

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年7月30日提出
【計算期間】	第14期(自 平成26年5月13日至 平成27年5月11日)
【ファンド名】	バランスセレクト70
【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
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

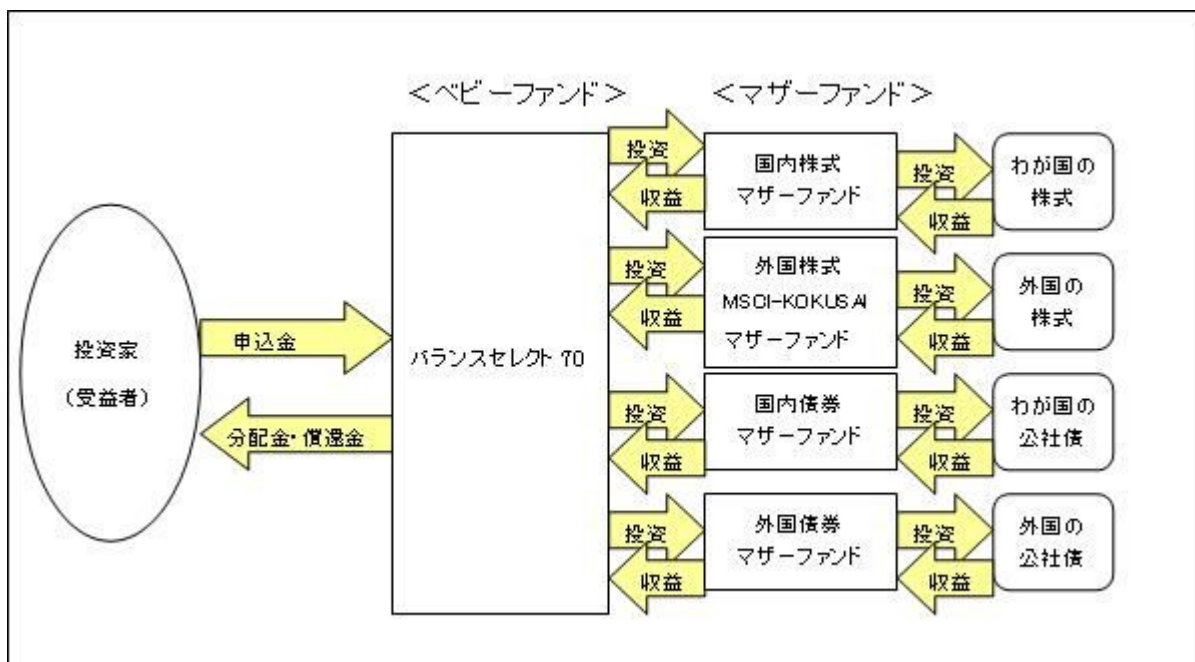
## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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	
		不動産投信	特殊型
	<b>内外</b>	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</b> <b>(日本を含む)</b>			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	<b>ファミリーファンド</b>	あり ( )	
債券	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	<b>なし</b>	<b>その他</b> <b>(合成指数)</b>
<b>その他資産</b> <b>(投資信託証券</b> <b>(資産複合(株式、</b> <b>債券)資産配分固</b> <b>定型))</b>		アフリカ			
		中近東 (中東)			
資産複合 ( ) 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〕

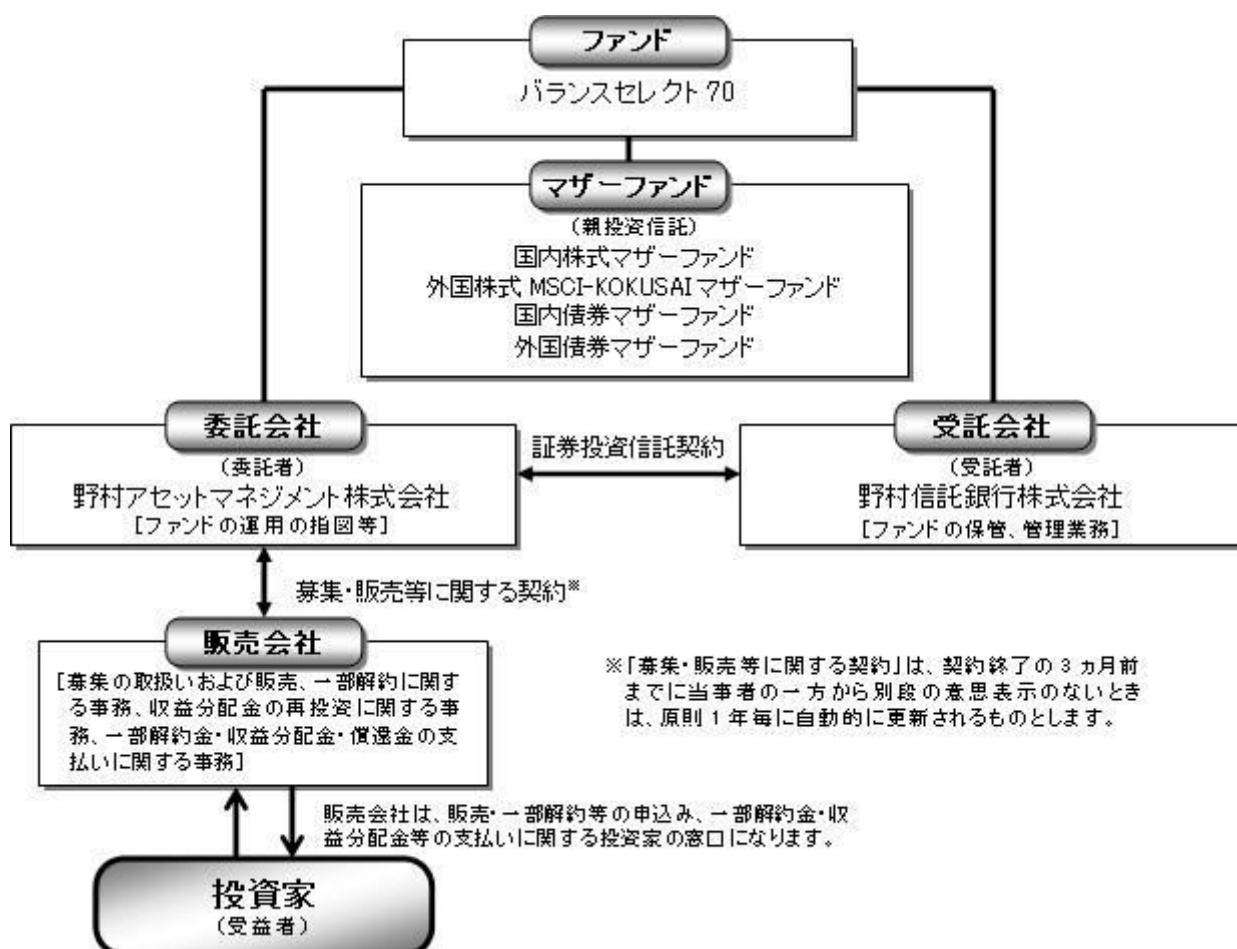
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

## (2)【ファンドの沿革】

平成13年5月11日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】



委託会社の概況(平成27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商号を変更
平成12年(2000年)11月1日	野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更
平成15年(2003年)6月27日	委員会等設置会社へ移行

## ・ 大株主の状況

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%

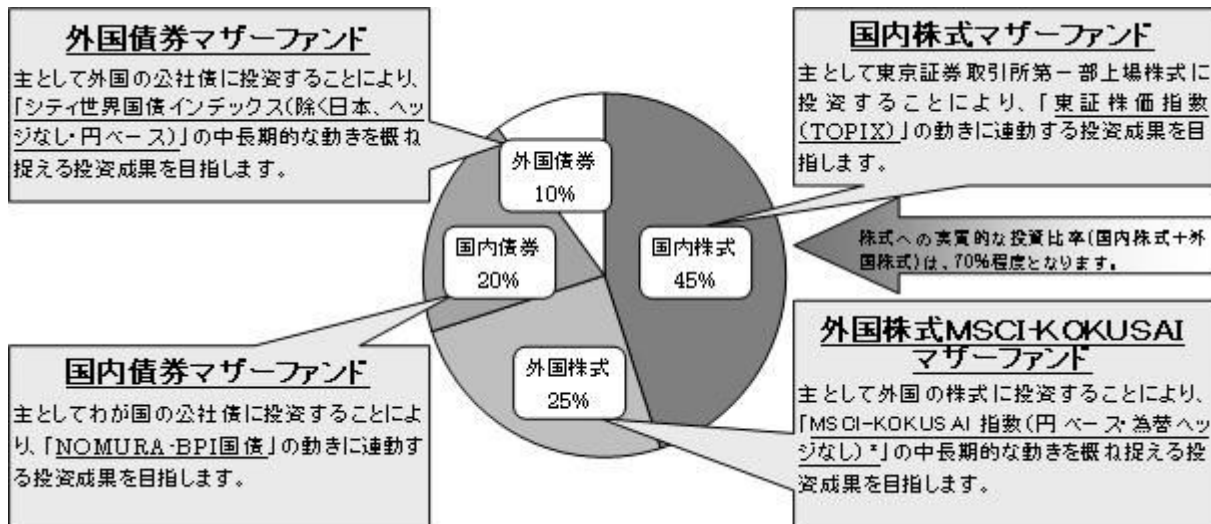
## 2【投資方針】

## (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。

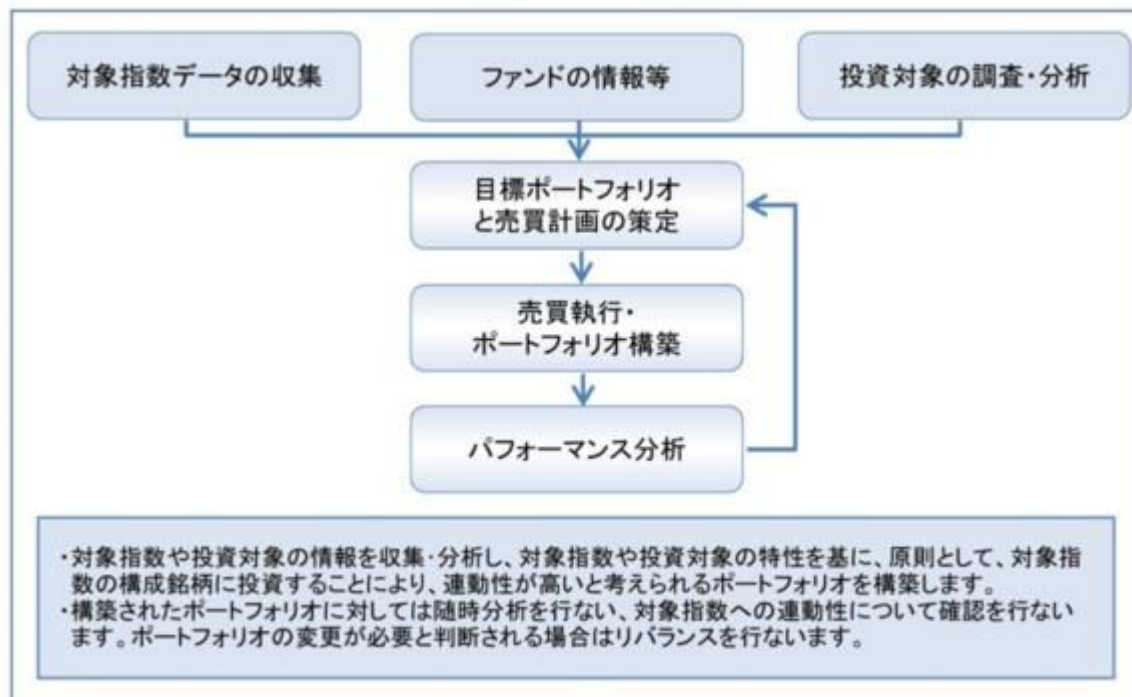
運用にあたっては、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券に投資を行ないます。

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。

## ■投資プロセス■



\* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 各マザーファンドが対象とするインデックスについて

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、野村證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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、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、Citigroup Index LLC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、Citigroup Index LLC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、Citigroup Index LLC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ます。)に係る権利

八 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

二 金銭債権（イ及び八に掲げるものに該当するものを除きます。）

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

有価証券の指図範囲(約款第21条第1項)

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

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

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

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

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

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

1 株券または新株引受権証書

2 国債証券

3 地方債証券

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

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

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

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

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

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

10 コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17 外国法人が発行する譲渡性預金証書

18 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

20 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券

に限ります。)

21 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

金融商品の指図範囲(約款第21条第2項)

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

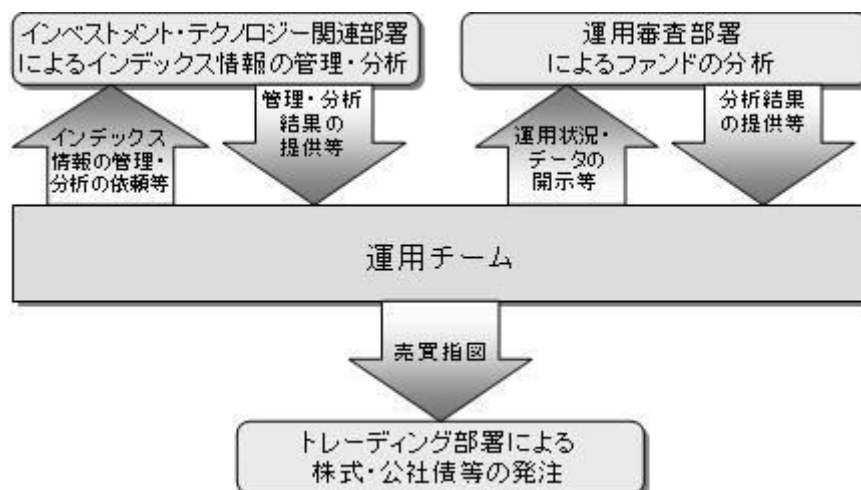
- 1 預金
- 2 指定金銭信託（上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。）
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

- 1 先物取引等
- 2 スワップ取引

### （3）【運用体制】

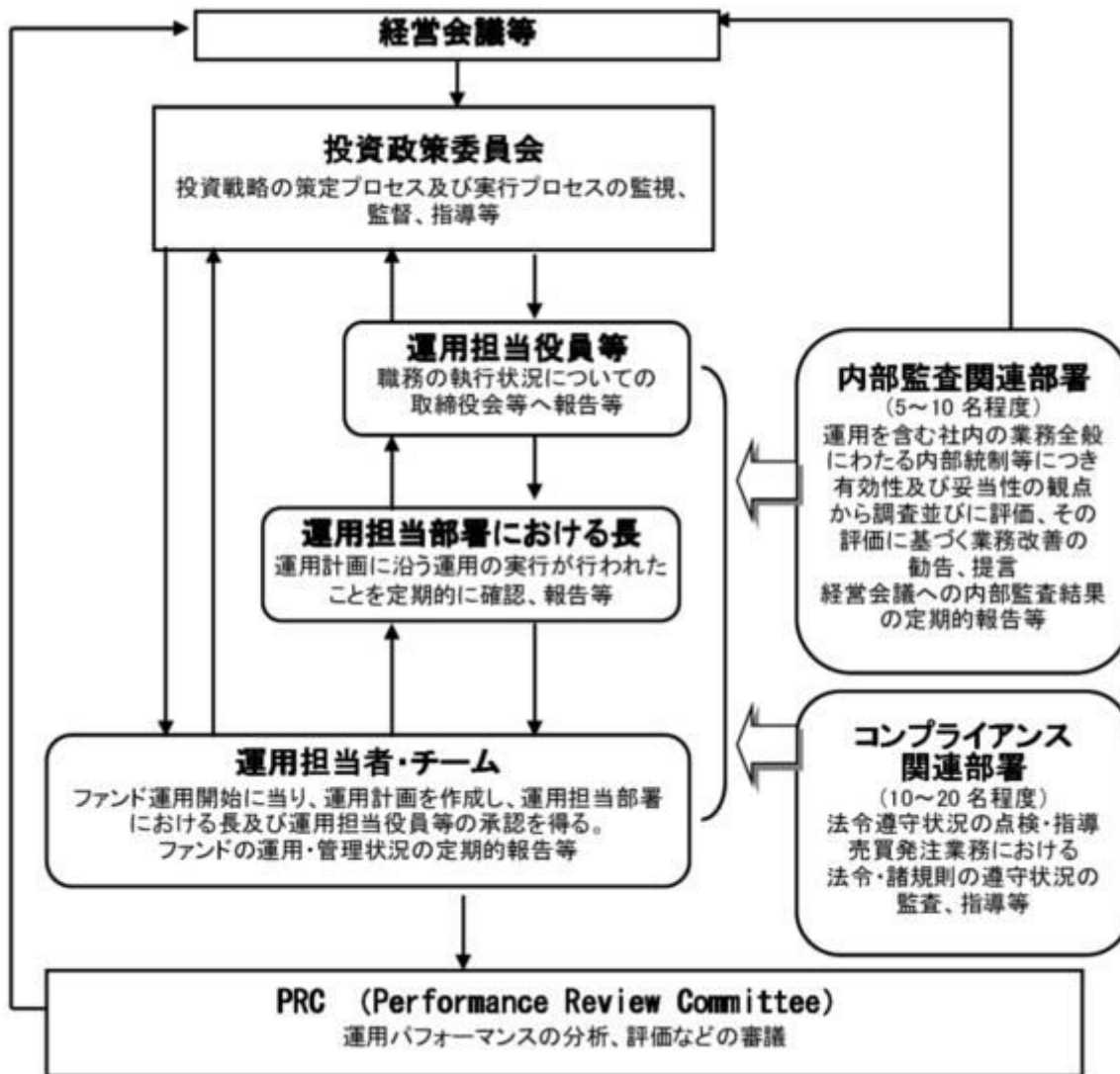
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

年1回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。

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

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

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

毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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

## ファンドの決算日

原則として**毎年5月10日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

## 分配金のお支払い

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。(運用の基本方針 2. 運用方法 (3)投資制限)

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し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金

および償還金等を加えた額を限度とします。

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

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。

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

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

(外国株式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。

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

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

(国内債券マザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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。

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

ません。

(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いません。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行いません。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行いません。

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

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

### 3【投資リスク】

#### 基準価額の変動要因

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

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

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

**[為替変動リスク]**

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

**[債券価格変動リスク]**

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行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

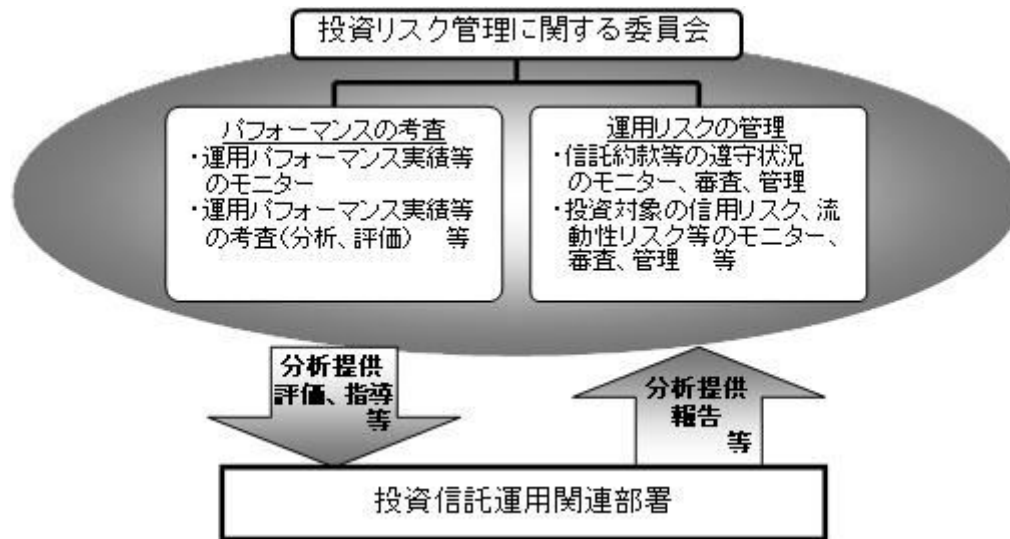
## パフォーマンスの考査

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

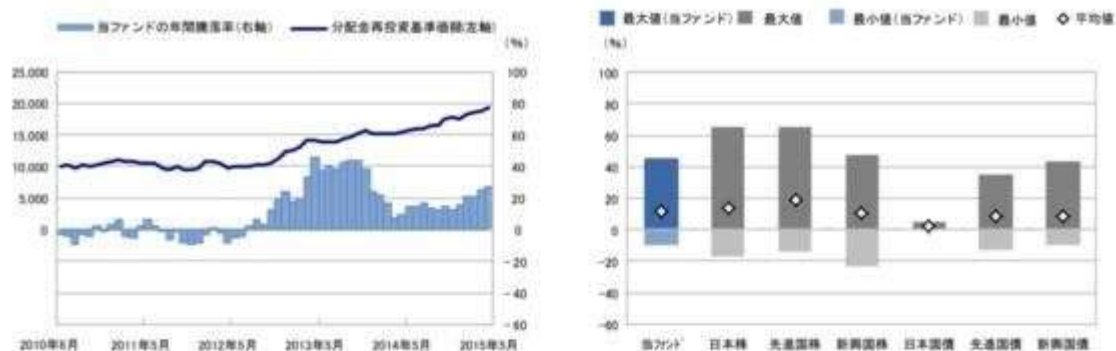


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

## リスクの定量的比較

(2010年6月末～2015年5月末:月次)

## 〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉 〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	45.2	65.0	65.7	47.4	4.5	34.9	43.7
最小値(%)	△ 9.8	△ 17.0	△ 13.6	△ 22.8	0.4	△ 12.7	△ 10.1
平均値(%)	11.3	13.8	19.4	10.6	2.4	8.5	8.7

- ◆ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2010年6月末を10,000として指数化しております。
- ◆ 年間騰落率は、2010年6月から2015年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- ◆ 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ◆ 2010年6月から2015年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- ◆ 決算日に対応した数値とは異なります。
- ◆ 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

## ＜代表的な資産クラスの指数＞

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

## ■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同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。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- 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、Citigroup Index LLC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で、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェント、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)(「指数スポンサー」)は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSE, J.P. Morgan Securities PLC、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所: 株式会社野村総合研究所、Citigroup Index LLC 他)

## 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。

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

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年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。

### 支払先の役務の内容

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

## （４）【その他の手数料等】

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。

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

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。

平成28年1月1日以降の損益通算について

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

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

(注1) 「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、平成27年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

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

上場株式、公募株式投資信託は税法上、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、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期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。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。

株式投資信託（一部のETFを除く）に係る益金不算入制度は、法令改正により、平成27年4月1日をもって廃止され、同日以後に開始する法人の事業年度については適用されません。

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。

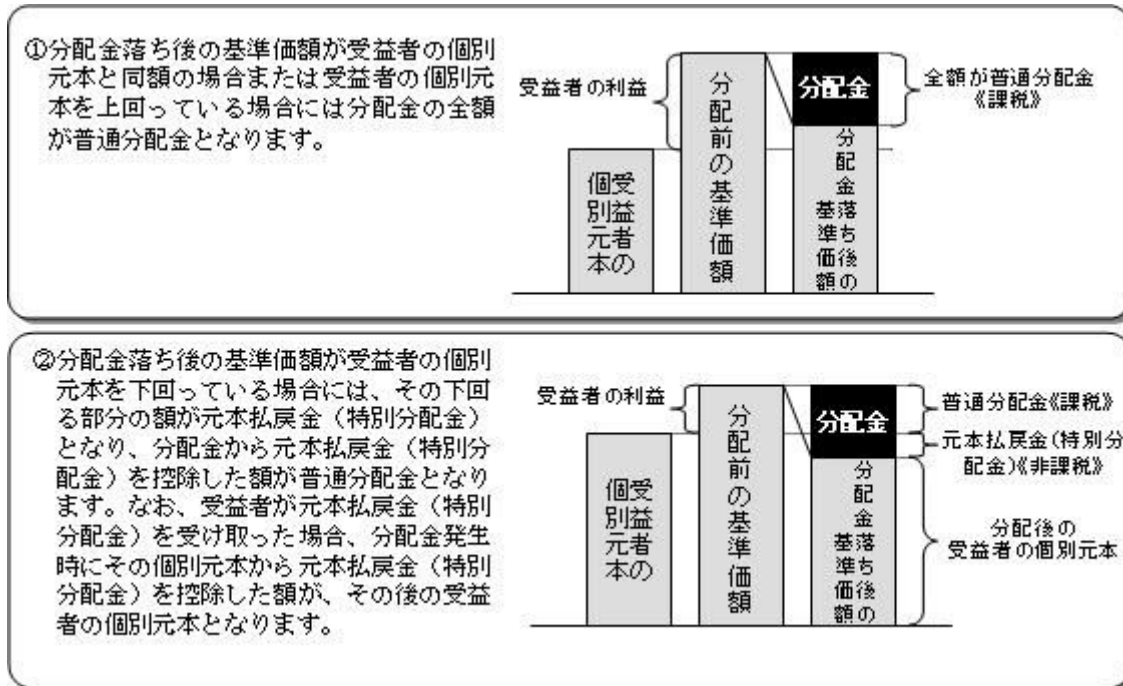
## 個別元本について

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（平成27年5月末現在）が変更となる場合があります。

## 5【運用状況】

以下は平成27年 5月29日現在の運用状況であります。

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

### (1)【投資状況】

#### 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	1,727,706,964	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,733,157	0.10
合計(純資産総額)		1,729,440,121	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	267,086,973,800	97.34
現金・預金・その他資産(負債控除後)		7,288,857,916	2.65
合計(純資産総額)		274,375,831,716	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	5,614,560,000	2.04

## (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	207,257,564,681	59.93
	カナダ	13,528,640,690	3.91
	ドイツ	12,966,811,217	3.74
	イタリア	3,427,835,907	0.99
	フランス	13,624,900,924	3.94
	オランダ	4,023,420,955	1.16
	スペイン	5,037,219,319	1.45
	ベルギー	1,864,607,868	0.53
	オーストリア	296,127,828	0.08
	ルクセンブルグ	166,541,963	0.04
	フィンランド	1,193,167,976	0.34
	アイルランド	517,621,810	0.14
	ポルトガル	220,503,893	0.06
	イギリス	29,174,593,250	8.43
	スイス	13,675,399,483	3.95
	スウェーデン	4,372,839,733	1.26
	ノルウェー	940,436,362	0.27
	デンマーク	2,447,643,756	0.70
	オーストラリア	9,040,112,773	2.61
	ニュージーランド	198,453,839	0.05
香港	4,600,148,167	1.33	
シンガポール	1,861,817,962	0.53	
イスラエル	842,647,735	0.24	
	小計	331,279,058,091	95.80
投資信託受益証券	アメリカ	41,880,749	0.01
投資証券	アメリカ	5,793,598,960	1.67
	カナダ	64,102,620	0.01
	フランス	459,884,632	0.13
	イギリス	502,227,421	0.14
	オーストラリア	836,105,868	0.24
	香港	143,001,600	0.04
	シンガポール	149,650,264	0.04

	小計	7,948,571,365	2.29
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,522,758,224	1.88
合計(純資産総額)		345,792,268,429	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	4,082,250,173	1.18
	買建	カナダ	263,179,577	0.07
	買建	ドイツ	839,615,747	0.24
	買建	イギリス	559,525,322	0.16
	買建	スイス	258,512,563	0.07

## (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	8,179,904,870	98.02
現金・預金・その他資産(負債控除後)		164,703,234	1.97
合計(純資産総額)		8,344,608,104	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	232,987,687,351	41.96
	カナダ	12,735,857,385	2.29
	メキシコ	5,957,796,853	1.07
	ドイツ	26,613,360,833	4.79
	イタリア	62,182,849,453	11.20
	フランス	50,726,750,885	9.13
	オランダ	13,288,839,297	2.39
	スペイン	37,154,452,128	6.69
	ベルギー	13,574,472,110	2.44
	オーストリア	8,441,103,158	1.52
	フィンランド	3,169,512,354	0.57
	アイルランド	5,976,586,183	1.07
	イギリス	46,541,585,671	8.38
	スイス	1,550,229,092	0.27
	スウェーデン	2,740,762,073	0.49
ノルウェー	1,658,357,334	0.29	

	デンマーク	3,766,947,631	0.67
	ポーランド	3,138,767,551	0.56
	オーストラリア	9,589,567,611	1.72
	シンガポール	2,046,976,453	0.36
	マレーシア	2,951,022,390	0.53
	南アフリカ	2,937,756,357	0.52
	小計	549,731,240,153	99.02
現金・預金・その他資産(負債控除後)		5,419,511,437	0.97
合計(純資産総額)		555,150,751,590	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	510,465,547	1.4594	744,973,420	1.5285	780,246,588	45.11
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	185,305,472	2.2722	421,051,094	2.3500	435,467,859	25.17
3	日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	266,314,856	1.2748	339,507,120	1.2742	339,338,389	19.62
4	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	72,708,721	2.3250	169,051,288	2.3746	172,654,128	9.98

## 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	99.89
合計	99.89

## (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	1,503,900	8,235.04	12,384,676,656	8,604.00	12,939,555,600	4.71
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,632,100	871.99	7,527,104,879	921.20	7,951,890,520	2.89
3	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	813,600	5,379.82	4,377,021,552	5,670.00	4,613,112,000	1.68
4	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	568,900	7,399.86	4,209,780,354	7,447.00	4,236,598,300	1.54
5	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	981,000	4,210.47	4,130,471,070	4,261.00	4,180,041,000	1.52

6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	15,003,700	233.50	3,503,444,610	274.60	4,120,016,020	1.50
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	421,000	8,170.07	3,439,601,200	8,669.00	3,649,649,000	1.33
8	日本	株式	ファナック	電気機器	113,500	25,475.43	2,891,462,000	27,540.00	3,125,790,000	1.13
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	676,900	4,268.07	2,889,056,583	4,540.00	3,073,126,000	1.12
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,092,900	2,868.41	3,134,885,289	2,811.00	3,072,141,900	1.11
11	日本	株式	ソニー	電気機器	712,700	3,727.11	2,656,315,400	3,862.00	2,752,447,400	1.00
12	日本	株式	キヤノン	電気機器	632,000	4,262.49	2,693,893,680	4,292.00	2,712,544,000	0.98
13	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	427,800	6,207.01	2,655,360,300	6,040.00	2,583,912,000	0.94
14	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,328,400	1,700.97	2,259,568,548	1,831.00	2,432,300,400	0.88
15	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,300,300	1,812.95	2,357,378,885	1,812.00	2,356,143,600	0.85
16	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	450,000	5,146.08	2,315,736,000	5,157.00	2,320,650,000	0.84
17	日本	株式	村田製作所	電気機器	114,400	18,061.31	2,066,214,500	20,235.00	2,314,884,000	0.84
18	日本	株式	三菱商事	卸売業	824,500	2,643.02	2,179,169,990	2,787.00	2,297,881,500	0.83
19	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	199,800	10,969.98	2,191,803,000	11,365.00	2,270,727,000	0.82
20	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	435,900	4,995.97	2,177,745,150	5,144.00	2,242,269,600	0.81
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	2,618,000	824.31	2,158,048,400	850.00	2,225,300,000	0.81
22	日本	株式	三菱地所	不動産業	800,000	2,751.30	2,201,044,500	2,779.00	2,223,200,000	0.81
23	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	97,600	21,329.63	2,081,772,000	21,625.00	2,110,600,000	0.76
24	日本	株式	三井不動産	不動産業	570,000	3,515.55	2,003,863,500	3,626.50	2,067,105,000	0.75
25	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,530,100	1,256.01	1,921,820,901	1,300.50	1,989,895,050	0.72
26	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,090,000	1,594.49	1,737,999,500	1,705.00	1,858,450,000	0.67
27	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	829,700	2,174.99	1,804,589,203	2,236.00	1,855,209,200	0.67
28	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	357,800	4,911.27	1,757,253,550	5,176.00	1,851,972,800	0.67
29	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	2,199,400	804.28	1,768,933,432	823.60	1,811,425,840	0.66
30	日本	株式	デンソー	輸送用機器	269,300	5,999.18	1,615,581,700	6,511.00	1,753,412,300	0.63

## 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	0.40
		建設業	2.52
		食料品	3.92
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.23
		化学	5.70
		医薬品	4.48
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.91
		ガラス・土石製品	0.91
		鉄鋼	1.47



非鉄金属	0.95
金属製品	0.59
機械	4.95
電気機器	12.73
輸送用機器	11.26
精密機器	1.26
その他製品	1.48
電気・ガス業	2.06
陸運業	3.81
海運業	0.29
空運業	0.59
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	6.44
卸売業	4.07
小売業	4.24
銀行業	9.50
証券、商品先物取引業	1.33
保険業	2.59
その他金融業	1.25
不動産業	2.84
サービス業	2.96
合 計	97.34

## (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	509,500	15,636.99	7,967,050,175	16,305.13	8,307,468,524	2.40
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフ トウ ェ ア	680,000	5,067.98	3,446,226,944	5,870.98	3,992,272,180	1.15
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石 油・ガ ス・消 耗燃 料	367,700	10,593.76	3,895,326,508	10,530.66	3,872,123,792	1.11
4	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医 薬 品	243,000	12,562.30	3,052,640,577	12,515.28	3,041,215,349	0.87
5	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コ ン グ ロ マ リ ット	871,800	3,108.09	2,709,639,488	3,418.65	2,980,387,701	0.86
6	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀 行	427,800	6,775.45	2,898,539,564	6,954.86	2,975,290,520	0.86
7	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食 品	279,900	9,741.03	2,726,514,409	9,676.73	2,708,518,826	0.78
8	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀 行	324,500	7,542.58	2,447,567,470	8,190.92	2,657,955,487	0.76
9	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医 薬 品	199,700	12,837.58	2,563,666,004	12,917.62	2,579,649,613	0.74
10	アメリカ	株式	PFIZER INC	医 薬 品	546,900	4,329.31	2,367,701,115	4,261.26	2,330,483,750	0.67
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家 庭 用 品	234,500	10,234.94	2,400,094,743	9,815.50	2,301,734,961	0.66
12	スイス	株式	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	医 薬 品	60,970	34,773.27	2,120,126,528	37,066.82	2,259,964,320	0.65
13	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各 種 電 気 通 信 サ ー ビ ス	360,200	6,077.61	2,189,157,860	6,129.58	2,207,876,229	0.63

14	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	164,100	13,226.73	2,170,507,541	12,773.88	2,096,194,561	0.60
15	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,665,000	1,105.19	1,840,146,512	1,182.15	1,968,293,936	0.56
16	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	450,100	4,079.37	1,836,128,082	4,305.80	1,938,042,380	0.56
17	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	メディア	139,800	13,128.99	1,835,432,844	13,675.87	1,911,887,591	0.55
18	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	912,500	1,920.28	1,752,264,260	2,062.57	1,882,103,429	0.54
19	アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	バイオテクノロジー	130,900	12,455.89	1,630,477,192	13,962.93	1,827,747,602	0.52
20	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	247,400	7,217.17	1,785,528,080	7,386.68	1,827,464,879	0.52
21	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・カタログ販売	34,150	46,349.25	1,582,827,160	52,779.50	1,802,420,133	0.52
22	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	100,220	18,059.63	1,809,936,199	17,908.68	1,794,807,930	0.51
23	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	262,800	6,389.41	1,679,138,840	6,749.47	1,773,761,110	0.51
24	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	419,500	3,891.30	1,632,403,915	4,208.05	1,765,280,037	0.51
25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	342,000	5,012.30	1,714,207,386	5,090.25	1,740,866,252	0.50
26	アメリカ	株式	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	情報技術サービス	81,570	20,125.92	1,641,671,441	21,245.67	1,733,009,979	0.50
27	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	173,600	10,293.09	1,786,881,935	9,916.34	1,721,476,772	0.49
28	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	24,710	69,412.52	1,715,183,616	68,568.69	1,694,332,364	0.48
29	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	25,090	68,102.22	1,708,684,933	66,786.97	1,675,685,313	0.48
30	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア	307,500	5,373.59	1,652,380,125	5,426.79	1,668,740,324	0.48

## 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	0.97
		石油・ガス・消耗燃料	6.91
		化学	2.81
		建設資材	0.32
		容器・包装	0.23
		金属・鉱業	1.51
		紙製品・林産品	0.12
		航空宇宙・防衛	2.08
		建設関連製品	0.20
		建設・土木	0.29
		電気設備	0.77
		コングロマリット	1.90
		機械	1.45
		商社・流通業	0.31

商業サービス・用品	0.39
航空貨物・物流サービス	0.55
旅客航空輸送業	0.16
海運業	0.08
陸運・鉄道	0.90
運送インフラ	0.18
自動車部品	0.58
自動車	1.16
家庭用耐久財	0.35
レジャー用品	0.08
繊維・アパレル・贅沢品	1.21
ホテル・レストラン・レジャー	1.64
メディア	3.20
販売	0.08
インターネット販売・カタログ販売	0.92
複合小売り	0.59
専門小売り	1.82
食品・生活必需品小売り	2.07
飲料	2.15
食品	2.57
タバコ	1.37
家庭用品	1.42
パーソナル用品	0.25
ヘルスケア機器・用品	1.56
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.90
バイオテクノロジー	2.16
医薬品	7.57
銀行	9.23
各種金融サービス	1.35
保険	4.13
不動産管理・開発	0.67
インターネットソフトウェア・サービス	2.02
情報技術サービス	2.25
ソフトウェア	2.79
通信機器	1.22
コンピュータ・周辺機器	2.98
電子装置・機器・部品	0.35
半導体・半導体製造装置	1.83
各種電気通信サービス	2.53
無線通信サービス	0.47
電力	1.57
ガス	0.14

		総合公益事業	1.23
		水道	0.08
		貯蓄・抵当・不動産金融	0.03
		消費者金融	0.53
		資本市場	2.20
		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	0.10
		ヘルスケア・テクノロジー	0.06
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.41
		専門サービス	0.49
投資信託受益証券			0.01
投資証券			2.29
合 計			98.11

## (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 (20年)第9 9回	170,000,000	118.42	201,321,400	118.19	200,934,900	2.1	2027/12/20	2.40
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	190,000,000	100.05	190,109,200	100.07	190,134,900	0.1	2020/3/20	2.27
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	160,000,000	100.64	161,026,200	100.67	161,078,400	0.2	2018/12/20	1.93
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 18回	140,000,000	105.41	147,577,600	105.43	147,611,800	1	2021/9/20	1.76
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 20回	130,000,000	105.64	137,338,500	105.61	137,300,800	1	2021/12/20	1.64
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	130,000,000	100.63	130,830,500	100.64	130,837,200	0.2	2019/3/20	1.56
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 52回	130,000,000	100.93	131,218,000	100.24	130,312,000	1.2	2035/3/20	1.56
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第5 9回	110,000,000	111.10	122,216,400	111.07	122,181,400	1.7	2022/12/20	1.46
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 21回	100,000,000	116.09	116,097,000	115.54	115,547,000	1.9	2030/9/20	1.38
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年)第4 5回	110,000,000	102.08	112,288,100	100.82	110,907,500	1.5	2044/12/20	1.32
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	110,000,000	100.20	110,227,400	100.09	110,103,400	0.4	2025/3/20	1.31
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 89回	100,000,000	103.90	103,908,000	103.83	103,839,000	1.5	2017/12/20	1.24
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 2回	100,000,000	101.29	101,296,000	101.23	101,235,000	0.4	2018/6/20	1.21

