券 利付(30年)第39回	20,000,000	20,921,200
国庫債券 利付(30年)第40回	10,000,000	10,225,800
国庫債券 利付(30年)第41回	20,000,000	19,980,200
国庫債券 利付(20年)第33回	20,000,000	21,747,600
国庫債券 利付(20年)第37回	30,000,000	32,996,700
国庫債券 利付(20年)第41回	30,000,000	31,911,300
国庫債券 利付(20年)第42回	10,000,000	11,168,700
国庫債券 利付(20年)第43回	10,000,000	11,439,200
国庫債券 利付(20年)第44回	10,000,000	11,316,600
国庫債券 利付(20年)第45回	10,000,000	11,258,900
国庫債券 利付(20年)第46回	5,000,000	5,588,100
国庫債券 利付(20年)第47回	15,000,000	16,814,250
国庫債券 利付(20年)第49回	20,000,000	22,402,800
国庫債券 利付(20年)第52回	25,000,000	28,097,000
国庫債券 利付(20年)第53回	10,000,000	11,266,700
国庫債券 利付(20年)第54回	10,000,000	11,340,600
国庫債券 利付(20年)第55回	10,000,000	11,205,200

国庫債券 利付(20年)第56回	10,000,000	11,224,700
国庫債券 利付(20年)第57回	10,000,000	11,146,400
国庫債券 利付(20年)第58回	10,000,000	11,158,300
国庫債券 利付(20年)第59回	10,000,000	11,007,900
国庫債券 利付(20年)第60回	10,000,000	10,755,600
国庫債券 利付(20年)第61回	10,000,000	10,406,000
国庫債券 利付(20年)第62回	10,000,000	10,225,500
国庫債券 利付(20年)第63回	10,000,000	11,107,500
国庫債券 利付(20年)第64回	10,000,000	11,210,900
国庫債券 利付(20年)第65回	10,000,000	11,226,200
国庫債券 利付(20年)第66回	20,000,000	22,259,800
国庫債券 利付(20年)第67回	10,000,000	11,240,300
国庫債券 利付(20年)第68回	10,000,000	11,525,400
国庫債券 利付(20年)第69回	30,000,000	34,296,300
国庫債券 利付(20年)第70回	10,000,000	11,736,600
国庫債券 利付(20年)第71回	10,000,000	11,540,300
国庫債券 利付(20年)第72回	20,000,000	22,913,000
国庫債券 利付(20年)第73回	30,000,000	34,084,800
国庫債券 利付(20年)第74回	10,000,000	11,466,700
国庫債券 利付(20年)第75回	10,000,000	11,481,100
国庫債券 利付(20年)第76回	17,000,000	19,163,250
国庫債券 利付(20年)第77回	15,000,000	17,060,850
国庫債券 利付(20年)第78回	10,000,000	11,282,500
国庫債券 利付(20年)第79回	10,000,000	11,386,000
国庫債券 利付(20年)第80回	10,000,000	11,495,400
国庫債券 利付(20年)第81回	10,000,000	11,391,200
国庫債券 利付(20年)第82回	15,000,000	17,254,050
国庫債券 利付(20年)第83回	15,000,000	17,262,750
国庫債券 利付(20年)第84回	10,000,000	11,395,000
国庫債券 利付(20年)第85回	13,000,000	14,966,770
国庫債券 利付(20年)第86回	10,000,000	11,737,800
国庫債券 利付(20年)第88回	20,000,000	23,504,400
国庫債券 利付(20年)第91回	10,000,000	11,752,400
国庫債券 利付(20年)第93回	20,000,000	22,796,200
国庫債券 利付(20年)第94回	20,000,000	23,042,800

国庫債券 利付(20年)第95回	10,000,000	11,764,800	
国庫債券 利付(20年)第96回	15,000,000	17,271,300	
国庫債券 利付(20年)第97回	10,000,000	11,639,800	
国庫債券 利付(20年)第99回	20,000,000	23,020,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	20,000,000	23,259,000	
国庫債券 利付(20年)第101回	20,000,000	23,782,000	
国庫債券 利付(20年)第102回	20,000,000	23,783,600	
国庫債券 利付(20年)第103回	15,000,000	17,638,800	
国庫債券 利付(20年)第104回	10,000,000	11,494,400	
国庫債券 利付(20年)第105回	20,000,000	22,992,200	
国庫債券 利付(20年)第106回	10,000,000	11,630,300	
国庫債券 利付(20年)第107回	20,000,000	22,964,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	20,000,000	22,422,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	10,000,000	11,199,800	
国庫債券 利付(20年)第110回	20,000,000	22,933,400	
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	11,597,200	
国庫債券 利付(20年)第112回	35,000,000	40,103,700	
国庫債券 利付(20年)第113回	40,000,000	45,795,200	
国庫債券 利付(20年)第114回	30,000,000	34,314,900	
国庫債券 利付(20年)第115回	10,000,000	11,580,500	
国庫債券 利付(20年)第116回	10,000,000	11,570,400	
国庫債券 利付(20年)第118回	10,000,000	11,261,800	
国庫債券 利付(20年)第119回	10,000,000	10,972,500	

国庫債券 利付(20年)第120回	25,000,000	26,691,500
国庫債券 利付(20年)第122回	20,000,000	21,894,800
国庫債券 利付(20年)第123回	10,000,000	11,371,900
国庫債券 利付(20年)第124回	40,000,000	44,896,400
国庫債券 利付(20年)第125回	10,000,000	11,506,300
国庫債券 利付(20年)第126回	10,000,000	11,199,700
国庫債券 利付(20年)第127回	20,000,000	22,101,400
国庫債券 利付(20年)第128回	20,000,000	22,049,000
国庫債券 利付(20年)第129回	20,000,000	21,749,000
国庫債券 利付(20年)第130回	20,000,000	21,692,200
国庫債券 利付(20年)第131回	15,000,000	16,042,500
国庫債券 利付(20年)第132回	10,000,000	10,664,600
国庫債券 利付(20年)第133回	20,000,000	21,649,400
国庫債券 利付(20年)第134回	10,000,000	10,794,700
国庫債券 利付(20年)第135回	15,000,000	15,950,100
国庫債券 利付(20年)第136回	15,000,000	15,720,150
国庫債券 利付(20年)第137回	10,000,000	10,609,400
国庫債券 利付(20年)第138回	10,000,000	10,285,500
国庫債券 利付(20年)第139回	10,000,000	10,447,200
国庫債券 利付(20年)第140回	30,000,000	31,707,600
国庫債券 利付(20年)第141回	10,000,000	10,536,000
国庫債券 利付(20年)第143回	10,000,000	10,336,800



