

【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29年7月27日提出
【計算期間】	第16期(自 平成28年5月11日至 平成29年5月10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】

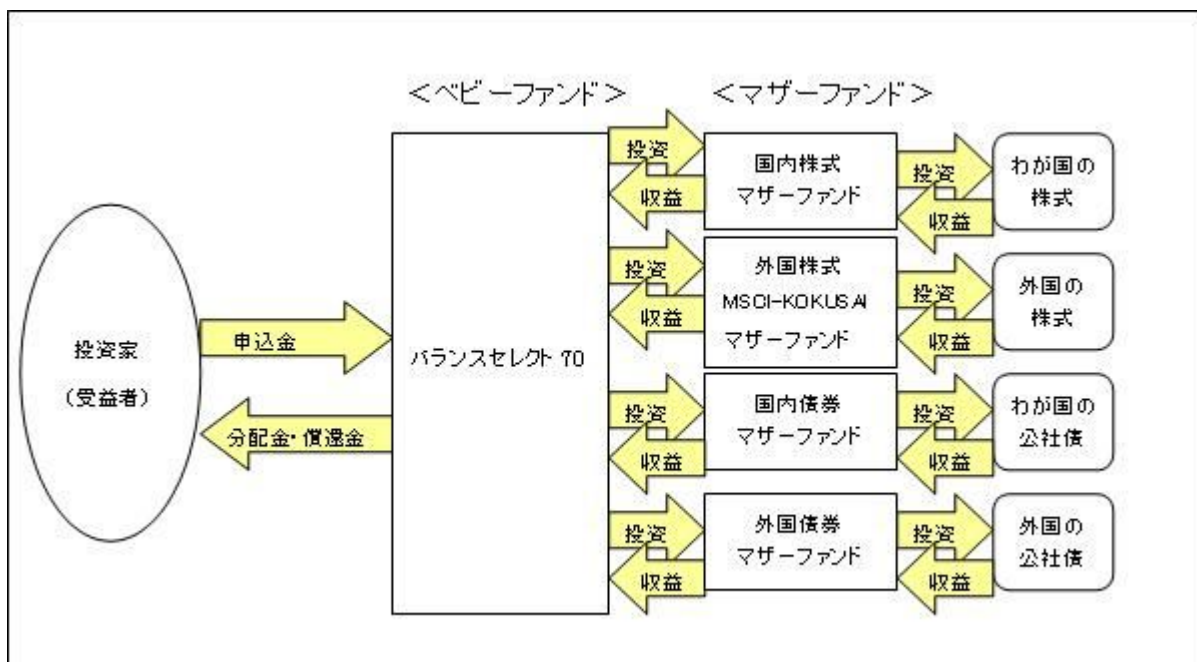
（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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	インデックス型
追加型	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産 ()	
		資産複合	

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
債券	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()	
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州			T O P I X
	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	なし	その他 (合成指数)
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券)資産配分固 定型))		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〕

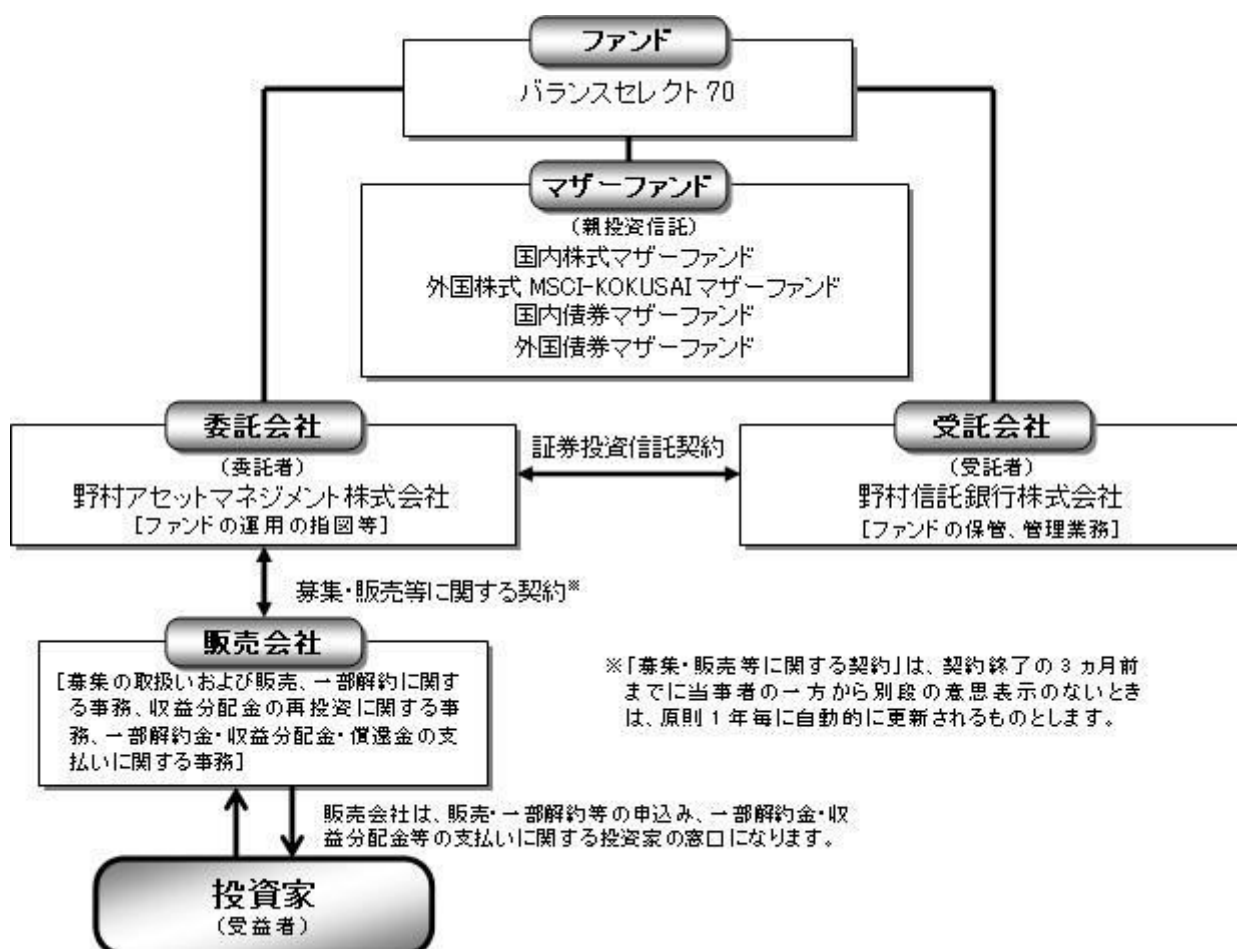
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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29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%

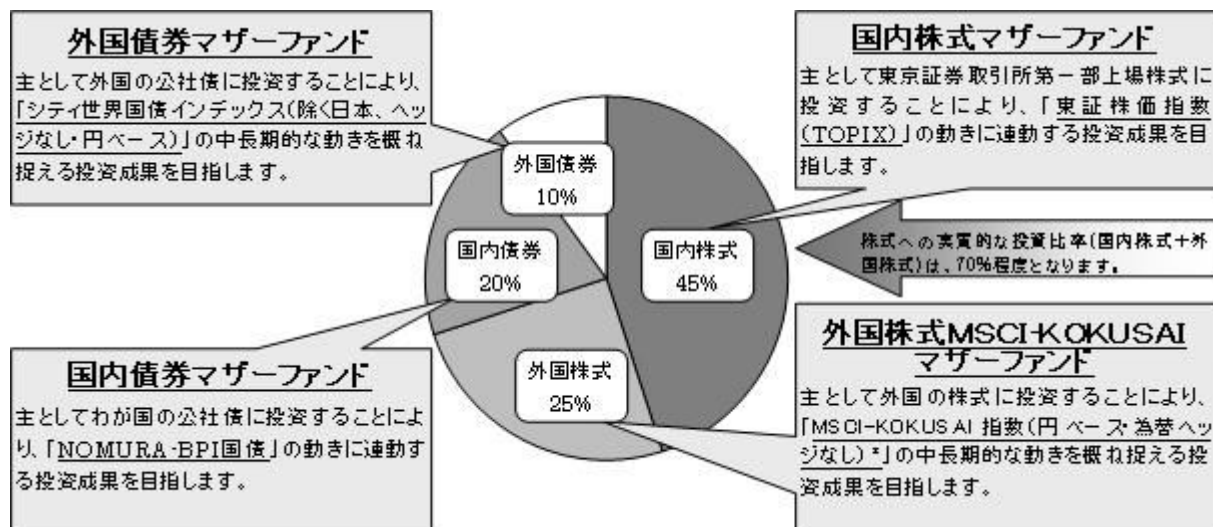
2【投資方針】

(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。

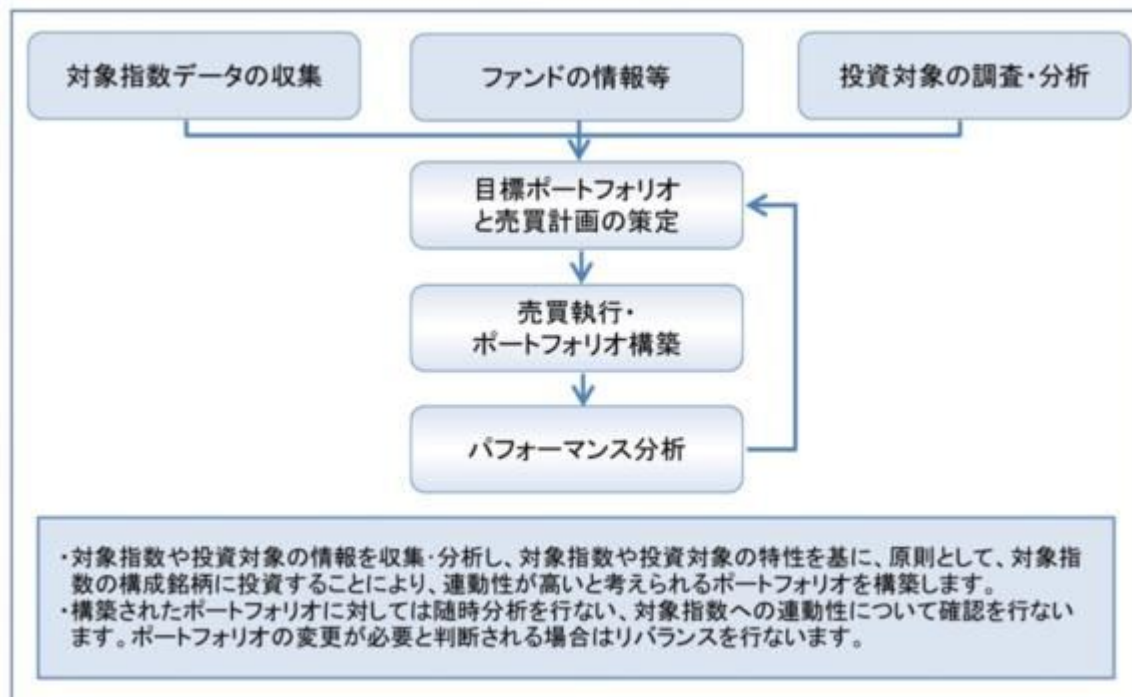
運用にあたっては、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券に投資を行ないます。

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券

2 国債証券

3 地方債証券

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

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

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

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

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

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

10 コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

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

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

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。

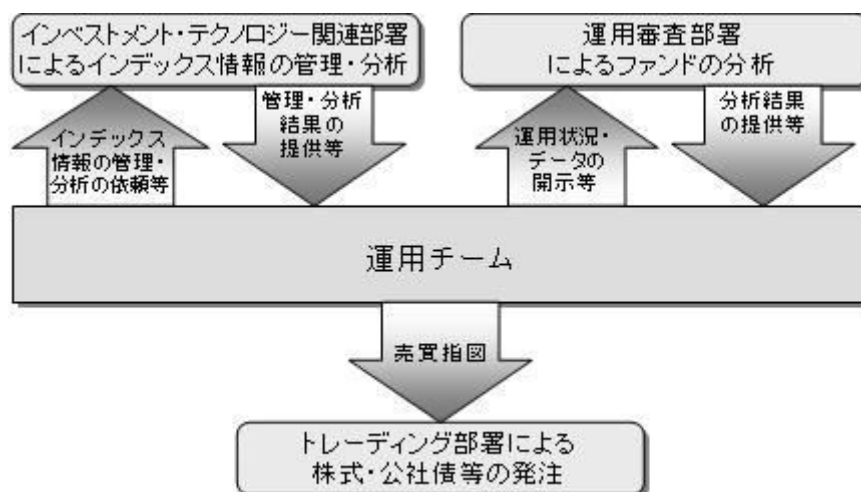
- 1 預金
- 2 指定金銭信託（上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。）
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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】

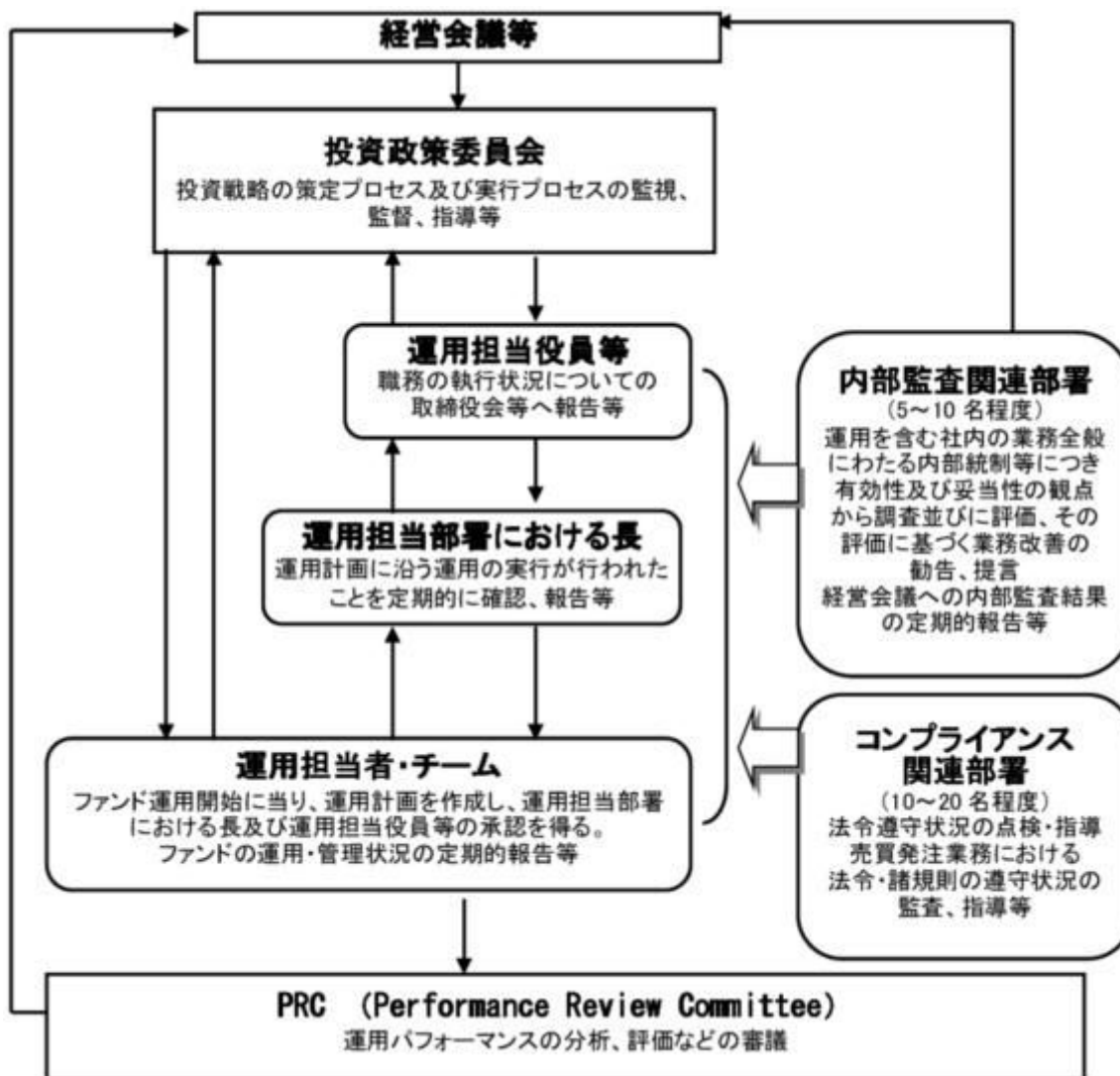
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ()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。

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

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ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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。

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に帰属します。

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

[株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

[為替変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

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

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

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

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

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて

「MSCI」の著作権等について

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

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

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

委託会社におけるリスク管理体制

リスク管理関連の委員会

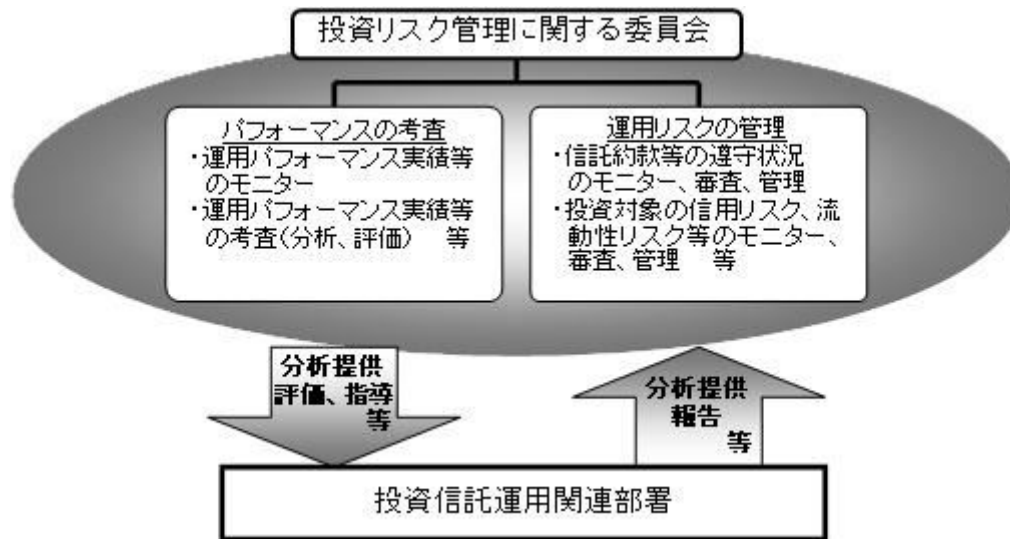
パフォーマンスの考査

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



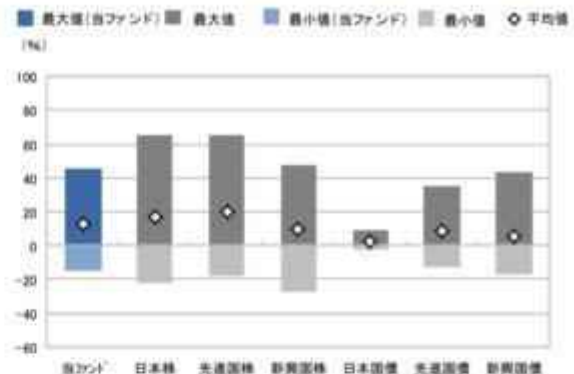
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

リスクの定量的比較

(2012年6月末～2017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	9.3	34.9
最小値(%)	△14.8	△22.0	△17.5	△27.4	△2.4	△12.3
平均値(%)	13.1	17.3	19.8	9.1	2.8	8.9

- 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。2012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、2012年6月から2017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。
- 2012年6月から2017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-KOKUSA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-KOKUSA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-KOKUSA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格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を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予測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・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国の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、或いは伝達または承認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、JPMS J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所: 株式会社野村総合研究所、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。

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です。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 特定公社債^(注1)の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金 	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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

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。

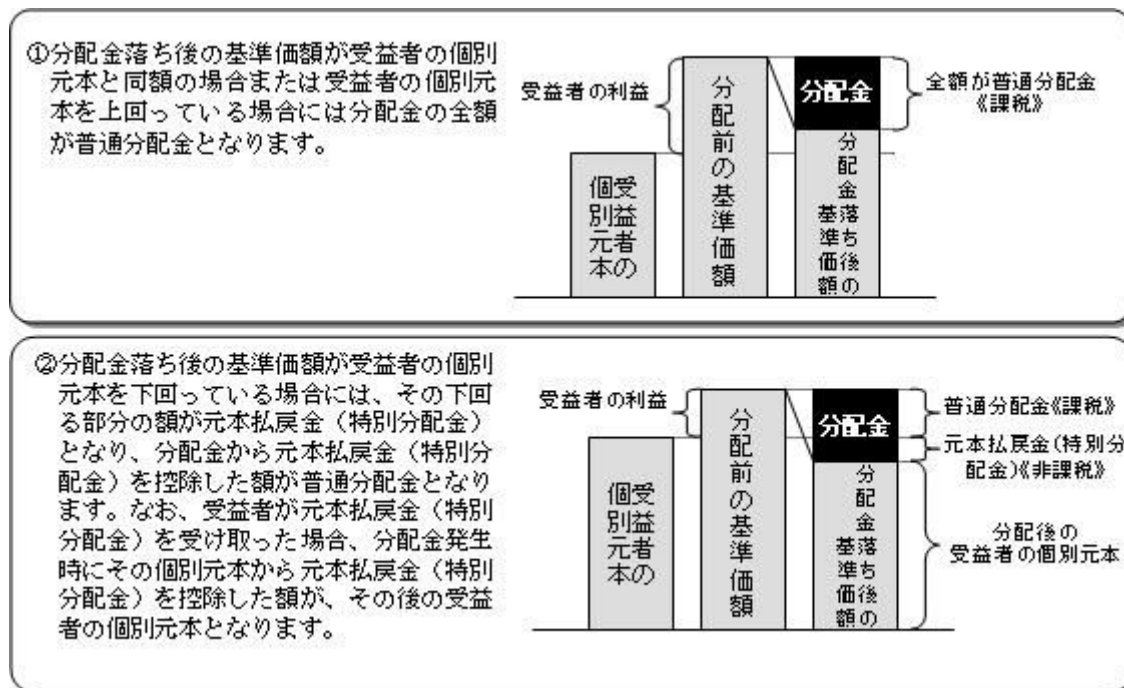
個別元本について

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29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29年 5月31日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

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	1,641,158,282	99.90
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,625,555	0.09
合計(純資産総額)		1,642,783,837	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	324,087,543,370	98.17
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,041,097,967	1.82
合計(純資産総額)		330,128,641,337	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	5,542,100,000	1.67

(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	233,287,812,903	62.20
	カナダ	13,787,916,211	3.67
	ドイツ	14,299,374,038	3.81
	イタリア	3,407,301,269	0.90
	フランス	15,235,815,917	4.06
	オランダ	4,929,854,344	1.31
	スペイン	5,262,749,627	1.40
	ベルギー	1,760,790,379	0.46
	オーストリア	349,403,398	0.09
	ルクセンブルグ	92,756,248	0.02
	フィンランド	1,537,245,006	0.40
	アイルランド	678,285,201	0.18
	ポルトガル	237,894,693	0.06
	イギリス	99,758,059	0.02
	イギリス	26,605,224,640	7.09
	スイス	12,985,097,837	3.46
	スウェーデン	4,357,301,596	1.16
	ノルウェー	935,640,121	0.24
	デンマーク	2,647,628,158	0.70
	オーストラリア	9,422,606,900	2.51
	ニュージーランド	244,508,360	0.06
	香港	4,572,813,629	1.21
シンガポール	1,765,236,240	0.47	
イスラエル	374,533,079	0.09	
小計		358,877,547,853	95.69
投資信託受益証券	アメリカ	22,873,849	0.00
投資証券	アメリカ	7,335,179,536	1.95
	カナダ	78,095,525	0.02
	フランス	520,252,360	0.13
	イギリス	369,862,091	0.09
	オーストラリア	909,929,964	0.24
	香港	223,370,064	0.05
	シンガポール	149,733,103	0.03

	小計	9,586,422,643	2.55
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,517,931,921	1.73
合計（純資産総額）		375,004,776,266	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	4,253,199,438	1.13
	買建	カナダ	239,321,200	0.06
	買建	ドイツ	852,922,255	0.22
	買建	イギリス	480,637,847	0.12
	買建	スイス	225,441,706	0.06
	買建	オーストラリア	189,741,520	0.05

（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	14,712,526,950	99.60
現金・預金・その他資産（負債控除後）		58,361,833	0.39
合計（純資産総額）		14,770,888,783	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	288,542,252,163	43.52
	カナダ	13,835,216,058	2.08
	メキシコ	5,797,044,294	0.87
	ドイツ	42,078,146,396	6.34
	イタリア	64,312,328,449	9.70
	フランス	65,949,894,468	9.94
	オランダ	14,032,241,445	2.11
	スペイン	39,922,438,538	6.02
	ベルギー	16,925,781,152	2.55
	オーストリア	9,656,324,055	1.45
	フィンランド	3,994,444,244	0.60
	アイルランド	6,448,677,213	0.97
	イギリス	47,782,426,220	7.20
	スイス	1,223,443,850	0.18
	スウェーデン	2,952,310,245	0.44

	ノルウェー	1,890,152,872	0.28
	デンマーク	4,044,041,431	0.60
	ポーランド	4,332,613,127	0.65
	オーストラリア	14,014,301,599	2.11
	シンガポール	2,545,732,909	0.38
	マレーシア	2,790,229,407	0.42
	南アフリカ	3,634,283,310	0.54
	小計	656,704,323,445	99.05
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,269,677,631	0.94
合計(純資産総額)		662,974,001,076	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	494,527,030	1.5104	746,936,850	1.4950	739,317,909	45.00
2	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	172,731,780	2.3967	413,986,820	2.3598	407,612,454	24.81
3	日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	246,095,083	1.3379	329,250,612	1.3396	329,668,973	20.06
4	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	75,058,815	2.2009	165,196,946	2.1924	164,558,946	10.01

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

(参考) 国内株式マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,721,700	6,080.99	10,469,647,700	5,932.00	10,213,124,400	3.09
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,591,200	727.69	7,707,203,760	690.90	7,317,460,080	2.21
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,122,000	5,050.01	5,666,120,100	5,308.00	5,955,576,000	1.80
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	629,200	8,700.04	5,474,068,000	9,003.00	5,664,687,600	1.71

5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,119,200	4,203.98	4,705,101,200	3,974.00	4,447,700,800	1.34
6	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,382,700	3,036.00	4,197,879,800	3,066.00	4,239,358,200	1.28
7	日本	株式	ソニー	電気機器	1,000,200	4,081.00	4,081,816,200	4,034.00	4,034,806,800	1.22
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,274,400	3,229.98	4,116,296,300	3,117.00	3,972,304,800	1.20
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	879,400	3,791.00	3,333,805,400	4,161.00	3,659,183,400	1.10
10	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,976,300	208.89	3,964,136,740	192.80	3,658,630,640	1.10
11	日本	株式	キーエンス	電気機器	64,200	48,320.00	3,102,144,000	50,310.00	3,229,902,000	0.97
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	556,200	5,489.04	3,053,008,300	5,707.00	3,174,233,400	0.96
13	日本	株式	ファナック	電気機器	143,600	22,895.00	3,287,722,000	21,770.00	3,126,172,000	0.94
14	日本	株式	任天堂	その他製品	87,200	29,500.00	2,572,400,000	33,650.00	2,934,280,000	0.88
15	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	274,000	10,255.16	2,809,914,500	10,615.00	2,908,510,000	0.88
16	日本	株式	キヤノン	電気機器	762,400	3,846.00	2,932,190,400	3,780.00	2,881,872,000	0.87
17	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,028,800	2,730.00	2,808,624,000	2,717.00	2,795,249,600	0.84
18	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	585,000	4,844.98	2,834,314,700	4,708.00	2,754,180,000	0.83
19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	562,900	4,943.00	2,782,414,700	4,700.00	2,645,630,000	0.80
20	日本	株式	信越化学工業	化学	266,000	9,871.00	2,625,686,000	9,932.00	2,641,912,000	0.80
21	日本	株式	花王	化学	370,000	6,594.00	2,439,780,000	6,983.00	2,583,710,000	0.78
22	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	500,500	4,772.00	2,388,386,000	4,652.00	2,328,326,000	0.70
23	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,048,800	2,363.98	2,479,350,100	2,218.00	2,326,238,400	0.70
24	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,626,300	1,373.00	2,232,909,900	1,420.50	2,310,159,150	0.69
25	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,510,600	1,647.00	2,487,958,200	1,527.00	2,306,686,200	0.69
26	日本	株式	村田製作所	電気機器	148,600	16,320.00	2,425,152,000	15,350.00	2,281,010,000	0.69
27	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,400,000	635.00	2,159,000,000	668.70	2,273,580,000	0.68
28	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,039,500	2,242.00	2,330,559,000	2,068.50	2,150,205,750	0.65
29	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	117,800	18,589.66	2,189,862,000	18,135.00	2,136,303,000	0.64
30	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,515,300	1,437.99	2,178,997,950	1,398.50	2,119,147,050	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	3.08
		食料品	4.74
		繊維製品	0.66
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.81
		医薬品	4.58
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.13

	非鉄金属	0.90
	金属製品	0.70
	機械	4.95
	電気機器	12.87
	輸送用機器	8.40
	精密機器	1.57
	その他製品	2.02
	電気・ガス業	1.86
	陸運業	4.17
	海運業	0.21
	空運業	0.53
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	8.06
	卸売業	4.21
	小売業	4.72
	銀行業	7.53
	証券、商品先物取引業	1.09
	保険業	2.49
	その他金融業	1.23
	不動産業	2.43
	サービス業	3.86
合 計		98.17

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	518,600	15,979.34	8,286,890,703	17,051.22	8,842,764,352	2.35
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	725,400	7,294.51	5,291,437,844	7,812.69	5,667,327,937	1.51
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	40,010	97,345.30	3,894,785,453	110,593.83	4,424,859,218	1.17
4	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	232,900	15,817.25	3,683,839,784	16,908.08	3,937,892,950	1.05

5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	268,300	13,827.83	3,710,008,185	14,104.12	3,784,136,899	1.00
6	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	410,800	9,284.49	3,814,070,469	8,998.85	3,696,730,045	0.98
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インターネットソフトウェア・サービス	30,780	92,396.31	2,843,958,621	108,283.64	3,332,970,587	0.88
8	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	354,500	9,873.65	3,500,211,741	9,309.54	3,300,233,348	0.88
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インターネットソフトウェア・サービス	29,340	94,397.29	2,769,616,736	110,535.02	3,243,097,581	0.86
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	308,400	8,789.02	2,710,534,516	9,360.72	2,886,847,436	0.76
11	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	471,200	6,235.95	2,938,380,582	5,787.67	2,727,151,800	0.72
12	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コングロマリット	861,500	3,313.26	2,854,378,314	3,035.86	2,615,398,214	0.69
13	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	608,700	4,628.52	2,817,384,485	4,277.50	2,603,719,120	0.69
14	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	991,300	2,647.50	2,624,472,302	2,542.09	2,519,977,386	0.67
15	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	253,500	10,004.01	2,536,018,288	9,697.90	2,458,418,664	0.65
16	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	122,510	18,562.92	2,274,144,191	18,320.60	2,244,457,392	0.59
17	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	187,200	11,955.17	2,238,008,044	11,546.49	2,161,504,351	0.57
18	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	468,000	4,163.21	1,948,386,586	4,560.45	2,134,293,408	0.56
19	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	69,660	29,326.76	2,042,902,564	30,315.78	2,111,797,862	0.56
20	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	587,500	3,809.25	2,237,938,370	3,565.14	2,094,522,570	0.55
21	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	404,200	5,439.86	2,198,794,018	5,126.35	2,072,071,478	0.55
22	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	120,800	16,318.16	1,971,234,175	17,074.52	2,062,602,596	0.55
23	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	153,800	12,591.93	1,936,639,698	13,309.65	2,047,024,478	0.54
24	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	403,300	4,728.00	1,906,804,658	5,040.91	2,033,000,132	0.54
25	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	221,400	8,532.45	1,889,086,313	8,934.46	1,978,089,887	0.52

26	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	273,400	7,040.54	1,924,883,736	7,199.08	1,968,229,784	0.52
27	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	183,700	9,879.87	1,814,933,662	10,510.13	1,930,711,101	0.51
28	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,963,000	933.03	1,831,553,885	960.47	1,885,406,536	0.50
29	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	メディア	156,400	12,535.08	1,960,487,974	12,021.40	1,880,147,961	0.50
30	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	467,500	3,967.92	1,855,007,088	4,014.53	1,876,794,084	0.50

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	不動産管理・開発	0.54
		エネルギー設備・サービス	0.60
		石油・ガス・消耗燃料	5.94
		化学	2.50
		建設資材	0.35
		容器・包装	0.29
		金属・鉱業	1.39
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.95
		建設関連製品	0.43
		建設・土木	0.33
		電気設備	0.79
		コングロマリット	2.06
		機械	1.55
		商社・流通業	0.30
		商業サービス・用品	0.36
		航空貨物・物流サービス	0.54
		旅客航空輸送業	0.14
		海運業	0.07
		陸運・鉄道	0.91
運送インフラ	0.25		
自動車部品	0.46		
自動車	0.98		
家庭用耐久財	0.47		
レジャー用品	0.07		

繊維・アパレル・贅沢品	1.17
ホテル・レストラン・レジャー	1.85
メディア	2.55
販売	0.07
インターネット販売・通信販売	1.76
複合小売り	0.36
専門小売り	1.69
食品・生活必需品小売り	1.84
飲料	2.09
食品	2.13
タバコ	1.67
家庭用品	1.45
パーソナル用品	0.75
ヘルスケア機器・用品	2.02
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.92
バイオテクノロジー	2.16
医薬品	5.77
銀行	9.14
各種金融サービス	0.89
保険	4.07
インターネットソフトウェア・サービス	3.25
情報技術サービス	2.74
ソフトウェア	3.73
通信機器	0.84
コンピュータ・周辺機器	2.71
電子装置・機器・部品	0.40
半導体・半導体製造装置	2.57
各種電気通信サービス	2.37
無線通信サービス	0.38
電力	1.92
ガス	0.14
総合公益事業	1.11
水道	0.09
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01
消費者金融	0.46
資本市場	2.73

		各種消費者サービス	0.01
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.02
		ヘルスケア・テクノロジー	0.07
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.53
		専門サービス	0.59
投資信託受益証券			0.00
投資証券			2.55
合 計			98.26

(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 (5年)第12 6回	240,000,000	100.90	242,177,000	100.85	242,054,400	0.1	2020/12/20	1.63
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	220,000,000	100.77	221,711,800	100.73	221,614,800	0.1	2020/6/20	1.50
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第37 4回	220,000,000	100.50	221,109,000	100.48	221,062,600	0.1	2019/3/15	1.49
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	200,000,000	100.96	201,938,000	100.91	201,832,000	0.1	2021/3/20	1.36
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	200,000,000	100.81	201,622,700	100.81	201,626,000	0.1	2026/6/20	1.36
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	200,000,000	100.69	201,388,000	100.64	201,280,000	0.1	2019/12/20	1.36
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	190,000,000	103.37	196,404,600	103.42	196,511,300	0.4	2025/6/20	1.33
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	190,000,000	100.82	191,573,000	100.83	191,586,500	0.1	2026/3/20	1.29
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	190,000,000	100.74	191,406,000	100.74	191,409,800	0.1	2026/9/20	1.29
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	180,000,000	101.05	181,895,400	101.06	181,909,800	0.1	2022/3/20	1.23
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	180,000,000	100.96	181,745,100	100.95	181,720,800	0.1	2021/6/20	1.23
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	180,000,000	100.86	181,549,800	100.79	181,432,800	0.1	2020/9/20	1.22
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	180,000,000	100.72	181,305,000	100.66	181,200,600	0.2	2019/3/20	1.22
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	170,000,000	101.16	171,972,000	101.07	171,829,200	0.1	2021/12/20	1.16

15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	170,000,000	101.01	171,728,200	100.99	171,689,800	0.1	2021/9/20	1.16
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	160,000,000	104.56	167,296,600	104.47	167,163,200	0.6	2023/12/20	1.13
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	160,000,000	103.42	165,481,600	103.40	165,441,600	0.4	2025/3/20	1.12
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	160,000,000	100.63	161,019,400	100.66	161,065,600	0.1	2026/12/20	1.09
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第9 9回	130,000,000	121.43	157,870,700	121.26	157,638,000	2.1	2027/12/20	1.06
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	150,000,000	102.67	154,005,000	102.60	153,913,500	0.3	2025/12/20	1.04
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	150,000,000	100.63	150,955,500	100.58	150,874,500	0.2	2018/12/20	1.02
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	140,000,000	104.13	145,786,300	104.06	145,695,200	0.5	2024/9/20	0.98
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	140,000,000	100.53	140,743,400	100.48	140,674,800	0.2	2018/9/20	0.95
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年)第3 7回	110,000,000	127.20	139,922,400	127.43	140,179,600	1.9	2042/9/20	0.94
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	130,000,000	105.52	137,187,700	105.41	137,036,900	0.8	2023/6/20	0.92
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 22回	130,000,000	105.00	136,507,800	104.87	136,331,000	0.9	2022/3/20	0.92
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	130,000,000	104.82	136,268,600	104.74	136,169,800	0.6	2024/6/20	0.92
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 36回	130,000,000	104.17	135,430,500	104.12	135,367,700	0.5	2024/12/20	0.91
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 54回	120,000,000	111.95	134,350,800	112.49	134,989,200	1.2	2035/9/20	0.91
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 09回	130,000,000	103.91	135,092,100	103.79	134,936,100	1.1	2020/6/20	0.91

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.60
合計	99.60

(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	51,800,000	11,726.65	6,074,405,294	11,752.65	6,087,876,244	3.625	2020/2/15	0.91
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	11,448.38	6,021,850,273	11,496.06	6,046,928,529	2.625	2020/11/15	0.91

3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	11,622.62	5,729,954,690	11,639.09	5,738,074,845	3.375	2019/11/15	0.86
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	39,200,000	14,319.04	5,613,063,953	14,495.88	5,682,386,213	6	2026/2/15	0.85
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	50,100,000	11,189.62	5,606,000,873	11,338.72	5,680,701,225	2.375	2024/8/15	0.85
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,300,000	11,003.24	5,534,631,781	11,169.68	5,618,351,101	2.25	2025/11/15	0.84
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,700,000	11,727.08	5,593,819,545	11,757.42	5,608,291,626	3.5	2020/5/15	0.84
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	11,864.91	5,434,132,120	11,910.86	5,455,175,025	3.625	2021/2/15	0.82
9	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	15,460.28	5,117,353,839	15,623.89	5,171,510,073	3.5	2026/4/25	0.78
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000	15,631.33	4,892,607,699	15,755.28	4,931,404,049	4.25	2023/10/25	0.74
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,700,000	10,859.34	4,854,126,005	11,011.91	4,922,324,795	2	2025/2/15	0.74
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,180,000	11,446.63	4,828,190,053	11,487.82	4,845,565,640	2.625	2020/8/15	0.73
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	40,900,000	11,502.18	4,704,393,845	11,502.99	4,704,725,708	3.75	2018/11/15	0.70
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,200,000	10,874.94	4,589,227,464	10,992.84	4,638,979,154	1.75	2023/5/15	0.69
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000	18,712.17	4,584,482,563	18,902.16	4,631,030,250	5.5	2029/4/25	0.69
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,400,000	11,666.40	4,479,898,827	11,728.81	4,503,866,187	3.125	2021/5/15	0.67
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,500,000	11,371.23	4,264,211,940	11,378.16	4,266,812,565	2.75	2019/2/15	0.64
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,600,000	11,265.90	4,235,981,220	11,311.85	4,253,256,201	2.125	2020/8/31	0.64
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	11,014.51	4,064,355,369	11,358.66	4,191,346,386	3	2044/11/15	0.63
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	13,767.12	4,020,000,938	13,764.64	4,019,277,070	4.25	2020/3/1	0.60
21	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000	20,217.85	3,962,699,845	20,495.13	4,017,045,970	5.75	2032/10/25	0.60
22	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	21,050,000	18,252.09	3,842,066,524	18,919.25	3,982,502,125	3.25	2044/1/22	0.60
23	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,000,000	19,169.61	3,833,922,000	19,876.59	3,975,318,500	3.5	2045/1/22	0.59
24	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000	19,877.48	3,856,232,992	20,065.76	3,892,759,322	6.5	2027/7/4	0.58
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	11,228.63	3,817,734,743	11,298.84	3,841,608,386	2.125	2021/6/30	0.57
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	11,150.17	3,757,610,508	11,232.09	3,785,217,396	2	2022/2/15	0.57
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,300,000	13,629.54	3,720,864,967	13,650.61	3,726,617,486	2.5	2020/10/25	0.56
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000	18,000.01	3,564,003,762	18,203.30	3,604,255,260	6	2025/10/25	0.54
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	23,700,000	14,889.44	3,528,798,465	15,100.09	3,578,722,466	6.125	2027/11/15	0.53
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	30,600,000	11,285.84	3,453,468,507	11,630.86	3,559,043,649	3.125	2044/8/15	0.53