14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	100,000,000	100.09	100,091,000	100.13	100,136,000	0.1	2019/12/20	1.20
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 84回	75,000,000	102.73	77,052,750	102.65	76,989,000	1.7	2016/12/20	0.92
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第4 0回	70,000,000	107.64	75,352,200	107.57	75,302,500	2.3	2018/9/20	0.90
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	70,000,000	106.04	74,229,400	105.98	74,188,800	1.2	2020/12/20	0.88
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	70,000,000	105.62	73,935,400	105.60	73,922,100	1.3	2019/12/20	0.88
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 24回	70,000,000	104.20	72,941,400	104.46	73,122,700	0.8	2022/6/20	0.87
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	70,000,000	104.16	72,912,000	104.35	73,048,500	0.8	2022/9/20	0.87
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	70,000,000	104.16	72,912,700	104.25	72,979,900	0.8	2023/6/20	0.87
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	70,000,000	102.61	71,831,200	102.75	71,928,500	0.6	2023/3/20	0.86
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 2回	70,000,000	100.48	70,336,700	100.48	70,336,000	0.3	2016/12/20	0.84
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第34 8回	70,000,000	100.16	70,116,900	100.18	70,130,200	0.1	2017/1/15	0.84
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 85回	68,000,000	103.15	70,147,440	103.07	70,089,640	1.7	2017/3/20	0.83
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 96回	65,000,000	104.96	68,225,950	104.93	68,207,100	1.5	2018/9/20	0.81
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 88回	65,000,000	104.00	67,603,250	103.92	67,550,600	1.7	2017/9/20	0.80
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第4 9回	60,000,000	111.54	66,929,400	111.44	66,865,200	2.1	2021/3/22	0.80
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 13回	60,000,000	106.82	64,095,600	106.76	64,057,200	1.3	2021/3/20	0.76
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	60,000,000	100.60	60,361,800	100.66	60,396,000	0.2	2018/9/20	0.72

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.02
合計	98.02

## (参考)外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
----	----------	----	-----	----	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------	------	-----------------

1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	30,500,000	13,694.88	4,176,938,580	13,688.59	4,175,022,262	3.625	2021/2/15	0.75
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	29,300,000	13,014.84	3,813,350,867	13,015.81	3,813,634,002	2.625	2020/11/15	0.68
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,400,000	13,262.30	3,501,249,675	13,253.60	3,498,952,692	3.125	2019/5/15	0.63
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	25,200,000	13,606.43	3,428,821,227	13,593.86	3,425,654,278	3.625	2020/2/15	0.61
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	25,400,000	13,349.86	3,390,866,044	13,351.24	3,391,215,039	3.125	2021/5/15	0.61
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	24,300,000	13,534.60	3,288,908,667	13,530.06	3,287,806,650	3.625	2019/8/15	0.59
7	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,500,000	20,608.99	3,194,393,901	20,569.32	3,188,245,344	6	2025/10/25	0.57
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	24,000,000	13,071.88	3,137,251,258	13,066.08	3,135,859,444	2.75	2019/2/15	0.56
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	23,300,000	13,150.17	3,063,991,722	13,128.91	3,059,036,578	4.625	2016/11/15	0.55
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000	17,188.56	3,007,999,312	17,206.19	3,011,084,440	3.5	2026/4/25	0.54
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	17,500,000	17,093.10	2,991,293,418	17,072.80	2,987,741,068	8	2021/11/15	0.53
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	21,500,000	13,561.00	2,915,615,219	13,548.43	2,912,913,525	3.5	2020/5/15	0.52
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	21,600,000	13,431.47	2,901,197,641	13,425.67	2,899,945,008	3.375	2019/11/15	0.52
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,200,000	17,611.67	2,853,090,654	17,589.97	2,849,575,643	4.25	2023/10/25	0.51
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	21,000,000	13,491.88	2,833,295,943	13,478.83	2,830,555,744	3.75	2018/11/15	0.50
16	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,000,000	23,194.73	2,783,368,128	22,980.19	2,757,623,927	5.75	2032/10/25	0.49
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	21,000,000	13,028.38	2,735,960,162	13,028.38	2,735,960,162	2.625	2020/8/15	0.49
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	20,400,000	13,267.62	2,706,595,462	13,236.20	2,700,186,793	4.625	2017/2/15	0.48
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000	20,239.79	2,691,892,403	19,870.93	2,642,834,129	6.5	2027/11/1	0.47
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,300,000	13,259.89	2,559,159,097	13,244.42	2,556,174,111	3.5	2018/2/15	0.46
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,500,000	13,068.98	2,548,451,344	13,076.71	2,549,959,303	2.75	2023/11/15	0.45
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,500,000	12,787.68	2,493,599,261	12,794.45	2,494,918,786	2.5	2024/5/15	0.44
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000	21,328.51	2,452,778,680	21,153.19	2,432,617,270	5.5	2029/4/25	0.43
24	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	11,100,000	21,796.91	2,419,457,079	21,639.41	2,401,975,123	3.25	2044/1/22	0.43
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	16,600,000	14,469.25	2,401,896,010	14,467.70	2,401,639,745	3.75	2043/11/15	0.43
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,600,000	12,908.03	2,400,894,417	12,896.91	2,398,826,860	2.75	2017/5/31	0.43
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,500,000	12,923.51	2,390,850,177	12,910.45	2,388,433,655	3.125	2017/1/31	0.43
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,000,000	12,547.96	2,384,112,712	12,547.96	2,384,112,712	1.625	2019/3/31	0.42
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,300,000	12,983.43	2,375,968,256	12,971.83	2,373,845,513	3.125	2017/4/30	0.42

30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000	15,795.75	2,337,772,165	15,802.63	2,338,789,728	3.5	2020/4/25	0.42
----	------	------	-------------------------------	------------	-----------	---------------	-----------	---------------	-----	-----------	------

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.02
合 計	99.02

## 【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(2015年06月限)	買建	336	日本円	5,423,394,844	5,614,560,000	2.04

(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 タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2015 年06月限)	買建	311	米ドル	32,420,975	4,011,447,232	32,993,212.5	4,082,250,173	1.18
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2015年06 月限)	買建	15	カナダ ドル	2,613,100	260,290,891	2,642,100	263,179,577	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(2015年06月 限)	買建	170	ユーロ	6,193,020	839,835,445	6,191,400	839,615,747	0.24
	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(2015年06月 限)	買建	42	英ポンド	2,893,605	548,540,696	2,951,550	559,525,322	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 (2015年06月 限)	買建	21	スイス フラン	1,917,560	251,603,049	1,970,220	258,512,563	0.07

#### (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27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
第14計算期間	(2015年 5月11日)	1,686	1,693	1.5575	1.5640
	2014年 5月末日	1,487		1.2745	
	6月末日	1,520		1.3086	
	7月末日	1,540		1.3267	
	8月末日	1,532		1.3290	
	9月末日	1,557		1.3687	
	10月末日	1,546		1.3720	
	11月末日	1,602		1.4609	
	12月末日	1,586		1.4694	
	2015年 1月末日	1,565		1.4521	
	2月末日	1,645		1.5209	
	3月末日	1,660		1.5333	
	4月末日	1,687		1.5596	
	5月末日	1,729		1.6065	

## 【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
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	0.0065円

## 【収益率の推移】

## バランスセレクト70

	計算期間	収益率
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%
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	25.3%

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
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	90,258,775	172,878,904	1,082,727,327

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 (2015年5月29日現在)

### 基準価額・純資産の推移 (目次)



### 分配の推移 (1万口あたり、課税前)

2015年5月	65 円
2014年5月	40 円
2013年5月	30 円
2012年5月	15 円
2011年5月	15 円
設定来累計	335 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	45.1
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	25.2
3	国内債券マザーファンド	19.6
4	外国債券マザーファンド	10.0

#### 実質的な銘柄別投資比率(上位)

##### ・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2.1
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.3
3	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.8
4	ソフトバンク	情報・通信業	0.7
5	本田技研工業	輸送用機器	0.7

##### ・「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	0.6
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3
3	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.3
4	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.2
5	GENERAL ELEC CO	コングロマリット	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(20年)第99回	国債証券	0.5
2	国庫債券 利付(5年)第123回	国債証券	0.4
3	国庫債券 利付(5年)第116回	国債証券	0.4
4	国庫債券 利付(10年)第318回	国債証券	0.3
5	国庫債券 利付(10年)第320回	国債証券	0.3

##### ・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

### 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2015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は、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時までには、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】

### < 基準価額の計算方法 >

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 <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(交付運用報告書を作成している場合は交付運用報告書)を作成し、知られたる受益者に対して交付します。

## (d) 信託約款の変更

( )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14期計算期間(平成26年5月13日から平成27年5月11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13期 (平成26年 5月12日現在)	第14期 (平成27年 5月11日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,019,356	17,727,268
親投資信託受益証券	1,453,348,664	1,684,304,120
未収入金	5,041,045	4,428,855
未収利息	12	29
流動資産合計	1,465,409,077	1,706,460,272
資産合計	1,465,409,077	1,706,460,272
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	4,661,389	7,037,727
未払解約金	370	6,751,223
未払受託者報酬	387,050	437,033
未払委託者報酬	5,186,437	5,856,253
その他未払費用	23,163	26,162
流動負債合計	10,258,409	20,108,398
負債合計	10,258,409	20,108,398
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,165,347,456	1,082,727,327
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	289,803,212	603,624,547
(分配準備積立金)	292,102,839	570,148,482
元本等合計	1,455,150,668	1,686,351,874
純資産合計	1,455,150,668	1,686,351,874
負債純資産合計	1,465,409,077	1,706,460,272

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日	自	平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日
営業収益				
受取利息		3,286		2,970
有価証券売買等損益		63,196,297		365,357,449
その他収益		-		42
営業収益合計		63,199,583		365,360,461
営業費用				
受託者報酬		775,952		846,654
委託者報酬		10,397,680		11,345,202
その他費用		46,430		50,679
営業費用合計		11,220,062		12,242,535
営業利益又は営業損失（ ）		51,979,521		353,117,926
経常利益又は経常損失（ ）		51,979,521		353,117,926
当期純利益又は当期純損失（ ）		51,979,521		353,117,926
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（ ）		4,255,956		26,654,168
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		267,097,170		289,803,212
剰余金増加額又は欠損金減少額		28,018,968		37,596,380
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		37,596,380
剰余金減少額又は欠損金増加額		48,375,102		43,201,076
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		43,201,076
分配金		4,661,389		7,037,727
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		289,803,212		603,624,547

## ( 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26年 5月13日から平成27年 5月11日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

第13期 平成26年 5月12日現在	第14期 平成27年 5月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,165,347,456口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,082,727,327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 1.2487円 (10,000口当たり純資産額) (12,487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 1.5575円 (10,000口当たり純資産額) (15,575円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日	第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11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>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	<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>28,671,589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>297,792,169円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>306,809,824円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>250,722,451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>883,996,033円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,082,727,327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>8,164円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>65円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>7,037,727円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	28,671,589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	297,792,169円	収益調整金額	C	306,809,824円	分配準備積立金額	D	250,722,451円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	883,996,033円	当ファンドの期末残存口数	F	1,082,727,327口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	8,164円	10,000口当たり分配金額	H	65円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	7,037,727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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	28,671,589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	297,792,169円																																																											
収益調整金額	C	306,809,824円																																																											
分配準備積立金額	D	250,722,451円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	883,996,033円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,082,727,327口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	8,164円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	65円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	7,037,727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13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日</p>	<p style="text-align: center;">第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11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。</p> <p style="padding-left: 2em;">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。</p> <p style="padding-left: 2em;">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。</p> <p style="padding-left: 2em;">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13期 平成26年 5月12日現在</p>	<p style="text-align: center;">第14期 平成27年 5月11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13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日	第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日	第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日
期首元本額 1,279,860,640円	期首元本額 1,165,347,456円
期中追加設定元本額 120,904,284円	期中追加設定元本額 90,258,775円
期中一部解約元本額 235,417,468円	期中一部解約元本額 172,878,904円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第13期 自 平成25年 5月11日 至 平成26年 5月12日	第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11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	53,502,368	327,414,485
合計	53,502,368	327,414,485

## 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27年 5月11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27年 5月11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		758,208,367	
		国内債券マザーファンド		335,074,803	
		外国債券マザーファンド		167,113,072	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド		423,907,878	
	小計	銘柄数: 4 組入時価比率: 99.9%		1,684,304,120	100.0%
合計			1,684,304,120		

(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27年 5月11日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,052,457,257
株式	254,864,000,400
派生商品評価勘定	56,745,238
未収入金	2,683,128,100
未収配当金	2,120,714,044



未収利息	5,937
その他未収収益	1,172,235
差入委託証拠金	127,510,000
流動資産合計	272,905,733,211
資産合計	272,905,733,211
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,268,328
未払解約金	3,447,064,001
未払利息	88,474
有価証券貸借取引受入金	9,533,010,490
流動負債合計	12,990,431,293
負債合計	12,990,431,293
純資産の部	
元本等	
元本	178,095,641,491
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	81,819,660,427
元本等合計	259,915,301,918
純資産合計	259,915,301,918
負債純資産合計	272,905,733,211

## 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27年 5月11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	1.4594円
(10,000口当たり純資産額)	(14,594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	9,185,811,500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26年 5月13日 至 平成27年 5月11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27年 5月11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>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27年 5月11日現在	
期首	平成26年 5月13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	168,203,176,561円
同期中における追加設定元本額	58,478,003,257円
同期中における一部解約元本額	48,585,538,327円
期末元本額	178,095,641,491円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	181,070,788円
バランスセレクト50	442,292,000円
バランスセレクト70	519,534,307円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,272,881,892円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	5,406,462,749円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	9,394,605,116円
野村資産設計ファンド2015	128,702,523円
野村資産設計ファンド2020	122,530,586円
野村資産設計ファンド2025	130,655,276円
野村資産設計ファンド2030	128,207,632円
野村資産設計ファンド2035	98,808,133円
野村資産設計ファンド2040	329,530,450円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	46,053,797,011円
のむらップ・ファンド（保守型）	902,669,095円
のむらップ・ファンド（普通型）	2,295,990,053円
のむらップ・ファンド（積極型）	968,136,061円
野村資産設計ファンド2045	24,414,708円
野村インデックスファンド・TOPIX	689,558,248円
マイ・ロード	2,244,075,986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	200,352,312円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	59,413,822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）	1,897,472,830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）	802,624,586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）	5,454,003,573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）	1,331,506,731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）	14,405,508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）	48,464,922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）	23,231,238円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,648,110,498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）	555,993,996円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	3,592,963,705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）	1,283,187,182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）	2,325,263,630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）	548,647,068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）	82,873,603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）	422,470,764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）	6,703,267,448円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	945,563,311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）	792,121,195円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用）	731,829円

バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	9,023,419円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	32,892,750円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	33,612,786円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	82,268,852円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	3,430,866,620円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	10,779,370,492円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	15,300,371,785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）	29,731,335,978円
マイバランスDC30	1,774,000,004円
マイバランスDC50	2,310,149,750円
マイバランスDC70	2,115,390,977円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	6,427,011,398円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	2,754,315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27年 5月11日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	52,000	290.00	15,080,000	貸付有価証券 19,000株(19,000株)
		日本水産	150,000	369.00	55,350,000	
		マルハニチロ	24,900	1,773.00	44,147,700	貸付有価証券 1,400株
		サカタのタネ	19,600	2,127.00	41,689,200	貸付有価証券 600株(600株)
		ホクト	13,500	2,200.00	29,700,000	
		住石ホールディングス	33,900	122.00	4,135,800	貸付有価証券 14,200株(12,600株)
		日鉄鉱業	34,000	481.00	16,354,000	
		三井松島産業	80,000	130.00	10,400,000	貸付有価証券 7,000株
		国際石油開発帝石	643,000	1,482.00	952,926,000	
		日本海洋掘削	3,700	3,985.00	14,744,500	貸付有価証券 1,600株(300株)
		石油資源開発	17,400	4,525.00	78,735,000	
		K&Oエナジーグループ	8,200	1,532.00	12,562,400	

ショーボンドホールディングス	11,800	5,280.00	62,304,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ミライト・ホールディングス	37,500	1,309.00	49,087,500	
タマホーム	9,100	601.00	5,469,100	貸付有価証券 4,000株(1,300株)
サンヨーホームズ	1,700	627.00	1,065,900	貸付有価証券 500株
ダイセキ環境ソリューション	1,400	1,866.00	2,612,400	貸付有価証券 100株
安藤・間	81,400	668.00	54,375,200	
東急建設	43,300	715.00	30,959,500	貸付有価証券 500株
コムシスホールディングス	54,300	1,709.00	92,798,700	
ミサワホーム	14,400	1,085.00	15,624,000	
高松コンストラクショングループ	9,200	2,736.00	25,171,200	
東建コーポレーション	4,600	6,270.00	28,842,000	
ヤマウラ	5,700	435.00	2,479,500	
大成建設	634,000	682.00	432,388,000	貸付有価証券 15,000株(15,000株)
大林組	366,000	797.00	291,702,000	
清水建設	373,000	838.00	312,574,000	
飛鳥建設	82,100	236.00	19,375,600	貸付有価証券 36,500株
長谷工コーポレーション	152,600	1,195.00	182,357,000	
松井建設	13,000	668.00	8,684,000	
銭高組	17,000	393.00	6,681,000	貸付有価証券 2,000株
鹿島建設	536,000	551.00	295,336,000	
不動テトラ	92,300	226.00	20,859,800	貸付有価証券 41,000株
大末建設	4,700	820.00	3,854,000	貸付有価証券 300株(200株)
鉄建建設	74,000	400.00	29,600,000	貸付有価証券 33,000株
日鉄住金テックスエンジ	23,000	655.00	15,065,000	
西松建設	132,000	440.00	58,080,000	
三井住友建設	495,200	166.00	82,203,200	貸付有価証券 148,800株(134,100)

				株)
大豊建設	33,000	598.00	19,734,000	貸付有価証券 14,000株
前田建設工業	81,000	867.00	70,227,000	貸付有価証券 9,000株(7,000株)
佐田建設	42,000	139.00	5,838,000	貸付有価証券 3,000株
ナカノフドー建設	9,300	439.00	4,082,700	
奥村組	116,000	589.00	68,324,000	
大和小田急建設	6,600	1,061.00	7,002,600	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
東鉄工業	14,700	2,631.00	38,675,700	
イチケン	13,000	307.00	3,991,000	貸付有価証券 2,000株
浅沼組	39,000	161.00	6,279,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
戸田建設	153,000	491.00	75,123,000	
熊谷組	153,000	372.00	56,916,000	
青木あすなろ建設	8,000	883.00	7,064,000	
北野建設	25,000	347.00	8,675,000	
植木組	15,000	262.00	3,930,000	
三井ホーム	16,000	516.00	8,256,000	
矢作建設工業	15,100	809.00	12,215,900	
ピーエス三菱	12,800	425.00	5,440,000	貸付有価証券 5,000株(1,100株)
日本ハウスホールディングス	20,200	567.00	11,453,400	貸付有価証券 3,900株
大東建託	45,600	13,530.00	616,968,000	
新日本建設	14,500	454.00	6,583,000	
N I P P O	28,000	1,982.00	55,496,000	
東亜道路工業	23,000	428.00	9,844,000	
前田道路	38,000	1,989.00	75,582,000	
日本道路	36,000	664.00	23,904,000	貸付有価証券 7,000株
東亜建設工業	91,000	210.00	19,110,000	
若築建設	70,000	181.00	12,670,000	貸付有価証券 31,000株
東洋建設	36,600	456.00	16,689,600	
五洋建設	135,400	447.00	60,523,800	貸付有価証券

				60,300株
大林道路	14,000	735.00	10,290,000	
世紀東急工業	17,800	540.00	9,612,000	
福田組	18,000	770.00	13,860,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
住友林業	90,000	1,426.00	128,340,000	
日本基礎技術	14,600	449.00	6,555,400	貸付有価証券 5,900株(4,400株)
日成ビルド工業	34,000	291.00	9,894,000	貸付有価証券 14,000株
ヤマダ・エスバイエル ホーム	55,000	107.00	5,885,000	貸付有価証券 23,000株
巴コーポレーション	15,200	430.00	6,536,000	貸付有価証券 6,300株
パナホーム	46,000	891.00	40,986,000	
大和ハウス工業	357,400	2,680.50	958,010,700	
ライト工業	19,600	953.00	18,678,800	
積水ハウス	379,700	1,897.50	720,480,750	
日特建設	16,300	524.00	8,541,200	貸付有価証券 7,300株(3,800株)
北陸電気工事	6,000	896.00	5,376,000	
ユアテック	19,000	861.00	16,359,000	
西部電気工業	10,000	456.00	4,560,000	
四電工	10,000	453.00	4,530,000	
中電工	17,600	2,341.00	41,201,600	
関電工	56,000	759.00	42,504,000	
きんでん	81,000	1,693.00	137,133,000	
東京エネシス	14,000	1,154.00	16,156,000	
トーエネック	17,000	608.00	10,336,000	
住友電設	9,600	1,427.00	13,699,200	
日本電設工業	19,900	2,090.00	41,591,000	
協和エクシオ	51,800	1,424.00	73,763,200	
新日本空調	10,300	1,023.00	10,536,900	貸付有価証券 800株
N D S	20,000	301.00	6,020,000	
九電工	22,000	1,705.00	37,510,000	
三機工業	24,800	982.00	24,353,600	
日揮	123,000	2,514.00	309,222,000	貸付有価証券

				6,000株(6,000株)
中外炉工業	37,000	287.00	10,619,000	貸付有価証券 13,000株(13,000株)
ヤマト	11,000	415.00	4,565,000	
太平電業	17,000	1,114.00	18,938,000	
高砂熱学工業	33,600	1,507.00	50,635,200	
三晃金属工業	12,000	252.00	3,024,000	
朝日工業社	14,000	441.00	6,174,000	
明星工業	20,100	604.00	12,140,400	
大気社	17,400	3,250.00	56,550,000	
ダイダン	16,000	838.00	13,408,000	
日比谷総合設備	15,700	1,624.00	25,496,800	
東芝プラントシステム	19,800	1,600.00	31,680,000	
OSJBホールディングス	16,600	250.00	4,150,000	貸付有価証券 7,300株
東洋エンジニアリング	59,000	342.00	20,178,000	貸付有価証券 25,000株(1,000株)
千代田化工建設	88,000	1,117.00	98,296,000	
新興プランテック	25,100	971.00	24,372,100	
日本製粉	75,000	598.00	44,850,000	
日清製粉グループ本社	133,800	1,393.00	186,383,400	
日東富士製粉	10,000	329.00	3,290,000	
昭和産業	50,000	492.00	24,600,000	
鳥越製粉	9,700	713.00	6,916,100	貸付有価証券 200株
中部飼料	11,700	781.00	9,137,700	
フィード・ワンホールディングス	73,400	120.00	8,808,000	
東洋精糖	18,000	102.00	1,836,000	
日本甜菜製糖	62,000	198.00	12,276,000	
三井製糖	48,000	437.00	20,976,000	
塩水港精糖	13,000	261.00	3,393,000	
森永製菓	110,000	402.00	44,220,000	
中村屋	28,000	490.00	13,720,000	
江崎グリコ	28,200	5,140.00	144,948,000	
名糖産業	5,400	1,225.00	6,615,000	
不二家	70,000	193.00	13,510,000	
山崎製パン	89,000	2,034.00	181,026,000	貸付有価証券



				3,000株(3,000株)
第一屋製パン	16,000	123.00	1,968,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
モロゾフ	19,000	381.00	7,239,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
亀田製菓	6,800	4,810.00	32,708,000	
寿スピリッツ	2,900	2,522.00	7,313,800	貸付有価証券 1,000株
カルビー	45,200	4,715.00	213,118,000	
森永乳業	109,000	437.00	47,633,000	
六甲バター	5,400	1,280.00	6,912,000	貸付有価証券 700株(700株)
ヤクルト本社	65,400	7,490.00	489,846,000	
明治ホールディングス	36,100	13,600.00	490,960,000	
雪印メグミルク	28,700	1,433.00	41,127,100	
プリマハム	68,000	376.00	25,568,000	
日本ハム	90,000	2,620.00	235,800,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
伊藤ハム	67,000	650.00	43,550,000	貸付有価証券 27,000株(27,000株)
林兼産業	39,000	105.00	4,095,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
丸大食品	63,000	431.00	27,153,000	
米久	3,900	1,829.00	7,133,100	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
S Foods	7,600	2,175.00	16,530,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
サッポロホールディングス	200,000	464.00	92,800,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
アサヒグループホールディングス	245,300	3,926.00	963,047,800	
キリンホールディングス	494,600	1,685.00	833,401,000	
宝ホールディングス	95,700	915.00	87,565,500	
オエノンホールディングス	31,000	222.00	6,882,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
養命酒製造	8,000	990.00	7,920,000	
コカ・コーラウエスト	41,300	2,024.00	83,591,200	
コカ・コーライースト ジャパン	37,100	2,224.00	82,510,400	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
サントリー食品インター	73,200	5,120.00	374,784,000	

ナショナル				
ダイトードリンコ	6,200	4,995.00	30,969,000	
伊藤園	36,200	2,486.00	89,993,200	貸付有価証券 16,100株（1,600株）
キーコーヒー	10,700	1,825.00	19,527,500	
ユニカフェ	3,300	897.00	2,960,100	
ジャパンフーズ	1,600	1,116.00	1,785,600	貸付有価証券 700株
日清オイリオグループ	59,000	448.00	26,432,000	
不二製油	32,600	1,871.00	60,994,600	
かどや製油	1,200	2,665.00	3,198,000	貸付有価証券 400株
J - オイルミルズ	51,000	412.00	21,012,000	
キッコーマン	100,000	3,355.00	335,500,000	
味の素	281,000	2,608.00	732,848,000	
キュービー	62,100	2,857.00	177,419,700	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
ハウス食品グループ本社	45,200	2,422.00	109,474,400	
カゴメ	47,200	1,871.00	88,311,200	貸付有価証券 21,000株（11,600株）
焼津水産化学工業	5,700	1,010.00	5,757,000	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
アリアケジャパン	11,100	3,850.00	42,735,000	
エバラ食品工業	2,000	2,050.00	4,100,000	貸付有価証券 900株
ニチレイ	130,000	645.00	83,850,000	
東洋水産	63,800	4,210.00	268,598,000	貸付有価証券 5,000株
イトアンド	1,300	1,855.00	2,411,500	貸付有価証券 600株
日清食品ホールディングス	51,600	5,830.00	300,828,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
永谷園	12,000	1,102.00	13,224,000	
一正蒲鉾	4,200	1,041.00	4,372,200	貸付有価証券 800株
フジッコ	12,000	1,943.00	23,316,000	
ロック・フィールド	6,300	2,472.00	15,573,600	貸付有価証券 200株（200株）
日本たばこ産業	676,500	4,268.00	2,887,302,000	貸付有価証券 11,100株（11,100株）

ケンコーマヨネーズ	4,000	1,595.00	6,380,000	
わらべや日洋	7,200	2,799.00	20,152,800	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
なとり	5,600	1,482.00	8,299,200	貸付有価証券 2,400株(1,800株)
ユーグレナ	40,800	1,835.00	74,868,000	貸付有価証券 18,100株(11,700株)
ミヨシ油脂	42,000	143.00	6,006,000	
理研ビタミン	3,600	4,110.00	14,796,000	貸付有価証券 100株
片倉工業	14,300	1,298.00	18,561,400	貸付有価証券 1,000株
グンゼ	92,000	334.00	30,728,000	
東洋紡	452,000	188.00	84,976,000	
ユニチカ	332,000	57.00	18,924,000	
富士紡ホールディングス	55,000	306.00	16,830,000	
日清紡ホールディングス	73,000	1,249.00	91,177,000	
倉敷紡績	117,000	237.00	27,729,000	
シキボウ	66,000	126.00	8,316,000	
日本毛織	36,000	898.00	32,328,000	貸付有価証券 15,000株
大東紡織	17,000	74.00	1,258,000	
トーア紡コーポレーション	51,000	74.00	3,774,000	
ダイドーリミテッド	12,800	520.00	6,656,000	貸付有価証券 5,300株
帝国繊維	11,900	1,704.00	20,277,600	貸付有価証券 5,300株(5,200株)
帝人	466,000	436.00	203,176,000	
東レ	883,000	1,026.00	905,958,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
サカイオーベックス	30,000	199.00	5,970,000	
住江織物	29,000	314.00	9,106,000	
日本フェルト	6,000	520.00	3,120,000	
イチカワ	8,000	299.00	2,392,000	
日本バイリーン	16,000	603.00	9,648,000	
日東製網	13,000	163.00	2,119,000	貸付有価証券 2,000株
芦森工業	25,000	162.00	4,050,000	貸付有価証券

				3,000株
アツギ	95,000	122.00	11,590,000	
ダイニック	22,000	185.00	4,070,000	
セーレン	28,400	1,271.00	36,096,400	
東海染工	16,000	129.00	2,064,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
小松精練	19,000	579.00	11,001,000	貸付有価証券 2,600株
ワコールホールディングス	68,000	1,410.00	95,880,000	
ホギメディカル	7,200	5,930.00	42,696,000	貸付有価証券 100株(100株)
レナウン	27,400	200.00	5,480,000	貸付有価証券 12,200株(7,000株)
クラウドシア	2,900	627.00	1,818,300	貸付有価証券 1,100株
T S Iホールディングス	50,900	859.00	43,723,100	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
三陽商会	60,000	305.00	18,300,000	貸付有価証券 18,000株(13,000株)
ナイガイ	42,000	63.00	2,646,000	貸付有価証券 12,000株
オンワードホールディングス	82,000	812.00	66,584,000	
ルック	19,000	232.00	4,408,000	貸付有価証券 2,000株
キムラタン	508,000	9.00	4,572,000	貸付有価証券 112,000株(49,000株)
ゴールドウイン	26,000	835.00	21,710,000	
デサント	26,000	1,570.00	40,820,000	
キング	5,700	429.00	2,445,300	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
ヤマトインターナショナル	7,400	421.00	3,115,400	貸付有価証券 2,900株(100株)
特種東海製紙	66,000	276.00	18,216,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
王子ホールディングス	468,000	539.00	252,252,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
日本製紙	55,000	2,092.00	115,060,000	貸付有価証券 24,400株
三菱製紙	174,000	91.00	15,834,000	貸付有価証券

				76,000株(76,000株)
北越紀州製紙	70,800	654.00	46,303,200	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
中越パルプ工業	43,000	255.00	10,965,000	貸付有価証券 19,000株(15,000株)
巴川製紙所	18,000	249.00	4,482,000	貸付有価証券 8,000株(6,000株)
大王製紙	51,000	1,292.00	65,892,000	
レンゴー	101,000	535.00	54,035,000	
トーモク	36,000	285.00	10,260,000	
ザ・パック	8,100	2,558.00	20,719,800	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
クラレ	194,200	1,628.00	316,157,600	貸付有価証券 3,500株(2,500株)
旭化成	712,000	1,143.00	813,816,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
共和レザー	7,500	844.00	6,330,000	
コープケミカル	17,000	93.00	1,581,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
昭和電工	760,000	158.00	120,080,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
住友化学	840,000	668.00	561,120,000	
日本化成	21,000	159.00	3,339,000	
住友精化	24,000	927.00	22,248,000	
日産化学工業	74,800	2,544.00	190,291,200	
ラサ工業	43,000	142.00	6,106,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
クレハ	80,000	553.00	44,240,000	貸付有価証券 35,000株(15,000株)
多木化学	7,000	724.00	5,068,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
テイカ	19,000	458.00	8,702,000	
石原産業	191,000	118.00	22,538,000	
片倉チッカリン	7,000	290.00	2,030,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
日本曹達	73,000	758.00	55,334,000	
東ソー	285,000	728.00	207,480,000	
トクヤマ	177,000	272.00	48,144,000	貸付有価証券 79,000株
セントラル硝子	116,000	556.00	64,496,000	

東亜合成	143,000	551.00	78,793,000	
ダイソー	45,000	433.00	19,485,000	
関東電化工業	27,000	781.00	21,087,000	貸付有価証券 12,000株(11,000株)
電気化学工業	236,000	491.00	115,876,000	
信越化学工業	204,600	7,459.00	1,526,111,400	貸付有価証券 800株(800株)
日本カーバイド工業	39,000	233.00	9,087,000	貸付有価証券 17,000株
堺化学工業	46,000	400.00	18,400,000	
エア・ウォーター	101,000	2,103.00	212,403,000	
大陽日酸	146,500	1,429.00	209,348,500	貸付有価証券 29,200株(11,000株)
日本化学工業	42,000	272.00	11,424,000	
日本パーカライジング	53,800	1,395.00	75,051,000	
高圧ガス工業	17,000	636.00	10,812,000	
チタン工業	13,000	233.00	3,029,000	貸付有価証券 5,000株
四国化成工業	16,000	1,082.00	17,312,000	
戸田工業	23,000	427.00	9,821,000	貸付有価証券 10,000株
ステラ ケミファ	5,800	1,348.00	7,818,400	貸付有価証券 200株(200株)
保土谷化学工業	34,000	205.00	6,970,000	貸付有価証券 1,000株
日本触媒	90,000	1,614.00	145,260,000	貸付有価証券 1,000株
大日精化工業	47,000	640.00	30,080,000	
カネカ	154,000	851.00	131,054,000	
三菱瓦斯化学	196,000	702.00	137,592,000	
三井化学	519,000	395.00	205,005,000	
J S R	112,700	2,036.00	229,457,200	
東京応化工業	23,600	3,675.00	86,730,000	
大阪有機化学工業	8,100	533.00	4,317,300	
三菱ケミカルホールディングス	713,300	750.80	535,545,640	
日本合成化学工業	27,000	945.00	25,515,000	
ダイセル	160,500	1,475.00	236,737,500	
住友ベークライト	107,000	537.00	57,459,000	

積水化学工業	264,000	1,621.00	427,944,000	
日本ゼオン	98,000	1,116.00	109,368,000	
アイカ工業	34,300	2,697.00	92,507,100	
宇部興産	575,000	200.00	115,000,000	
積水樹脂	17,600	1,587.00	27,931,200	
タキロン	24,000	556.00	13,344,000	
旭有機材工業	40,000	272.00	10,880,000	
日立化成	56,400	2,325.00	131,130,000	
ニチバン	11,000	476.00	5,236,000	
リケンテクノス	18,400	462.00	8,500,800	
大倉工業	27,000	368.00	9,936,000	
積水化成成品工業	32,000	467.00	14,944,000	
群栄化学工業	30,000	340.00	10,200,000	貸付有価証券 13,000株
タイガースポリマー	5,600	818.00	4,580,800	
ミライアル	4,100	1,464.00	6,002,400	貸付有価証券 1,800株
ダイキアクシス	1,700	1,075.00	1,827,500	
ダイキョーニシカワ	3,700	3,615.00	13,375,500	
日本化薬	74,000	1,475.00	109,150,000	
カーリットホールディングス	9,100	639.00	5,814,900	
日本精化	9,400	1,019.00	9,578,600	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
A D E K A	52,600	1,673.00	87,999,800	
日油	93,000	996.00	92,628,000	
新日本理化	18,000	223.00	4,014,000	貸付有価証券 8,000株
ハリマ化成グループ	9,700	478.00	4,636,600	
花王	306,800	5,621.00	1,724,522,800	
第一工業製薬	25,000	358.00	8,950,000	貸付有価証券 2,000株
三洋化成工業	36,000	875.00	31,500,000	
大日本塗料	65,000	161.00	10,465,000	
日本ペイントホールディングス	98,700	4,140.00	408,618,000	
関西ペイント	138,000	2,114.00	291,732,000	
神東塗料	8,000	221.00	1,768,000	

中国塗料	33,000	1,078.00	35,574,000	
日本特殊塗料	8,800	828.00	7,286,400	
藤倉化成	15,500	557.00	8,633,500	
太陽ホールディングス	9,300	4,740.00	44,082,000	
D I C	457,000	362.00	165,434,000	
サカタインクス	23,300	1,187.00	27,657,100	
東洋インキ S C ホール ディングス	113,000	581.00	65,653,000	
T & K T O K A	3,800	2,350.00	8,930,000	
富士フィルムホールディ ングス	261,100	4,557.00	1,189,832,700	
資生堂	202,900	2,154.50	437,148,050	貸付有価証券 5,400株(5,100株)
ライオン	132,000	778.00	102,696,000	貸付有価証券 58,000株(56,000株)
高砂香料工業	37,000	553.00	20,461,000	
マンダム	11,400	4,390.00	50,046,000	
ミルボン	6,700	3,860.00	25,862,000	
ファンケル	26,500	1,561.00	41,366,500	貸付有価証券 11,800株(10,600株)
コーセー	18,400	7,410.00	136,344,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
コタ	3,900	1,394.00	5,436,600	
ドクターシーラボ	7,700	4,260.00	32,802,000	
シーボン	1,300	2,777.00	3,610,100	貸付有価証券 500株(500株)
ポーラ・オルビスホール ディングス	13,600	6,250.00	85,000,000	貸付有価証券 5,900株(5,800株)
ノエビアホールディ ングス	7,200	2,507.00	18,050,400	
アジュバンコスメジャ パン	2,100	864.00	1,814,400	貸付有価証券 700株(700株)
エステー	7,800	1,066.00	8,314,800	
アグロ カネショウ	3,100	871.00	2,700,100	
コニシ	8,900	2,237.00	19,909,300	
長谷川香料	14,400	1,793.00	25,819,200	
星光 P M C	6,200	1,108.00	6,869,600	貸付有価証券 2,700株(100株)
小林製薬	18,700	8,020.00	149,974,000	



荒川化学工業	9,600	1,384.00	13,286,400	
メック	8,800	875.00	7,700,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
日本高純度化学	3,200	2,482.00	7,942,400	
J C U	3,100	5,000.00	15,500,000	
新田ゼラチン	6,800	808.00	5,494,400	貸付有価証券 3,000株(2,000株)
アース製薬	8,200	4,365.00	35,793,000	
イハラケミカル工業	17,500	1,607.00	28,122,500	貸付有価証券 7,800株(7,800株)
北興化学工業	12,000	436.00	5,232,000	
大成ラミック	3,200	2,813.00	9,001,600	貸付有価証券 1,400株(1,100株)
クミアイ化学工業	23,500	1,019.00	23,946,500	
日本農薬	26,100	1,196.00	31,215,600	
アキレス	97,000	156.00	15,132,000	
有沢製作所	19,200	1,030.00	19,776,000	
日東電工	88,200	8,315.00	733,383,000	
レック	3,900	1,463.00	5,705,700	
きもと	20,400	296.00	6,038,400	
藤森工業	9,800	3,715.00	36,407,000	
前澤化成工業	8,000	1,217.00	9,736,000	
J S P	8,500	2,109.00	17,926,500	
エフピコ	10,100	4,320.00	43,632,000	貸付有価証券 2,700株
天馬	8,800	1,957.00	17,221,600	
信越ポリマー	22,400	588.00	13,171,200	
東リ	29,000	307.00	8,903,000	
ニフコ	25,500	4,455.00	113,602,500	貸付有価証券 11,300株
日本バルカー工業	47,000	312.00	14,664,000	
ユニ・チャーム	231,000	2,722.00	628,782,000	
協和発酵キリン	136,000	1,722.00	234,192,000	
武田薬品工業	427,500	6,207.00	2,653,492,500	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
アステラス製薬	1,299,400	1,813.00	2,355,812,200	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
大日本住友製薬	80,700	1,372.00	110,720,400	貸付有価証券 35,900株