	回			
	国庫債券 利付（20年）第144回	10,000,000	10,171,800	
	国庫債券 利付（20年）第145回	30,000,000	31,403,700	
	国庫債券 利付（20年）第146回	30,000,000	31,298,700	
	国庫債券 利付（20年）第147回	40,000,000	40,946,800	
小計	銘柄数：233 組入時価比率：99.1%	5,928,000,000	6,290,280,500 100.0%	
合計			6,290,280,500	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成26年 5月12日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,591,416,131
コール・ローン	914,609,102
国債証券	289,180,036,761
派生商品評価勘定	2,235,065
未収入金	672,973,333
未収利息	3,143,501,736
前払費用	163,068,109
流動資産合計	295,667,840,237
資産合計	295,667,840,237
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,491,182
未払金	373,862,217
未払解約金	2,040,619,994
その他未払費用	3,999,600
流動負債合計	2,419,972,993
負債合計	2,419,972,993
純資産の部	
元本等	
元本	141,638,321,997
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	151,609,545,247
元本等合計	293,247,867,244

(平成26年 5月12日現在)

純資産合計	293,247,867,244
負債純資産合計	295,667,840,237

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 5月12日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0704円
(10,000口当たり純資産額)	(20,704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25年 5月11日 至 平成26年 5月12日	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 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26年 5月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成26年 5月12日現在	
期首	平成25年 5月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	157,271,997,364円
同期中における追加設定元本額	26,182,965,787円
同期中における一部解約元本額	41,816,641,154円
期末元本額	141,638,321,997円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	87,043,565円
バランスセレクト50	96,928,875円
バランスセレクト70	70,179,481円
野村外国債券インデックスファンド	291,182,675円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,860,388,804円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	40,609,317,520円

野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,932,004,399円
野村資産設計ファンド2015	94,916,929円
野村資産設計ファンド2020	63,618,816円
野村資産設計ファンド2025	56,021,922円
野村資産設計ファンド2030	44,993,280円
野村資産設計ファンド2035	30,735,611円
野村資産設計ファンド2040	95,929,065円
野村外国債券インデックス(野村投資一任口座向け)	13,087,861,682円
のむラップ・ファンド(保守型)	1,823,057,254円
のむラップ・ファンド(普通型)	1,762,426,014円
のむラップ・ファンド(積極型)	734,130,603円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	1,744,930,510円
野村資産設計ファンド2045	3,336,450円
野村インデックスファンド・外国債券	223,598,022円
マイ・ロード	5,099,009,430円
ネクストコア	654,098,746円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	11,907,946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)	62,654,324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)	11,300,762,771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)	1,107,430,549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)	16,410,415,285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)	3,112,268,263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)	10,669,088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)	40,887,651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)	7,798,366円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	9,418,685,693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)	732,348,938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)	2,628,617,074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)	347,716,840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)	96,994,520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)	292,876,665円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	2,561,432,761円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,335,640,863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)	2,128,190,484円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,503,311円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	6,640,930円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	3,990,683円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	493,466,657円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,485,193,841円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	1,993,519,893円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	1,858,801,423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)	10,205,867,863円
マイバランスDC30	724,697,205円
マイバランスDC50	386,892,615円
マイバランスDC70	221,486,107円
野村DC外国債券インデックスファンド	1,457,565,555円
野村DC運用戦略ファンド	707,020,526円
野村DC運用戦略ファンドM	10,842,944円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成26年 5月12日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(平成26年 5月12日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	4,000,000.00	4,584,218.40	
		US TREASURY BOND	9,400,000.00	10,689,194.96	
		US TREASURY BOND	7,000,000.00	8,205,038.80	
		US TREASURY BOND	5,000,000.00	6,176,367.00	
		US TREASURY BOND	3,500,000.00	4,690,273.35	
		US TREASURY BOND	3,200,000.00	4,239,499.84	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,804,531.20	
		US TREASURY BOND	3,700,000.00	5,188,382.72	
		US TREASURY BOND	4,500,000.00	5,918,906.25	
		US TREASURY BOND	4,200,000.00	5,588,625.00	
		US TREASURY BOND	1,300,000.00	1,811,976.53	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,729,218.60	
		US TREASURY BOND	3,500,000.00	4,543,710.85	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,541,093.60	
		US TREASURY BOND	2,200,000.00	2,582,250.00	
		US TREASURY BOND	1,600,000.00	1,427,500.00	
		US TREASURY BOND	3,700,000.00	3,906,968.75	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,404,296.00	
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,007,226.50	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,211,328.00	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,028,125.00	
		US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,239,530.80	
		US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,017,772.30	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,196,484.00	
		US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,620,624.40	
		US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,157,694.90	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,028,515.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,194,491.70			
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,009,375.00			

US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,139,570.20	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,648,046.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,162,070.20	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,001,523.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,001,093.60	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,367,968.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,088,945.20	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	11,280,526.95	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,207,617.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,196,171.80	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,995,117.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,005,859.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,751,620.85	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,249,921.70	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,002,343.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,989,257.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,133,710.90	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,757,187.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,233,906.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,108,750.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,006,835.50	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,476,249.60	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,022,694.70	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,611,328.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,788,436.80	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,509,413.50	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,042,500.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,029,218.40	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,580,078.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,492,187.20	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,699,179.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,423,749.60	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,017,109.30	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,671,875.00	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,033,085.50	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,580,428.90	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,619,531.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,022,500.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,995,507.50	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,630,351.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,601,523.10	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,542,382.50	

US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,450,312.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,243,750.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,955,312.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,357,812.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,971,874.40	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,142,773.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,278,906.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,888,749.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,137,890.50	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,980,858.70	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,458,749.60	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,913,046.80	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,212,500.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,954,218.40	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,423,046.50	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,346,875.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,961,718.60	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,916,875.00	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,912,500.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,253,593.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,005,859.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,182,421.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,999,765.40	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,660,000.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,022,500.00	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,969,062.50	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,077,343.60	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,010,937.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,945,117.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,969,335.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,994,531.00	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,438,125.00	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	11,187,968.22	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,986,250.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,981,718.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,005,000.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,941,483.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,932,109.20	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	10,097,000.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,803,906.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,022,811.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,844,687.20	