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.05
合計	99.05

【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 - KOKUSA I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(2017年06月限)	買建	353	日本円	5,576,232,944	5,542,100,000	1.67

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

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(2017 年06月限)	買建	318	米ドル	37,901,825	4,205,586,502	38,330,925	4,253,199,438	1.13
	カナダ	モント リ オール 取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2017年06 月限)	買建	16	カナダ ドル	2,926,980	241,534,390	2,900,160	239,321,200	0.06
	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(2017年06 月限)	買建	194	ユーロ	6,826,740	846,174,420	6,881,180	852,922,255	0.22

オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2017年06月限)	買建	16豪ドル	2,330,625	193,208,813	2,288,800	189,741,520	0.05
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(2017年06月限)	買建	45英ポンド	3,316,350	471,750,785	3,378,825	480,637,847	0.12
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(2017年06月限)	買建	22スイスフラン	1,955,920	222,329,428	1,983,300	225,441,706	0.06

(参考) 国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

バランスセレクト70

平成29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
第15計算期間 (2016年 5月10日)	1,459	1,465	1.3927	1.3982
第16計算期間 (2017年 5月10日)	1,655	1,662	1.5849	1.5914
2016年 5月末日	1,512		1.4321	
6月末日	1,398		1.3313	
7月末日	1,451		1.3884	
8月末日	1,454		1.3856	
9月末日	1,445		1.3760	
10月末日	1,477		1.4145	

11月末日	1,534		1.4852
12月末日	1,574		1.5343
2017年 1月末日	1,566		1.5282
2月末日	1,594		1.5416
3月末日	1,600		1.5398
4月末日	1,599		1.5532
5月末日	1,642		1.5706

【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
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	0.0055円
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	0.0065円

【収益率の推移】

バランスセレクト70

	計算期間	収益率
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%
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	10.2%
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	14.3%

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
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	100,611,270	135,156,755	1,048,181,842
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	117,702,378	121,463,090	1,044,421,130

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 (2017年5月31日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次)



分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2017年5月	65 円
2016年5月	55 円
2015年5月	65 円
2014年5月	40 円
2013年5月	30 円
設定来累計	455 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	45.0
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	24.8
3	国内債券マザーファンド	20.1
4	外国債券マザーファンド	10.0

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1.4
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.0
3	日本電信電話	情報・通信業	0.8
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.8
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.6

・「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	0.4
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.3
4	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	0.3
5	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	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(5年)第126回	国債証券	0.3
2	国庫債券 利付(5年)第124回	国債証券	0.3
3	国庫債券 利付(2年)第374回	国債証券	0.3
4	国庫債券 利付(5年)第127回	国債証券	0.3
5	国庫債券 利付(10年)第343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 BOND	国債証券	0.1
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.1

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2017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せん。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法

により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2【換金（解約）手続等】

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

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

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

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

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

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

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 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 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て)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16期計算期間(平成28年5月11日から平成29年5月10日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【バランスセレクト70】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (平成28年 5月10日現在)	第16期 (平成29年 5月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,322,309	7,535,500
親投資信託受益証券	1,458,121,216	1,653,351,943
未収入金	-	7,633,967
流動資産合計	1,471,443,525	1,668,521,410
資産合計	1,471,443,525	1,668,521,410
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,765,000	6,788,737
未払解約金	63,175	312,020
未払受託者報酬	400,038	423,492
未払委託者報酬	5,360,463	5,674,750
未払利息	23	9
その他未払費用	23,943	25,351
流動負債合計	11,612,642	13,224,359
負債合計	11,612,642	13,224,359
純資産の部		
元本等		
元本	1,048,181,842	1,044,421,130
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	411,649,041	610,875,921
(分配準備積立金)	514,765,174	491,486,642
元本等合計	1,459,830,883	1,655,297,051
純資産合計	1,459,830,883	1,655,297,051
負債純資産合計	1,471,443,525	1,668,521,410

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日	自	平成28年 5月11日 至 平成29年 5月10日
営業収益				
受取利息		2,114		-
有価証券売買等損益		150,988,930		216,274,858
営業収益合計		150,986,816		216,274,858
営業費用				
支払利息		325		2,108
受託者報酬		838,460		818,983
委託者報酬		11,235,207		10,974,233
その他費用		50,186		49,023
営業費用合計		12,124,178		11,844,347
営業利益又は営業損失（ ）		163,110,994		204,430,511
経常利益又は経常損失（ ）		163,110,994		204,430,511
当期純利益又は当期純損失（ ）		163,110,994		204,430,511
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（ ）		1,645,820		4,472,209
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		603,624,547		411,649,041
剰余金増加額又は欠損金減少額		50,013,863		53,343,021
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		50,013,863		53,343,021
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,759,195		47,285,706
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,759,195		47,285,706
分配金		5,765,000		6,788,737
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		411,649,041		610,875,921

(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28年 5月11日から平成29年 5月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第15期 平成28年 5月10日現在	第16期 平成29年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,048,181,842口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,044,421,130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 1.3927円 (10,000口当たり純資産額) (13,927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 1.5849円 (10,000口当たり純資産額) (15,849円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日	第16期 自 平成28年 5月11日 至 平成29年 5月10日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>18,711,620円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>347,989,052円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>501,818,554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>868,519,226円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,048,181,842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>8,285円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>55円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>5,765,000円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	18,711,620円	費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	347,989,052円	分配準備積立金額	D	501,818,554円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	868,519,226円	当ファンドの期末残存口数	F	1,048,181,842口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	8,285円	10,000口当たり分配金額	H	55円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,765,000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>28,833,422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>10,713,790円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>401,629,115円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>458,728,167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>899,904,494円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,044,421,130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>8,616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>6,788,737円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	28,833,422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	10,713,790円	収益調整金額	C	401,629,115円	分配準備積立金額	D	458,728,167円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	899,904,494円	当ファンドの期末残存口数	F	1,044,421,130口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	8,616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	6,788,737円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	18,711,620円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	347,989,052円																																																											
分配準備積立金額	D	501,818,554円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	868,519,226円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,048,181,842口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	8,285円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	55円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,765,000円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	28,833,422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	10,713,790円																																																											
収益調整金額	C	401,629,115円																																																											
分配準備積立金額	D	458,728,167円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	899,904,494円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,044,421,130口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	8,616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	6,788,737円																																																											
2. 追加情報																																																													

平成28年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

<p>第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日</p>	<p>第16期 自 平成28年 5月11日 至 平成29年 5月10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、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

<p>第15期 平成28年 5月10日現在</p>	<p>第16期 平成29年 5月10日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p>

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	2. 時価の算定方法 同左
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。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日	第16期 自 平成28年 5月11日 至 平成29年 5月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日	第16期 自 平成28年 5月11日 至 平成29年 5月10日
期首元本額 1,082,727,327円	期首元本額 1,048,181,842円
期中追加設定元本額 100,611,270円	期中追加設定元本額 117,702,378円
期中一部解約元本額 135,156,755円	期中一部解約元本額 121,463,090円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日	第16期 自 平成28年 5月11日 至 平成29年 5月10日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	154,528,704	204,402,829
合計	154,528,704	204,402,829

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29年 5月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年 5月10日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	492,630,002	744,068,355	
		国内債券マザーファンド	246,288,282	329,533,721	
		外国債券マザーファンド	75,084,362	165,253,172	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	172,937,540	414,496,695	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.9%	986,940,186	1,653,351,943 100.0%	
合計				1,653,351,943	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-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29年 5月10日現在)

資産の部

(平成29年 5月10日現在)

流動資産	
コール・ローン	21,873,459,041
株式	330,412,047,974
派生商品評価勘定	189,986,742
未収入金	21,149,436
未収配当金	2,950,845,638
未収利息	543,599
その他未収収益	86,467,666
流動資産合計	355,534,500,096
資産合計	355,534,500,096
負債の部	
流動負債	
前受金	17,984,400
未払解約金	1,601,919,769
未払利息	28,357
有価証券貸借取引受入金	18,667,721,193
流動負債合計	20,287,653,719
負債合計	20,287,653,719
純資産の部	
元本等	
元本	221,965,622,884
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	113,281,223,493
元本等合計	335,246,846,377
純資産合計	335,246,846,377
負債純資産合計	355,534,500,096

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29年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.5104円
(10,000口当たり純資産額)	(15,104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	17,841,716,950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28年 5月11日 至 平成29年 5月10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29年 5月10日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年 5月10日現在	
期首	平成28年 5月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	224,682,172,660円
同期中における追加設定元本額	32,249,274,528円
同期中における一部解約元本額	34,965,824,304円
期末元本額	221,965,622,884円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	175,483,135円
バランスセレクト50	418,593,693円
バランスセレクト70	492,630,002円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,409,272,944円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	4,163,759,183円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	8,036,894,535円
野村資産設計ファンド2015	70,751,521円
野村資産設計ファンド2020	85,412,792円
野村資産設計ファンド2025	113,812,816円
野村資産設計ファンド2030	107,573,922円
野村資産設計ファンド2035	82,715,829円
野村資産設計ファンド2040	245,929,318円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	77,203,300,380円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	2,359,839,944円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	5,220,966,643円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	1,602,447,010円
野村資産設計ファンド2045	27,039,967円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,119,555,225円
マイ・ロード	3,544,803,938円
ネクストコア	223,790,775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	461,145,203円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,426,247,772円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,225,604,388円
野村資産設計ファンド2050	31,653,026円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	10,507,754円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,532,311円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,661,340円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,137,429円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	179,929,017円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	68,595,015円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	99,658円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	99,736円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	253,742円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	427,066円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	351,039円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	4,105,773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)	698,799,761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)	599,139,603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)	2,441,288,679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)	1,023,038,055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)	4,498,782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)	20,663,460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)	4,858,092円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	6,283,566,619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)	414,711,205円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	2,745,069,556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)	1,085,919,937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)	1,801,441,145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)	394,793,662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)	124,256,024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)	351,982,004円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	5,606,629,978円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	793,341,865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)	622,645,528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)	1,100,646,830円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	2,027,512,834円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,139,774円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	32,223,718円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	37,271,853円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	97,535,624円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,154,306,788円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,761,236,710円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	17,109,445,525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)	31,298,165,516円
マイバランスDC30	2,442,487,926円
マイバランスDC50	3,356,581,109円
マイバランスDC70	3,064,982,602円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,732,980,916円
野村DC運用戦略ファンド	398,436,426円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	4,426,414円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	190,765,947円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	5,234,697円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	8,673,879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29年 5月10日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	6,300	2,990.00	18,837,000	貸付有価証券 2,900株
		日本水産	207,800	561.00	116,575,800	
		マルハニチロ	30,400	3,130.00	95,152,000	
		カネコ種苗	5,500	1,471.00	8,090,500	
		サカタのタネ	23,600	3,380.00	79,768,000	貸付有価証券 2,800株(2,200株)
		ホクト	16,300	2,170.00	35,371,000	
		ホクリヨウ	2,300	888.00	2,042,400	貸付有価証券 500株(500株)
		住石ホールディングス	44,400	99.00	4,395,600	貸付有価証券 14,200株(12,600株)
		日鉄鉱業	4,400	5,900.00	25,960,000	
		三井松島産業	9,800	1,504.00	14,739,200	貸付有価証券 1,500株
		国際石油開発帝石	843,000	1,096.50	924,349,500	
		日本海洋掘削	5,600	2,250.00	12,600,000	貸付有価証券 2,600株(300株)
		石油資源開発	25,300	2,495.00	63,123,500	
		K&Oエナジーグループ	10,800	1,829.00	19,753,200	貸付有価証券 600株
		ショーボンドホールディングス	15,500	5,180.00	80,290,000	貸付有価証券 4,200株
		ミライト・ホールディングス	49,200	1,179.00	58,006,800	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
		タマホーム	12,000	663.00	7,956,000	貸付有価証券 1,600株(1,300株)
		サンヨーホームズ	3,400	645.00	2,193,000	
		ファーストコーポレーション	3,500	1,135.00	3,972,500	
		インベスターズクラウド	2,000	4,500.00	9,000,000	貸付有価証券 900株(700株)
ダイセキ環境ソリューション	4,500	1,306.00	5,877,000	貸付有価証券 1,800株		
安藤・間	115,000	820.00	94,300,000	貸付有価証券 32,200株		
東急建設	56,800	987.00	56,061,600	貸付有価証券 24,800株		

コムシスホールディングス	62,500	2,263.00	141,437,500	貸付有価証券 100株
ミサワホーム	18,900	1,017.00	19,221,300	貸付有価証券 6,600株（4,500株）
ピーアールホールディングス	15,800	401.00	6,335,800	
高松コンストラクショングループ	12,100	2,750.00	33,275,000	
東建コーポレーション	6,000	9,480.00	56,880,000	
ソネック	2,000	706.00	1,412,000	
ヤマウラ	7,500	666.00	4,995,000	
大成建設	814,000	885.00	720,390,000	
大林組	479,900	1,126.00	540,367,400	
清水建設	490,000	1,108.00	542,920,000	
飛島建設	154,100	174.00	26,813,400	貸付有価証券 33,800株
長谷工コーポレーション	186,700	1,338.00	249,804,600	
松井建設	17,600	1,000.00	17,600,000	貸付有価証券 100株
銭高組	23,000	428.00	9,844,000	貸付有価証券 1,000株
鹿島建設	703,000	787.00	553,261,000	
不動テトラ	129,200	192.00	24,806,400	
大末建設	5,600	1,006.00	5,633,600	
鉄建建設	97,000	336.00	32,592,000	貸付有価証券 35,000株
西松建設	185,000	583.00	107,855,000	
三井住友建設	613,200	125.00	76,650,000	貸付有価証券 30,700株
大豊建設	58,000	570.00	33,060,000	
前田建設工業	105,000	1,087.00	114,135,000	
佐田建設	11,000	431.00	4,741,000	
ナカノフードー建設	12,200	680.00	8,296,000	
奥村組	132,000	710.00	93,720,000	貸付有価証券 2,000株
東鉄工業	19,200	3,240.00	62,208,000	貸付有価証券 200株
イチケン	15,000	430.00	6,450,000	
浅沼組	56,000	340.00	19,040,000	

戸田建設	186,000	719.00	133,734,000	貸付有価証券 5,000株
熊谷組	251,000	310.00	77,810,000	貸付有価証券 8,000株
青木あすなろ建設	10,500	816.00	8,568,000	
北野建設	33,000	317.00	10,461,000	
植木組	20,000	264.00	5,280,000	
三井ホーム	21,000	697.00	14,637,000	
矢作建設工業	21,800	925.00	20,165,000	
ピーエス三菱	16,800	445.00	7,476,000	貸付有価証券 4,100株（1,100株）
日本ハウスホールディングス	32,600	497.00	16,202,200	貸付有価証券 600株
大東建託	57,900	17,015.00	985,168,500	貸付有価証券 18,000株
新日本建設	19,000	931.00	17,689,000	
N I P P O	37,000	2,255.00	83,435,000	
東亜道路工業	30,000	355.00	10,650,000	
前田道路	50,000	2,174.00	108,700,000	
日本道路	48,000	532.00	25,536,000	
東亜建設工業	13,000	2,225.00	28,925,000	貸付有価証券 1,600株
若築建設	92,000	152.00	13,984,000	
東洋建設	46,000	416.00	19,136,000	貸付有価証券 300株（100株）
五洋建設	177,600	585.00	103,896,000	
大林道路	16,600	694.00	11,520,400	
世紀東急工業	23,300	600.00	13,980,000	
福田組	26,000	1,000.00	26,000,000	
住友林業	110,100	1,771.00	194,987,100	
日本基礎技術	17,800	354.00	6,301,200	
日成ビルド工業	47,000	583.00	27,401,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	81,000	85.00	6,885,000	
巴コーポレーション	19,900	353.00	7,024,700	
パナホーム	60,000	1,230.00	73,800,000	貸付有価証券 28,000株（1,000株）
大和ハウス工業	472,700	3,547.00	1,676,666,900	
ライト工業	30,800	1,167.00	35,943,600	貸付有価証券

				800株
積水ハウス	503,500	1,914.50	963,950,750	貸付有価証券 56,600株(56,600株)
日特建設	13,600	496.00	6,745,600	
北陸電気工事	7,800	913.00	7,121,400	
ユアテック	25,000	735.00	18,375,000	
西部電気工業	2,700	2,292.00	6,188,400	貸付有価証券 400株(300株)
四電工	12,000	496.00	5,952,000	
中電工	18,000	2,710.00	48,780,000	貸付有価証券 200株
関電工	64,000	1,143.00	73,152,000	貸付有価証券 4,000株(2,000株)
きんでん	106,400	1,765.00	187,796,000	
東京エネシス	16,500	994.00	16,401,000	貸付有価証券 400株
トーエネック	23,000	602.00	13,846,000	貸付有価証券 1,000株
住友電設	11,100	1,435.00	15,928,500	
日本電設工業	26,100	2,213.00	57,759,300	貸付有価証券 1,900株
協和エクシオ	62,700	1,835.00	115,054,500	貸付有価証券 2,500株
新日本空調	12,300	1,513.00	18,609,900	貸付有価証券 800株
N D S	2,500	3,005.00	7,512,500	
九電工	31,100	3,670.00	114,137,000	貸付有価証券 4,600株(4,400株)
三機工業	35,500	1,031.00	36,600,500	
日揮	149,300	1,775.00	265,007,500	
中外炉工業	48,000	225.00	10,800,000	貸付有価証券 4,000株
ヤマト	14,300	557.00	7,965,100	
太平電業	22,000	1,155.00	25,410,000	
高砂熱学工業	44,000	1,783.00	78,452,000	貸付有価証券 100株
三晃金属工業	1,400	3,125.00	4,375,000	貸付有価証券 600株
朝日工業社	3,600	3,190.00	11,484,000	
明星工業	29,000	639.00	18,531,000	

大気社	21,200	2,911.00	61,713,200	貸付有価証券 4,700株
ダイダン	21,000	1,157.00	24,297,000	
日比谷総合設備	17,900	1,784.00	31,933,600	貸付有価証券 200株
東芝プラントシステム	26,000	1,826.00	47,476,000	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
OSJBホールディングス	48,900	266.00	13,007,400	貸付有価証券 22,900株
東洋エンジニアリング	94,000	281.00	26,414,000	貸付有価証券 44,000株(1,000株)
千代田化工建設	115,000	736.00	84,640,000	貸付有価証券 3,000株
新興プランテック	32,900	837.00	27,537,300	
日本製粉	47,600	1,714.00	81,586,400	
日清製粉グループ本社	175,500	1,747.00	306,598,500	貸付有価証券 11,100株(11,100株)
日東富士製粉	1,000	3,850.00	3,850,000	
昭和産業	66,000	617.00	40,722,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
鳥越製粉	12,700	823.00	10,452,100	
中部飼料	17,500	1,402.00	24,535,000	
フィード・ワン	96,300	220.00	21,186,000	
東洋精糖	24,000	116.00	2,784,000	
日本甜菜製糖	8,200	2,386.00	19,565,200	
三井製糖	11,300	2,816.00	31,820,800	
塩水港精糖	17,100	252.00	4,309,200	
日新製糖	6,800	1,905.00	12,954,000	
森永製菓	31,200	5,880.00	183,456,000	
中村屋	3,700	4,950.00	18,315,000	
江崎グリコ	40,000	6,040.00	241,600,000	
名糖産業	6,900	1,528.00	10,543,200	
不二家	91,000	257.00	23,387,000	
山崎製パン	117,200	2,259.00	264,754,800	貸付有価証券 54,100株
第一屋製パン	25,000	124.00	3,100,000	
モロゾフ	24,000	593.00	14,232,000	
亀田製菓	8,900	5,370.00	47,793,000	貸付有価証券 300株(300株)

寿スピリッツ	15,200	3,070.00	46,664,000	貸付有価証券 1,900株
カルビー	65,300	4,045.00	264,138,500	貸付有価証券 25,800株(6,300株)
森永乳業	144,000	921.00	132,624,000	
六甲バター	7,100	2,466.00	17,508,600	
ヤクルト本社	85,800	6,590.00	565,422,000	貸付有価証券 900株
明治ホールディングス	94,800	9,640.00	913,872,000	
雪印メグミルク	34,500	3,410.00	117,645,000	
プリマハム	101,000	540.00	54,540,000	
日本ハム	112,000	3,320.00	371,840,000	
林兼産業	5,100	856.00	4,365,600	貸付有価証券 100株
丸大食品	76,000	514.00	39,064,000	
S Foods	8,600	3,525.00	30,315,000	貸付有価証券 4,000株(2,600株)
伊藤ハム米久ホールディングス	92,300	1,053.00	97,191,900	
サッポロホールディングス	52,400	3,215.00	168,466,000	貸付有価証券 21,200株
アサヒグループホールディングス	300,200	4,391.00	1,318,178,200	貸付有価証券 23,200株(23,200株)
キリンホールディングス	689,000	2,253.00	1,552,317,000	貸付有価証券 125,300株(63,000株)
宝ホールディングス	115,800	1,175.00	136,065,000	貸付有価証券 100株
オエノンホールディングス	41,000	255.00	10,455,000	
養命酒製造	4,900	2,100.00	10,290,000	
コカ・コーラボトラーズ ジャパン	100,900	3,395.00	342,555,500	
サントリー食品インター ナショナル	109,600	5,240.00	574,304,000	
ダイドーグループホール ディングス	7,300	5,420.00	39,566,000	貸付有価証券 200株(200株)
伊藤園	47,500	4,180.00	198,550,000	貸付有価証券 10,500株(600株)
キーコーヒー	14,100	2,259.00	31,851,900	貸付有価証券 300株(100株)

ユニカフェ	4,300	980.00	4,214,000	
ジャパンフーズ	2,000	1,355.00	2,710,000	
日清オイリオグループ	92,000	687.00	63,204,000	
不二製油グループ本社	42,700	2,507.00	107,048,900	
かどや製油	1,600	5,650.00	9,040,000	貸付有価証券 300株
J - オイルミルズ	7,400	4,325.00	32,005,000	
キッコーマン	112,000	3,520.00	394,240,000	
味の素	329,700	2,209.50	728,472,150	貸付有価証券 16,800株
キュービー	81,400	2,881.00	234,513,400	
ハウス食品グループ本社	59,200	2,524.00	149,420,800	
カゴメ	57,400	3,340.00	191,716,000	貸付有価証券 9,200株(5,000株)
焼津水産化学工業	7,500	1,280.00	9,600,000	
アリアケジャパン	13,100	7,300.00	95,630,000	貸付有価証券 3,500株(800株)
ピエトロ	1,900	1,632.00	3,100,800	貸付有価証券 700株
エバラ食品工業	3,800	2,126.00	8,078,800	
ニチレイ	78,700	2,864.00	225,396,800	
東洋水産	78,700	4,310.00	339,197,000	
イトアンド	1,800	2,304.00	4,147,200	貸付有価証券 600株
大冷	1,600	1,813.00	2,900,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	2,946.00	883,800	
日清食品ホールディングス	62,500	6,530.00	408,125,000	貸付有価証券 400株
永谷園ホールディングス	15,000	1,432.00	21,480,000	
一正蒲鉾	5,600	1,317.00	7,375,200	貸付有価証券 800株
フジッコ	15,500	2,595.00	40,222,500	
ロック・フィールド	15,400	1,826.00	28,120,400	
日本たばこ産業	886,900	3,791.00	3,362,237,900	貸付有価証券 4,800株
ケンコーマヨネーズ	8,600	2,887.00	24,828,200	貸付有価証券 1,400株
わらべや日洋ホールディ	9,400	2,832.00	26,620,800	

ングス				
なとり	8,000	2,019.00	16,152,000	貸付有価証券 800株(800株)
イフジ産業	2,500	768.00	1,920,000	
北の達人コーポレーション	6,900	784.00	5,409,600	貸付有価証券 3,200株
ユーグレナ	55,300	1,206.00	66,691,800	貸付有価証券 25,900株(4,200株)
ミヨシ油脂	55,000	145.00	7,975,000	
理研ビタミン	4,700	4,270.00	20,069,000	
片倉工業	18,700	1,428.00	26,703,600	
グンゼ	112,000	465.00	52,080,000	
東洋紡	592,000	198.00	117,216,000	貸付有価証券 13,000株
ユニチカ	410,000	95.00	38,950,000	
富士紡ホールディングス	7,300	3,160.00	23,068,000	貸付有価証券 300株
倉敷紡績	151,000	261.00	39,411,000	
シキボウ	81,000	141.00	11,421,000	
日本毛織	42,200	908.00	38,317,600	貸付有価証券 19,800株
ダイトウボウ	20,000	73.00	1,460,000	貸付有価証券 3,000株
トーア紡コーポレーション	6,300	558.00	3,515,400	
ダイドーリミテッド	16,700	442.00	7,381,400	貸付有価証券 900株
帝国繊維	15,600	1,784.00	27,830,400	
帝人	122,300	2,188.00	267,592,400	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
東レ	1,085,200	954.10	1,035,389,320	貸付有価証券 3,700株
サカイオーベックス	3,500	1,821.00	6,373,500	
住江織物	41,000	262.00	10,742,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
日本フェルト	8,600	520.00	4,472,000	
イチカワ	10,000	302.00	3,020,000	
日東製網	1,600	1,880.00	3,008,000	貸付有価証券 400株
アツギ	123,000	135.00	16,605,000	

ダイニック	28,000	193.00	5,404,000	
セーレン	37,300	1,646.00	61,395,800	
ソトー	5,600	1,175.00	6,580,000	
東海染工	21,000	137.00	2,877,000	
小松精練	21,000	788.00	16,548,000	
ワコールホールディングス	89,000	1,445.00	128,605,000	
ホギメディカル	9,400	7,390.00	69,466,000	貸付有価証券 2,200株（1,900株）
レナウン	40,400	148.00	5,979,200	貸付有価証券 19,400株（7,000株）
クラウドシア	3,400	553.00	1,880,200	貸付有価証券 1,400株
T S Iホールディングス	61,600	780.00	48,048,000	
三陽商会	78,000	169.00	13,182,000	貸付有価証券 36,000株
ナイガイ	55,000	57.00	3,135,000	貸付有価証券 6,000株
オンワードホールディングス	97,000	860.00	83,420,000	貸付有価証券 26,000株（1,000株）
ルック	27,000	201.00	5,427,000	貸付有価証券 5,000株
キムラタン	632,000	7.00	4,424,000	貸付有価証券 157,000株（2,000株）
ゴールドウイン	6,300	6,120.00	38,556,000	貸付有価証券 100株
デサント	34,100	1,381.00	47,092,100	貸付有価証券 9,400株
キング	7,400	403.00	2,982,200	
ヤマトインターナショナル	9,900	420.00	4,158,000	
特種東海製紙	8,700	4,245.00	36,931,500	
王子ホールディングス	585,000	548.00	320,580,000	
日本製紙	67,000	2,139.00	143,313,000	貸付有価証券 3,400株
三菱製紙	21,300	780.00	16,614,000	
北越紀州製紙	83,500	804.00	67,134,000	貸付有価証券 4,700株（600株）
中越パルプ工業	59,000	240.00	14,160,000	貸付有価証券 19,000株（19,000株）
巴川製紙所	23,000	244.00	5,612,000	

大王製紙	59,600	1,478.00	88,088,800	貸付有価証券 28,000株（8,600株）
阿波製紙	3,600	602.00	2,167,200	
レンゴー	144,200	674.00	97,190,800	
トーモク	47,000	363.00	17,061,000	
ザ・パック	10,600	3,245.00	34,397,000	
クラレ	251,800	1,842.00	463,815,600	
旭化成	933,000	1,105.00	1,030,965,000	
共和レザー	8,700	924.00	8,038,800	
昭和電工	99,600	2,194.00	218,522,400	
住友化学	1,101,000	645.00	710,145,000	
住友精化	6,200	5,000.00	31,000,000	
日産化学工業	81,900	3,560.00	291,564,000	貸付有価証券 6,400株
ラサ工業	56,000	145.00	8,120,000	
クレハ	11,300	5,050.00	57,065,000	貸付有価証券 1,100株（100株）
多木化学	10,000	927.00	9,270,000	
テイカ	23,000	777.00	17,871,000	
石原産業	26,900	1,134.00	30,504,600	
片倉コープアグリ	20,000	250.00	5,000,000	
日東エフシー	8,700	912.00	7,934,400	貸付有価証券 4,100株
日本曹達	90,000	621.00	55,890,000	貸付有価証券 1,000株
東ソー	432,000	1,058.00	457,056,000	
トクヤマ	233,000	533.00	124,189,000	貸付有価証券 24,000株
セントラル硝子	152,000	492.00	74,784,000	
東亜合成	93,700	1,334.00	124,995,800	
大阪ソーダ	64,000	514.00	32,896,000	貸付有価証券 30,000株（26,000株）
関東電化工業	30,600	1,007.00	30,814,200	
デンカ	310,000	588.00	182,280,000	
信越化学工業	268,300	9,871.00	2,648,389,300	貸付有価証券 44,500株
日本カーバイド工業	51,000	166.00	8,466,000	
堺化学工業	56,000	394.00	22,064,000	

エア・ウォーター	123,400	2,203.00	271,850,200	
大陽日酸	115,200	1,360.00	156,672,000	貸付有価証券 54,100株
日本化学工業	55,000	239.00	13,145,000	
日本パーカライジング	76,400	1,503.00	114,829,200	貸付有価証券 200株
高圧ガス工業	22,200	774.00	17,182,800	
チタン工業	17,000	191.00	3,247,000	
四国化成工業	22,000	1,446.00	31,812,000	
戸田工業	30,000	271.00	8,130,000	貸付有価証券 1,000株
ステラ ケミファ	7,300	2,951.00	21,542,300	貸付有価証券 3,400株（100株）
保土谷化学工業	5,200	3,680.00	19,136,000	貸付有価証券 1,500株
日本触媒	23,500	6,940.00	163,090,000	
大日精化工業	62,000	803.00	49,786,000	
カネカ	202,000	907.00	183,214,000	
三菱瓦斯化学	139,400	2,408.00	335,675,200	
三井化学	680,000	597.00	405,960,000	
J S R	150,400	1,989.00	299,145,600	
東京応化工業	28,000	3,650.00	102,200,000	
大阪有機化学工業	9,700	1,214.00	11,775,800	貸付有価証券 200株
三菱ケミカルホールディングス	1,007,800	902.00	909,035,600	
K Hネオケム	24,400	1,684.00	41,089,600	貸付有価証券 400株
ダイセル	201,700	1,310.00	264,227,000	
住友ベークライト	132,000	730.00	96,360,000	
積水化学工業	339,600	1,996.00	677,841,600	
日本ゼオン	126,000	1,196.00	150,696,000	
アイカ工業	48,000	3,295.00	158,160,000	
宇部興産	754,000	264.00	199,056,000	
積水樹脂	23,100	2,082.00	48,094,200	
タキロンシーアイ	31,000	585.00	18,135,000	
旭有機材	48,000	239.00	11,472,000	
日立化成	83,200	3,260.00	271,232,000	

ニチバン	15,000	888.00	13,320,000	
リケンテクノス	32,200	566.00	18,225,200	貸付有価証券 5,700株(800株)
大倉工業	36,000	537.00	19,332,000	
積水化成工業	20,800	846.00	17,596,800	
群栄化学工業	3,600	3,750.00	13,500,000	
タイガースポリマー	7,400	740.00	5,476,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
ミライアル	5,400	962.00	5,194,800	
ダイキアクシス	2,500	2,035.00	5,087,500	
ダイキョーニシカワ	26,200	1,450.00	37,990,000	貸付有価証券 8,800株
日本化薬	97,000	1,546.00	149,962,000	
カーリットホールディングス	13,900	582.00	8,089,800	
日本精化	12,400	1,015.00	12,586,000	貸付有価証券 100株(100株)
扶桑化学工業	10,600	3,700.00	39,220,000	貸付有価証券 1,300株
A D E K A	64,300	1,701.00	109,374,300	
日油	116,000	1,327.00	153,932,000	
新日本理化	23,600	149.00	3,516,400	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
ハリマ化成グループ	12,700	829.00	10,528,300	
花王	373,200	6,594.00	2,460,880,800	
第一工業製薬	33,000	467.00	15,411,000	
日華化学	4,700	1,189.00	5,588,300	
ニイタカ	2,200	1,836.00	4,039,200	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
三洋化成工業	9,400	5,160.00	48,504,000	
有機合成薬品工業	9,700	293.00	2,842,100	
大日本塗料	86,000	269.00	23,134,000	
日本ペイントホールディングス	115,400	4,400.00	507,760,000	貸付有価証券 40,400株(10,700株)
関西ペイント	157,200	2,485.00	390,642,000	貸付有価証券 38,700株(3,000株)
神東塗料	11,000	215.00	2,365,000	
中国塗料	42,900	879.00	37,709,100	
日本特殊塗料	10,500	1,766.00	18,543,000	

藤倉化成	20,300	681.00	13,824,300	
太陽ホールディングス	12,200	4,845.00	59,109,000	
D I C	59,100	4,145.00	244,969,500	
サカティクス	30,500	1,659.00	50,599,500	貸付有価証券 3,600株
東洋インキ S C ホール ディングス	148,000	574.00	84,952,000	
T & K T O K A	10,800	1,145.00	12,366,000	
富士フイルムホールディ ングス	296,700	4,270.00	1,266,909,000	
資生堂	283,800	3,198.00	907,592,400	貸付有価証券 2,900株
ライオン	185,700	2,137.00	396,840,900	貸付有価証券 87,400株(38,000株)
高砂香料工業	9,800	3,975.00	38,955,000	
マンダム	15,000	5,560.00	83,400,000	
ミルボン	8,100	5,570.00	45,117,000	貸付有価証券 400株
ファンケル	31,800	1,886.00	59,974,800	貸付有価証券 500株
コーセー	24,200	11,360.00	274,912,000	
コタ	6,200	1,172.00	7,266,400	
シーズ・ホールディング ス	19,400	3,385.00	65,669,000	
シーボン	1,700	2,503.00	4,255,100	貸付有価証券 700株
ポーラ・オルビスホール ディングス	61,000	2,720.00	165,920,000	貸付有価証券 28,600株
ノエビアホールディング ス	9,400	4,650.00	43,710,000	
アジュバンコスメジャパ ン	2,800	957.00	2,679,600	貸付有価証券 1,300株
エステー	10,200	1,976.00	20,155,200	
アグロ カネショウ	5,800	1,553.00	9,007,400	
コニシ	23,500	1,437.00	33,769,500	
長谷川香料	18,900	2,259.00	42,695,100	貸付有価証券 1,000株
星光 P M C	8,200	1,207.00	9,897,400	貸付有価証券 3,800株(800株)
小林製薬	40,000	6,280.00	251,200,000	

荒川化学工業	12,800	1,965.00	25,152,000	
メック	11,600	1,164.00	13,502,400	貸付有価証券 5,400株(2,600株)
日本高純度化学	4,200	2,418.00	10,155,600	
タカラバイオ	42,700	1,550.00	66,185,000	貸付有価証券 2,500株
J C U	9,400	3,470.00	32,618,000	
新田ゼラチン	9,000	772.00	6,948,000	貸付有価証券 300株
O A T アグリオ	1,700	1,667.00	2,833,900	
デクセリアルズ	39,300	974.00	38,278,200	貸付有価証券 100株(100株)
アース製薬	10,700	5,790.00	61,953,000	
北興化学工業	15,000	486.00	7,290,000	
大成ラミック	4,600	2,933.00	13,491,800	貸付有価証券 900株
クマイ化学工業	63,299	636.00	40,258,164	貸付有価証券 12,500株(10,300株)
日本農薬	37,300	740.00	27,602,000	貸付有価証券 10,900株(500株)
アキレス	12,200	1,835.00	22,387,000	
有沢製作所	25,300	853.00	21,580,900	
日東電工	107,900	9,197.00	992,356,300	
レック	9,300	2,965.00	27,574,500	貸付有価証券 4,000株
きもと	26,700	233.00	6,221,100	
藤森工業	11,100	3,545.00	39,349,500	
前澤化成工業	9,800	1,223.00	11,985,400	
J S P	7,000	2,826.00	19,782,000	
エフピコ	13,300	5,500.00	73,150,000	貸付有価証券 6,200株(1,700株)
天馬	9,900	2,201.00	21,789,900	
信越ポリマー	29,300	837.00	24,524,100	
東リ	35,600	372.00	13,243,200	
ニフコ	26,200	5,730.00	150,126,000	貸付有価証券 5,100株
日本バルカー工業	11,600	1,939.00	22,492,400	
ユニ・チャーム	302,800	2,819.00	853,593,200	貸付有価証券 57,400株(57,400株)

協和発酵キリン	178,900	2,049.00	366,566,100	貸付有価証券 200株
武田薬品工業	560,900	5,489.00	3,078,780,100	
アステラス製薬	1,528,200	1,438.00	2,197,551,600	
大日本住友製薬	105,900	1,856.00	196,550,400	貸付有価証券 43,900株
塩野義製薬	189,700	6,183.00	1,172,915,100	
田辺三菱製薬	174,300	2,506.00	436,795,800	
わかもと製薬	17,000	275.00	4,675,000	
あすか製薬	16,300	1,711.00	27,889,300	貸付有価証券 100株
日本新薬	34,300	6,280.00	215,404,000	
ビオフェルミン製薬	2,400	2,999.00	7,197,600	
中外製薬	148,900	4,135.00	615,701,500	貸付有価証券 1,700株
科研製薬	27,900	6,890.00	192,231,000	
エーザイ	184,100	5,994.00	1,103,495,400	
ロート製薬	73,200	2,254.00	164,992,800	貸付有価証券 4,500株
小野薬品工業	339,700	2,446.00	830,906,200	
久光製薬	42,200	5,980.00	252,356,000	貸付有価証券 15,700株（400株）
持田製薬	10,000	8,880.00	88,800,000	
参天製薬	270,200	1,640.00	443,128,000	
扶桑薬品工業	5,000	2,932.00	14,660,000	
日本ケミファ	2,100	5,530.00	11,613,000	
ツムラ	50,200	3,835.00	192,517,000	
日医工	35,000	1,810.00	63,350,000	貸付有価証券 16,400株
キッセイ薬品工業	26,500	2,842.00	75,313,000	
生化学工業	27,700	1,850.00	51,245,000	
栄研化学	12,600	3,415.00	43,029,000	
日水製薬	6,000	1,338.00	8,028,000	
鳥居薬品	10,200	2,929.00	29,875,800	
J C R ファーマ	11,500	2,448.00	28,152,000	貸付有価証券 5,400株（3,200株）
東和薬品	6,900	5,850.00	40,365,000	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
富士製薬工業	4,900	3,690.00	18,081,000	貸付有価証券