塩野義製薬	178,100	4,190.00	746,239,000	
田辺三菱製薬	132,900	2,041.00	271,248,900	
わかもと製薬	13,000	294.00	3,822,000	
あすか製薬	13,400	1,225.00	16,415,000	
日本新薬	26,000	3,975.00	103,350,000	
ピオフェルミン製薬	1,800	2,859.00	5,146,200	
中外製薬	113,600	3,750.00	426,000,000	貸付有価証券 800株(800株)
科研製薬	39,000	4,170.00	162,630,000	
エーザイ	150,500	8,001.00	1,204,150,500	貸付有価証券 300株(300株)
ロート製薬	51,900	1,770.00	91,863,000	貸付有価証券 1,700株
小野薬品工業	51,800	12,990.00	672,882,000	
久光製薬	32,200	5,080.00	163,576,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
有機合成薬品工業	7,000	274.00	1,918,000	
持田製薬	7,900	8,140.00	64,306,000	
参天製薬	209,700	1,572.00	329,648,400	
扶桑薬品工業	38,000	296.00	11,248,000	
日本ケミファ	14,000	602.00	8,428,000	
ツムラ	35,900	2,881.00	103,427,900	貸付有価証券 16,000株
日医工	26,700	2,573.00	68,699,100	
キッセイ薬品工業	21,200	3,615.00	76,638,000	
生化学工業	21,800	2,024.00	44,123,200	貸付有価証券 1,400株
栄研化学	9,600	2,357.00	22,627,200	
日水製薬	4,600	1,404.00	6,458,400	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
鳥居薬品	7,800	3,230.00	25,194,000	
JCRファーマ	8,800	2,922.00	25,713,600	貸付有価証券 2,800株(2,600株)
東和薬品	5,800	6,300.00	36,540,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
富士製薬工業	3,200	2,212.00	7,078,400	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	18,100	6,780.00	122,718,000	
ゼリア新薬工業	23,400	1,868.00	43,711,200	

第一三共	383,700	2,081.50	798,671,550	貸付有価証券 170,400株
キョーリン製薬ホールディングス	30,400	2,815.00	85,576,000	
大幸薬品	5,100	1,883.00	9,603,300	
ダイト	5,100	2,375.00	12,112,500	
大塚ホールディングス	226,400	3,807.50	862,018,000	
大正製薬ホールディングス	27,400	8,490.00	232,626,000	貸付有価証券 2,100株
日本コークス工業	102,300	118.00	12,071,400	
昭和シェル石油	102,000	1,180.00	120,360,000	
コスモ石油	315,000	181.00	57,015,000	貸付有価証券 43,000株（43,000株）
ニチレキ	14,000	1,045.00	14,630,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
東燃ゼネラル石油	172,000	1,148.00	197,456,000	貸付有価証券 3,000株
ユシロ化学工業	6,100	1,570.00	9,577,000	
ピーピー・カストロール	4,700	1,379.00	6,481,300	貸付有価証券 1,000株
富士石油	26,400	413.00	10,903,200	
MORESCO	2,900	2,209.00	6,406,100	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
出光興産	54,100	2,378.00	128,649,800	
JXホールディングス	1,266,100	528.80	669,513,680	
横浜ゴム	126,000	1,265.00	159,390,000	
東洋ゴム工業	51,600	2,301.00	118,731,600	
ブリヂストン	357,500	4,911.50	1,755,861,250	貸付有価証券 4,800株（4,800株）
住友ゴム工業	89,000	2,022.00	179,958,000	貸付有価証券 23,300株（23,300株）
藤倉ゴム工業	9,500	740.00	7,030,000	貸付有価証券 1,900株
オカモト	39,000	469.00	18,291,000	
フコク	4,800	1,222.00	5,865,600	
ニッタ	11,300	3,280.00	37,064,000	
住友理工	21,100	1,058.00	22,323,800	
三ツ星ベルト	28,000	951.00	26,628,000	
バンドー化学	42,000	482.00	20,244,000	

日東紡績	84,000	466.00	39,144,000	
旭硝子	562,000	789.00	443,418,000	
日本板硝子	550,000	121.00	66,550,000	貸付有価証券 220,000株
石塚硝子	15,000	260.00	3,900,000	貸付有価証券 6,000株
日本山村硝子	45,000	176.00	7,920,000	
日本電気硝子	219,000	662.00	144,978,000	貸付有価証券 67,000株
オハラ	4,300	613.00	2,635,900	貸付有価証券 1,700株
住友大阪セメント	212,000	409.00	86,708,000	
太平洋セメント	712,000	386.00	274,832,000	
デイ・シイ	11,700	457.00	5,346,900	
日本ヒューム	11,900	828.00	9,853,200	
日本コンクリート工業	19,500	489.00	9,535,500	貸付有価証券 9,000株
三谷セキサン	5,700	1,836.00	10,465,200	
ジャパンパイル	15,200	689.00	10,472,800	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	99,000	357.00	35,343,000	
日本カーボン	60,000	383.00	22,980,000	
東洋炭素	6,300	2,285.00	14,395,500	貸付有価証券 2,700株（1,000株）
ノリタケカンパニーリミ テド	64,000	285.00	18,240,000	
TOTO	168,000	1,812.00	304,416,000	
日本碍子	144,000	2,726.00	392,544,000	
日本特殊陶業	98,300	3,360.00	330,288,000	
ダントーホールディング ス	15,000	161.00	2,415,000	貸付有価証券 6,000株（6,000株）
MARUWA	3,300	2,886.00	9,523,800	
品川リフラクトリーズ	29,000	304.00	8,816,000	
黒崎播磨	25,000	251.00	6,275,000	
ヨータイ	6,000	397.00	2,382,000	貸付有価証券 1,000株
イソライト工業	5,600	243.00	1,360,800	
東京窯業	14,000	215.00	3,010,000	
ニッカトー	4,000	415.00	1,660,000	

フジインコーポレーテッド	11,000	2,105.00	23,155,000	貸付有価証券 400株
エーアンドエーマテリアル	24,000	122.00	2,928,000	
ニチアス	51,000	740.00	37,740,000	貸付有価証券 22,000株（22,000株）
ニチハ	15,100	1,371.00	20,702,100	
新日鐵住金	4,821,000	315.30	1,520,061,300	
神戸製鋼所	1,972,000	218.00	429,896,000	貸付有価証券 89,000株（89,000株）
中山製鋼所	85,000	89.00	7,565,000	貸付有価証券 10,000株
合同製鐵	58,000	205.00	11,890,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	290,900	2,726.50	793,138,850	
日新製鋼	48,300	1,687.00	81,482,100	
東京製鐵	57,700	834.00	48,121,800	
共英製鋼	12,100	2,093.00	25,325,300	貸付有価証券 1,400株（800株）
大和工業	26,000	2,827.00	73,502,000	貸付有価証券 4,500株
東京鐵鋼	22,000	537.00	11,814,000	
大阪製鐵	7,200	2,146.00	15,451,200	
淀川製鋼所	79,000	509.00	40,211,000	
東洋鋼鋳	27,300	574.00	15,670,200	
丸一鋼管	35,000	3,070.00	107,450,000	貸付有価証券 12,100株
モリ工業	18,000	400.00	7,200,000	
大同特殊鋼	191,000	560.00	106,960,000	貸付有価証券 40,000株（40,000株）
日本高周波鋼業	45,000	121.00	5,445,000	貸付有価証券 19,000株
日本冶金工業	89,100	241.00	21,473,100	貸付有価証券 39,700株
山陽特殊製鋼	68,000	596.00	40,528,000	
愛知製鋼	67,000	576.00	38,592,000	
日立金属	116,000	1,872.00	217,152,000	
日本金属	29,000	151.00	4,379,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
大平洋金属	73,000	364.00	26,572,000	貸付有価証券

				32,000株(6,000株)
新日本電工	69,500	296.00	20,572,000	
栗本鐵工所	59,000	222.00	13,098,000	
虹技	16,000	221.00	3,536,000	
日本鑄鉄管	11,000	224.00	2,464,000	
三菱製鋼	74,000	271.00	20,054,000	
日亜鋼業	15,800	340.00	5,372,000	
日本精線	9,000	620.00	5,580,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	11,800	569.00	6,714,200	
新家工業	22,000	191.00	4,202,000	
大紀アルミニウム工業所	19,000	381.00	7,239,000	貸付有価証券 1,000株
日本軽金属ホールディング グス	276,600	192.00	53,107,200	貸付有価証券 5,500株
三井金属鉱業	310,000	328.00	101,680,000	
東邦亜鉛	64,000	426.00	27,264,000	
三菱マテリアル	712,000	448.00	318,976,000	
住友金属鉱山	315,000	1,830.50	576,607,500	
DOWAホールディング ス	136,000	1,129.00	153,544,000	
古河機械金属	178,000	214.00	38,092,000	貸付有価証券 1,000株
大阪チタニウムテクノ ロジーズ	11,200	2,703.00	30,273,600	貸付有価証券 200株
東邦チタニウム	19,300	1,184.00	22,851,200	貸付有価証券 200株
UACJ	130,000	357.00	46,410,000	
古河電気工業	335,000	231.00	77,385,000	
住友電気工業	429,700	1,680.00	721,896,000	
フジクラ	159,000	634.00	100,806,000	貸付有価証券 43,000株(43,000株)
昭和電線ホールディング ス	125,000	94.00	11,750,000	貸付有価証券 55,000株
東京特殊電線	1,600	1,382.00	2,211,200	貸付有価証券 300株
タツタ電線	21,400	523.00	11,192,200	貸付有価証券 100株
沖電線	12,000	320.00	3,840,000	貸付有価証券 5,000株

カナレ電気	1,800	2,196.00	3,952,800	
平河ヒューテック	2,700	1,401.00	3,782,700	貸付有価証券 200株
リヨービ	64,000	404.00	25,856,000	
アーレスティ	13,200	917.00	12,104,400	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
アサヒホールディングス	17,200	2,309.00	39,714,800	
稲葉製作所	6,100	1,473.00	8,985,300	貸付有価証券 500株
宮地エンジニアリンググループ	33,000	196.00	6,468,000	貸付有価証券 14,000株
トーカロ	7,500	2,606.00	19,545,000	
アルファC o	3,800	1,311.00	4,981,800	
SUMCO	88,800	1,892.00	168,009,600	貸付有価証券 39,200株(5,600株)
川田テクノロジーズ	2,200	3,770.00	8,294,000	貸付有価証券 900株
東洋製罐グループホールディングス	81,000	1,850.00	149,850,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ホッカンホールディングス	27,000	295.00	7,965,000	
コロナ	6,000	1,150.00	6,900,000	
横河ブリッジホールディングス	21,600	1,347.00	29,095,200	
駒井ハルテック	20,000	253.00	5,060,000	
高田機工	10,000	246.00	2,460,000	
三和ホールディングス	107,300	895.00	96,033,500	
文化シャッター	31,700	1,103.00	34,965,100	貸付有価証券 2,000株
三協立山	14,900	2,422.00	36,087,800	
アルインコ	4,800	1,155.00	5,544,000	貸付有価証券 2,100株
東洋シャッター	2,800	920.00	2,576,000	
LIXILグループ	169,400	2,364.00	400,461,600	貸付有価証券 5,900株
日本ファイルコン	8,200	506.00	4,149,200	
ノーリツ	22,300	2,102.00	46,874,600	貸付有価証券 900株(900株)
長府製作所	12,200	2,852.00	34,794,400	貸付有価証券 1,300株

リンナイ	21,200	9,140.00	193,768,000	貸付有価証券 500株
ダイニチ工業	5,800	795.00	4,611,000	
日東精工	16,000	382.00	6,112,000	
三洋工業	14,000	214.00	2,996,000	
岡部	22,400	1,013.00	22,691,200	貸付有価証券 8,400株（8,400株）
ジーテクト	10,400	1,169.00	12,157,600	
中国工業	1,700	841.00	1,429,700	貸付有価証券 100株
東ブレ	21,900	1,964.00	43,011,600	
高周波熱錬	19,700	915.00	18,025,500	
東京製綱	77,000	198.00	15,246,000	
サンコール	7,000	656.00	4,592,000	
モリテック スチール	5,700	316.00	1,801,200	
パイオラックス	5,800	5,350.00	31,030,000	
日本発條	99,100	1,366.00	135,370,600	貸付有価証券 12,900株（8,200株）
中央発條	15,000	325.00	4,875,000	
アドバネクス	21,000	175.00	3,675,000	
三益半導体工業	8,400	1,359.00	11,415,600	
日本ドライケミカル	1,600	2,361.00	3,777,600	
日本製鋼所	163,000	533.00	86,879,000	
三浦工業	50,900	1,365.00	69,478,500	貸付有価証券 300株（300株）
タクマ	36,000	931.00	33,516,000	
ツガミ	33,000	697.00	23,001,000	貸付有価証券 14,000株
オークマ	74,000	1,315.00	97,310,000	
東芝機械	62,000	537.00	33,294,000	
アマダホールディングス	169,900	1,205.00	204,729,500	
アイダエンジニアリング	24,900	1,385.00	34,486,500	
滝澤鉄工所	36,000	227.00	8,172,000	
富士機械製造	37,200	1,316.00	48,955,200	
牧野フライス製作所	57,000	1,143.00	65,151,000	貸付有価証券 8,000株（6,000株）
オーエスジー	51,900	2,448.00	127,051,200	貸付有価証券 23,100株（23,100株）



ダイジェット工業	13,000	218.00	2,834,000	
旭ダイヤモンド工業	31,200	1,524.00	47,548,800	貸付有価証券 11,800株
D M G 森精機	71,900	1,915.00	137,688,500	貸付有価証券 900株
ソディック	21,700	1,240.00	26,908,000	
ディスコ	13,300	11,060.00	147,098,000	
日東工器	6,600	2,470.00	16,302,000	
パンチ工業	4,000	1,274.00	5,096,000	
豊和工業	6,400	739.00	4,729,600	
大阪機工	44,000	162.00	7,128,000	貸付有価証券 19,000株
東洋機械金属	7,700	516.00	3,973,200	
津田駒工業	28,000	151.00	4,228,000	貸付有価証券 12,000株
エンシュウ	28,000	114.00	3,192,000	貸付有価証券 12,000株（3,000株）
島精機製作所	16,100	2,054.00	33,069,400	貸付有価証券 800株
日阪製作所	14,400	1,129.00	16,257,600	
やまびこ	4,500	5,080.00	22,860,000	
ペガサスミシン製造	10,000	605.00	6,050,000	貸付有価証券 4,000株
ナプテスコ	69,400	3,075.00	213,405,000	
三井海洋開発	11,400	1,998.00	22,777,200	貸付有価証券 5,100株
レオン自動機	8,600	579.00	4,979,400	
S M C	34,200	35,705.00	1,221,111,000	貸付有価証券 200株（200株）
新川	9,500	793.00	7,533,500	貸付有価証券 4,200株（4,100株）
ホソカワミクロン	19,000	627.00	11,913,000	
ユニオンツール	5,600	3,695.00	20,692,000	貸付有価証券 2,500株（100株）
オイレス工業	13,500	2,178.00	29,403,000	
日精エー・エス・ピー機 械	4,200	2,311.00	9,706,200	
サトーホールディングス	14,200	3,205.00	45,511,000	
日本エアーテック	3,400	637.00	2,165,800	貸付有価証券 1,400株

日精樹脂工業	8,300	1,167.00	9,686,100	
ワイエイシイ	4,600	689.00	3,169,400	
小松製作所	558,900	2,395.50	1,338,844,950	貸付有価証券 14,200株(14,200株)
住友重機械工業	312,000	766.00	238,992,000	
日立建機	50,900	2,133.00	108,569,700	貸付有価証券 11,200株
日工	16,000	509.00	8,144,000	
巴工業	4,300	1,731.00	7,443,300	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
井関農機	117,000	247.00	28,899,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
TOWA	9,300	721.00	6,705,300	貸付有価証券 700株(700株)
丸山製作所	24,000	231.00	5,544,000	
北川鉄工所	52,000	260.00	13,520,000	
クボタ	548,000	1,882.00	1,031,336,000	
荏原実業	3,400	1,454.00	4,943,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
三菱化工機	37,000	414.00	15,318,000	貸付有価証券 16,000株
月島機械	20,100	1,217.00	24,461,700	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
帝国電機製作所	7,600	1,109.00	8,428,400	
東京機械製作所	43,000	76.00	3,268,000	貸付有価証券 2,000株
新東工業	26,800	1,022.00	27,389,600	
澁谷工業	9,500	2,385.00	22,657,500	貸付有価証券 4,200株(500株)
アイチ コーポレーショ ン	16,100	674.00	10,851,400	
小森コーポレーション	27,700	1,507.00	41,743,900	
鶴見製作所	8,500	1,734.00	14,739,000	
住友精密工業	18,000	466.00	8,388,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
酒井重工業	22,000	292.00	6,424,000	
荏原製作所	236,000	549.00	129,564,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
石井鐵工所	17,000	221.00	3,757,000	貸付有価証券 3,000株

西島製作所	11,100	875.00	9,712,500	貸付有価証券 4,800株(1,300株)
北越工業	11,200	972.00	10,886,400	
ダイキン工業	158,600	8,035.00	1,274,351,000	
オルガノ	22,000	543.00	11,946,000	
トーヨーカネツ	66,000	234.00	15,444,000	
栗田工業	64,500	3,015.00	194,467,500	
椿本チエイン	58,000	1,039.00	60,262,000	
大同工業	22,000	263.00	5,786,000	
日本コンベヤ	35,000	207.00	7,245,000	貸付有価証券 15,000株
木村化工機	10,500	528.00	5,544,000	
アネスト岩田	17,000	747.00	12,699,000	
ダイフク	53,800	1,643.00	88,393,400	
サムコ	1,600	1,148.00	1,836,800	貸付有価証券 700株
加藤製作所	24,000	779.00	18,696,000	
油研工業	21,000	256.00	5,376,000	
タダノ	53,000	1,695.00	89,835,000	
フジテック	31,700	1,350.00	42,795,000	
C K D	30,500	1,117.00	34,068,500	
キトー	11,900	1,112.00	13,232,800	貸付有価証券 5,300株
平和	23,600	2,594.00	61,218,400	
理想科学工業	13,200	2,096.00	27,667,200	
S A N K Y O	30,300	4,610.00	139,683,000	
日本金銭機械	10,000	1,737.00	17,370,000	貸付有価証券 4,400株(1,100株)
マースエンジニアリング	6,100	2,208.00	13,468,800	貸付有価証券 600株
福島工業	6,000	2,011.00	12,066,000	
オーイズミ	3,800	879.00	3,340,200	貸付有価証券 1,700株(100株)
ダイコク電機	4,500	1,867.00	8,401,500	貸付有価証券 2,000株(1,300株)
竹内製作所	4,600	5,640.00	25,944,000	
アマノ	36,300	1,630.00	59,169,000	
J U K I	81,000	368.00	29,808,000	貸付有価証券 19,000株

サンデンホールディングス	66,000	566.00	37,356,000	
蛇の目マシン工業	106,000	149.00	15,794,000	貸付有価証券 4,000株
マックス	17,000	1,324.00	22,508,000	
グローリー	34,800	3,360.00	116,928,000	
新晃工業	7,600	1,235.00	9,386,000	貸付有価証券 700株（400株）
大和冷機工業	15,700	828.00	12,999,600	
セガサミーホールディングス	117,100	1,675.00	196,142,500	貸付有価証券 23,200株（23,200株）
日本ピストンリング	42,000	233.00	9,786,000	貸付有価証券 16,000株（16,000株）
リケン	47,000	472.00	22,184,000	
T P R	12,200	3,340.00	40,748,000	
ホシザキ電機	23,900	7,100.00	169,690,000	
大豊工業	8,800	1,507.00	13,261,600	貸付有価証券 300株（300株）
日本精工	223,700	1,894.00	423,687,800	
N T N	252,000	649.00	163,548,000	貸付有価証券 6,000株（6,000株）
ジェイテクト	116,100	2,013.00	233,709,300	貸付有価証券 4,100株（4,100株）
不二越	101,000	687.00	69,387,000	
日本トムソン	37,000	700.00	25,900,000	
T H K	72,400	2,992.00	216,620,800	
ユースン精機	4,800	2,714.00	13,027,200	貸付有価証券 2,100株（1,000株）
前澤給装工業	4,100	1,538.00	6,305,800	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
イーグル工業	15,100	2,489.00	37,583,900	
前澤工業	8,000	389.00	3,112,000	
日本ピラー工業	11,900	1,088.00	12,947,200	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
キッツ	48,900	580.00	28,362,000	
日立工機	29,100	991.00	28,838,100	
マキタ	71,000	6,140.00	435,940,000	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
日立造船	85,200	664.00	56,572,800	貸付有価証券 9,300株

三菱重工業	1,826,000	715.10	1,305,772,600	貸付有価証券 11,000株（11,000株）
I H I	785,000	556.00	436,460,000	
イビデン	71,400	2,321.00	165,719,400	
コニカミノルタ	259,600	1,341.00	348,123,600	貸付有価証券 4,700株（4,700株）
ブラザー工業	140,800	1,905.00	268,224,000	貸付有価証券 1,700株
ミネベア	162,000	1,984.00	321,408,000	
日立製作所	2,616,000	824.30	2,156,368,800	貸付有価証券 16,000株（16,000株）
東芝	2,293,000	403.30	924,766,900	貸付有価証券 93,000株（93,000株）
三菱電機	1,089,000	1,594.50	1,736,410,500	
富士電機	303,000	567.00	171,801,000	
東洋電機製造	21,000	434.00	9,114,000	
安川電機	132,900	1,647.00	218,886,300	貸付有価証券 16,400株（13,500株）
シンフォニアテクノロ ジー	76,000	205.00	15,580,000	
明電舎	100,000	393.00	39,300,000	
オリジン電気	16,000	501.00	8,016,000	
山洋電気	24,000	996.00	23,904,000	
デンヨー	9,300	1,835.00	17,065,500	
東芝テック	78,000	648.00	50,544,000	
芝浦メカトロニクス	18,000	291.00	5,238,000	貸付有価証券 7,000株
マブチモーター	33,300	6,900.00	229,770,000	
日本電産	119,400	8,963.00	1,070,182,200	
東光高岳	5,500	1,604.00	8,822,000	貸付有価証券 100株（100株）
ダイヘン	60,000	583.00	34,980,000	
田淵電機	12,300	1,346.00	16,555,800	貸付有価証券 5,500株（4,100株）
ヤーマン	1,400	1,564.00	2,189,600	貸付有価証券 600株（600株）
J V C ケンウッド	79,900	362.00	28,923,800	貸付有価証券 28,200株
ミマキエンジニアリング	6,500	1,060.00	6,890,000	
第一精工	4,000	2,550.00	10,200,000	貸付有価証券

				1,700株(500株)
日新電機	25,500	800.00	20,400,000	
大崎電気工業	20,000	745.00	14,900,000	貸付有価証券 7,000株
オムロン	117,600	5,410.00	636,216,000	
日東工業	17,500	2,219.00	38,832,500	
I D E C	12,900	1,074.00	13,854,600	
不二電機工業	1,000	1,465.00	1,465,000	貸付有価証券 200株
ジーエス・ユアサコーポレーション	210,000	539.00	113,190,000	貸付有価証券 3,000株
サクサホールディングス	27,000	234.00	6,318,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
メルコホールディングス	6,000	2,507.00	15,042,000	貸付有価証券 2,000株
テクノメディカ	2,400	2,533.00	6,079,200	
日本電気	1,410,000	408.00	575,280,000	
富士通	1,050,000	670.20	703,710,000	貸付有価証券 87,000株(87,000株)
沖電気工業	383,000	249.00	95,367,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
岩崎通信機	48,000	94.00	4,512,000	
電気興業	31,000	566.00	17,546,000	
サンケン電気	55,000	919.00	50,545,000	
ナカヨ	11,000	361.00	3,971,000	
アイホン	6,300	2,049.00	12,908,700	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
ルネサスエレクトロニクス	56,400	956.00	53,918,400	貸付有価証券 25,100株
セイコーエプソン	148,700	2,193.00	326,099,100	
ワコム	85,800	505.00	43,329,000	貸付有価証券 38,200株
アルバック	18,400	2,031.00	37,370,400	貸付有価証券 2,200株
アクセル	5,000	1,588.00	7,940,000	貸付有価証券 2,200株(1,900株)
E I Z O	10,000	2,773.00	27,730,000	貸付有価証券 2,900株
ジャパンディスプレイ	223,700	480.00	107,376,000	
日本信号	30,000	1,167.00	35,010,000	

京三製作所	26,000	379.00	9,854,000	
能美防災	14,400	1,528.00	22,003,200	
ホーチキ	7,900	858.00	6,778,200	
エレコム	4,500	2,773.00	12,478,500	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
日本無線	23,000	391.00	8,993,000	貸付有価証券 10,000株
パナソニック	1,327,500	1,701.00	2,258,077,500	
シャープ	921,000	190.00	174,990,000	貸付有価証券 410,000株
アンリツ	65,400	846.00	55,328,400	貸付有価証券 5,500株
富士通ゼネラル	33,000	1,728.00	57,024,000	貸付有価証券 14,000株(14,000株)
日立国際電気	28,000	1,705.00	47,740,000	
ソニー	712,200	3,727.00	2,654,369,400	貸付有価証券 6,500株(6,500株)
T D K	65,700	8,850.00	581,445,000	
帝国通信工業	26,000	241.00	6,266,000	
ミツミ電機	38,500	939.00	36,151,500	
タムラ製作所	42,000	556.00	23,352,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
アルプス電気	86,000	2,973.00	255,678,000	
池上通信機	37,000	185.00	6,845,000	貸付有価証券 16,000株(2,000株)
パイオニア	163,700	229.00	37,487,300	
日本電波工業	9,800	994.00	9,741,200	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
鈴木	1,400	1,298.00	1,817,200	
日本トリム	2,600	3,765.00	9,789,000	貸付有価証券 1,100株(300株)
ローランド ディー . ジー .	4,400	3,175.00	13,970,000	
フォスター電機	12,800	3,015.00	38,592,000	
クラリオン	57,000	330.00	18,810,000	貸付有価証券 25,000株(1,000株)
S M K	32,000	491.00	15,712,000	
ヨコオ	8,500	739.00	6,281,500	
東光	26,000	351.00	9,126,000	貸付有価証券 11,000株(11,000株)

ティアック	59,000	55.00	3,245,000	貸付有価証券 25,000株
ホシデン	33,000	858.00	28,314,000	
ヒロセ電機	18,500	17,200.00	318,200,000	貸付有価証券 300株
日本航空電子工業	31,000	3,035.00	94,085,000	
TOA	11,700	1,278.00	14,952,600	貸付有価証券 5,100株（5,000株）
日立マクセル	21,600	1,934.00	41,774,400	貸付有価証券 1,900株
古野電気	12,900	945.00	12,190,500	貸付有価証券 600株
ユニデン	30,000	218.00	6,540,000	
アルパイン	26,000	2,400.00	62,400,000	貸付有価証券 400株
スミダコーポレーション	9,700	848.00	8,225,600	貸付有価証券 1,900株
アイコム	6,000	3,035.00	18,210,000	
リオン	4,100	1,600.00	6,560,000	
船井電機	11,000	1,392.00	15,312,000	貸付有価証券 200株
横河電機	109,000	1,440.00	156,960,000	
新電元工業	42,000	657.00	27,594,000	貸付有価証券 18,000株（13,000株）
アズビル	35,600	3,130.00	111,428,000	
東亜ディーケーケー	4,500	630.00	2,835,000	
日本光電工業	46,400	3,025.00	140,360,000	
チノー	3,900	1,186.00	4,625,400	貸付有価証券 1,300株
共和電業	13,300	487.00	6,477,100	
日本電子材料	4,700	811.00	3,811,700	
堀場製作所	20,100	4,680.00	94,068,000	
アドバンテスト	74,200	1,432.00	106,254,400	貸付有価証券 2,200株（700株）
小野測器	5,300	1,021.00	5,411,300	貸付有価証券 100株
エスベック	12,100	1,264.00	15,294,400	
パナソニック デバイス SUNX	9,500	840.00	7,980,000	
キーエンス	24,700	63,600.00	1,570,920,000	



日置電機	5,700	2,392.00	13,634,400	貸付有価証券 900株(900株)
シスメックス	84,400	6,430.00	542,692,000	
メガチップス	11,400	1,411.00	16,085,400	貸付有価証券 5,000株(4,100株)
OBARA GROUP	7,100	7,270.00	51,617,000	貸付有価証券 1,500株(1,400株)
澤藤電機	7,000	242.00	1,694,000	貸付有価証券 2,000株
コーセル	15,800	1,438.00	22,720,400	貸付有価証券 7,000株(6,600株)
新日本無線	8,000	578.00	4,624,000	
オブテックス	7,500	2,755.00	20,662,500	
千代田インテグレ	5,700	3,080.00	17,556,000	
レーザーテック	11,200	1,797.00	20,126,400	貸付有価証券 4,900株(4,800株)
スタンレー電気	78,200	2,686.00	210,045,200	
岩崎電気	37,000	276.00	10,212,000	貸付有価証券 10,000株
ウシオ電機	66,100	1,614.00	106,685,400	貸付有価証券 1,200株
岡谷電機産業	5,800	430.00	2,494,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
ヘリオス テクノ ホールディング	10,000	435.00	4,350,000	貸付有価証券 4,400株(4,300株)
日本セラミック	6,200	1,726.00	10,701,200	
遠藤照明	5,000	1,403.00	7,015,000	貸付有価証券 2,200株
日本デジタル研究所	9,200	1,800.00	16,560,000	
古河電池	8,000	891.00	7,128,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
双信電機	5,300	409.00	2,167,700	
山一電機	12,600	905.00	11,403,000	貸付有価証券 4,200株(3,900株)
図研	7,900	1,088.00	8,595,200	貸付有価証券 300株(300株)
日本電子	46,000	629.00	28,934,000	
カシオ計算機	109,200	2,295.00	250,614,000	貸付有価証券 48,400株
ファナック	113,400	25,475.00	2,888,865,000	
日本シイエムケイ	27,700	309.00	8,559,300	貸付有価証券

				300株(300株)
エンブラス	4,900	4,990.00	24,451,000	
大真空	20,000	322.00	6,440,000	貸付有価証券 8,000株
ローム	53,700	8,380.00	450,006,000	
浜松ホトニクス	85,000	3,525.00	299,625,000	
三井ハイテック	14,400	904.00	13,017,600	
新光電気工業	41,100	996.00	40,935,600	
京セラ	178,800	6,539.00	1,169,173,200	
太陽誘電	57,100	1,843.00	105,235,300	
村田製作所	114,300	18,060.00	2,064,258,000	
ユーシン	15,200	791.00	12,023,200	貸付有価証券 6,900株(6,000株)
双葉電子工業	18,600	2,069.00	38,483,400	
北陸電気工業	47,000	181.00	8,507,000	
ニチコン	34,300	1,123.00	38,518,900	
日本ケミコン	88,000	374.00	32,912,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
K O A	15,100	1,251.00	18,890,100	
市光工業	26,000	266.00	6,916,000	貸付有価証券 10,000株
小糸製作所	65,300	4,240.00	276,872,000	
ミツバ	20,000	2,820.00	56,400,000	
スター精密	20,700	1,959.00	40,551,300	
S C R E E Nホールディングス	103,000	842.00	86,726,000	
キャノン電子	10,000	2,427.00	24,270,000	
キャノン	631,600	4,262.50	2,692,195,000	
リコー	327,500	1,275.50	417,726,250	
M U T O Hホールディングス	15,000	437.00	6,555,000	貸付有価証券 6,000株
東京エレクトロン	91,600	7,082.00	648,711,200	貸付有価証券 10,900株
トヨタ紡織	38,100	1,806.00	68,808,600	貸付有価証券 15,300株
鬼怒川ゴム工業	25,000	599.00	14,975,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
ユニプレス	20,900	2,648.00	55,343,200	
豊田自動織機	99,200	6,760.00	670,592,000	

モリタホールディングス	19,000	1,186.00	22,534,000	貸付有価証券 1,300株
三櫻工業	13,800	882.00	12,171,600	
デンソー	269,100	5,999.00	1,614,330,900	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
東海理化電機製作所	28,700	2,980.00	85,526,000	
三井造船	422,000	215.00	90,730,000	
川崎重工業	791,000	601.00	475,391,000	
名村造船所	30,300	932.00	28,239,600	
サノヤホールディングス	13,200	257.00	3,392,400	
日本車輛製造	40,000	353.00	14,120,000	貸付有価証券 17,000株(8,000株)
ニチュ三菱フォークリフト	12,500	634.00	7,925,000	
近畿車輛	16,000	372.00	5,952,000	貸付有価証券 7,000株
日産自動車	1,529,000	1,256.00	1,920,424,000	
いすゞ自動車	344,400	1,628.50	560,855,400	
トヨタ自動車	1,502,900	8,235.00	12,376,381,500	貸付有価証券 25,500株(25,500株)
日野自動車	155,500	1,598.00	248,489,000	
三菱自動車工業	399,200	1,138.00	454,289,600	貸付有価証券 156,800株(156,800株)
エフテック	6,200	1,251.00	7,756,200	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
レシップホールディングス	3,600	872.00	3,139,200	貸付有価証券 400株
G M B	1,600	1,273.00	2,036,800	
ファルテック	1,600	1,641.00	2,625,600	
武蔵精密工業	11,600	2,566.00	29,765,600	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日産車体	47,900	1,591.00	76,208,900	
新明和工業	44,000	1,217.00	53,548,000	
極東開発工業	20,200	1,379.00	27,855,800	貸付有価証券 800株
日信工業	19,900	1,977.00	39,342,300	貸付有価証券 3,600株
トピー工業	90,000	301.00	27,090,000	

ティラド	42,000	259.00	10,878,000	
曙ブレーキ工業	46,000	415.00	19,090,000	貸付有価証券 20,500株
タチエス	17,300	1,937.00	33,510,100	
N O K	52,700	3,760.00	198,152,000	
フタバ産業	33,200	605.00	20,086,000	
カヤバ工業	122,000	441.00	53,802,000	
シロキ工業	24,000	397.00	9,528,000	貸付有価証券 1,000株
大同メタル工業	15,200	1,333.00	20,261,600	
プレス工業	54,000	528.00	28,512,000	貸付有価証券 18,200株
ミクニ	10,400	643.00	6,687,200	
カルソニックカンセイ	83,000	882.00	73,206,000	
太平洋工業	22,200	1,053.00	23,376,600	貸付有価証券 8,900株
ケーヒン	25,000	1,992.00	49,800,000	
河西工業	13,400	1,097.00	14,699,800	
アイシン精機	99,700	5,420.00	540,374,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
富士機工	12,600	608.00	7,660,800	
マツダ	324,600	2,501.50	811,986,900	
ダイハツ工業	130,000	1,740.00	226,200,000	貸付有価証券 57,800株(1,100株)
今仙電機製作所	9,300	1,480.00	13,764,000	
本田技研工業	980,300	4,210.50	4,127,553,150	貸付有価証券 7,800株(7,800株)
スズキ	227,700	3,827.50	871,521,750	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
富士重工業	370,700	4,266.00	1,581,406,200	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
安永	3,600	599.00	2,156,400	貸付有価証券 1,400株
ヤマハ発動機	165,700	2,871.00	475,724,700	
ショーワ	25,700	1,280.00	32,896,000	
T B K	13,900	580.00	8,062,000	
エクセディ	14,800	2,964.00	43,867,200	
豊田合成	35,200	2,865.00	100,848,000	貸付有価証券 15,600株(15,600株)

愛三工業	16,900	1,149.00	19,418,100	
盟和産業	9,000	152.00	1,368,000	
ヨロズ	10,200	2,493.00	25,428,600	
エフ・シー・シー	16,000	1,950.00	31,200,000	
シマノ	47,000	16,650.00	782,550,000	貸付有価証券 17,400株（17,400株）
タカタ	19,700	1,661.00	32,721,700	貸付有価証券 8,700株（500株）
テイ・エス テック	23,000	3,510.00	80,730,000	
ジャムコ	4,100	3,610.00	14,801,000	
テルモ	167,000	2,823.00	471,441,000	
クリエートメディック	3,600	1,043.00	3,754,800	
日機装	35,300	1,132.00	39,959,600	貸付有価証券 12,300株
島津製作所	130,000	1,412.00	183,560,000	貸付有価証券 2,000株
J M S	20,000	296.00	5,920,000	貸付有価証券 2,000株
クボテック	2,300	1,021.00	2,348,300	貸付有価証券 1,000株（900株）
ショットモリテックス	2,400	256.00	614,400	貸付有価証券 900株
長野計器	7,000	736.00	5,152,000	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
ブイ・テクノロジー	2,100	3,260.00	6,846,000	貸付有価証券 900株
東京計器	38,000	284.00	10,792,000	貸付有価証券 7,000株
愛知時計電機	14,000	344.00	4,816,000	貸付有価証券 6,000株
オーバル	10,600	304.00	3,222,400	貸付有価証券 3,200株（3,200株）
東京精密	19,600	2,636.00	51,665,600	
マニー	3,300	7,850.00	25,905,000	
ニコン	203,400	1,708.00	347,407,200	貸付有価証券 90,600株（1,700株）
トプコン	32,900	2,992.00	98,436,800	
オリンパス	162,300	4,085.00	662,995,500	
理研計器	9,600	1,420.00	13,632,000	
タムロン	8,400	2,875.00	24,150,000	

HOYA	259,200	4,594.50	1,190,894,400	貸付有価証券 15,200株(15,200株)
ノーリツ銅機	9,800	688.00	6,742,400	
エー・アンド・デイ	9,900	526.00	5,207,400	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
シチズンホールディングス	134,100	920.00	123,372,000	
リズム時計工業	48,000	173.00	8,304,000	
大研医器	7,500	1,294.00	9,705,000	貸付有価証券 3,300株(200株)
松風	5,300	1,313.00	6,958,900	貸付有価証券 2,300株
セイコーホールディングス	77,000	603.00	46,431,000	貸付有価証券 31,000株(8,000株)
ニプロ	69,600	1,177.00	81,919,200	
パラマウントベッドホールディングス	11,500	3,285.00	37,777,500	
トランザクション	800	1,188.00	950,400	
SHO-BI	3,600	403.00	1,450,800	
前田工織	12,000	1,057.00	12,684,000	貸付有価証券 5,300株(2,800株)
永大産業	15,000	451.00	6,765,000	
アートネイチャー	7,800	1,114.00	8,689,200	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
ダンロップスポーツ	6,900	1,240.00	8,556,000	
バンダイナムコホールディングス	120,100	2,481.00	297,968,100	
共立印刷	19,700	296.00	5,831,200	
フランスベッドホールディングス	76,000	178.00	13,528,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
パイロットコーポレーション	9,500	6,900.00	65,550,000	貸付有価証券 100株
萩原工業	2,300	2,058.00	4,733,400	
トッパン・フォームズ	19,400	1,515.00	29,391,000	
フジシールインターナショナル	13,200	3,415.00	45,078,000	貸付有価証券 5,500株
タカラトミー	39,100	750.00	29,325,000	貸付有価証券 17,400株(4,800株)
廣済堂	10,100	686.00	6,928,600	貸付有価証券 2,800株(2,400株)
As-meエステール	2,900	778.00	2,256,200	

アーク	34,400	133.00	4,575,200	貸付有価証券 13,600株(10,800株)
タカノ	4,800	708.00	3,398,400	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
プロネクサス	11,100	762.00	8,458,200	
ホクシン	8,600	132.00	1,135,200	
ウッドワン	18,000	275.00	4,950,000	
大建工業	44,000	286.00	12,584,000	
凸版印刷	308,000	1,017.00	313,236,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
大日本印刷	332,000	1,247.00	414,004,000	貸付有価証券 140,000株(140,000株)
図書印刷	18,000	388.00	6,984,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
共同印刷	34,000	381.00	12,954,000	貸付有価証券 6,000株
日本写真印刷	18,300	2,281.00	41,742,300	貸付有価証券 6,800株(1,100株)
光村印刷	10,000	268.00	2,680,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
宝印刷	5,700	1,092.00	6,224,400	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
アシックス	108,200	3,020.00	326,764,000	貸付有価証券 47,300株(3,300株)
ツツミ	5,400	2,760.00	14,904,000	
小松ウオール工業	3,300	2,581.00	8,517,300	
ヤマハ	80,100	2,309.00	184,950,900	
河合楽器製作所	3,800	2,552.00	9,697,600	貸付有価証券 1,400株
クリナップ	9,900	953.00	9,434,700	
ピジョン	61,700	3,160.00	194,972,000	
兼松日産農林	14,000	160.00	2,240,000	貸付有価証券 6,000株
キングジム	9,100	914.00	8,317,400	
リンテック	25,900	2,842.00	73,607,800	
T A S A K I	2,000	2,431.00	4,862,000	貸付有価証券 900株
イトーキ	22,900	720.00	16,488,000	貸付有価証券 200株(200株)