US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,180,311.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,825,156.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,726,249.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,979,062.40	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,004,687.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,371,875.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,987,343.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	981,093.70	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,461,601.40	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,087,890.50	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	12,067,343.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,964,687.20	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,831,795.90	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,443,554.05	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	8,829,843.30	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,377,968.75	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,731,405.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,532,500.00	
US TREASURY N/B	8,200,000.00	7,684,616.88	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,469,311.84	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	8,627,155.56	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,968,202.30	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,111,562.50	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,252,374.88	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,249,218.75	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	4,187,968.75	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,585,038.80	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	4,036,210.85	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,390,507.70	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	7,060,780.80	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,547,109.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,414,374.40	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	9,028,843.75	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	9,009,609.18	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,730,312.50	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,253,437.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,161,288.90	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,504,609.28	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,058,398.35	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,487,500.00	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,317,093.68	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,304,749.76	



小計	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,547,812.50	
	US TREASURY NOTE	7,500,000.00	8,299,511.25	
	US TREASURY NOTE	7,000,000.00	7,433,671.70	
	銘柄数：158 組入時価比率：37.7%	1,029,900,000.00	1,084,405,524.53 (110,631,051,612) 38.3%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	2,800,000.00	2,817,332.00	
	CANADA GOVERNMENT	2,000,000.00	2,093,520.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	500,075.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,147,000.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,153,850.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,204,380.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,238,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,633,490.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	504,625.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,020,620.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,904,236.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	906,543.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,293,552.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,556,312.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,669,868.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,307,670.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,080,027.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,855,736.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,278,290.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,442,934.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,417,990.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,933,572.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,493,558.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	3,735,550.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	9,112,938.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	722,856.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,689,450.00	
小計	銘柄数：27 組入時価比率：2.3%	64,400,000.00	71,714,374.00 (6,713,182,550) 2.3%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,000,000.00	13,330,200.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,000,000.00	26,616,250.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	27,000,000.00	28,233,900.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	16,000,000.00	17,218,400.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	15,306,000.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	37,000,000.00	40,798,050.00	

	MEX BONOS DESARR FIX RT	19,000,000.00	18,898,350.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	31,000,000.00	35,347,750.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,000,000.00	26,411,250.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	6,302,034.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	18,381,132.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,000,000.00	48,851,000.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	4,753,352.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	16,612,500.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	61,626,200.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,000,000.00	8,220,324.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	16,000,000.00	18,449,600.00
小計	銘柄数：17	360,000,000.00	405,356,292.00 (3,194,207,580)
	組入時価比率：1.1%		1.1%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,049,900.00
	BELGIUM KINGDOM	4,300,000.00	4,984,289.10
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,239,730.00
	BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	4,028,150.00
	BELGIUM KINGDOM	2,800,000.00	3,372,600.00
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,074,500.00
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	2,100,520.00
	BELGIUM KINGDOM	2,300,000.00	2,876,495.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,000,000.00	2,098,000.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,800,000.00	4,070,180.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,800,000.00	3,092,180.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,000,000.00	3,507,300.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,500,000.00	2,828,125.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,700,000.00	3,111,750.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	4,200,000.00	5,729,430.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	6,300,000.00	8,476,946.10
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,138,780.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,200,000.00	5,412,160.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,257,100.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,148,200.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,800,000.00	4,008,240.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,545,870.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	5,061,430.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,134,935.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,114,400.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,395,600.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	527,950.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000.00	5,169,600.00

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,900,000.00	4,428,840.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,706,100.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,332,330.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000.00	5,458,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,722,100.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	5,082,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,391,950.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,800,000.00	6,762,800.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,493,635.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,600,000.00	4,570,200.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,924,080.00
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,045,620.00
BUNDES OblIGATION	5,000,000.00	5,248,450.00
BUNDES OblIGATION	4,000,000.00	4,106,200.00
BUNDES OblIGATION	2,500,000.00	2,517,500.00
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	1,992,300.00
BUNDES OblIGATION	2,100,000.00	2,151,135.00
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,022,650.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,177,400.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	7,388,430.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,413,250.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	6,569,100.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	9,012,400.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	6,813,000.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	6,033,300.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,759,250.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,321,425.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,500,000.00	5,147,775.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,676,250.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,085,200.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	7,184,560.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,275,600.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,184,000.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,200,000.00	2,251,260.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,746,980.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	3,247,360.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	3,587,000.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	5,762,400.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	6,187,600.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	4,340,700.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	4,670,400.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	4,698,880.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	4,905,883.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,300,000.00	5,563,598.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	4,092,336.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000.00	4,557,806.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,600,000.00	3,083,925.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,090,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,200,000.00	5,330,364.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,500,000.00	12,963,250.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,062,360.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	4,227,320.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,028,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000.00	11,699,600.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,358,240.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,400,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,536,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,660,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,700,000.00	8,685,600.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,613,250.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,806,400.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,486,990.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,625,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,194,930.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,609,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,900,000.00	6,694,730.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	5,067,450.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	6,158,160.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,000,000.00	6,760,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,453,090.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	3,831,450.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	983,250.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,300,000.00	3,601,950.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,100,000.00	7,052,210.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,400,000.00	5,163,840.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	4,843,600.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000.00	5,559,560.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,628,480.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	4,626,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	10,575,600.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,832,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,522,150.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	7,425,300.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,100,000.00	8,127,640.00

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,939,530.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	6,599,450.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,600,000.00	7,263,760.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,833,700.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	5,541,770.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,500,000.00	7,680,400.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,900,000.00	8,094,390.00
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,046,800.00
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	824,440.00
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,232,300.00
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	613,650.00
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	945,280.00
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,709,925.00
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,731,900.00
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,195,860.00
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,911,200.00
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	428,520.00
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	518,975.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	7,805,625.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,001,000.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,000,000.00	7,415,100.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,700,000.00	9,711,810.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	8,253,750.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,700,000.00	8,712,165.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	5,679,000.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,500,000.00	2,544,875.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,800,000.00	6,722,490.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,030,800.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	8,783,250.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,500,000.00	4,933,425.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,924,600.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,800,000.00	7,788,040.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,523,800.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000.00	7,591,675.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,400,000.00	7,273,920.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	5,921,955.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	4,217,600.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	7,864,000.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,700,000.00	10,599,210.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000.00	9,113,325.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,800,000.00	8,899,800.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,051,500.00