				1,400株
沢井製薬	25,400	6,230.00	158,242,000	貸付有価証券 9,400株
ゼリア新薬工業	30,600	1,774.00	54,284,400	
第一三共	440,200	2,595.50	1,142,539,100	
キョーリン製薬ホールディングス	36,600	2,448.00	89,596,800	
大幸薬品	7,500	1,907.00	14,302,500	貸付有価証券 2,100株
ダイト	8,900	2,412.00	21,466,800	
大塚ホールディングス	321,600	5,153.00	1,657,204,800	貸付有価証券 600株(600株)
大正製薬ホールディングス	32,000	9,580.00	306,560,000	貸付有価証券 3,000株
ペプチドリーム	28,000	6,220.00	174,160,000	貸付有価証券 13,100株
日本コークス工業	120,700	102.00	12,311,400	貸付有価証券 400株
昭和シェル石油	133,700	1,143.00	152,819,100	
ニチレキ	18,300	1,035.00	18,940,500	
ユシロ化学工業	8,000	1,462.00	11,696,000	
ビーピー・カストロール	6,100	1,879.00	11,461,900	貸付有価証券 2,800株
富士石油	34,700	371.00	12,873,700	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
MORESCO	5,100	1,934.00	9,863,400	貸付有価証券 200株
出光興産	71,000	3,920.00	278,320,000	貸付有価証券 100株
JXTGホールディングス	2,280,700	512.40	1,168,630,680	
コスモエネルギーホールディングス	45,100	1,883.00	84,923,300	
横浜ゴム	90,200	2,243.00	202,318,600	貸付有価証券 500株
東洋ゴム工業	79,000	1,958.00	154,682,000	
ブリヂストン	504,800	4,772.00	2,408,905,600	貸付有価証券 17,100株(14,800株)
住友ゴム工業	140,000	2,067.00	289,380,000	
藤倉ゴム工業	12,500	704.00	8,800,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)

オカモト	45,000	1,244.00	55,980,000	
フコク	6,200	932.00	5,778,400	
ニッタ	13,400	3,330.00	44,622,000	
住友理工	27,700	1,187.00	32,879,900	
三ツ星ベルト	35,000	1,142.00	39,970,000	
バンドー化学	27,200	1,076.00	29,267,200	
日東紡績	121,000	597.00	72,237,000	
旭硝子	737,000	939.00	692,043,000	貸付有価証券 55,000株（55,000株）
日本板硝子	68,100	915.00	62,311,500	貸付有価証券 29,600株（19,800株）
石塚硝子	21,000	217.00	4,557,000	
日本山村硝子	59,000	201.00	11,859,000	
日本電気硝子	309,000	752.00	232,368,000	
オハラ	5,600	1,122.00	6,283,200	貸付有価証券 2,600株（800株）
住友大阪セメント	278,000	509.00	141,502,000	
太平洋セメント	902,000	380.00	342,760,000	
日本ヒューム	14,300	698.00	9,981,400	
日本コンクリート工業	33,300	368.00	12,254,400	
三谷セキサン	7,500	2,830.00	21,225,000	
アジアパイルホールディングス	18,400	631.00	11,610,400	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	139,700	590.00	82,423,000	
日本カーボン	73,000	310.00	22,630,000	貸付有価証券 34,000株（7,000株）
東洋炭素	8,300	1,915.00	15,894,500	貸付有価証券 1,300株
ノリタケカンパニーリミテド	8,400	3,075.00	25,830,000	
TOTO	109,900	4,280.00	470,372,000	
日本碍子	188,800	2,445.00	461,616,000	
日本特殊陶業	128,900	2,565.00	330,628,500	貸付有価証券 100株
ダントーホールディングス	12,000	173.00	2,076,000	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
MARUWA	5,500	4,370.00	24,035,000	
品川リフラクトリーズ	38,000	315.00	11,970,000	
黒崎播磨	32,000	455.00	14,560,000	貸付有価証券

				2,000株
ヨータイ	9,000	388.00	3,492,000	
イソライト工業	7,300	432.00	3,153,600	
東京窯業	18,200	201.00	3,658,200	
ニッカトー	4,800	488.00	2,342,400	
フジインコーポレー テッド	12,700	2,212.00	28,092,400	貸付有価証券 4,600株
エーアンドエーマテリア ル	31,000	129.00	3,999,000	
ニチアス	78,000	1,292.00	100,776,000	
ニチハ	19,900	3,550.00	70,645,000	
新日鐵住金	674,300	2,542.50	1,714,407,750	
神戸製鋼所	258,500	1,112.00	287,452,000	貸付有価証券 120,400株(1,600株)
中山製鋼所	16,800	740.00	12,432,000	貸付有価証券 1,000株
合同製鐵	8,400	1,762.00	14,800,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	408,700	1,898.50	775,916,950	貸付有価証券 300株
日新製鋼	48,700	1,388.00	67,595,600	貸付有価証券 22,600株(22,600株)
東京製鐵	75,600	893.00	67,510,800	貸付有価証券 6,300株
共英製鋼	15,900	1,835.00	29,176,500	貸付有価証券 1,300株
大和工業	30,000	2,901.00	87,030,000	
東京鐵鋼	31,000	454.00	14,074,000	
大阪製鐵	9,400	2,095.00	19,693,000	
淀川製鋼所	20,700	3,210.00	66,447,000	
東洋鋼鈹	35,800	412.00	14,749,600	
丸一鋼管	50,000	3,460.00	173,000,000	貸付有価証券 7,100株
モリ工業	4,700	2,389.00	11,228,300	
大同特殊鋼	250,000	629.00	157,250,000	
日本高周波鋼業	52,000	82.00	4,264,000	
日本冶金工業	123,700	248.00	30,677,600	貸付有価証券 21,300株
山陽特殊製鋼	89,000	612.00	54,468,000	
愛知製鋼	8,800	4,450.00	39,160,000	

日立金属	152,200	1,612.00	245,346,400	貸付有価証券 3,700株
日本金属	3,600	1,483.00	5,338,800	貸付有価証券 1,200株
大太平洋金属	95,000	357.00	33,915,000	貸付有価証券 35,000株（7,000株）
新日本電工	84,600	354.00	29,948,400	
栗本鐵工所	7,100	2,272.00	16,131,200	
虹技	21,000	221.00	4,641,000	貸付有価証券 2,000株
日本鑄鉄管	15,000	170.00	2,550,000	
三菱製鋼	104,000	258.00	26,832,000	
日亜鋼業	20,700	273.00	5,651,100	
日本精線	10,000	684.00	6,840,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	12,200	724.00	8,832,800	貸付有価証券 500株（100株）
新家工業	32,000	208.00	6,656,000	
大紀アルミニウム工業所	25,000	580.00	14,500,000	
日本軽金属ホールディング グス	384,900	248.00	95,455,200	
三井金属鉱業	407,000	374.00	152,218,000	
東邦亜鉛	84,000	491.00	41,244,000	
三菱マテリアル	93,300	3,350.00	312,555,000	
住友金属鉱山	387,000	1,478.50	572,179,500	
DOWAホールディング ス	165,000	820.00	135,300,000	貸付有価証券 3,000株
古河機械金属	233,000	217.00	50,561,000	貸付有価証券 1,000株
大阪チタニウムテクノロ ジーズ	16,300	1,759.00	28,671,700	貸付有価証券 7,500株
東邦チタニウム	25,300	775.00	19,607,500	貸付有価証券 11,800株
UACJ	211,000	309.00	65,199,000	貸付有価証券 7,000株
古河電気工業	50,100	4,690.00	234,969,000	貸付有価証券 3,600株
住友電気工業	563,300	1,889.50	1,064,355,350	
フジクラ	196,800	885.00	174,168,000	
昭和電線ホールディング	178,000	86.00	15,308,000	貸付有価証券

ス				22,000株
東京特殊電線	2,100	1,748.00	3,670,800	
タツタ電線	28,000	576.00	16,128,000	
沖電線	16,000	228.00	3,648,000	
カナレ電気	2,100	2,259.00	4,743,900	貸付有価証券 900株
平河ヒューテック	7,000	1,380.00	9,660,000	
リョービ	91,000	519.00	47,229,000	
アーレスティ	17,300	1,127.00	19,497,100	貸付有価証券 3,100株
アサヒホールディングス	22,500	2,141.00	48,172,500	
稲葉製作所	7,900	1,394.00	11,012,600	貸付有価証券 3,400株
宮地エンジニアリンググループ	43,000	238.00	10,234,000	
トーカロ	9,800	3,310.00	32,438,000	
アルファC o	5,000	2,191.00	10,955,000	貸付有価証券 2,300株
SUMCO	156,100	1,963.00	306,424,300	
川田テクノロジーズ	2,900	7,900.00	22,910,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
RS Technologies	700	7,070.00	4,949,000	貸付有価証券 300株
東洋製罐グループホールディングス	106,200	1,922.00	204,116,400	
ホッカンホールディングス	39,000	523.00	20,397,000	
コロナ	7,800	1,167.00	9,102,600	
横河ブリッジホールディングス	26,300	1,421.00	37,372,300	
駒井ハルテック	2,900	2,251.00	6,527,900	
高田機工	13,000	279.00	3,627,000	
三和ホールディングス	148,400	1,178.00	174,815,200	
文化シャッター	41,600	906.00	37,689,600	
三協立山	19,600	1,737.00	34,045,200	貸付有価証券 8,200株(600株)
アルインコ	10,300	1,040.00	10,712,000	
東洋シャッター	3,700	635.00	2,349,500	
LIXILグループ	208,200	2,812.00	585,458,400	貸付有価証券 28,200株

日本ファイルコン	10,800	605.00	6,534,000	貸付有価証券 300株(300株)
ノーリツ	29,300	2,246.00	65,807,800	貸付有価証券 600株
長府製作所	16,000	2,746.00	43,936,000	貸付有価証券 900株
リンナイ	25,500	9,840.00	250,920,000	貸付有価証券 10,800株(500株)
ダイニチ工業	7,600	720.00	5,472,000	
日東精工	21,300	466.00	9,925,800	
三洋工業	19,000	203.00	3,857,000	
岡部	31,000	1,013.00	31,403,000	
ジーテクト	15,600	2,098.00	32,728,800	
中国工業	2,100	767.00	1,610,700	
東プレ	28,700	3,160.00	90,692,000	貸付有価証券 12,900株(10,900株)
高周波熱錬	27,200	963.00	26,193,600	
東京製綱	10,100	1,741.00	17,584,100	貸付有価証券 4,700株(800株)
サンコール	7,900	550.00	4,345,000	
モリテック スチール	7,500	287.00	2,152,500	
パイオラックス	22,600	2,770.00	62,602,000	
エイチワン	11,300	1,340.00	15,142,000	貸付有価証券 3,200株
日本発條	140,700	1,263.00	177,704,100	
中央発條	17,000	352.00	5,984,000	
アドバネクス	2,600	1,574.00	4,092,400	
立川ブラインド工業	6,200	996.00	6,175,200	
三益半導体工業	12,600	1,751.00	22,062,600	
日本ドライケミカル	1,900	2,496.00	4,742,400	
日本製鋼所	49,400	1,834.00	90,599,600	貸付有価証券 300株
三浦工業	61,100	1,970.00	120,367,000	
タクマ	47,800	1,156.00	55,256,800	
ツガミ	40,000	922.00	36,880,000	
オークマ	97,000	1,139.00	110,483,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
東芝機械	89,000	492.00	43,788,000	
アマダホールディングス	201,200	1,365.00	274,638,000	

アイダエンジニアリング	42,500	1,006.00	42,755,000	貸付有価証券 13,800株
滝澤鉄工所	44,000	173.00	7,612,000	
富士機械製造	45,500	1,442.00	65,611,000	貸付有価証券 21,000株(20,900株)
牧野フライス製作所	74,000	1,030.00	76,220,000	貸付有価証券 34,000株(16,000株)
オーエスジー	68,100	2,329.00	158,604,900	貸付有価証券 32,000株(29,400株)
ダイジェット工業	17,000	182.00	3,094,000	
旭ダイヤモンド工業	42,000	896.00	37,632,000	貸付有価証券 14,000株(11,300株)
D M G 森精機	86,100	1,925.00	165,742,500	貸付有価証券 28,200株(20,000株)
ソディック	37,900	1,134.00	42,978,600	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
ディスコ	17,500	18,370.00	321,475,000	
日東工器	8,700	2,679.00	23,307,300	
パンチ工業	5,400	1,172.00	6,328,800	
豊和工業	8,300	713.00	5,917,900	貸付有価証券 3,900株(3,600株)
O K K	54,000	121.00	6,534,000	貸付有価証券 3,000株
東洋機械金属	10,100	716.00	7,231,600	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
津田駒工業	33,000	179.00	5,907,000	貸付有価証券 15,000株
エンシュウ	37,000	86.00	3,182,000	貸付有価証券 17,000株(14,000株)
島精機製作所	19,500	5,100.00	99,450,000	貸付有価証券 2,400株(1,600株)
N C ホールディングス	4,800	999.00	4,795,200	
フリーー	8,800	1,477.00	12,997,600	
ヤマシンフィルタ	3,900	2,188.00	8,533,200	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
日阪製作所	20,300	985.00	19,995,500	
やまびこ	27,400	1,375.00	37,675,000	
ペガサスミシン製造	14,300	919.00	13,141,700	貸付有価証券 400株(400株)
ナプテスコ	77,700	3,365.00	261,460,500	貸付有価証券 6,900株

三井海洋開発	15,000	2,585.00	38,775,000	貸付有価証券 5,500株
レオン自動機	12,600	1,111.00	13,998,600	
S M C	44,800	32,010.00	1,434,048,000	
新川	12,400	820.00	10,168,000	貸付有価証券 100株
ホソカワミクロン	5,300	4,310.00	22,843,000	
ユニオンツール	6,500	3,295.00	21,417,500	貸付有価証券 1,100株
オイレス工業	18,300	2,116.00	38,722,800	
日精エー・エス・ピー機 械	4,800	3,430.00	16,464,000	貸付有価証券 2,200株
サトーホールディングス	18,600	2,573.00	47,857,800	
日本エアテック	4,800	804.00	3,859,200	貸付有価証券 2,200株
日精樹脂工業	11,900	1,153.00	13,720,700	貸付有価証券 400株
オカダアイヨン	4,200	1,142.00	4,796,400	
ワイエイシイホールディ ングス	5,600	1,405.00	7,868,000	貸付有価証券 2,600株
小松製作所	689,600	2,888.00	1,991,564,800	貸付有価証券 147,200株
住友重機械工業	436,000	770.00	335,720,000	
日立建機	66,800	2,789.00	186,305,200	貸付有価証券 2,300株(2,000株)
日工	4,500	2,076.00	9,342,000	
巴工業	6,100	1,815.00	11,071,500	貸付有価証券 300株
井関農機	153,000	234.00	35,802,000	貸付有価証券 6,000株(2,000株)
T O W A	12,200	1,978.00	24,131,600	
丸山製作所	3,100	1,804.00	5,592,400	
北川鉄工所	6,800	2,262.00	15,381,600	
ローツェ	7,000	2,430.00	17,010,000	貸付有価証券 3,100株(600株)
タカキタ	5,000	561.00	2,805,000	
クボタ	715,500	1,756.50	1,256,775,750	貸付有価証券 107,400株(107,400 株)
荏原実業	4,200	1,485.00	6,237,000	

三菱化工機	49,000	227.00	11,123,000	貸付有価証券 9,000株
月島機械	28,300	1,276.00	36,110,800	
帝国電機製作所	10,900	1,103.00	12,022,700	
東京機械製作所	56,000	66.00	3,696,000	貸付有価証券 26,000株
新東工業	33,900	1,034.00	35,052,600	
澁谷工業	12,500	3,510.00	43,875,000	貸付有価証券 500株(500株)
アイチ コーポレーショ ン	21,100	804.00	16,964,400	
小森コーポレーション	35,900	1,586.00	56,937,400	
鶴見製作所	11,100	1,716.00	19,047,600	
住友精密工業	24,000	368.00	8,832,000	
酒井重工業	28,000	313.00	8,764,000	
荏原製作所	67,700	3,430.00	232,211,000	
石井鐵工所	2,200	1,683.00	3,702,600	
西島製作所	14,600	1,079.00	15,753,400	貸付有価証券 100株
北越工業	16,100	951.00	15,311,100	
ダイキン工業	195,000	11,135.00	2,171,325,000	貸付有価証券 9,700株
オルガノ	28,000	528.00	14,784,000	
トーヨーカネツ	69,000	295.00	20,355,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
栗田工業	84,500	3,020.00	255,190,000	
椿本チエイン	85,000	1,008.00	85,680,000	
大同工業	29,000	300.00	8,700,000	
木村化工機	12,800	333.00	4,262,400	貸付有価証券 300株(100株)
アネスト岩田	25,900	1,029.00	26,651,100	
ダイフク	71,300	3,035.00	216,395,500	貸付有価証券 33,500株
サムコ	3,900	1,005.00	3,919,500	貸付有価証券 500株
加藤製作所	7,800	2,932.00	22,869,600	貸付有価証券 800株
油研工業	28,000	230.00	6,440,000	
タダノ	74,700	1,390.00	103,833,000	貸付有価証券

				14,000株(3,400株)
フジテック	41,600	1,397.00	58,115,200	貸付有価証券 800株
C K D	42,800	1,505.00	64,414,000	
キトー	18,000	1,204.00	21,672,000	貸付有価証券 400株
平和	44,300	2,908.00	128,824,400	
理想科学工業	14,200	2,107.00	29,919,400	
S A N K Y O	39,700	3,925.00	155,822,500	
日本金銭機械	13,200	1,319.00	17,410,800	貸付有価証券 6,100株(1,200株)
マースエンジニアリング	8,100	2,418.00	19,585,800	
福島工業	8,800	4,215.00	37,092,000	
オーイズミ	6,000	596.00	3,576,000	貸付有価証券 2,800株(200株)
ダイコク電機	5,900	1,787.00	10,543,300	貸付有価証券 1,800株
竹内製作所	26,100	1,956.00	51,051,600	貸付有価証券 2,600株
アマノ	44,200	2,448.00	108,201,600	
J U K I	22,500	1,599.00	35,977,500	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
サンデンホールディングス	87,000	336.00	29,232,000	貸付有価証券 2,000株
蛇の目マシン工業	13,900	803.00	11,161,700	貸付有価証券 1,400株
マックス	22,000	1,650.00	36,300,000	
グローリー	45,700	3,855.00	176,173,500	
新晃工業	13,300	1,761.00	23,421,300	貸付有価証券 300株
大和冷機工業	22,900	1,160.00	26,564,000	
セガサミーホールディングス	141,700	1,553.00	220,060,100	貸付有価証券 17,700株
日本ピストンリング	5,600	2,571.00	14,397,600	
リケン	6,600	5,160.00	34,056,000	
T P R	16,000	3,930.00	62,880,000	
ツバキ・ナカシマ	16,000	2,059.00	32,944,000	貸付有価証券 7,500株
ホシザキ	41,700	9,500.00	396,150,000	貸付有価証券 12,400株

大豊工業	11,600	1,497.00	17,365,200	
日本精工	293,400	1,557.00	456,823,800	貸付有価証券 1,300株
NTN	331,000	585.00	193,635,000	
ジェイテクト	152,200	1,850.00	281,570,000	
不二越	144,000	624.00	89,856,000	貸付有価証券 32,000株(3,000株)
日本トムソン	45,600	644.00	29,366,400	貸付有価証券 500株
THK	100,900	2,977.00	300,379,300	
ユースン精機	6,300	2,884.00	18,169,200	貸付有価証券 2,900株(300株)
前澤給装工業	5,400	1,616.00	8,726,400	貸付有価証券 100株
イーグル工業	15,400	1,668.00	25,687,200	
前澤工業	9,500	330.00	3,135,000	
日本ピラー工業	14,400	1,579.00	22,737,600	
キッツ	68,500	923.00	63,225,500	
日立工機	10,900	866.00	9,439,400	貸付有価証券 2,000株
マキタ	186,300	4,210.00	784,323,000	
日立造船	113,200	661.00	74,825,200	
三菱重工業	2,394,000	475.80	1,139,065,200	
IHI	1,097,000	427.00	468,419,000	貸付有価証券 24,000株
スター精密	25,000	1,859.00	46,475,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
日清紡ホールディングス	79,300	1,186.00	94,049,800	
イビデン	99,900	2,010.00	200,799,000	貸付有価証券 47,000株
コニカミノルタ	334,400	1,007.00	336,740,800	
ブラザー工業	184,600	2,534.00	467,776,400	
ミネベアミツミ	259,900	1,738.00	451,706,200	
日立製作所	3,429,000	635.00	2,177,415,000	
東芝	3,195,000	269.00	859,455,000	貸付有価証券 1,256,000株
三菱電機	1,523,500	1,647.00	2,509,204,500	
富士電機	430,000	648.00	278,640,000	
東洋電機製造	6,000	1,690.00	10,140,000	貸付有価証券

				2,700株
安川電機	165,600	2,240.00	370,944,000	貸付有価証券 15,000株(1,900株)
シンフォニアテクノロ ジー	92,000	339.00	31,188,000	
明電舎	131,000	425.00	55,675,000	貸付有価証券 1,000株
オリジン電気	21,000	321.00	6,741,000	
山洋電気	37,000	997.00	36,889,000	
デンヨー	13,200	1,795.00	23,694,000	
東芝テック	89,000	597.00	53,133,000	
芝浦メカトロニクス	23,000	293.00	6,739,000	貸付有価証券 4,000株
マブチモーター	40,300	6,660.00	268,398,000	
日本電産	185,100	10,670.00	1,975,017,000	
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	2,200	3,095.00	6,809,000	貸付有価証券 700株
東光高岳	7,200	1,702.00	12,254,400	貸付有価証券 500株
ダブル・スコープ	13,800	1,630.00	22,494,000	貸付有価証券 6,400株(100株)
ダイヘン	78,000	748.00	58,344,000	
田淵電機	21,600	331.00	7,149,600	貸付有価証券 10,100株
ヤーマン	1,800	5,810.00	10,458,000	貸付有価証券 800株(800株)
JVCケンウッド	104,800	308.00	32,278,400	貸付有価証券 29,000株(24,200株)
ミマキエンジニアリング	12,800	702.00	8,985,600	貸付有価証券 3,000株
第一精工	6,700	1,870.00	12,529,000	
日新電機	28,700	1,390.00	39,893,000	
大崎電気工業	28,000	899.00	25,172,000	貸付有価証券 1,000株
オムロン	151,800	4,695.00	712,701,000	
日東工業	21,000	1,731.00	36,351,000	
I D E C	18,600	1,299.00	24,161,400	
不二電機工業	1,600	1,347.00	2,155,200	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサコー	275,000	517.00	142,175,000	貸付有価証券

ポレーション				1,000株(1,000株)
サクサホールディングス	36,000	221.00	7,956,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
メルコホールディングス	7,900	3,240.00	25,596,000	貸付有価証券 800株
テクノメディカ	3,200	2,095.00	6,704,000	
日本電気	1,964,000	286.00	561,704,000	貸付有価証券 133,000株(126,000 株)
富士通	1,377,000	797.10	1,097,606,700	
沖電気工業	61,900	1,686.00	104,363,400	貸付有価証券 200株
岩崎通信機	63,000	86.00	5,418,000	
電気興業	41,000	576.00	23,616,000	
サンケン電気	83,000	554.00	45,982,000	
ナカヨ	15,000	368.00	5,520,000	
アイホン	8,100	1,870.00	15,147,000	
ルネサスエレクトロニクス	73,900	1,128.00	83,359,200	貸付有価証券 35,000株
セイコーエプソン	212,700	2,362.00	502,397,400	
ワコム	110,800	438.00	48,530,400	貸付有価証券 36,300株(500株)
アルバック	24,100	5,620.00	135,442,000	
アクセル	6,000	790.00	4,740,000	貸付有価証券 800株
E I Z O	14,100	4,065.00	57,316,500	
ジャパンディスプレイ	266,700	239.00	63,741,300	貸付有価証券 125,700株(16,500 株)
日本信号	39,400	1,140.00	44,916,000	貸付有価証券 11,600株(4,100株)
京三製作所	33,000	482.00	15,906,000	
能美防災	16,200	1,546.00	25,045,200	
ホーチキ	10,300	1,602.00	16,500,600	
エレコム	12,400	2,261.00	28,036,400	貸付有価証券 3,800株
日本無線	8,700	1,443.00	12,554,100	貸付有価証券 800株
パナソニック	1,640,200	1,373.00	2,251,994,600	
アンリツ	104,100	961.00	100,040,100	

富士通ゼネラル	48,500	2,467.00	119,649,500	
日立国際電気	37,300	2,491.00	92,914,300	貸付有価証券 17,500株(16,500株)
ソニー	1,008,700	4,081.00	4,116,504,700	
T D K	80,500	7,280.00	586,040,000	
帝国通信工業	31,000	193.00	5,983,000	
タムラ製作所	55,000	524.00	28,820,000	
アルプス電気	131,800	3,335.00	439,553,000	貸付有価証券 1,900株
池上通信機	45,000	149.00	6,705,000	貸付有価証券 16,000株
パイオニア	214,600	214.00	45,924,400	貸付有価証券 95,700株(200株)
日本電波工業	13,800	833.00	11,495,400	
鈴木	5,500	684.00	3,762,000	
日本トリム	3,500	3,885.00	13,597,500	貸付有価証券 1,600株(600株)
ローランド ディー . ジー .	7,300	2,960.00	21,608,000	
フォスター電機	16,700	1,925.00	32,147,500	貸付有価証券 5,100株
クラリオン	75,000	461.00	34,575,000	
S M K	37,000	396.00	14,652,000	
ヨコオ	10,200	1,428.00	14,565,600	貸付有価証券 700株
ティアック	103,000	45.00	4,635,000	貸付有価証券 48,000株(3,000株)
ホシデン	43,300	1,251.00	54,168,300	
ヒロセ電機	23,100	15,310.00	353,661,000	
日本航空電子工業	41,000	1,583.00	64,903,000	
T O A	16,800	1,028.00	17,270,400	
日立マクセル	21,300	2,265.00	48,244,500	
古野電気	18,400	706.00	12,990,400	
ユニデンホールディング ス	42,000	176.00	7,392,000	
アルパイン	34,000	1,650.00	56,100,000	貸付有価証券 6,900株
スミダコーポレーション	12,900	1,507.00	19,440,300	貸付有価証券 5,200株(1,100株)
アイコム	7,900	2,828.00	22,341,200	

リオン	5,500	1,550.00	8,525,000	
本多通信工業	6,100	1,482.00	9,040,200	
船井電機	16,000	871.00	13,936,000	貸付有価証券 7,400株
横河電機	154,900	1,804.00	279,439,600	
新電元工業	55,000	520.00	28,600,000	貸付有価証券 19,000株
アズビル	43,300	3,975.00	172,117,500	
東亜ディーケーケー	7,100	655.00	4,650,500	貸付有価証券 100株(100株)
日本光電工業	59,700	2,614.00	156,055,800	貸付有価証券 5,400株(1,000株)
チノー	5,100	1,269.00	6,471,900	
共和電業	16,200	484.00	7,840,800	
日本電子材料	5,600	666.00	3,729,600	
堀場製作所	28,300	6,970.00	197,251,000	貸付有価証券 13,300株
アドバンテスト	97,300	2,045.00	198,978,500	貸付有価証券 4,700株(4,300株)
小野測器	6,900	807.00	5,568,300	
エスペック	12,700	1,421.00	18,046,700	
キーエンス	64,700	48,320.00	3,126,304,000	
日置電機	7,500	2,432.00	18,240,000	
シスメックス	111,000	7,250.00	804,750,000	貸付有価証券 500株
日本マイクロニクス	24,800	947.00	23,485,600	貸付有価証券 11,700株
メガチップス	13,300	3,185.00	42,360,500	貸付有価証券 6,100株(500株)
OBARA GROUP	8,300	5,640.00	46,812,000	
澤藤電機	9,000	525.00	4,725,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
コーセル	19,800	1,534.00	30,373,200	
イリソ電子工業	6,000	8,120.00	48,720,000	貸付有価証券 100株
新日本無線	12,100	561.00	6,788,100	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
オブテックスグループ	10,800	3,920.00	42,336,000	貸付有価証券 2,300株(400株)
千代田インテグレ	7,500	2,548.00	19,110,000	

アイ・オー・データ機器	5,900	1,206.00	7,115,400	貸付有価証券 1,800株(100株)
レーザーテック	31,400	1,400.00	43,960,000	
スタンレー電気	101,900	3,415.00	347,988,500	貸付有価証券 8,400株
岩崎電気	52,000	173.00	8,996,000	
ウシオ電機	86,700	1,473.00	127,709,100	貸付有価証券 19,100株
岡谷電機産業	7,600	400.00	3,040,000	貸付有価証券 100株(100株)
ヘリオス テクノ ホールディング	13,100	751.00	9,838,100	貸付有価証券 600株
日本セラミック	11,700	2,438.00	28,524,600	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
遠藤照明	7,200	1,113.00	8,013,600	
古河電池	10,000	820.00	8,200,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
双信電機	6,900	299.00	2,063,100	
山一電機	13,400	1,575.00	21,105,000	貸付有価証券 5,700株
図研	9,300	1,509.00	14,033,700	
日本電子	52,000	581.00	30,212,000	貸付有価証券 2,000株
カシオ計算機	114,900	1,638.00	188,206,200	貸付有価証券 1,300株(500株)
ファナック	144,800	22,895.00	3,315,196,000	
日本シイエムケイ	30,800	809.00	24,917,200	
エンプラス	6,500	3,245.00	21,092,500	貸付有価証券 200株(200株)
大真空	5,200	1,446.00	7,519,200	貸付有価証券 1,800株
ローム	69,000	8,630.00	595,470,000	
浜松ホトニクス	104,000	3,505.00	364,520,000	貸付有価証券 33,100株
三井ハイテック	18,800	1,190.00	22,372,000	
新光電気工業	53,900	903.00	48,671,700	
京セラ	234,400	6,680.00	1,565,792,000	貸付有価証券 11,600株
太陽誘電	69,500	1,492.00	103,694,000	
村田製作所	149,800	16,320.00	2,444,736,000	

ユーシン	19,800	768.00	15,206,400	貸付有価証券 9,300株（5,200株）
双葉電子工業	23,400	2,065.00	48,321,000	貸付有価証券 200株
北陸電気工業	57,000	141.00	8,037,000	
ニチコン	45,000	1,121.00	50,445,000	
日本ケミコン	123,000	400.00	49,200,000	
K O A	19,700	2,034.00	40,069,800	
市光工業	30,000	625.00	18,750,000	貸付有価証券 7,000株（2,000株）
小糸製作所	85,600	6,110.00	523,016,000	貸付有価証券 21,300株
ミツバ	26,300	2,232.00	58,701,600	
S C R E E Nホールディングス	29,300	8,240.00	241,432,000	
キャノン電子	13,100	2,153.00	28,204,300	
キャノン	768,900	3,846.00	2,957,189,400	貸付有価証券 24,300株
リコー	429,400	931.00	399,771,400	貸付有価証券 5,100株
M U T O Hホールディングス	19,000	247.00	4,693,000	
東京エレクトロン	95,200	14,770.00	1,406,104,000	貸付有価証券 4,900株
トヨタ紡織	49,900	2,394.00	119,460,600	
芦森工業	32,000	166.00	5,312,000	
ユニプレス	27,600	2,469.00	68,144,400	
豊田自動織機	130,000	5,710.00	742,300,000	貸付有価証券 10,100株
モリタホールディングス	25,000	1,710.00	42,750,000	貸付有価証券 1,000株
三櫻工業	18,100	848.00	15,348,800	
デンソー	352,100	4,946.00	1,741,486,600	
東海理化電機製作所	37,600	2,181.00	82,005,600	貸付有価証券 3,000株
三井造船	516,000	170.00	87,720,000	
川崎重工業	1,111,000	351.00	389,961,000	貸付有価証券 10,000株
名村造船所	42,900	751.00	32,217,900	貸付有価証券 200株（200株）

サノヤスホールディングス	17,300	282.00	4,878,600	貸付有価証券 8,100株
日本車輛製造	52,000	308.00	16,016,000	貸付有価証券 24,000株（8,000株）
ニチユ三菱フォークリフト	17,000	642.00	10,914,000	貸付有価証券 2,600株
近畿車輛	2,100	2,628.00	5,518,800	貸付有価証券 900株
日産自動車	1,684,500	1,075.00	1,810,837,500	
いすゞ自動車	413,900	1,548.50	640,924,150	
トヨタ自動車	1,736,400	6,081.00	10,559,048,400	貸付有価証券 105,200株
日野自動車	203,800	1,365.00	278,187,000	
三菱自動車工業	523,400	773.00	404,588,200	貸付有価証券 246,400株
エフテック	8,200	1,358.00	11,135,600	貸付有価証券 3,400株（3,400株）
レシップホールディングス	4,700	889.00	4,178,300	貸付有価証券 1,900株
G M B	2,300	1,454.00	3,344,200	貸付有価証券 500株
ファルテック	2,500	1,385.00	3,462,500	
武蔵精密工業	16,600	3,020.00	50,132,000	貸付有価証券 7,300株（7,300株）
日産車体	62,800	1,084.00	68,075,200	
新明和工業	58,000	955.00	55,390,000	
極東開発工業	28,400	1,857.00	52,738,800	
日信工業	31,900	1,907.00	60,833,300	貸付有価証券 200株
トピー工業	11,700	3,120.00	36,504,000	貸付有価証券 500株
ティラド	56,000	341.00	19,096,000	
曙ブレーキ工業	66,300	375.00	24,862,500	貸付有価証券 9,300株（4,300株）
タチエス	24,200	2,258.00	54,643,600	
N O K	69,100	2,680.00	185,188,000	貸付有価証券 9,200株
フタバ産業	43,500	924.00	40,194,000	貸付有価証券 20,400株（20,400株）
K Y B	160,000	531.00	84,960,000	貸付有価証券 5,000株

大同メタル工業	17,900	1,022.00	18,293,800	貸付有価証券 1,900株(400株)
プレス工業	75,800	573.00	43,433,400	
ミクニ	18,100	460.00	8,326,000	
太平洋工業	32,100	1,625.00	52,162,500	
ケーヒン	32,800	1,811.00	59,400,800	
河西工業	19,300	1,406.00	27,135,800	貸付有価証券 3,400株
アイシン精機	130,700	5,810.00	759,367,000	
富士機工	14,100	739.00	10,419,900	貸付有価証券 6,500株(6,500株)
マツダ	452,200	1,601.50	724,198,300	
今仙電機製作所	13,100	1,095.00	14,344,500	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,285,200	3,230.00	4,151,196,000	貸付有価証券 73,700株
スズキ	283,100	4,895.00	1,385,774,500	貸付有価証券 37,600株(37,600株)
S U B A R U	443,400	3,982.00	1,765,618,800	
安永	6,900	1,382.00	9,535,800	貸付有価証券 2,700株(1,000株)
ヤマハ発動機	201,700	2,739.00	552,456,300	貸付有価証券 3,500株
ショーワ	37,100	1,085.00	40,253,500	
T B K	18,300	531.00	9,717,300	
エクセディ	19,400	3,210.00	62,274,000	貸付有価証券 1,400株(200株)
豊田合成	46,100	2,879.00	132,721,900	
愛三工業	25,000	990.00	24,750,000	
盟和産業	2,200	1,249.00	2,747,800	
ヨロズ	13,300	1,830.00	24,339,000	
エフ・シー・シー	23,300	2,213.00	51,562,900	
シマノ	57,600	17,980.00	1,035,648,000	貸付有価証券 10,400株
タカタ	25,800	414.00	10,681,200	貸付有価証券 12,200株(3,000株)
テイ・エス テック	33,200	3,325.00	110,390,000	
ジャムコ	8,300	2,850.00	23,655,000	貸付有価証券 3,900株(100株)
テルモ	218,900	4,175.00	913,907,500	貸付有価証券

				5,500株
クリエートメディック	4,700	991.00	4,657,700	
日機装	49,400	1,207.00	59,625,800	
島津製作所	183,800	2,003.00	368,151,400	
JMS	26,000	346.00	8,996,000	
クボテック	3,100	559.00	1,732,900	貸付有価証券 1,400株(900株)
長野計器	11,200	735.00	8,232,000	
ブイ・テクノロジー	2,900	18,200.00	52,780,000	貸付有価証券 500株
東京計器	49,000	227.00	11,123,000	貸付有価証券 23,000株(9,000株)
愛知時計電機	1,900	3,730.00	7,087,000	
インターアクション	5,300	777.00	4,118,100	貸付有価証券 300株
オーバル	13,900	269.00	3,739,100	貸付有価証券 6,100株
東京精密	27,600	3,630.00	100,188,000	
マニー	17,400	3,120.00	54,288,000	
ニコン	248,900	1,663.00	413,920,700	貸付有価証券 45,000株
トプコン	71,900	2,179.00	156,670,100	
オリンパス	227,900	4,290.00	977,691,000	貸付有価証券 14,600株(3,000株)
理研計器	12,600	1,709.00	21,533,400	
タムロン	12,700	2,157.00	27,393,900	
HOYA	293,800	5,591.00	1,642,635,800	
シード	1,800	2,118.00	3,812,400	
ノーリツ鋼機	14,400	888.00	12,787,200	
エー・アンド・デイ	13,000	472.00	6,136,000	貸付有価証券 100株
シチズン時計	156,300	777.00	121,445,100	
リズム時計工業	57,000	194.00	11,058,000	
大研医器	12,700	825.00	10,477,500	貸付有価証券 3,900株(400株)
メニコン	9,800	3,570.00	34,986,000	貸付有価証券 3,000株
松風	7,500	1,354.00	10,155,000	貸付有価証券 2,200株
セイコーホールディング	101,000	497.00	50,197,000	

ス				貸付有価証券 34,000株(15,000株)
ニプロ	98,800	1,723.00	170,232,400	貸付有価証券 3,200株
スノーピーク	2,200	3,230.00	7,106,000	貸付有価証券 1,000株(500株)
パラマウントベッドホールディングス	13,700	4,875.00	66,787,500	貸付有価証券 5,400株(1,800株)
トランザクション	6,400	976.00	6,246,400	貸付有価証券 3,000株(2,800株)
S H O - B I	4,800	473.00	2,270,400	
ニホンフラッシュ	6,700	1,498.00	10,036,600	貸付有価証券 100株(100株)
前田工織	14,300	1,462.00	20,906,600	
永大産業	19,000	535.00	10,165,000	
アートネイチャー	15,300	756.00	11,566,800	
ダンロップスポーツ	9,000	1,140.00	10,260,000	
バンダイナムコホールディングス	157,500	3,610.00	568,575,000	
アイフィスジャパン	3,200	454.00	1,452,800	
共立印刷	23,700	346.00	8,200,200	
S H O E I	6,400	2,799.00	17,913,600	貸付有価証券 200株
フランスベッドホールディングス	17,900	961.00	17,201,900	貸付有価証券 300株
パイロットコーポレーション	24,900	4,395.00	109,435,500	
萩原工業	4,000	2,752.00	11,008,000	
トッパン・フォームズ	25,500	1,184.00	30,192,000	
フジシールインターナショナル	32,000	2,716.00	86,912,000	貸付有価証券 3,700株
タカラトミー	55,500	1,179.00	65,434,500	
廣濟堂	14,400	378.00	5,443,200	
A s - m e エステール	3,800	712.00	2,705,600	貸付有価証券 100株
アーク	60,100	107.00	6,430,700	貸付有価証券 14,100株
タカノ	6,300	1,030.00	6,489,000	
プロネクサス	13,300	1,326.00	17,635,800	
ホクシン	10,100	186.00	1,878,600	貸付有価証券

				100株
ウッドワン	24,000	308.00	7,392,000	
大建工業	10,000	2,190.00	21,900,000	
凸版印刷	403,000	1,178.00	474,734,000	貸付有価証券 3,000株
大日本印刷	412,000	1,268.00	522,416,000	
図書印刷	19,000	517.00	9,823,000	貸付有価証券 7,000株
共同印刷	44,000	385.00	16,940,000	
日本写真印刷	24,900	2,925.00	72,832,500	貸付有価証券 11,700株(300株)
光村印刷	13,000	265.00	3,445,000	
宝印刷	7,500	1,777.00	13,327,500	貸付有価証券 3,100株
アシックス	141,900	1,922.00	272,731,800	貸付有価証券 63,700株(2,100株)
ツツミ	5,300	2,126.00	11,267,800	
小松ウオール工業	4,800	2,140.00	10,272,000	
ヤマハ	96,200	3,625.00	348,725,000	貸付有価証券 8,100株(5,100株)
河合楽器製作所	5,600	2,434.00	13,630,400	
クリナップ	16,700	818.00	13,660,600	
ピジョン	86,300	3,535.00	305,070,500	貸付有価証券 600株
兼松サステック	15,000	226.00	3,390,000	貸付有価証券 2,000株
キングジム	11,900	904.00	10,757,600	貸付有価証券 5,500株
リンテック	34,000	2,677.00	91,018,000	
T A S A K I	3,900	2,187.00	8,529,300	
イトーキ	30,100	792.00	23,839,200	貸付有価証券 900株(100株)
任天堂	88,000	29,500.00	2,596,000,000	
三菱鉛筆	11,800	6,650.00	78,470,000	貸付有価証券 3,000株(1,000株)
タカラスタンダード	29,500	1,904.00	56,168,000	
コクヨ	74,200	1,514.00	112,338,800	
ナカバヤシ	26,000	274.00	7,124,000	
グローブライド	6,900	1,986.00	13,703,400	
岡村製作所	49,800	1,009.00	50,248,200	