任天堂	67,100	20,595.00	1,381,924,500	貸付有価証券 5,200株（5,200株）
三菱鉛筆	9,000	4,925.00	44,325,000	
タカラスタンダード	45,000	994.00	44,730,000	
コクヨ	56,600	1,085.00	61,411,000	貸付有価証券 9,300株（9,300株）
ナカバヤシ	23,000	220.00	5,060,000	
グローブライド	53,000	192.00	10,176,000	貸付有価証券 4,000株
岡村製作所	41,800	1,017.00	42,510,600	
美津濃	58,000	640.00	37,120,000	
アデランス	12,600	1,100.00	13,860,000	貸付有価証券 300株
東京電力	924,000	512.00	473,088,000	貸付有価証券 128,900株（128,900株）
中部電力	333,300	1,658.50	552,778,050	
関西電力	444,500	1,243.00	552,513,500	
中国電力	150,600	1,762.00	265,357,200	
北陸電力	106,700	1,776.00	189,499,200	
東北電力	272,100	1,554.00	422,843,400	
四国電力	98,100	1,679.00	164,709,900	
九州電力	240,600	1,267.00	304,840,200	貸付有価証券 75,800株
北海道電力	101,900	1,175.00	119,732,500	貸付有価証券 1,000株
沖縄電力	7,100	4,735.00	33,618,500	
電源開発	79,000	4,015.00	317,185,000	
東京瓦斯	1,324,000	690.70	914,486,800	
大阪瓦斯	1,127,000	486.50	548,285,500	
東邦瓦斯	277,000	759.00	210,243,000	
北海道瓦斯	23,000	281.00	6,463,000	貸付有価証券 10,000株
広島ガス	17,200	456.00	7,843,200	
西部瓦斯	123,000	282.00	34,686,000	
静岡ガス	30,900	779.00	24,071,100	
メタウォーター	6,800	2,811.00	19,114,800	
SBSホールディングス	10,700	940.00	10,058,000	貸付有価証券 3,000株



東武鉄道	582,000	550.00	320,100,000	
相鉄ホールディングス	187,000	568.00	106,216,000	
東京急行電鉄	592,000	772.00	457,024,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
京浜急行電鉄	298,000	935.00	278,630,000	貸付有価証券 13,000株
小田急電鉄	349,000	1,154.00	402,746,000	
京王電鉄	304,000	896.00	272,384,000	
京成電鉄	163,000	1,404.00	228,852,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
富士急行	30,000	1,072.00	32,160,000	貸付有価証券 8,000株(3,000株)
新京成電鉄	14,000	405.00	5,670,000	
東日本旅客鉄道	199,600	10,970.00	2,189,612,000	
西日本旅客鉄道	104,800	6,826.00	715,364,800	貸付有価証券 100株
東海旅客鉄道	97,500	21,330.00	2,079,675,000	
西武ホールディングス	86,800	3,355.00	291,214,000	
鴻池運輸	13,500	1,287.00	17,374,500	
西日本鉄道	141,000	540.00	76,140,000	貸付有価証券 44,000株(44,000株)
ハマキョウレックス	3,400	4,940.00	16,796,000	
サカイ引越センター	1,900	3,995.00	7,590,500	貸付有価証券 200株(200株)
近鉄グループホールディングス	1,096,000	419.00	459,224,000	貸付有価証券 488,000株(217,000株)
阪急阪神ホールディングス	731,000	716.00	523,396,000	
南海電気鉄道	244,000	546.00	133,224,000	
京阪電気鉄道	244,000	687.00	167,628,000	貸付有価証券 102,000株
神戸電鉄	27,000	357.00	9,639,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
名糖運輸	4,500	732.00	3,294,000	貸付有価証券 900株
名古屋鉄道	397,000	469.00	186,193,000	貸付有価証券 67,000株(67,000株)
山陽電気鉄道	40,000	470.00	18,800,000	
日本通運	421,000	691.00	290,911,000	貸付有価証券

				7,000株(7,000株)
ヤマトホールディングス	191,500	2,516.00	481,814,000	貸付有価証券 100株
山九	132,000	556.00	73,392,000	
丸運	5,900	260.00	1,534,000	
丸全昭和運輸	37,000	417.00	15,429,000	
センコー	48,000	758.00	36,384,000	貸付有価証券 20,000株
トナミホールディングス	22,000	424.00	9,328,000	
日本梱包運輸倉庫	35,600	2,176.00	77,465,600	
日本石油輸送	12,000	247.00	2,964,000	
福山通運	66,000	682.00	45,012,000	貸付有価証券 29,000株(28,000株)
セイノーホールディングス	84,300	1,370.00	115,491,000	
神奈川中央交通	13,000	570.00	7,410,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日立物流	22,700	1,946.00	44,174,200	
日本郵船	920,000	377.00	346,840,000	
商船三井	571,000	410.00	234,110,000	貸付有価証券 53,000株
川崎汽船	477,000	312.00	148,824,000	
NSユナイテッド海運	47,000	269.00	12,643,000	貸付有価証券 2,000株
明治海運	9,700	380.00	3,686,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
飯野海運	56,400	605.00	34,122,000	
共栄タンカー	9,000	225.00	2,025,000	貸付有価証券 3,000株
第一中央汽船	126,000	42.00	5,292,000	貸付有価証券 35,000株(1,000株)
日本航空	208,600	4,015.00	837,529,000	
ANAホールディングス	2,141,000	327.60	701,391,600	
パスコ	10,000	333.00	3,330,000	貸付有価証券 4,000株
トランコム	3,100	5,640.00	17,484,000	貸付有価証券 400株
日新	41,000	330.00	13,530,000	
三菱倉庫	71,000	1,770.00	125,670,000	
三井倉庫ホールディング	63,000	418.00	26,334,000	

ス				
住友倉庫	80,000	682.00	54,560,000	
澁澤倉庫	28,000	354.00	9,912,000	
東陽倉庫	19,000	300.00	5,700,000	
乾汽船	7,300	1,027.00	7,497,100	貸付有価証券 3,200株
日本トランスシティ	25,000	389.00	9,725,000	
ケイヒン	20,000	191.00	3,820,000	
中央倉庫	6,300	953.00	6,003,900	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
安田倉庫	8,500	999.00	8,491,500	
東洋埠頭	34,000	200.00	6,800,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	8,800	556.00	4,892,800	
上組	130,000	1,188.00	154,440,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
サンリツ	2,600	545.00	1,417,000	
キムラユニティー	2,800	1,084.00	3,035,200	
キューソー流通システム	3,000	1,696.00	5,088,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
郵船ロジスティクス	10,000	1,508.00	15,080,000	
近鉄エクスプレス	9,700	5,630.00	54,611,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
東海運	5,900	288.00	1,699,200	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
エーアイテイー	5,000	1,188.00	5,940,000	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
内外トランスライン	1,200	2,192.00	2,630,400	
NEC ネットエスアイ	13,500	2,524.00	34,074,000	
システナ	10,500	920.00	9,660,000	
デジタルアーツ	5,700	1,246.00	7,102,200	
新日鉄住金ソリューションズ	9,000	4,000.00	36,000,000	
キューブシステム	4,700	648.00	3,045,600	
コア	4,500	877.00	3,946,500	貸付有価証券 2,000株（1,600株）
ソフトクリエイトホールディングス	3,500	961.00	3,363,500	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
ITホールディングス	35,600	2,557.00	91,029,200	
ネオス	2,900	684.00	1,983,600	貸付有価証券

				900株(800株)
電算システム	3,700	1,595.00	5,901,500	貸付有価証券 900株(600株)
グリー	65,100	774.00	50,387,400	貸付有価証券 28,600株(600株)
コーエーテクモホール ディングス	24,300	2,000.00	48,600,000	
三菱総合研究所	4,200	2,744.00	11,524,800	
ボルテージ	1,900	1,107.00	2,103,300	貸付有価証券 400株
電算	1,200	2,304.00	2,764,800	貸付有価証券 300株(200株)
A G S	1,700	1,025.00	1,742,500	貸付有価証券 700株
ファインデックス	6,200	1,521.00	9,430,200	貸付有価証券 2,700株(2,400株)
ヒト・コミュニケーショ ンズ	1,200	1,855.00	2,226,000	貸付有価証券 500株
ブレインパッド	1,600	1,145.00	1,832,000	貸付有価証券 700株(300株)
K L a b	11,400	1,404.00	16,005,600	貸付有価証券 5,000株(100株)
ポルトゥウィン・ピッ トクルーホールディ	7,100	1,031.00	7,320,100	貸付有価証券 2,600株(2,500株)
イーブックイニシアティ ブジャパン	2,400	1,012.00	2,428,800	貸付有価証券 1,100株(900株)
ネクソン	102,300	1,594.00	163,066,200	貸付有価証券 2,300株
アイスタイル	4,600	869.00	3,997,400	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
エムアップ	3,000	772.00	2,316,000	
エイチーム	3,900	2,544.00	9,921,600	貸付有価証券 1,700株(200株)
e n i s h	2,800	1,408.00	3,942,400	貸付有価証券 1,200株
コロプラ	29,500	2,556.00	75,402,000	貸付有価証券 13,100株(2,800株)
モバイルクリエイト	6,300	810.00	5,103,000	貸付有価証券 2,700株
オルトプラス	3,900	889.00	3,467,100	貸付有価証券 1,500株
ブロードリーフ	8,900	1,815.00	16,153,500	貸付有価証券

				3,500株(3,000株)
ハーツユニテッドグループ	3,200	1,902.00	6,086,400	貸付有価証券 1,400株(1,300株)
ベリサーブ	1,200	1,170.00	1,404,000	貸付有価証券 400株(400株)
ティーガイア	10,700	1,596.00	17,077,200	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
豆蔵ホールディングス	8,400	624.00	5,241,600	貸付有価証券 3,700株
テクマトリックス	4,600	735.00	3,381,000	貸付有価証券 100株
GMOペイメントゲートウェイ	9,300	3,005.00	27,946,500	貸付有価証券 3,000株(1,600株)
ザッパラス	6,000	610.00	3,660,000	貸付有価証券 2,600株
インターネットイニシアティブ	17,400	2,053.00	35,722,200	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
GMOクラウド	2,400	903.00	2,167,200	
ビットアイル	12,200	526.00	6,417,200	
SRAホールディングス	5,700	1,615.00	9,205,500	
システムインテグレータ	1,500	566.00	849,000	貸付有価証券 600株
パイプドビッツ	1,400	1,802.00	2,522,800	貸付有価証券 300株
朝日ネット	11,000	521.00	5,731,000	
コムチュア	1,800	1,970.00	3,546,000	
gumi	10,800	1,523.00	16,448,400	貸付有価証券 900株
パナソニック インフォメーションシステム	2,500	4,225.00	10,562,500	
フェイス	3,200	1,605.00	5,136,000	貸付有価証券 1,400株
ハイマックス	1,400	1,179.00	1,650,600	
野村総合研究所	60,900	4,800.00	292,320,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
サイバネットシステム	8,800	458.00	4,030,400	貸付有価証券 3,600株(3,400株)
CEホールディングス	1,600	1,322.00	2,115,200	
インテージホールディングス	6,100	2,096.00	12,785,600	
東邦システムサイエンス	3,200	613.00	1,961,600	

ソースネクスト	5,400	734.00	3,963,600	貸付有価証券 2,300株(1,200株)
ティー・ワイ・オー	14,800	205.00	3,034,000	
クレスコ	2,400	2,016.00	4,838,400	
フジ・メディア・ホールディングス	112,000	1,709.00	191,408,000	
オービック	37,100	4,970.00	184,387,000	
ジャストシステム	19,600	816.00	15,993,600	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
TDCソフトウェアエンジニアリング	2,300	1,101.00	2,532,300	
ヤフー	770,500	503.00	387,561,500	貸付有価証券 343,500株
トレンドマイクロ	56,900	4,295.00	244,385,500	
インフォメーション・ディベロプメント	2,000	938.00	1,876,000	
日本オラクル	17,200	5,490.00	94,428,000	
アルファシステムズ	3,500	1,808.00	6,328,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
フューチャーアーキテクト	11,300	742.00	8,384,600	貸付有価証券 4,500株
CAC Holdings	7,300	1,133.00	8,270,900	
ソフトバンク・テクノロジー	2,900	1,393.00	4,039,700	貸付有価証券 1,000株
トーセ	2,900	825.00	2,392,500	貸付有価証券 700株
オービックビジネスコンサルティング	6,800	4,320.00	29,376,000	貸付有価証券 1,300株(200株)
伊藤忠テクノソリューションズ	24,400	2,896.00	70,662,400	
アイティフォー	12,900	447.00	5,766,300	
東計電算	1,900	1,849.00	3,513,100	貸付有価証券 800株(800株)
エクスネット	1,000	1,514.00	1,514,000	
大塚商会	28,900	5,590.00	161,551,000	
サイボウズ	14,300	338.00	4,833,400	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
ソフトブレイン	14,700	189.00	2,778,300	貸付有価証券 3,600株
電通国際情報サービス	6,600	1,235.00	8,151,000	

E Mシステムズ	1,700	1,972.00	3,352,400	貸付有価証券 500株（100株）
ウェザーニューズ	3,200	3,500.00	11,200,000	
C I J	9,700	550.00	5,335,000	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
東洋ビジネスエンジニア リング	1,100	1,417.00	1,558,700	
日本エンタープライズ	9,500	348.00	3,306,000	貸付有価証券 4,200株
WOWOW	5,100	3,960.00	20,196,000	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
フュージョンパートナー	6,100	756.00	4,611,600	
日本コロムビア	3,700	393.00	1,454,100	貸付有価証券 1,300株
イマジカ・ロボット ホールディングス	7,500	709.00	5,317,500	貸付有価証券 1,500株
ネットワンシステムズ	43,600	940.00	40,984,000	
アルゴグラフィックス	4,400	1,787.00	7,862,800	
マーベラス	18,100	1,734.00	31,385,400	貸付有価証券 7,100株（100株）
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	21,300	1,935.00	41,215,500	
日本ユニシス	29,700	1,155.00	34,303,500	貸付有価証券 13,200株（4,100株）
兼松エレクトロニクス	6,800	1,855.00	12,614,000	
東京放送ホールディング ス	64,400	1,669.00	107,483,600	貸付有価証券 1,800株
日本テレビホールディン グス	98,200	2,169.00	212,995,800	貸付有価証券 1,200株
朝日放送	10,600	1,042.00	11,045,200	
テレビ朝日ホールディン グス	29,400	2,124.00	62,445,600	貸付有価証券 9,600株（3,200株）
スカパーJ S A Tホール ディングス	81,600	769.00	62,750,400	
テレビ東京ホールディン グス	8,800	2,204.00	19,395,200	
日本BS放送	1,800	1,110.00	1,998,000	
コネクシオ	7,600	1,254.00	9,530,400	
クロップス	1,300	515.00	669,500	貸付有価証券 500株
日本電信電話	420,700	8,170.00	3,437,119,000	

K D D I	1,092,200	2,868.50	3,132,975,700	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
光通信	9,700	8,000.00	77,600,000	
N T T ドコモ	829,200	2,175.00	1,803,510,000	
エムティーアイ	13,600	798.00	10,852,800	
G M O インターネット	35,900	1,413.00	50,726,700	貸付有価証券 2,100株
K A D O K A W A ・ D W A N G O	26,400	1,945.00	51,348,000	
学研ホールディングス	36,000	250.00	9,000,000	
ゼンリン	14,200	1,551.00	22,024,200	貸付有価証券 6,100株(2,600株)
昭文社	6,400	889.00	5,689,600	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
インプレスホールディング ス	7,600	235.00	1,786,000	貸付有価証券 3,300株
アイネット	5,500	970.00	5,335,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
松竹	71,000	1,018.00	72,278,000	
東宝	76,700	3,275.00	251,192,500	
東映	40,000	893.00	35,720,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
A O I P r o .	5,000	888.00	4,440,000	貸付有価証券 1,100株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	66,400	5,270.00	349,928,000	
ピー・シー・エー	1,400	1,651.00	2,311,400	貸付有価証券 600株
D T S	11,100	2,487.00	27,605,700	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	41,300	2,561.00	105,769,300	
シーイーシー	7,000	924.00	6,468,000	
カプコン	27,500	2,317.00	63,717,500	
アイ・エス・ビー	1,100	919.00	1,010,900	
ジャステック	6,200	955.00	5,921,000	貸付有価証券 2,700株
S C S K	25,600	3,510.00	89,856,000	
日本システムウエア	4,000	905.00	3,620,000	貸付有価証券 1,800株
アイネス	14,600	1,116.00	16,293,600	



TKC	9,900	2,788.00	27,601,200	
富士ソフト	14,800	2,482.00	36,733,600	
NSD	25,100	1,615.00	40,536,500	
コナミ	43,700	2,371.00	103,612,700	
福井コンピュータホールディングス	2,900	671.00	1,945,900	貸付有価証券 900株
JBCCHホールディングス	9,000	815.00	7,335,000	
ミロク情報サービス	7,100	691.00	4,906,100	
ソフトバンク	568,500	7,400.00	4,206,900,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
ハウスイ	9,000	137.00	1,233,000	貸付有価証券 3,000株
高千穂交易	4,100	1,063.00	4,358,300	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
伊藤忠食品	2,600	4,065.00	10,569,000	
エレマテック	5,000	3,075.00	15,375,000	
JALUX	3,000	2,363.00	7,089,000	貸付有価証券 400株
あらた	24,000	321.00	7,704,000	
トーメンデバイス	1,600	2,073.00	3,316,800	
東京エレクトロン デバイス	2,800	1,640.00	4,592,000	貸付有価証券 900株
双日	719,600	262.00	188,535,200	
アルフレッサ ホールディングス	127,200	1,815.00	230,868,000	
横浜冷凍	26,600	870.00	23,142,000	貸付有価証券 1,900株
神栄	16,000	193.00	3,088,000	
山下医科器械	900	1,787.00	1,608,300	貸付有価証券 300株(300株)
ラサ商事	5,000	608.00	3,040,000	
アルコニックス	6,100	1,915.00	11,681,500	
神戸物産	3,500	4,975.00	17,412,500	貸付有価証券 1,500株(1,300株)
あい ホールディングス	17,200	2,108.00	36,257,600	
ディービーエックス	3,100	1,097.00	3,400,700	
ダイワボウホールディングス	98,000	214.00	20,972,000	
マクニカ・富士エレホー	19,300	1,544.00	29,799,200	

ルディングス				
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,200	882.00	17,816,400	貸付有価証券 8,900株（8,800株）
八洲電機	8,300	579.00	4,805,700	
U K C ホールディングス	6,900	2,149.00	14,828,100	
O C H I ホールディングス	2,800	1,353.00	3,788,400	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
T O K A I ホールディングス	52,500	503.00	26,407,500	
三洋貿易	5,900	1,615.00	9,528,500	
ウイン・パートナーズ	3,500	1,442.00	5,047,000	貸付有価証券 300株
ミタチ産業	2,500	802.00	2,005,000	
シップヘルスケアホールディングス	19,700	2,653.00	52,264,100	
明治電機工業	3,100	1,105.00	3,425,500	貸付有価証券 1,000株
デリカフーズ	1,800	1,032.00	1,857,600	
スターティア	1,200	1,721.00	2,065,200	
富士興産	4,100	601.00	2,464,100	
協栄産業	13,000	202.00	2,626,000	
小野建	9,300	1,062.00	9,876,600	貸付有価証券 4,100株
佐鳥電機	8,500	842.00	7,157,000	
エコートレーディング	2,500	691.00	1,727,500	貸付有価証券 1,100株（100株）
伯東	7,300	1,395.00	10,183,500	
コンドーテック	7,800	769.00	5,998,200	
中山福	6,200	864.00	5,356,800	貸付有価証券 200株
ナガイレーベン	15,500	2,224.00	34,472,000	
三菱食品	11,800	2,599.00	30,668,200	
松田産業	7,800	1,591.00	12,409,800	
メディカルホールディングス	107,500	1,674.00	179,955,000	
アドヴァン	5,500	1,643.00	9,036,500	
S P K	2,300	2,393.00	5,503,900	
萩原電気	3,000	1,916.00	5,748,000	貸付有価証券 1,300株
アズワン	7,700	3,965.00	30,530,500	

スズデン	3,500	714.00	2,499,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
尾家産業	3,400	893.00	3,036,200	
シモジマ	6,600	1,074.00	7,088,400	貸付有価証券 900株(900株)
ドウシシャ	13,900	1,898.00	26,382,200	貸付有価証券 100株
小津産業	2,100	2,313.00	4,857,300	貸付有価証券 900株
高速	6,400	893.00	5,715,200	
たけびし	3,800	1,060.00	4,028,000	貸付有価証券 1,600株
黒田電気	18,700	2,150.00	40,205,000	
丸文	9,500	803.00	7,628,500	
ハピネット	6,500	1,353.00	8,794,500	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
橋本総業	2,000	1,400.00	2,800,000	
エクセル	4,900	1,443.00	7,070,700	貸付有価証券 2,200株
マルカキカイ	3,500	2,124.00	7,434,000	貸付有価証券 900株(900株)
ガリバーインターナショナル	32,500	943.00	30,647,500	貸付有価証券 14,900株(14,900株)
日本エム・ディ・エム	9,000	547.00	4,923,000	貸付有価証券 2,900株
進和	6,300	1,924.00	12,121,200	
エスケイジャパン	2,500	231.00	577,500	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
ダイトエレクトロン	4,900	755.00	3,699,500	
シークス	6,800	3,350.00	22,780,000	貸付有価証券 900株(900株)
田中商事	3,300	689.00	2,273,700	
オーハシテクニカ	6,600	1,630.00	10,758,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
白銅	3,500	1,346.00	4,711,000	
伊藤忠商事	899,900	1,541.50	1,387,195,850	貸付有価証券 13,100株(13,100株)
丸紅	940,500	707.70	665,591,850	
高島	20,000	271.00	5,420,000	
長瀬産業	60,300	1,619.00	97,625,700	

蝶理	6,800	1,901.00	12,926,800	
豊田通商	119,800	3,100.00	371,380,000	
三共生興	18,300	538.00	9,845,400	
兼松	214,000	202.00	43,228,000	
ツカモトコーポレーション	19,000	136.00	2,584,000	貸付有価証券 8,000株
三井物産	911,400	1,694.50	1,544,367,300	
日本紙パルプ商事	56,000	331.00	18,536,000	
日立ハイテクノロジーズ	37,300	3,545.00	132,228,500	
カメイ	14,000	914.00	12,796,000	
東都水産	18,000	199.00	3,582,000	
OUGホールディングス	17,000	243.00	4,131,000	
スターゼン	42,000	395.00	16,590,000	貸付有価証券 9,000株（9,000株）
山善	41,300	1,076.00	44,438,800	
椿本興業	12,000	324.00	3,888,000	
住友商事	634,500	1,441.50	914,631,750	
内田洋行	26,000	403.00	10,478,000	
三菱商事	823,900	2,643.00	2,177,567,700	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
第一実業	26,000	625.00	16,250,000	
キャノンマーケティング ジャパン	30,700	2,238.00	68,706,600	
西華産業	35,000	328.00	11,480,000	
佐藤商事	9,600	817.00	7,843,200	
菱洋エレクトロ	12,400	1,406.00	17,434,400	貸付有価証券 5,500株（5,400株）
東京産業	10,700	495.00	5,296,500	貸付有価証券 1,400株
ユアサ商事	9,400	2,685.00	25,239,000	
神鋼商事	27,000	265.00	7,155,000	
小林産業	7,800	259.00	2,020,200	
阪和興業	107,000	501.00	53,607,000	
カナデン	9,200	895.00	8,234,000	
菱電商事	17,000	863.00	14,671,000	
フルサト工業	5,900	1,813.00	10,696,700	貸付有価証券 200株
岩谷産業	119,000	827.00	98,413,000	貸付有価証券

				4,000株(2,000株)
すてきナイスグループ	46,000	191.00	8,786,000	
昭光通商	38,000	124.00	4,712,000	貸付有価証券 17,000株
ニチモウ	17,000	196.00	3,332,000	
極東貿易	12,000	217.00	2,604,000	貸付有価証券 1,000株
イワキ	16,000	241.00	3,856,000	
三愛石油	28,000	772.00	21,616,000	
稲畑産業	25,800	1,279.00	32,998,200	
G S Iクレオス	28,000	140.00	3,920,000	貸付有価証券 12,000株(7,000株)
明和産業	8,500	435.00	3,697,500	
ワキタ	22,900	1,217.00	27,869,300	
東邦ホールディングス	37,100	2,134.00	79,171,400	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
サンゲツ	37,600	1,839.00	69,146,400	
ミツウロコグループホー ルディングス	17,300	581.00	10,051,300	
シナネン	23,000	469.00	10,787,000	
伊藤忠エネクス	23,700	1,080.00	25,596,000	
サンリオ	30,100	3,305.00	99,480,500	貸付有価証券 12,500株
サンワテクノス	6,800	1,162.00	7,901,600	
リョーサン	18,100	3,020.00	54,662,000	
新光商事	12,600	1,252.00	15,775,200	
トーヨー	24,000	480.00	11,520,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
三信電気	14,900	1,049.00	15,630,100	
東陽テクニカ	15,700	1,150.00	18,055,000	
モスフードサービス	14,100	2,493.00	35,151,300	貸付有価証券 100株(100株)
加賀電子	9,700	1,464.00	14,200,800	
ソーダニッカ	11,100	549.00	6,093,900	
立花エレテック	7,900	1,450.00	11,455,000	
フォーバル	2,100	2,371.00	4,979,100	
P a l t a c	17,200	1,773.00	30,495,600	
三谷産業	11,400	522.00	5,950,800	
太平洋興発	42,000	96.00	4,032,000	貸付有価証券

				6,000株
ヤマタネ	54,000	189.00	10,206,000	
丸紅建材リース	9,000	267.00	2,403,000	
日鉄住金物産	71,000	417.00	29,607,000	
トラスコ中山	13,400	3,880.00	51,992,000	
オートバックスセブン	39,600	1,863.00	73,774,800	
加藤産業	16,800	2,597.00	43,629,600	
イノテック	9,900	503.00	4,979,700	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	10,100	2,527.00	25,522,700	
J Kホールディングス	10,800	585.00	6,318,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
日伝	4,400	2,732.00	12,020,800	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
北沢産業	8,900	181.00	1,610,900	
杉本商事	5,800	1,371.00	7,951,800	
因幡電機産業	16,000	4,430.00	70,880,000	
バイテック	3,600	1,130.00	4,068,000	
ミスミグループ本社	40,200	4,660.00	187,332,000	
アルテック	7,900	281.00	2,219,900	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
タキヒヨー	18,000	469.00	8,442,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
蔵王産業	1,400	1,390.00	1,946,000	
スズケン	48,900	3,740.00	182,886,000	
ジェコス	7,400	1,524.00	11,277,600	
ルネサスイーストン	5,300	611.00	3,238,300	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
ローソン	40,700	8,460.00	344,322,000	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
サンエー	8,100	5,280.00	42,768,000	
ダイユーエイト	2,500	811.00	2,027,500	貸付有価証券 200株
カワチ薬品	8,300	1,912.00	15,869,600	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
エービーシー・マート	15,300	6,860.00	104,958,000	貸付有価証券 6,700株(3,700株)
ハードオフコーポレーション	5,200	1,232.00	6,406,400	
アスクル	11,200	2,940.00	32,928,000	貸付有価証券

				3,700株
ゲオホールディングス	20,200	1,292.00	26,098,400	
アダストリアホールディングス	9,100	3,610.00	32,851,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	14,000	119.00	1,666,000	貸付有価証券 5,000株
くらコーポレーション	6,300	4,675.00	29,452,500	貸付有価証券 100株(100株)
キャンドウ	5,100	1,533.00	7,818,300	貸付有価証券 2,200株(1,800株)
パル	6,300	3,985.00	25,105,500	
エディオン	49,200	850.00	41,820,000	貸付有価証券 9,000株(8,900株)
サーラコーポレーション	9,200	599.00	5,510,800	
ワッツ	4,200	986.00	4,141,200	貸付有価証券 1,800株
あみやき亭	1,900	4,865.00	9,243,500	貸付有価証券 700株(700株)
ひらまつ	14,800	641.00	9,486,800	
ゲンキー	1,100	10,340.00	11,374,000	貸付有価証券 400株(400株)
サッポロドラッグストア	900	1,750.00	1,575,000	貸付有価証券 300株
大黒天物産	2,600	4,885.00	12,701,000	貸付有価証券 1,100株
ハニーズ	9,400	1,074.00	10,095,600	貸付有価証券 4,200株
ファーマライズホールディングス	2,400	605.00	1,452,000	
アルペン	9,600	1,896.00	18,201,600	
クオール	10,900	1,037.00	11,303,300	
ジェイアイエヌ	7,300	4,615.00	33,689,500	貸付有価証券 3,200株(3,000株)
ビックカメラ	52,800	1,205.00	63,624,000	貸付有価証券 23,400株(100株)
DCMホールディングス	52,000	1,037.00	53,924,000	
MonotaRO	21,000	4,045.00	84,945,000	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
きちり	2,900	708.00	2,053,200	貸付有価証券 900株(800株)
アークランドサービス	1,300	4,975.00	6,467,500	貸付有価証券

				300株(200株)
J・フロントリテイリング	136,000	2,074.00	282,064,000	
ドトール・日レスホールディングス	18,800	2,303.00	43,296,400	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
マツモトキヨシホールディングス	24,000	4,400.00	105,600,000	
ブロンコビリー	1,900	5,310.00	10,089,000	貸付有価証券 300株(300株)
スタートトゥデイ	33,500	3,190.00	106,865,000	
トレジャー・ファクトリー	1,300	3,155.00	4,101,500	貸付有価証券 400株(400株)
物語コーポレーション	3,000	3,955.00	11,865,000	
ココカラファイン	11,200	3,325.00	37,240,000	
三越伊勢丹ホールディングス	213,700	1,957.00	418,210,900	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
ウエルシアホールディングス	9,200	5,310.00	48,852,000	貸付有価証券 600株
クリエイティブSDホールディングス	5,300	5,240.00	27,772,000	貸付有価証券 2,300株
丸善CHIホールディングス	12,500	374.00	4,675,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
エー・ピーカンパニー	1,500	1,823.00	2,734,500	貸付有価証券 600株
チムニー	2,600	2,975.00	7,735,000	貸付有価証券 800株(800株)
ネクステージ	1,400	887.00	1,241,800	貸付有価証券 400株
ジョイフル本田	7,900	4,790.00	37,841,000	貸付有価証券 2,200株
麒麟堂ホールディングス	3,400	1,123.00	3,818,200	
すかいらーく	52,500	1,859.00	97,597,500	貸付有価証券 17,400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	35,300	1,056.00	37,276,800	
ブックオフコーポレーション	6,100	875.00	5,337,500	
あさひ	7,100	1,051.00	7,462,100	貸付有価証券 3,100株
日本調剤	1,400	6,040.00	8,456,000	貸付有価証券 600株



コスモス薬品	5,400	15,990.00	86,346,000	貸付有価証券 2,400株(500株)
トーエル	5,700	763.00	4,349,100	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
一六堂	2,600	431.00	1,120,600	
セブン & アイ・ホールディングス	449,700	5,146.00	2,314,156,200	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
薬王堂	1,500	2,747.00	4,120,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	7,500	2,248.00	16,860,000	
ツルハホールディングス	23,000	8,690.00	199,870,000	貸付有価証券 10,200株
サンマルクホールディングス	7,700	4,060.00	31,262,000	
フェリシモ	2,700	1,126.00	3,040,200	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
トリドール	11,500	1,616.00	18,584,000	
クスリのアオキ	4,200	8,370.00	35,154,000	貸付有価証券 200株
メディカルシステムネットワーク	9,700	537.00	5,208,900	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
総合メディカル	5,200	3,425.00	17,810,000	
はるやま商事	4,500	774.00	3,483,000	
カップ・クリエイトホールディングス	16,800	1,133.00	19,034,400	貸付有価証券 7,400株
ライトオン	8,000	949.00	7,592,000	貸付有価証券 200株
ジーンズメイト	3,400	264.00	897,600	貸付有価証券 1,500株(100株)
良品計画	13,300	18,790.00	249,907,000	
三城ホールディングス	13,300	476.00	6,330,800	
アルビス	2,400	2,106.00	5,054,400	
コナカ	12,600	733.00	9,235,800	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,397.00	1,676,400	貸付有価証券 500株(500株)
G - 7ホールディングス	2,300	1,015.00	2,334,500	
イオン北海道	6,800	653.00	4,440,400	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
コジマ	15,800	325.00	5,135,000	
ヒマラヤ	3,300	1,063.00	3,507,900	貸付有価証券

				300株
コーナン商事	16,400	1,359.00	22,287,600	
エコス	3,700	951.00	3,518,700	
ワタミ	12,700	1,152.00	14,630,400	貸付有価証券 5,600株(5,400株)
マルシェ	2,600	897.00	2,332,200	貸付有価証券 1,100株
ドンキホーテホールディングス	34,700	9,240.00	320,628,000	
西松屋チェーン	21,200	1,127.00	23,892,400	
ゼンショーホールディングス	55,300	1,133.00	62,654,900	貸付有価証券 20,100株
幸楽苑	6,700	1,531.00	10,257,700	貸付有価証券 2,900株(1,800株)
ハークスレイ	3,000	1,039.00	3,117,000	
サイゼリヤ	17,700	2,427.00	42,957,900	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
魚力	3,000	2,053.00	6,159,000	
ポブラ	2,700	538.00	1,452,600	貸付有価証券 1,100株(500株)
ユナイテッドアローズ	14,100	3,860.00	54,426,000	貸付有価証券 5,900株(1,700株)
ハイデイ日高	8,100	2,963.00	24,000,300	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
京都きもの友禅	6,300	1,029.00	6,482,700	貸付有価証券 2,900株
コロワイド	35,600	1,672.00	59,523,200	貸付有価証券 15,800株
壱番屋	4,900	5,420.00	26,558,000	貸付有価証券 2,100株
トップカルチャー	4,300	504.00	2,167,200	貸付有価証券 1,800株(1,600株)
P L A N T	2,400	1,348.00	3,235,200	貸付有価証券 1,100株
スギホールディングス	19,300	5,790.00	111,747,000	
スクロール	13,900	285.00	3,961,500	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
ヨンドシーホールディングス	8,200	2,717.00	22,279,400	貸付有価証券 2,600株(1,800株)
ファミリーマート	36,300	5,070.00	184,041,000	貸付有価証券 11,600株(11,400株)

木曽路	13,100	1,973.00	25,846,300	貸付有価証券 5,800株(4,500株)
サトレストランシステムズ	10,000	1,075.00	10,750,000	貸付有価証券 4,400株(1,300株)
千趣会	19,300	850.00	16,405,000	貸付有価証券 8,100株(8,100株)
タカキュー	7,400	213.00	1,576,200	貸付有価証券 3,200株(3,000株)
ケーヨー	20,100	555.00	11,155,500	貸付有価証券 8,800株
上新電機	23,000	948.00	21,804,000	
日本瓦斯	17,200	2,892.00	49,742,400	
ベスト電器	34,600	149.00	5,155,400	貸付有価証券 15,400株(14,100株)
ロイヤルホールディングス	17,900	2,121.00	37,965,900	貸付有価証券 7,900株(100株)
東天紅	8,000	191.00	1,528,000	貸付有価証券 1,000株
いなげや	12,000	1,342.00	16,104,000	
島忠	27,800	3,065.00	85,207,000	
チヨダ	12,700	2,661.00	33,794,700	
ライフコーポレーション	6,800	2,149.00	14,613,200	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
リンガーハット	10,400	2,316.00	24,086,400	貸付有価証券 300株(300株)
さが美	8,000	93.00	744,000	
MrMax	10,700	277.00	2,963,900	
テナライド	9,000	379.00	3,411,000	
AOKIホールディングス	24,700	1,734.00	42,829,800	
オークワ	17,000	1,023.00	17,391,000	
コメリ	18,400	2,787.00	51,280,800	
青山商事	27,000	4,190.00	113,130,000	
しまむら	12,500	11,830.00	147,875,000	
CFSコーポレーション	7,000	1,049.00	7,343,000	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
はせがわ	3,800	551.00	2,093,800	
高島屋	156,000	1,139.00	177,684,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
松屋	21,600	1,831.00	39,549,600	

エイチ・ツー・オー リテイリング	50,800	2,207.00	112,115,600	
近鉄百貨店	41,000	322.00	13,202,000	貸付有価証券 1,000株
丸栄	18,000	134.00	2,412,000	貸付有価証券 7,000株
ニッセンホールディングス	22,500	270.00	6,075,000	貸付有価証券 5,900株(5,900株)
パルコ	10,300	1,125.00	11,587,500	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
丸井グループ	113,100	1,308.00	147,934,800	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
アクシアル リテイリング	8,300	3,145.00	26,103,500	
井筒屋	58,000	63.00	3,654,000	貸付有価証券 2,000株
イオン	443,400	1,526.00	676,628,400	貸付有価証券 197,000株(27,300株)
ユニグループ・ホールディングス	102,900	676.00	69,560,400	貸付有価証券 16,200株(5,700株)
イズミ	24,000	4,715.00	113,160,000	
東武ストア	14,000	334.00	4,676,000	貸付有価証券 6,000株(5,000株)
平和堂	21,800	2,837.00	61,846,600	貸付有価証券 200株(200株)
フジ	11,900	2,209.00	26,287,100	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
ヤオコー	12,200	4,400.00	53,680,000	
ゼビオ	14,600	2,286.00	33,375,600	貸付有価証券 2,900株(2,800株)
ケーズホールディングス	24,800	4,200.00	104,160,000	貸付有価証券 3,400株
O l y m p i cグループ	6,300	798.00	5,027,400	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
日産東京販売ホールディングス	18,000	358.00	6,444,000	
アインファーマシーズ	12,900	4,210.00	54,309,000	
元気寿司	3,300	2,287.00	7,547,100	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
ヤマダ電機	425,000	509.00	216,325,000	貸付有価証券 186,500株(20,300株)

				株)
アークランドサカモト	7,700	2,933.00	22,584,100	
ニトリホールディングス	46,400	8,960.00	415,744,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
グルメ杵屋	8,000	940.00	7,520,000	
愛眼	8,600	253.00	2,175,800	貸付有価証券 3,800株(3,500株)
ケーユーホールディングス	5,600	697.00	3,903,200	貸付有価証券 900株
吉野家ホールディングス	30,300	1,396.00	42,298,800	貸付有価証券 13,400株(3,300株)
松屋フーズ	5,200	2,373.00	12,339,600	
サガミチェーン	14,000	1,158.00	16,212,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
関西スーパーマーケット	8,000	811.00	6,488,000	
王将フードサービス	7,900	4,270.00	33,733,000	貸付有価証券 300株
ブレナス	12,000	2,406.00	28,872,000	
ミニストップ	7,900	1,794.00	14,172,600	
アークス	18,700	2,481.00	46,394,700	
パロー	23,200	2,515.00	58,348,000	
藤久	800	1,742.00	1,393,600	貸付有価証券 300株(300株)
ベルク	4,800	3,475.00	16,680,000	
大庄	5,000	1,508.00	7,540,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
ファーストリテイリング	21,500	48,450.00	1,041,675,000	貸付有価証券 100株(100株)
サンドラッグ	22,700	5,920.00	134,384,000	
サックスパーホールディングス	8,100	2,171.00	17,585,100	貸付有価証券 2,700株(600株)
ヤマザワ	2,200	1,722.00	3,788,400	貸付有価証券 200株
やまや	1,800	1,831.00	3,295,800	
ベルーナ	26,800	600.00	16,080,000	
島根銀行	2,300	1,545.00	3,553,500	
じもとホールディングス	77,100	231.00	17,810,100	貸付有価証券 1,100株
足利ホールディングス	67,600	500.00	33,800,000	
東京TYフィナンシャル	13,800	3,490.00	48,162,000	