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,200,000.00	8,620,170.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,900,000.00	7,188,790.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,329,000.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,800,000.00	5,839,200.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,100,000.00	9,372,355.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	800,000.00	854,440.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,492,200.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,400,000.00	1,750,490.00
FRENCH TREASURY NOTE	3,500,000.00	3,573,500.00
FRENCH TREASURY NOTE	5,200,000.00	5,390,840.00
FRENCH TREASURY NOTE	3,000,000.00	3,149,700.00
FRENCH TREASURY NOTE	4,000,000.00	4,160,200.00
FRENCH TREASURY NOTE	2,000,000.00	2,039,900.00
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	1,500,000.00	1,731,225.00
IRISH GOVERNMENT	2,800,000.00	3,024,140.00
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	928,760.00
IRISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,298,500.00
IRISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,237,000.00
IRISH GOVERNMENT	2,300,000.00	2,677,660.00
IRISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,798,050.00
IRISH GOVERNMENT	2,500,000.00	3,097,250.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,590,075.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	1,993,000.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,868,550.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,800,000.00	1,907,730.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	5,654,000.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	514,650.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	4,911,890.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,200,000.00	1,232,460.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,800,000.00	3,259,760.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,800,000.00	3,222,940.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,100,000.00	3,534,930.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	638,970.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	4,148,900.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,300,000.00	3,436,660.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,418,200.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,022,300.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,000,000.00	4,224,900.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,200,000.00	5,378,524.20
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,000,000.00	3,800,760.00
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,557,750.00
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,200,000.00	2,393,600.00

	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,622,712.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,613,600.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	3,872,550.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,750,400.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,600,000.00	3,010,800.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,753,500.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,306,000.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,956,750.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	3,406,295.40
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,800,000.00	4,900,100.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	787,500.00
	REPUBLIC OF IRELAND	1,400,000.00	1,568,630.00
	SPANISH GOVERNMENT	4,300,000.00	4,895,335.00
	SPANISH GOVERNMENT	5,100,000.00	6,585,885.00
	SPANISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,871,500.00
	SPANISH GOVERNMENT	4,400,000.00	4,671,040.00
小計	銘柄数：212	790,400,000.00	918,845,564.30 (128,923,221,126)
	組入時価比率：44.0%		44.6%
英ポンド	UK TREASURY	3,000,000.00	3,167,100.00
	UK TREASURY	5,000,000.00	5,105,500.00
	UK TREASURY	5,300,000.00	5,674,180.00
	UK TREASURY	2,900,000.00	2,946,690.00
	UK TREASURY	1,800,000.00	2,227,140.00
	UK TREASURY	4,000,000.00	3,947,600.00
	UK TREASURY	4,500,000.00	5,076,450.00
	UK TREASURY	4,600,000.00	4,512,140.00
	UK TREASURY	4,700,000.00	5,272,930.00
	UK TREASURY	900,000.00	889,290.00
	UK TREASURY	3,900,000.00	4,249,050.00
	UK TREASURY	3,700,000.00	4,241,310.00
	UK TREASURY	3,700,000.00	4,042,620.00
	UK TREASURY	2,400,000.00	3,294,720.00
	UK TREASURY	4,000,000.00	4,377,600.00
	UK TREASURY	3,900,000.00	4,339,530.00
	UK TREASURY	2,900,000.00	2,727,740.00
	UK TREASURY	4,600,000.00	4,438,080.00
	UK TREASURY	3,900,000.00	4,701,450.00
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,612,110.00
	UK TREASURY	2,100,000.00	2,823,870.00
	UK TREASURY	3,200,000.00	3,844,480.00
	UK TREASURY	3,400,000.00	3,863,760.00

	UK TREASURY	1,900,000.00	2,230,600.00
	UK TREASURY	4,300,000.00	4,895,120.00
	UK TREASURY	3,300,000.00	4,063,290.00
	UK TREASURY	3,400,000.00	3,894,020.00
	UK TREASURY	1,850,000.00	2,123,615.00
	UK TREASURY	6,800,000.00	8,170,200.00
	UK TREASURY	3,200,000.00	3,730,880.00
	UK TREASURY	2,600,000.00	3,061,760.00
	UK TREASURY	2,400,000.00	2,576,160.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	2,800,000.00	2,703,120.00
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,400,000.00	7,654,400.00
小計	銘柄数：34	119,650,000.00	133,478,505.00 (22,950,294,149)
	組入時価比率：7.8%		7.9%
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	5,900,000.00	6,664,640.00
	SWITZERLAND GOVERNMENT	1,000,000.00	1,366,900.00
小計	銘柄数：2	6,900,000.00	8,031,540.00 (923,386,153)
	組入時価比率：0.3%		0.3%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	5,000,000.00	5,246,500.00
	SWEDISH GOVERNMENT	10,000,000.00	10,510,500.00
	SWEDISH GOVERNMENT	13,000,000.00	14,203,800.00
	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	18,293,600.00
	SWEDISH GOVERNMENT	25,000,000.00	30,408,750.00
	SWEDISH GOVERNMENT	7,200,000.00	8,143,200.00
	SWEDISH GOVERNMENT	9,500,000.00	9,159,900.00
	SWEDISH GOVERNMENT	9,800,000.00	11,386,620.00
小計	銘柄数：8	95,500,000.00	107,352,870.00 (1,665,043,013)
	組入時価比率：0.6%		0.6%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,700,000.00	15,208,620.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	11,300,000.00	12,138,912.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	11,153,500.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,700,000.00	11,628,760.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	7,592,800.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,087,200.00
小計	銘柄数：6	58,700,000.00	61,809,792.00 (1,066,218,912)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	4,000,000.00	4,238,400.00
	KINGDOM OF DENMARK	15,500,000.00	16,415,275.00
	KINGDOM OF DENMARK	12,000,000.00	13,545,480.00
	KINGDOM OF DENMARK	16,000,000.00	18,834,400.00