美津濃	77,000	601.00	46,277,000	
東京電力ホールディングス	1,211,500	460.00	557,290,000	貸付有価証券 75,800株
中部電力	470,600	1,475.50	694,370,300	
関西電力	582,800	1,546.00	901,008,800	
中国電力	197,500	1,223.00	241,542,500	貸付有価証券 15,800株
北陸電力	139,900	1,021.00	142,837,900	貸付有価証券 65,200株
東北電力	356,800	1,573.00	561,246,400	貸付有価証券 26,300株
四国電力	128,600	1,381.00	177,596,600	貸付有価証券 59,600株(4,300株)
九州電力	315,400	1,291.00	407,181,400	貸付有価証券 94,200株(41,400株)
北海道電力	133,700	825.00	110,302,500	貸付有価証券 1,700株
沖縄電力	21,000	2,916.00	61,236,000	
電源開発	113,600	2,776.00	315,353,600	貸付有価証券 8,600株
エフオン	7,000	934.00	6,538,000	貸付有価証券 100株(100株)
イーレックス	17,900	1,215.00	21,748,500	貸付有価証券 8,400株(300株)
東京瓦斯	1,532,000	551.50	844,898,000	
大阪瓦斯	1,386,000	422.90	586,139,400	
東邦瓦斯	358,000	815.00	291,770,000	
北海道瓦斯	36,000	273.00	9,828,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
広島ガス	29,400	362.00	10,642,800	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
西部瓦斯	161,000	265.00	42,665,000	
静岡ガス	43,900	773.00	33,934,700	
メタウォーター	8,000	2,994.00	23,952,000	貸付有価証券 3,800株
SBSホールディングス	14,100	843.00	11,886,300	貸付有価証券 100株
東武鉄道	763,000	570.00	434,910,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
相鉄ホールディングス	228,000	539.00	122,892,000	貸付有価証券

				1,000株
東京急行電鉄	776,000	823.00	638,648,000	
京浜急行電鉄	391,000	1,349.00	527,459,000	貸付有価証券 18,000株
小田急電鉄	228,800	2,155.00	493,064,000	貸付有価証券 31,100株
京王電鉄	399,000	891.00	355,509,000	貸付有価証券 2,000株
京成電鉄	107,000	2,732.00	292,324,000	
富士急行	39,000	1,047.00	40,833,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
新京成電鉄	18,000	419.00	7,542,000	
東日本旅客鉄道	276,300	10,255.00	2,833,456,500	貸付有価証券 17,100株(16,300株)
西日本旅客鉄道	137,500	7,560.00	1,039,500,000	貸付有価証券 7,900株
東海旅客鉄道	118,800	18,590.00	2,208,492,000	貸付有価証券 12,700株(2,600株)
西武ホールディングス	197,200	2,069.00	408,006,800	貸付有価証券 32,200株
鴻池運輸	20,200	1,592.00	32,158,400	
西日本鉄道	172,000	471.00	81,012,000	貸付有価証券 3,000株
ハマキョウレックス	9,300	2,578.00	23,975,400	
サカイ引越センター	6,600	3,830.00	25,278,000	貸付有価証券 200株
近鉄グループホールディングス	1,437,000	421.00	604,977,000	貸付有価証券 154,000株
阪急阪神ホールディングス	180,400	3,815.00	688,226,000	
南海電気鉄道	302,000	569.00	171,838,000	貸付有価証券 3,000株
京阪ホールディングス	320,000	724.00	231,680,000	貸付有価証券 61,000株
神戸電鉄	35,000	388.00	13,580,000	
名古屋鉄道	520,000	523.00	271,960,000	貸付有価証券 203,000株(23,000株)
山陽電気鉄道	52,000	578.00	30,056,000	
日本通運	531,000	658.00	349,398,000	
ヤマトホールディングス	255,400	2,421.00	618,323,400	貸付有価証券

				6,700株
山九	188,000	696.00	130,848,000	貸付有価証券 1,000株
丸運	7,700	262.00	2,017,400	
丸全昭和運輸	48,000	460.00	22,080,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
センコーグループホールディングス	67,800	751.00	50,917,800	貸付有価証券 900株
トナミホールディングス	29,000	393.00	11,397,000	
ニッコンホールディングス	48,400	2,446.00	118,386,400	
日本石油輸送	1,600	2,693.00	4,308,800	
福山通運	87,000	704.00	61,248,000	貸付有価証券 40,000株
セイノーホールディングス	101,300	1,353.00	137,058,900	貸付有価証券 1,600株
神奈川中央交通	17,000	722.00	12,274,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日立物流	29,700	2,511.00	74,576,700	
丸和運輸機関	3,600	2,979.00	10,724,400	貸付有価証券 1,600株
C & F ロジホールディングス	14,800	1,472.00	21,785,600	
九州旅客鉄道	141,900	3,690.00	523,611,000	
日本郵船	1,207,000	216.00	260,712,000	貸付有価証券 138,000株
商船三井	749,000	330.00	247,170,000	貸付有価証券 171,000株
川崎汽船	542,000	287.00	155,554,000	貸付有価証券 249,000株(4,000株)
N S ユナイテッド海運	64,000	245.00	15,680,000	
明治海運	12,800	448.00	5,734,400	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
飯野海運	73,900	470.00	34,733,000	
共栄タンカー	12,000	236.00	2,832,000	
乾汽船	10,400	957.00	9,952,800	貸付有価証券 1,800株
日本航空	251,000	3,419.00	858,169,000	
A N A ホールディングス	2,651,000	342.60	908,232,600	
パスコ	13,000	370.00	4,810,000	貸付有価証券 6,000株

トランコム	4,100	5,540.00	22,714,000	
日新	58,000	433.00	25,114,000	
三菱倉庫	94,000	1,442.00	135,548,000	貸付有価証券 1,000株
三井倉庫ホールディングス	83,000	326.00	27,058,000	貸付有価証券 10,000株(9,000株)
住友倉庫	104,000	704.00	73,216,000	貸付有価証券 1,000株
澁澤倉庫	37,000	359.00	13,283,000	
東陽倉庫	24,400	306.00	7,466,400	
日本トランスシティ	33,000	491.00	16,203,000	
ケイヒン	26,000	163.00	4,238,000	
中央倉庫	8,200	1,098.00	9,003,600	
安田倉庫	11,100	747.00	8,291,700	
東洋埠頭	41,000	180.00	7,380,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	11,600	425.00	4,930,000	
上組	170,000	1,053.00	179,010,000	
サンリツ	3,500	524.00	1,834,000	
キムラユニティー	3,600	1,167.00	4,201,200	
キューソー流通システム	4,500	2,673.00	12,028,500	
郵船ロジスティクス	13,100	1,127.00	14,763,700	
近鉄エクスプレス	25,500	1,821.00	46,435,500	貸付有価証券 1,600株(1,400株)
東海運	7,700	466.00	3,588,200	貸付有価証券 3,600株(2,500株)
エーアイティー	8,800	1,038.00	9,134,400	
内外トランスライン	4,300	1,177.00	5,061,100	
NEC ネットエスアイ	15,500	2,403.00	37,246,500	貸付有価証券 200株
システナ	11,200	2,169.00	24,292,800	
デジタルアーツ	6,300	3,435.00	21,640,500	貸付有価証券 2,900株(2,600株)
新日鉄住金ソリューションズ	23,500	2,553.00	59,995,500	
キューブシステム	8,100	767.00	6,212,700	貸付有価証券 100株
コア	5,900	1,317.00	7,770,300	貸付有価証券 1,000株

ソフトクリエイティブホールディングス	6,700	1,387.00	9,292,900	貸付有価証券 2,000株（1,900株）
T I S	46,700	3,015.00	140,800,500	
ネオス	4,200	451.00	1,894,200	貸付有価証券 1,900株（800株）
電算システム	4,900	1,707.00	8,364,300	貸付有価証券 300株
グリー	85,800	874.00	74,989,200	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
コーエーテクモホールディングス	33,400	2,217.00	74,047,800	貸付有価証券 1,800株（100株）
三菱総合研究所	6,000	3,200.00	19,200,000	
ボルテージ	2,500	1,382.00	3,455,000	貸付有価証券 1,100株
電算	1,600	2,245.00	3,592,000	貸付有価証券 200株
A G S	3,500	1,994.00	6,979,000	貸付有価証券 1,600株
ファインデックス	10,400	1,031.00	10,722,400	貸付有価証券 4,800株（2,800株）
ヒト・コミュニケーションズ	3,200	1,767.00	5,654,400	貸付有価証券 1,000株（200株）
ブレインパッド	3,000	1,113.00	3,339,000	
K L a b	26,900	918.00	24,694,200	貸付有価証券 12,600株（500株）
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	10,100	1,450.00	14,645,000	
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	1,258.00	2,767,600	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ネクソン	154,900	2,085.00	322,966,500	
アイスタイル	29,700	1,044.00	31,006,800	貸付有価証券 13,900株（1,200株）
エムアップ	4,000	856.00	3,424,000	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
エイチーム	9,500	2,994.00	28,443,000	貸付有価証券 3,600株（700株）
テクノスジャパン	10,900	1,033.00	11,259,700	貸付有価証券 5,100株（1,000株）
e n i s h	4,200	969.00	4,069,800	貸付有価証券 2,000株
コロプラ	45,200	1,087.00	49,132,400	貸付有価証券 18,700株

モバイルクリエイト	10,300	369.00	3,800,700	貸付有価証券 4,800株(1,000株)
オルトプラス	5,500	903.00	4,966,500	貸付有価証券 100株(100株)
ブロードリーフ	34,700	748.00	25,955,600	
ハーツユニテッドグループ	7,400	1,491.00	11,033,400	貸付有価証券 3,500株(1,900株)
メディアドゥ	4,000	2,542.00	10,168,000	貸付有価証券 1,400株
ブイキューブ	7,700	589.00	4,535,300	貸付有価証券 3,600株(400株)
サイバーリンクス	2,100	1,075.00	2,257,500	
ディー・エル・イー	6,300	586.00	3,691,800	貸付有価証券 2,200株(200株)
フィックスターズ	2,400	3,100.00	7,440,000	貸付有価証券 900株
VOYAGE GROUP	7,000	2,360.00	16,520,000	貸付有価証券 3,200株(2,200株)
オブティム	3,000	2,957.00	8,871,000	貸付有価証券 1,400株
セレス	3,300	1,549.00	5,111,700	貸付有価証券 1,100株
ベリサーブ	1,600	3,255.00	5,208,000	貸付有価証券 700株(400株)
ティーガイア	14,000	1,990.00	27,860,000	
日本アジアグループ	15,900	435.00	6,916,500	貸付有価証券 200株
豆蔵ホールディングス	10,300	911.00	9,383,300	貸付有価証券 300株
テクマトリックス	8,800	1,524.00	13,411,200	貸付有価証券 4,100株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	295,500	276.00	81,558,000	貸付有価証券 136,600株
GMOペイメントゲートウェイ	9,900	5,850.00	57,915,000	貸付有価証券 4,000株
ザッパラス	7,300	497.00	3,628,100	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
システムリサーチ	1,400	2,088.00	2,923,200	貸付有価証券 600株(600株)
インターネットイニシアティブ	20,700	2,120.00	43,884,000	貸付有価証券 1,400株
さくらインターネット	11,400	883.00	10,066,200	貸付有価証券

				4,600株(2,000株)
GMOクラウド	3,100	2,577.00	7,988,700	貸付有価証券 600株
SRAホールディングス	7,400	3,125.00	23,125,000	
Minorityソリューションズ	3,100	1,368.00	4,240,800	
システムインテグレータ	2,000	745.00	1,490,000	貸付有価証券 300株(100株)
朝日ネット	12,800	517.00	6,617,600	
アドソル日進	3,700	1,235.00	4,569,500	貸付有価証券 1,200株
フリービット	10,400	940.00	9,776,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
コムチュア	2,400	4,120.00	9,888,000	貸付有価証券 1,100株
サイバーコム	2,500	993.00	2,482,500	貸付有価証券 1,100株
メディカル・データ・ビジョン	6,200	1,935.00	11,997,000	貸付有価証券 2,900株(1,800株)
gumi	16,000	1,154.00	18,464,000	貸付有価証券 7,800株(1,100株)
ショーケース・ティービー	2,100	1,336.00	2,805,600	貸付有価証券 700株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,100	1,948.00	4,090,800	貸付有価証券 500株
PCIホールディングス	2,300	2,670.00	6,141,000	貸付有価証券 700株
パイプドHD	2,500	1,071.00	2,677,500	貸付有価証券 400株
アイピーシー	1,500	941.00	1,411,500	貸付有価証券 500株
オープンドア	1,800	3,130.00	5,634,000	貸付有価証券 800株
LINE	31,600	3,795.00	119,922,000	貸付有価証券 11,100株(4,800株)
オークネット	4,400	1,266.00	5,570,400	
AOI TYO Holdings	11,500	833.00	9,579,500	
マクロミル	18,100	1,975.00	35,747,500	
ソルクシーズ	5,400	576.00	3,110,400	
フェイス	3,700	1,216.00	4,499,200	貸付有価証券

				1,700株
ハイマックス	1,900	1,533.00	2,912,700	
野村総合研究所	105,400	4,155.00	437,937,000	貸付有価証券 100株(100株)
サイバネットシステム	11,500	738.00	8,487,000	貸付有価証券 5,400株(1,100株)
C Eホールディングス	2,000	1,095.00	2,190,000	貸付有価証券 800株
インテージホールディングス	8,000	2,203.00	17,624,000	
東邦システムサイエンス	4,600	683.00	3,141,800	
ソースネクスト	8,400	565.00	4,746,000	貸付有価証券 3,600株(2,600株)
フォーカスシステムズ	7,200	553.00	3,981,600	
クレスコ	3,200	3,420.00	10,944,000	
フジ・メディア・ホールディングス	146,800	1,645.00	241,486,000	貸付有価証券 68,800株
オービック	48,600	6,260.00	304,236,000	貸付有価証券 100株
ジャストシステム	22,800	1,387.00	31,623,600	
T D C ソフトウェアエンジニアリング	6,100	1,264.00	7,710,400	
ヤフー	1,010,300	477.00	481,913,100	貸付有価証券 475,600株
トレンドマイクロ	74,700	5,330.00	398,151,000	
インフォメーション・ディベロプメント	4,000	1,254.00	5,016,000	貸付有価証券 1,800株
日本オラクル	22,600	6,780.00	153,228,000	
アルファシステムズ	4,600	2,018.00	9,282,800	
フューチャー	19,000	872.00	16,568,000	
C A C H o l d i n g s	10,500	1,105.00	11,602,500	
ソフトバンク・テクノロジー	3,400	4,050.00	13,770,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
トーセ	3,800	862.00	3,275,600	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルタント	7,200	5,640.00	40,608,000	貸付有価証券 3,000株
伊藤忠テクノソリューションズ	31,900	3,605.00	114,999,500	
アイティフォー	18,300	582.00	10,650,600	

東計電算	2,500	2,413.00	6,032,500	
エックスネット	2,600	932.00	2,423,200	
大塚商会	37,900	6,600.00	250,140,000	
サイボウズ	18,700	458.00	8,564,600	貸付有価証券 300株
ソフトブレーン	19,200	526.00	10,099,200	貸付有価証券 1,500株
電通国際情報サービス	8,700	2,441.00	21,236,700	
デジタルガレージ	27,300	2,510.00	68,523,000	貸付有価証券 900株
E Mシステムズ	4,800	1,926.00	9,244,800	貸付有価証券 800株
ウェザーニューズ	4,700	3,940.00	18,518,000	貸付有価証券 2,200株(200株)
C I J	11,800	569.00	6,714,200	
東洋ビジネスエンジニア リング	1,400	1,690.00	2,366,000	
日本エンタープライズ	14,400	265.00	3,816,000	貸付有価証券 700株
WOWOW	6,700	3,815.00	25,560,500	貸付有価証券 1,000株(400株)
スカラ	9,700	872.00	8,458,400	貸付有価証券 4,500株
日本コロムビア	4,200	707.00	2,969,400	貸付有価証券 1,500株
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,800	783.00	9,239,400	貸付有価証券 2,100株
ネットワンシステムズ	61,000	979.00	59,719,000	
システムソフト	33,200	141.00	4,681,200	貸付有価証券 12,600株
アルゴグラフィックス	6,400	2,572.00	16,460,800	
マーベラス	23,800	948.00	22,562,400	貸付有価証券 6,700株(800株)
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	25,900	1,708.00	44,237,200	
日本ユニシス	38,900	1,744.00	67,841,600	
兼松エレクトロニクス	8,900	3,435.00	30,571,500	
東京放送ホールディング ス	92,900	2,000.00	185,800,000	貸付有価証券 11,300株
日本テレビホールディン グス	128,700	1,930.00	248,391,000	

朝日放送	13,900	794.00	11,036,600	
テレビ朝日ホールディングス	38,500	2,056.00	79,156,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	91,700	521.00	47,775,700	貸付有価証券 7,500株(4,700株)
テレビ東京ホールディングス	11,500	2,570.00	29,555,000	貸付有価証券 2,600株(100株)
日本BS放送	4,700	1,157.00	5,437,900	貸付有価証券 1,000株(700株)
ビジョン	2,200	4,230.00	9,306,000	貸付有価証券 700株(100株)
U-NEXT	3,600	1,048.00	3,772,800	貸付有価証券 1,600株
ワイヤレスゲート	6,500	1,484.00	9,646,000	貸付有価証券 2,300株
コネクシオ	12,400	1,841.00	22,828,400	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
日本通信	117,900	183.00	21,575,700	貸付有価証券 55,500株
クロップス	3,000	609.00	1,827,000	
日本電信電話	1,131,500	5,050.00	5,714,075,000	
KDDI	1,394,500	3,036.00	4,233,702,000	貸付有価証券 78,900株
光通信	16,900	10,880.00	183,872,000	
NTTドコモ	1,037,600	2,730.00	2,832,648,000	
エムティーアイ	18,900	632.00	11,944,800	貸付有価証券 4,900株(1,300株)
GMOインターネット	51,400	1,453.00	74,684,200	貸付有価証券 24,200株(2,300株)
アイドママーケティングコミュニケーション	1,800	722.00	1,299,600	
カドカワ	40,900	1,600.00	65,440,000	
学研ホールディングス	4,700	3,140.00	14,758,000	
ゼンリン	18,600	2,550.00	47,430,000	貸付有価証券 200株
昭文社	8,100	741.00	6,002,100	貸付有価証券 300株
インプレスホールディングス	11,600	138.00	1,600,800	貸付有価証券 100株(100株)
アイネット	7,900	1,304.00	10,301,600	
松竹	93,000	1,330.00	123,690,000	

東宝	92,200	3,270.00	301,494,000	
東映	52,000	1,002.00	52,104,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	87,100	5,620.00	489,502,000	
ピー・シー・エー	2,000	1,602.00	3,204,000	
ビジネスブレイン太田昭 和	2,400	1,056.00	2,534,400	
D T S	14,500	3,060.00	44,370,000	貸付有価証券 300株
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	54,300	3,510.00	190,593,000	
シーイーシー	8,300	2,232.00	18,525,600	
カプコン	33,000	2,536.00	83,688,000	貸付有価証券 13,000株(5,100株)
アイ・エス・ピー	2,700	1,421.00	3,836,700	
ジャステック	8,900	1,220.00	10,858,000	
S C S K	38,300	4,850.00	185,755,000	
日本システムウエア	4,600	1,659.00	7,631,400	貸付有価証券 1,800株(500株)
アイネス	17,800	1,113.00	19,811,400	貸付有価証券 100株
T K C	13,000	3,160.00	41,080,000	
富士ソフト	20,900	3,075.00	64,267,500	
N S D	29,900	1,838.00	54,956,200	
コナミホールディングス	63,600	4,960.00	315,456,000	貸付有価証券 100株
福井コンピュータホール ディングス	4,100	3,015.00	12,361,500	貸付有価証券 800株
J B C Cホールディング ス	11,800	847.00	9,994,600	
ミロク情報サービス	13,900	2,200.00	30,580,000	
ソフトバンクグループ	634,500	8,700.00	5,520,150,000	
ハウスイ	11,000	123.00	1,353,000	
高千穂交易	5,400	1,029.00	5,556,600	
伊藤忠食品	3,500	4,780.00	16,730,000	
エレマテック	5,600	1,900.00	10,640,000	
J A L U X	4,500	2,641.00	11,884,500	貸付有価証券 1,600株(900株)
あらた	6,400	3,355.00	21,472,000	貸付有価証券 2,900株(1,400株)

トーメンデバイス	2,100	2,225.00	4,672,500	
東京エレクトロン デバイス	5,100	1,668.00	8,506,800	
フィールズ	10,800	1,251.00	13,510,800	貸付有価証券 4,200株
双日	832,500	291.00	242,257,500	
アルフレッサ ホールディングス	166,700	2,164.00	360,738,800	
横浜冷凍	33,100	1,137.00	37,634,700	貸付有価証券 15,300株（12,100株）
神栄	19,000	182.00	3,458,000	貸付有価証券 8,000株
山下医科器械	1,100	1,799.00	1,978,900	貸付有価証券 500株（100株）
ラサ商事	6,000	797.00	4,782,000	貸付有価証券 200株
ラクーン	8,900	527.00	4,690,300	貸付有価証券 3,100株
アルコニックス	8,000	1,996.00	15,968,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
神戸物産	7,600	4,300.00	32,680,000	
あい ホールディングス	20,100	2,908.00	58,450,800	貸付有価証券 9,400株（2,300株）
ディービーエックス	5,000	1,431.00	7,155,000	
ダイワボウホールディングス	120,000	394.00	47,280,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	26,100	1,784.00	46,562,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,500	1,019.00	27,003,500	貸付有価証券 8,800株（8,800株）
八洲電機	10,900	667.00	7,270,300	
メディアスホールディングス	2,200	2,773.00	6,100,600	
U K C ホールディングス	9,100	2,268.00	20,638,800	
O C H I ホールディングス	4,100	1,376.00	5,641,600	
T O K A I ホールディングス	61,900	818.00	50,634,200	貸付有価証券 13,100株
大阪工機	2,100	760.00	1,596,000	
三洋貿易	7,700	2,102.00	16,185,400	
ビューティガレージ	1,900	1,605.00	3,049,500	

ウイン・パートナーズ	10,100	1,020.00	10,302,000	
ミタチ産業	3,300	686.00	2,263,800	
シップヘルスケアホールディングス	27,100	3,070.00	83,197,000	
明治電機工業	4,800	1,295.00	6,216,000	貸付有価証券 400株
デリカフーズ	3,000	1,170.00	3,510,000	貸付有価証券 600株
スターティア	3,200	528.00	1,689,600	貸付有価証券 200株（200株）
コメダホールディングス	25,500	1,884.00	48,042,000	貸付有価証券 8,100株
富士興産	5,000	503.00	2,515,000	
協栄産業	17,000	170.00	2,890,000	
小野建	12,200	1,560.00	19,032,000	貸付有価証券 600株
佐鳥電機	10,300	834.00	8,590,200	
エコトレーディング	3,200	712.00	2,278,400	
伯東	9,600	1,382.00	13,267,200	
コンドーテック	11,200	940.00	10,528,000	
中山福	8,100	857.00	6,941,700	貸付有価証券 100株
ナガイレーベン	18,700	2,608.00	48,769,600	
三菱食品	15,500	3,465.00	53,707,500	貸付有価証券 200株
松田産業	10,300	1,507.00	15,522,100	
第一興商	22,900	4,975.00	113,927,500	
メディカルホールディングス	141,000	1,941.00	273,681,000	
S P K	3,000	2,673.00	8,019,000	
萩原電気	4,800	2,339.00	11,227,200	
アズワン	11,000	5,310.00	58,410,000	
スズデン	5,000	1,143.00	5,715,000	
尾家産業	4,500	1,204.00	5,418,000	
シモジマ	8,600	1,198.00	10,302,800	
ドウシシャ	16,600	2,189.00	36,337,400	貸付有価証券 1,900株
小津産業	3,100	2,300.00	7,130,000	貸付有価証券 1,400株

高速	8,400	1,122.00	9,424,800	
たけびし	4,900	1,508.00	7,389,200	
黒田電気	19,200	2,342.00	44,966,400	
リックス	3,200	1,716.00	5,491,200	
丸文	12,400	751.00	9,312,400	
ハピネット	11,700	1,916.00	22,417,200	
橋本総業ホールディングス	2,900	1,584.00	4,593,600	
日本ライフライン	16,000	2,890.00	46,240,000	貸付有価証券 5,600株
エクセル	6,000	1,518.00	9,108,000	貸付有価証券 2,200株
マルカキカイ	4,500	1,892.00	8,514,000	
I D O M	37,900	605.00	22,929,500	貸付有価証券 17,800株（14,000株）
日本エム・ディ・エム	10,600	866.00	9,179,600	貸付有価証券 200株
進和	8,300	1,987.00	16,492,100	
エスケイジャパン	2,600	293.00	761,800	
ダイトロン	6,400	1,250.00	8,000,000	
シークス	10,100	4,620.00	46,662,000	貸付有価証券 4,700株（500株）
田中商事	4,300	705.00	3,031,500	
オーハシテクニカ	7,900	1,435.00	11,336,500	
白銅	3,500	1,704.00	5,964,000	
伊藤忠商事	1,032,400	1,674.50	1,728,753,800	
丸紅	1,387,200	723.70	1,003,916,640	
高島	24,000	204.00	4,896,000	
長瀬産業	84,700	1,614.00	136,705,800	
蝶理	9,000	2,085.00	18,765,000	
豊田通商	157,000	3,665.00	575,405,000	
三共生興	21,300	395.00	8,413,500	
兼松	300,000	231.00	69,300,000	
ツカモトコーポレーション	25,000	121.00	3,025,000	
三井物産	1,274,700	1,569.50	2,000,641,650	
日本紙パルプ商事	73,000	405.00	29,565,000	
日立ハイテクノロジーズ	48,900	4,570.00	223,473,000	

カメイ	18,300	1,272.00	23,277,600	
東都水産	2,100	1,920.00	4,032,000	
OUGホールディングス	22,000	266.00	5,852,000	
スターゼン	5,900	4,780.00	28,202,000	
山善	54,100	1,112.00	60,159,200	
椿本興業	16,000	452.00	7,232,000	
住友商事	887,300	1,554.00	1,378,864,200	
内田洋行	6,500	2,637.00	17,140,500	
三菱商事	1,057,700	2,364.00	2,500,402,800	
第一実業	32,000	733.00	23,456,000	
キャノンマーケティング ジャパン	40,200	2,422.00	97,364,400	
西華産業	44,000	367.00	16,148,000	
佐藤商事	12,600	896.00	11,289,600	
菱洋エレクトロ	13,100	1,729.00	22,649,900	
東京産業	14,000	468.00	6,552,000	貸付有価証券 1,500株
ユアサ商事	13,300	3,310.00	44,023,000	
神鋼商事	3,500	2,640.00	9,240,000	
小林産業	10,200	291.00	2,968,200	貸付有価証券 1,100株(800株)
阪和興業	141,000	819.00	115,479,000	
カナデン	13,400	1,133.00	15,182,200	
菱電商事	22,000	750.00	16,500,000	
フルサト工業	7,800	1,686.00	13,150,800	
岩谷産業	156,000	676.00	105,456,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
すてきナイスグループ	60,000	160.00	9,600,000	
昭光通商	50,000	97.00	4,850,000	貸付有価証券 22,000株
ニチモウ	20,000	185.00	3,700,000	貸付有価証券 5,000株
極東貿易	22,000	252.00	5,544,000	
イワキ	21,000	328.00	6,888,000	
三愛石油	37,800	991.00	37,459,800	
稲畑産業	33,800	1,456.00	49,212,800	
G S Iクレオス	34,000	149.00	5,066,000	
明和産業	13,000	425.00	5,525,000	

ワキタ	30,000	1,275.00	38,250,000	
東邦ホールディングス	45,100	2,516.00	113,471,600	貸付有価証券 18,600株（17,800株）
サンゲツ	48,300	2,007.00	96,938,100	
ミツウロコグループホールディングス	22,700	718.00	16,298,600	
シナネンホールディングス	6,000	2,257.00	13,542,000	
伊藤忠エネクス	31,100	955.00	29,700,500	貸付有価証券 200株
サンリオ	43,400	2,117.00	91,877,800	貸付有価証券 20,200株（7,400株）
サンワテクノス	8,300	1,365.00	11,329,500	
リョーサン	21,000	3,800.00	79,800,000	
新光商事	15,400	1,348.00	20,759,200	
トーヨー	6,300	2,877.00	18,125,100	
三信電気	15,600	1,430.00	22,308,000	貸付有価証券 400株
東陽テクニカ	16,200	1,095.00	17,739,000	貸付有価証券 3,100株
モスフードサービス	18,500	3,550.00	65,675,000	貸付有価証券 100株（100株）
加賀電子	12,700	2,075.00	26,352,500	
ソーダニッカ	14,500	545.00	7,902,500	
立花エレテック	9,500	1,458.00	13,851,000	
フォーバル	6,100	652.00	3,977,200	
PALTA C	22,500	3,430.00	77,175,000	
三谷産業	14,900	399.00	5,945,100	貸付有価証券 3,500株
太平洋興発	59,000	101.00	5,959,000	貸付有価証券 27,000株
ヤマタネ	7,000	1,584.00	11,088,000	
丸紅建材リース	14,000	233.00	3,262,000	
日鉄住金物産	12,400	4,770.00	59,148,000	貸付有価証券 100株
トラスコ中山	32,200	2,531.00	81,498,200	貸付有価証券 14,900株
オートバックスセブン	52,200	1,763.00	92,028,600	貸付有価証券 700株
モリト	11,300	934.00	10,554,200	貸付有価証券

				4,500株
加藤産業	22,000	2,819.00	62,018,000	
イノテック	12,100	662.00	8,010,200	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	13,300	2,650.00	35,245,000	
J Kホールディングス	14,100	683.00	9,630,300	
日伝	5,800	3,585.00	20,793,000	
北沢産業	11,600	218.00	2,528,800	
杉本商事	8,100	1,553.00	12,579,300	
因幡電機産業	19,800	4,210.00	83,358,000	
バイテックホールディングス	5,700	1,319.00	7,518,300	貸付有価証券 1,600株
ミスミグループ本社	158,900	2,240.00	355,936,000	貸付有価証券 600株
アルテック	12,000	216.00	2,592,000	貸付有価証券 5,600株
タキヒヨー	21,000	463.00	9,723,000	
蔵王産業	2,300	1,495.00	3,438,500	
スズケン	64,200	3,920.00	251,664,000	
ジェコス	9,700	1,182.00	11,465,400	
ルネサスイーストン	12,900	607.00	7,830,300	貸付有価証券 200株(200株)
ローソン	44,500	7,550.00	335,975,000	貸付有価証券 5,300株
サンエー	10,600	5,160.00	54,696,000	
カワチ薬品	10,900	2,861.00	31,184,900	
エービーシー・マート	25,600	6,510.00	166,656,000	貸付有価証券 5,000株
ハードオフコーポレーション	6,200	1,061.00	6,578,200	
アスクル	14,700	3,375.00	49,612,500	貸付有価証券 6,900株(500株)
ゲオホールディングス	23,600	1,251.00	29,523,600	貸付有価証券 11,000株(1,300株)
アダストリア	21,600	3,055.00	65,988,000	
ジーフット	8,500	772.00	6,562,000	
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	1,800	693.00	1,247,400	
くらコーポレーション	9,200	4,655.00	42,826,000	貸付有価証券 900株

キャンドウ	7,400	1,707.00	12,631,800	貸付有価証券 2,100株(1,700株)
パルグループホールディングス	7,200	2,980.00	21,456,000	
エディオン	54,600	1,032.00	56,347,200	貸付有価証券 25,400株(14,600株)
サーラコーポレーション	17,600	656.00	11,545,600	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ワッツ	5,600	1,235.00	6,916,000	貸付有価証券 1,300株
ハローズ	4,600	2,340.00	10,764,000	貸付有価証券 2,100株
あみやき亭	2,700	4,180.00	11,286,000	
ひらまつ	19,400	662.00	12,842,800	貸付有価証券 7,400株(600株)
ゲンキー	5,600	2,956.00	16,553,600	貸付有価証券 2,600株
大黒天物産	3,400	5,590.00	19,006,000	貸付有価証券 1,500株
ハニーズホールディングス	13,600	1,188.00	16,156,800	貸付有価証券 6,300株
ファーマライズホールディングス	3,200	533.00	1,705,600	貸付有価証券 100株(100株)
アルペン	10,800	2,082.00	22,485,600	貸付有価証券 1,900株(1,700株)
クオール	15,900	1,555.00	24,724,500	
ジンズ	9,600	6,370.00	61,152,000	貸付有価証券 4,500株
ビックカメラ	80,900	1,146.00	92,711,400	貸付有価証券 4,800株(1,200株)
DCMホールディングス	85,500	995.00	85,072,500	貸付有価証券 23,500株(13,600株)
Monotaro	50,000	3,680.00	184,000,000	貸付有価証券 23,500株
東京一番フーズ	3,500	567.00	1,984,500	貸付有価証券 1,600株(800株)
ダイヤモンドダイニング	3,100	2,187.00	6,779,700	貸付有価証券 1,400株
きちり	3,700	665.00	2,460,500	貸付有価証券 1,700株(1,200株)
アークランドサービスホールディングス	5,900	3,470.00	20,473,000	貸付有価証券 2,000株

J・フロント リテイリング	178,300	1,655.00	295,086,500	貸付有価証券 900株
ドトール・日レスホールディングス	24,700	2,434.00	60,119,800	
マツモトキヨシホールディングス	26,700	5,720.00	152,724,000	
ブロンコピリー	7,400	2,618.00	19,373,200	貸付有価証券 3,400株（300株）
スタートトゥデイ	128,700	2,743.00	353,024,100	
トレジャー・ファクトリー	4,000	791.00	3,164,000	貸付有価証券 1,800株
物語コーポレーション	4,000	5,130.00	20,520,000	貸付有価証券 600株（600株）
ココカラファイン	14,700	5,430.00	79,821,000	
三越伊勢丹ホールディングス	280,400	1,158.00	324,703,200	貸付有価証券 1,900株
H a m e e	4,200	1,094.00	4,594,800	貸付有価証券 1,400株（100株）
ウエルシアホールディングス	37,200	3,670.00	136,524,000	
クリエイトSDホールディングス	20,700	2,707.00	56,034,900	貸付有価証券 9,700株
丸善CHIホールディングス	16,400	352.00	5,772,800	貸付有価証券 300株
ミサワ	2,500	439.00	1,097,500	貸付有価証券 1,000株
ティーライフ	1,900	1,770.00	3,363,000	
エー・ピーカンパニー	2,300	970.00	2,231,000	貸付有価証券 1,000株
チムニー	4,300	2,817.00	12,113,100	
シュッピン	5,300	1,969.00	10,435,700	貸付有価証券 2,400株（100株）
ネクステージ	5,500	1,461.00	8,035,500	貸付有価証券 2,500株
ジョイフル本田	22,900	3,810.00	87,249,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
鳥貴族	5,200	2,550.00	13,260,000	貸付有価証券 1,600株（800株）
麒麟堂ホールディングス	4,500	864.00	3,888,000	貸付有価証券 800株
ホットランド	6,500	1,198.00	7,787,000	貸付有価証券 3,000株（1,600株）

すかいらーく	60,500	1,783.00	107,871,500	貸付有価証券 900株
綿半ホールディングス	5,700	1,852.00	10,556,400	貸付有価証券 1,700株
ヨシックス	1,800	1,356.00	2,440,800	
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	46,700	1,108.00	51,743,600	
ブックオフコーポレー ション	8,000	808.00	6,464,000	貸付有価証券 3,700株(800株)
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	5,700	835.00	4,759,500	貸付有価証券 2,500株
B E E N O S	2,200	1,434.00	3,154,800	貸付有価証券 1,000株
あさひ	10,500	1,377.00	14,458,500	
日本調剤	5,000	4,090.00	20,450,000	貸付有価証券 2,100株
コスモス薬品	7,100	23,470.00	166,637,000	貸付有価証券 3,300株(400株)
トーエル	6,800	909.00	6,181,200	貸付有価証券 2,300株
一六堂	3,000	391.00	1,173,000	
オンリー	2,100	897.00	1,883,700	
セブン & アイ・ホール ディングス	590,000	4,845.00	2,858,550,000	貸付有価証券 17,800株(17,800株)
薬王堂	7,000	3,210.00	22,470,000	貸付有価証券 1,100株
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	37,800	940.00	35,532,000	貸付有価証券 17,700株
ツルハホールディングス	28,200	11,670.00	329,094,000	貸付有価証券 13,200株
サンマルクホールディン グス	9,100	3,445.00	31,349,500	
フェリシモ	4,000	1,065.00	4,260,000	
トリドールホールディン グス	17,300	2,782.00	48,128,600	
T O K Y O B A S E	1,800	3,315.00	5,967,000	貸付有価証券 800株
サツドラホールディン グス	1,900	2,195.00	4,170,500	貸付有価証券 800株
ダイユー・リックホール ディングス	4,500	769.00	3,460,500	
パロックジャパンリミ	11,100	1,223.00	13,575,300	

テッド				貸付有価証券 5,200株(600株)
クスリのアオキホールディングス	11,200	4,980.00	55,776,000	貸付有価証券 5,200株
スシローグローバルホールディングス	12,800	3,490.00	44,672,000	貸付有価証券 1,300株
メディカルシステムネットワーク	15,900	501.00	7,965,900	貸付有価証券 7,300株
総合メディカル	6,800	4,830.00	32,844,000	
はるやまホールディングス	6,600	996.00	6,573,600	
ノジマ	22,000	1,547.00	34,034,000	
カップ・クリエイト	19,700	1,304.00	25,688,800	貸付有価証券 7,600株(1,800株)
ライトオン	11,800	999.00	11,788,200	貸付有価証券 4,900株
ジーンズメイト	4,500	260.00	1,170,000	貸付有価証券 1,300株
良品計画	18,700	26,600.00	497,420,000	貸付有価証券 8,700株
三城ホールディングス	17,400	479.00	8,334,600	貸付有価証券 100株(100株)
アドヴァン	14,300	1,176.00	16,816,800	
アルピス	3,700	4,160.00	15,392,000	
コナカ	18,000	604.00	10,872,000	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,573.00	2,674,100	貸付有価証券 100株(100株)
G-7ホールディングス	4,100	2,342.00	9,602,200	
イオン北海道	14,100	603.00	8,502,300	貸付有価証券 600株
コジマ	24,200	304.00	7,356,800	貸付有価証券 900株
ヒマラヤ	3,800	832.00	3,161,600	貸付有価証券 300株
コーナン商事	20,000	2,281.00	45,620,000	貸付有価証券 8,800株
エコス	5,500	1,199.00	6,594,500	貸付有価証券 200株(100株)
ワタミ	16,600	1,363.00	22,625,800	貸付有価証券 5,600株(5,400株)
マルシェ	3,100	828.00	2,566,800	貸付有価証券