グループ				
新生銀行	1,023,000	248.00	253,704,000	
あおぞら銀行	726,000	450.00	326,700,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,626,200	872.00	7,522,046,400	貸付有価証券 94,900株（94,900株）
りそなホールディングス	1,257,700	638.30	802,789,910	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,376,000	537.10	1,276,149,600	
三井住友フィナンシャルグループ	813,100	5,380.00	4,374,478,000	貸付有価証券 28,400株（28,400株）
第四銀行	136,000	464.00	63,104,000	
北越銀行	116,000	246.00	28,536,000	
西日本シティ銀行	377,000	388.00	146,276,000	
千葉銀行	415,000	988.00	410,020,000	貸付有価証券 7,000株（7,000株）
横浜銀行	721,000	765.50	551,925,500	
常陽銀行	389,000	669.00	260,241,000	貸付有価証券 54,000株（54,000株）
群馬銀行	255,000	852.00	217,260,000	
武蔵野銀行	17,200	4,450.00	76,540,000	
千葉興業銀行	22,300	855.00	19,066,500	
筑波銀行	44,700	407.00	18,192,900	貸付有価証券 6,600株（6,600株）
七十七銀行	181,000	690.00	124,890,000	
青森銀行	84,000	404.00	33,936,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
秋田銀行	71,000	383.00	27,193,000	
山形銀行	65,000	535.00	34,775,000	貸付有価証券 28,000株（8,000株）
岩手銀行	7,500	5,510.00	41,325,000	貸付有価証券 3,300株（800株）
東邦銀行	96,000	505.00	48,480,000	
東北銀行	58,000	170.00	9,860,000	
みちのく銀行	54,000	213.00	11,502,000	貸付有価証券 23,000株（18,000株）
ふくおかフィナンシャルグループ	436,000	682.00	297,352,000	
静岡銀行	315,000	1,343.00	423,045,000	
十六銀行	135,000	493.00	66,555,000	
スルガ銀行	113,500	2,686.00	304,861,000	

八十二銀行	194,000	956.00	185,464,000	
山梨中央銀行	67,000	574.00	38,458,000	
大垣共立銀行	134,000	420.00	56,280,000	
福井銀行	92,000	268.00	24,656,000	貸付有価証券 1,000株
北國銀行	120,000	437.00	52,440,000	
清水銀行	3,700	3,150.00	11,655,000	
滋賀銀行	108,000	637.00	68,796,000	貸付有価証券 47,000株
南都銀行	104,000	436.00	45,344,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
百五銀行	103,000	607.00	62,521,000	
京都銀行	205,000	1,327.00	272,035,000	
紀陽銀行	42,200	1,764.00	74,440,800	
三重銀行	48,000	270.00	12,960,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	731,000	291.00	212,721,000	
広島銀行	317,000	709.00	224,753,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
山陰合同銀行	65,000	1,141.00	74,165,000	
中国銀行	76,200	1,929.00	146,989,800	
鳥取銀行	34,000	261.00	8,874,000	
伊予銀行	115,000	1,490.00	171,350,000	
百十四銀行	118,000	423.00	49,914,000	
四国銀行	83,000	265.00	21,995,000	貸付有価証券 16,000株
阿波銀行	88,000	730.00	64,240,000	
鹿児島銀行	75,000	872.00	65,400,000	
大分銀行	66,000	485.00	32,010,000	貸付有価証券 29,000株
宮崎銀行	72,000	480.00	34,560,000	
肥後銀行	88,000	780.00	68,640,000	
佐賀銀行	65,000	316.00	20,540,000	
十八銀行	66,000	389.00	25,674,000	
沖縄銀行	8,500	5,110.00	43,435,000	
琉球銀行	22,100	1,773.00	39,183,300	
セブン銀行	362,500	582.00	210,975,000	
みずほフィナンシャルグ	14,990,100	233.50	3,500,188,350	

ループ				
高知銀行	42,000	177.00	7,434,000	
山口フィナンシャルグループ	107,000	1,556.00	166,492,000	貸付有価証券 47,000株(24,000株)
長野銀行	35,000	202.00	7,070,000	貸付有価証券 15,000株
名古屋銀行	97,000	441.00	42,777,000	貸付有価証券 43,000株
北洋銀行	162,000	489.00	79,218,000	
愛知銀行	3,900	6,370.00	24,843,000	
第三銀行	61,000	200.00	12,200,000	貸付有価証券 26,000株
中京銀行	44,000	231.00	10,164,000	
東日本銀行	47,000	425.00	19,975,000	
大光銀行	38,000	238.00	9,044,000	
愛媛銀行	63,000	259.00	16,317,000	貸付有価証券 28,000株(26,000株)
トマト銀行	41,000	206.00	8,446,000	
みなと銀行	97,000	298.00	28,906,000	貸付有価証券 4,000株
京葉銀行	89,000	725.00	64,525,000	
関西アーバン銀行	15,000	1,303.00	19,545,000	
栃木銀行	54,000	685.00	36,990,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
北日本銀行	3,300	3,415.00	11,269,500	
東和銀行	151,000	105.00	15,855,000	
福島銀行	132,000	95.00	12,540,000	貸付有価証券 56,000株(56,000株)
大東銀行	69,000	174.00	12,006,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
トモニホールディングス	82,500	582.00	48,015,000	
フィデアホールディングス	63,800	242.00	15,439,600	貸付有価証券 27,500株(1,300株)
池田泉州ホールディングス	102,500	530.00	54,325,000	
F P G	31,800	953.00	30,305,400	貸付有価証券 12,300株(12,000株)
S B Iホールディングス	129,100	1,610.00	207,851,000	
日本アジア投資	78,000	72.00	5,616,000	
ジャフコ	14,700	4,465.00	65,635,500	貸付有価証券



				100株
大和証券グループ本社	1,006,000	978.70	984,572,200	
野村ホールディングス	2,197,900	804.30	1,767,770,970	
岡三証券グループ	92,000	925.00	85,100,000	
丸三証券	34,200	1,201.00	41,074,200	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
東洋証券	41,000	382.00	15,662,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,400	927.00	114,391,800	
光世証券	26,000	241.00	6,266,000	貸付有価証券 11,000株(10,000株)
水戸証券	33,300	454.00	15,118,200	
いちよし証券	22,500	1,304.00	29,340,000	
松井証券	54,600	1,103.00	60,223,800	
だいこう証券ビジネス	5,200	887.00	4,612,400	貸付有価証券 2,200株
マネックスグループ	126,500	352.00	44,528,000	
カブドットコム証券	47,700	873.00	41,642,100	
極東証券	14,400	1,825.00	26,280,000	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
岩井コスモホールディングス	11,000	1,664.00	18,304,000	
藍澤證券	15,100	829.00	12,517,900	
マネースクウェアHD	4,400	1,376.00	6,054,400	貸付有価証券 1,900株
マネーパートナーズグループ	11,000	374.00	4,114,000	貸付有価証券 100株
小林洋行	3,100	339.00	1,050,900	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	238,800	3,973.50	948,871,800	
アニコムホールディングス	6,000	2,187.00	13,122,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
MS&ADインシュアランスグループホール	342,700	3,507.00	1,201,848,900	
ソニーフィナンシャルホールディングス	103,000	2,172.00	223,716,000	
第一生命保険	688,800	2,033.50	1,400,674,800	
東京海上ホールディングス	435,600	4,996.00	2,176,257,600	
T&Dホールディングス	391,800	1,771.00	693,877,800	

全国保証	27,900	4,665.00	130,153,500	
クレディセゾン	87,800	2,265.00	198,867,000	
アクリーティブ	7,300	464.00	3,387,200	貸付有価証券 3,200株（2,400株）
芙蓉総合リース	11,300	4,910.00	55,483,000	
興銀リース	20,200	2,680.00	54,136,000	
東京センチュリーリース	25,200	3,810.00	96,012,000	
日本証券金融	47,400	770.00	36,498,000	
アイフル	179,900	411.00	73,938,900	貸付有価証券 80,200株（2,500株）
ポケットカード	8,000	505.00	4,040,000	貸付有価証券 2,700株
リコーリース	8,500	3,550.00	30,175,000	貸付有価証券 3,000株
イオンフィナンシャル サービス	70,500	3,080.00	217,140,000	貸付有価証券 31,400株（1,400株）
アコム	216,000	403.00	87,048,000	貸付有価証券 96,200株（5,000株）
ジャックス	59,000	609.00	35,931,000	
オリエントコーポレー ション	248,500	194.00	48,209,000	貸付有価証券 85,500株
日立キャピタル	21,100	2,693.00	56,822,300	
アプラスフィナンシャル	51,600	129.00	6,656,400	貸付有価証券 23,100株
オリックス	761,100	1,889.00	1,437,717,900	貸付有価証券 10,200株（10,200株）
三菱UFJリース	272,700	645.00	175,891,500	
日本取引所グループ	157,900	3,570.00	563,703,000	
イー・ギャランティ	3,100	1,924.00	5,964,400	貸付有価証券 1,400株
アサックス	1,900	1,641.00	3,117,900	
NECキャピタルソ リューション	4,400	1,818.00	7,999,200	
日本駐車場開発	116,800	189.00	22,075,200	貸付有価証券 19,700株
ヒューリック	199,600	1,289.00	257,284,400	貸付有価証券 69,600株（30,600株）
東京建物不動産販売	5,600	550.00	3,080,000	
三栄建築設計	4,300	935.00	4,020,500	
野村不動産ホールディン	64,600	2,443.00	157,817,800	

グス				
三重交通グループホールディングス	19,100	450.00	8,595,000	
日本商業開発	3,400	1,940.00	6,596,000	貸付有価証券 1,500株
プレサンスコーポレーション	3,600	3,980.00	14,328,000	
常和ホールディングス	5,900	4,830.00	28,497,000	
日本管理センター	6,900	1,646.00	11,357,400	
サンセイランディック	1,600	837.00	1,339,200	貸付有価証券 400株
エストラスト	1,500	617.00	925,500	
フージャースホールディングス	16,000	580.00	9,280,000	貸付有価証券 100株(100株)
オープンハウス	7,800	3,040.00	23,712,000	
東急不動産ホールディングス	281,800	905.00	255,029,000	
飯田グループホールディングス	69,700	1,656.00	115,423,200	
パーク24	54,100	2,404.00	130,056,400	貸付有価証券 24,100株(1,300株)
パラカ	3,700	1,157.00	4,280,900	
三井不動産	570,000	3,515.50	2,003,835,000	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
三菱地所	799,000	2,751.50	2,198,448,500	貸付有価証券 24,000株(24,000株)
平和不動産	20,300	1,646.00	33,413,800	
東京建物	234,000	900.00	210,600,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
ダイビル	27,700	1,143.00	31,661,100	
京阪神ビルディング	17,800	710.00	12,638,000	
住友不動産	258,000	4,585.50	1,183,059,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
大京	171,000	180.00	30,780,000	
テーオーシー	37,000	916.00	33,892,000	
東京楽天地	18,000	496.00	8,928,000	
レオパレス21	117,600	669.00	78,674,400	
スターツコーポレーション	12,300	1,931.00	23,751,300	貸付有価証券 300株
フジ住宅	13,700	684.00	9,370,800	貸付有価証券

				6,100株
空港施設	13,000	692.00	8,996,000	
明和地所	6,200	515.00	3,193,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
住友不動産販売	7,700	3,305.00	25,448,500	
ゴールドクレスト	9,700	2,425.00	23,522,500	
日本エスリード	4,200	1,200.00	5,040,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
日神不動産	14,300	480.00	6,864,000	
タカラレーベン	47,600	749.00	35,652,400	貸付有価証券 21,100株(21,100株)
サンヨーハウジング名古屋	6,000	1,244.00	7,464,000	
イオンモール	69,400	2,322.00	161,146,800	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
ファースト住建	4,000	1,445.00	5,780,000	貸付有価証券 1,800株(200株)
トーセイ	14,700	875.00	12,862,500	貸付有価証券 500株(500株)
穴吹興産	10,000	265.00	2,650,000	貸付有価証券 2,000株
エヌ・ティ・ティ都市開発	66,800	1,215.00	81,162,000	貸付有価証券 2,100株
サンフロンティア不動産	11,600	1,094.00	12,690,400	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	551.00	4,518,200	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ランドビジネス	7,200	408.00	2,937,600	
グランディハウス	9,400	331.00	3,111,400	
日本空港ビルデング	37,100	6,720.00	249,312,000	貸付有価証券 100株(100株)
日本工営	38,000	489.00	18,582,000	貸付有価証券 4,000株
ネクスト	13,400	1,200.00	16,080,000	貸付有価証券 700株
日本M&Aセンター	17,600	4,275.00	75,240,000	
ノバレーゼ	2,900	890.00	2,581,000	貸付有価証券 1,200株(1,000株)
アコーディア・ゴルフ	42,800	1,236.00	52,900,800	
タケエイ	11,100	1,081.00	11,999,100	貸付有価証券 3,400株

トラスト・テック	2,000	2,141.00	4,282,000	貸付有価証券 600株
パソナグループ	8,500	763.00	6,485,500	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
C D S	2,600	1,069.00	2,779,400	貸付有価証券 500株
リンクアンドモチベー ション	15,300	179.00	2,738,700	貸付有価証券 4,300株
G C A サヴィアン	9,000	1,356.00	12,204,000	貸付有価証券 2,000株
エス・エム・エス	12,800	1,458.00	18,662,400	貸付有価証券 400株
テンプホールディングス	22,400	3,780.00	84,672,000	貸付有価証券 500株
リニカル	2,900	1,012.00	2,934,800	
クックパッド	7,200	5,400.00	38,880,000	貸付有価証券 2,600株（700株）
エスクリ	4,000	1,323.00	5,292,000	
アイ・ケイ・ケイ	6,100	647.00	3,946,700	貸付有価証券 2,600株
学情	4,200	1,316.00	5,527,200	貸付有価証券 1,800株（200株）
スタジオアリス	5,200	2,217.00	11,528,400	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
シミックホールディング ス	5,100	1,683.00	8,583,300	貸付有価証券 2,200株（1,800株）
N J S	2,500	1,584.00	3,960,000	
総合警備保障	38,000	4,155.00	157,890,000	
カカクコム	75,000	2,030.00	152,250,000	貸付有価証券 33,400株（33,300株）
ルネサンス	5,800	1,252.00	7,261,600	
ディップ	2,500	8,000.00	20,000,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
オプトホールディング	5,100	721.00	3,677,100	貸付有価証券 200株
新日本科学	10,800	807.00	8,715,600	貸付有価証券 4,700株
ツクイ	13,500	926.00	12,501,000	貸付有価証券 6,000株（1,500株）
総合臨床ホールディング ス	5,800	483.00	2,801,400	貸付有価証券 100株

キャリアデザインセンター	3,100	1,078.00	3,341,800	
エムスリー	98,500	2,248.00	221,428,000	
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	800.00	6,640,000	貸付有価証券 3,600株(2,000株)
アウトソーシング	4,300	1,627.00	6,996,100	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
ウェルネット	4,000	2,609.00	10,436,000	貸付有価証券 1,300株
ディー・エヌ・エー	56,100	2,495.00	139,969,500	貸付有価証券 24,200株
博報堂DYホールディングス	157,700	1,303.00	205,483,100	
ぐるなび	13,200	2,183.00	28,815,600	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
エスアールジータカミヤ	9,200	752.00	6,918,400	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
一休	8,900	2,313.00	20,585,700	貸付有価証券 2,500株
ジャパンベストレスキューシステム	12,900	251.00	3,237,900	
ファンコミュニケーションズ	26,200	1,042.00	27,300,400	貸付有価証券 11,600株(5,800株)
ジェイコムホールディングス	2,700	974.00	2,629,800	貸付有価証券 1,100株(400株)
PGMホールディングス	16,000	1,280.00	20,480,000	貸付有価証券 1,700株(300株)
WDBホールディングス	4,100	1,082.00	4,436,200	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ティア	4,800	618.00	2,966,400	
バリューコマース	9,300	586.00	5,449,800	貸付有価証券 3,000株
J Pホールディングス	28,200	342.00	9,644,400	貸付有価証券 12,500株
EPSホールディングス	10,400	1,477.00	15,360,800	
プレステージ・インターナショナル	8,700	916.00	7,969,200	
アミューズ	3,500	3,175.00	11,112,500	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ドリームインキュベータ	3,700	2,487.00	9,201,900	貸付有価証券 400株
クイック	5,200	987.00	5,132,400	

T A C	5,600	212.00	1,187,200	
ケネディクス	161,700	477.00	77,130,900	貸付有価証券 71,400株
電通	126,800	5,550.00	703,740,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,400	975.00	4,290,000	貸付有価証券 200株(100株)
ぴあ	3,300	2,304.00	7,603,200	貸付有価証券 1,400株(100株)
イオンファンタジー	3,700	1,956.00	7,237,200	貸付有価証券 1,400株
ネクシィーズ	4,100	653.00	2,677,300	貸付有価証券 500株(500株)
みらかホールディングス	29,000	5,750.00	166,750,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
アルプス技研	4,600	2,287.00	10,520,200	貸付有価証券 1,800株
ダイオーズ	2,400	908.00	2,179,200	貸付有価証券 200株
日本空調サービス	5,600	831.00	4,653,600	
オリエンタルランド	123,000	7,983.00	981,909,000	貸付有価証券 16,000株
ダスキン	32,200	2,083.00	67,072,600	
明光ネットワークジャパン	13,200	1,472.00	19,430,400	貸付有価証券 4,500株(4,200株)
ファルコホールディングス	5,400	1,382.00	7,462,800	
秀英予備校	2,300	310.00	713,000	
田谷	1,900	786.00	1,493,400	貸付有価証券 100株
ラウンドワン	32,300	608.00	19,638,400	
リゾートトラスト	43,000	3,030.00	130,290,000	貸付有価証券 12,800株
ピー・エム・エル	6,700	3,620.00	24,254,000	
ワタベウェディング	3,700	501.00	1,853,700	貸付有価証券 300株
もしもしホットライン	21,200	1,329.00	28,174,800	
リソー教育	17,600	329.00	5,790,400	貸付有価証券 7,700株(2,900株)
早稲田アカデミー	1,700	844.00	1,434,800	
ユー・エス・エス	137,700	2,148.00	295,779,600	
東京個別指導学院	5,500	733.00	4,031,500	貸付有価証券

				2,400株(200株)
サイバーエージェント	27,800	5,970.00	165,966,000	
楽天	494,800	2,087.00	1,032,647,600	
テー・オー・ダブリュー	3,400	1,010.00	3,434,000	
セントラルスポーツ	3,900	2,224.00	8,673,600	
フルキャストホールディングス	11,700	747.00	8,739,900	貸付有価証券 100株(100株)
リゾートソリューション	11,000	275.00	3,025,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
テクノプロ・ホールディングス	16,100	3,175.00	51,117,500	貸付有価証券 5,900株
リブセンス	6,600	611.00	4,032,600	貸付有価証券 3,000株(2,400株)
ジャパンマテリアル	4,700	1,575.00	7,402,500	貸付有価証券 2,100株
ベクトル	2,500	1,685.00	4,212,500	
ウチヤマホールディングス	6,600	564.00	3,722,400	
サクセスホールディングス	1,200	1,198.00	1,437,600	貸付有価証券 100株
キャリアリンク	1,500	1,824.00	2,736,000	
アサンテ	3,800	1,530.00	5,814,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	400	2,820.00	1,128,000	
E R Iホールディングス	2,900	1,008.00	2,923,200	貸付有価証券 900株
アビスト	1,200	1,553.00	1,863,600	
ウィルグループ	1,300	1,639.00	2,130,700	
リクルートホールディングス	172,100	3,890.00	669,469,000	貸付有価証券 600株(600株)
リロ・ホールディング	3,900	9,780.00	38,142,000	
東祥	2,400	2,800.00	6,720,000	
エイチ・アイ・エス	18,500	4,045.00	74,832,500	貸付有価証券 1,800株
共立メンテナンス	6,800	5,960.00	40,528,000	
イチネンホールディングス	11,900	1,123.00	13,363,700	
建設技術研究所	6,700	1,246.00	8,348,200	貸付有価証券 2,900株(600株)
スペース	6,100	1,254.00	7,649,400	



燦ホールディングス	2,300	1,741.00	4,004,300	
スバル興業	8,000	435.00	3,480,000	
東京テアトル	43,000	139.00	5,977,000	
よみうりランド	23,000	465.00	10,695,000	貸付有価証券 1,000株
東京都競馬	78,000	293.00	22,854,000	貸付有価証券 34,000株(34,000株)
常磐興産	42,000	154.00	6,468,000	貸付有価証券 18,000株(1,000株)
カナモト	15,900	3,585.00	57,001,500	
東京ドーム	78,000	516.00	40,248,000	
西尾レントオール	9,200	3,460.00	31,832,000	
トランス・コスモス	14,900	2,716.00	40,468,400	
乃村工藝社	22,300	1,368.00	30,506,400	貸付有価証券 400株
藤田観光	41,000	405.00	16,605,000	貸付有価証券 3,000株
日本管財	5,600	2,860.00	16,016,000	
トーカイ	5,000	3,940.00	19,700,000	
白洋舎	12,000	258.00	3,096,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
セコム	110,500	8,695.00	960,797,500	
セントラル警備保障	5,000	1,395.00	6,975,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
丹青社	13,100	986.00	12,916,600	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
メイテック	15,200	3,925.00	59,660,000	
アサツー ディ・ケイ	21,400	3,285.00	70,299,000	
応用地質	11,900	1,611.00	19,170,900	
船井総研ホールディングス	12,300	1,238.00	15,227,400	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
進学会	4,700	538.00	2,528,600	
ベネッセホールディングス	41,600	3,060.00	127,296,000	
イオンディライト	11,000	3,195.00	35,145,000	
ナック	7,600	1,009.00	7,668,400	貸付有価証券 3,300株
ニチイ学館	22,200	1,157.00	25,685,400	貸付有価証券 9,900株(5,400株)
ダイセキ	18,300	2,291.00	41,925,300	貸付有価証券

					2,300株（2,300株）
	ステップ	3,800	965.00	3,667,000	
小計	銘柄数：1,866			254,864,000,400	
	組入時価比率：98.1%			100.0%	
合計				254,864,000,400	

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

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

## (2) 株式以外の有価証券(平成27年 5月11日現在)

該当事項はありません。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成27年 5月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	4,996,520,000	-	5,043,150,000	46,476,910
合計	4,996,520,000	-	5,043,150,000	46,476,910

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成27年 5月11日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	813,554,287
コール・ローン	3,336,890,339
株式	321,403,036,088
投資信託受益証券	40,831,521
投資証券	7,758,153,704

(平成27年 5月11日現在)

派生商品評価勘定	83,491,393
未収入金	1,824,747,560
未収配当金	512,761,617
未収利息	5,577
差入委託証拠金	1,517,945,657
流動資産合計	337,291,417,743
資産合計	337,291,417,743
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,795,510
未払金	4,435,500
未払解約金	3,541,216,910
その他未払費用	4,474,200
流動負債合計	3,555,922,120
負債合計	3,555,922,120
純資産の部	
元本等	
元本	146,878,539,520
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	186,856,956,103
元本等合計	333,735,495,623
純資産合計	333,735,495,623
負債純資産合計	337,291,417,743

## 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</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、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</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、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</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、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</p> <p>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</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	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金

	<p>（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27年 5月11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	2,2722円
(10,000口当たり純資産額)	(22,722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26年 5月13日 至 平成27年 5月11日	
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	

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

#### 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27年 5月11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27年 5月11日現在	
期首	平成26年 5月13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	149,456,306,918円
同期中における追加設定元本額	30,025,708,528円
同期中における一部解約元本額	32,603,475,926円
期末元本額	146,878,539,520円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	58,561,163円
バランスセレクト50	190,573,165円
バランスセレクト70	186,562,749円
野村外国株式インデックスファンド	578,745,638円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,469,621,764円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	10,489,844,553円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	6,075,934,940円
野村資産設計ファンド2015	50,699,039円

野村資産設計ファンド2020	48,536,797円
野村資産設計ファンド2025	51,524,483円
野村資産設計ファンド2030	50,832,226円
野村資産設計ファンド2035	39,078,475円
野村資産設計ファンド2040	129,970,041円
野村外国株インデックス（野村投資一任口座向け）	10,934,259,475円
のむらップ・ファンド（保守型）	470,569,411円
のむらップ・ファンド（普通型）	2,768,555,279円
のむらップ・ファンド（積極型）	2,943,942,751円
野村資産設計ファンド2045	9,665,500円
野村インデックスファンド・外国株式	1,721,354,262円
マイ・ロード	1,112,290,931円
ネクストコア	140,765,849円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	72,641,752円
野村外国株インデックス（野村SMA・EW向け）	37,036,300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）	1,227,184,612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）	519,079,093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）	10,522,066,734円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	4,281,321,977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）	9,316,716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）	38,309,989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）	33,054,401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）	143,830,573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）	1,549,158,728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）	553,296,951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）	266,118,724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）	35,731,077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）	273,227,436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）	4,954,497,464円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	614,217,960円
野村MSCI-KOKUSAインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,487,037,330円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	447,559円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,918,642円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	14,182,489円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	12,069,057円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA（確定拠出年金向け）	55,492,695,824円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,108,709,330円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	4,646,128,820円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	5,493,808,509円
マイバランスDC30	573,484,531円
マイバランスDC50	995,972,178円
マイバランスDC70	763,788,350円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA	10,474,382,780円
野村DC運用戦略ファンド	157,180,387円
野村DC運用戦略ファンドM	450,980円
野村DC運用戦略ファンドA	2,314,370円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	989,406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27年 5月11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	38,000	67.70	2,572,600.00	
		CAMERON INTERNATIONAL CORP	16,800	53.39	896,952.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	3,830	130.34	499,202.20	
		DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,500	33.80	219,700.00	
		ENSCO PLC-CL A	19,900	26.51	527,549.00	
		FMC TECHNOLOGIES INC	19,800	42.78	847,044.00	
		HALLIBURTON CO	73,200	48.11	3,521,652.00	
		HELMERICH & PAYNE	9,100	77.66	706,706.00	
		NABORS INDUSTRIES INC	22,900	16.31	373,499.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,000	53.23	1,969,510.00	
		NOBLE CORP PLC	21,100	17.10	360,810.00	
		OCEANEERING INTL INC	9,400	54.00	507,600.00	
		SCHLUMBERGER LTD	111,600	92.43	10,315,188.00	
		SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	13,200	24.71	326,172.00	
		WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	66,400	14.64	972,096.00	
		ANADARKO PETE	43,800	88.56	3,878,928.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	4,100	45.65	187,165.00	
		APACHE CORPORATION	32,400	65.54	2,123,496.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	35,200	35.06	1,234,112.00	
		CHENIERE ENERGY INC	19,700	78.00	1,536,600.00	
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	46,300	15.28	707,464.00	
		CHEVRON CORP	164,100	108.65	17,829,465.00	
		CIMAREX ENERGY CO	7,580	118.44	897,775.20	
		COBALT INTERNATIONAL ENERGY	23,600	10.64	251,104.00	
CONCHO RESOURCES INC	10,230	118.30	1,210,209.00			
CONOCOPHILLIPS	107,400	67.17	7,214,058.00			

CONSOL ENERGY INC	19,800	33.34	660,132.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,000	48.34	386,720.00
DEVON ENERGY CORP	33,700	67.89	2,287,893.00
ENERGEN CORP	6,000	67.68	406,080.00
EOG RESOURCES INC	47,400	93.50	4,431,900.00
EQT CORP	13,400	90.85	1,217,390.00
EXXON MOBIL CORP	367,700	88.99	32,721,623.00
HESS CORP	23,100	74.34	1,717,254.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	42.25	701,350.00
KINDER MORGAN INC	157,100	43.03	6,760,013.00
MARATHON OIL CORP	59,300	29.31	1,738,083.00
MARATHON PETROLEUM CORP	24,600	104.88	2,580,048.00
MURPHY OIL CORP	15,000	46.64	699,600.00
NOBLE ENERGY INC	33,300	49.12	1,635,696.00
OCCIDENTAL PETE CORP	68,100	77.90	5,304,990.00
ONEOK INC	18,300	44.75	818,925.00
PHILLIPS 66	48,400	81.63	3,950,892.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,810	159.06	2,037,558.60
QEP RESOURCES INC	14,700	21.59	317,373.00
RANGE RESOURCES CORP	14,300	64.29	919,347.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	33,600	28.94	972,384.00
SPECTRA ENERGY CORP	58,100	37.03	2,151,443.00
TESORO CORP	11,300	90.48	1,022,424.00
VALERO ENERGY CORP	45,700	59.09	2,700,413.00
WHITING PETROLEUM CORP	17,800	35.45	631,010.00
WILLIAMS COS	62,200	50.94	3,168,468.00
AIR PRODUCTS	18,600	147.97	2,752,242.00
AIRGAS INC	5,900	100.87	595,133.00
ALBEMARLE CORP	9,600	63.16	606,336.00
ASHLAND INC	5,900	130.50	769,950.00
CELANESE CORP-SERIES A	12,900	67.30	868,170.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,370	310.86	1,358,458.20
DOW CHEM CO	102,900	51.85	5,335,365.00
DU PONT E I DE NEMOURS	79,100	75.28	5,954,648.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	12,600	80.08	1,009,008.00



ECOLAB INC	23,600	114.79	2,709,044.00
FMC CORP	11,800	60.95	719,210.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	6,800	119.44	812,192.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	36,800	103.83	3,820,944.00
MONSANTO CO	42,300	120.79	5,109,417.00
MOSAIC CO/THE	28,100	45.46	1,277,426.00
PPG INDUSTRIES	11,900	229.05	2,725,695.00
PRAXAIR INC	25,300	121.02	3,061,806.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,010	287.20	2,013,272.00
SIGMA-ALDRICH	10,300	138.90	1,430,670.00
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,100	70.41	288,681.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,100	154.89	789,939.00
VULCAN MATERIALS CO	11,700	90.47	1,058,499.00
AVERY DENNISON CORP	8,300	58.20	483,060.00
BALL CORP	11,700	72.30	845,910.00
CROWN HOLDINGS INC	12,100	54.91	664,411.00
MEADWESTVACO CORP	14,000	49.07	686,980.00
OWENS-ILLINOIS INC	14,000	24.31	340,340.00
ROCK-TENN COMPANY CL-A	11,800	63.25	746,350.00
SEALED AIR CORP	17,900	47.91	857,589.00
ALCOA INC	102,100	13.82	1,411,022.00
FREEMONT-MCMORAN INC	89,400	23.29	2,082,126.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	42,400	26.04	1,104,096.00
NUCOR CORP	28,100	48.90	1,374,090.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	34,600	52.49	1,816,154.00
B/E AEROSPACE INC	9,000	59.59	536,310.00
BOEING CO	58,700	145.46	8,538,502.00
GENERAL DYNAMICS	24,660	141.66	3,493,335.60
HONEYWELL INTERNATIONAL	64,900	102.12	6,627,588.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	7,500	116.45	873,375.00
LOCKHEED MARTIN	23,460	190.48	4,468,660.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,820	156.31	2,629,134.20
PRECISION CASTPARTS CORP	12,390	206.36	2,556,800.40
RAYTHEON COMPANY	27,000	106.79	2,883,330.00
ROCKWELL COLLINS INC	10,500	97.26	1,021,230.00

TEXTRON INC	23,500	45.19	1,061,965.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,350	221.86	965,091.00
UNITED TECHNOLOGIES	75,100	118.43	8,894,093.00
MASCO CORP	31,000	26.45	819,950.00
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	8,400	48.01	403,284.00
FLUOR CORP	13,800	59.66	823,308.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,000	43.75	525,000.00
QUANTA SERVICES INC	18,600	28.77	535,122.00
AMETEK INC	21,300	52.91	1,126,983.00
EATON CORP PLC	40,900	72.10	2,948,890.00
EMERSON ELEC	60,700	58.79	3,568,553.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,900	120.08	1,428,952.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,900	56.51	785,489.00
3M CORP	52,760	160.60	8,473,256.00
DANAHER CORP	54,700	84.03	4,596,441.00
GENERAL ELEC CO	871,800	27.36	23,852,448.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,670	172.34	1,494,187.80
AGCO CORP	7,800	50.96	397,488.00
CATERPILLAR INC DEL	50,300	87.31	4,391,693.00
CUMMINS INC	14,900	140.66	2,095,834.00
DEERE & COMPANY	29,700	89.89	2,669,733.00
DOVER CORP	14,500	75.12	1,089,240.00
FLOWERVE CORP	12,300	55.70	685,110.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	32,500	95.92	3,117,400.00
INGERSOLL-RAND PLC	23,300	67.44	1,571,352.00
JOY GLOBAL INC	9,100	42.03	382,473.00
PACCAR	30,600	66.49	2,034,594.00
PALL CORP	9,500	99.52	945,440.00
PARKER HANNIFIN CORP	12,700	121.49	1,542,923.00
PENTAIR PLC	16,700	62.08	1,036,736.00
SNAP-ON INC	4,980	155.48	774,290.40
SPX CORP	3,300	76.11	251,163.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,700	103.33	1,312,291.00
WABTEC CORP	8,200	99.62	816,884.00
XYLEM INC	15,400	36.90	568,260.00

FASTENAL CO	24,700	42.72	1,055,184.00
GRAINGER(W.W.) INC	5,360	249.16	1,335,497.60
UNITED RENTALS INC	8,600	101.41	872,126.00
ADT CORP/THE	15,800	37.53	592,974.00
CINTAS CORP	8,900	82.41	733,449.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	25,200	40.27	1,014,804.00
STERICYCLE INC	7,550	134.01	1,011,775.50
TYCO INTERNATIONAL PLC	35,800	39.77	1,423,766.00
WASTE MANAGEMENT INC	38,100	49.33	1,879,473.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	12,800	65.70	840,960.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	17,300	48.06	831,524.50
FEDEX CORPORATION	23,250	173.35	4,030,387.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	61,300	100.36	6,152,068.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	16,000	49.04	784,640.00
DELTA AIR LINES INC	17,900	46.17	826,443.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	43.23	661,419.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	8,300	62.44	518,252.00
CSX CORP	87,200	36.68	3,198,496.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	38,700	20.94	810,378.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,000	87.43	699,440.00
KANSAS CITY SOUTHERN	9,700	102.16	990,952.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	27,000	100.63	2,717,010.00
UNION PAC CORP	77,100	107.44	8,283,624.00
AUTOLIV INC	8,100	121.72	985,932.00
BORGWARNER INC	19,500	61.27	1,194,765.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	26,000	85.33	2,218,580.00
JOHNSON CONTROLS INC	58,400	50.22	2,932,848.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	9,800	105.41	1,033,018.00
FORD MOTOR COMPANY	313,500	15.67	4,912,545.00
GENERAL MOTORS CO	111,100	35.32	3,924,052.00
HARLEY-DAVIDSON INC	19,100	57.23	1,093,093.00
TESLA MOTORS INC	7,710	236.61	1,824,263.10
DR HORTON INC	28,100	25.92	728,352.00
GARMIN LTD	10,200	45.94	468,588.00
JARDEN CORP	15,600	52.00	811,200.00

LEGGETT & PLATT INC	12,300	46.54	572,442.00
LENNAR CORP-A	15,600	47.49	740,844.00
MOHAWK INDUSTRIES	5,410	184.25	996,792.50
NEWELL RUBBERMAID INC	24,100	40.04	964,964.00
PULTEGROUP INC	29,500	19.79	583,805.00
TOLL BROTHERS INC	14,700	36.59	537,873.00
WHIRLPOOL CORP	6,800	185.65	1,262,420.00
HASBRO INC	9,400	71.22	669,468.00
MATTEL INC	30,100	27.14	817,064.50
POLARIS INDUSTRIES INC	5,610	143.01	802,286.10
COACH INC	24,300	38.46	934,578.00
FOSSIL GROUP INC	4,100	79.62	326,442.00
HANESBRANDS INC	34,000	31.66	1,076,440.00
LULULEMON ATHLETICA INC	9,800	65.49	641,802.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	17,600	62.51	1,100,176.00
NIKE INC-B	59,700	102.44	6,115,668.00
PVH CORP	7,160	106.06	759,389.60
RALPH LAUREN CORPORATION	5,230	134.39	702,859.70
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,400	79.08	1,138,752.00
V F CORP	29,700	71.90	2,135,430.00
CARNIVAL CORP	33,000	46.16	1,523,280.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,660	633.82	1,685,961.20
DARDEN RESTAURANTS INC	11,300	63.96	722,748.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,300	30.10	1,032,430.00
LAS VEGAS SANDS CORP	34,400	52.74	1,814,256.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	19,400	80.30	1,557,820.00
MCDONALD'S CORP	84,300	98.23	8,280,789.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,600	19.93	669,648.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9,900	54.10	535,590.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,500	72.45	1,050,525.00
STARBUCKS CORP	130,600	49.78	6,501,268.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	15,300	86.61	1,325,133.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,000	86.71	953,810.00
WYNN RESORTS LTD	6,950	117.84	818,988.00
YUM BRANDS INC	38,300	89.88	3,442,404.00

CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	16,700	20.55	343,185.00
CBS CORP-CL B	42,100	60.82	2,560,522.00
CHARTER COMMUNICATION-A	6,680	180.67	1,206,875.60
COMCAST CORP SPECIAL CL-A	36,600	58.22	2,130,852.00
COMCAST CORP-CL A	186,500	58.41	10,893,465.00
DIRECTV	41,200	89.38	3,682,456.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	12,500	31.33	391,625.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	24,600	28.90	711,063.00
DISH NETWORK CORP-A	19,000	66.86	1,270,340.00
DISNEY (WALT) CO	139,800	110.11	15,393,378.00
INTERPUBRIC GROUP	36,900	21.01	775,269.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	55,700	48.82	2,719,274.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	21,200	50.41	1,068,692.00
LIBERTY MEDIA CORP-A	8,170	37.93	309,888.10
LIBERTY MEDIA CORP-C	17,940	37.38	670,597.20
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	33,600	15.14	508,704.00
OMNICOM GROUP	21,300	77.09	1,642,017.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,100	68.00	482,800.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	222,000	3.87	859,140.00
TIME WARNER CABLE-A	24,230	154.68	3,747,896.40
TIME WARNER INC	73,200	84.23	6,165,636.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	118,700	32.79	3,892,173.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	37,900	32.44	1,229,476.00
VIACOM INC-CLASS B	30,900	66.44	2,052,996.00
GENUINE PARTS CO	13,600	94.08	1,279,488.00
LKQ CORP	26,300	27.50	723,381.50
AMAZON.COM INC	34,150	433.69	14,810,513.50
EXPEDIA INC	8,900	102.76	914,564.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP	38,100	27.70	1,055,370.00
NETFLIX INC	4,960	574.60	2,850,016.00
PRICELINE GROUP INC/THE	4,570	1,204.76	5,505,753.20
TRIPADVISOR INC	10,300	81.93	843,879.00
DOLLAR GENERAL CORP	26,600	74.85	1,991,010.00
DOLLAR TREE INC	17,900	79.18	1,417,322.00
FAMILY DOLLAR STORES	9,000	78.94	710,460.00