小計	KINGDOM OF DENMARK	20,500,000.00	23,197,800.00		
	KINGDOM OF DENMARK	4,000,000.00	3,998,000.00		
	KINGDOM OF DENMARK	8,000,000.00	12,347,200.00		
	KINGDOM OF DENMARK	24,500,000.00	34,459,250.00		
	銘柄数：8	104,500,000.00	127,035,805.00	(2,388,273,134)	
	組入時価比率：0.8%		0.8%		
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,148,200.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,814,200.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,737,250.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,300,000.00	4,468,130.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	3,963,400.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,276,000.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,075,000.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	962,500.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,502,500.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,258,300.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,958,500.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,600,000.00	5,226,267.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	3,811,400.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,338,780.00		
	小計	銘柄数：14	54,500,000.00	57,540,427.00	(1,932,782,942)
	組入時価比率：0.7%		0.7%		
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,750,405.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,540,590.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,748,380.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,078,800.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	3,149,110.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,543,900.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,922,000.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	4,772,040.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,126,680.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,532,000.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,098,750.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,411,800.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,022,500.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,458,815.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	894,750.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,322,230.00		
	小計	銘柄数：16	46,200,000.00	49,372,750.00	(4,713,616,442)

	組入時価比率：1.6%		1.6%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,544,100.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,614,375.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,481,930.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,265,350.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	856,800.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,061,690.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	999,400.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	287,970.00
小計	銘柄数：8	12,200,000.00	13,111,615.00 (1,069,907,784)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,681,360.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	7,847,840.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,451,850.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,165,900.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	998,550.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,000,000.00	9,312,750.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	4,970,560.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,727,910.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,023,820.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,670,600.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,670,634.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	568,623.60
小計	銘柄数：12	47,800,000.00	48,090,397.60 (1,516,290,236)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,400,000.00	13,773,377.60
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,000,000.00	15,289,906.50
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,000,000.00	16,681,088.50
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	20,000,000.00	18,895,282.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,000,000.00	6,901,752.90
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	33,000,000.00	39,167,224.80
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,000,000.00	6,856,000.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	31,500,000.00	23,926,804.65
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,500,000.00	4,963,014.55
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,000,000.00	4,920,916.50
小計	銘柄数：10	156,400,000.00	151,375,368.00 (1,492,561,128)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
合計			289,180,036,761 (289,180,036,761)

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成26年 5月12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	1,158,868,783	-	1,158,124,900	743,883
米ドル	441,307,094	-	442,723,400	1,416,306
カナダドル	27,215,534	-	27,144,000	71,534
メキシコペソ	7,850,200	-	7,870,000	19,800
ユーロ	530,844,426	-	528,931,000	1,913,426
英ポンド	96,420,280	-	96,280,800	139,480
スイスフラン	11,544,000	-	11,496,000	48,000
スウェーデンクローナ	7,801,300	-	7,750,000	51,300
ズロチ	5,048,325	-	5,037,000	11,325
豪ドル	19,055,880	-	19,091,000	35,120
リングギ	4,409,019	-	4,414,200	5,181
ランド	7,372,725	-	7,387,500	14,775
合計	1,158,868,783	-	1,158,124,900	743,883

(注) 時価の算定方法

### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## バランスセレクト70

平成26年 5月30日現在

資産総額	1,489,186,322円
負債総額	1,592,125円
純資産総額（ - ）	1,487,594,197円
発行済口数	1,167,210,434口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2745円

## （参考）国内株式マザーファンド

平成26年 5月30日現在

資産総額	198,858,712,138円
負債総額	17,953,875,693円
純資産総額（ - ）	180,904,836,445円
発行済口数	167,935,791,937口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0772円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成26年 5月30日現在

資産総額	271,955,675,466円
負債総額	943,979,055円
純資産総額（ - ）	271,011,696,411円
発行済口数	149,013,676,696口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8187円

## （参考）国内債券マザーファンド

平成26年 5月30日現在

資産総額	6,607,786,540円
負債総額	178,471,772円
純資産総額（ - ）	6,429,314,768円
発行済口数	5,172,335,751口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2430円

## （参考）外国債券マザーファンド

平成26年 5月30日現在

資産総額	293,909,670,288円
負債総額	841,199,422円
純資産総額（ - ）	293,068,470,866円
発行済口数	141,783,736,000口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0670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26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。