				1,200株(100株)
ドンキホーテホールディングス	91,200	4,185.00	381,672,000	貸付有価証券 1,600株
西松屋チェーン	24,700	1,207.00	29,812,900	
ゼンショーホールディングス	73,000	1,923.00	140,379,000	
幸楽苑ホールディングス	8,900	1,813.00	16,135,700	貸付有価証券 1,900株(1,800株)
ハークスレイ	3,400	1,177.00	4,001,800	
サイゼリヤ	20,900	3,200.00	66,880,000	貸付有価証券 100株
V Tホールディングス	47,600	587.00	27,941,200	貸付有価証券 3,300株
魚力	4,400	1,269.00	5,583,600	
ポブラ	3,500	537.00	1,879,500	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
フジ・コーポレーション	2,100	2,004.00	4,208,400	貸付有価証券 900株
ユナイテッドアローズ	18,800	3,520.00	66,176,000	貸付有価証券 5,100株(300株)
ハイデイ日高	15,400	2,447.00	37,683,800	
京都きもの友禅	8,900	937.00	8,339,300	貸付有価証券 3,300株
コロワイド	46,700	1,928.00	90,037,600	貸付有価証券 21,500株
ピーシーデポコーポレーション	18,700	584.00	10,920,800	貸付有価証券 8,800株
壱番屋	9,900	3,620.00	35,838,000	貸付有価証券 2,600株
トップカルチャー	5,100	482.00	2,458,200	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
P L A N T	3,200	1,221.00	3,907,200	貸付有価証券 800株
スギホールディングス	30,900	5,730.00	177,057,000	貸付有価証券 200株(200株)
ヴィア・ホールディングス	10,700	1,124.00	12,026,800	貸付有価証券 4,900株
スクロール	21,300	378.00	8,051,400	貸付有価証券 2,100株
ヨンドシーホールディングス	14,300	2,737.00	39,139,100	貸付有価証券 2,000株(1,800株)
ユニー・ファミリーマー	61,800	6,480.00	400,464,000	貸付有価証券

トホールディングス				11,000株(1,900株)
木曽路	17,200	2,634.00	45,304,800	
サトレストランシステムズ	16,600	874.00	14,508,400	貸付有価証券 7,100株
千趣会	25,500	821.00	20,935,500	貸付有価証券 200株(200株)
タカキュー	10,900	198.00	2,158,200	
ケーヨー	23,700	685.00	16,234,500	貸付有価証券 3,300株(100株)
上新電機	33,000	1,281.00	42,273,000	
日本瓦斯	25,800	3,260.00	84,108,000	貸付有価証券 5,700株(1,100株)
ベスト電器	45,400	166.00	7,536,400	
ロイヤルホールディングス	23,200	2,241.00	51,991,200	貸付有価証券 1,000株
東天紅	11,000	174.00	1,914,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
いなげや	15,700	1,799.00	28,244,300	
島忠	36,500	2,627.00	95,885,500	貸付有価証券 12,200株(7,700株)
チヨダ	16,600	2,897.00	48,090,200	
ライフコーポレーション	10,700	3,065.00	32,795,500	
リンガーハット	15,900	2,346.00	37,301,400	
さが美	13,000	121.00	1,573,000	貸付有価証券 6,000株
MrMax	17,600	484.00	8,518,400	
テンアライド	13,000	394.00	5,122,000	貸付有価証券 900株
AOKIホールディングス	28,100	1,397.00	39,255,700	
オークワ	20,000	1,243.00	24,860,000	
コメリ	21,700	2,907.00	63,081,900	貸付有価証券 2,400株
青山商事	29,500	3,990.00	117,705,000	
しまむら	16,400	15,820.00	259,448,000	
はせがわ	7,400	466.00	3,448,400	貸付有価証券 1,500株(1,000株)
高島屋	236,000	1,078.00	254,408,000	貸付有価証券 34,000株(6,000株)
松屋	30,700	1,029.00	31,590,300	貸付有価証券

				11,400株(300株)
エイチ・ツー・オー テイリング	72,200	1,986.00	143,389,200	
近鉄百貨店	54,000	358.00	19,332,000	貸付有価証券 14,000株
丸栄	29,000	127.00	3,683,000	貸付有価証券 7,000株
パルコ	13,500	1,201.00	16,213,500	貸付有価証券 100株
丸井グループ	148,300	1,549.00	229,716,700	貸付有価証券 1,400株
アクシアル リテイリ ング	10,900	4,365.00	47,578,500	
井筒屋	7,600	461.00	3,503,600	
イオン	580,000	1,697.00	984,260,000	貸付有価証券 224,900株(95,100 株)
イズミ	28,000	5,660.00	158,480,000	
東武ストア	1,700	2,964.00	5,038,800	
平和堂	28,600	2,510.00	71,786,000	
フジ	15,700	2,909.00	45,671,300	
ヤオコー	16,000	4,475.00	71,600,000	貸付有価証券 7,000株
ゼビオホールディングス	19,100	1,922.00	36,710,200	
ケーズホールディングス	59,600	2,320.00	138,272,000	貸付有価証券 28,000株(23,200株)
O l y m p i cグループ	8,300	574.00	4,764,200	
日産東京販売ホールディ ングス	20,700	483.00	9,998,100	
アインホールディングス	18,400	8,200.00	150,880,000	貸付有価証券 5,500株(200株)
元気寿司	3,500	2,227.00	7,794,500	
ヤマダ電機	471,400	596.00	280,954,400	貸付有価証券 187,000株(156,700 株)
アークランドサカモト	23,900	1,493.00	35,682,700	
ニトリホールディングス	60,900	15,010.00	914,109,000	
グルメ杵屋	10,000	1,084.00	10,840,000	
愛眼	10,300	198.00	2,039,400	貸付有価証券 4,500株(3,500株)
ケヨーホールディング	7,300	1,003.00	7,321,900	貸付有価証券

ス				100株
吉野家ホールディングス	49,100	1,854.00	91,031,400	貸付有価証券 16,200株
松屋フーズ	6,800	4,225.00	28,730,000	貸付有価証券 200株(200株)
サガミチェーン	17,600	1,413.00	24,868,800	
関西スーパーマーケット	11,500	1,618.00	18,607,000	貸付有価証券 5,400株(5,200株)
王将フードサービス	10,300	4,330.00	44,599,000	貸付有価証券 500株
プレナス	15,700	2,359.00	37,036,300	
ミニストップ	10,400	2,235.00	23,244,000	
アークス	26,400	2,434.00	64,257,600	
パローホールディングス	30,400	2,665.00	81,016,000	
藤久	1,100	1,743.00	1,917,300	
ベルク	6,200	5,170.00	32,054,000	貸付有価証券 200株
大庄	7,500	1,625.00	12,187,500	貸付有価証券 1,000株
ファーストリテイリング	23,500	38,460.00	903,810,000	貸付有価証券 500株(500株)
サンドラッグ	53,600	4,105.00	220,028,000	
サックスパーホールディングス	13,200	1,331.00	17,569,200	貸付有価証券 2,100株
ヤマザワ	2,900	1,817.00	5,269,300	
やまや	2,900	1,659.00	4,811,100	
ベルーナ	30,200	1,092.00	32,978,400	
島根銀行	3,000	1,361.00	4,083,000	
じもとホールディングス	101,100	201.00	20,321,100	
めぶきフィナンシャルグループ	679,700	444.00	301,786,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	20,400	3,430.00	69,972,000	
九州フィナンシャルグループ	231,200	732.00	169,238,400	貸付有価証券 4,500株
ゆうちょ銀行	399,100	1,414.00	564,327,400	貸付有価証券 36,500株
富山第一銀行	35,800	528.00	18,902,400	貸付有価証券 16,400株
コンコルディア・フィナ	913,600	532.00	486,035,200	貸付有価証券

ンシャルグループ				57,500株(57,500株)
西日本フィナンシャル ホールディングス	95,600	1,130.00	108,028,000	
新生銀行	1,342,000	211.00	283,162,000	貸付有価証券 631,000株
あおぞら銀行	892,000	421.00	375,532,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,681,400	727.70	7,772,854,780	貸付有価証券 607,900株
りそなホールディングス	1,649,000	610.10	1,006,054,900	
三井住友トラスト・ホールディングス	294,300	4,005.00	1,178,671,500	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
三井住友フィナンシャルグループ	1,128,700	4,204.00	4,745,054,800	
第四銀行	173,000	459.00	79,407,000	貸付有価証券 4,000株
北越銀行	15,200	2,875.00	43,700,000	貸付有価証券 700株
千葉銀行	544,000	772.00	419,968,000	貸付有価証券 42,000株
群馬銀行	313,200	620.00	194,184,000	
武蔵野銀行	22,500	3,420.00	76,950,000	貸付有価証券 800株
千葉興業銀行	38,600	663.00	25,591,800	
筑波銀行	58,600	328.00	19,220,800	
七十七銀行	221,000	496.00	109,616,000	貸付有価証券 4,000株
青森銀行	109,000	397.00	43,273,000	
秋田銀行	90,000	367.00	33,030,000	
山形銀行	79,000	506.00	39,974,000	貸付有価証券 37,000株(8,000株)
岩手銀行	9,200	4,680.00	43,056,000	貸付有価証券 400株(400株)
東邦銀行	126,000	425.00	53,550,000	貸付有価証券 2,000株
東北銀行	72,000	158.00	11,376,000	
みちのく銀行	84,000	190.00	15,960,000	貸付有価証券 38,000株(18,000株)
ふくおかフィナンシャルグループ	572,000	525.00	300,300,000	
静岡銀行	372,000	963.00	358,236,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)

十六銀行	189,000	368.00	69,552,000	
スルガ銀行	144,100	2,449.00	352,900,900	貸付有価証券 10,900株
八十二銀行	272,000	672.00	182,784,000	
山梨中央銀行	87,000	501.00	43,587,000	
大垣共立銀行	218,000	336.00	73,248,000	貸付有価証券 1,000株
福井銀行	120,000	287.00	34,440,000	
北國銀行	150,000	424.00	63,600,000	貸付有価証券 3,000株
清水銀行	4,800	3,730.00	17,904,000	
富山銀行	2,700	4,555.00	12,298,500	
滋賀銀行	132,000	600.00	79,200,000	貸付有価証券 24,000株（5,000株）
南都銀行	13,600	4,370.00	59,432,000	
百五銀行	127,000	469.00	59,563,000	
京都銀行	252,000	921.00	232,092,000	貸付有価証券 26,000株（20,000株）
紀陽銀行	53,000	1,820.00	96,460,000	貸付有価証券 700株
三重銀行	6,300	2,359.00	14,861,700	
ほくほくフィナンシャル グループ	93,800	1,839.00	172,498,200	
広島銀行	416,000	488.00	203,008,000	貸付有価証券 10,000株
山陰合同銀行	83,500	934.00	77,989,000	貸付有価証券 400株
中国銀行	99,900	1,716.00	171,428,400	
鳥取銀行	4,500	1,785.00	8,032,500	
伊予銀行	201,000	812.00	163,212,000	貸付有価証券 2,400株
百十四銀行	155,000	384.00	59,520,000	
四国銀行	108,000	353.00	38,124,000	貸付有価証券 11,000株
阿波銀行	120,000	781.00	93,720,000	
大分銀行	81,000	452.00	36,612,000	貸付有価証券 38,000株
宮崎銀行	94,000	368.00	34,592,000	
佐賀銀行	85,000	302.00	25,670,000	
十八銀行	87,000	341.00	29,667,000	

沖縄銀行	13,700	4,475.00	61,307,500	貸付有価証券 500株
琉球銀行	29,000	1,656.00	48,024,000	貸付有価証券 100株
セブン銀行	528,400	383.00	202,377,200	貸付有価証券 248,700株
みずほフィナンシャルグループ	19,137,800	208.90	3,997,886,420	
高知銀行	51,000	134.00	6,834,000	
山口フィナンシャルグループ	132,000	1,282.00	169,224,000	貸付有価証券 41,000株（24,000株）
長野銀行	4,600	2,022.00	9,301,200	貸付有価証券 2,100株（300株）
名古屋銀行	11,400	4,285.00	48,849,000	貸付有価証券 5,300株（1,000株）
北洋銀行	230,100	434.00	99,863,400	貸付有価証券 8,000株
愛知銀行	4,700	6,630.00	31,161,000	
第三銀行	8,000	1,755.00	14,040,000	
中京銀行	5,800	2,348.00	13,618,400	貸付有価証券 200株
大光銀行	48,000	261.00	12,528,000	
愛媛銀行	17,900	1,411.00	25,256,900	貸付有価証券 6,800株（5,600株）
トマト銀行	5,400	1,608.00	8,683,200	
みなと銀行	12,800	2,177.00	27,865,600	
京葉銀行	115,000	495.00	56,925,000	
関西アーバン銀行	19,600	1,419.00	27,812,400	
栃木銀行	77,800	561.00	43,645,800	貸付有価証券 800株
北日本銀行	4,400	3,260.00	14,344,000	
東和銀行	264,000	120.00	31,680,000	
福島銀行	153,000	91.00	13,923,000	貸付有価証券 44,000株
大東銀行	73,000	173.00	12,629,000	貸付有価証券 34,000株（11,000株）
トモニホールディングス	116,200	610.00	70,882,000	貸付有価証券 3,700株
フィデアホールディングス	136,800	220.00	30,096,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）

池田泉州ホールディングス	149,500	490.00	73,255,000	貸付有価証券 2,700株
F P G	50,300	1,030.00	51,809,000	貸付有価証券 16,200株
S B Iホールディングス	159,300	1,520.00	242,136,000	貸付有価証券 75,000株（23,300株）
日本アジア投資	13,500	427.00	5,764,500	貸付有価証券 6,200株（300株）
ジャフコ	23,600	4,265.00	100,654,000	
大和証券グループ本社	1,281,000	680.10	871,208,100	
野村ホールディングス	2,881,700	697.60	2,010,273,920	
岡三証券グループ	120,000	680.00	81,600,000	
丸三証券	44,800	909.00	40,723,200	貸付有価証券 20,800株
東洋証券	50,000	265.00	13,250,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	161,800	591.00	95,623,800	貸付有価証券 32,000株
光世証券	34,000	168.00	5,712,000	
水戸証券	43,600	316.00	13,777,600	貸付有価証券 3,200株
いちよし証券	31,500	927.00	29,200,500	
松井証券	80,500	928.00	74,704,000	貸付有価証券 5,700株（1,300株）
だいこう証券ビジネス	6,800	648.00	4,406,400	
マネックスグループ	149,300	289.00	43,147,700	貸付有価証券 51,000株（28,400株）
カブドットコム証券	105,100	364.00	38,256,400	貸付有価証券 2,500株
極東証券	18,900	1,746.00	32,999,400	
岩井コスモホールディングス	13,300	1,093.00	14,536,900	貸付有価証券 400株
藍澤證券	26,400	667.00	17,608,800	
マネーパートナーズグループ	18,000	578.00	10,404,000	貸付有価証券 8,300株
小林洋行	4,000	279.00	1,116,000	貸付有価証券 300株
かんぽ生命保険	53,200	2,592.00	137,894,400	
S O M P Oホールディングス	294,700	4,470.00	1,317,309,000	
アニコムホールディング	9,500	2,280.00	21,660,000	貸付有価証券

グス				2,200株
MS & A Dインシュアランスグループホール	421,200	3,730.00	1,571,076,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	135,000	1,872.00	252,720,000	貸付有価証券 5,800株
第一生命ホールディングス	850,000	1,978.50	1,681,725,000	
東京海上ホールディングス	567,700	4,943.00	2,806,141,100	
T & Dホールディングス	513,700	1,732.50	889,985,250	
アドバンスクリエイト	3,300	1,993.00	6,576,900	貸付有価証券 900株
全国保証	39,700	4,415.00	175,275,500	貸付有価証券 14,000株
クレディセゾン	106,900	2,093.00	223,741,700	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
アクリーティブ	11,600	359.00	4,164,400	貸付有価証券 5,400株
芙蓉総合リース	16,100	5,300.00	85,330,000	
興銀リース	26,500	2,489.00	65,958,500	貸付有価証券 300株(300株)
東京センチュリー	28,400	3,995.00	113,458,000	
日本証券金融	62,100	610.00	37,881,000	貸付有価証券 7,100株
アイフル	236,400	346.00	81,794,400	貸付有価証券 111,200株(3,200株)
ポケットカード	10,600	696.00	7,377,600	貸付有価証券 900株
リコーリース	11,100	3,720.00	41,292,000	貸付有価証券 3,200株(900株)
イオンフィナンシャルサービス	90,000	2,142.00	192,780,000	貸付有価証券 42,300株(100株)
アコム	283,100	501.00	141,833,100	貸付有価証券 124,200株(19,200株)
ジャックス	78,000	488.00	38,064,000	貸付有価証券 9,000株
オリエントコーポレーション	304,800	202.00	61,569,600	貸付有価証券 76,100株(7,300株)
日立キャピタル	33,200	2,745.00	91,134,000	貸付有価証券 600株
アプラスフィナンシャル	67,600	113.00	7,638,800	貸付有価証券

				31,700株
オリックス	998,200	1,763.50	1,760,325,700	
三菱UFJリース	357,500	603.00	215,572,500	
日本取引所グループ	438,300	1,651.00	723,633,300	
イー・ギャランティ	4,200	2,472.00	10,382,400	貸付有価証券 1,900株(500株)
アサックス	2,400	1,661.00	3,986,400	
NECキャピタルソ リューション	5,700	1,781.00	10,151,700	貸付有価証券 100株
いちご	134,000	335.00	44,890,000	貸付有価証券 63,000株(15,000株)
日本駐車場開発	169,900	152.00	25,824,800	貸付有価証券 20,700株
ヒューリック	294,000	1,059.00	311,346,000	貸付有価証券 32,000株
三栄建築設計	5,600	1,567.00	8,775,200	
野村不動産ホールディン グス	93,600	2,006.00	187,761,600	貸付有価証券 10,200株
三重交通グループホール ディングス	25,000	395.00	9,875,000	貸付有価証券 100株
サムティ	11,300	1,163.00	13,141,900	貸付有価証券 5,400株(3,000株)
ディア・ライフ	12,500	394.00	4,925,000	貸付有価証券 2,300株(100株)
エー・ディー・ワークス	129,200	40.00	5,168,000	貸付有価証券 60,700株
日本商業開発	7,900	1,907.00	15,065,300	貸付有価証券 3,700株
プレサンスコーポレー ション	21,900	1,383.00	30,287,700	
ユニゾホールディングス	11,600	3,075.00	35,670,000	貸付有価証券 300株
THEグローバル社	6,600	552.00	3,643,200	
日本管理センター	10,100	1,353.00	13,665,300	
サンセイランディック	2,900	779.00	2,259,100	貸付有価証券 1,300株
エストラスト	2,500	678.00	1,695,000	貸付有価証券 100株
フージャースホールディ ングス	18,200	681.00	12,394,200	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
オープンハウス	22,900	2,948.00	67,509,200	貸付有価証券

				5,100株
東急不動産ホールディングス	341,000	628.00	214,148,000	貸付有価証券 1,400株
飯田グループホールディングス	117,500	1,841.00	216,317,500	
ムゲンエステート	6,500	915.00	5,947,500	貸付有価証券 400株
ファーストブラザーズ	1,900	1,540.00	2,926,000	
ハウズドゥ	2,300	1,681.00	3,866,300	貸付有価証券 700株(700株)
シーアールイー	2,200	1,602.00	3,524,400	
ケイアイスター不動産	3,800	1,686.00	6,406,800	
パーク24	71,500	2,982.00	213,213,000	貸付有価証券 9,000株(3,900株)
パラカ	4,500	2,098.00	9,441,000	
三井不動産	747,400	2,588.00	1,934,271,200	
三菱地所	1,048,400	2,242.00	2,350,512,800	
平和不動産	26,600	1,870.00	49,742,000	貸付有価証券 1,800株
東京建物	163,600	1,562.00	255,543,200	貸付有価証券 10,200株
ダイビル	36,300	1,110.00	40,293,000	
京阪神ビルディング	23,300	664.00	15,471,200	
住友不動産	338,000	3,165.00	1,069,770,000	
大京	262,000	239.00	62,618,000	
テーオーシー	54,600	1,118.00	61,042,800	貸付有価証券 11,800株
東京楽天地	23,000	542.00	12,466,000	
レオパレス21	177,900	620.00	110,298,000	貸付有価証券 9,400株
スターツコーポレーション	19,200	2,623.00	50,361,600	
フジ住宅	18,000	739.00	13,302,000	
空港施設	17,000	608.00	10,336,000	
明和地所	7,700	754.00	5,805,800	貸付有価証券 3,200株(500株)
住友不動産販売	12,700	3,595.00	45,656,500	貸付有価証券 700株
ゴールドクレスト	12,700	2,109.00	26,784,300	
日本エスリード	5,500	1,488.00	8,184,000	

日神不動産	16,700	631.00	10,537,700	
日本エスコ	24,500	417.00	10,216,500	貸付有価証券 8,800株(4,700株)
タカラレーベン	60,500	552.00	33,396,000	貸付有価証券 28,400株
サンヨーハウジング名古屋	7,300	1,040.00	7,592,000	
イオンモール	90,800	2,041.00	185,322,800	貸付有価証券 41,800株
ファースト住建	5,200	1,491.00	7,753,200	
トーセイ	19,300	816.00	15,748,800	貸付有価証券 9,000株
穴吹興産	1,500	2,799.00	4,198,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	87,600	1,024.00	89,702,400	
サンフロンティア不動産	15,200	1,116.00	16,963,200	貸付有価証券 500株(100株)
エフ・ジェー・ネクスト	12,300	870.00	10,701,000	貸付有価証券 4,100株
インテリックス	4,300	880.00	3,784,000	貸付有価証券 1,400株
ランドビジネス	8,300	298.00	2,473,400	
グランディハウス	12,300	413.00	5,079,900	
日本空港ビルデング	45,000	4,200.00	189,000,000	貸付有価証券 21,100株
日本工営	10,000	3,060.00	30,600,000	
L i f u l l	36,900	796.00	29,372,400	貸付有価証券 17,500株
ジェイエイシーリクルートメント	9,200	1,717.00	15,796,400	貸付有価証券 3,500株(100株)
日本M&Aセンター	43,100	3,985.00	171,753,500	貸付有価証券 2,000株
中広	1,400	749.00	1,048,600	
タケエイ	13,100	1,027.00	13,453,700	貸付有価証券 5,000株
トラスト・テック	6,000	2,128.00	12,768,000	
コシダカホールディングス	6,800	2,428.00	16,510,400	
パソナグループ	11,100	931.00	10,334,100	貸付有価証券 5,100株(3,800株)
C D S	3,400	1,163.00	3,954,200	貸付有価証券

				300株
リンクアンドモチベーション	35,100	712.00	24,991,200	貸付有価証券 16,500株
G C A	13,200	938.00	12,381,600	貸付有価証券 6,200株(1,400株)
エス・エム・エス	21,200	3,110.00	65,932,000	貸付有価証券 9,100株
テンプホールディングス	115,400	2,200.00	253,880,000	貸付有価証券 4,900株
リニカル	8,800	1,517.00	13,349,600	貸付有価証券 4,100株
クックパッド	33,300	942.00	31,368,600	貸付有価証券 3,100株(1,000株)
エスクリ	5,300	804.00	4,261,200	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
アイ・ケイ・ケイ	6,600	781.00	5,154,600	貸付有価証券 100株(100株)
学情	6,200	1,299.00	8,053,800	貸付有価証券 2,100株
スタジオアリス	6,100	2,358.00	14,383,800	
シミックホールディングス	7,600	1,441.00	10,951,600	貸付有価証券 1,700株(1,600株)
N J S	3,300	1,387.00	4,577,100	
総合警備保障	54,300	4,665.00	253,309,500	貸付有価証券 4,700株
カカクコム	106,400	1,586.00	168,750,400	貸付有価証券 40,600株
セントケア・ホールディング	1,900	1,605.00	3,049,500	貸付有価証券 800株(800株)
サイネックス	1,400	1,159.00	1,622,600	貸付有価証券 500株(500株)
ルネサンス	7,600	1,938.00	14,728,800	
ディップ	19,200	2,548.00	48,921,600	貸付有価証券 9,000株
オプトホールディング	10,900	1,319.00	14,377,100	貸付有価証券 5,000株(100株)
新日本科学	16,600	649.00	10,773,400	貸付有価証券 7,100株
ツクイ	35,300	626.00	22,097,800	
キャリアデザインセンター	3,100	1,236.00	3,831,600	
エムスリー	129,200	2,943.00	380,235,600	貸付有価証券

				15,000株
ツカダ・グローバルホールディング	10,900	576.00	6,278,400	貸付有価証券 2,700株
アウトソーシング	9,600	4,865.00	46,704,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
ウェルネット	11,200	1,473.00	16,497,600	貸付有価証券 800株
ワールドホールディングス	4,500	2,486.00	11,187,000	貸付有価証券 1,600株
ディー・エヌ・エー	66,900	2,555.00	170,929,500	貸付有価証券 8,700株
博報堂DYホールディングス	206,800	1,411.00	291,794,800	
ぐるなび	21,600	2,262.00	48,859,200	
エスアールジータカミヤ	16,100	554.00	8,919,400	貸付有価証券 7,200株
ジャパンベストレスキューシステム	16,900	274.00	4,630,600	貸付有価証券 7,900株(3,900株)
ファンコミュニケーションズ	37,900	969.00	36,725,100	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
ライク	2,700	2,768.00	7,473,600	貸付有価証券 1,200株
ビジネス・ブレークスルー	6,300	388.00	2,444,400	
WDBホールディングス	5,300	1,585.00	8,400,500	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
ティア	7,200	765.00	5,508,000	貸付有価証券 500株(500株)
CDG	1,000	1,820.00	1,820,000	貸付有価証券 400株
バリューコマース	13,800	586.00	8,086,800	貸付有価証券 300株(300株)
インフォマート	63,300	761.00	48,171,300	貸付有価証券 29,700株(1,600株)
JPHホールディングス	42,900	299.00	12,827,100	貸付有価証券 20,100株(1,400株)
EPSホールディングス	20,500	1,703.00	34,911,500	
レッグス	3,400	779.00	2,648,600	
プレステージ・インターナショナル	28,200	1,076.00	30,343,200	貸付有価証券 1,900株
アミューズ	8,300	2,552.00	21,181,600	貸付有価証券 3,000株

ドリームインキュベータ	4,500	2,216.00	9,972,000	貸付有価証券 1,800株
クイック	7,600	1,346.00	10,229,600	
T A C	8,200	232.00	1,902,400	
ケネディクス	189,200	539.00	101,978,800	貸付有価証券 89,000株
電通	166,300	6,460.00	1,074,298,000	貸付有価証券 12,500株（9,700株）
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,900	972.00	6,706,800	貸付有価証券 3,100株
ぴあ	4,500	2,985.00	13,432,500	貸付有価証券 2,100株
イオンファンタジー	4,400	3,020.00	13,288,000	貸付有価証券 1,800株
シーティーエス	7,900	757.00	5,980,300	
ネクシィーズグループ	5,400	1,583.00	8,548,200	貸付有価証券 2,500株（2,000株）
みらかホールディングス	38,100	5,320.00	202,692,000	
アルプス技研	6,000	3,860.00	23,160,000	
ダイオーズ	2,700	1,082.00	2,921,400	
日本空調サービス	14,300	699.00	9,995,700	貸付有価証券 400株
オリエンタルランド	161,300	6,772.00	1,092,323,600	貸付有価証券 44,400株（9,000株）
ダスキン	36,700	2,642.00	96,961,400	
明光ネットワークジャパン	17,300	1,486.00	25,707,800	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
ファルコホールディングス	7,000	1,590.00	11,130,000	
秀英予備校	3,000	476.00	1,428,000	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
田谷	2,500	666.00	1,665,000	
ラウンドワン	46,600	1,071.00	49,908,600	貸付有価証券 100株
リゾートトラスト	57,700	1,972.00	113,784,400	貸付有価証券 9,800株
ビー・エム・エル	19,500	2,502.00	48,789,000	
ワタベウェディング	2,200	616.00	1,355,200	貸付有価証券 900株
りらいあコミュニケーションズ	24,700	1,133.00	27,985,100	貸付有価証券 2,600株

リソー教育	25,400	788.00	20,015,200	貸付有価証券 100株
早稲田アカデミー	1,900	1,285.00	2,441,500	
ユー・エス・エス	180,600	2,029.00	366,437,400	
東京個別指導学院	4,800	1,366.00	6,556,800	貸付有価証券 2,200株
サイバーエージェント	89,700	3,620.00	324,714,000	貸付有価証券 21,800株(16,600株)
楽天	762,400	1,173.00	894,295,200	貸付有価証券 40,900株
クリーク・アンド・リ バー社	7,000	1,009.00	7,063,000	
テー・オー・ダブリュー	11,900	801.00	9,531,900	貸付有価証券 3,600株
セントラルスポーツ	5,100	3,440.00	17,544,000	
フルキャストホールディ ングス	15,400	1,180.00	18,172,000	貸付有価証券 4,100株
リソルホールディングス	15,000	350.00	5,250,000	
テクノプロ・ホールディ ングス	24,300	4,350.00	105,705,000	
アトラ	2,300	646.00	1,485,800	貸付有価証券 700株
インターワークス	3,000	1,116.00	3,348,000	
K e e P e r 技研	2,200	1,986.00	4,369,200	
ファーストロジック	1,000	2,429.00	2,429,000	貸付有価証券 300株(300株)
デザインワン・ジャパン	2,700	1,449.00	3,912,300	貸付有価証券 1,200株(700株)
イー・ガーディアン	6,900	1,746.00	12,047,400	貸付有価証券 2,500株(1,300株)
リブセンス	10,000	524.00	5,240,000	貸付有価証券 4,400株(2,400株)
ジャパンマテリアル	10,900	1,841.00	20,066,900	貸付有価証券 5,100株
ベクトル	12,100	1,579.00	19,105,900	貸付有価証券 5,200株(3,000株)
ウチヤマホールディング ス	6,700	459.00	3,075,300	
サクセスホールディング ス	1,400	1,557.00	2,179,800	
キャリアリンク	3,300	584.00	1,927,200	貸付有価証券

				1,500株
I B J	11,600	604.00	7,006,400	貸付有価証券 4,900株
アサンテ	5,500	1,772.00	9,746,000	
N・フィールド	7,000	1,346.00	9,422,000	貸付有価証券 3,300株(100株)
バリューHR	1,500	2,935.00	4,402,500	貸付有価証券 200株
M&Aキャピタルパートナーズ	2,500	5,210.00	13,025,000	貸付有価証券 1,100株
ライドオン・エクスプレス	3,700	882.00	3,263,400	貸付有価証券 1,700株(1,300株)
E R Iホールディングス	3,800	868.00	3,298,400	貸付有価証券 900株
アビスト	1,900	4,005.00	7,609,500	貸付有価証券 800株(600株)
ウィルグループ	5,900	847.00	4,997,300	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	3,300	2,040.00	6,732,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
日本ビューホテル	3,000	1,392.00	4,176,000	貸付有価証券 900株(400株)
リクルートホールディ ングス	325,900	6,000.00	1,955,400,000	
エラン	2,000	2,082.00	4,164,000	
土木管理総合試験所	2,000	705.00	1,410,000	貸付有価証券 100株
日本郵政	389,300	1,399.00	544,630,700	
ベルシステム24ホール ディングス	22,700	1,109.00	25,174,300	貸付有価証券 10,700株
一蔵	1,500	1,170.00	1,755,000	
L I T A L I C O	1,700	1,645.00	2,796,500	貸付有価証券 700株(400株)
エボラブルアジア	2,800	2,958.00	8,282,400	貸付有価証券 1,300株(600株)
ソラスト	9,400	1,537.00	14,447,800	貸付有価証券 3,200株
リログループ	74,600	2,056.00	153,377,600	貸付有価証券 26,000株
東祥	4,200	5,110.00	21,462,000	貸付有価証券 300株
エイチ・アイ・エス	24,300	2,765.00	67,189,500	貸付有価証券

				9,000株
ラックランド	2,600	2,100.00	5,460,000	貸付有価証券 1,200株
共立メンテナンス	24,200	3,290.00	79,618,000	貸付有価証券 4,000株
イチネンホールディングス	15,300	1,205.00	18,436,500	
建設技術研究所	9,400	1,182.00	11,110,800	
スペース	8,000	1,448.00	11,584,000	
燦ホールディングス	3,000	1,718.00	5,154,000	
スバル興業	11,000	495.00	5,445,000	
東京テアトル	57,000	150.00	8,550,000	
タナベ経営	2,900	1,404.00	4,071,600	
ナガワ	2,700	3,870.00	10,449,000	
よみうりランド	30,000	437.00	13,110,000	
東京都競馬	102,000	262.00	26,724,000	
常磐興産	5,500	1,771.00	9,740,500	貸付有価証券 2,100株(100株)
カナモト	20,800	3,055.00	63,544,000	貸付有価証券 300株
東京ドーム	59,500	1,030.00	61,285,000	
西尾レントオール	12,000	3,110.00	37,320,000	
トランス・コスモス	17,300	2,612.00	45,187,600	貸付有価証券 400株
乃村工藝社	31,900	2,270.00	72,413,000	
藤田観光	49,000	360.00	17,640,000	貸付有価証券 23,000株
KNT-CTホールディングス	85,000	145.00	12,325,000	
日本管財	12,800	1,945.00	24,896,000	
トーカイ	6,600	4,295.00	28,347,000	
白洋舎	1,400	2,997.00	4,195,800	
セコム	155,200	8,400.00	1,303,680,000	
セントラル警備保障	6,600	1,818.00	11,998,800	
丹青社	25,800	1,104.00	28,483,200	貸付有価証券 8,500株(7,900株)
メイテック	17,300	5,110.00	88,403,000	貸付有価証券 1,700株
アサツー ディ・ケイ	24,300	2,977.00	72,341,100	貸付有価証券

					2,400株
	応用地質	14,100	1,452.00	20,473,200	貸付有価証券 200株
	船井総研ホールディングス	18,900	2,725.00	51,502,500	
	進学会	6,200	591.00	3,664,200	
	オオバ	11,600	536.00	6,217,600	貸付有価証券 5,400株
	いであ	2,700	1,128.00	3,045,600	貸付有価証券 1,200株
	学究社	3,900	1,613.00	6,290,700	貸付有価証券 600株（600株）
	ベネッセホールディングス	50,000	3,880.00	194,000,000	貸付有価証券 22,500株（1,000株）
	イオンディライト	16,800	3,550.00	59,640,000	
	ナック	9,100	976.00	8,881,600	貸付有価証券 3,600株
	ニチイ学館	25,900	895.00	23,180,500	貸付有価証券 11,100株（9,200株）
	ダイセキ	26,000	2,534.00	65,884,000	貸付有価証券 1,200株
	ステップ	5,000	1,488.00	7,440,000	
	小計 銘柄数：2,001 組入時価比率：98.6%			330,412,047,974	100.0%
	合計			330,412,047,974	

(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29年 5月10日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年 5月10日現在		
	契約額等（円）		時価（円）
	うち1年超		
			評価損益（円）
市場取引			
株価指数先物取引			

買建	4,613,931,000	-	4,804,065,000	189,986,742
合計	4,613,931,000	-	4,804,065,000	189,986,742

(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29年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	4,119,220,934
コール・ローン	3,874,064,687
株式	364,814,183,207
投資信託受益証券	23,471,669
投資証券	9,662,009,252
派生商品評価勘定	106,577,650
未収入金	69,301,482
未収配当金	468,464,558
差入委託証拠金	1,111,596,289
流動資産合計	384,248,889,728
資産合計	384,248,889,728
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,015,898
未払金	3,978,057,875
未払解約金	767,984,426
未払利息	5,022
その他未払費用	3,848,200
流動負債合計	4,750,911,421
負債合計	4,750,911,421
純資産の部	
元本等	
元本	158,337,887,741
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	221,160,090,566
元本等合計	379,497,978,307
純資産合計	379,497,978,307
負債純資産合計	384,248,889,728

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

	<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>市場価格のない有価証券については基準価額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	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>(株式、投資証券)</p> <p>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)</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2,3968円
(10,000口当たり純資産額)	(23,968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28年 5月11日

至 平成29年 5月10日

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 5月10日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（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29年 5月10日現在

期首	平成28年 5月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	160,220,261,550円
同期中における追加設定元本額	26,587,595,315円
同期中における一部解約元本額	28,469,969,124円
期末元本額	158,337,887,741円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	55,543,916円
バランスセレクト50	177,719,334円
バランスセレクト70	172,937,540円
野村外国株式インデックスファンド	560,813,471円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,655,183,511円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	7,844,856,695円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	5,047,384,739円
野村資産設計ファンド2015	26,660,307円
野村資産設計ファンド2020	32,184,903円
野村資産設計ファンド2025	43,262,689円
野村資産設計ファンド2030	40,840,146円
野村資産設計ファンド2035	31,380,684円
野村資産設計ファンド2040	93,202,677円
野村外国株インデックス(野村投資一任口座向け)	17,001,376,343円
のむらップ・ファンド(保守型)	979,619,538円
のむらップ・ファンド(普通型)	5,320,134,565円
のむらップ・ファンド(積極型)	4,119,739,077円
野村資産設計ファンド2045	10,242,165円
野村インデックスファンド・外国株式	3,056,795,943円
マイ・ロード	1,510,560,871円
ネクストコア	139,077,821円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	82,993,492円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	602,099,350円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,021,245,176円
野村資産設計ファンド2050	11,984,973円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,969,622円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	963,310円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	630,458円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	428,537円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	128,239,948円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	107,313,471円
インデックス・ブレンド(タイプ)	41,996円
インデックス・ブレンド(タイプ)	49,379円
インデックス・ブレンド(タイプ)	155,364円
インデックス・ブレンド(タイプ)	262,677円
インデックス・ブレンド(タイプ)	228,618円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	61,945,195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)	438,864,957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)	376,198,502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)	4,588,437,583円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,204,692,437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)	2,824,775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)	15,857,684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)	6,710,849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)	104,179,841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)	1,149,317,624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)	456,674,899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)	185,917,539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)	52,013,399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)	221,052,309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)	4,023,703,397円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	498,724,304円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,512,216,805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)	313,869,174円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,684,554,233円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,246,420円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	13,585,521円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	13,084,127円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	57,741,930,101円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,322,760,016円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,390,987,769円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,023,074,756円
マイバランスDC30	774,845,177円
マイバランスDC50	1,418,084,725円
マイバランスDC70	1,074,259,469円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	14,462,424,483円
野村DC運用戦略ファンド	247,478,424円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	2,722,865円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	67,069,812円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	2,152,035円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	3,303,229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29年 5月10日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES	39,900	58.60	2,338,140.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	4,300	106.76	459,068.00	
		HALLIBURTON CO	84,600	45.03	3,809,538.00	
		HELMERICH & PAYNE	10,600	58.18	616,708.00	

NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,500	33.76	1,232,240.00
SCHLUMBERGER LTD	138,200	72.28	9,989,096.00
TECHNIPFMC PLC	43,300	31.62	1,369,146.00
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	85,000	5.07	430,950.00
ANADARKO PETE	55,300	51.33	2,838,549.00
ANTERO RESOURCES CORP	14,700	20.95	307,965.00
APACHE CORPORATION	38,200	50.45	1,927,190.00
CABOT OIL & GAS CORP	45,700	23.82	1,088,574.00
CHENIERE ENERGY INC	19,500	45.96	896,220.00
CHEVRON CORP	187,200	105.08	19,670,976.00
CIMAREX ENERGY CO	9,700	119.01	1,154,397.00
CONCHO RESOURCES INC	14,200	129.60	1,840,320.00
CONOCOPHILLIPS	123,300	46.27	5,705,091.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	9,400	41.54	390,476.00
DEVON ENERGY CORP	45,800	37.89	1,735,362.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,500	99.62	846,770.00
EOG RESOURCES INC	57,400	91.64	5,260,136.00
EQT CORP	16,500	56.37	930,105.00
EXXON MOBIL CORP	410,800	82.31	33,812,948.00
HESS CORP	27,400	47.83	1,310,542.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	27.79	461,314.00
KINDER MORGAN INC	185,800	19.90	3,697,420.00
MARATHON OIL CORP	81,200	14.40	1,169,280.00
MARATHON PETROLEUM CORP	52,900	51.46	2,722,234.00
MURPHY OIL CORP	16,700	26.63	444,721.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	18,800	34.05	640,140.00
NOBLE ENERGY INC	47,300	31.09	1,470,557.00
OCCIDENTAL PETE CORP	76,200	59.88	4,562,856.00
ONEOK INC	21,200	50.48	1,070,176.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	21,700	31.45	682,465.00
PHILLIPS 66	46,300	79.60	3,685,480.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,650	169.48	2,821,842.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	14,000	27.36	383,040.00
RANGE RESOURCES CORP	19,000	25.13	477,470.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	46,800	7.13	333,684.00