KOHL'S CORP	18,200	74.28	1,351,896.00
MACYS INC	29,700	65.94	1,958,418.00
NORDSTROM INC	12,100	77.27	934,967.00
TARGET CORP	52,800	80.74	4,263,072.00
ADVANCE AUTO PARTS	6,350	144.76	919,226.00
AUTONATION INC	6,200	63.12	391,344.00
AUTOZONE	2,750	686.13	1,886,857.50
BED BATH & BEYOND	16,500	71.44	1,178,760.00
BEST BUY COMPANY INC	26,400	36.61	966,504.00
CARMAX INC	18,400	71.53	1,316,152.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,800	55.62	433,836.00
FOOT LOCKER INC	12,300	61.44	755,712.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	10,000	40.19	401,900.00
GAP INC	21,200	39.61	839,732.00
HOME DEPOT	114,300	112.47	12,855,321.00
L BRANDS, INC	21,300	90.27	1,922,751.00
LOWES COS INC	86,100	73.26	6,307,686.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	8,720	221.09	1,927,904.80
ROSS STORES INC	18,400	102.55	1,886,920.00
SIGNET JEWELERS LTD	6,500	137.26	892,190.00
STAPLES INC	55,000	16.51	908,050.00
TIFFANY & CO	11,200	88.65	992,880.00
TJX COS INC	59,900	67.32	4,032,468.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,800	86.92	1,025,656.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,300	154.29	817,737.00
URBAN OUTFITTERS INC	9,600	40.67	390,432.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	38,220	145.88	5,575,533.60
CVS HEALTH CORP	99,400	100.66	10,005,604.00
KROGER CO	40,200	71.79	2,885,958.00
SYSCO CORP	50,500	36.61	1,848,805.00
WAL-MART STORES INC	139,700	78.53	10,970,641.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	76,100	85.02	6,470,022.00
WHOLE FOODS MARKET INC	30,800	42.58	1,311,618.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	10,700	92.48	989,536.00
COCA COLA CO	342,000	40.98	14,015,160.00

COCA COLA ENTERPRISES	20,600	45.98	947,188.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,700	116.32	1,709,904.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,600	76.51	1,270,066.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	13,500	74.55	1,006,425.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	12,220	128.47	1,569,903.40	
PEPSICO INC	129,800	96.55	12,532,190.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	56,500	51.25	2,895,625.00	
BUNGE LIMITED	12,800	89.91	1,150,848.00	
CAMPBELL SOUP CO	18,100	45.83	829,523.00	
CONAGRA INC	36,700	37.51	1,376,617.00	
GENERAL MILLS	52,900	56.27	2,976,683.00	
HERSHEY CO/THE	13,300	94.44	1,256,052.00	
HORMEL FOODS CORP	13,100	55.97	733,207.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,700	115.99	1,009,113.00	
KELLOGG CO	23,500	63.61	1,494,835.00	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	10,600	101.48	1,075,741.00	
KRAFT FOODS GROUP INC	50,900	86.04	4,379,436.00	
MCCORMICK & CO INC.	10,100	77.08	778,508.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,300	96.00	1,660,800.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	146,700	39.44	5,785,848.00	
TYSON FOODS INC-CL A	26,600	41.26	1,097,516.00	
ALTRIA GROUP INC	171,300	52.17	8,936,721.00	
LORILLARD INC	31,500	71.64	2,256,660.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	134,700	85.19	11,475,093.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	27,600	76.57	2,113,332.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,700	83.23	973,791.00	
CLOROX CO	11,200	107.59	1,205,008.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	79,600	68.20	5,428,720.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,500	141.85	780,175.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,300	110.71	3,575,933.00	
PROCTER & GAMBLE CO	234,500	80.96	18,985,120.00	
AVON PRODUCTS INC	37,800	7.21	272,538.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20,400	88.42	1,803,768.00	
ABBOTT LABORATORIES	131,400	47.57	6,250,698.00	
BARD (C R)	6,590	170.29	1,122,211.10	

BAXTER INTERNATIONAL INC.	47,200	69.59	3,284,648.00
BECTON,DICKINSON	18,030	142.01	2,560,440.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	114,700	17.51	2,008,397.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	12,400	51.11	633,764.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,200	126.40	1,162,880.00
HOLOGIC INC	19,900	33.99	676,401.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,160	494.32	1,562,051.20
MEDTRONIC PLC	122,800	76.21	9,358,588.00
RESMED INC	12,200	65.62	800,564.00
ST JUDE MEDICAL INC	25,000	72.46	1,811,500.00
STRYKER CORP	29,700	94.56	2,808,432.00
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,130	180.85	746,910.50
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,800	87.94	773,872.00
ZIMMER HOLDINGS INC	14,700	112.95	1,660,365.00
AETNA INC	30,800	109.26	3,365,208.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,200	115.30	2,213,760.00
ANTHEM INC	23,620	158.40	3,741,408.00
CARDINAL HEALTH INC	29,000	86.65	2,512,850.00
CIGNA CORP	22,900	128.49	2,942,421.00
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	14,900	82.17	1,224,333.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC- COMMON	64,100	85.71	5,494,011.00
HCA HOLDINGS INC	26,200	76.90	2,014,780.00
HENRY SCHEIN INC	7,440	138.27	1,028,728.80
HUMANA INC	13,400	167.90	2,249,860.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,700	118.40	1,030,080.00
MCKESSON CORP	20,260	229.08	4,641,160.80
OMNICARE INC	8,600	90.34	776,924.00
PATTERSON COS INC	7,500	46.06	345,450.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	12,600	71.02	894,852.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	83,200	115.68	9,624,576.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,900	120.63	952,977.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,100	163.02	2,787,642.00
ALKERMES PLC	12,300	59.25	728,775.00
AMGEN INC	65,960	162.34	10,707,946.40
BIOGEN INC	20,460	398.43	8,151,877.80



BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,600	121.66	1,654,576.00
CELGENE CORP	69,200	113.21	7,834,132.00
GILEAD SCIENCES INC	130,900	103.85	13,593,965.00
INCYTE CORP	13,000	103.83	1,349,790.00
ISIS PHARMACEUTICALS INC	9,900	61.94	613,206.00
MEDIVATION INC	6,600	123.65	816,090.00
PHARMACYCLICS INC	5,670	255.00	1,445,850.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,920	481.29	3,330,526.80
VERTEX PHARMACEUTICALS	21,100	127.41	2,688,351.00
ABBVIE INC	138,100	65.24	9,009,644.00
ACTAVIS PLC	32,640	292.82	9,557,644.80
BRISTOL MYERS SQUIBB	143,800	66.93	9,624,534.00
ELI LILLY & CO.	86,800	73.26	6,358,968.00
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,300	87.04	1,331,712.00
HOSPIRA INC	14,800	87.94	1,301,512.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,160	175.44	905,270.40
JOHNSON & JOHNSON	243,000	101.47	24,657,210.00
MALLINCKRODT PLC	10,000	122.67	1,226,700.00
MERCK & CO INC	247,400	60.74	15,027,076.00
MYLAN NV	36,200	71.31	2,581,422.00
PERRIGO CO PLC	12,300	192.60	2,368,980.00
PFIZER INC	546,900	34.02	18,605,538.00
ZOETIS INC	43,900	45.90	2,015,010.00
BANK OF AMERICA CORP	912,500	16.45	15,010,625.00
BB&T CORPORATION	62,000	39.06	2,421,720.00
CIT GROUP INC	16,400	46.10	756,040.00
CITIGROUP	262,800	54.02	14,196,456.00
COMERICA INC	15,900	48.11	764,949.00
FIFTH THIRD BANCORP	70,500	20.21	1,424,805.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,400	59.31	676,134.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	70,000	11.00	770,000.00
JPMORGAN CHASE & CO	324,500	65.49	21,251,505.00
KEYCORP	76,500	14.58	1,115,370.00
M & T BANK CORP	10,200	121.50	1,239,300.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	27,000	15.33	413,910.00

PNC FINANCIAL	46,000	93.65	4,307,900.00
REGIONS FINANCIAL CORP	120,000	9.93	1,191,600.00
SUNTRUST BKS INC.	44,800	42.36	1,897,728.00
US BANCORP	156,100	43.86	6,846,546.00
WELLS FARGO CO	427,800	56.05	23,978,190.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	100,220	148.31	14,863,628.20
CME GROUP INC	27,600	94.37	2,604,612.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,820	238.24	2,339,516.80
LEUCADIA NATIONAL CORP	27,200	24.00	652,800.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	23,700	106.63	2,527,131.00
MOODYS CORP	16,500	107.88	1,780,020.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	10,100	50.55	510,555.00
VOYA FINANCIAL INC	19,800	44.12	873,576.00
ACE LTD	29,000	108.78	3,154,620.00
AFLAC INC	39,200	64.22	2,517,424.00
ALLEGHANY CORP	1,410	480.50	677,505.00
ALLSTATE CORP	36,800	67.27	2,475,536.00
AMERICAN INTL GROUP	121,300	59.67	7,237,971.00
AON PLC	23,800	99.89	2,377,382.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,400	62.66	714,381.00
ASSURANT INC	6,200	64.66	400,892.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,000	55.06	440,480.00
CHUBB CORP	20,700	100.43	2,078,901.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,700	51.47	705,207.50
EVEREST RE GROUP LTD	4,020	181.66	730,273.20
FNF GROUP	21,100	37.55	792,305.00
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	41,300	8.28	341,964.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	37,000	41.71	1,543,270.00
LINCOLN NATIONAL CORP	22,300	58.77	1,310,571.00
LOEWS CORP	29,500	41.42	1,221,890.00
MARSH & MCLENNAN COS	47,200	57.96	2,735,712.00
METLIFE INC	83,500	52.25	4,362,875.00
PARTNERRE LTD	3,700	132.85	491,545.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,600	52.39	1,341,184.00
PROGRESSIVE CO	47,700	27.14	1,294,578.00

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,700	85.58	3,397,526.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,000	103.71	414,840.00
TORCHMARK CORP	11,250	57.20	643,500.00
TRAVELERS COS INC/THE	29,000	103.73	3,008,170.00
UNUM GROUP	22,700	34.65	786,555.00
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	14,000	47.89	670,460.00
WR BERKLEY CORP	9,800	49.98	489,804.00
XL GROUP PLC	26,700	36.98	987,366.00
CBRE GROUP INC	26,000	37.55	976,300.00
REALOGY HOLDINGS CORP	13,000	46.74	607,620.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,400	76.43	1,177,022.00
EBAY INC	97,600	58.82	5,740,832.00
FACEBOOK INC-A	173,600	78.51	13,629,336.00
GOOGLE INC-CL A	24,710	548.95	13,564,554.50
GOOGLE INC-CL C	25,090	538.22	13,503,939.80
LINKEDIN CORP - A	9,500	198.72	1,887,840.00
RACKSPACE HOSTING INC	11,000	54.00	594,000.00
TWITTER INC	32,800	37.59	1,232,952.00
VERISIGN INC	9,600	63.90	613,440.00
YAHOO! INC	78,800	44.09	3,474,292.00
ZILLOW GROUP INC	4,300	92.28	396,804.00
ACCENTURE PLC-CL A	54,800	95.89	5,254,772.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,560	303.30	1,686,348.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	42,200	87.35	3,686,170.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	52,500	63.09	3,312,225.00
COMPUTER SCIENCE	12,600	65.31	822,906.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	24,300	65.08	1,581,444.00
FISERV INC	21,400	80.14	1,714,996.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,650	154.82	1,029,553.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	81,570	172.68	14,085,507.60
MASTERCARD INC-CLASS A	86,800	93.51	8,116,668.00
PAYCHEX INC	28,800	49.13	1,414,944.00
TERADATA CORP	13,900	40.86	567,954.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,800	41.11	567,318.00
VANTIV INC - CL A	12,700	40.41	513,207.00

VISA INC-CLASS A SHARES	171,100	69.47	11,886,317.00	
WESTERN UNION CO	46,300	21.93	1,015,359.00	
XEROX CORP	95,600	11.37	1,086,972.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,600	25.04	1,091,962.00	
ADOBE SYSTEMS INC.	40,900	76.31	3,121,079.00	
ANSYS INC	7,800	86.69	676,182.00	
AUTODESK INC.	19,600	57.26	1,122,394.00	
CA INC	28,900	31.60	913,240.00	
CITRIX SYSTEMS INC	14,300	66.59	952,237.00	
ELECTRONIC ARTS	26,600	61.88	1,646,008.00	
FIREEYE INC	7,000	41.69	291,830.00	
INTUIT INC	23,400	102.75	2,404,350.00	
MICROSOFT CORP	680,000	47.75	32,470,000.00	
NETSUITE INC	2,800	97.99	274,372.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	20,900	16.57	346,313.00	
ORACLE CORPORATION	307,500	44.01	13,533,075.00	
RED HAT INC	16,700	75.98	1,268,866.00	
SALESFORCE.COM INC	51,800	72.40	3,750,320.00	
SERVICENOW INC	11,300	73.91	835,183.00	
SYMANTEC CORP	60,100	25.53	1,534,353.00	
SYNOPSYS INC	13,100	47.98	628,538.00	
VMWARE INC - CLASS A	7,400	88.00	651,200.00	
WORKDAY INC-CLASS A	8,300	89.51	742,933.00	
CISCO SYSTEMS	443,600	29.23	12,966,428.00	
F5 NETWORKS INC	6,500	126.05	819,325.00	
HARRIS CORP	9,200	78.87	725,604.00	
JUNIPER NETWORKS INC	32,700	26.98	882,246.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,700	60.59	1,193,623.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,800	151.10	876,380.00	
QUALCOMM INC	144,200	69.41	10,008,922.00	
APPLE INC	509,500	127.62	65,022,390.00	
EMC CORP	177,700	26.93	4,785,461.00	
HEWLETT PACKARD CO	163,000	33.41	5,445,830.00	
NETAPP INC	27,900	35.64	994,495.50	
SAN DISK CORPORATION	18,800	67.72	1,273,230.00	

SEAGATE TECHNOLOGY	28,200	57.23	1,614,027.00
WESTERN DIGITAL CORP	19,200	96.53	1,853,376.00
AMPHENOL CORP-CL A	26,500	56.81	1,505,465.00
ARROW ELECTRS INC	8,300	61.60	511,280.00
AVNET	11,800	44.75	528,050.00
CORNING INC	112,000	21.15	2,368,800.00
FLEXTRONICS INTL LTD	51,000	11.96	609,960.00
FLIR SYSTEMS INC	12,600	31.55	397,530.00
TE CONNECTIVITY LTD	35,400	68.91	2,439,414.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,200	25.49	591,368.00
ALTERA CORP.	26,000	44.46	1,155,960.00
ANALOG DEVICES INC	27,000	62.72	1,693,440.00
APPLIED MATERIALS	105,800	19.69	2,083,202.00
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	22,000	123.33	2,713,260.00
BROADCOM CORP-CL A	46,900	46.30	2,171,470.00
CREE INC	10,700	30.36	324,852.00
INTEL CORP	419,500	32.80	13,759,600.00
KLA TENCOR CORP	14,200	59.80	849,160.00
LAM RESEARCH	14,000	77.02	1,078,280.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	21,300	46.54	991,302.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	31,900	14.19	452,661.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,900	32.54	777,706.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	17,800	48.97	871,666.00
MICRON TECHNOLOGY	92,500	27.18	2,514,150.00
NVIDIA CORP	48,000	20.82	999,600.00
QORVO INC	12,500	76.56	957,000.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,300	97.71	1,592,673.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	92,200	54.70	5,043,340.00
XILINX INC	22,900	44.20	1,012,180.00
AT & T INC	450,100	33.69	15,163,869.00
CENTURYLINK INC	50,000	34.95	1,747,500.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	91,000	6.00	546,000.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,800	56.42	1,399,216.00
VERIZON COMMUNICATIONS	360,200	50.14	18,060,428.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	11,400	115.95	1,321,830.00

SPRINT CORP	65,000	4.77	310,050.00	
T-MOBILE US INC	20,500	33.77	692,285.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,400	55.80	2,365,920.00	
DUKE ENERGY CORP	61,800	77.11	4,765,398.00	
EDISON INTERNATIONAL	26,900	60.67	1,632,023.00	
ENTERGY CORP	15,900	76.40	1,214,760.00	
EVERSOURCE ENERGY	27,800	48.46	1,347,188.00	
EXELON CORPORATION	74,500	33.93	2,527,785.00	
FIRSTENERGY CORP	36,600	35.09	1,284,294.00	
NEXTERA ENERGY INC	37,700	101.21	3,815,617.00	
OGE ENERGY CORP	16,600	31.96	530,536.00	
PEPCO HOLDINGS INC	22,700	25.49	578,623.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,800	59.86	586,628.00	
PPL CORPORATION	57,200	33.90	1,939,080.00	
SOUTHERN CO.	77,700	44.15	3,430,455.00	
XCEL ENERGY INC	43,700	33.62	1,469,194.00	
ALLIANT ENERGY CORP	9,500	60.26	572,470.00	
AMEREN CORPORATION	20,600	40.39	832,034.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	34,500	20.72	714,840.00	
CMS ENERGY CORP	23,700	33.66	797,742.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,100	61.08	1,533,108.00	
DOMINION RESOURCES INC/VA	50,400	71.79	3,618,216.00	
DTE ENERGY COMPANY	15,700	79.21	1,243,597.00	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,000	72.08	504,560.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	15,100	20.48	309,248.00	
NISOURCE INC	27,300	44.07	1,203,111.00	
PG&E CORP	40,900	52.40	2,143,160.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	43,400	42.06	1,825,404.00	
SCANA CORP	11,300	52.25	590,425.00	
SEMPRA ENERGY	20,100	105.86	2,127,786.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	19,600	48.09	942,564.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,400	52.98	815,892.00	
HUDSON CITY BANCORP INC	39,000	9.41	366,990.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,900	17.02	679,098.00	
ALLY FINANCIAL INC	38,100	22.77	867,537.00	

AMERICAN EXPRESS CO	81,300	78.98	6,421,074.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	48,600	83.16	4,041,576.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	39,800	59.01	2,348,598.00	
NAVIENT CORP	37,100	20.02	742,742.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	14,300	33.20	474,760.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,810	223.47	1,074,890.70	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,210	126.35	2,048,133.50	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	98,400	43.41	4,271,544.00	
BLACKROCK INC	11,430	370.04	4,229,557.20	
EATON VANCE CORP	10,000	40.93	409,300.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	35,200	52.29	1,840,608.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	34,210	200.50	6,859,105.00	
INVESCO LTD	37,600	41.43	1,557,768.00	
LEGG MASON INC	9,200	54.34	499,928.00	
MORGAN STANLEY	128,300	37.89	4,861,287.00	
NORTHERN TRUST CORP	19,700	75.25	1,482,425.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,100	57.96	643,356.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	102,400	31.28	3,203,072.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,900	46.65	601,785.00	
STATE STREET CORP	36,600	78.75	2,882,250.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	22,300	81.68	1,821,464.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,000	36.38	873,120.00	
H & R BLOCK INC	23,400	31.02	725,868.00	
AES CORP	58,200	13.66	795,012.00	
CALPINE CORP	30,000	21.03	630,900.00	
NRG ENERGY INC	29,400	26.40	776,160.00	
CERNER CORP	26,600	68.02	1,809,332.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,000	42.50	1,232,500.00	
ILLUMINA INC	12,220	195.81	2,392,798.20	
METTLER-TOLEDO INTL	2,570	326.29	838,565.30	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	5,800	64.85	376,130.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,600	129.98	4,497,308.00	
WATERS CORP	7,300	130.40	951,920.00	
DUN & BRADSTREET CORP	3,100	125.84	390,104.00	
EQUIFAX INC	10,600	98.89	1,048,234.00	

	IHS INC-CLASS A	5,700	126.47	720,879.00	
	MANPOWERGROUP INC	7,000	84.71	592,970.00	
	NIELSEN NV	29,900	45.24	1,352,676.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	12,100	56.11	678,931.00	
	TOWERS WATSON & CO-CL A	6,300	130.62	822,906.00	
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	13,000	73.66	957,580.00	
小計	銘柄数：592			1,670,642,990.90	
				(200,026,085,300)	
	組入時価比率：59.9%			62.3%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	12,100	40.49	489,929.00	
	ARC RESOURCES LTD	26,600	23.71	630,686.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	18,500	22.46	415,510.00	
	CAMECO CORP	34,600	20.73	717,258.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	95,600	38.24	3,655,744.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	42,000	12.28	515,760.00	
	CENOVUS ENERGY INC	71,100	21.07	1,498,077.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	35,900	30.93	1,110,387.00	
	ENBRIDGE INC	73,900	62.14	4,592,146.00	
	ENCANA CORP	72,000	16.99	1,223,280.00	
	ENERPLUS CORP	18,700	13.78	257,686.00	
	HUSKY ENERGY INC	30,100	25.24	759,724.00	
	IMPERIAL OIL	25,300	50.11	1,267,783.00	
	INTER PIPELINE LTD	28,000	30.45	852,600.00	
	KEYERA CORP	14,400	41.88	603,072.00	
	MEG ENERGY CORP	13,600	19.53	265,608.00	
	PARAMOUNT RESOURCES LTD.	4,900	32.70	160,230.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,600	42.05	1,202,630.00	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,900	34.70	447,630.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	11,100	33.36	370,296.00	
	SUNCOR ENERGY INC	125,400	36.77	4,610,958.00	
	TALISMAN ENERGY	91,000	9.67	879,970.00	
	TOURMALINE OIL CORP	15,300	40.26	615,978.00	
	TRANSCANADA CORP	61,100	54.15	3,308,565.00	
	VERMILION ENERGY INC	9,300	57.29	532,797.00	
	AGRIUM INC	12,400	131.40	1,629,360.00	



METHANEX CORP	8,200	70.50	578,100.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	72,000	39.09	2,814,480.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,600	38.32	712,752.00
BARRICK GOLD	101,500	15.39	1,562,085.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	62,800	6.04	379,312.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	51,000	18.26	931,260.00
FRANCO-NEVADA CORP	13,500	64.42	869,670.00
GOLDCORP INC	70,700	22.66	1,602,062.00
KINROSS GOLD CORP	104,600	2.96	309,616.00
NEW GOLD INC	43,100	4.09	176,279.00
SILVER WHEATON CORP	35,100	24.00	842,400.00
TECK RESOURCES LTD	49,200	18.06	888,552.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	65,000	5.19	337,350.00
YAMANA GOLD INC	79,000	4.60	363,400.00
WEST FRASER TIMBER	5,600	64.03	358,568.00
BOMBARDIER B SHEARS	116,000	2.63	305,080.00
CAE INC	21,200	15.13	320,756.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,800	45.33	580,224.00
FINNING INTERNATIONAL INC	14,900	25.38	378,162.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	71,200	78.78	5,609,136.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	14,990	228.22	3,421,017.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	36,400	68.60	2,497,040.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,800	38.03	791,024.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,995	49.73	845,161.35
SHAW COMMUNICATIONS-B	35,100	27.44	963,144.00
THOMSON REUTERS CORP	31,600	49.45	1,562,620.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	6,400	127.60	816,640.00
DOLLARAMA INC	10,800	71.80	775,440.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	36,400	45.90	1,670,760.00
EMPIRE CO LTD A	4,600	88.47	406,962.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	6,200	23.24	144,088.00
LOBLAW COMPANIES	20,200	63.70	1,286,740.00
METRO INC	22,900	34.94	800,126.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,200	101.14	424,788.00
SAPUTO INC	21,600	35.65	770,040.00

CATAMARAN CORP	17,700	72.10	1,276,170.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	27,610	267.86	7,395,614.60	
BANK OF MONTREAL	56,500	77.94	4,403,610.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	105,300	65.41	6,887,673.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	34,500	95.26	3,286,470.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,000	48.64	1,361,920.00	
ROYAL BANK OF CANADA	125,000	79.18	9,897,500.00	
TORONTO DOMINION BANK	159,600	55.59	8,872,164.00	
ONEX CORP	8,000	69.15	553,200.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,770	633.00	1,120,410.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	26,100	36.94	964,134.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,300	42.60	353,580.00	
INTACT FINANCIAL CORP	11,100	89.51	993,561.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	172,600	22.98	3,966,348.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	33,000	33.50	1,105,500.00	
POWER FINANCIAL CORP	22,300	37.47	835,581.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	53,100	40.92	2,172,852.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	49,600	65.97	3,272,112.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,700	19.28	148,456.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	18,800	52.51	987,188.00	
CONSTELLATION SOFTWARE	1,540	491.45	756,833.00	
CONSTELLATION SOFTWARE-RIGHTS	1,540	0.17	261.80	
OPEN TEXT CORP	11,100	59.51	660,561.00	
BLACKBERRY LTD	43,900	11.93	523,727.00	
BCE INC	13,000	53.50	695,500.00	
TELUS CORP	19,300	41.97	810,021.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	32,000	43.47	1,391,040.00	
FORTIS INC	23,500	39.04	917,440.00	
ATCO LTD CL1	6,800	44.53	302,804.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,600	37.09	393,154.00	
CI FINANCIAL CORP	20,500	36.17	741,485.00	
IGM FINANCIAL INC	8,500	45.35	385,475.00	
TRANSALTA CORP	24,300	11.43	277,749.00	
小計銘柄数：94			137,418,593.55	

				(13,598,944,017)	
	組入時価比率：4.1%			4.2%	
ユーロ	SAIPEM	23,900	12.24	292,536.00	
	TECHNIP SA	8,800	61.81	543,928.00	
	TENARIS SA	41,700	13.45	560,865.00	
	ENI SPA	219,900	17.23	3,788,877.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	33,500	11.62	389,437.50	
	NESTE OIL OYJ	10,700	23.12	247,384.00	
	OMV AG	12,500	30.40	380,062.50	
	REPSOL SA	91,500	18.18	1,663,927.50	
	TOTAL SA	185,600	48.00	8,908,800.00	
	VOPAK	6,100	45.21	275,811.50	
	AIR LIQUIDE	30,100	120.60	3,630,060.00	
	AKZO NOBEL	21,000	69.27	1,454,670.00	
	ARKEMA	5,900	72.20	425,980.00	
	BASF SE	79,600	88.35	7,032,660.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	38.00	243,232.00	
	K+S AG	15,700	31.38	492,666.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	14,900	50.64	754,536.00	
	LANXESS	8,300	51.57	428,031.00	
	LINDE AG	16,030	178.55	2,862,156.50	
	OCI	8,000	26.51	212,080.00	
	SOLVAY SA	5,100	130.35	664,785.00	
	SYMRISE AG	10,600	58.14	616,284.00	
	UMICORE	8,800	44.80	394,240.00	
	CRH PLC	73,700	25.93	1,911,041.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	12,300	74.49	916,227.00	
	IMERYS	3,000	66.77	200,310.00	
	LAFARGE SA	16,000	64.26	1,028,160.00	
	ARCELORMITTAL	87,100	9.40	818,827.10	
	THYSSENKRUPP AG	40,400	24.84	1,003,536.00	
	VOESTALPINE AG	9,600	38.72	371,712.00	
	STORA ENSO OYJ-R	49,400	9.46	467,324.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	45,200	16.22	733,144.00	
	AIRBUS GROUP NV	51,500	63.40	3,265,100.00	
	FINMECCANICA SPA	37,000	11.38	421,060.00	

SAFRAN SA	25,700	67.25	1,728,325.00
THALES (EX THOMSON-CSF)	8,300	54.70	454,010.00
ZODIAC AEROSPACE	15,600	32.96	514,254.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	39,100	41.41	1,619,326.50
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,016	31.18	468,273.96
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	7,100	46.81	332,386.50
BOUYGUES	14,100	36.79	518,809.50
FERROVIAL SA	36,365	19.62	713,663.12
FERROVIAL SA-RIGHTS	36,365	0.29	10,800.40
VINCI	41,400	53.67	2,221,938.00
ALSTOM	18,700	28.03	524,254.50
LEGRAND SA	23,200	50.73	1,176,936.00
OSRAM LICHT AG	7,750	46.77	362,506.25
PRYSMIAN SPA	17,400	19.84	345,216.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,000	68.49	3,150,540.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	80,500	25.40	2,045,102.50
SIEMENS AG	69,200	97.11	6,720,012.00
ANDRITZ AG	6,500	55.93	363,545.00
CNH INDUSTRIAL NV	80,100	7.74	620,374.50
GEA GROUP AG	16,300	43.67	711,902.50
KONE OYJ	27,300	39.48	1,077,804.00
MAN SE	3,200	94.60	302,720.00
METSO OYJ	10,400	26.04	270,816.00
VALLOUREC	9,300	21.97	204,367.50
WARTSILA OYJ	12,300	40.38	496,674.00
ZARDOYA OTIS S.A	16,224	11.55	187,387.20
BRENNTAG AG	13,290	56.12	745,834.80
REXEL SA	25,200	16.33	411,642.00
BIC	2,500	150.15	375,375.00
EDENRED	18,700	24.13	451,324.50
BOLLORE	75,000	5.06	379,950.00
DEUTSCHE POST AG-REG	83,400	29.96	2,499,081.00
TNT EXPRESS NV	36,000	7.64	275,112.00
DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	19,200	13.23	254,112.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED	74,000	7.86	581,640.00

AIRLINES GRP				
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	35,000	16.02	560,700.00	
ADP	2,400	112.20	269,280.00	
AENA SA	5,500	87.50	481,250.00	
ATLANTIA SPA	35,100	23.62	829,062.00	
FRAPORT AG	2,900	59.26	171,854.00	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	41,000	13.70	561,700.00	
CONTINENTAL AG	9,470	217.50	2,059,725.00	
MICHELIN B	16,200	102.10	1,654,020.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,200	31.36	319,872.00	
PIRELLI&CO	21,100	15.43	325,573.00	
VALEO	6,600	146.80	968,880.00	
BAYER MOTOREN WERK	28,600	109.50	3,131,700.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,700	83.92	394,424.00	
DAIMLER AG	83,400	88.07	7,345,038.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	78,000	13.50	1,053,000.00	
PEUGEOT CITROEN	34,200	17.19	587,898.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	13,400	84.74	1,135,516.00	
RENAULT	16,800	94.78	1,592,304.00	
VOLKSWAGEN AG	2,570	225.35	579,149.50	
VOLKSWAGEN AG-PREF	14,040	232.00	3,257,280.00	
ADIDAS AG	18,600	73.74	1,371,564.00	
CHRISTIAN DIOR SE	4,780	177.25	847,255.00	
HERMES INTERNATIONAL	2,330	337.45	786,258.50	
HUGO BOSS AG	5,800	108.25	627,850.00	
KERING	6,630	163.95	1,086,988.50	
LUXOTTICA GROUP SPA	14,800	59.90	886,520.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	24,400	160.80	3,923,520.00	
ACCOR SA	18,200	48.77	887,705.00	
SODEXO	8,000	92.66	741,280.00	
ALTICE SA	7,800	93.32	727,896.00	
AXEL SPRINGER SE	3,500	50.27	175,945.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,000	31.06	403,845.00	
JC DECAUX INTERNATIONAL	5,300	34.92	185,102.50	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,080	120.75	251,160.00	

LAGARDERE S.C.A	9,700	27.08	262,676.00	
NUMERICABLE-SFR	8,500	50.41	428,485.00	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	18,700	47.22	883,107.50	
PUBLICIS GROUPE	16,100	74.74	1,203,314.00	
REED ELSEVIER NV	59,900	21.91	1,312,409.00	
RTL GROUP	3,300	81.75	269,775.00	
SES FDR	26,100	30.88	805,968.00	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,300	52.67	226,481.00	
VIVENDI SA	105,400	22.75	2,397,850.00	
WOLTERS KLUWER	25,900	28.91	748,769.00	
INDITEX SA	94,100	29.04	2,733,134.50	
CARREFOUR SUPERMARCHE	48,300	30.76	1,485,708.00	
CASINO GUICHARD	4,900	79.70	390,530.00	
COLRUYT SA	6,100	42.55	259,585.50	
DELHAIZE GROUP	8,700	72.39	629,793.00	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	57,000	7.40	422,085.00	
JERONIMO MARTINS	22,400	12.95	290,080.00	
KONINKLIJKE AHOLD NV	78,600	17.23	1,354,671.00	
METRO AG	13,400	30.95	414,730.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	69,700	109.60	7,639,120.00	
HEINEKEN HOLDING NV	9,100	62.80	571,480.00	
HEINEKEN NV	20,000	71.48	1,429,600.00	
PERNOD-RICARD	18,300	111.30	2,036,790.00	
REMY COINTREAU	2,300	66.10	152,030.00	
DANONE	50,000	63.89	3,194,500.00	
KERRY GROUP PLC-A	14,700	64.84	953,148.00	
UNILEVER NV-CVA	142,200	39.42	5,606,235.00	
HENKEL AG & CO KGAA	10,100	91.61	925,261.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,400	105.90	1,630,860.00	
BEIERSDORF AG	8,700	81.66	710,442.00	
LOREAL-ORD	21,730	173.45	3,769,068.50	
ESSILOR INTERNATIONAL	17,600	111.55	1,963,280.00	
CELESIO AG	5,200	26.67	138,684.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	18,800	76.53	1,438,764.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	32,600	55.09	1,795,934.00	

GRIFOLS SA	13,200	36.17	477,444.00
BAYER AG	71,710	132.75	9,519,502.50
MERCK KGAA	11,300	100.25	1,132,825.00
ORION OYJ	8,700	29.81	259,347.00
SANOFI	103,600	91.69	9,499,084.00
U.C.B. SA	11,000	61.69	678,590.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	375,000	0.59	222,000.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	551,771	9.13	5,038,221.00
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD	3,040,000	0.08	272,688.00
BANCO DE SABADELL SA	381,600	2.35	898,286.40
BANCO POPOLARE SPA	30,300	14.44	437,532.00
BANCO SANTANDER SA	1,247,891	6.80	8,485,658.80
BANK OF IRELAND	2,530,000	0.36	910,800.00
BANKIA SA	385,000	1.21	469,315.00
BANKINTER S.A.	58,000	6.82	395,908.00
BCO POPULAR ESPANOL	156,309	4.82	753,409.38
BCO POPULAR ESPANOL - RTS	156,222	0.01	2,861.98
BNP PARIBAS	91,700	57.41	5,264,497.00
CAIXABANK	197,978	4.42	875,656.69
COMMERZBANK AG	83,100	12.32	1,024,207.50
CREDIT AGRICOLE SA	88,200	13.92	1,228,185.00
ERSTE GROUP BANK AG	25,100	26.10	655,110.00
ING GROEP NV	337,100	14.26	4,807,046.00
INTESA SANPAOLO	1,109,000	3.14	3,488,914.00
INTESA SANPAOLO-RSP	76,000	2.80	212,800.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROUPE NV	21,400	58.76	1,257,464.00
NATIXIS	79,000	7.25	572,750.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	15.17	166,870.00
SOCIETE GENERALE	62,500	44.07	2,754,687.50
UNICREDIT SPA	379,000	6.54	2,478,660.00
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	75,000	7.20	540,000.00
DEUTSCHE BOERSE AG	16,800	75.50	1,268,400.00
EURAZEO	3,025	61.53	186,128.25
EXOR SPA	8,600	42.36	364,296.00

GROUPE BRUXELLES LAM	7,200	75.20	541,440.00	
WENDEL	2,800	109.75	307,300.00	
AEGON NV	159,000	7.02	1,116,498.00	
AGEAS	19,400	32.77	635,835.00	
ALLIANZ SE	39,580	151.00	5,976,580.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	101,100	17.61	1,780,371.00	
AXA	158,900	23.44	3,725,410.50	
CNP ASSURANCES	13,500	16.00	216,000.00	
DELTA LLOYD NV	18,300	16.92	309,727.50	
HANNOVER RUECK SE	5,300	87.00	461,100.00	
MAPFRE SA	79,000	3.24	256,592.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	15,150	174.60	2,645,190.00	
NN GROUP NV	13,600	26.04	354,212.00	
SAMPO OYJ-A	38,800	44.00	1,707,200.00	
SCOR SE	14,000	30.87	432,180.00	
UNIPOLSAI SPA	80,000	2.50	200,000.00	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN	3,100	36.68	113,708.00	
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN SE	30,100	29.45	886,445.00	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	25,700	23.46	603,050.50	
IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00	
IMMOFINANZ AG	82,000	2.61	214,512.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	10,500	40.24	422,572.50	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	38,400	40.41	1,551,744.00	
ATOS	7,100	70.72	502,112.00	
CAP GEMINI SA	12,500	80.71	1,008,875.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,400	69.00	786,600.00	
GEMALTO	6,800	81.04	551,072.00	
SAP SE	80,400	67.92	5,460,768.00	
ALCATEL-LUCENT	246,000	3.43	844,518.00	
NOKIA OYJ	322,000	6.20	1,996,400.00	
ASML HOLDING NV	30,600	96.35	2,948,310.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	100,000	11.40	1,140,000.00	
STMICROELECTRONICS NV	57,700	7.00	403,900.00	
BELGACOM SA	13,700	33.38	457,306.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	277,300	16.92	4,693,302.50	



	ELISA CORPORATION	12,500	27.41	342,625.00	
	ILIAD SA	2,190	213.00	466,470.00	
	KONINKLIJKE KPN NV	272,000	3.40	924,800.00	
	ORANGE	159,800	14.77	2,360,246.00	
	TELECOM ITALIA SPA	860,000	1.06	911,600.00	
	TELECOM ITALIA-RNC	520,000	0.85	444,340.00	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	47,600	5.50	262,038.00	
	TELEFONICA SA	387,500	13.77	5,337,812.50	
	ELECTRICITE DE FRANCE	20,300	22.26	451,979.50	
	ENDESA S.A.	26,300	17.27	454,332.50	
	ENEL SPA	572,000	4.22	2,417,272.00	
	ENERGIAS DE PORTUGAL	200,000	3.65	730,000.00	
	FORTUM OYJ	39,600	17.89	708,444.00	
	IBERDROLA SA	445,000	6.08	2,709,160.00	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,600	75.09	720,864.00	
	TERNA SPA	135,000	4.21	569,430.00	
	ENAGAS	17,500	27.04	473,287.50	
	GAS NATURAL SDG	30,500	21.84	666,272.50	
	SNAM SPA	178,000	4.73	843,008.00	
	E.ON SE	174,200	13.99	2,437,058.00	
	GDF SUEZ	127,000	18.52	2,352,675.00	
	RWE AG	43,200	23.29	1,006,344.00	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	27,000	18.73	505,710.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	37,200	18.53	689,502.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	120,600	28.86	3,481,119.00	
	MEDIOBANCA SPA-ORD	55,000	8.96	492,800.00	
	ENEL GREEN POWER SPA	160,000	1.78	284,800.00	
	QIAGEN NV	20,100	21.87	439,687.50	
	BUREAU VERITAS SA	23,100	20.98	484,753.50	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,000	52.59	578,490.00	
	小計 銘柄数：238			317,567,826.83	
				(42,487,399,551)	
	組入時価比率：12.7%			13.2%	
英債券	AMEC FOSTER WHEELER PLC PLC	33,200	8.85	293,986.00	
	PETROFAC LTD	22,700	8.55	194,085.00	