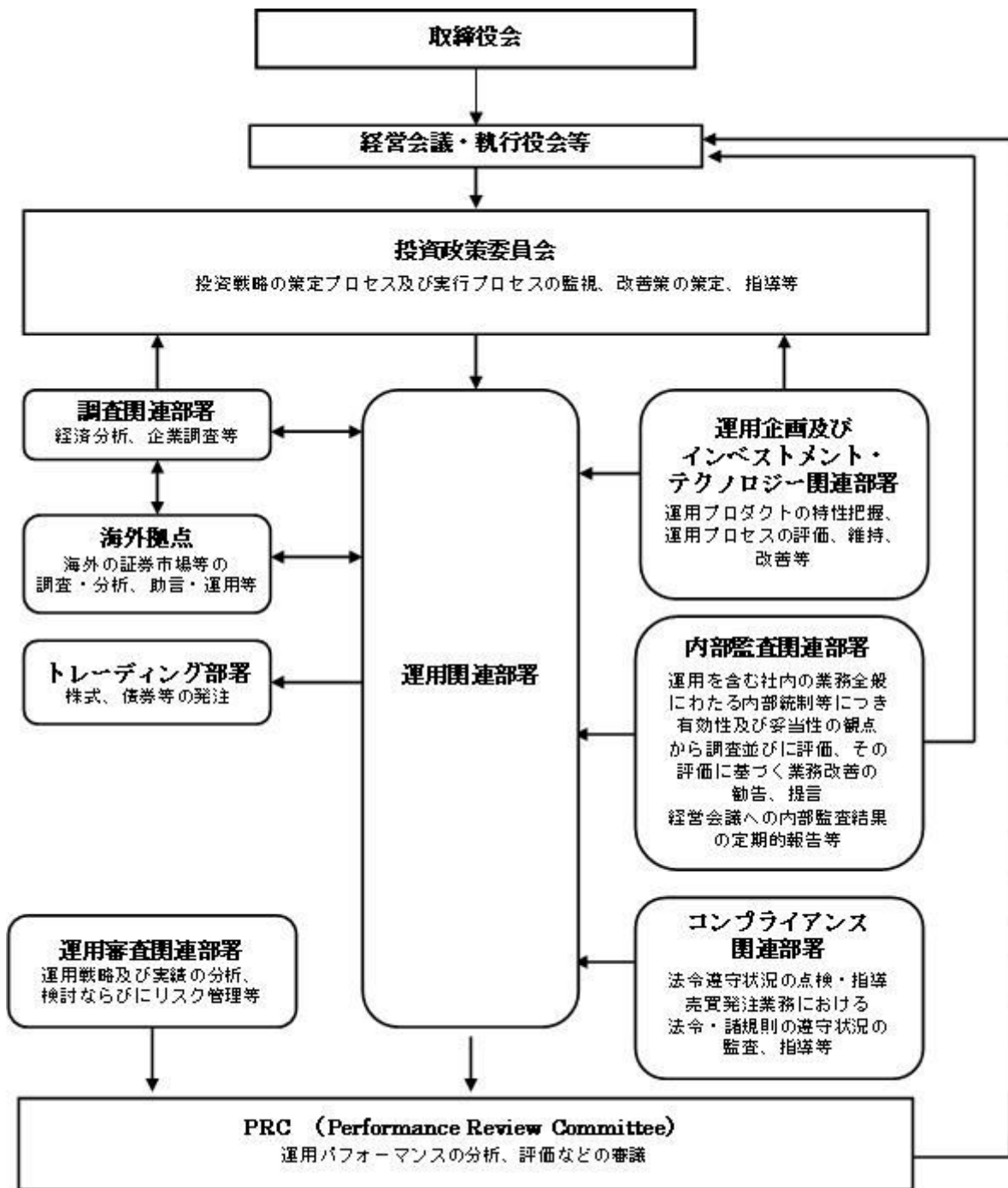
###### 代表執行役・執行役

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26年5月30日現在次の通りです（ただし、親投資信託を除きます。）。

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	812	13,895,732



単位型株式投資信託	44	234,703
追加型公社債投資信託	18	6,143,470
単位型公社債投資信託	37	445,590
合計	911	20,719,495

### 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。

なお、当事業年度(平成25年4月1日から平成26年3月31日まで)の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」(平成24年9月21日内閣府令第61号)附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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25年4月1日から平成26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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		333	247
金銭の信託		51,061	51,758
有価証券		4,500	11,800
前払金		-	0
前払費用		29	28
未収入金		271	287
未収委託者報酬		8,651	10,741
未収収益		4,224	5,999
繰延税金資産		1,504	2,010
その他		12	159
貸倒引当金		6	8
流動資産計		70,582	83,026
固定資産			
有形固定資産		1,470	1,508

建物	2	485		442	
器具備品	2	985		1,065	
無形固定資産			8,458		8,249
ソフトウェア		8,457		8,248	
電話加入権		1		1	
その他		0		0	
投資その他の資産			21,443		22,052
投資有価証券		9,061		11,747	
関係会社株式		12,092		9,609	
従業員長期貸付金		29		35	
長期差入保証金		55		50	
長期前払費用		19		80	
前払年金費用		-		347	
その他		184		181	
貸倒引当金		0		0	
固定資産計			31,373		31,810
資産合計			101,956		114,837

区分	注記 番号	前事業年度 (平成25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
流動負債					
短期借入金			3,000		-
関係会社短期借入金			2,000		-
預り金			102		106
未払金	1		6,481		9,720
未払収益分配金		3		2	
未払償還金		42		33	
未払手数料		3,764		4,493	
その他未払金		2,671		5,191	
未払費用	1		6,979		8,420
未払法人税等			763		1,960
賞与引当金			3,109		3,984
流動負債計			22,436		24,191
固定負債					
退職給付引当金			813		-
時効後支払損引当金			495		505
繰延税金負債			1,640		3,211
固定負債計			2,948		3,716
負債合計			25,385		27,907
<b>(純資産の部)</b>					
株主資本					
資本金			71,942		80,249
資本剰余金			17,180		17,180
資本準備金		11,729		11,729	
利益剰余金			43,032		51,339
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		42,347		50,654	
別途積立金		24,606		24,606	

繰越利益剰余金		17,740		26,048	
評価・換算差額等			4,628		6,679
その他有価証券評価差額金			4,659		6,679
繰延ヘッジ損益			30		-
純資産合計			76,570		86,929
負債・純資産合計			101,956		114,837

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			74,067		87,258
運用受託報酬			17,516		24,589
その他営業収益			163		188
営業収益計			91,747		112,036
営業費用					
支払手数料			37,925		44,194
広告宣伝費			768		793
公告費			0		0
受益証券発行費			5		6
調査費			16,591		20,794
調査費		1,138		1,250	
委託調査費		15,453		19,544	
委託計算費			903		941
営業雑経費			2,616		2,926
通信費		199		188	
印刷費		1,057		948	
協会費		76		76	
諸経費		1,282		1,712	
営業費用計			58,810		69,656
一般管理費					
給料			10,039		11,091
役員報酬	2	229		292	
給料・手当		6,696		6,823	
賞与		3,114		3,975	
交際費			122		131
旅費交通費			446		454
租税公課			289		387
不動産賃借料			1,242		1,212
退職給付費用			1,067		1,069
固定資産減価償却費			4,106		3,518
諸経費			6,273		6,596
一般管理費計			23,589		24,460
営業利益			9,347		17,919

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)		当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26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	3,002		3,680	
収益分配金		0		0	
受取利息		2		3	
金銭の信託運用益		1,016		379	
為替差益		43		-	
その他		331		336	
営業外収益計			4,396		4,400
営業外費用					
支払利息	1	56		11	
時効後支払損引当金繰入額		9		24	
その他		78		132	
営業外費用計			145		169
経常利益			13,598		22,151
特別利益					
投資有価証券等売却益		59		-	
株式報酬受入益		160		203	
固定資産売却益		10		-	
特別利益計			230		203
特別損失					
投資有価証券売却損		60		-	
投資有価証券償還損		-		51	
投資有価証券評価損		9		2	
関係会社株式評価損		2,916		2,491	
固定資産除却損	3	118		17	
特別損失計			3,105		2,562
税引前当期純利益			10,723		19,792
法人税、住民税及び事業税			3,765		7,608
法人税等調整額			446		90
当期純利益			6,510		12,273