TARGA RESOURCES CORP	17,800	49.26	876,828.00
TESORO CORP	11,300	83.47	943,211.00
VALERO ENERGY CORP	45,300	66.63	3,018,339.00
WILLIAMS COS	81,000	30.06	2,434,860.00
AIR PRODUCTS	20,600	145.30	2,993,180.00
ALBEMARLE CORP	11,100	109.33	1,213,563.00
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,800	123.16	714,328.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	21,200	31.30	663,560.00
CELANESE CORP-SERIES A	14,400	86.65	1,247,760.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,900	27.42	627,918.00
DOW CHEM CO	111,500	61.83	6,894,045.00
DU PONT E I DE NEMOURS	86,500	79.49	6,875,885.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	14,100	78.39	1,105,299.00
ECOLAB INC	25,700	125.61	3,228,177.00
FMC CORP	13,200	72.60	958,320.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	7,600	128.98	980,248.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34,700	81.91	2,842,277.00
MONSANTO CO	43,700	116.05	5,071,385.00
MOSAIC CO/THE	31,200	23.49	732,888.00
PPG INDUSTRIES	26,400	107.85	2,847,240.00
PRAXAIR INC	28,000	128.62	3,601,360.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,840	338.38	2,652,899.20
VALSPAR CORP	7,300	112.31	819,863.00
WR GRACE & CO	6,700	69.76	467,392.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,910	233.84	1,381,994.40
VULCAN MATERIALS CO	12,800	126.11	1,614,208.00
AVERY DENNISON CORP	8,700	83.01	722,187.00
BALL CORP	16,900	79.64	1,345,916.00
CROWN HOLDINGS INC	13,100	56.55	740,805.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	39,300	52.54	2,064,822.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	9,700	100.60	975,820.00
SEALED AIR CORP	19,200	42.30	812,160.00
WESTROCK CO	24,300	53.41	1,297,863.00
FREEMONT-MCMORAN INC	131,000	11.63	1,523,530.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	53,500	32.76	1,752,660.00

NUCOR CORP	32,100	58.80	1,887,480.00
ARCONIC INC	43,666	27.26	1,190,335.16
BOEING CO	58,210	186.91	10,880,031.10
GENERAL DYNAMICS	25,790	196.59	5,070,056.10
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,600	195.99	901,554.00
L3 TECHNOLOGIES INC	7,760	167.77	1,301,895.20
LOCKHEED MARTIN	26,220	273.87	7,180,871.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,530	249.49	4,124,069.70
RAYTHEON COMPANY	29,300	160.06	4,689,758.00
ROCKWELL COLLINS INC	15,932	105.07	1,673,975.24
TEXTRON INC	26,400	47.08	1,242,912.00
TRANSDIGM GROUP INC	5,230	242.42	1,267,856.60
UNITED TECHNOLOGIES	77,700	121.46	9,437,442.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	15,300	63.50	971,550.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	91,700	42.01	3,852,317.00
MASCO CORP	32,900	36.95	1,215,655.00
SMITH (A.O.) CORP	14,400	54.84	789,696.00
FLUOR CORP	13,900	48.39	672,621.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,300	55.92	687,816.00
ACUITY BRANDS INC	4,380	191.37	838,200.60
AMETEK INC	23,300	60.30	1,404,990.00
EATON CORP PLC	44,700	76.76	3,431,172.00
EMERSON ELEC	63,000	58.85	3,707,550.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,900	157.13	2,026,977.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16,900	40.35	681,915.00
3M CORP	59,700	197.96	11,818,212.00
GENERAL ELEC CO	876,700	28.93	25,362,931.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	71,900	131.91	9,484,329.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	25,300	63.66	1,610,598.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	22,000	41.23	907,060.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,960	221.90	2,210,124.00
AGCO CORP	6,300	63.82	402,066.00
CATERPILLAR INC DEL	58,200	99.29	5,778,678.00
CUMMINS INC	15,600	157.75	2,460,900.00

DEERE & COMPANY	26,700	113.58	3,032,586.00
DOVER CORP	15,300	79.43	1,215,279.00
FLOWSERVE CORP	12,200	49.14	599,508.00
FORTIVE CORP	31,000	62.70	1,943,700.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	31,200	138.95	4,335,240.00
INGERSOLL-RAND PLC	25,100	89.36	2,242,936.00
MIDDLEBY CORP	5,700	137.45	783,465.00
PACCAR	34,100	66.29	2,260,489.00
PARKER HANNIFIN CORP	13,300	159.25	2,118,025.00
PENTAIR PLC	16,700	67.73	1,131,091.00
SNAP-ON INC	5,940	170.69	1,013,898.60
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,000	138.85	2,082,750.00
WABCO HOLDINGS INC	5,200	119.06	619,112.00
WABTEC CORP	9,000	81.30	731,700.00
XYLEM INC	17,000	51.85	881,450.00
AERCAP HOLDINGS NV	15,000	46.02	690,300.00
FASTENAL CO	29,300	45.50	1,333,150.00
GRAINGER(W.W.) INC	5,540	187.77	1,040,245.80
UNITED RENTALS INC	8,500	111.70	949,450.00
CINTAS CORP	8,500	121.50	1,032,750.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	22,900	63.01	1,442,929.00
STERICYCLE INC	7,900	86.27	681,533.00
WASTE CONNECTIONS INC	17,500	91.94	1,608,950.00
WASTE MANAGEMENT INC	43,300	72.76	3,150,508.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,600	70.86	963,696.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	17,700	53.37	944,649.00
FEDEX CORPORATION	25,160	190.79	4,800,276.40
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	68,500	106.51	7,295,935.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,500	47.08	588,500.00
DELTA AIR LINES INC	17,700	49.56	877,212.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	58.28	891,684.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,600	78.55	596,980.00
AMERCO	680	369.58	251,314.40
CSX CORP	92,400	51.81	4,787,244.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,700	87.61	762,207.00

KANSAS CITY SOUTHERN	10,600	92.35	978,910.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,900	116.67	3,371,763.00	
UNION PAC CORP	81,900	109.96	9,005,724.00	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	7,600	80.35	610,660.00	
AUTOLIV INC	8,400	103.78	871,752.00	
BORGWARNER INC	21,300	41.90	892,470.00	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	26,900	88.27	2,374,463.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	24,800	35.51	880,648.00	
LEAR CORP	6,900	144.21	995,049.00	
FORD MOTOR COMPANY	363,000	11.16	4,051,080.00	
GENERAL MOTORS CO	137,000	34.26	4,693,620.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	16,800	56.22	944,496.00	
TESLA INC	12,710	321.26	4,083,214.60	
DR HORTON INC	36,100	33.21	1,198,881.00	
GARMIN LTD	11,400	52.01	592,914.00	
LEGGETT & PLATT INC	13,400	53.49	716,766.00	
LENNAR CORP-A	20,100	50.66	1,018,266.00	
MOHAWK INDUSTRIES	6,310	234.39	1,479,000.90	
NEWELL BRANDS INC	42,200	52.88	2,231,536.00	
PULTEGROUP INC	28,900	22.71	656,319.00	
TOLL BROTHERS INC	14,200	37.36	530,512.00	
WHIRLPOOL CORP	7,610	184.50	1,404,045.00	
HASBRO INC	10,700	101.19	1,082,733.00	
MATTEL INC	33,400	22.43	749,162.00	
POLARIS INDUSTRIES INC	6,200	91.20	565,440.00	
COACH INC	27,900	45.20	1,261,080.00	
HANESBRANDS INC	37,700	22.49	847,873.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,600	52.05	551,730.00	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,100	38.65	622,265.00	
NIKE INC-B	132,900	54.89	7,294,881.00	
PVH CORP	8,000	102.76	822,080.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	5,800	84.05	487,490.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	18,400	21.39	393,576.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	18,700	19.81	370,447.00	
	33,400	55.58	1,856,372.00	

V F CORP				
ARAMARK	23,200	37.40	867,680.00	
CARNIVAL CORP	34,800	63.22	2,200,056.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,900	479.13	1,389,477.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,800	87.27	1,029,786.00	
DOMINOS PIZZA INC	4,610	195.36	900,609.60	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	18,966	62.33	1,182,150.78	
LAS VEGAS SANDS CORP	43,800	58.04	2,542,152.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	33,200	102.50	3,403,000.00	
MCDONALD'S CORP	82,400	144.36	11,895,264.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	18,400	22.05	405,720.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,900	30.96	1,390,104.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	16,100	55.78	898,058.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,900	108.82	1,839,058.00	
STARBUCKS CORP	144,600	60.98	8,817,708.00	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,900	96.67	1,053,703.00	
WYNN RESORTS LTD	7,700	123.46	950,642.00	
YUM BRANDS INC	34,600	68.76	2,379,096.00	
CBS CORP-CL B	38,800	63.56	2,466,128.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	21,530	325.52	7,008,445.60	
COMCAST CORP-CL A	472,600	39.08	18,469,208.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	14,300	26.66	381,238.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,200	26.00	551,200.00	
DISH NETWORK CORP-A	21,800	61.24	1,335,032.00	
DISNEY (WALT) CO	149,900	112.07	16,799,293.00	
INTERPUBRIC GROUP	39,200	24.45	958,440.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	10,100	85.99	868,499.00	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	59,500	30.36	1,806,420.00	
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	11,286	21.52	242,874.72	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	30.85	740,400.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	19,300	37.14	716,802.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	9,870	37.33	368,447.10	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	37,400	13.11	490,314.00	
OMNICOM GROUP	23,000	84.00	1,932,000.00	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,800	69.79	544,362.00	
	163,000	4.87	793,810.00	

SIRIUS XM HOLDINGS INC			
TEGNA INC	20,600	24.05	495,430.00
TIME WARNER INC	76,700	98.13	7,526,571.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	104,500	28.23	2,950,035.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	42,800	27.96	1,196,688.00
VIACOM INC-CLASS B	34,100	36.23	1,235,443.00
GENUINE PARTS CO	14,400	92.83	1,336,752.00
LKQ CORP	30,000	31.41	942,300.00
AMAZON.COM INC	40,010	952.82	38,122,328.20
EXPEDIA INC	12,300	139.40	1,714,620.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	42,300	23.70	1,002,510.00
NETFLIX INC	42,700	157.46	6,723,542.00
PRICELINE GROUP INC/THE	4,901	1,911.13	9,366,448.13
TRIPADVISOR INC	12,300	46.92	577,116.00
DOLLAR GENERAL CORP	28,300	73.69	2,085,427.00
DOLLAR TREE INC	23,700	82.78	1,961,886.00
KOHL'S CORP	17,200	39.82	684,904.00
MACYS INC	30,400	29.30	890,720.00
NORDSTROM INC	12,700	49.35	626,745.00
TARGET CORP	52,800	58.08	3,066,624.00
ADVANCE AUTO PARTS	7,110	146.12	1,038,913.20
AUTONATION INC	7,100	40.14	284,994.00
AUTOZONE	2,870	707.05	2,029,233.50
BED BATH & BEYOND	15,600	37.54	585,624.00
BEST BUY COMPANY INC	28,400	51.82	1,471,688.00
CARMAX INC	18,300	60.28	1,103,124.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,200	51.68	423,776.00
FOOT LOCKER INC	13,400	76.67	1,027,378.00
GAP INC	22,900	26.41	604,789.00
HOME DEPOT	120,800	157.68	19,047,744.00
L BRANDS, INC	24,000	52.90	1,269,600.00
LOWE'S COS INC	86,500	85.85	7,426,025.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,250	255.75	2,365,687.50
ROSS STORES INC	39,000	65.22	2,543,580.00

SIGNET JEWELERS LTD	5,400	64.95	350,730.00
STAPLES INC	62,000	9.62	596,440.00
TIFFANY & CO	11,900	92.46	1,100,274.00
TJX COS INC	64,300	78.98	5,078,414.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13,000	61.84	803,920.00
ULTA BEAUTY INC	5,980	299.57	1,791,428.60
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	43,460	172.68	7,504,672.80
CVS HEALTH CORP	106,000	81.10	8,596,600.00
KROGER CO	88,900	29.05	2,582,545.00
RITE AID CORP	99,000	4.07	402,930.00
SYSCO CORP	51,500	54.91	2,827,865.00
WAL-MART STORES INC	153,500	76.72	11,776,520.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	91,500	85.98	7,867,170.00
WHOLE FOODS MARKET INC	31,600	36.57	1,155,612.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	20,000	49.41	988,200.00
COCA COLA CO	406,300	43.51	17,678,113.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	17,590	177.77	3,126,974.30
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,800	90.51	1,611,078.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	18,800	92.80	1,744,640.00
MONSTER BEVERAGE CORP	40,200	47.99	1,929,198.00
PEPSICO INC	142,200	112.72	16,028,784.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	57,100	42.36	2,418,756.00
BUNGE LIMITED	13,800	69.43	958,134.00
CAMPBELL SOUP CO	19,100	57.17	1,091,947.00
CONAGRA BRANDS INC	40,000	37.29	1,491,600.00
GENERAL MILLS	58,000	56.37	3,269,460.00
HERSHEY CO/THE	14,400	106.41	1,532,304.00
HORMEL FOODS CORP	29,400	34.58	1,016,652.00
INGREDION INC	6,800	118.41	805,188.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	11,300	125.49	1,418,037.00
KELLOGG CO	25,500	70.85	1,806,675.00
KRAFT HEINZ CO/THE	60,600	89.20	5,405,520.00
MCCORMICK & CO INC.	11,300	99.72	1,126,836.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,800	88.85	1,581,530.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	153,600	44.30	6,804,480.00

TYSON FOODS INC-CL A	28,900	57.88	1,672,732.00	
ALTRIA GROUP INC	193,500	70.29	13,601,115.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	153,800	111.93	17,214,834.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	85,200	64.82	5,522,664.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	25,700	50.29	1,292,453.00	
CLOROX CO	12,400	132.43	1,642,132.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	84,000	71.50	6,006,000.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	35,700	128.21	4,577,097.00	
PROCTER & GAMBLE CO	253,500	86.40	21,902,400.00	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,600	126.62	329,212.00	
COTY INC-CL A	47,635	17.83	849,332.05	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,800	73.89	428,562.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	22,400	92.98	2,082,752.00	
ABBOTT LABORATORIES	171,100	44.67	7,643,037.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,100	138.17	981,007.00	
BARD (C R)	7,320	305.97	2,239,700.40	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	48,500	56.14	2,722,790.00	
BECTON,DICKINSON	21,190	180.66	3,828,185.40	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	134,600	26.38	3,550,748.00	
DANAHER CORP	62,000	83.17	5,156,540.00	
DENTSPLY SIRONA INC	23,400	63.25	1,480,050.00	
DEXCOM INC	8,300	71.99	597,517.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	21,100	109.99	2,320,789.00	
HOLOGIC INC	24,700	45.57	1,125,579.00	
IDEXX LABORATORIES INC	8,600	162.06	1,393,716.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,830	843.17	3,229,341.10	
MEDTRONIC PLC	138,300	83.34	11,525,922.00	
RESMED INC	14,100	67.46	951,186.00	
STRYKER CORP	33,600	134.87	4,531,632.00	
TELEFLEX INC	4,330	194.40	841,752.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,700	207.65	975,955.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,600	96.01	921,696.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,700	118.66	2,337,602.00	
AETNA INC	35,000	142.40	4,984,000.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,600	87.54	1,453,164.00	

ANTHEM INC	26,260	177.73	4,667,189.80
CARDINAL HEALTH INC	32,100	72.39	2,323,719.00
CENTENE CORP	16,800	75.73	1,272,264.00
CIGNA CORP	25,600	162.65	4,163,840.00
DAVITA INC	15,700	65.87	1,034,159.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	11,600	55.99	649,484.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	60,400	62.08	3,749,632.00
HCA HEALTHCARE INC	29,700	84.13	2,498,661.00
HENRY SCHEIN INC	8,070	177.41	1,431,698.70
HUMANA INC	14,630	230.59	3,373,531.70
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,300	142.03	1,462,909.00
MCKESSON CORP	22,400	142.49	3,191,776.00
MEDNAX INC	9,100	54.43	495,313.00
PATTERSON COS INC	8,700	44.18	384,366.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,300	107.28	1,426,824.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	95,470	173.24	16,539,222.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,600	122.50	1,053,500.00
ABBVIE INC	161,300	66.17	10,673,221.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	22,200	124.70	2,768,340.00
ALKERMES PLC	15,200	57.34	871,568.00
AMGEN INC	73,800	163.22	12,045,636.00
BIOGEN INC	21,660	261.28	5,659,324.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,800	91.15	1,531,320.00
CELGENE CORP	77,000	120.10	9,247,700.00
GILEAD SCIENCES INC	130,900	67.61	8,850,149.00
INCYTE CORP	16,700	119.73	1,999,491.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,620	427.18	3,255,111.60
SEATTLE GENETICS INC	9,700	61.74	598,878.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,340	124.79	541,588.60
VERTEX PHARMACEUTICALS	24,600	116.63	2,869,098.00
ALLERGAN PLC	37,260	238.51	8,886,882.60
BRISTOL MYERS SQUIBB	166,000	55.32	9,183,120.00
ELI LILLY & CO.	98,700	80.79	7,973,973.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,100	158.35	965,935.00
JOHNSON & JOHNSON	269,500	123.21	33,205,095.00

MALLINCKRODT PLC	9,700	44.55	432,135.00
MERCK & CO INC	273,400	63.29	17,303,486.00
MYLAN NV	45,400	38.01	1,725,654.00
PERRIGO CO PLC	13,800	74.73	1,031,274.00
PFIZER INC	601,600	33.38	20,081,408.00
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	1,500	114.31	171,465.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	91,400	31.15	2,847,110.00
ZOETIS INC	45,800	59.43	2,721,894.00
BANK OF AMERICA CORP	1,001,500	23.98	24,015,970.00
BB&T CORPORATION	79,500	43.47	3,455,865.00
CIT GROUP INC	19,400	46.70	905,980.00
CITIGROUP	282,600	60.23	17,020,998.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,400	37.18	1,873,872.00
COMERICA INC	17,300	71.21	1,231,933.00
FIFTH THIRD BANCORP	73,700	24.84	1,830,708.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,500	92.84	1,439,020.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107,000	12.93	1,383,510.00
JPMORGAN CHASE & CO	354,500	86.75	30,752,875.00
KEYCORP	107,700	18.47	1,989,219.00
M & T BANK CORP	13,700	159.31	2,182,547.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	35,400	17.34	613,836.00
PNC FINANCIAL	47,900	121.96	5,841,884.00
REGIONS FINANCIAL CORP	121,000	14.21	1,719,410.00
SIGNATURE BANK	5,070	136.40	691,548.00
SUNTRUST BKS INC.	48,600	57.62	2,800,332.00
US BANCORP	168,900	51.58	8,711,862.00
WELLS FARGO CO	472,800	54.68	25,852,704.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	121,410	163.46	19,845,678.60
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,200	25.30	814,660.00
VOYA FINANCIAL INC	18,700	36.63	684,981.00
AFLAC INC	40,000	73.86	2,954,400.00
ALLEGHANY CORP	1,510	578.21	873,097.10
ALLSTATE CORP	36,100	84.17	3,038,537.00
AMERICAN INTL GROUP	102,200	61.82	6,318,004.00
AON PLC	25,700	124.30	3,194,510.00

ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,100	95.37	1,153,977.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,000	55.22	993,960.00
ASSURANT INC	6,000	104.43	626,580.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,500	64.16	545,360.00
CHUBB LTD	46,300	136.32	6,311,616.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,500	68.99	1,069,345.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,010	243.06	974,670.60
FNF GROUP	24,400	40.36	984,784.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	37,700	49.26	1,857,102.00
LINCOLN NATIONAL CORP	22,300	68.61	1,530,003.00
LOEWS CORP	27,700	46.33	1,283,341.00
MARKEL CORP	1,340	961.74	1,288,731.60
MARSH & MCLENNAN COS	50,900	73.65	3,748,785.00
METLIFE INC	93,100	52.31	4,870,061.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	27,900	63.46	1,770,534.00
PROGRESSIVE CO	56,500	40.32	2,278,080.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,900	107.88	4,628,052.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,300	124.55	784,665.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,200	139.01	583,842.00
TORCHMARK CORP	11,200	76.04	851,648.00
TRAVELERS COS INC/THE	28,400	119.95	3,406,580.00
UNUM GROUP	22,500	46.39	1,043,775.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,600	142.11	1,790,586.00
WR BERKLEY CORP	9,900	65.81	651,519.00
XL GROUP LTD	26,400	42.00	1,108,800.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	16,600	50.40	836,640.00
ALPHABET INC-CL A	29,340	956.71	28,069,871.40
ALPHABET INC-CL C	30,780	932.17	28,692,192.60
COSTAR GROUP INC	3,210	252.25	809,722.50
EBAY INC	104,900	33.72	3,537,228.00
FACEBOOK INC-A	231,900	150.48	34,896,312.00
MERCADOLIBRE INC	3,910	281.77	1,101,720.70
TWITTER INC	58,400	18.37	1,072,808.00
VERISIGN INC	9,700	89.00	863,300.00
YAHOO! INC	90,400	49.49	4,473,896.00

ZILLOW GROUP INC - C	10,900	42.64	464,776.00
ACCENTURE PLC-CL A	61,700	121.07	7,470,019.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,220	260.21	1,358,296.20
AUTOMATIC DATA PROCESS	44,500	97.08	4,320,060.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	11,400	68.36	779,304.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	60,000	64.17	3,850,200.00
DXC TECHNOLOGY CO	27,819	79.00	2,197,701.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	31,300	83.15	2,602,595.00
FIRST DATA CORP- CLASS A	30,200	16.48	497,696.00
FISERV INC	21,500	119.73	2,574,195.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,850	134.89	1,193,776.50
GARTNER INC	9,100	113.69	1,034,579.00
GLOBAL PAYMENTS INC	15,600	87.27	1,361,412.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	89,600	152.11	13,629,056.00
MASTERCARD INC	95,600	116.41	11,128,796.00
PAYCHEX INC	31,500	58.02	1,827,630.00
PAYPAL HOLDINGS INC	108,200	49.22	5,325,604.00
SABRE CORP	20,000	24.70	494,000.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,300	57.93	944,259.00
VANTIV INC - CL A	16,100	64.54	1,039,094.00
VISA INC-CLASS A SHARES	185,200	92.00	17,038,400.00
WESTERN UNION CO	45,800	19.49	892,642.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	59,500	54.62	3,249,890.00
ADOBE SYSTEMS INC.	49,500	135.60	6,712,200.00
ANSYS INC	8,300	121.29	1,006,707.00
AUTODESK INC.	19,900	94.74	1,885,326.00
CA INC	30,900	32.05	990,345.00
CADENCE DESIGN SYS INC	29,100	33.00	960,300.00
CDK GLOBAL INC	12,800	62.11	795,008.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	13,200	106.04	1,399,728.00
CITRIX SYSTEMS INC	15,800	86.82	1,371,756.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	21,701	67.24	1,459,175.24
ELECTRONIC ARTS	29,900	96.01	2,870,699.00
FORTINET INC	13,900	39.06	542,934.00

INTUIT INC	24,100	126.73	3,054,193.00
MICROSOFT CORP	731,600	69.04	50,509,664.00
MOBILEYE NV	17,000	61.70	1,048,900.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	25,000	18.16	454,000.00
ORACLE CORPORATION	305,500	45.48	13,894,140.00
RED HAT INC	17,800	88.58	1,576,724.00
SALESFORCE.COM INC	63,600	87.13	5,541,468.00
SERVICENOW INC	16,600	97.33	1,615,678.00
SPLUNK INC	12,800	66.77	854,656.00
SYMANTEC CORP	60,800	32.37	1,968,096.00
SYNOPSYS INC	14,900	74.12	1,104,388.00
VMWARE INC - CLASS A	6,200	94.06	583,172.00
WORKDAY INC-CLASS A	12,000	89.78	1,077,360.00
CISCO SYSTEMS	497,800	33.90	16,875,420.00
F5 NETWORKS INC	6,200	130.84	811,208.00
HARRIS CORP	11,900	108.50	1,291,150.00
JUNIPER NETWORKS INC	33,500	30.68	1,027,780.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,500	84.77	1,229,165.00
PALO ALTO NETWORKS INC	9,000	118.30	1,064,700.00
APPLE INC	528,000	153.99	81,306,720.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	163,200	18.78	3,064,896.00
HP INC	167,000	19.24	3,213,080.00
NETAPP INC	26,700	40.13	1,071,471.00
SEAGATE TECHNOLOGY	28,600	42.83	1,224,938.00
WESTERN DIGITAL CORP	27,800	88.88	2,470,864.00
XEROX CORP	84,000	7.04	591,360.00
AMPHENOL CORP-CL A	30,400	72.66	2,208,864.00
ARROW ELECTRS INC	8,900	76.50	680,850.00
AVNET	12,200	37.45	456,890.00
CDW CORPORATION	14,000	59.48	832,720.00
CORNING INC	94,300	29.08	2,742,244.00
FLEX LTD	50,500	15.34	774,670.00
FLIR SYSTEMS INC	12,700	37.08	470,916.00
TE CONNECTIVITY LTD	35,600	75.81	2,698,836.00
TRIMBLE INC	25,600	35.67	913,152.00

ADVANCED MICRO DEVICES	78,000	10.18	794,040.00	
ANALOG DEVICES INC	35,700	78.50	2,802,450.00	
APPLIED MATERIALS	107,800	42.04	4,531,912.00	
BROADCOM LTD	39,970	228.46	9,131,546.20	
INTEL CORP	470,000	36.37	17,093,900.00	
KLA TENCOR CORP	15,000	100.81	1,512,150.00	
LAM RESEARCH	16,000	150.54	2,408,640.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	41,000	15.54	637,140.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	28,800	45.90	1,321,920.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	21,600	76.45	1,651,320.00	
MICRON TECHNOLOGY	104,300	28.81	3,004,883.00	
NVIDIA CORP	53,100	102.94	5,466,114.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,000	106.77	2,989,560.00	
QORVO INC	12,700	66.16	840,232.00	
QUALCOMM INC	146,800	55.15	8,096,020.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,100	101.93	1,844,933.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	99,300	79.45	7,889,385.00	
XILINX INC	25,000	64.69	1,617,250.00	
AT & T INC	608,700	38.22	23,264,514.00	
CENTURYLINK INC	55,400	25.03	1,386,662.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	114,000	1.43	163,020.00	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	30,100	59.84	1,801,184.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	404,200	46.42	18,762,964.00	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,500	35.02	542,810.00	
SPRINT CORP	75,000	7.90	592,500.00	
T-MOBILE US INC	28,300	65.50	1,853,650.00	
ALLIANT ENERGY CORP	22,900	39.57	906,153.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	48,200	67.31	3,244,342.00	
DUKE ENERGY CORP	68,600	82.11	5,632,746.00	
EDISON INTERNATIONAL	31,700	79.53	2,521,101.00	
ENERGY CORP	18,200	75.23	1,369,186.00	
EVERSOURCE ENERGY	30,700	59.35	1,822,045.00	
EXELON CORPORATION	90,500	33.59	3,039,895.00	
FIRSTENERGY CORP	41,800	28.76	1,202,168.00	
NEXTERA ENERGY INC	46,000	133.77	6,153,420.00	

OGE ENERGY CORP	19,600	33.61	658,756.00	
PG&E CORP	49,600	66.77	3,311,792.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,100	84.14	933,954.00	
PPL CORPORATION	66,800	38.37	2,563,116.00	
SOUTHERN CO.	96,700	49.98	4,833,066.00	
WESTAR ENERGY INC	13,400	52.33	701,222.00	
XCEL ENERGY INC	49,400	44.77	2,211,638.00	
ATMOS ENERGY CORP	10,500	80.55	845,775.00	
UGI CORP	16,300	49.27	803,101.00	
AMEREN CORPORATION	24,300	54.21	1,317,303.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	41,200	27.45	1,130,940.00	
CMS ENERGY CORP	27,300	44.90	1,225,770.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	30,200	78.81	2,380,062.00	
DOMINION RESOURCES INC/VA	62,500	77.48	4,842,500.00	
DTE ENERGY COMPANY	17,900	103.97	1,861,063.00	
NISOURCE INC	30,300	24.10	730,230.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	50,800	42.95	2,181,860.00	
SCANA CORP	12,900	65.51	845,079.00	
SEMPRA ENERGY	23,800	111.53	2,654,414.00	
WEC ENERGY GROUP INC	30,600	60.94	1,864,764.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,800	75.30	1,340,340.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	47,100	13.08	616,068.00	
ALLY FINANCIAL INC	42,100	19.75	831,475.00	
AMERICAN EXPRESS CO	76,600	78.44	6,008,504.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	47,200	82.32	3,885,504.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,500	60.70	2,336,950.00	
NAVIENT CORP	29,900	14.60	436,540.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	80,500	28.10	2,262,050.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,200	154.00	800,800.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,700	128.91	2,023,887.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	104,200	47.12	4,909,904.00	
BLACKROCK INC	12,120	380.50	4,611,660.00	
CME GROUP INC	33,200	117.64	3,905,648.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	28,000	35.63	997,640.00	
EATON VANCE CORP	11,700	44.39	519,363.00	

FRANKLIN RESOURCES INC	35,900	43.43	1,559,137.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	35,570	223.76	7,959,143.20	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	58,400	58.91	3,440,344.00	
INVESCO LTD	39,600	32.56	1,289,376.00	
MOODYS CORP	16,800	116.71	1,960,728.00	
MORGAN STANLEY	139,800	42.83	5,987,634.00	
MSCI INC	8,500	97.65	830,025.00	
NASDAQ INC	11,100	66.75	740,925.00	
NORTHERN TRUST CORP	21,700	90.79	1,970,143.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,100	75.52	913,792.00	
S&P GLOBAL INC	25,400	137.31	3,487,674.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	118,900	40.50	4,815,450.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,700	51.04	648,208.00	
STATE STREET CORP	38,200	83.45	3,187,790.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,900	71.52	1,709,328.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,300	39.06	988,344.50	
H & R BLOCK INC	22,400	25.88	579,712.00	
AES CORP	65,000	11.34	737,100.00	
CALPINE CORP	34,700	10.07	349,429.00	
CERNER CORP	30,100	64.85	1,951,985.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,700	56.87	1,859,649.00	
ILLUMINA INC	14,720	183.59	2,702,444.80	
METTLER-TOLEDO INTL	2,620	547.43	1,434,266.60	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	14,200	84.27	1,196,634.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,900	172.12	6,695,468.00	
WATERS CORP	8,000	174.50	1,396,000.00	
DUN & BRADSTREET CORP	3,600	112.75	405,900.00	
EQUIFAX INC	11,700	135.87	1,589,679.00	
IHS MARKIT LTD	35,373	43.50	1,538,725.50	
MANPOWERGROUP INC	6,200	103.36	640,832.00	
NIELSEN HOLDINGS PLC	36,200	40.79	1,476,598.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	13,300	47.93	637,469.00	
VERISK ANALYTICS INC	16,000	79.26	1,268,160.00	
CBRE GROUP INC	29,600	36.26	1,073,296.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,000	7.60	866,400.00	

	JONES LANG LASALLE INC	4,700	121.09	569,123.00	
小計	銘柄数：596			2,082,476,251.82	
				(237,110,746,032)	
	組入時価比率：62.5%			65.0%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	16,600	31.23	518,418.00	
	ARC RESOURCES LTD	32,900	17.74	583,646.00	
	CAMECO CORP	38,600	13.68	528,048.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	108,300	42.35	4,586,505.00	
	CENOVUS ENERGY INC	103,000	13.05	1,344,150.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	53,700	13.11	704,007.00	
	ENBRIDGE INC	162,000	56.61	9,170,820.00	
	ENCANA CORP	95,000	15.04	1,428,800.00	
	HUSKY ENERGY INC	35,745	16.05	573,707.25	
	IMPERIAL OIL	28,500	39.45	1,124,325.00	
	INTER PIPELINE LTD	36,200	28.00	1,013,600.00	
	KEYERA CORP	17,800	40.62	723,036.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	39,600	43.76	1,732,896.00	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	17,200	25.71	442,212.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	20,726	28.94	599,810.44	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,600	25.61	578,786.00	
	SUNCOR ENERGY INC	165,900	43.11	7,151,949.00	
	TOURMALINE OIL CORP	21,600	27.67	597,672.00	
	TRANSCANADA CORP	86,200	63.83	5,502,146.00	
	VERESEN INC	29,000	18.60	539,400.00	
	VERMILION ENERGY INC	12,000	48.28	579,360.00	
	AGRIUM INC	13,200	125.83	1,660,956.00	
	METHANEX CORP	8,200	58.27	477,814.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	81,200	22.64	1,838,368.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,660	311.11	827,552.60	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,600	63.48	1,371,168.00	
	BARRICK GOLD	115,800	22.35	2,588,130.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	70,800	4.87	344,796.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,000	11.56	751,400.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	17,900	92.41	1,654,139.00	
	GOLDCORP INC	82,900	18.78	1,556,862.00	

KINROSS GOLD CORP	118,600	5.14	609,604.00
SILVER WHEATON CORP	45,400	26.40	1,198,560.00
TECK RESOURCES LTD	54,900	24.85	1,364,265.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	98,000	3.55	347,900.00
YAMANA GOLD INC	97,000	3.42	331,740.00
WEST FRASER TIMBER	6,800	60.50	411,400.00
BOMBARDIER B SHEARS	189,000	2.05	387,450.00
CAE INC	26,000	21.86	568,360.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,500	53.97	782,565.00
FINNING INTERNATIONAL INC	15,200	26.21	398,392.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	76,400	101.89	7,784,396.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,600	213.29	2,900,744.00
LINAMAR CORP	4,800	58.62	281,376.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	37,700	58.90	2,220,530.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,800	39.20	815,360.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	22,600	81.26	1,836,476.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	40,400	29.17	1,178,468.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,000	164.69	1,152,830.00
DOLLARAMA INC	10,700	122.74	1,313,318.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	42,300	64.11	2,711,853.00
EMPIRE CO LTD A	16,200	21.01	340,362.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	22.36	210,184.00
LOBLAW COMPANIES	22,300	77.69	1,732,487.00
METRO INC	23,200	46.20	1,071,840.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,800	124.69	598,512.00
SAPUTO INC	25,900	44.48	1,152,032.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	31,300	16.58	518,954.00
BANK OF MONTREAL	64,400	95.70	6,163,080.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	120,100	75.91	9,116,791.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	38,900	108.36	4,215,204.00
NATIONAL BANK OF CANADA	33,400	52.90	1,766,860.00
ROYAL BANK OF CANADA	147,500	92.94	13,708,650.00
TORONTO DOMINION BANK	184,600	63.62	11,744,252.00

	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	36,000	11.35	408,600.00	
	ONEX CORPORATION	8,000	99.70	797,600.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,350	606.00	1,424,100.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	30,000	34.90	1,047,000.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,900	57.00	564,300.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,600	92.00	1,159,200.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	193,400	24.49	4,736,366.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	37,900	30.94	1,172,626.00	
	POWER FINANCIAL CORP	24,300	34.15	829,845.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	61,600	48.88	3,011,008.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	21,400	65.62	1,404,268.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,910	684.00	1,306,440.00	
	OPEN TEXT CORP	26,200	45.13	1,182,406.00	
	BLACKBERRY LTD	50,900	12.99	661,191.00	
	BCE INC	15,400	61.88	952,952.00	
	TELUS CORP	19,300	45.68	881,624.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	36,100	62.98	2,273,578.00	
	EMERA INC	4,900	47.21	231,329.00	
	FORTIS INC	38,400	44.19	1,696,896.00	
	HYDRO ONE LTD	17,300	23.13	400,149.00	
	ATCO LTD CL1	6,800	50.01	340,068.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	12,400	39.81	493,644.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	87,900	51.16	4,496,964.00	
	CI FINANCIAL CORP	24,200	26.73	646,866.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	39.49	406,747.00	
	THOMSON REUTERS CORP	32,400	60.61	1,963,764.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,300	20.19	228,147.00	
小計	銘柄数：91			168,746,952.29	
				(14,014,434,387)	
	組入時価比率：3.7%			3.8%	
ユ一ロ	SAIPEM SPA	589,700	0.40	235,880.00	
	TENARIS SA	46,000	14.12	649,520.00	
	ENAGAS	22,800	25.34	577,866.00	
	ENI SPA	254,000	14.74	3,743,960.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	50,000	13.97	698,750.00	

NESTE OYJ	12,500	37.73	471,625.00
OMV AG	15,000	42.89	643,350.00
REPSOL SA	108,781	14.65	1,594,185.55
SNAM SPA	233,000	4.24	988,386.00
TOTAL SA	225,900	47.82	10,803,667.50
VOPAK	7,100	42.27	300,117.00
AIR LIQUIDE	38,400	114.40	4,392,960.00
AKZO NOBEL	24,800	77.00	1,909,600.00
ARKEMA	6,700	97.61	653,987.00
BASF SE	91,200	89.93	8,201,616.00
COVESTRO AG	8,800	71.10	625,680.00
EVONIK INDUSTRIES AG	16,900	31.53	532,857.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	48.15	308,192.00
K+S AG	18,800	22.90	430,614.00
KONINKLIJKE DSM NV	18,000	65.52	1,179,360.00
LANXESS	8,900	67.42	600,038.00
LINDE AG	18,220	170.85	3,112,887.00
SOLVAY SA	7,300	122.05	890,965.00
SYMRISE AG	12,100	64.50	780,450.00
UMICORE	9,400	58.53	550,182.00
CRH PLC	82,300	34.39	2,830,297.00
HEIDELBERGCEMENT AG	14,300	89.69	1,282,567.00
IMERYS	3,800	77.28	293,664.00
ARCELORMITTAL	178,000	7.18	1,278,930.00
THYSSENKRUPP AG	36,300	22.44	814,753.50
VOESTALPINE AG	11,000	38.42	422,620.00
STORA ENSO OYJ-R	54,000	11.12	600,480.00
UPM-KYMMENE OYJ	52,900	24.53	1,297,637.00
AIRBUS SE	57,800	75.50	4,363,900.00
DASSAULT AVIATION SA	200	1,309.50	261,900.00
LEONARDO SPA	41,000	15.42	632,220.00
SAFRAN SA	31,300	77.71	2,432,323.00
THALES SA	10,500	98.48	1,034,040.00
ZODIAC AEROSPACE	19,500	22.60	440,700.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	49,600	51.03	2,531,088.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	24,000	35.28	846,720.00

BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	9,300	34.33	319,315.50
BOUYGUES	20,100	38.46	773,046.00
EIFFAGE SA	6,100	78.90	481,290.00
FERROVIAL SA	46,466	19.70	915,612.53
FERROVIAL SA-RIGHTS	46,466	0.32	14,915.58
HOCHTIEF AG	2,000	171.30	342,600.00
VINCI	50,100	79.00	3,957,900.00
LEGRAND SA	26,400	61.33	1,619,112.00
OSRAM LICHT AG	8,850	67.23	594,985.50
PRYSMIAN SPA	19,400	26.87	521,278.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	55,500	71.18	3,950,490.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	93,900	33.00	3,098,700.00
SIEMENS AG	75,900	131.65	9,992,235.00
ALSTOM	15,500	30.44	471,820.00
ANDRITZ AG	7,200	54.87	395,064.00
CNH INDUSTRIAL NV	99,000	9.92	982,575.00
GEA GROUP AG	18,600	39.50	734,793.00
KONE OYJ	34,100	42.72	1,456,752.00
MAN SE	3,700	97.60	361,120.00
METSO OYJ	10,300	32.03	329,909.00
WARTSILA OYJ	14,700	54.75	804,825.00
ZARDOYA OTIS S.A	17,546	8.60	150,895.60
BRENNTAG AG	15,190	56.18	853,374.20
REXEL SA	28,600	15.96	456,599.00
EDENRED	21,400	24.40	522,267.00
SOCIETE BIC SA	2,810	107.90	303,199.00
BOLLORE	87,000	3.94	343,476.00
DEUTSCHE POST AG-REG	96,000	32.85	3,153,600.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,600	16.65	376,290.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	80,000	7.24	579,600.00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	63,010	16.30	1,027,063.00
ADP	2,800	127.65	357,420.00
AENA SA	6,500	164.00	1,066,000.00
ATLANTIA SPA	41,700	24.20	1,009,140.00
FRAPORT AG	3,800	72.35	274,930.00