BG GROUP PLC	295,400	11.90	3,516,737.00
BP PLC	1,582,000	4.61	7,297,766.00
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	339,100	20.72	7,026,152.00
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	211,400	20.96	4,430,944.00
TULLOW OIL PLC	78,200	4.07	318,508.60
CRODA INTERNATIONAL PLC	11,500	28.86	331,890.00
JOHNSON MATTHEY PLC	17,700	33.52	593,304.00
REXAM PLC	59,555	5.71	340,059.05
ANGLO AMERICAN PLC	122,400	11.15	1,365,372.00
ANTOFAGASTA PLC	34,900	7.90	275,710.00
BHP BILLITON PLC	182,600	15.60	2,849,473.00
FRESNILLO PLC	20,900	7.06	147,658.50
GLENCORE PLC	962,000	3.02	2,911,012.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,400	47.64	352,536.00
RIO TINTO PLC-REG	111,200	29.98	3,334,332.00
BAE SYSTEMS PLC	271,000	5.09	1,380,745.00
COBHAM PLC	99,000	3.00	297,693.00
MEGGITT PLC	70,600	5.27	372,062.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT	23,532,900	0.00	23,532.90
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	162,600	10.30	1,674,780.00
SMITHS GROUP PLC	33,900	11.62	393,918.00
IMI PLC	22,600	12.00	271,200.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	86,427	2.67	230,846.51
WEIR GROUP PLC	18,200	18.81	342,342.00
ASHTED GROUP PLC	43,100	11.63	501,253.00
BUNZLE	29,500	19.11	563,745.00
TRAVIS PERKINS PLC	20,900	21.40	447,260.00
WOLSELEY PLC	22,300	39.75	886,425.00
AGGREKO PLC	23,033	16.51	380,274.83
BABCOCK INTL GROUP PLC	21,900	10.83	237,177.00
G4S PLC	136,800	2.93	401,918.40
ROYAL MAIL PLC	55,000	4.78	263,395.00
EASYJET PLC	14,200	18.60	264,120.00
GKN PLC	143,000	3.58	512,226.00
PERSIMMON PLC	27,700	17.46	483,642.00

BURBERRY GROUP PLC	39,300	17.80	699,540.00
CARNIVAL PLC	16,500	30.93	510,345.00
COMPASS GROUP PLC	145,100	11.80	1,712,180.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	20,123	28.20	567,468.60
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	65,000	4.56	296,400.00
TUI AG-DI	39,852	12.47	496,954.44
WHITBREAD PLC	15,800	52.75	833,450.00
WILLIAM HILL PLC	76,000	3.95	300,884.00
ITV PLC	334,000	2.60	870,738.00
PEARSON	72,000	13.17	948,240.00
REED ELSEVIER PLC	97,400	10.94	1,065,556.00
SKY PLC	89,200	10.81	964,252.00
WPP PLC	115,100	15.42	1,774,842.00
MARKS & SPENCER PLC	141,000	5.63	794,535.00
NEXT PLC	13,300	74.30	988,190.00
DIXONS CARPHONE PLC	85,000	4.50	382,925.00
KINGFISHER PLC	206,000	3.69	760,140.00
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	21,300	6.54	139,302.00
MORRISON SUPERMARKETS	192,000	1.81	347,520.00
SAINSBURY	111,800	2.78	310,804.00
TESCO PLC	705,000	2.28	1,613,392.50
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,400	14.15	246,210.00
DIAGEO PLC	217,600	17.91	3,897,216.00
SABMILLER PLC	84,600	35.99	3,044,754.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,300	29.28	916,464.00
TATE & LYLE ORD.	42,500	6.03	256,487.50
UNILEVER PLC	112,100	28.94	3,244,174.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	161,600	36.40	5,882,240.00
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	82,700	32.97	2,726,619.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,500	58.45	3,302,425.00
SMITH & NEPHEW PLC	76,400	11.42	872,488.00
ASTRAZENECA PLC	109,400	45.32	4,958,008.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	421,400	14.78	6,230,399.00
SHIRE PLC	51,000	53.30	2,718,300.00
BARCLAYS PLC	1,436,000	2.58	3,705,598.00

HSBC HOLDINGS PLC	1,665,000	6.41	10,674,315.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,940,000	0.86	4,290,390.00	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	221,000	3.52	778,804.00	
STANDARD CHARTERED PLC	213,500	10.53	2,249,222.50	
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	27,209	25.53	694,645.77	
ADMIRAL GROUP PLC	17,500	15.23	266,525.00	
AVIVA PLC	348,240	5.44	1,896,166.80	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	131,000	3.22	421,820.00	
LEGAL & GENERAL	515,000	2.69	1,385,350.00	
OLD MUTUAL PLC	427,000	2.34	999,607.00	
PRUDENTIAL PLC	224,100	16.47	3,692,047.50	
RSA INSURANCE GROUP PLC	90,750	4.33	393,582.75	
STANDARD LIFE PLC	173,727	4.75	825,376.97	
SAGE GROUP PLC (THE)	95,000	5.43	516,325.00	
ARM HOLDINGS PLC	123,000	11.46	1,409,580.00	
BT GROUP PLC	711,000	4.69	3,339,211.50	
INMARSAT PLC	38,900	10.22	397,558.00	
VODAFONE GROUP PLC	2,297,000	2.33	5,358,901.00	
SSE PLC	85,900	16.47	1,414,773.00	
CENTRICA PLC	426,000	2.78	1,185,132.00	
NATIONAL GRID PLC	329,000	9.05	2,980,411.00	
SEVERN TRENT PLC	20,300	21.51	436,653.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	60,100	9.99	600,699.50	
3I GROUP PLC	87,000	5.02	437,175.00	
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	83,000	4.51	374,994.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	22,000	12.13	266,860.00	
ICAP PLC	46,000	5.62	258,750.00	
INVESTEC PLC	47,000	6.18	290,695.00	
SCHRODERS PLC	11,400	33.20	378,480.00	
CAPITA PLC	58,100	12.38	719,278.00	
EXPERIAN PLC	86,000	11.56	994,160.00	
INTERTEK GROUP PLC	13,700	26.50	363,050.00	
小計銘柄数：104			154,177,661.12	
			(28,481,239,338)	
組入時価比率：8.5%				8.9%

スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	31,500	16.98	534,870.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	730	400.50	292,365.00
	GIVAUDAN-REG	798	1,757.00	1,402,086.00
	SIKA AG-BR	194	3,134.00	607,996.00
	SYNGENTA AG	8,150	396.90	3,234,735.00
	HOLCIM LTD-REG	20,100	74.70	1,501,470.00
	GEBERIT AG-REG	3,340	330.20	1,102,868.00
	ABB LTD	192,300	20.39	3,920,997.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	157.00	303,010.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,970	159.20	632,024.00
	SULZER AG-REG	2,000	108.60	217,200.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,530	132.30	599,319.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	45,100	82.35	3,713,985.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,650	394.40	1,045,160.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	77.65	357,190.00
	ARYZTA AG	7,200	61.05	439,560.00
	BARRY CALLEBAUT AG	190	1,113.00	211,470.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	87	5,080.00	441,960.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	9	59,725.00	537,525.00
	NESTLE SA-REG	279,900	72.55	20,306,745.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,560	133.50	608,760.00
	ACTELION LTD	8,900	128.60	1,144,540.00
	NOVARTIS-REG	199,700	95.65	19,101,305.00
	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	60,970	266.10	16,224,117.00
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	2,440	65.50	159,820.00
	BALOISE HOLDING AG	4,090	119.30	487,937.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,890	225.80	652,562.00
	SWISS RE LTD	30,400	82.20	2,498,880.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,920	295.20	3,813,984.00
	SWISS PRIME SITE-REG	4,700	82.20	386,340.00
	SWISSCOM AG-REG	2,020	553.50	1,118,070.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	133,700	24.35	3,255,595.00
JULIUS BAER GROUP LTD	19,800	48.35	957,330.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,560	296.50	462,540.00	
UBS GROUP AG	316,300	19.81	6,265,903.00	

	LONZA AG-REG	4,600	131.40	604,440.00	
	ADECCO SA-REG	14,800	72.00	1,065,600.00	
	SGS SA-REG	465	1,815.00	843,975.00	
小計	銘柄数：38			101,054,233.00	
				(12,990,521,652)	
	組入時価比率：3.9%			4.0%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	20,100	140.10	2,816,010.00	
	BOLIDEN AB	23,000	178.50	4,105,500.00	
	ASSA ABLOY AB-B	29,400	483.30	14,209,020.00	
	SKANSKA AB-B SHS	32,900	177.30	5,833,170.00	
	ALFA LAVAL AB	27,000	159.90	4,317,300.00	
	ATLAS COPCO AB-A	58,400	255.70	14,932,880.00	
	ATLAS COPCO AB-B	34,400	228.70	7,867,280.00	
	SANDVIK AB	92,700	100.30	9,297,810.00	
	SKF AB-B SHARES	33,600	202.40	6,800,640.00	
	VOLVO AB-B SHS	132,000	110.60	14,599,200.00	
	SECURITAS AB-B SHS	25,800	118.80	3,065,040.00	
	ELECTROLUX AB-B	20,800	250.60	5,212,480.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	61.55	2,338,900.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	82,000	334.80	27,453,600.00	
	ICA GRUPPEN AB	6,600	312.90	2,065,140.00	
	SWEDISH MATCH AB	17,400	251.70	4,379,580.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	50,200	221.10	11,099,220.00	
	ELEKTA AB-B SHS	31,700	77.00	2,440,900.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,100	204.90	3,503,790.00	
	NORDEA BANK AB	262,000	106.50	27,903,000.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	132,000	101.00	13,332,000.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	43,300	377.40	16,341,420.00	
	SWEDBANK AB	78,700	191.10	15,039,570.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,000	164.10	2,297,400.00	
	INVESTOR AB-B SHS	39,700	335.10	13,303,470.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	20,300	270.10	5,483,030.00	
	ERICSSON LM-B	266,000	94.80	25,216,800.00	
	HEXAGON AB-B SHS	22,800	298.40	6,803,520.00	
	TELIA AB	229,000	51.60	11,816,400.00	

	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6,000	639.00	3,834,000.00	
	TELE 2 AB-B SHS	28,400	110.60	3,141,040.00	
小計	銘柄数：31			290,849,110.00	
	組入時価比率：1.3%			(4,214,403,603)	1.3%
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD	33,800	98.75	3,337,750.00	
	SUBSEA 7 SA	25,900	83.00	2,149,700.00	
	STATOIL ASA	98,200	155.80	15,299,560.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,700	401.80	6,308,260.00	
	NORSK HYDRO	116,000	36.27	4,207,320.00	
	ORKLA ASA	68,800	60.65	4,172,720.00	
	DNB ASA	83,700	137.20	11,483,640.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,200	125.40	2,156,880.00	
	TELENOR ASA	65,600	179.40	11,768,640.00	
	小計	銘柄数：9			60,884,470.00
	組入時価比率：0.3%			(972,933,830)	0.3%
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	21,200	311.70	6,608,040.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,900	329.00	6,218,100.00	
	ISS A/S	10,400	223.70	2,326,480.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	335	12,840.00	4,301,400.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	622	13,290.00	8,266,380.00	
	DSV A/S	16,000	229.00	3,664,000.00	
	PANDORA A/S	9,800	693.50	6,796,300.00	
	CARLSBERG B	9,300	621.50	5,779,950.00	
	COLOPLAST-B	9,900	519.00	5,138,100.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,100	546.00	1,146,600.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	174,000	373.10	64,919,400.00	
	DANSKE BANK AS	56,400	194.90	10,992,360.00	
	TRYG A/S	1,900	731.50	1,389,850.00	
	TDC A/S	68,800	49.22	3,386,336.00	
小計	銘柄数：14			130,933,296.00	
	組入時価比率：0.7%			(2,347,633,997)	0.7%

豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	18,000	9.88	177,840.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	23,500	33.09	777,615.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	98,000	12.43	1,218,140.00	
	SANTOS LTD.	84,600	8.59	726,714.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	64,600	33.80	2,183,480.00	
	INCITEC PIVOT LTD	143,000	3.91	559,130.00	
	ORICA LTD	32,600	20.34	663,084.00	
	BORAL LTD	67,000	6.19	414,730.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,900	14.93	550,917.00	
	AMCOR	107,000	13.48	1,442,360.00	
	ALUMINA LTD	233,000	1.68	392,605.00	
	BHP BILLITON LIMITED	278,200	31.30	8,707,660.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,000	2.50	355,000.00	
	ILUKA RESOURCES LTD	37,800	8.46	319,788.00	
	NEWCREST MINING	65,000	13.75	893,750.00	
	RIO TINTO LTD	38,000	58.43	2,220,340.00	
	CIMIC GROUP LTD	8,938	21.55	192,613.90	
	BRAMBLES LTD	136,000	10.92	1,485,120.00	
	TOLL HLDGS	62,000	9.00	558,000.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	47,000	3.40	159,800.00	
	ASCIANO LTD	85,000	6.40	544,000.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,000	4.86	928,260.00	
	SYDNEY AIRPORT	97,900	5.19	508,101.00	
	TRANSURBAN GROUP	156,604	9.74	1,525,322.96	
	CROWN RESORTS LTD	29,700	12.83	381,051.00	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	43.84	227,968.00	
	TABCORP HOLDINGS	78,000	4.57	356,460.00	
	TATTS GROUP LTD	131,000	3.91	512,210.00	
	REA GROUP LTD	4,100	41.99	172,159.00	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	39,727	4.35	172,812.45	
	WESFARMERS LIMITED	98,400	43.74	4,304,016.00	
	WOOLWORTHS LIMITED	108,800	27.38	2,978,944.00	
	COCA-COLA AMATIL LTD	52,000	9.89	514,280.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	54,000	5.08	274,320.00	
	COCHLEAR LTD	5,200	80.43	418,236.00	



	HEALTHSCOPE LTD	96,000	2.81	269,760.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,900	62.10	738,990.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	33,900	19.45	659,355.00	
	CSL LIMITED	41,200	89.66	3,693,992.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	238,700	32.35	7,721,945.00	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,115	13.07	393,603.05	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,300	12.16	477,888.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	140,600	82.64	11,619,184.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	206,500	35.20	7,268,800.00	
	WESTPAC BANKING CORP	269,400	34.05	9,173,070.00	
	ASX LTD	17,500	42.09	736,575.00	
	AMP LIMITED	260,000	6.37	1,656,200.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	204,000	5.50	1,122,000.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	230,000	2.15	494,500.00	
	QBE INSURANCE	117,000	13.79	1,613,430.00	
	SUNCORP GROUP LTD	110,000	12.95	1,424,500.00	
	COMPUTERSHARE LTD	41,000	12.23	501,430.00	
	TELSTRA CORP LTD	377,000	6.17	2,326,090.00	
	TPG TELECOM LTD	27,000	9.06	244,620.00	
	AUSTNET SERVICES	163,400	1.44	236,113.00	
	APA GROUP	99,000	8.94	885,060.00	
	AGL ENERGY LTD	56,640	14.77	836,572.80	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,800	79.18	1,963,664.00	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	17,000	7.37	125,290.00	
	ALS LTD	35,236	5.46	192,388.56	
	SEEK LTD	28,800	15.69	451,872.00	
小計	銘柄数：61			94,643,719.72	
				(8,976,956,815)	
	組入時価比率：2.7%			2.8%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,000	8.49	526,380.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	88,110	4.60	405,746.55	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	30,000	8.19	245,700.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	163,000	2.85	464,550.00	
	CONTACT ENERGY LTD	31,800	5.56	176,808.00	
	MIGHTY RIVER POWER	60,000	2.88	173,100.00	

	MERIDIAN ENERGY LTD	100,000	2.40	240,000.00	
小計	銘柄数：7			2,232,284.55	
				(198,025,962)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	185,000	111.40	20,609,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	135,500	13.48	1,826,540.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	19.56	2,092,920.00	
	MTR CORP	130,500	37.55	4,900,275.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	126,000	26.75	3,370,500.00	
	LI & FUNG LTD	493,600	7.54	3,721,744.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	62,000	29.70	1,841,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	206,000	37.80	7,786,800.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	78,000	14.98	1,168,440.00	
	SANDS CHINA LTD	208,000	33.00	6,864,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	74,333	11.58	860,776.14	
	SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	10.06	1,669,960.00	
	WYNN MACAU LTD	132,400	15.84	2,097,216.00	
	WH GROUP LIMITED	310,000	5.39	1,670,900.00	
	BANK OF EAST ASIA	96,860	33.85	3,278,711.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	315,500	29.80	9,401,900.00	
	HANG SENG BANK	67,000	153.40	10,277,800.00	
	FIRST PACIFIC CO	226,000	7.42	1,676,920.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	95,900	283.80	27,216,420.00	
	AIA GROUP LTD	1,043,400	51.25	53,474,250.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	120,000	163.20	19,584,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	192,000	24.90	4,780,800.00	
	HENDERSON LAND	93,652	62.10	5,815,789.20	
	HYSAN DEVELOPMENT	54,000	36.05	1,946,700.00	
	KERRY PROPERTIES	57,000	32.25	1,838,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	466,666	10.74	5,011,992.84	
	SINO LAND CO.LTD	256,000	13.68	3,502,080.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	146,000	131.10	19,140,600.00	
	SWIRE PACIFIC-A	54,500	105.30	5,738,850.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	100,800	27.05	2,726,640.00	
	WHARF(HOLDING)	133,000	56.65	7,534,450.00	

	WHEELLOCK & COMPANY LTD	77,000	44.55	3,430,350.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	86.15	1,886,685.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	219,600	10.36	2,275,056.00	
	PCCW LTD	386,000	5.36	2,068,960.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	55,000	64.85	3,566,750.00	
	CLP HLDGS	167,500	68.70	11,507,250.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	123,000	78.50	9,655,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	551,413	18.56	10,234,225.28	
小計	銘柄数：39			288,051,400.46	
				(4,447,513,623)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	141,000	3.65	514,650.00	
	KEPPEL CORP.	123,700	8.78	1,086,086.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	83,040	4.37	362,884.80	
	SEMBCORP MARINE	72,600	3.00	217,800.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	1.45	237,165.00	
	NOBLE GROUP LTD	412,481	0.83	342,359.23	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	49,040	11.77	577,200.80	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	167,000	3.00	501,000.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	524,600	1.02	537,715.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	146,000	4.13	602,980.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	9,000	41.23	371,070.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	615,320	0.41	255,357.80	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	160,000	3.20	512,000.00	
	DBS GROUP HLDGS	149,400	21.05	3,144,870.00	
	OCBC-ORD	263,500	10.45	2,753,575.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	111,900	24.16	2,703,504.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,000	8.55	581,400.00	
	CAPITALAND LIMITED	229,000	3.58	819,820.00	
	CITY DEVELOPMENT	37,000	10.28	380,360.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	264,000	2.68	707,520.00	
	UOL GROUP LIMITED	38,700	7.61	294,507.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	686,000	4.32	2,963,520.00	
	STARHUB LTD	53,000	4.27	226,310.00	

新シケル	小計	銘柄数：23			20,693,654.63	
					(1,860,980,360)	
						0.6%
		組入時価比率：0.6%				
	DELEK GROUP LTD		470	1,085.00	509,950.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED		34,000	27.10	921,400.00	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE		210	1,403.00	294,630.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		75,100	235.80	17,708,580.00	
	BANK HAPOALIM BM		93,000	19.43	1,806,990.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL		115,000	15.00	1,725,000.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		9,000	43.41	390,690.00		
NICE SYSTEMS LTD		5,300	245.40	1,300,620.00		
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP		165,000	7.14	1,178,100.00		
小計	銘柄数：9				25,835,960.00	
					(800,398,040)	
						0.2%
	組入時価比率：0.2%					
合計					321,403,036,088	
					(321,403,036,088)	

(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27年 5月11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		341,030.00	
	小計	銘柄数：1		341,030.00	
				(40,831,521)	
					0.5%
	組入時価比率：0.0%				
	合計			40,831,521	
				(40,831,521)	
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	29,500	608,585.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	81,000	734,670.00	
		AMERICAN TOWER CORP	36,300	3,446,685.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,000	808,000.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,340	1,910,903.40	
		BOSTON PROPERTIES	13,280	1,770,622.40	

	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,600	575,776.00	
	COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	10,200	282,030.00	
	CROWN CASTLE INTL CORP	28,700	2,401,329.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800	776,204.00	
	DUKE REALTY CORP	28,600	574,002.00	
	EQUINIX INC	4,690	1,256,591.70	
	EQUITY RESIDENTIAL	29,600	2,215,264.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,460	1,241,822.40	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,800	777,374.00	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,600	1,290,820.00	
	HCP INC	39,800	1,584,836.00	
	HEALTH CARE REIT INC	30,300	2,186,448.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	65,900	1,339,088.00	
	IRON MOUNTAIN INC	14,800	524,512.00	
	KIMCO REALTY CORP	36,900	905,895.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	12,500	436,000.00	
	MACERICH CO /THE	12,200	1,001,254.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	15,400	661,276.00	
	PROLOGIS INC	43,800	1,784,850.00	
	PUBLIC STORAGE	12,640	2,484,139.20	
	RAYONIER INC	11,800	308,570.00	
	REALTY INCOME CORP	19,300	913,855.00	
	REGENCY CENTERS CORP	8,000	519,680.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	27,150	5,094,697.50	
	SL GREEN REALTY CORP	8,600	1,057,886.00	
	UDR INC	22,600	758,230.00	
	VENTAS INC	28,300	1,956,096.00	
	VORNADO REALTY TRUST	14,900	1,533,061.00	
	WEYERHAEUSER CO	45,900	1,493,127.00	
小計	銘柄数：35	901,260	47,214,179.60	
			(5,652,953,723)	
	組入時価比率：1.7%		72.5%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	10,500	237,930.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,400	421,056.00	
小計	銘柄数：2	24,900	658,986.00	

			(65,213,254)	
	組入時価比率：0.0%		0.8%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,500	206,300.00	
	GECINA SA	2,470	291,336.50	
	ICADE	3,000	218,910.00	
	KLEPIERRE	15,600	657,306.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	8,440	2,056,828.00	
小計	銘柄数：5	32,010	3,430,680.50	
			(458,990,744)	
	組入時価比率：0.1%		5.9%	
英ポンド	BRITISH LAND	84,000	707,280.00	
	HAMMERSON PLC	67,000	451,580.00	
	INTU PROPERTIES PLC	77,000	264,649.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	68,000	858,840.00	
	SEGRO PLC	69,000	289,179.00	
小計	銘柄数：5	365,000	2,571,528.00	
			(475,038,367)	
	組入時価比率：0.1%		6.1%	
豪ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	75,000	550,500.00	
	FEDERATION CENTRES	132,200	393,956.00	
	GOODMAN GROUP	150,000	933,000.00	
	GPT GROUP	148,000	645,280.00	
	LEND LEASE GROUP	48,000	779,040.00	
	MIRVAC GROUP	336,000	655,200.00	
	NOVION PROPERTY GROUP	184,200	462,342.00	
	SCENTRE GROUP	455,000	1,719,900.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	197,000	856,950.00	
	WESTFIELD CORP	171,400	1,621,444.00	
小計	銘柄数：10	1,896,800	8,617,612.00	
			(817,380,498)	
	組入時価比率：0.2%		10.5%	
香港ドル	LINK REIT	200,000	9,420,000.00	
小計	銘柄数：1	200,000	9,420,000.00	
			(145,444,800)	
	組入時価比率：0.0%		1.9%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	187,000	460,020.00	

		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	192,000	312,000.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	219,900	468,387.00	
		SUNTEC REIT	203,000	351,190.00	
	小計	銘柄数：4	801,900	1,591,597.00	
				(143,132,318)	
		組入時価比率：0.0%		1.8%	
	合計			7,758,153,704	
				(7,758,153,704)	
	合計			7,798,985,225	
				(7,798,985,225)	

(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27年 5月11日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	4,128,753,585	-	4,205,832,468	77,078,883
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	243,028,300	-	242,411,300	617,000
米ドル	98,350,800	-	98,170,400	180,400
カナダドル	9,899,000	-	9,895,000	4,000
ユーロ	93,996,000	-	93,653,000	343,000
英ポンド	27,786,000	-	27,708,000	78,000
香港ドル	7,735,000	-	7,720,000	15,000
新シェケル	5,261,500	-	5,264,900	3,400
合計	-	-	-	77,695,883

(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27年 5月11日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	33,682,072
国債証券	6,886,119,920
未収入金	31,642,800
未収利息	21,864,148
前払費用	396,759
流動資産合計	6,973,705,699
資産合計	6,973,705,699
負債の部	
流動負債	
未払解約金	40,126,701
流動負債合計	40,126,701
負債合計	40,126,701
純資産の部	
元本等	
元本	5,438,368,348
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,495,210,650
元本等合計	6,933,578,998
純資産合計	6,933,578,998
負債純資産合計	6,973,705,699

## 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



3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>約定日基準で計上しております。</p> <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>
------------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

平成27年 5月11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	1.2749円
(10,000口当たり純資産額)	(12,749円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11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 style="padding-left: 20px;">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 style="padding-left: 20px;">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 style="padding-left: 20px;">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27年 5月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成27年 5月11日現在	
期首	平成26年 5月13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	5,120,703,874円
同期中における追加設定元本額	721,223,710円
同期中における一部解約元本額	403,559,236円
期末元本額	5,438,368,348円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	565,753,041円
バランスセレクト50	671,150,787円
バランスセレクト70	262,824,381円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	28,174,417円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	49,788,045円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	17,001,656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）	3,740,066,814円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	93,070,994円
野村DC運用戦略ファンドM	10,538,213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27年 5月11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27年 5月11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348回	70,000,000	70,116,900	
		国庫債券 利付（2年）第350回	40,000,000	40,073,200	
		国庫債券 利付（5年）第97回	30,000,000	30,134,100	

国庫債券	利付（5年）第98回	10,000,000	10,033,600
国庫債券	利付（5年）第99回	60,000,000	60,325,200
国庫債券	利付（5年）第100回	50,000,000	50,203,000
国庫債券	利付（5年）第101回	40,000,000	40,256,800
国庫債券	利付（5年）第102回	70,000,000	70,336,700
国庫債券	利付（5年）第103回	40,000,000	40,222,000
国庫債券	利付（5年）第104回	50,000,000	50,185,000
国庫債券	利付（5年）第105回	50,000,000	50,205,000
国庫債券	利付（5年）第106回	40,000,000	40,188,400
国庫債券	利付（5年）第107回	40,000,000	40,208,400
国庫債券	利付（5年）第110回	20,000,000	20,168,200
国庫債券	利付（5年）第111回	40,000,000	40,450,400
国庫債券	利付（5年）第113回	50,000,000	50,449,500
国庫債券	利付（5年）第114回	20,000,000	20,187,800
国庫債券	利付（5年）第115回	60,000,000	60,361,800
国庫債券	利付（5年）第116回	60,000,000	60,367,200
国庫債券	利付（5年）第117回	30,000,000	30,184,500
国庫債券	利付（5年）第118回	50,000,000	50,307,000
国庫債券	利付（5年）第119回	40,000,000	40,081,600
国庫債券	利付（5年）第120回	20,000,000	20,117,200
国庫債券	利付（5年）第121回	30,000,000	30,045,600
国庫債券	利付（5年）第122回	100,000,000	100,091,000
国庫債券	利付（5年）第123回	40,000,000	40,019,200
国庫債券	利付（40年）第1回	10,000,000	12,361,500
国庫債券	利付（40年）第2回	10,000,000	11,850,900
国庫債券	利付（40年）第3回	20,000,000	23,719,800
国庫債券	利付（40年）第4回	15,000,000	17,800,650
国庫債券	利付（40年）第5回	28,000,000	31,698,520
国庫債券	利付（40年）第6回	20,000,000	22,064,600
国庫債券	利付（40年）第7回	10,000,000	10,439,600
国庫債券	利付（10年）第280回	42,000,000	42,883,260
国庫債券	利付（10年）第281回	35,000,000	35,774,550
国庫債券	利付（10年）第282回	45,000,000	46,040,400
国庫債券	利付（10年）第283回	20,000,000	20,489,600

回			
国庫債券 利付(10年)第284回	75,000,000	77,052,750	
国庫債券 利付(10年)第285回	68,000,000	70,147,440	
国庫債券 利付(10年)第286回	30,000,000	31,136,100	
国庫債券 利付(10年)第287回	50,000,000	51,998,500	
国庫債券 利付(10年)第288回	65,000,000	67,603,250	
国庫債券 利付(10年)第289回	100,000,000	103,908,000	
国庫債券 利付(10年)第290回	50,000,000	51,996,000	
国庫債券 利付(10年)第291回	20,000,000	20,741,400	
国庫債券 利付(10年)第292回	45,000,000	47,181,600	
国庫債券 利付(10年)第293回	30,000,000	31,671,300	
国庫債券 利付(10年)第294回	40,000,000	42,104,000	
国庫債券 利付(10年)第295回	25,000,000	26,159,750	
国庫債券 利付(10年)第296回	65,000,000	68,225,950	
国庫債券 利付(10年)第297回	40,000,000	41,981,200	
国庫債券 利付(10年)第298回	20,000,000	20,918,400	
国庫債券 利付(10年)第299回	45,000,000	47,180,700	
国庫債券 利付(10年)第300回	35,000,000	36,965,250	
国庫債券 利付(10年)第301回	45,000,000	47,672,100	
国庫債券 利付(10年)第302回	40,000,000	42,211,600	
国庫債券 利付(10年)第303回	45,000,000	47,619,900	
国庫債券 利付(10年)第304回	30,000,000	31,616,100	

国庫債券 利付(10年)第305回	70,000,000	73,935,400	
国庫債券 利付(10年)第306回	45,000,000	47,847,600	
国庫債券 利付(10年)第307回	30,000,000	31,753,500	
国庫債券 利付(10年)第308回	30,000,000	31,836,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	40,000,000	42,041,600	
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	31,429,800	
国庫債券 利付(10年)第311回	20,000,000	20,740,200	
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	74,229,400	
国庫債券 利付(10年)第313回	60,000,000	64,095,600	
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	31,699,200	
国庫債券 利付(10年)第315回	50,000,000	53,223,500	
国庫債券 利付(10年)第316回	10,000,000	10,584,200	
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	31,804,200	
国庫債券 利付(10年)第318回	40,000,000	42,153,600	
国庫債券 利付(10年)第319回	30,000,000	31,853,400	
国庫債券 利付(10年)第320回	30,000,000	31,657,500	
国庫債券 利付(10年)第321回	30,000,000	31,675,500	
国庫債券 利付(10年)第322回	30,000,000	31,472,400	
国庫債券 利付(10年)第323回	20,000,000	20,987,800	
国庫債券 利付(10年)第324回	70,000,000	72,941,400	
国庫債券 利付(10年)第325回	70,000,000	72,912,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	40,000,000	41,358,800	

回			
国庫債券 利付(10年)第327回	40,000,000	41,657,200	
国庫債券 利付(10年)第328回	70,000,000	71,831,200	
国庫債券 利付(10年)第329回	70,000,000	72,912,700	
国庫債券 利付(10年)第330回	50,000,000	52,080,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	30,000,000	30,758,700	
国庫債券 利付(10年)第332回	50,000,000	51,236,500	
国庫債券 利付(10年)第333回	20,000,000	20,473,200	
国庫債券 利付(10年)第334回	20,000,000	20,459,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	50,000,000	50,656,500	
国庫債券 利付(10年)第336回	40,000,000	40,482,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	10,000,000	9,930,400	
国庫債券 利付(10年)第338回	10,000,000	10,009,400	
国庫債券 利付(30年)第3回	10,000,000	12,125,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	10,000,000	11,979,400	
国庫債券 利付(30年)第6回	10,000,000	12,272,300	
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	18,179,700	
国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	22,605,400	
国庫債券 利付(30年)第9回	20,000,000	21,309,200	
国庫債券 利付(30年)第10回	10,000,000	10,143,700	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	11,090,000	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	11,733,300	
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	11,550,500	
国庫債券 利付(30年)第14回	30,000,000	36,632,700	
国庫債券 利付(30年)第15回	10,000,000	12,386,100	
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	12,372,300	
国庫債券 利付(30年)第17回	10,000,000	12,194,900	
国庫債券 利付(30年)第18回	20,000,000	24,008,200	

国庫債券	利付(30年)第19回	10,000,000	11,995,300
国庫債券	利付(30年)第20回	10,000,000	12,338,700
国庫債券	利付(30年)第21回	10,000,000	11,965,500
国庫債券	利付(30年)第22回	10,000,000	12,332,700
国庫債券	利付(30年)第23回	10,000,000	12,334,500
国庫債券	利付(30年)第24回	21,000,000	25,927,230
国庫債券	利付(30年)第25回	20,000,000	23,938,800
国庫債券	利付(30年)第26回	40,000,000	48,604,400
国庫債券	利付(30年)第27回	20,000,000	24,691,800
国庫債券	利付(30年)第28回	30,000,000	37,093,800
国庫債券	利付(30年)第29回	20,000,000	24,356,000
国庫債券	利付(30年)第30回	30,000,000	35,985,900
国庫債券	利付(30年)第31回	20,000,000	23,613,600
国庫債券	利付(30年)第32回	30,000,000	36,075,300
国庫債券	利付(30年)第33回	40,000,000	45,600,400
国庫債券	利付(30年)第34回	30,000,000	35,499,000
国庫債券	利付(30年)第35回	32,000,000	36,504,640
国庫債券	利付(30年)第36回	30,000,000	34,213,800
国庫債券	利付(30年)第37回	30,000,000	33,530,700
国庫債券	利付(30年)第38回	20,000,000	21,888,000
国庫債券	利付(30年)第39回	20,000,000	22,332,000
国庫債券	利付(30年)第40回	20,000,000	21,867,800
国庫債券	利付(30年)第41回	20,000,000	21,378,200
国庫債券	利付(30年)第42回	20,000,000	21,364,600
国庫債券	利付(30年)第43回	10,000,000	10,664,400
国庫債券	利付(30年)第44回	20,000,000	21,314,800
国庫債券	利付(30年)第45回	10,000,000	10,156,100
国庫債券	利付(30年)第46回	10,000,000	10,146,400
国庫債券	利付(20年)第33回	20,000,000	21,030,600
国庫債券	利付(20年)第37回	30,000,000	32,191,200
国庫債券	利付(20年)第40回	70,000,000	75,352,200
国庫債券	利付(20年)第41回	30,000,000	31,696,500
国庫債券	利付(20年)第42回	10,000,000	10,986,700
国庫債券	利付(20年)第43回	10,000,000	11,233,900
国庫債券	利付(20年)第44回	10,000,000	11,172,300
国庫債券	利付(20年)第45回	10,000,000	11,121,300

国庫債券	利付（20年）第46回	5,000,000	5,535,150
国庫債券	利付（20年）第47回	15,000,000	16,683,450
国庫債券	利付（20年）第49回	60,000,000	66,929,400
国庫債券	利付（20年）第52回	25,000,000	28,088,250
国庫債券	利付（20年）第53回	10,000,000	11,275,400
国庫債券	利付（20年）第54回	10,000,000	11,337,100
国庫債券	利付（20年）第55回	10,000,000	11,243,700
国庫債券	利付（20年）第56回	10,000,000	11,260,800
国庫債券	利付（20年）第57回	10,000,000	11,190,700
国庫債券	利付（20年）第58回	10,000,000	11,216,100
国庫債券	利付（20年）第59回	10,000,000	11,090,400
国庫債券	利付（20年）第60回	10,000,000	10,866,400
国庫債券	利付（20年）第61回	10,000,000	10,573,400
国庫債券	利付（20年）第62回	10,000,000	10,416,100
国庫債券	利付（20年）第63回	10,000,000	11,217,800
国庫債券	利付（20年）第64回	10,000,000	11,318,100
国庫債券	利付（20年）第65回	10,000,000	11,351,700
国庫債券	利付（20年）第66回	20,000,000	22,535,400
国庫債券	利付（20年）第67回	10,000,000	11,369,800
国庫債券	利付（20年）第68回	10,000,000	11,633,300
国庫債券	利付（20年）第69回	30,000,000	34,641,300
国庫債券	利付（20年）第70回	10,000,000	11,834,800
国庫債券	利付（20年）第71回	10,000,000	11,657,900
国庫債券	利付（20年）第72回	20,000,000	23,212,800
国庫債券	利付（20年）第73回	30,000,000	34,583,700
国庫債券	利付（20年）第74回	10,000,000	11,620,800
国庫債券	利付（20年）第75回	40,000,000	46,599,600
国庫債券	利付（20年）第76回	17,000,000	19,472,310
国庫債券	利付（20年）第77回	15,000,000	17,332,200
国庫債券	利付（20年）第78回	10,000,000	11,473,400
国庫債券	利付（20年）第79回	10,000,000	11,576,300
国庫債券	利付（20年）第80回	10,000,000	11,673,600
国庫債券	利付（20年）第81回	10,000,000	11,591,000
国庫債券	利付（20年）第82回	15,000,000	17,544,450
国庫債券	利付（20年）第83回	15,000,000	17,567,400
国庫債券	利付（20年）第84回	10,000,000	11,610,100



国庫債券 利付(20年)第85回	13,000,000	15,243,020	
国庫債券 利付(20年)第86回	10,000,000	11,932,600	
国庫債券 利付(20年)第87回	30,000,000	35,487,000	
国庫債券 利付(20年)第88回	20,000,000	23,912,800	
国庫債券 利付(20年)第89回	20,000,000	23,701,400	
国庫債券 利付(20年)第90回	20,000,000	23,742,800	
国庫債券 利付(20年)第91回	10,000,000	11,979,300	
国庫債券 利付(20年)第92回	30,000,000	35,323,200	
国庫債券 利付(20年)第93回	20,000,000	23,343,600	
国庫債券 利付(20年)第94回	20,000,000	23,580,400	
国庫債券 利付(20年)第95回	10,000,000	12,033,800	
国庫債券 利付(20年)第96回	15,000,000	17,698,800	
国庫債券 利付(20年)第97回	10,000,000	11,929,700	
国庫債券 利付(20年)第99回	20,000,000	23,640,400	
国庫債券 利付(20年)第100回	20,000,000	23,903,600	
国庫債券 利付(20年)第101回	20,000,000	24,397,200	
国庫債券 利付(20年)第102回	20,000,000	24,418,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	15,000,000	18,130,950	
国庫債券 利付(20年)第104回	10,000,000	11,836,700	
国庫債券 利付(20年)第105回	20,000,000	23,680,200	
国庫債券 利付(20年)第106回	10,000,000	11,963,600	
国庫債券 利付(20年)第107回	20,000,000	23,699,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	20,000,000	23,182,800	
国庫債券 利付(20年)第109回	10,000,000	11,595,800	
国庫債券 利付(20年)第110回	20,000,000	23,715,400	
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	11,994,800	
国庫債券 利付(20年)第112回	35,000,000	41,503,000	

国庫債券 利付(20年)第113回	40,000,000	47,428,800
国庫債券 利付(20年)第114回	30,000,000	35,588,700
国庫債券 利付(20年)第115回	10,000,000	11,995,500
国庫債券 利付(20年)第116回	10,000,000	11,993,800
国庫債券 利付(20年)第118回	10,000,000	11,711,700
国庫債券 利付(20年)第119回	10,000,000	11,424,500
国庫債券 利付(20年)第120回	25,000,000	27,845,250
国庫債券 利付(20年)第122回	20,000,000	22,844,400
国庫債券 利付(20年)第123回	10,000,000	11,844,600
国庫債券 利付(20年)第124回	20,000,000	23,394,400
国庫債券 利付(20年)第125回	10,000,000	11,994,800
国庫債券 利付(20年)第126回	10,000,000	11,696,300
国庫債券 利付(20年)第127回	20,000,000	23,094,800
国庫債券 利付(20年)第128回	20,000,000	23,072,600
国庫債券 利付(20年)第129回	20,000,000	22,772,000
国庫債券 利付(20年)第130回	20,000,000	22,744,600
国庫債券 利付(20年)第131回	15,000,000	16,830,750
国庫債券 利付(20年)第132回	10,000,000	11,204,200
国庫債券 利付(20年)第133回	20,000,000	22,715,200
国庫債券 利付(20年)第134回	10,000,000	11,341,800
国庫債券 利付(20年)第135回	15,000,000	16,780,350
国庫債券 利付(20年)第136回	15,000,000	16,548,450