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		

当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	14,320	39,611	68,521
当期変動額								
剰余金の配当						3,090	3,090	3,090
当期純利益						6,510	6,510	6,510
株主資本以外の 項目の当期 変動額（純 額）								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	3,420	3,420	3,420
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	17,740	43,032	71,942

(単位：百万円)

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,693	12	2,705	71,227
当期変動額				
剰余金の配当				3,090
当期純利益				6,510
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	1,965	43	1,922	1,922
当期変動額合計	1,965	43	1,922	5,342
当期末残高	4,659	30	4,628	76,570

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	17,740	43,032	71,942
当期変動額								
剰余金の配当						3,966	3,966	3,966
当期純利益						12,273	12,273	12,273
株主資本以外 項目の当期 変動額（純 額）								

当期変動額合計	-	-	-	-	-	8,307	8,307	8,307
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249

(単位：百万円)

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,659	30	4,628	76,570
当期変動額				
剰余金の配当				3,966
当期純利益				12,273
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	2,020	30	2,051	2,051
当期変動額合計	2,020	30	2,051	10,358
当期末残高	6,679	-	6,679	86,929

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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  (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								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、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。 <table style="margin-left: 20px;"> <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> (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。	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								
4. 引当金の計上基準	(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。  (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>5 . 消費税等の会計処理方法</p> <p>6 . 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金          従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。          退職給付見込額の期間帰属方法          退職給付の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。          数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法          確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。          退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金          時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	--

## [未適用の会計基準等]

<p>「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）</p>	
(1) 概要	<p>未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充等について改正されました。</p>
(2) 適用予定日	<p>退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用します。          なお、当該会計基準等には経過的な取り扱いが定められているため、過去の期間の財務諸表に対しては遡及適用しません。</p>
(3) 当該会計基準等の適用による影響	<p>退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中でありです。</p>

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成25年3月31日)		当事業年度末 (平成26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。		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。	
未払金	2,368百万円	未払金	4,601百万円
未払費用	1,584	未払費用	1,607

2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額		2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	
建物	518百万円	建物	565百万円
器具備品	2,524	器具備品	2,849
合計	3,043	合計	3,414

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
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。 受取配当金 2,922百万円 支 払 利 息 44	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。 受取配当金 3,568百万円 支 払 利 息 5
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。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損 建物 5百万円 器具備品 23 ソ フ ト ウ エ 89 ア 合計 118	3. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 6 ソ フ ト ウ エ 11 ア 合計 17

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25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

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

## (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25年 5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 3,966百万円

配当の原資 利益剰余金



1株当たり配当額	770円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月21日

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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25年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

##### 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	3,966百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	770円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月21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26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

##### 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	10,043百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,950円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月2日

#### 金融商品関係

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25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、自ら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及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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25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	333	333	-
(2)金銭の信託	51,061	51,061	-
(3)未収委託者報酬	8,651	8,651	-
(4)有価証券及び投資有価証券			
其他有価証券	12,678	12,678	-
(5)関係会社株式	3,064	104,822	101,758
資産計	75,789	177,548	101,758
(6)短期借入金	3,000	3,000	-
(7)関係会社短期借入金	2,000	2,000	-
(8)未払金	6,481	6,481	-
未払収益分配金	3	3	-
未払償還金	42	42	-
未払手数料	3,764	3,764	-
其他未払金	2,671	2,671	-
(9)未払費用	6,979	6,979	-
(10)未払法人税等	763	763	-
負債計	19,224	19,224	-
(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	3	3	-
デリバティブ取引計	3	3	-

(\*) 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)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。

## (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。

## (4) 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。

## (5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

## (6) 短期借入金、(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883百万円、関係会社株式9,028百万円）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2,916百万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	333	-	-	-
金銭の信託	51,061	-	-	-
未収委託者報酬	8,651	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	4,500	-	-	-

合計	64,547	-	-	-
----	--------	---	---	---

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金銭信託を通じ保有しております。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、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

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

### （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金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26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	247	247	-
(2)金銭の信託	51,758	51,758	-
(3)未収委託者報酬	10,741	10,741	-
(4)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	22,467	22,467	-
(5)関係会社株式	3,064	141,441	138,377

資産計	88,278	226,656	138,377
(6)未払金	9,720	9,720	-
未払収益分配金	2	2	-
未払償還金	33	33	-
未払手数料	4,493	4,493	-
その他未払金	5,191	5,191	-
(7)未払費用	8,420	8,420	-
(8)未払法人税等	1,960	1,960	-
負債計	20,100	20,100	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金、(3)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。

(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。

(4) 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。

(5) 関係会社株式

取引所の価格によります。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等(貸借対照表計上額：投資有価証券1,080百万円、関係会社株式6,545百万円)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。なお、当事業年度において、非上場株式について2,494百万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	247	-	-	-
金銭の信託	51,758	-	-	-
未収委託者報酬	10,741	-	-	-
有価証券	11,800	-	-	-
合計	74,547	-	-	-

## 有価証券関係

前事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成25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25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25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	104,822	101,758
合計	3,064	104,822	101,758

## 4．その他有価証券(平成25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	7,534	282	7,251
小計	7,534	282	7,251
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 )	644	645	0
譲渡性預金	4,500	4,500	-
小計	5,144	5,145	0
合計	12,678	5,427	7,250

- ( 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300万円（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24年4月1日至平成25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	21	6	-
投資信託	708	-	60
合計	730	6	60

## 当事業年度(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

## 1. 売買目的有価証券(平成26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26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26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	141,441	138,377
合計	3,064	141,441	138,377

## 4. その他有価証券(平成26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	10,667	282	10,384
小計	10,667	282	10,384
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	11,800	11,800	-
小計	11,800	11,800	-
合計	22,467	12,082	10,384

## 5. 事業年度中に売却したその他有価証券(自平成25年4月1日至平成26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	-	-	-
投資信託	761	-	51
合計	761	-	51