GRUPE EUROTUNNEL SE - REGR	45,000	10.42	469,125.00	
CONTINENTAL AG	10,920	205.10	2,239,692.00	
MICHELIN (CGDE)	18,200	120.90	2,200,380.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	11,300	38.19	431,547.00	
SCHAEFFLER AG	16,000	15.56	248,960.00	
VALEO SA	23,900	65.56	1,566,884.00	
BAYER MOTOREN WERK	32,800	89.53	2,936,584.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	5,300	77.92	412,976.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	95,700	68.59	6,564,063.00	
FERRARI NV	12,500	78.00	975,000.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,000	10.18	906,020.00	
PEUGEOT CITROEN	47,300	19.35	915,255.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	15,200	53.80	817,760.00	
RENAULT SA	18,600	85.02	1,581,372.00	
VOLKSWAGEN AG	3,250	148.15	481,487.50	
VOLKSWAGEN AG-PREF	18,400	144.25	2,654,200.00	
SEB SA	2,000	153.45	306,900.00	
ADIDAS AG	18,450	183.85	3,392,032.50	
CHRISTIAN DIOR SE	5,380	254.00	1,366,520.00	
HERMES INTERNATIONAL	2,620	447.35	1,172,057.00	
HUGO BOSS AG	6,300	68.69	432,747.00	
KERING SA	7,470	289.20	2,160,324.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	16,500	54.55	900,075.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,730	233.65	6,479,114.50	
ACCOR SA	16,400	41.90	687,160.00	
PADDY POWER PLC	8,700	99.65	866,955.00	
SODEXO	8,900	119.45	1,063,105.00	
ALTICE NV - A	36,830	23.10	850,957.15	
ALTICE NV - B	10,010	23.09	231,180.95	
AXEL SPRINGER SE	4,400	53.73	236,412.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,300	22.13	360,719.00	
JC DECAUX SA	6,800	30.09	204,612.00	
LAGARDERE S.C.A	11,600	27.70	321,320.00	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	22,300	41.16	917,868.00	
PUBLICIS GROUPE	19,300	65.86	1,271,098.00	

RTL GROUP	3,900	72.77	283,803.00
SES FDR	34,400	20.95	720,680.00
TELENET GROUP HOLDING NV	5,200	57.42	298,584.00
VIVENDI SA	100,000	19.02	1,902,500.00
ZALANDO SE	8,100	40.53	328,333.50
INDITEX SA	106,800	36.53	3,901,938.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	55,200	21.90	1,209,156.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	54.45	321,255.00
COLRUYT SA	7,300	47.47	346,531.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	66,000	5.58	368,412.00
JERONIMO MARTINS	26,700	17.00	453,900.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	127,000	19.55	2,482,850.00
METRO AG	18,200	30.00	546,000.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	75,700	109.30	8,274,010.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	21,900	37.03	810,957.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,700	80.83	784,051.00
HEINEKEN NV	23,200	85.36	1,980,352.00
PERNOD RICARD SA	21,300	120.20	2,560,260.00
REMY COINTREAU	2,300	95.38	219,374.00
DANONE	58,900	66.13	3,895,057.00
KERRY GROUP PLC-A	16,800	81.09	1,362,312.00
HENKEL AG & CO KGAA	10,600	109.20	1,157,520.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,900	126.55	2,265,245.00
BEIERSDORF AG	10,000	94.18	941,800.00
LOREAL-ORD	25,090	189.50	4,754,555.00
UNILEVER NV-CVA	161,800	49.14	7,951,661.00
ESSILOR INTERNATIONAL	20,400	121.60	2,480,640.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	21,600	85.75	1,852,200.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	40,600	79.02	3,208,212.00
GRIFOLS SA	28,800	25.30	728,784.00
BAYER AG-REG	82,100	115.70	9,498,970.00
MERCK KGAA	12,500	111.45	1,393,125.00
ORION OYJ	9,500	56.55	537,225.00
SANOFI	115,200	89.98	10,365,696.00
UCB SA	12,100	74.90	906,290.00

ABN AMRO GROUP NV-CVA	27,900	24.89	694,431.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	670,888	7.60	5,102,103.24	
BANCO DE SABADELL SA	530,000	1.85	983,680.00	
BANCO SANTANDER SA	1,448,000	6.15	8,916,784.00	
BANK OF IRELAND	2,850,000	0.25	721,050.00	
BANKIA SA	430,000	1.11	479,880.00	
BANKINTER S.A.	65,000	8.47	550,875.00	
BCO POPULAR ESPANOL	300,260	0.77	232,401.24	
BNP PARIBAS	111,500	66.66	7,432,590.00	
CAIXABANK	359,000	4.25	1,525,750.00	
COMMERZBANK AG	102,000	9.40	958,800.00	
CREDIT AGRICOLE SA	113,000	14.24	1,609,120.00	
ERSTE GROUP BANK AG	30,700	32.50	997,903.50	
ING GROEP NV	385,800	15.57	6,006,906.00	
INTESA SANPAOLO	1,266,000	2.84	3,605,568.00	
INTESA SANPAOLO-RSP	92,000	2.67	245,640.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	24,400	67.90	1,656,760.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	53,000	9.10	482,300.00	
NATIXIS	98,000	6.44	631,610.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	21.40	235,455.00	
SOCIETE GENERALE	75,800	49.58	3,758,164.00	
UNICREDIT SPA	189,000	15.90	3,005,100.00	
EURAZEO	4,069	65.27	265,583.63	
EXOR NV	10,400	53.70	558,480.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	7,800	87.30	680,940.00	
WENDEL	2,900	134.45	389,905.00	
AEGON NV	170,000	4.89	832,320.00	
AGEAS	19,000	38.91	739,290.00	
ALLIANZ SE-REG	45,410	173.55	7,880,905.50	
ASSICURAZIONI GENERALI	117,000	15.33	1,793,610.00	
AXA	193,200	24.51	4,735,332.00	
CNP ASSURANCES	16,500	20.22	333,712.50	
HANNOVER RUECK SE	6,200	115.65	717,030.00	
MAPFRE SA	98,000	3.22	316,344.00	

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,930	177.20	2,822,796.00
NN GROUP NV	32,400	32.46	1,051,704.00
POSTE ITALIANE SPA	50,000	6.39	319,750.00
SAMPO OYJ-A SHS	44,400	45.50	2,020,200.00
SCOR SE	15,400	35.62	548,625.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	2.20	236,042.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,900	43.57	562,053.00
AMADEUS IT GROUP SA	44,000	52.45	2,307,800.00
ATOS SE	8,600	125.50	1,079,300.00
CAP GEMINI SA	15,800	96.03	1,517,274.00
DASSAULT SYSTEMES SA	12,800	83.55	1,069,440.00
GEMALTO	8,500	55.50	471,750.00
SAP SE	97,600	95.20	9,291,520.00
NOKIA OYJ	583,000	5.67	3,308,525.00
INGENICO GROUP	5,500	86.82	477,510.00
ASML HOLDING NV	36,800	123.85	4,557,680.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	112,500	18.73	2,107,125.00
STMICROELECTRONICS NV	65,000	15.15	984,750.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	325,800	16.85	5,491,359.00
ELISA OYJ	14,500	33.49	485,605.00
ILIAD SA	2,710	230.00	623,300.00
KONINKLIJKE KPN NV	341,000	2.87	981,739.00
ORANGE SA	199,000	15.05	2,994,950.00
PROXIMUS	15,100	30.22	456,397.50
SFR GROUP SA	7,700	31.50	242,550.00
TELECOM ITALIA SPA	1,130,000	0.89	1,010,220.00
TELECOM ITALIA-RNC	570,000	0.73	417,525.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	74,600	4.34	323,987.80
TELEFONICA SA	452,000	10.44	4,721,140.00
ELECTRICITE DE FRANCE	37,000	8.70	322,085.00
ENDESA S.A.	31,700	21.82	691,852.50
ENEL SPA	747,000	4.55	3,398,850.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	235,000	3.25	763,750.00
FORTUM OYJ	44,000	13.84	608,960.00
IBERDROLA SA	552,000	6.84	3,775,680.00

	RED ELECTRICA CORPORACION SA	43,200	18.95	818,640.00	
	TERNA SPA	152,000	4.92	747,840.00	
	GAS NATURAL SDG	35,800	20.89	748,041.00	
	E.ON SE	215,000	7.39	1,590,570.00	
	ENGIE	157,000	14.00	2,198,000.00	
	INNOGY SE	12,700	34.04	432,308.00	
	RWE AG	49,600	15.56	772,024.00	
	SUEZ	33,300	16.30	542,956.50	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	46,100	18.68	861,148.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	202,600	17.33	3,512,071.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	18,900	92.88	1,755,432.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,030	462.90	476,787.00	
	QIAGEN NV	21,474	29.21	627,255.54	
	BUREAU VERITAS SA	25,500	21.73	554,115.00	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,600	56.54	655,864.00	
	RELX NV	99,100	18.31	1,815,016.50	
	WOLTERS KLUWER	29,900	39.77	1,189,123.00	
	DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	34,200	32.90	1,125,180.00	
	IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00	
	VONOVIA SE	46,500	34.64	1,610,760.00	
小計	銘柄数：236			391,700,677.51	
				(48,594,386,051)	
	組入時価比率：12.8%			13.3%	
英債券	PETROFAC LTD	26,000	8.04	209,170.00	
	BP PLC	1,878,000	4.55	8,558,985.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	433,700	20.91	9,068,667.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	371,900	21.41	7,962,379.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,600	38.73	526,728.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,150	31.39	601,118.50	
	ANGLO AMERICAN PLC	136,400	10.20	1,391,962.00	
	ANTOFAGASTA PLC	41,000	7.61	312,010.00	
	BHP BILLITON PLC	207,100	11.50	2,381,650.00	
	FRESNILLO PLC	20,900	14.26	298,034.00	
	GLENCORE PLC	1,220,000	2.90	3,548,980.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	8,800	68.45	602,360.00	

RIO TINTO PLC-REG	123,300	29.68	3,660,160.50
MONDI PLC	37,200	20.23	752,556.00
BAE SYSTEMS PLC	315,000	6.43	2,025,450.00
COBHAM PLC	254,000	1.37	347,980.00
MEGGITT PLC	78,000	4.80	374,868.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	183,000	8.90	1,628,700.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC -C	12,993,000	0.00	12,993.00
DCC PLC	8,600	73.45	631,670.00
SMITHS GROUP PLC	37,100	16.58	615,118.00
IMI PLC	25,900	12.94	335,146.00
WEIR GROUP PLC	22,000	18.60	409,200.00
ASHTED GROUP PLC	47,600	16.00	761,600.00
BUNZLE	33,100	24.34	805,654.00
TRAVIS PERKINS PLC	24,700	16.30	402,610.00
WOLSELEY PLC	25,500	50.50	1,287,750.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	9.02	233,747.50
G4S PLC	152,000	3.17	482,904.00
ROYAL MAIL PLC	88,000	4.17	367,048.00
EASYJET PLC	16,300	13.01	212,063.00
GKN PLC	169,000	3.52	596,232.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	98,000	5.96	584,570.00
PERSIMMON PLC	29,500	24.02	708,590.00
TAYLOR WIMPEY PLC	319,000	1.99	636,086.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	12,400	33.35	413,540.00
BURBERRY GROUP PLC	41,900	16.02	671,238.00
CARNIVAL PLC	18,700	48.29	903,023.00
COMPASS GROUP PLC	161,100	15.95	2,569,545.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	17,409	42.34	737,097.06
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	69,000	5.08	350,865.00
TUI AG-DI	49,000	11.76	576,240.00
WHITBREAD PLC	18,800	40.74	765,912.00
WILLIAM HILL PLC	85,000	3.02	256,870.00
ITV PLC	353,000	2.00	708,824.00
PEARSON	78,000	7.34	572,520.00
SKY PLC	99,000	9.95	985,050.00

WPP PLC	126,700	17.01	2,155,167.00
MARKS & SPENCER PLC	153,000	3.80	581,400.00
NEXT PLC	14,000	43.29	606,060.00
DIXONS CARPHONE PLC	92,000	3.25	299,184.00
KINGFISHER PLC	214,000	3.42	733,378.00
MORRISON SUPERMARKETS	213,000	2.41	513,330.00
SAINSBURY	170,000	2.69	458,660.00
TESCO PLC	823,000	1.81	1,490,041.50
COCA-COLA HBC AG-CDI	16,700	21.95	366,565.00
DIAGEO PLC	250,200	22.91	5,732,082.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	36,200	28.10	1,017,220.00
TATE & LYLE ORD.	48,000	7.76	372,480.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	185,000	53.10	9,823,500.00
IMPERIAL BRANDS PLC	95,600	36.98	3,535,766.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	62,700	72.80	4,564,560.00
UNILEVER PLC	127,700	40.46	5,166,742.00
SMITH & NEPHEW PLC	89,100	13.01	1,159,191.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	8.20	307,687.50
SHIRE PLC	89,000	46.63	4,150,515.00
ASTRAZENECA PLC	125,800	47.10	5,925,809.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	484,200	16.00	7,747,200.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,900	19.79	275,081.00
BARCLAYS PLC	1,671,000	2.05	3,430,563.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,963,000	6.64	13,051,987.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,390,000	0.69	4,410,378.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	341,000	2.63	897,853.00
STANDARD CHARTERED PLC	322,000	7.20	2,321,298.00
ADMIRAL GROUP PLC	21,900	21.20	464,280.00
AVIVA PLC	406,000	5.35	2,174,130.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	136,083	3.57	487,041.05
LEGAL & GENERAL	577,000	2.53	1,460,387.00
OLD MUTUAL PLC	488,000	1.94	946,720.00
PRUDENTIAL PLC	256,700	17.50	4,492,250.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	98,750	6.22	614,225.00
ST JAMES S PLACE PLC	54,000	11.74	633,960.00

	STANDARD LIFE PLC	187,000	3.81	712,470.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	95,000	4.06	385,890.00	
	WORLDPAY GROUP PLC	184,000	3.16	581,440.00	
	SAGE GROUP PLC (THE)	105,000	6.98	733,425.00	
	BT GROUP PLC	837,000	3.06	2,561,220.00	
	INMARSAT PLC	42,500	7.68	326,612.50	
	VODAFONE GROUP PLC	2,647,000	2.05	5,430,320.50	
	SSE PLC	99,000	14.31	1,416,690.00	
	CENTRICA PLC	549,000	2.00	1,098,000.00	
	NATIONAL GRID PLC	375,000	10.32	3,870,000.00	
	SEVERN TRENT PLC	23,700	24.02	569,274.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,000	10.12	678,040.00	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	14,300	32.43	463,749.00	
	3I GROUP PLC	97,000	8.21	796,855.00	
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	94,000	2.94	276,830.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,000	14.08	352,000.00	
	INVESTEC PLC	61,000	5.84	356,545.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	31,700	33.86	1,073,362.00	
	SCHRODERS PLC	13,300	32.54	432,782.00	
	CAPITA PLC	64,000	5.74	367,680.00	
	EXPERIAN PLC	94,600	16.89	1,597,794.00	
	INTERTEK GROUP PLC	16,300	41.76	680,688.00	
	RELX PLC	105,800	16.07	1,700,206.00	
小計	銘柄数：105			181,674,027.61	
				(26,795,102,332)	
	組入時価比率：7.1%			7.3%	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	830	654.00	542,820.00	
	GIVAUDAN-REG	931	1,961.00	1,825,691.00	
	SIKA AG-BR	218	6,485.00	1,413,730.00	
	SYNGENTA AG-2ND LINE	9,130	460.00	4,199,800.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	45,700	56.75	2,593,475.00	
	GEBERIT AG-REG	3,580	459.20	1,643,936.00	
	ABB LTD	184,100	24.70	4,547,270.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	204.00	393,720.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,870	208.50	806,895.00	

	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,250	154.60	811,650.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	51,100	85.10	4,348,610.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,930	409.90	1,201,007.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	80.05	368,230.00
	DUFREY AG-REG	4,500	161.40	726,300.00
	ARYZTA AG	8,500	34.41	292,485.00
	BARRY CALLEBAUT AG	230	1,407.00	323,610.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	5,780.00	601,120.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	10	69,675.00	696,750.00
	NESTLE SA-REG	308,400	80.95	24,964,980.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,000	148.20	741,000.00
	ACTELION LTD-NEW LINE	9,390	285.05	2,676,619.50
	GALENICA AG-REG	360	1,168.00	420,480.00
	NOVARTIS-REG	221,400	79.15	17,523,810.00
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	69,660	272.60	18,989,316.00
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	3,200	74.00	236,800.00
	BALOISE HOLDING AG	5,000	149.20	746,000.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,180	335.50	1,066,890.00
	SWISS RE LTD	32,100	90.65	2,909,865.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,730	278.50	4,102,305.00
	SWISSCOM AG-REG	2,560	454.20	1,162,752.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	195,000	14.99	2,923,050.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,000	52.50	1,155,000.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,690	620.50	1,048,645.00
	UBS GROUP AG	364,000	16.95	6,169,800.00
	LONZA AG-REG	7,540	196.10	1,478,594.00
	ADECCO GROUP AG-REG	16,400	76.65	1,257,060.00
	SGS SA-REG	551	2,299.00	1,266,749.00
	SWISS PRIME SITE-REG	6,800	88.65	602,820.00
小計	銘柄数：38			118,779,634.50 (13,433,976,661)
	組入時価比率：3.5%			3.7%
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	17,100	169.60	2,900,160.00
	BOLIDEN AB	26,300	238.90	6,283,070.00
	ASSA ABLOY AB-B	99,700	197.10	19,650,870.00

	SKANSKA AB-B SHS	34,100	216.50	7,382,650.00	
	ALFA LAVAL AB	27,700	179.50	4,972,150.00	
	ATLAS COPCO AB-A	66,000	333.80	22,030,800.00	
	ATLAS COPCO AB-B	38,200	296.80	11,337,760.00	
	SANDVIK AB	108,000	139.40	15,055,200.00	
	SKF AB-B SHARES	38,800	190.00	7,372,000.00	
	VOLVO AB-B SHS	152,000	145.70	22,146,400.00	
	SECURITAS AB-B SHS	29,000	138.20	4,007,800.00	
	ELECTROLUX AB-B	23,300	276.40	6,440,120.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	91.20	3,465,600.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	94,300	219.00	20,651,700.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,800	308.50	2,406,300.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,900	298.40	5,639,760.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	60,000	296.70	17,802,000.00	
	GETINGE AB-B SHS	19,100	179.70	3,432,270.00	
	NORDEA BANK AB	300,000	112.10	33,630,000.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	150,000	106.50	15,975,000.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	153,000	127.40	19,492,200.00	
	SWEDBANK AB	91,000	215.90	19,646,900.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,800	214.50	3,603,600.00	
	INVESTOR AB-B SHS	45,800	413.80	18,952,040.00	
	KINNEVIK AB - B	23,600	249.80	5,895,280.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,400	669.50	2,276,300.00	
	ERICSSON LM-B	309,000	59.05	18,246,450.00	
	HEXAGON AB-B SHS	25,800	392.80	10,134,240.00	
	TELIA CO AB	262,000	37.89	9,927,180.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6,800	478.30	3,252,440.00	
	TELE 2 AB-B SHS	34,000	93.80	3,189,200.00	
小計	銘柄数：31			347,197,440.00	
				(4,454,543,155)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	111,300	150.40	16,739,520.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,800	326.40	5,483,520.00	
	NORSK HYDRO	130,000	46.57	6,054,100.00	

	SCHIBSTED ASA	7,800	221.50	1,727,700.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,100	199.50	1,815,450.00	
	MARINE HARVEST ASA	37,200	153.00	5,691,600.00	
	ORKLA ASA	80,000	80.55	6,444,000.00	
	DNB ASA	98,000	146.20	14,327,600.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,700	136.10	2,681,170.00	
	TELENOR ASA	76,000	138.80	10,548,800.00	
小計	銘柄数：10			71,513,460.00	
				(938,256,595)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,200	456.40	4,655,280.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,500	288.10	6,482,250.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	22,100	618.00	13,657,800.00	
	ISS A/S	16,100	286.00	4,604,600.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	375	11,140.00	4,177,500.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	620	11,560.00	7,167,200.00	
	DSV A/S	19,000	391.30	7,434,700.00	
	PANDORA A/S	10,800	683.00	7,376,400.00	
	CARLSBERG B	10,500	702.00	7,371,000.00	
	COLOPLAST-B	11,700	546.50	6,394,050.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	163.10	2,120,300.00	
	GENMAB A/S	5,490	1,344.00	7,378,560.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	190,000	273.80	52,022,000.00	
	DANSKE BANK AS	69,000	257.50	17,767,500.00	
	TRYG A/S	11,800	132.90	1,568,220.00	
	TDC A/S	76,800	37.76	2,899,968.00	
	DONG ENERGY A/S	14,100	276.70	3,901,470.00	
小計	銘柄数：17			156,978,798.00	
				(2,615,266,774)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	25,500	32.22	821,610.00	
	OIL SEARCH LTD	129,000	7.37	950,730.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	175,000	7.78	1,361,500.00	
	SANTOS LTD.	176,000	3.67	645,920.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	76,400	32.34	2,470,776.00	

INCITEC PIVOT LTD	161,000	3.80	611,800.00
ORICA LTD	36,600	18.55	678,930.00
BORAL LTD	115,000	6.50	747,500.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	44,000	21.89	963,160.00
AMCOR	112,000	15.47	1,732,640.00
ALUMINA LTD	233,000	1.73	403,090.00
BHP BILLITON LIMITED	319,800	23.16	7,406,568.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	148,000	4.88	722,240.00
NEWCREST MINING	75,000	19.73	1,479,750.00
RIO TINTO LTD	42,300	58.79	2,486,817.00
SOUTH32 LTD	537,000	2.73	1,466,010.00
CIMIC GROUP LTD	8,938	38.66	345,543.08
BRAMBLES LTD	153,000	10.43	1,595,790.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	44,133	4.73	208,749.09
AURIZON HOLDINGS LTD	209,000	5.40	1,128,600.00
SYDNEY AIRPORT	107,900	7.27	784,433.00
TRANSURBAN GROUP	206,000	12.40	2,554,400.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,000	20.08	1,044,160.00
CROWN RESORTS LTD	36,000	12.71	457,560.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	5,900	62.15	366,685.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	36.65	190,580.00
TABCORP HOLDINGS	78,000	4.72	368,160.00
TATTS GROUP LTD	147,000	4.34	637,980.00
REA GROUP LTD	5,400	64.87	350,298.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	4.13	218,890.00
WESFARMERS LIMITED	113,000	43.63	4,930,190.00
WOOLWORTHS LIMITED	127,700	26.62	3,399,374.00
COCA-COLA AMATIL LTD	60,000	9.64	578,400.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	12.93	930,960.00
COCHLEAR LTD	5,800	145.04	841,232.00
HEALTHSCOPE LTD	176,000	2.20	387,200.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,100	71.51	1,008,291.00
SONIC HEALTHCARE LTD	38,000	22.95	872,100.00
CSL LIMITED	45,500	134.25	6,108,375.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	291,200	29.16	8,491,392.00

	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,115	11.58	406,631.70	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	44,300	11.79	522,297.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	171,100	82.02	14,033,622.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	264,300	32.42	8,568,606.00	
	WESTPAC BANKING CORP	332,500	32.88	10,932,600.00	
	AMP LIMITED	298,000	5.36	1,597,280.00	
	CHALLENGER LIMITED	56,000	13.45	753,200.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	228,000	6.38	1,454,640.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	261,000	2.98	777,780.00	
	QBE INSURANCE	132,000	12.98	1,713,360.00	
	SUNCORP GROUP LTD	126,000	14.16	1,784,160.00	
	COMPUTERSHARE LTD	47,000	15.12	710,640.00	
	TELSTRA CORP LTD	414,000	4.45	1,842,300.00	
	TPG TELECOM LTD	33,000	5.86	193,380.00	
	TPG TELECOM LTD-RTS	2,964	0.61	1,808.04	
	VOCUS GROUP LTD	54,000	2.47	133,380.00	
	AUSNET SERVICES	163,400	1.75	286,767.00	
	APA GROUP	111,000	9.48	1,052,280.00	
	AGL ENERGY LTD	65,700	27.27	1,791,639.00	
	DUET GROUP	229,000	3.02	691,580.00	
	ASX LTD	19,600	51.04	1,000,384.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	30,500	92.46	2,820,030.00	
	SEEK LTD	32,800	17.85	585,480.00	
小計	銘柄数：63			116,402,227.91	
				(9,742,866,476)	
	組入時価比率：2.6%			2.7%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	69,000	8.48	585,120.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	91,110	6.97	635,036.70	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,000	8.48	296,800.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	189,000	3.69	697,410.00	
	CONTACT ENERGY LTD	76,000	5.19	394,440.00	
	MERCURY NZ LTD	60,000	3.21	192,600.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	120,000	2.82	339,000.00	
小計	銘柄数：7			3,140,406.70	
				(246,616,138)	

	組入時価比率：0.1%			0.1%
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	264,540	98.45	26,043,963.00
	NWS HOLDINGS LTD	159,500	15.02	2,395,690.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	11.14	1,191,980.00
	MTR CORP	148,000	46.40	6,867,200.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	140,000	35.80	5,012,000.00
	LI & FUNG LTD	563,600	3.28	1,848,608.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	75,000	31.90	2,392,500.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	236,000	41.10	9,699,600.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	94,000	17.22	1,618,680.00
	SANDS CHINA LTD	233,600	34.95	8,164,320.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	108,333	11.10	1,202,496.30
	SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	7.13	1,183,580.00
	WYNN MACAU LTD	148,400	16.02	2,377,368.00
	WH GROUP LIMITED	810,000	6.80	5,508,000.00
	BANK OF EAST ASIA	120,860	32.40	3,915,864.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	363,500	32.75	11,904,625.00
	HANG SENG BANK	75,600	162.70	12,300,120.00
	FIRST PACIFIC CO	226,000	5.95	1,344,700.00
	AIA GROUP LTD	1,198,000	55.40	66,369,200.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	119.60	2,619,240.00
	HKT TRUST AND HKT LTD	379,600	9.90	3,758,040.00
	PCCW LTD	386,000	4.47	1,725,420.00
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	65,000	68.30	4,439,500.00
	CLP HLDGS	166,000	84.00	13,944,000.00
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	139,000	71.75	9,973,250.00
	HONG KONG & CHINA GAS	754,809	15.66	11,820,308.94
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	115,200	194.40	22,394,880.00
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	271,040	56.50	15,313,760.00
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	32.15	2,604,150.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	19.36	4,123,680.00
	HENDERSON LAND	107,818	49.20	5,304,645.60
HYSAN DEVELOPMENT	65,000	36.95	2,401,750.00	
KERRY PROPERTIES	57,000	28.65	1,633,050.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	549,666	9.68	5,320,766.88	

	SINO LAND CO.LTD	314,000	13.40	4,207,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	144,000	117.50	16,920,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	53,500	74.35	3,977,725.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	25.95	3,030,960.00	
	WHARF(HOLDING)	133,000	67.00	8,911,000.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	84,000	61.50	5,166,000.00	
小計	銘柄数：40			320,930,220.72	
				(4,695,209,129)	
	組入時価比率：1.2%				1.3%
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	161,000	3.85	619,850.00	
ド	KEPPEL CORP.	142,700	6.63	946,101.00	
ル	SEMBCORP INDUSTRIES	99,040	3.14	310,985.60	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	163,000	1.24	202,120.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	52,040	10.70	556,828.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	207,000	2.73	565,110.00	
	SATS LTD	59,000	5.21	307,390.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	614,600	1.10	676,060.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	148,000	3.40	503,200.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	46.14	461,400.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	620,320	0.38	235,721.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	184,000	3.47	638,480.00	
	DBS GROUP HLDGS	177,000	20.50	3,628,500.00	
	OCBC-ORD	316,000	10.46	3,305,360.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	130,000	23.55	3,061,500.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	821,000	3.72	3,054,120.00	
	STARHUB LTD	69,000	2.72	187,680.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	7.45	573,650.00	
	CAPITALAND LIMITED	246,000	3.64	895,440.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	41,000	10.78	441,980.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	266,000	2.93	779,380.00	
	UOL GROUP LIMITED	48,700	7.11	346,257.00	
小計	銘柄数：22			22,297,113.20	
				(1,800,045,948)	
	組入時価比率：0.5%				0.5%

新シケル	FRUTAROM	3,800	220.00	836,000.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	50,000	15.36	768,000.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,300	431.50	992,450.00	
	BANK HAPOALIM BM	102,000	22.80	2,325,600.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	142,000	17.10	2,428,200.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,000	60.68	788,840.00	
	NICE LTD	5,900	262.40	1,548,160.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	204,000	6.21	1,268,268.00	
	AZRIELI GROUP	4,100	209.40	858,540.00	
	小計	銘柄数：9 組入時価比率：0.1%			11,814,058.00 (372,733,529) 0.1%
合計				364,814,183,207 (364,814,183,207)	

(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29年 5月10日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	206,145.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	509,000	206,145.00 (23,471,669) 0.2%	
	合計			23,471,669 (23,471,669)	
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	36,800	723,488.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	862,752.00	
		AMERICAN TOWER CORP	42,400	5,431,016.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	102,000	1,146,480.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,620	2,616,810.60	
		BOSTON PROPERTIES	14,900	1,834,488.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,000	573,600.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,200	668,628.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	51,000	670,140.00	

	CROWN CASTLE INTL CORP	36,000	3,418,200.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	16,000	1,824,000.00	
	DUKE REALTY CORP	34,000	947,920.00	
	EQUINIX INC	7,660	3,262,470.60	
	EQUITY RESIDENTIAL	36,300	2,353,692.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,550	1,640,316.50	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,700	928,878.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,910	902,100.50	
	GGP INC	56,500	1,259,950.00	
	HCP INC	47,400	1,416,786.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	74,100	1,321,203.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,400	849,120.00	
	KIMCO REALTY CORP	40,000	780,800.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	581,009.00	
	MACERICH CO /THE	12,300	733,572.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,200	1,106,112.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	558,685.00	
	PROLOGIS INC	52,900	2,867,180.00	
	PUBLIC STORAGE	14,450	3,006,611.50	
	REALTY INCOME CORP	26,200	1,439,952.00	
	REGENCY CENTERS CORP	15,100	929,103.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,000	1,557,000.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,300	5,084,998.00	
	SL GREEN REALTY CORP	9,800	1,014,300.00	
	UDR INC	25,300	950,015.00	
	VENTAS INC	34,800	2,179,524.00	
	VEREIT INC	95,000	729,600.00	
	VORNADO REALTY TRUST	16,500	1,557,105.00	
	WELLTOWER INC	35,300	2,436,759.00	
	WEYERHAEUSER CO	75,000	2,490,750.00	
小計	銘柄数：39	1,200,990	64,655,114.70	
			(7,361,631,359)	
	組入時価比率：1.9%		76.1%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	309,944.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	435,175.00	

小計	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	218,730.00
	銘柄数：3	37,400	963,849.00 (80,047,659)
	組入時価比率：0.0%		0.8%
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	3,100	265,732.00
	GECINA SA	4,000	545,600.00
	ICADE	3,700	265,327.00
	KLEPIERRE	22,300	837,253.50
	UNIBAIL RODAMCO-NA	9,960	2,342,094.00
	小計	銘柄数：5	43,060
	組入時価比率：0.1%		5.5%
英ポンド	BRITISH LAND	92,000	615,940.00
	HAMMERSON PLC	74,000	439,190.00
	INTU PROPERTIES PLC	88,000	243,584.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,500	878,075.00
	SEGRO PLC	103,000	514,176.00
小計	銘柄数：5	434,500	2,690,965.00 (396,890,427)
	組入時価比率：0.1%		4.1%
豪ドル	DEXUS	100,000	1,024,000.00
	GOODMAN GROUP	174,000	1,432,020.00
	GPT GROUP	179,000	950,490.00
	LENDLEASE GROUP	53,000	869,200.00
	MIRVAC GROUP	381,000	880,110.00
	SCENTRE GROUP	518,000	2,196,320.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	244,000	1,168,760.00
	VICINITY CENTRES	328,704	926,945.28
	WESTFIELD CORP	191,000	1,699,900.00
小計	銘柄数：9	2,168,704	11,147,745.28 (933,066,279)
	組入時価比率：0.2%		9.6%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,846,000.00
	LINK REIT	225,000	12,735,000.00
小計	銘柄数：2	485,000	14,581,000.00

				(213,320,030)	
		組入時価比率：0.1%		2.2%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		239,000	619,010.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		192,000	311,040.00	
	CAPITALAND MALL TRUST		249,900	489,804.00	
	SUNTEC REIT		243,000	426,465.00	
	小計	銘柄数：4	923,900	1,846,319.00	
		組入時価比率：0.0%		(149,053,332)	
				1.5%	
合計				9,662,009,252	
				(9,662,009,252)	
合計				9,685,480,921	
				(9,685,480,921)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年 5月10日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株値指数先物取引				
買建	4,450,542,191	-	4,546,819,270	96,277,079
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	3,065,778,127	-	3,075,062,800	9,284,673
米ドル	1,951,453,520	-	1,958,220,000	6,766,480
カナダドル	111,763,530	-	112,104,000	340,470
ユーロ	519,855,000	-	521,052,000	1,197,000
英ポンド	196,720,040	-	197,623,200	903,160
スイスフラン	136,165,200	-	135,720,000	445,200
スウェーデンクローナ	30,744,000	-	30,792,000	48,000
デンマーククローネ	23,289,000	-	23,324,000	35,000
豪ドル	74,943,900	-	75,321,000	377,100

香港ドル	20,843,937	-	20,906,600	62,663
合計	-	-	-	105,561,752

(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29年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	65,414,005
国債証券	16,695,477,060
未収利息	31,056,038
前払費用	3,023,147
流動資産合計	16,794,970,250
資産合計	16,794,970,250
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,102,195
未払利息	84
流動負債合計	14,102,279
負債合計	14,102,279
純資産の部	
元本等	
元本	12,541,631,820
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	4,239,236,151
元本等合計	16,780,867,971
純資産合計	16,780,867,971

(平成29年 5月10日現在)

負債純資産合計 16,794,970,250

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3380円
(10,000口当たり純資産額)	(13,380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28年 5月11日 至 平成29年 5月10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なっております。</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なっております。</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なっております。</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なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成29年 5月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年 5月10日現在		平成28年 5月11日
期首		
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		6,001,927,033円
同期中における追加設定元本額		8,264,665,487円
同期中における一部解約元本額		1,724,960,700円
期末元本額		12,541,631,820円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		540,077,672円
バランスセレクト50		621,163,457円
バランスセレクト70		246,288,282円
ネクストコア		434,840,753円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)		5,425,396,206円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)		21,405,749円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)		47,377,704円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)		18,134,731円
野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け)		4,286,547,054円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)		106,264,907円
野村DC運用戦略ファンド		774,137,021円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)		19,998,284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29年 5月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年 5月10日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第366回	50,000,000	50,170,500	
		国庫債券 利付(2年)第367回	130,000,000	130,475,800	
		国庫債券 利付(2年)第368回	170,000,000	170,652,800	
		国庫債券 利付(2年)第369回	100,000,000	100,415,000	
		国庫債券 利付(2年)第371回	80,000,000	80,370,400	
		国庫債券 利付(2年)第372回	120,000,000	120,585,600	
		国庫債券 利付(2年)第373回	60,000,000	60,307,800	
		国庫債券 利付(2年)第374回	170,000,000	170,909,500	
		国庫債券 利付(5年)第112回	130,000,000	130,856,700	
		国庫債券 利付(5年)第113回	50,000,000	50,274,500	
		国庫債券 利付(5年)第114回	20,000,000	20,133,400	
		国庫債券 利付(5年)第115回	140,000,000	140,743,400	
		国庫債券 利付(5年)第116回	150,000,000	150,955,500	
		国庫債券 利付(5年)第117回	180,000,000	181,305,000	
		国庫債券 利付(5年)第118回	110,000,000	110,860,200	
		国庫債券 利付(5年)第119回	70,000,000	70,399,000	
		国庫債券 利付(5年)第120回	210,000,000	211,814,400	
		国庫債券 利付(5年)第121回	160,000,000	161,003,200	
		国庫債券 利付(5年)第122回	200,000,000	201,388,000	
		国庫債券 利付(5年)第123回	230,000,000	231,748,000	
		国庫債券 利付(5年)第124回	240,000,000	241,946,400	
		国庫債券 利付(5年)第125回	180,000,000	181,549,800	
		国庫債券 利付(5年)第126回	240,000,000	242,220,000	
		国庫債券 利付(5年)第127回	200,000,000	201,938,000	
		国庫債券 利付(5年)第128回	290,000,000	292,934,800	
		国庫債券 利付(5年)第129回	290,000,000	293,050,800	
		国庫債券 利付(5年)第130回	170,000,000	171,972,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	140,000,000	141,572,200	
		国庫債券 利付(40年)第1回	10,000,000	14,223,400	
		国庫債券 利付(40年)第2回	30,000,000	41,237,700	
		国庫債券 利付(40年)第3回	20,000,000	27,607,800	
		国庫債券 利付(40年)第4回	35,000,000	48,505,450	

国庫債券 利付(40年)第5回	40,000,000	53,227,200
国庫債券 利付(40年)第6回	40,000,000	52,114,000
国庫債券 利付(40年)第7回	30,000,000	37,313,100
国庫債券 利付(40年)第8回	40,000,000	45,971,200
国庫債券 利付(40年)第9回	60,000,000	49,441,800
国庫債券 利付(10年)第293回	30,000,000	30,662,100
国庫債券 利付(10年)第294回	40,000,000	40,838,400
国庫債券 利付(10年)第295回	25,000,000	25,468,500
国庫債券 利付(10年)第296回	65,000,000	66,491,750
国庫債券 利付(10年)第297回	40,000,000	41,029,200
国庫債券 利付(10年)第298回	20,000,000	20,482,200
国庫債券 利付(10年)第299回	45,000,000	46,243,350
国庫債券 利付(10年)第300回	35,000,000	36,097,600
国庫債券 利付(10年)第301回	45,000,000	46,588,950
国庫債券 利付(10年)第302回	40,000,000	41,323,200
国庫債券 利付(10年)第303回	45,000,000	46,667,700
国庫債券 利付(10年)第304回	30,000,000	31,040,700
国庫債券 利付(10年)第305回	110,000,000	114,220,700
国庫債券 利付(10年)第306回	45,000,000	47,006,100
国庫債券 利付(10年)第307回	30,000,000	31,251,600
国庫債券 利付(10年)第308回	30,000,000	31,362,600
国庫債券 利付(10年)第309回	130,000,000	135,092,100
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	31,164,600
国庫債券 利付(10年)第311回	130,000,000	134,169,100

回			
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	73,427,900	
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	31,447,800	
国庫債券 利付(10年)第315回	70,000,000	73,874,500	
国庫債券 利付(10年)第316回	10,000,000	10,512,100	
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	31,624,500	
国庫債券 利付(10年)第318回	80,000,000	83,980,800	
国庫債券 利付(10年)第319回	70,000,000	73,991,400	
国庫債券 利付(10年)第320回	90,000,000	94,714,200	
国庫債券 利付(10年)第321回	40,000,000	42,197,600	
国庫債券 利付(10年)第322回	130,000,000	136,507,800	
国庫債券 利付(10年)第323回	120,000,000	126,289,200	
国庫債券 利付(10年)第324回	70,000,000	73,308,900	
国庫債券 利付(10年)第325回	150,000,000	157,399,500	
国庫債券 利付(10年)第326回	60,000,000	62,742,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	80,000,000	84,108,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	150,000,000	156,229,500	
国庫債券 利付(10年)第329回	130,000,000	137,187,700	
国庫債券 利付(10年)第330回	110,000,000	116,297,500	
国庫債券 利付(10年)第331回	160,000,000	167,113,600	
国庫債券 利付(10年)第332回	110,000,000	115,044,600	
国庫債券 利付(10年)第333回	150,000,000	157,084,500	