	回			
	国庫債券 利付(20年)第137回	10,000,000	11,169,200	
	国庫債券 利付(20年)第138回	10,000,000	10,857,100	
	国庫債券 利付(20年)第139回	10,000,000	11,013,000	
	国庫債券 利付(20年)第140回	30,000,000	33,451,800	
	国庫債券 利付(20年)第141回	30,000,000	33,393,600	
	国庫債券 利付(20年)第142回	20,000,000	22,581,000	
	国庫債券 利付(20年)第143回	10,000,000	10,950,300	
	国庫債券 利付(20年)第144回	10,000,000	10,790,000	
	国庫債券 利付(20年)第145回	20,000,000	22,180,000	
	国庫債券 利付(20年)第146回	30,000,000	33,205,200	
	国庫債券 利付(20年)第147回	40,000,000	43,525,600	
	国庫債券 利付(20年)第148回	10,000,000	10,691,300	
	国庫債券 利付(20年)第149回	20,000,000	21,330,200	
	国庫債券 利付(20年)第150回	20,000,000	20,940,600	
	国庫債券 利付(20年)第151回	10,000,000	10,088,000	
	国庫債券 利付(20年)第152回	10,000,000	10,056,400	
小計	銘柄数: 244 組入時価比率: 99.3%	6,366,000,000	6,886,119,920 100.0%	
合計			6,886,119,920	

(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27年 5月11日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	1,805,316,113
コール・ローン	2,001,674,074
国債証券	520,433,659,516
派生商品評価勘定	1,147,174
未収入金	259,868,778
未収利息	4,568,606,051
前払費用	781,085,409
流動資産合計	529,851,357,115
<b>資産合計</b>	<b>529,851,357,115</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,165,637
未払金	2,859,588,516
未払解約金	921,991,078
その他未払費用	7,129,100
流動負債合計	3,792,874,331
<b>負債合計</b>	<b>3,792,874,331</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	226,250,611,838
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	299,807,870,946
元本等合計	526,058,482,784
純資産合計	526,058,482,784
<b>負債純資産合計</b>	<b>529,851,357,115</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	<p>国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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27年 5月11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	2.3251円
(10,000口当たり純資産額)	(23,251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26年 5月13日 至 平成27年 5月11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、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>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</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 style="padding-left: 20px;">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 style="padding-left: 20px;">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 style="padding-left: 20px;">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27年 5月11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27年 5月11日現在	
期首	平成26年 5月13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	141,638,321,997円
同期中における追加設定元本額	115,185,647,477円
同期中における一部解約元本額	30,573,357,636円
期末元本額	226,250,611,838円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	84,703,792円
バランスセレクト50	91,931,341円
バランスセレクト70	71,873,499円
野村外国債券インデックスファンド	290,077,914円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,589,205,722円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	33,740,052,397円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,675,108,883円
野村資産設計ファンド2015	64,254,622円
野村資産設計ファンド2020	57,363,787円
野村資産設計ファンド2025	47,734,736円
野村資産設計ファンド2030	41,745,342円
野村資産設計ファンド2035	28,462,149円
野村資産設計ファンド2040	78,214,339円
野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け）	112,089,107,120円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	2,230,574,762円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	3,461,242,330円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	1,096,807,985円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	2,556,583,473円
野村資産設計ファンド2045	4,432,493円
野村インデックスファンド・外国債券	446,443,316円
マイ・ロード	6,093,382,682円
ネクストコア	666,660,552円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	70,094,822円
野村外国債券インデックス（野村SMA・EW向け）	116,363,569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）	48,073,128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）	5,683,909,109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）	801,652,597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）	11,912,829,551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）	2,077,380,737円

ワールド・インデックス・ファンドV A安定型（適格機関投資家専用）	8,989,981円
ワールド・インデックス・ファンドV Aバランス型（適格機関投資家専用）	40,327,052円
ワールド・インデックス・ファンドV A積極型（適格機関投資家専用）	5,799,118円
野村インデックス・バランス60V A（適格機関投資家専用）	7,957,777,395円
野村ワールド・インデックス・バランス35V A（適格機関投資家専用）	624,786,024円
野村ワールド・インデックス・バランス50V A（適格機関投資家専用）	2,242,246,017円
野村世界インデックス・バランス40V A（適格機関投資家専用）	256,887,606円
野村グローバル・インデックス・バランス25V A（適格機関投資家専用）	120,720,632円
野村グローバル・インデックス・バランス50V A（適格機関投資家専用）	263,673,506円
野村グローバル・インデックス・バランス75V A（適格機関投資家専用）	2,391,317,436円
野村世界バランス25V A（適格機関投資家専用）	1,185,088,552円
ノムラ外国債券インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	1,848,304,992円
ノムラF O F s用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	425,379円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	4,225,788円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	6,847,102円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	4,658,252円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	508,824,115円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,604,503,364円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	2,225,536,394円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	2,120,145,987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）	11,286,684,016円
マイバランスD C 3 0	829,742,878円
マイバランスD C 5 0	480,989,713円
マイバランスD C 7 0	295,675,308円
野村D C 外国債券インデックスファンド	1,941,264,794円
野村D C 運用戦略ファンド	766,143,632円
野村D C 運用戦略ファンドM	6,315,989円
野村D C 運用戦略ファンドA	6,062,196円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	381,871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27年 5月11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27年 5月11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	7,000,000.00	7,744,569.70	
		US TREASURY BOND	10,500,000.00	13,501,522.65	

US TREASURY BOND	9,300,000.00	11,924,343.75	
US TREASURY BOND	12,200,000.00	16,656,812.50	
US TREASURY BOND	17,500,000.00	24,175,975.25	
US TREASURY BOND	13,400,000.00	17,778,030.58	
US TREASURY BOND	13,700,000.00	13,997,546.19	
US TREASURY BOND	10,500,000.00	14,337,421.35	
US TREASURY BOND	7,800,000.00	11,164,968.36	
US TREASURY BOND	6,600,000.00	9,327,655.92	
US TREASURY BOND	3,500,000.00	4,735,663.80	
US TREASURY BOND	4,000,000.00	5,310,937.20	
US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,661,250.00	
US TREASURY BOND	2,200,000.00	2,795,202.96	
US TREASURY BOND	14,600,000.00	14,519,015.26	
US TREASURY BOND	16,100,000.00	18,838,257.41	
US TREASURY N/B	12,500,000.00	13,108,886.25	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,341,600.60	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,183,280.80	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,003,593.60	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,512,441.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,462,109.20	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,131,250.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,011,484.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,027,773.10	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,352,734.00	
US TREASURY N/B	16,500,000.00	16,728,807.15	
US TREASURY N/B	11,500,000.00	12,152,265.05	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,012,343.60	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,439,257.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,038,671.50	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,079,726.40	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	15,017,128.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,114,296.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,008,320.20	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	18,192,480.25	
US TREASURY N/B	23,300,000.00	24,763,531.25	



US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,608,859.24	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,494,921.00	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,332,917.77	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,509,667.80	
US TREASURY N/B	18,000,000.00	18,809,296.20	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,057,655.80	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,413,679.56	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,759,022.80	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,515,039.00	
US TREASURY N/B	12,500,000.00	13,050,292.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,059,765.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,018,554.50	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	15,227,831.85	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,528,847.35	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,028,710.50	
US TREASURY N/B	18,300,000.00	19,202,846.97	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	16,379,779.92	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,228,233.92	
US TREASURY N/B	18,600,000.00	19,404,303.06	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,500,331.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,024,414.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,353,320.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,014,687.20	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,638,163.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,489,257.75	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,188,788.90	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,344,804.20	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,976,562.00	
US TREASURY N/B	11,500,000.00	11,804,120.95	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,974,374.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,002,460.90	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,266,796.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,040,155.20	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,581,873.60	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,497,265.00	

US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,985,468.60	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,541,718.48	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,000,781.20	
US TREASURY N/B	19,300,000.00	20,683,416.28	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,466,093.75	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,989,609.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,392,500.00	
US TREASURY N/B	9,800,000.00	10,650,608.64	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,168,124.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,003,124.80	
US TREASURY N/B	11,500,000.00	11,981,562.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,571,601.40	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,929,889.98	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,556,718.75	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	5,262,937.44	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	11,455,375.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,106,874.40	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,145,468.40	
US TREASURY N/B	21,000,000.00	22,899,021.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,016,796.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,546,718.75	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,561,444.90	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,107,569.93	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,021,406.20	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	25,355,623.20	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,523,554.35	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,040,312.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,037,968.40	
US TREASURY N/B	19,000,000.00	19,268,671.40	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,816,225.91	
US TREASURY N/B	26,400,000.00	28,297,500.00	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,433,859.32	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,974,218.60	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,137,296.72	
US TREASURY N/B	18,000,000.00	19,696,640.40	

US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,952,656.10	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,074,375.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,949,843.60	
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,669,359.26	
US TREASURY N/B	21,600,000.00	23,447,810.88	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,668,781.08	
US TREASURY N/B	600,000.00	601,898.40	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,419,433.25	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,991,953.00	
US TREASURY N/B	25,200,000.00	27,712,125.00	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,670,152.31	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,929,843.60	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	13,922,343.40	
US TREASURY N/B	21,500,000.00	23,564,335.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,066,874.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,067,265.40	
US TREASURY N/B	21,000,000.00	22,112,342.70	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,193,593.40	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,123,750.00	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,610,874.88	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	30,819,937.50	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	7,059,250.00	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,426,288.93	
US TREASURY N/B	30,500,000.00	33,758,494.95	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,082,031.00	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,662,421.60	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,984,734.23	
US TREASURY N/B	24,600,000.00	26,542,054.38	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,084,140.40	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,122,812.20	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,191,405.90	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,664,687.50	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,070,546.80	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,110,156.00	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	6,215,500.00	

US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,154,007.58	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,883,203.00	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,781,562.50	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,241,827.76	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	991,562.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,912,500.00	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,334,316.30	
US TREASURY N/B	9,800,000.00	9,585,241.82	
US TREASURY N/B	15,700,000.00	15,742,928.51	
US TREASURY N/B	11,200,000.00	10,990,000.00	
US TREASURY N/B	16,300,000.00	16,916,343.75	
US TREASURY N/B	19,500,000.00	20,596,875.00	
US TREASURY N/B	16,300,000.00	17,190,131.59	
US TREASURY N/B	19,500,000.00	20,153,554.20	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,357,124.96	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,432,617.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,588,437.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,380,859.30	
US TREASURY N/B	500,000.00	645,664.05	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,903,320.05	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	6,237,500.00	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	7,111,757.40	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	9,794,941.31	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,230,702.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,196,874.40	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,473,124.80	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	9,786,257.52	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,456,835.50	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,978,046.70	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,807,226.40	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,196,468.75	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,593,163.95	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,796,015.10	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	10,964,531.25	
US TREASURY N/B	12,500,000.00	13,042,968.75	

小計	US TREASURY N/B	11,800,000.00	13,502,702.24	
	US TREASURY N/B	13,800,000.00	15,804,233.34	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,147,500.00	
	US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,753,085.80	
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,531,992.15	
	US TREASURY NOTE	20,400,000.00	21,875,013.84	
	US TREASURY NOTE	13,300,000.00	14,037,213.68	
	銘柄数：184 組入時価比率：41.3%	1,698,500,000.00	1,814,749,759.17 (217,279,988,665) 41.7%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	3,600,000.00	3,934,620.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,507,425.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,900,000.00	7,139,982.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	3,142,532.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,711,448.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,957,760.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,909,785.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,550,505.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,538,550.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,846,276.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,747,138.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,650,882.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,253,792.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,543,520.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	3,158,280.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,418,866.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	4,688,460.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,624,495.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,863,560.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	5,040,900.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	3,477,301.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,499,615.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,500,000.00	5,919,980.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,418,795.00	
CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	2,663,984.00		

小計	CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	4,528,480.00		
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	4,308,304.00		
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	9,899,585.00		
	CANADIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	6,782,592.00		
	CANADIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	6,443,391.00		
	銘柄数：30	109,000,000.00	123,170,803.00		
	組入時価比率：2.3%		(12,188,982,664)	2.3%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	29,300,000.00	30,212,958.70		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	32,600,000.00	34,399,650.40		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	34,500,000.00	35,165,263.50		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	42,500,000.00	45,894,092.50		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,800,000.00	64,786,586.40		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	50,000,000.00	55,816,400.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,500,000.00	54,408,706.50		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,000,000.00	34,588,158.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	22,500,000.00	23,497,537.50		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,500,000.00	33,030,328.50		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	50,700,000.00	56,407,501.80		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,500,000.00	25,986,319.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,300,000.00	37,693,335.60		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	64,173,128.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	28,000,000.00	34,332,928.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	22,500,000.00	25,668,382.50		
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	52,500,000.00	59,855,302.50		
	小計	銘柄数：17	637,700,000.00	715,916,579.40	
		組入時価比率：1.1%		(5,662,900,143)	1.1%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,833,375.20		
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,164,200.00		
	BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,689,000.00		
	BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	6,553,475.50		
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,482,320.00		
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	6,232,025.00		
	BELGIUM KINGDOM	4,200,000.00	5,354,580.00		
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,397,218.00		

BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,815,000.00
BELGIUM KINGDOM	5,300,000.00	7,302,207.50
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,841,708.50
BELGIUM KINGDOM	4,100,000.00	6,568,179.50
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	3,056,098.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	2,300,000.00	2,411,941.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	1,500,000.00	1,618,650.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	2,000,000.00	2,274,140.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	2,500,000.00	2,794,875.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,999,708.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	5,100,000.00	7,859,661.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	6,900,000.00	11,314,406.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,000,000.00	9,283,662.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,700,000.00	10,089,901.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,800,000.00	12,533,228.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,500,000.00	14,365,485.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,500,000.00	12,987,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,400,000.00	6,447,616.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,500,000.00	12,833,425.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,100,000.00	11,318,969.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,698,100.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,200,000.00	7,839,360.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,500,000.00	8,769,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	8,232,095.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	10,783,815.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,300,000.00	7,645,377.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,300,000.00	7,958,538.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	6,518,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,700,000.00	9,967,650.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,690,915.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,300,000.00	7,976,871.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,300,000.00	9,794,830.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,700,000.00	11,113,206.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,000,000.00	11,280,800.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,400,000.00	4,587,280.00

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,400,000.00	6,184,200.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	4,258,581.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,600,000.00	3,873,272.00	
BUNDES OblIGATION	3,000,000.00	3,118,500.00	
BUNDES OblIGATION	2,500,000.00	2,551,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	7,062,420.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,299,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	9,192,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,747,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	8,269,440.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,310,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,385,200.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	7,154,880.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,527,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,937,330.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	5,119,710.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	3,489,280.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	6,114,960.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	11,990,400.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,347,520.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,091,200.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	2,927,400.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	12,284,440.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	8,783,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,900,000.00	4,364,790.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	6,155,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,600,000.00	7,722,480.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,657,957.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	10,277,410.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	5,881,785.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,400,000.00	7,970,120.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	5,895,711.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	6,352,191.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,600,000.00	3,539,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	10,731,945.00	



BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	12,225,330.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	15,724,556.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,600,000.00	8,940,990.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	15,891,148.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,800,000.00	15,045,864.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,700,000.00	9,513,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	10,670,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,200,000.00	9,940,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,900,000.00	3,947,190.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	11,688,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	5,913,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	9,504,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000.00	6,315,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	8,411,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,500,000.00	7,480,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	7,741,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,300,000.00	13,046,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,900,000.00	8,107,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,320,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,500,000.00	11,027,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,696,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	7,154,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	6,134,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,900,000.00	10,838,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	10,209,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,600,000.00	9,767,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,800,000.00	12,608,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,922,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	6,352,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	12,708,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,500,000.00	9,247,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,529,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	11,650,284.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	5,162,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,100,000.00	11,012,810.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000.00	19,850,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,157,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,300,000.00	12,803,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,700,000.00	13,083,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	8,658,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	11,385,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,724,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	11,076,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,300,000.00	14,670,290.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,300,000.00	6,085,790.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,189,310.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,558,462.50	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,532,336.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,315,900.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,382,970.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,474,032.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,369,074.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,178,080.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,843,785.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	676,960.20	
FINNISH GOVERNMENT	1,400,000.00	1,889,900.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,207,746.00	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	7,266,252.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,800,000.00	3,864,763.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,186,969.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,600,000.00	11,401,254.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	8,066,250.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,700,000.00	10,746,028.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,725,916.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	4,645,359.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	12,391,704.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	6,832,498.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,100,000.00	9,446,584.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,494,212.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	11,042,657.50	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,238,936.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,000,000.00	11,217,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,000,000.00	13,238,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,000,000.00	13,036,430.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,100,000.00	14,238,070.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,700,000.00	8,693,199.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	13,310,412.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,200,000.00	21,038,940.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	22,057,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	22,181,250.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	5,644,230.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	18,087,004.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,000,000.00	20,524,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,600,000.00	8,984,640.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,800,000.00	8,758,754.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,100,000.00	11,714,119.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	8,372,520.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	7,487,550.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,400,000.00	4,071,504.00	
FRENCH TREASURY NOTE	6,000,000.00	6,194,352.00	
FRENCH TREASURY NOTE	4,300,000.00	4,445,340.00	
FRENCH TREASURY NOTE	3,200,000.00	3,279,520.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	2,500,000.00	2,932,750.00	
IRISH GOVERNMENT	6,600,000.00	7,489,482.00	
IRISH GOVERNMENT	3,800,000.00	4,372,318.00	
IRISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,739,200.00	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,357,265.20	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,347,525.00	
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	8,344,080.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	500,000.00	559,960.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,200,000.00	1,220,280.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	1,300,000.00	1,566,372.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	3,670,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,181,772.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,402,800.00	

NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,665,024.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	7,330,050.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,615,485.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,655,200.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,788,320.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,960,230.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,698,145.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,100,000.00	6,337,770.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,582,440.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,537,464.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,700,000.00	5,278,927.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,600,000.00	8,694,560.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	3,095,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,200,000.00	6,591,186.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	7,202,542.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,785,260.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,441,956.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,656,216.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,383,700.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,392,966.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	5,592,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,511,997.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,809,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,200,000.00	5,049,156.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	4,034,250.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,500,000.00	4,130,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,757,032.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,181,230.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,900,000.00	5,549,700.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,800,000.00	4,556,048.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	6,320,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,500,000.00	5,110,542.50	
REPUBLIC OF IRELAND	2,400,000.00	2,942,400.00	
SPANISH GOVERNMENT	11,300,000.00	12,638,485.00	
SPANISH GOVERNMENT	8,300,000.00	12,087,954.00	

小計	SPANISH GOVERNMENT	4,800,000.00	7,107,360.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	6,578,572.00	
	銘柄数：220	1,277,400,000.00	1,586,171,250.00	
	組入時価比率：40.3%		(212,213,851,537)	40.8%
英ポンド	UK TREASURY	5,000,000.00	5,233,500.00	
	UK TREASURY	6,000,000.00	6,125,400.00	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,902,080.00	
	UK TREASURY	8,400,000.00	8,462,160.00	
	UK TREASURY	5,400,000.00	6,036,120.00	
	UK TREASURY	9,000,000.00	9,085,500.00	
	UK TREASURY	5,200,000.00	5,869,240.00	
	UK TREASURY	8,100,000.00	8,280,630.00	
	UK TREASURY	5,000,000.00	5,542,000.00	
	UK TREASURY	5,400,000.00	6,274,260.00	
	UK TREASURY	6,800,000.00	7,004,000.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,724,240.00	
	UK TREASURY	3,700,000.00	5,104,890.00	
	UK TREASURY	6,000,000.00	6,814,200.00	
	UK TREASURY	4,300,000.00	4,981,550.00	
	UK TREASURY	7,400,000.00	7,443,660.00	
	UK TREASURY	6,300,000.00	6,524,910.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	7,191,780.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	8,314,800.00	
	UK TREASURY	3,600,000.00	4,465,080.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,241,830.00	
	UK TREASURY	5,300,000.00	7,060,130.00	
	UK TREASURY	5,900,000.00	7,515,420.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	8,626,150.00	
	UK TREASURY	5,500,000.00	7,142,850.00	
	UK TREASURY	4,300,000.00	6,083,640.00	
	UK TREASURY	3,400,000.00	4,512,820.00	
	UK TREASURY	3,300,000.00	4,407,480.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	9,127,950.00	
UK TREASURY	9,800,000.00	11,810,960.00		

小計	UK TREASURY	4,400,000.00	6,099,280.00	
	UK TREASURY	3,000,000.00	4,246,200.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	6,675,390.00	
	UK TREASURY	2,400,000.00	3,151,200.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	10,200,000.00	11,734,080.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	6,400,000.00	9,399,680.00	
	銘柄数：36	200,400,000.00	238,215,060.00	(44,005,468,033)
組入時価比率：8.4%			8.5%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	6,000,000.00	6,819,000.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,300,000.00	4,928,880.00	
小計	銘柄数：2	9,300,000.00	11,747,880.00	(1,510,189,974)
組入時価比率：0.3%			0.3%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	11,500,000.00	11,949,650.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,000,000.00	7,630,574.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	19,800,000.00	23,034,825.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	33,300,000.00	41,997,793.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	31,300,000.00	37,788,490.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,900,000.00	19,203,567.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	19,200,000.00	22,379,520.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	11,800,000.00	16,813,017.60	
小計	銘柄数：8	151,800,000.00	180,797,437.60	(2,619,754,870)
組入時価比率：0.5%			0.5%	
ノルウェークロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	18,500,000.00	19,734,875.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	18,000,000.00	20,431,800.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	19,000,000.00	21,568,800.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,710,410.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	18,900,000.00	20,939,310.00	
小計	銘柄数：5	88,700,000.00	97,385,195.00	(1,556,215,416)
組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーククロー ネ	KINGDOM OF DENMARK	35,000,000.00	41,305,600.00	
	KINGDOM OF DENMARK	26,000,000.00	30,364,100.00	
	KINGDOM OF DENMARK	26,600,000.00	28,964,208.00	

小計	KINGDOM OF DENMARK	14,500,000.00	23,236,105.00	
	KINGDOM OF DENMARK	18,600,000.00	20,582,760.00	
	KINGDOM OF DENMARK	34,200,000.00	58,145,985.00	
	銘柄数：6	154,900,000.00	202,598,758.00	(3,632,595,730)
	組入時価比率：0.7%			0.7%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,176,657.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,600,000.00	11,066,877.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,655,499.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	7,472,741.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,323,658.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,642,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,283,680.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	9,673,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,388,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,960,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	4,185,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	7,189,917.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,973,910.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,223,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	3,344,500.00	
小計	銘柄数：15	85,600,000.00	93,559,240.20	(3,081,841,372)
	組入時価比率：0.6%			0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,600,000.00	7,829,140.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,600,000.00	8,122,424.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,818,316.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	5,013,241.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	727,090.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,028,511.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,454,758.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	7,841,531.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,600,000.00	6,634,678.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	6,027,000.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	8,777,030.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,786,080.00	

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,280,121.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,300,000.00	4,852,550.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	4,012,659.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,258,582.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,517,875.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,100,438.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,123,366.00	
	銘柄数：19	88,600,000.00	97,205,394.10	(9,219,931,630)
組入時価比率：1.8%			1.8%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,276,379.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	306,999.90	
	SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	878,759.10	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,384,225.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,965,253.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,193,575.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,411,649.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,271,470.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,800,000.00	1,854,660.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,640,772.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,930,240.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	541,323.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	974,197.00	
小計	銘柄数：13	20,700,000.00	21,629,507.50	(1,945,141,609)
組入時価比率：0.4%			0.4%	
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	8,618,821.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,319,552.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,905,080.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,060,548.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,146,279.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,685,396.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,008,868.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,900,000.00	11,234,499.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,269,755.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,129,504.00	



	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,434,034.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,529,048.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,816,920.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,864,368.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,089,358.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,783,936.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,736,735.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,006,514.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,569,603.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,664,427.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	382,440.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,692,200.00	
小計	銘柄数：22	80,100,000.00	80,947,890.30	
			(2,694,755,268)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	10,167,750.45	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,800,000.00	24,375,836.24	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,800,000.00	23,606,813.02	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	25,083,509.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,500,000.00	14,462,136.15	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	41,500,000.00	49,213,629.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,300,000.00	23,427,719.91	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,500,000.00	20,311,050.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,500,000.00	8,287,552.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	33,500,000.00	25,972,081.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,100,000.00	9,849,520.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	18,600,000.00	14,538,978.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	31,800,000.00	32,063,602.92	
小計	銘柄数：13	289,900,000.00	281,360,179.99	
			(2,822,042,605)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
合計			520,433,659,516	
			(520,433,659,516)	

(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27年 5月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,380,973,432	-	1,377,809,400	3,164,032
米ドル	663,291,426	-	662,051,600	1,239,826
カナダドル	21,792,760	-	21,769,000	23,760
メキシコペソ	15,668,800	-	15,800,000	131,200
ユーロ	550,161,370	-	548,539,000	1,622,370
英ポンド	116,778,060	-	116,373,600	404,460
豪ドル	13,281,016	-	13,276,200	4,816
売建	321,740,769	-	321,595,200	145,569
米ドル	209,070,575	-	209,510,000	439,425
カナダドル	9,914,780	-	9,895,000	19,780
ユーロ	67,845,250	-	66,895,000	950,250
英ポンド	27,277,020	-	27,708,000	430,980
豪ドル	7,633,144	-	7,587,200	45,944
合計	-	-	-	3,018,463

### (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27年 5月29日現在

資産総額	1,731,386,741円
負債総額	1,946,620円
純資産総額（ - ）	1,729,440,121円
発行済口数	1,076,536,450口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6065円

## （参考）国内株式マザーファンド

平成27年 5月29日現在

資産総額	300,010,294,531円
負債総額	25,634,462,815円
純資産総額（ - ）	274,375,831,716円
発行済口数	179,502,352,034口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5285円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成27年 5月29日現在

資産総額	346,836,644,016円
負債総額	1,044,375,587円
純資産総額（ - ）	345,792,268,429円
発行済口数	147,144,290,130口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3500円

## （参考）国内債券マザーファンド

平成27年 5月29日現在

資産総額	8,592,591,768円
負債総額	247,983,664円
純資産総額（ - ）	8,344,608,104円
発行済口数	6,548,766,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2742円

## （参考）外国債券マザーファンド

平成27年 5月29日現在

資産総額	557,095,166,031円
負債総額	1,944,414,441円
純資産総額（ - ）	555,150,751,590円
発行済口数	233,791,669,946口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3746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。

## 第二部【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27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27年5月29日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
----	----	------------

追加型株式投資信託	881	19,140,040
単位型株式投資信託	45	222,398
追加型公社債投資信託	18	7,630,335
単位型公社債投資信託	122	1,039,578
合計	1,066	28,032,350

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成26年4月1日から平成27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26年3月31日)		当事業年度 (平成27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			247		411
金銭の信託			51,758		56,824
有価証券			11,800		17,100
前払金			0		15
前払費用			28		29
未収入金			287		330
未収委託者報酬			10,741		12,679
未収収益			5,999		7,436
繰延税金資産			2,010		2,594
その他			159		73
貸倒引当金			8		9
流動資産計			83,026		97,486
固定資産					
有形固定資産			1,508		1,322
建物	2	442		413	
器具備品	2	1,065		909	
無形固定資産			8,249		7,254
ソフトウェア		8,248		7,253	
電話加入権		1		0	



その他		0		0	
投資その他の資産			22,052		24,840
投資有価証券		11,747		11,593	
関係会社株式		9,609		10,149	
従業員長期貸付金		35		30	
長期差入保証金		50		49	
長期前払費用		80		60	
前払年金費用		347		2,776	
その他		181		179	
貸倒引当金		0		0	
固定資産計			31,810		33,417
資産合計			114,837		130,903

区分	注記 番号	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
<b>流動負債</b>					
預り金			106		118
未払金	1		9,720		11,602
未払収益分配金		2		1	
未払償還金		33		32	
未払手数料		4,493		4,883	
その他未払金		5,191		6,684	
未払費用	1		8,420		10,221
未払法人税等			1,960		1,961
賞与引当金			3,984		4,558
外国税支払損失引当金			-		1,721
流動負債計			24,191		30,182
<b>固定負債</b>					
退職給付引当金			-		2,467
時効後支払損引当金			505		521
繰延税金負債			3,211		747
固定負債計			3,716		3,735
負債合計			27,907		33,918
<b>(純資産の部)</b>					
<b>株主資本</b>					
資本金			80,249		90,092
資本剰余金			17,180		17,180
資本準備金		11,729	11,729	11,729	11,729
利益剰余金			51,339		61,182
利益準備金		685	685	685	685
その他利益剰余金		50,654	60,497	60,497	61,182
別途積立金		24,606	24,606	24,606	24,606
繰越利益剰余金		26,048	35,890	35,890	35,890
評価・換算差額等			6,679		6,893
その他有価証券評価差額金			6,679		6,893
純資産合計			86,929		96,985
負債・純資産合計			114,837		130,903

## ( 2 ) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)		当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			87,258		96,159
運用受託報酬			24,589		31,466
その他営業収益			188		221
営業収益計			112,036		127,847
営業費用					
支払手数料			44,194		47,060
広告宣伝費			793		823
公告費			0		-
受益証券発行費			6		5
調査費			20,794		28,326
調査費		1,250		1,299	
委託調査費		19,544		27,027	
委託計算費			941		1,156
営業雑経費			2,926		3,275
通信費		188		193	
印刷費		948		951	
協会費		76		77	
諸経費		1,712		2,053	
営業費用計			69,656		80,648
一般管理費					
給料			11,091		11,660
役員報酬	2	292		289	
給料・手当		6,823		6,874	
賞与		3,975		4,496	
交際費			131		131
旅費交通費			454		472
租税公課			387		501
不動産賃借料			1,212		1,218
退職給付費用			1,069		723
固定資産減価償却費			3,518		3,120
諸経費			6,596		6,815
一般管理費計			24,460		24,643
営業利益			17,919		22,555

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)		当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27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	3,680		4,038	

収益分配金		0		-	
受取利息		3		5	
金銭の信託運用益		379		347	
その他		336		366	
営業外収益計			4,400		4,756
営業外費用					
支払利息	1	11		-	
時効後支払損引当金繰入額		24		28	
その他		132		137	
営業外費用計			169		166
経常利益			22,151		27,146
特別利益					
投資有価証券等売却益		-		794	
株式報酬受入益		203		142	
特別利益計			203		936
特別損失					
投資有価証券償還損		51		-	
投資有価証券等評価損		2		91	
関係会社株式評価損		2,491		-	
固定資産除却損	3	17		357	
外国税支払損失引当金繰入額		-		1,721	
特別損失計			2,562		2,169
税引前当期純利益			19,792		25,913
法人税、住民税及び事業税			7,608		8,433
法人税等調整額			90		2,488
当期純利益			12,273		19,967

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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
会計方針の変更による累積的影響額								

会計方針の変更を反映した 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 の項目の当期 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
会計方針の変更による 累積的影響額				
会計方針の変更を反 映した当期首残高	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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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	26,048	51,339	80,249
会計方針の変更による累積的影響額						81	81	81
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	25,966	51,258	80,168
当期変動額								
剰余金の配当						10,043	10,043	10,043
当期純利益						19,967	19,967	19,967
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	9,923	9,923	9,923
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	6,679	6,679	86,929
会計方針の変更による累積的影響額			81
会計方針の変更を反映した当期首残高	6,679	6,679	86,847
当期変動額			
剰余金の配当			10,043
当期純利益			19,967
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	213	213	213
当期変動額合計	213	213	10,137
当期末残高	6,893	6,893	96,985

## [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 ... 決算期末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 data-bbox="686 577 989 705"> <tbody> <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> </tbody> </table>	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	(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。 (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。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付 型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務 及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業 年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定 式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発 生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数によ る定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理 することとしております。また、退職一時金に係る数理 計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費 用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用 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。 (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。 (5) 外国税支払損失引当金 将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社にお いて見込まれる負担所要額を計上して おります。								
5. 消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によ っており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期 の費用として処理して おります。								

6. 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。
--------------	------------------

## [会計方針の変更]

<p>(退職給付に関する会計基準等の適用)</p> <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。以下「退職給付会計基準」という。)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。)を当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更、割引率の決定方法を平均残存勤務期間に基づく割引率から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更しております。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。</p> <p>この結果、当事業年度の期首の前払年金費用が127百万円減少し、繰越利益剰余金が81百万円減少しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前純利益はそれぞれ38百万円増加しております。</p>
--

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成26年3月31日)	当事業年度末 (平成27年3月31日)												
<p>1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">未払金</td> <td style="text-align: right;">4,601百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,607</td> </tr> </table>	未払金	4,601百万円	未払費用	1,607	<p>1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">未払金</td> <td style="text-align: right;">4,979百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,411</td> </tr> </table>	未払金	4,979百万円	未払費用	1,411				
未払金	4,601百万円												
未払費用	1,607												
未払金	4,979百万円												
未払費用	1,411												
<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">建物</td> <td style="text-align: right;">565百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">2,849</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,414</td> </tr> </table>	建物	565百万円	器具備品	2,849	合計	3,414	<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">建物</td> <td style="text-align: right;">607百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">3,052</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,659</td> </tr> </table>	建物	607百万円	器具備品	3,052	合計	3,659
建物	565百万円												
器具備品	2,849												
合計	3,414												
建物	607百万円												
器具備品	3,052												
合計	3,659												

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)								
<p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">3,568百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">5</td> </tr> </table>	受取配当金	3,568百万円	支払利息	5	<p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">3,966百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </table>	受取配当金	3,966百万円	支払利息	-
受取配当金	3,568百万円								
支払利息	5								
受取配当金	3,966百万円								
支払利息	-								
<p>2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。</p>	<p>2. 役員報酬の範囲額 (同左)</p>								

3. 固定資産除却損		3. 固定資産除却損	
器具備品	6百万円	器具備品	15百万円
ソフトウェア	11	ソフトウェア	342
ア		ア	
合計	17	合計	357

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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

## (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27年 5 月15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	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年 3 月31日
効力発生日	平成27年 6 月26日

## 金融商品関係

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物、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

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

(3) 未収委託者報酬

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、当該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) 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、当該帳簿価額によっております。

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、かつ将来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	-	-	-

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物、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27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	411	411	-
(2)金銭の信託	56,824	56,824	-
(3)未収委託者報酬	12,679	12,679	-
(4)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	27,398	27,398	-
(5)関係会社株式	3,064	196,109	193,045
資産計	100,378	293,423	193,045
(6)未払金	11,602	11,602	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	32	32	-
未払手数料	4,883	4,883	-
その他未払金	6,684	6,684	-
(7)未払費用	10,221	10,221	-
(8)未払法人税等	1,961	1,961	-
負債計	23,784	23,784	-

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

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

### (3) 未収委託者報酬

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、当該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) 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、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,294百万円、関係会社株式7,085百万円）は、市場価格がなく、かつ将来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90百万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	411	-	-	-
金銭の信託	56,824	-	-	-
未収委託者報酬	12,679	-	-	-
有価証券	17,100	-	-	-
合計	87,015	-	-	-

## 有価証券関係

前事業年度（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。

## 当事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

## 1. 売買目的有価証券(平成27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27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27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	196,109	193,045
合計	3,064	196,109	193,045

## 4．その他有価証券(平成27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	10,298	282	10,015
小計	10,298	282	10,015
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	17,100	17,100	-
小計	17,100	17,100	-
合計	27,398	17,382	10,015

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自平成26年4月1日 至平成27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	800	790	-
投資信託	-	-	-
合計	800	790	-

## 退職給付関係

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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	15,680 百万円
会計方針の変更による累積的影響額	127
会計方針の変更を反映した期首残高	15,808
勤務費用	746
利息費用	213
数理計算上の差異の発生額	1,128
退職給付の支払額	724
その他	46
退職給付債務の期末残高	17,218

## (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	14,786 百万円
期待運用収益	369
数理計算上の差異の発生額	975
事業主からの拠出額	558
退職給付の支払額	573
年金資産の期末残高	16,117

## (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	14,474 百万円
年金資産	16,117
	1,643
非積立型制度の退職給付債務	2,743
未積立退職給付債務	1,100
未認識数理計算上の差異	1,861
未認識過去勤務費用	451
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309
退職給付引当金	2,467
前払年金費用	2,776
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	746 百万円
利息費用	213
期待運用収益	369
数理計算上の差異の費用処理額	24
過去勤務費用の費用処理額	40
その他	24
確定給付制度に係る退職給付費用	550

## (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	31%
株式	13%
受益証券等	29%
生保一般勘定	21%
その他	6%
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	
確定給付型企業年金制度の割引率	1.1%
退職一時金制度の割引率	0.8%
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、172百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (平成26年3月31日)	当事業年度末 (平成27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 1,947	関係会社株式評価減 1,784
賞与引当金 1,434	賞与引当金 1,504
退職給付引当金 -	退職給付引当金 789
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 690
外国税支払損失引当金 -	外国税支払損失引当金 567
投資有価証券評価減 502	投資有価証券評価減 475
未払事業税 425	未払事業税 387
ゴルフ会員権評価減 408	ゴルフ会員権評価減 296
減価償却超過額 206	減価償却超過額 186
関連会社株式譲渡益 -	関連会社株式譲渡益 169
時効後支払損引当金 181	時効後支払損引当金 166
子会社株式売却損 172	子会社株式売却損 153
未払社会保険料 100	未払社会保険料 92
その他 126	その他 214
繰延税金資産小計 6,284	繰延税金資産小計 7,479
評価性引当額 3,602	評価性引当額 1,500
繰延税金資産合計 2,681	繰延税金資産合計 5,979
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 3,757	その他有価証券評価差額金 3,243
前払年金費用 125	前払年金費用 888
繰延税金負債合計 3,882	繰延税金負債合計 4,132
繰延税金負債の純額 1,200	繰延税金資産の純額 1,847
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 36.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.4%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 6.7%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 6.0%
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 1.4%	タックスヘイブン税制 1.2%
外国税額控除 0.3%	外国税額控除 0.2%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 0.5%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 1.8%
評価性引当額 4.7%	評価性引当額 7.3%
その他 0.1%	その他 2.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 37.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 22.9%

### 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。

### 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」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の36%から、平成27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は33%に、平成28年4月1日に開始する前事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の純額は73百万円減少し、法人税等調整額が479百万円、その他有価証券評価差額金が405百万円、それぞれ増加しております。

## セグメント情報等

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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㈱(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㈱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)

㈱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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	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 21.4%	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(*1)	3,990	未払費用	547

## (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(*2)	39,273	未払手数料	4,182
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	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*3)	1,976	未払費用	815

## (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) 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。

(\*2) 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。

(\*3) 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㈱(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	229,418
固定資産合計	273,220
流動負債合計	87,832
固定負債合計	65,965
純資産合計	348,841
売上高	358,952
税引前当期純利益	51,509
当期純利益	34,167

#### 1株当たり情報

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,877円25銭	1株当たり純資産額	18,829円58銭
1株当たり当期純利益	2,382円87銭	1株当たり当期純利益	3,876円72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	12,273百万円	損益計算書上の当期純利益	19,967百万円
普通株式に係る当期純利益	12,273百万円	普通株式に係る当期純利益	19,967百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有す

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

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

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

## 5【その他】

### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2)訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 <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27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
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 島根銀行	6,636百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社 十八銀行	24,404百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社 筑波銀行	48,868百万円	
株式会社 トマト銀行	14,310百万円	
株式会社 沖縄海邦銀行	4,537百万円	

\* 平成27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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成26年 7月25日	有価証券届出書
平成26年 7月25日	有価証券報告書
平成27年 1月28日	有価証券届出書の訂正届出書
平成27年 1月28日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成27年6月12日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 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26年4月1日から平成27年3月31日までの第56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27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27年6月17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 公認会計士 岩部 俊夫  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛  
業務執行社員

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26年5月13日から平成27年5月11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27年5月11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。