(注) 投資信託の「売却額」及び「売却損の合計額」は償還によるものであります。

## 退職給付関係

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 退職給付債務に関する事項(平成25年 3月31日)	
イ. 退職給付債務	15,209百万円
ロ. 年金資産	12,456
ハ. 未積立退職給付債務(イ + ロ)	2,752
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	2,471
ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額)	532
ト. 貸借対照表計上額純額(ハ + ニ + ホ + ヘ)	813
チ. 前払年金費用	
リ. 退職給付引当金(ト - チ)	813
3. 退職給付費用に関する事項(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	
イ. 勤務費用	608百万円
ロ. 利息費用	251
ハ. 期待運用収益	237
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	304
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)	885
チ. その他(注)	170
計	1,055
(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	1.5%
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25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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



## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	15,209 百万円
勤務費用	750
利息費用	228
数理計算上の差異の発生額	25
退職給付の支払額	494
その他	11
退職給付債務の期末残高	15,680

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	12,456 百万円
期待運用収益	311
数理計算上の差異の発生額	428
事業主からの拠出額	2,065
退職給付の支払額	475
年金資産の期末残高	14,786

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

積立型制度の退職給付債務	13,485 百万円
年金資産	14,786
	1,301
非積立型制度の退職給付債務	2,194
未積立退職給付債務	893
未認識数理計算上の差異	1,733
未認識過去勤務費用	492
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	347
前払年金費用	347
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	347

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	750 百万円
利息費用	228
期待運用収益	311
数理計算上の差異の費用処理額	284
過去勤務費用の費用処理額	40
その他	12
確定給付制度に係る退職給付費用	899

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	30%
株式	18%
受益証券等	14%
生保一般勘定	19%
その他	19%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.6%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、170百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (平成25年3月31日)	当事業年度末 (平成26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
関係会社株式評価減 1,050	関係会社株式評価減 1,947
賞与引当金 1,181	賞与引当金 1,434
所有株式税務簿価通算差異 776	所有株式税務簿価通算差異 776
投資有価証券評価減 501	投資有価証券評価減 502
未払事業税 184	未払事業税 425
ゴルフ会員権評価減 408	ゴルフ会員権評価減 408
減価償却超過額 208	減価償却超過額 206
時効後支払損引当金 178	時効後支払損引当金 181
子会社株式売却損 172	子会社株式売却損 172
未払社会保険料 90	未払社会保険料 100
退職給付引当金 292	退職給付引当金 -
繰延ヘッジ損失 18	繰延ヘッジ損失 -
その他 124	その他 126
繰延税金資産小計 5,189	繰延税金資産小計 6,284
評価性引当金 2,704	評価性引当金 3,602
繰延税金資産計 2,485	繰延税金資産計 2,681
繰延税金負債	繰延税金負債
有価証券評価差額金 2,620	有価証券評価差額金 3,757
前払年金費用 -	前払年金費用 125
繰延税金負債計 2,620	繰延税金負債計 3,882
繰延税金負債(純額) 135	繰延税金負債(純額) 1,200
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 38.0%	法定実効税率 38.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.5%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.4%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 10.1%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 6.7%
住民税等均等割 0.0%	住民税等均等割 0.0%
タックスヘイブン税制 2.1%	タックスヘイブン税制 1.4%
外国税額控除 0.0%	外国税額控除 0.3%
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 0.5%
関係会社株式評価減 10.3%	関係会社株式評価減 4.7%
その他 1.6%	その他 0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 39.2%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 37.9%

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について、前事業年度の38%から36%に変更されております。この変更により、繰延税金負債の純額が111百万円増加し、法人税等調整額（貸方）は111百万円減少しております。

## セグメント情報等

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品・サービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

##### 売上高

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

##### 有形固定資産

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

#### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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24年4月1日 至 平成25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)	59,500	短期借入金	2,000
							資金の返済	66,000		
							借入金利息の支払	44	未払費用	0

##### (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(*2)	4,433	未払費用	706

##### (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出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3)	30,983	未払手数料	3,105

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 (*4)	1,941	未払費用	827
親会社の子会社	野村信託銀行株式会社	東京都千代田区	30,000 (百万円)	信託銀行業		資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任	資金の借入(*1)	3,000	短期借入金	3,000
							借入金利息の支払	12	未払費用	-

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) 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) 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。

(\*3) 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。

(\*4) 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	173,289
固定資産合計	239,585
流動負債合計	119,860
固定負債合計	20,742
純資産合計	272,272
売上高	337,340
税引前当期純利益	34,116
当期純利益	21,546

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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)	8,000	短期借入金	-
							資金の返済	10,000		
							借入金利息の支払	5	未払費用	-

## (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 21.5%	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(*2)	5,073	未払費用	716

## (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(*3)	36,867	未払手数料	3,854
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(*4)	1,959	未払費用	760
親会社の子会社	野村信託銀行株式会社	東京都千代田区	30,000 (百万円)	信託銀行業		資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任	資金の返済	3,000	短期借入金	-
							借入金利息の支払	6	未払費用	-

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\* 1) 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) 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。

(\* 3) 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。

(\* 4) 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、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	191,892
固定資産合計	249,548
流動負債合計	84,950
固定負債合計	55,262
純資産合計	301,227
売上高	355,777
税引前当期純利益	47,854
当期純利益	28,759

1株当たり情報

前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,866円12銭	1株当たり純資産額	16,877円25銭
1株当たり当期純利益	1,264円08銭	1株当たり当期純利益	2,382円87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	6,510百万円	損益計算書上の当期純利益	12,273百万円
普通株式に係る当期純利益	6,510百万円	普通株式に係る当期純利益	12,273百万円
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。		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。	
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。)

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
野村信託銀行株式会社	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26年5月末現在



## (2)販売会社

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

\* 平成26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】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

## (1) 受託者

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。
- (2) 目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。
- (3) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

- (4) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5) 目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (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ことがあります。
- (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ことがあります。
- (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ことがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成26年6月6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 岩部俊夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 湯原尚

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25年4月1日から平成26年3月31日までの第55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26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) 1. 上記は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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成26年6月23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	岩 部 俊 夫
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25年5月11日から平成26年5月12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26年5月12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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。