国庫債券 利付(10年)第334回	130,000,000	136,268,600	
国庫債券 利付(10年)第335回	130,000,000	135,380,700	
国庫債券 利付(10年)第336回	40,000,000	41,664,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	270,000,000	277,109,100	
国庫債券 利付(10年)第338回	160,000,000	165,481,600	
国庫債券 利付(10年)第339回	190,000,000	196,558,800	
国庫債券 利付(10年)第340回	125,000,000	129,395,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	150,000,000	154,005,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	250,000,000	252,212,500	
国庫債券 利付(10年)第343回	210,000,000	211,717,800	
国庫債券 利付(10年)第344回	290,000,000	292,166,300	
国庫債券 利付(10年)第345回	190,000,000	191,364,200	
国庫債券 利付(10年)第346回	190,000,000	191,212,200	
国庫債券 利付(30年)第3回	40,000,000	50,757,200	
国庫債券 利付(30年)第5回	10,000,000	12,676,000	
国庫債券 利付(30年)第6回	10,000,000	13,004,500	
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	19,353,900	
国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	24,361,600	
国庫債券 利付(30年)第9回	130,000,000	150,646,600	
国庫債券 利付(30年)第10回	60,000,000	66,709,200	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	12,049,100	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	12,678,300	
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	12,540,600	
国庫債券 利付(30年)第14回	30,000,000	39,599,100	
国庫債券 利付(30年)第15回	10,000,000	13,373,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	13,397,800	
国庫債券 利付(30年)第17回	10,000,000	13,246,300	

国庫債券	利付(30年)第18回	20,000,000	26,179,800
国庫債券	利付(30年)第19回	10,000,000	13,097,300
国庫債券	利付(30年)第20回	10,000,000	13,464,900
国庫債券	利付(30年)第21回	10,000,000	13,131,400
国庫債券	利付(30年)第22回	10,000,000	13,492,500
国庫債券	利付(30年)第23回	40,000,000	54,046,400
国庫債券	利付(30年)第24回	10,000,000	13,518,100
国庫債券	利付(30年)第25回	20,000,000	26,334,600
国庫債券	利付(30年)第26回	20,000,000	26,742,600
国庫債券	利付(30年)第27回	20,000,000	27,190,200
国庫債券	利付(30年)第28回	30,000,000	40,906,200
国庫債券	利付(30年)第29回	20,000,000	26,968,800
国庫債券	利付(30年)第30回	50,000,000	66,616,000
国庫債券	利付(30年)第31回	30,000,000	39,462,600
国庫債券	利付(30年)第32回	40,000,000	53,613,200
国庫債券	利付(30年)第33回	50,000,000	64,013,000
国庫債券	利付(30年)第34回	40,000,000	53,078,400
国庫債券	利付(30年)第35回	42,000,000	54,037,200
国庫債券	利付(30年)第36回	30,000,000	38,666,100
国庫債券	利付(30年)第37回	30,000,000	38,080,800
国庫債券	利付(30年)第38回	50,000,000	62,382,000
国庫債券	利付(30年)第39回	20,000,000	25,437,800
国庫債券	利付(30年)第40回	30,000,000	37,468,500
国庫債券	利付(30年)第41回	20,000,000	24,513,400
国庫債券	利付(30年)第42回	60,000,000	73,563,000
国庫債券	利付(30年)第43回	50,000,000	61,391,500
国庫債券	利付(30年)第44回	30,000,000	36,846,000
国庫債券	利付(30年)第45回	40,000,000	47,185,200
国庫債券	利付(30年)第46回	60,000,000	70,776,000
国庫債券	利付(30年)第47回	20,000,000	24,086,000
国庫債券	利付(30年)第48回	40,000,000	46,188,000
国庫債券	利付(30年)第49回	50,000,000	57,723,000
国庫債券	利付(30年)第50回	70,000,000	70,000,000
国庫債券	利付(30年)第51回	120,000,000	104,355,600
国庫債券	利付(30年)第52回	100,000,000	91,992,000
国庫債券	利付(30年)第53回	90,000,000	84,978,900

国庫債券	利付（30年）第54回	60,000,000	59,712,000	
国庫債券	利付（20年）第41回	30,000,000	30,940,800	
国庫債券	利付（20年）第42回	10,000,000	10,518,300	
国庫債券	利付（20年）第43回	10,000,000	10,724,500	
国庫債券	利付（20年）第44回	10,000,000	10,762,800	
国庫債券	利付（20年）第45回	10,000,000	10,734,100	
国庫債券	利付（20年）第46回	5,000,000	5,368,250	
国庫債券	利付（20年）第47回	15,000,000	16,188,150	
国庫債券	利付（20年）第48回	30,000,000	32,880,300	
国庫債券	利付（20年）第49回	40,000,000	43,486,000	
国庫債券	利付（20年）第52回	25,000,000	27,445,250	
国庫債券	利付（20年）第53回	10,000,000	11,033,800	
国庫債券	利付（20年）第54回	10,000,000	11,080,100	
国庫債券	利付（20年）第55回	10,000,000	11,035,800	
国庫債券	利付（20年）第56回	10,000,000	11,083,600	
国庫債券	利付（20年）第57回	10,000,000	11,032,200	
国庫債券	利付（20年）第58回	10,000,000	11,083,500	
国庫債券	利付（20年）第59回	30,000,000	33,054,600	
国庫債券	利付（20年）第60回	10,000,000	10,849,000	
国庫債券	利付（20年）第61回	10,000,000	10,650,900	
国庫債券	利付（20年）第62回	10,000,000	10,556,200	
国庫債券	利付（20年）第63回	10,000,000	11,167,400	
国庫債券	利付（20年）第64回	10,000,000	11,272,700	
国庫債券	利付（20年）第65回	10,000,000	11,315,300	
国庫債券	利付（20年）第66回	20,000,000	22,497,800	
国庫債券	利付（20年）第67回	10,000,000	11,364,700	
国庫債券	利付（20年）第68回	10,000,000	11,571,500	
国庫債券	利付（20年）第69回	30,000,000	34,507,500	
国庫債券	利付（20年）第70回	40,000,000	47,056,400	
国庫債券	利付（20年）第71回	10,000,000	11,621,300	
国庫債券	利付（20年）第72回	20,000,000	23,184,400	
国庫債券	利付（20年）第73回	30,000,000	34,670,400	
国庫債券	利付（20年）第74回	10,000,000	11,633,100	
国庫債券	利付（20年）第75回	40,000,000	46,708,000	
国庫債券	利付（20年）第76回	17,000,000	19,583,150	
国庫債券	利付（20年）第77回	15,000,000	17,397,300	

国庫債券 利付(20年)第78回	10,000,000	11,563,700	
国庫債券 利付(20年)第79回	10,000,000	11,644,900	
国庫債券 利付(20年)第80回	10,000,000	11,726,200	
国庫債券 利付(20年)第81回	10,000,000	11,686,400	
国庫債券 利付(20年)第82回	15,000,000	17,655,150	
国庫債券 利付(20年)第83回	15,000,000	17,719,200	
国庫債券 利付(20年)第84回	50,000,000	58,633,000	
国庫債券 利付(20年)第85回	13,000,000	15,410,460	
国庫債券 利付(20年)第86回	10,000,000	12,031,200	
国庫債券 利付(20年)第88回	20,000,000	24,167,000	
国庫債券 利付(20年)第90回	20,000,000	24,072,800	
国庫債券 利付(20年)第91回	10,000,000	12,129,800	
国庫債券 利付(20年)第92回	30,000,000	35,966,700	
国庫債券 利付(20年)第93回	20,000,000	23,859,600	
国庫債券 利付(20年)第94回	20,000,000	24,056,000	
国庫債券 利付(20年)第95回	10,000,000	12,268,700	
国庫債券 利付(20年)第96回	15,000,000	18,101,250	
国庫債券 利付(20年)第97回	50,000,000	61,046,500	
国庫債券 利付(20年)第99回	130,000,000	157,870,700	
国庫債券 利付(20年)第100回	20,000,000	24,562,800	
国庫債券 利付(20年)第101回	20,000,000	24,993,200	
国庫債券 利付(20年)第102回	20,000,000	25,080,400	
国庫債券 利付(20年)第103回	25,000,000	31,075,750	
国庫債券 利付(20年)第104回	10,000,000	12,210,300	
国庫債券 利付(20年)第105回	70,000,000	85,723,400	
国庫債券 利付(20年)第106回	10,000,000	12,358,500	
国庫債券 利付(20年)第107回	20,000,000	24,547,600	
国庫債券 利付(20年)第108回	10,000,000	12,044,700	
国庫債券 利付(20年)第109回	10,000,000	12,066,400	

国庫債券 利付(20年)第110回	20,000,000	24,599,800	
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	12,452,400	
国庫債券 利付(20年)第112回	35,000,000	43,166,550	
国庫債券 利付(20年)第113回	40,000,000	49,434,400	
国庫債券 利付(20年)第114回	30,000,000	37,169,700	
国庫債券 利付(20年)第115回	10,000,000	12,513,400	
国庫債券 利付(20年)第116回	10,000,000	12,537,900	
国庫債券 利付(20年)第118回	40,000,000	49,227,200	
国庫債券 利付(20年)第119回	50,000,000	60,256,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	25,000,000	29,489,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	40,000,000	48,815,600	
国庫債券 利付(20年)第122回	20,000,000	24,147,800	
国庫債券 利付(20年)第123回	10,000,000	12,492,200	
国庫債券 利付(20年)第124回	20,000,000	24,720,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	10,000,000	12,653,600	
国庫債券 利付(20年)第126回	30,000,000	37,154,400	
国庫債券 利付(20年)第127回	20,000,000	24,484,400	
国庫債券 利付(20年)第128回	70,000,000	85,855,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	20,000,000	24,257,200	
国庫債券 利付(20年)第130回	40,000,000	48,560,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	85,000,000	102,012,750	
国庫債券 利付(20年)第132回	30,000,000	36,029,100	

回			
国庫債券 利付(20年)第133回	40,000,000	48,600,800	
国庫債券 利付(20年)第134回	30,000,000	36,503,100	
国庫債券 利付(20年)第135回	15,000,000	18,024,750	
国庫債券 利付(20年)第136回	90,000,000	106,866,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	10,000,000	12,031,900	
国庫債券 利付(20年)第138回	110,000,000	129,076,200	
国庫債券 利付(20年)第139回	10,000,000	11,878,700	
国庫債券 利付(20年)第140回	120,000,000	144,453,600	
国庫債券 利付(20年)第141回	70,000,000	84,297,500	
国庫債券 利付(20年)第142回	20,000,000	24,382,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	40,000,000	47,582,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	10,000,000	11,736,200	
国庫債券 利付(20年)第145回	10,000,000	12,049,100	
国庫債券 利付(20年)第146回	60,000,000	72,309,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	20,000,000	23,793,200	
国庫債券 利付(20年)第148回	60,000,000	70,421,400	
国庫債券 利付(20年)第149回	70,000,000	82,131,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	110,000,000	127,234,800	
国庫債券 利付(20年)第151回	70,000,000	78,565,200	
国庫債券 利付(20年)第152回	50,000,000	56,058,500	
国庫債券 利付(20年)第153回	60,000,000	68,253,000	

	国庫債券 利付（20年）第154回	120,000,000	134,350,800	
	国庫債券 利付（20年）第155回	120,000,000	129,992,400	
	国庫債券 利付（20年）第156回	160,000,000	155,899,200	
	国庫債券 利付（20年）第157回	160,000,000	149,670,400	
	国庫債券 利付（20年）第158回	150,000,000	148,039,500	
	国庫債券 利付（20年）第159回	120,000,000	120,315,600	
	国庫債券 利付（20年）第160回	100,000,000	101,955,000	
小計	銘柄数：255 組入時価比率：99.5%	15,542,000,000	16,695,477,060 100.0%	
合計			16,695,477,060	

(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29年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	182,483,774
コール・ローン	3,174,269,037
国債証券	658,099,760,346
派生商品評価勘定	4,886,783
未収入金	274,270,881
未収利息	6,265,289,584
前払費用	256,762,197
流動資産合計	668,257,722,602
資産合計	
668,257,722,602	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,841,617
未払金	2,847,902,018
未払解約金	645,927,677
未払利息	4,115
その他未払費用	7,899,200
流動負債合計	3,503,574,627

(平成29年 5月10日現在)

負債合計	3,503,574,627
純資産の部	
元本等	
元本	302,031,601,625
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	362,722,546,350
元本等合計	664,754,147,975
純資産合計	664,754,147,975
負債純資産合計	668,257,722,602

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	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.2009円
(10,000口当たり純資産額)	(22,009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28年 5月11日 至 平成29年 5月10日
1.金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 5月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、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29年 5月10日現在	
期首	平成28年 5月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	291,325,475,847円
同期中における追加設定元本額	41,419,676,069円
同期中における一部解約元本額	30,713,550,291円
期末元本額	302,031,601,625円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	90,376,727円
バランスセレクト50	95,597,698円
バランスセレクト70	75,084,362円

野村外国債券インデックスファンド	294,047,502円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,903,770,200円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	28,123,863,474円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,550,992,042円
野村資産設計ファンド2015	39,664,609円
野村資産設計ファンド2020	48,213,634円
野村資産設計ファンド2025	50,575,113円
野村資産設計ファンド2030	41,284,644円
野村資産設計ファンド2035	28,505,057円
野村資産設計ファンド2040	71,599,738円
野村外国債券インデックス(野村投資一任口座向け)	186,858,504,066円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	4,923,155,923円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	7,049,506,140円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	1,650,685,398円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	1,726,688,217円
野村資産設計ファンド2045	6,164,098円
野村インデックスファンド・外国債券	704,799,284円
マイ・ロード	8,396,053,347円
ネクストコア	678,789,899円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	89,259,609円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	2,465,959,976円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	540,099,984円
野村資産設計ファンド2050	5,453,395円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,895,239円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,093,066円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	888,025円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	793,345円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	289,746,172円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	80,942,919円
インデックス・ブレンド(タイプ)	17,860円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,796円
インデックス・ブレンド(タイプ)	24,808円
インデックス・ブレンド(タイプ)	36,599円
インデックス・ブレンド(タイプ)	24,301円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	29,700,278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)	11,603,558円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,265,600,667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)	647,553,052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)	5,771,334,376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)	1,727,512,193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)	3,038,940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)	18,611,102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)	1,312,663円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,074,282,593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)	504,205,034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)	1,854,139,207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)	200,013,315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)	195,849,097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)	237,745,036円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	2,164,169,025円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,073,157,685円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,963,921,785円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	455,477,950円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,625,898円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,306,024円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,631,680円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	530,972,422円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,130,321,675円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	2,900,464,411円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,589,009,498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)	12,779,489,266円
マイバランスDC30	1,241,002,811円
マイバランスDC50	765,928,639円
マイバランスDC70	461,341,370円
野村DC外国債券インデックスファンド	3,259,609,223円
野村DC運用戦略ファンド	1,207,900,516円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	31,841,681円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	29,086,187円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,163,075円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,511,427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29年 5月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年 5月10日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	19,300,000.00	22,183,690.20	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	15,567,421.24	
		US TREASURY BOND	21,100,000.00	26,675,014.57	
		US TREASURY BOND	13,800,000.00	17,154,045.84	
		US TREASURY BOND	50,100,000.00	50,522,718.75	
		US TREASURY BOND	39,200,000.00	50,586,373.04	
		US TREASURY BOND	18,800,000.00	25,384,404.84	

US TREASURY BOND	23,700,000.00	31,802,437.50	
US TREASURY BOND	12,000,000.00	15,549,374.40	
US TREASURY BOND	5,000,000.00	6,373,437.50	
US TREASURY BOND	800,000.00	1,023,062.48	
US TREASURY BOND	100,000.00	124,476.56	
US TREASURY BOND	25,300,000.00	24,588,437.50	
US TREASURY BOND	16,000,000.00	18,155,000.00	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,616,542.65	
US TREASURY N/B	500,000.00	497,265.60	
US TREASURY N/B	400,000.00	410,718.72	
US TREASURY N/B	600,000.00	598,757.76	
US TREASURY N/B	600,000.00	607,265.58	
US TREASURY N/B	4,900,000.00	4,889,281.25	
US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,379,100.76	
US TREASURY N/B	31,200,000.00	31,603,403.52	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,513,945.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	995,781.20	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,911,718.64	
US TREASURY N/B	18,400,000.00	18,428,750.00	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,594,214.18	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,967,062.08	
US TREASURY N/B	19,600,000.00	19,539,514.40	
US TREASURY N/B	28,800,000.00	28,887,747.84	
US TREASURY N/B	800,000.00	797,093.68	
US TREASURY N/B	27,400,000.00	27,436,389.94	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,927,734.00	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,386,218.72	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,967,675.41	
US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,389,967.68	
US TREASURY N/B	700,000.00	694,449.21	
US TREASURY N/B	35,700,000.00	37,006,673.55	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,699,269.51	
US TREASURY N/B	500,000.00	500,527.30	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,994,609.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	699,535.13	

US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,506,347.25	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,515,898.30	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,083,863.09	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,490,038.50	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,510,117.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,679.60	
US TREASURY N/B	37,500,000.00	38,430,172.50	
US TREASURY N/B	900,000.00	890,964.81	
US TREASURY N/B	16,100,000.00	16,111,319.91	
US TREASURY N/B	16,200,000.00	16,246,827.72	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,733,764.68	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,012,031.20	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	25,633,474.65	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,996,328.00	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,468,417.75	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,990,039.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,629,750.00	
US TREASURY N/B	27,600,000.00	28,569,231.96	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,287,456.95	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,393,273.42	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,629,398.04	
US TREASURY N/B	500,000.00	494,785.15	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,389,007.76	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,939,500.00	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,423,730.40	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,571,366.10	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	27,385,628.58	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,971,757.70	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,842,280.48	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,969,531.10	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,834,132.37	
US TREASURY N/B	49,300,000.00	51,639,822.37	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,699,624.56	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,801,757.70	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,891,250.00	

US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,814,546.78	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,993,750.00	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,364,562.50	
US TREASURY N/B	51,800,000.00	54,744,099.62	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,680,066.17	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,012,695.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,953,593.60	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	21,201,819.78	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,182,499.84	
US TREASURY N/B	47,700,000.00	50,412,937.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,483,241.70	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,741,358.96	
US TREASURY N/B	13,200,000.00	13,207,217.76	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,164,061.80	
US TREASURY N/B	42,500,000.00	43,844,725.50	
US TREASURY N/B	37,600,000.00	38,175,750.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,066,562.20	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,603,124.96	
US TREASURY N/B	52,600,000.00	54,270,460.28	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,957,781.08	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,374,116.79	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,905,937.50	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	48,973,793.44	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,046,484.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,764,843.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,831,781.16	
US TREASURY N/B	12,900,000.00	13,124,741.22	
US TREASURY N/B	38,400,000.00	40,373,998.08	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,674,021.75	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,406,405.40	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,859,140.14	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,122,436.16	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,342,202.76	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,170,000.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,049,218.00	

US TREASURY N/B	26,000,000.00	26,142,186.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,995,000.00	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,522,061.88	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,906,250.00	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	33,864,550.36	
US TREASURY N/B	27,300,000.00	27,073,920.51	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,812,600.82	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	29,718,750.00	
US TREASURY N/B	23,900,000.00	23,675,003.01	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	27,204,608.70	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,160,351.10	
US TREASURY N/B	12,800,000.00	12,528,000.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,049,765.30	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	21,620,154.60	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,932,265.20	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	24,205,077.50	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,637,343.20	
US TREASURY N/B	42,200,000.00	41,359,295.82	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	29,549,748.48	
US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,818,312.50	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	17,399,812.08	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,740,093.08	
US TREASURY N/B	29,100,000.00	29,631,982.92	
US TREASURY N/B	23,100,000.00	23,060,295.72	
US TREASURY N/B	44,700,000.00	43,746,629.46	
US TREASURY N/B	26,500,000.00	26,119,062.50	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,590,000.00	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	49,879,522.18	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,198,125.00	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,794,968.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	126,531.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,765.62	
US TREASURY N/B	800,000.00	974,687.44	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,148,632.75	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	5,200,781.04	

	US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,251,249.60	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,910,624.80	
	US TREASURY N/B	7,200,000.00	8,304,186.96	
	US TREASURY N/B	7,800,000.00	9,503,812.50	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,153,593.40	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,693,671.70	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,642,695.15	
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,266,000.00	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,486,991.85	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	8,848,803.99	
	US TREASURY N/B	17,600,000.00	16,735,123.68	
	US TREASURY N/B	25,200,000.00	25,654,779.36	
	US TREASURY N/B	15,400,000.00	17,100,015.24	
	US TREASURY N/B	23,200,000.00	25,788,250.00	
	US TREASURY N/B	18,900,000.00	20,121,115.77	
	US TREASURY N/B	30,600,000.00	31,123,544.58	
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	36,629,013.78	
	US TREASURY N/B	26,000,000.00	23,308,591.80	
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,528,771.81	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,934,843.60	
	US TREASURY N/B	15,100,000.00	14,972,593.75	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	8,493,593.75	
	US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,306,296.69	
小計	銘柄数：170	2,480,300,000.00	2,561,758,948.69	
			(291,681,873,897)	
	組入時価比率：43.9%		44.4%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	4,600,000.00	4,975,682.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,189,600.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,993,940.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	9,571,630.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	9,973,900.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	4,585,455.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	10,617,200.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,900,796.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,792,590.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,428,290.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,789,808.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,142,272.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	11,452,980.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,728,320.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,679,028.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,155,202.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	9,046,125.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	5,891,399.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	943,250.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,680,000.00	8,097,748.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	5,128,492.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	7,728,354.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	8,474,880.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	11,942,640.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,008,980.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	579,890.00	
小計	銘柄数：26	148,180,000.00	165,818,451.80	
			(13,771,222,421)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	70,000,000.00	68,614,000.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,700,000.00	113,368,977.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	60,300,000.00	57,460,473.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	70,700,000.00	72,492,245.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	124,300,000.00	121,531,839.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,400,000.00	47,053,028.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,700,000.00	35,719,450.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,000,000.00	7,245,920.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	103,100,000.00	104,793,933.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,100,000.00	51,498,198.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,500,000.00	45,760,685.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,257,900.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	57,661,920.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	33,630,215.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	65,613,042.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	2,092,340.00	

小計	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	86,597,220.00	
	銘柄数：17	953,500,000.00	981,391,385.00	
	組入時価比率：0.9%		(5,839,278,740)	0.9%
ユ-口	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	102,041.70	
	BELGIUM KINGDOM	7,600,000.00	8,239,920.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	6,624,533.80	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,233,760.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,800,000.00	5,789,160.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	7,895,040.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,672,590.00	
	BELGIUM KINGDOM	10,000,000.00	11,610,000.00	
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,293,833.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,032,900.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	974,400.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,845,067.50	
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	9,741,030.40	
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	9,341,585.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	939,271.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,291,405.70	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,649,488.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,900,000.00	17,798,830.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	17,474,589.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	100,560.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	8,219,803.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	7,535,336.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,700,000.00	2,723,976.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,300,000.00	14,103,399.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,900,000.00	9,863,754.30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	9,782,960.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	27,500,000.00	30,869,877.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,600,000.00	12,404,067.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,900,000.00	9,607,585.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,048,739.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	11,592,901.60		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,000,000.00	21,602,954.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	7,363,098.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,900,000.00	17,450,060.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,700,000.00	7,982,045.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	923,940.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000,000.00	17,632,300.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,253,578.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,401,236.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	10,524,540.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	7,437,636.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	11,308,281.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	11,158,524.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,044,530.00
BUNDES OblIGATION	1,800,000.00	1,841,886.00
BUNDES OblIGATION	10,000,000.00	10,222,100.00
BUNDES OblIGATION	3,600,000.00	3,665,808.00
BUNDES OblIGATION	3,000,000.00	3,081,660.00
BUNDES OblIGATION	1,600,000.00	1,630,192.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,700,000.00	19,303,266.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,700,000.00	7,402,897.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,568,343.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,552,328.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,779,758.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,088,360.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	9,379,860.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,500,000.00	12,779,720.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,500,000.00	8,287,500.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,468,900.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,705,128.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,717,504.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,000,000.00	15,859,340.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,100,000.00	20,007,618.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,393,177.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,658,220.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	6,742,386.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,700,000.00	9,991,582.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	3,415,744.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,041,920.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	589,566.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	31,111,198.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,216,660.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	4,961,076.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	10,988,380.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,642,127.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,435,126.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	8,353,573.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	13,118,008.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	14,442,356.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,900,000.00	8,629,399.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,300,000.00	5,595,207.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,500,000.00	11,141,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	2,807,892.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,400,000.00	21,576,876.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,444,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,300,000.00	16,422,408.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,026,828.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	501,215.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,081,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	824,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,080,000.00	12,127,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,100,000.00	6,799,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	32,432,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	18,098,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,016,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,790,207.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	10,107,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,016,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,800,000.00	14,965,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	5,300,154.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,966,800.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	11,763,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,700,000.00	25,427,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	3,930,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	7,912,485.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,300,000.00	11,174,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,104,230.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	18,825,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,029,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,609,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	18,289,988.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,915,124.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,997,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	10,169,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	10,366,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,200,000.00	25,314,380.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,300,000.00	7,728,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,700,000.00	26,769,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	25,554,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,677,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	8,843,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	10,830,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	7,745,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,380,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,600,000.00	20,085,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,100,000.00	12,677,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	8,056,260.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,536,135.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,100,000.00	2,324,303.10	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,226,200.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,300,000.00	2,359,731.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,302,808.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,491,459.20	
FINNISH GOVERNMENT	4,200,000.00	4,571,288.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,111,840.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,039,551.00	

FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,002,160.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,276,342.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	684,096.70	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,074,979.20	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,248,640.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,300,000.00	10,558,983.20	
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	2,835,840.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,114,360.50	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	6,986,644.00	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	8,160,250.00	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	569,640.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	200,000.00	203,248.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	11,559,369.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,200,000.00	26,816,617.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,200,000.00	2,220,240.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	12,583,852.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	4,891,012.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	12,710,202.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	16,540,021.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,300,000.00	30,019,080.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,042,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	13,684,460.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	17,423,225.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	16,726,127.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	22,550,451.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	12,308,856.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000.00	39,472,430.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,798,920.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	28,753,560.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,192,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	41,285,630.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,519,040.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000.00	36,986,547.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,034,430.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000.00	31,970,148.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	10,094,449.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	16,979,610.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,900,000.00	24,679,980.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,200,000.00	19,817,608.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	6,891,570.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,800,000.00	5,918,120.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	3,600,000.00	3,971,412.00	
IRISH GOVERNMENT	5,600,000.00	5,998,496.00	
IRISH GOVERNMENT	3,400,000.00	3,925,912.00	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,061,080.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,143,650.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,769,485.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	1,000,000.00	989,250.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,183,280.00	
IRISH TSY 2% 2045	2,500,000.00	2,495,540.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,600,000.00	7,936,830.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,470,000.00	7,880,850.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,300,000.00	6,502,822.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	7,816,390.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,044,516.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,545,590.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,900,000.00	9,109,813.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	404,897.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,692,300.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,201,540.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,166,630.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,553,459.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,288,750.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,004,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,021,534.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	11,011,320.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	5,453,360.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	7,676,495.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,200,000.00	9,639,425.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	6,125,755.50	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,357,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,726,250.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,632,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,400,000.00	2,445,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,600,000.00	6,374,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,127,320.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	3,923,700.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	5,966,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,989,700.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,900,000.00	4,323,228.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,309,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,386,450.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,489,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,032,956.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,100,000.00	9,570,796.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,203,300.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,700,000.00	7,119,419.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,800,000.00	7,984,094.40	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,400,000.00	4,141,268.00	
	SPANISH GOVERNMENT	17,500,000.00	25,194,995.00	
	SPANISH GOVERNMENT	8,500,000.00	12,435,500.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	6,541,028.00	
小計	銘柄数：228	1,715,950,000.00	2,106,816,988.10	
			(261,371,715,543)	
	組入時価比率：39.3%		39.7%	
英債券	UK TREASURY	150,000.00	152,025.00	
	UK TREASURY	7,100,000.00	7,666,580.00	
	UK TREASURY	19,600,000.00	20,287,960.00	
	UK TREASURY	2,000,000.00	2,167,800.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,596,930.00	
	UK TREASURY	17,490,000.00	18,462,444.00	
	UK TREASURY	7,000,000.00	7,820,400.00	
	UK TREASURY	2,200,000.00	2,293,940.00	
	UK TREASURY	9,340,000.00	12,253,146.00	
	UK TREASURY	8,900,000.00	10,194,060.00	

	UK TREASURY	4,850,000.00	5,676,925.00	
	UK TREASURY	4,000,000.00	3,980,000.00	
	UK TREASURY	8,700,000.00	9,240,270.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,587,050.00	
	UK TREASURY	11,200,000.00	12,712,000.00	
	UK TREASURY	12,450,000.00	16,315,725.00	
	UK TREASURY	9,530,000.00	12,411,872.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,077,965.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,010,780.00	
	UK TREASURY	5,750,000.00	7,789,525.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,355,500.00	
	UK TREASURY	3,400,000.00	4,748,780.00	
	UK TREASURY	4,400,000.00	6,699,000.00	
	UK TREASURY	4,200,000.00	6,036,660.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,293,500.00	
	UK TREASURY	6,100,000.00	9,366,550.00	
	UK TREASURY	20,000,000.00	26,952,000.00	
	UK TREASURY	5,950,000.00	9,171,925.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,544,485.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,284,250.00	
	UK TREASURY	900,000.00	910,260.00	
	UK TREASURY	2,600,000.00	3,298,100.00	
	UK TREASURY	6,200,000.00	10,058,880.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	21,050,000.00	27,009,255.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,500,000.00	11,115,650.00	
小計	銘柄数：35	256,410,000.00	328,542,192.00	
			(48,456,687,898)	
	組入時価比率：7.3%		7.4%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	5,000,000.00	5,538,000.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,600,000.00	5,181,120.00	
小計	銘柄数：2	8,600,000.00	10,719,120.00	
			(1,212,332,472)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,300,000.00	2,507,211.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	45,500,000.00	54,113,150.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	53,400,000.00	62,803,740.00	

小計	SWEDISH GOVERNMENT	26,600,000.00	28,761,170.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	41,700,000.00	48,405,360.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	9,900,000.00	10,225,749.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,300,000.00	21,986,124.60	
	銘柄数：7 組入時価比率：0.4%	195,700,000.00	228,802,506.00 (2,935,536,151) 0.4%	
小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,300,000.00	29,420,391.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	30,623,580.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,893,450.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	49,654,910.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,797,384.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,664,985.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	7,354,750.00	
	銘柄数：7 組入時価比率：0.3%	130,800,000.00	141,409,450.00 (1,855,291,984) 0.3%	
小計	KINGDOM OF DENMARK	2,500,000.00	2,530,475.00	
	KINGDOM OF DENMARK	34,100,000.00	37,970,350.00	
	KINGDOM OF DENMARK	41,100,000.00	47,043,060.00	
	KINGDOM OF DENMARK	30,100,000.00	32,843,013.00	
	KINGDOM OF DENMARK	31,400,000.00	34,985,880.00	
	KINGDOM OF DENMARK	4,000,000.00	3,923,724.00	
	KINGDOM OF DENMARK	48,300,000.00	80,154,912.60	
	銘柄数：7 組入時価比率：0.6%	191,500,000.00	239,451,414.60 (3,989,260,567) 0.6%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	8,900,000.00	8,983,660.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,200,000.00	6,036,940.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	5,942,680.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	11,990,220.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,153,210.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	33,515,190.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	12,495,270.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	10,701,900.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,190,625.00	

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	22,979,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	7,478,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,538,050.00	
	銘柄数：12	136,700,000.00	144,005,045.00	(4,219,347,818)
	組入時価比率：0.6%			0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,600,000.00	6,749,886.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,700,000.00	14,573,635.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	5,011,190.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,100,000.00	14,074,692.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	6,744,539.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	11,651,358.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	397,566.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,400,000.00	9,854,460.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,527,649.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	8,047,730.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	18,300,000.00	19,211,687.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,600,000.00	14,222,880.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,250,000.00	13,267,541.25	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	800,132.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,502,460.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,506,343.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,235,839.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,675,159.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,727,477.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,679,920.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	175,880.00	
小計	銘柄数：21	153,750,000.00	165,638,028.35	(13,863,902,972)
	組入時価比率：2.1%			2.1%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,660,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,950,000.00	5,077,833.75	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,000,000.00	4,230,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	3,054,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,498,280.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,148,500.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,456,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,346,784.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,541,816.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	563,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,900,000.00	3,034,850.00	
	銘柄数：11	29,930,000.00	31,612,123.75	(2,552,046,750)
組入時価比率：0.4%			0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	405,128.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,019,645.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	907,549.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,414,620.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	12,157,040.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,600,000.00	6,590,581.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,421,585.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,109,680.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,834,823.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,524,302.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,000,000.00	10,822,933.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,883,386.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	598,189.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	8,997,419.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	5,623,332.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,708,250.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,940,853.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,528,073.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,326,498.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,569,664.30	
MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	375,369.20		
MALAYSIAN GOVERNMENT	7,600,000.00	7,690,348.80		
小計	銘柄数：22	107,200,000.00	107,449,274.20	(2,815,170,984)
組入時価比率：0.4%			0.4%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	20,100,000.00	20,241,421.59	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,300,000.00	25,063,095.86	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	25,197,130.53	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,200,000.00	24,654,175.56	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	70,000,000.00	77,582,183.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,000,000.00	24,505,237.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	24,738,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,400,000.00	42,126,453.28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	47,100,000.00	33,644,486.13	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	28,816,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	4,475,003.52	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	21,566,148.66	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,100,000.00	28,925,663.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,100,000.00	41,442,530.83	
小計	銘柄数：14	462,800,000.00	422,977,529.86	
			(3,536,092,149)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
合計			658,099,760,346	
			(658,099,760,346)	

(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29年 5月10日現在			
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,733,782,817	-	2,738,669,600	4,886,783
米ドル	1,258,783,177	-	1,261,458,000	2,674,823
カナダドル	55,558,812	-	55,636,800	77,988
メキシコペソ	24,309,648	-	24,472,800	163,152
ユーロ	1,135,388,320	-	1,136,389,600	1,001,280
英ポンド	213,063,058	-	213,846,000	782,942
豪ドル	46,679,802	-	46,866,400	186,598
売建	235,047,383	-	236,889,000	1,841,617
米ドル	123,907,553	-	125,235,000	1,327,447

ユーロ	111,139,830	-	111,654,000	514,170
合計	-	-	-	3,045,166

(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29年 5月31日現在

資産総額	1,645,265,681円
負債総額	2,481,844円
純資産総額（ - ）	1,642,783,837円
発行済口数	1,045,955,312口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5706円

（参考）国内株式マザーファンド

平成29年 5月31日現在

資産総額	380,266,630,414円
負債総額	50,137,989,077円
純資産総額（ - ）	330,128,641,337円
発行済口数	220,828,047,741口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4950円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成29年 5月31日現在

資産総額	376,220,230,487円
負債総額	1,215,454,221円
純資産総額（ - ）	375,004,776,266円
発行済口数	158,912,200,722口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3598円

（参考）国内債券マザーファンド

平成29年 5月31日現在

資産総額	15,043,808,151円
負債総額	272,919,368円
純資産総額（ - ）	14,770,888,783円
発行済口数	11,026,443,093口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3396円

（参考）外国債券マザーファンド

平成29年 5月31日現在

資産総額	663,547,753,899円
負債総額	573,752,823円
純資産総額（ - ）	662,974,001,076円
発行済口数	302,391,014,156口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1924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ないません。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29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

当社は指名委員会等設置会社であり、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29年5月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	945	21,853,307
単位型株式投資信託	73	382,375
追加型公社債投資信託	15	5,705,403
単位型公社債投資信託	346	1,950,815
合計	1,379	29,891,900

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28年4月1日から平成29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28年3月31日)	当事業年度 (平成29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		208	127
金銭の信託		55,341	52,247
有価証券		24,100	15,700
前払金		34	33
前払費用		2	2
未収入金		511	495
未収委託者報酬		14,131	16,287
未収運用受託報酬		7,309	7,481
繰延税金資産		2,028	1,661
その他		56	42
貸倒引当金		10	11
流動資産計		103,715	94,066
固定資産			
有形固定資産		1,176	1,001
建物	2	403	377
器具備品	2	773	624
無形固定資産		7,681	7,185
ソフトウェア		7,680	7,184

その他		0		0
投資その他の資産			23,225	13,165
投資有価証券		9,216		1,233
関係会社株式		10,958		8,124
長期差入保証金		45		44
長期前払費用		49		37
前払年金費用		2,777		2,594
繰延税金資産		-		960
その他		176		170
固定資産計			32,083	21,353
資産合計			135,799	115,419

区分	注記 番号	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			118		98
未払金	1		11,855		10,401
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		31		31	
未払手数料		4,537		5,242	
その他未払金		7,284		5,126	
未払費用	1		8,872		9,461
未払法人税等			1,838		714
前受収益			45		39
賞与引当金			4,809		4,339
流動負債計			27,538		25,055
固定負債					
退職給付引当金			2,708		2,947
時効後支払損引当金			526		538
繰延税金負債			68		-
固定負債計			3,303		3,485
負債合計			30,842		28,540
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			99,606		86,837
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			68,696		55,927
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		68,011		55,242	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		43,405		30,635	
評価・換算差額等			5,349		41
その他有価証券評価差額金			5,349		41
純資産合計			104,956		86,878
負債・純資産合計			135,799		115,419

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)		当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			104,445		96,594
運用受託報酬			31,351		28,466
その他営業収益			219		266
営業収益計			136,016		125,327
営業費用					
支払手数料			46,531		39,785
広告宣伝費			1,008		1,011
公告費			0		0
調査費			28,068		26,758
調査費		4,900		5,095	
委託調査費		23,167		21,662	
委託計算費			1,148		1,290
営業雑経費			3,905		4,408
通信費		185		162	
印刷費		969		940	
協会費		78		76	
諸経費		2,672		3,228	
営業費用計			80,662		73,254
一般管理費					
給料			11,835		11,269
役員報酬	2	367		301	
給料・手当		6,928		6,923	
賞与		4,539		4,044	
交際費			124		126
旅費交通費			488		469
租税公課			695		898
不動産賃借料			1,230		1,222
退職給付費用			1,063		1,223
固定資産減価償却費			2,589		2,730
諸経費			7,801		8,118
一般管理費計			25,827		26,059
営業利益			29,526		26,012

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)		当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29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	7,323		7,397	
受取利息		4		0	

金銭の信託運用益		-		684	
為替差益		281		-	
その他		382		379	
営業外収益計			7,991		8,461
営業外費用					
支払利息		-		17	
金銭の信託運用損		1,196		-	
時効後支払損引当金繰入額		72		16	
為替差損		-		33	
その他		52		9	
営業外費用計			1,321		77
経常利益			36,196		34,397
特別利益					
投資有価証券等売却益		50		26	
関係会社清算益		-		41	
株式報酬受入益		96		59	
特別利益計			146		126
特別損失					
投資有価証券売却損		95		-	
投資有価証券等評価損		-		6	
固定資産除却損	3	60		9	
特別損失計			156		15
税引前当期純利益			36,186		34,507
法人税、住民税及び事業税			9,806		7,147
法人税等調整額			744		1,722
当期純利益			25,635		25,637

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	-	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092
当期変動額									
剰余金の配当							19,933	19,933	19,933
当期純利益							25,635	25,635	25,635
合併による増加			2,000	2,000			144	144	2,144
吸収分割による 増加							1,668	1,668	1,668

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	2,000	2,000	-	-	7,514	7,514	9,514
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606

(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	6,893	6,893	96,985
当期変動額			
剰余金の配当			19,933
当期純利益			25,635
合併による増加			2,144
吸収分割による増加			1,668
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	1,543	1,543	1,543
当期変動額合計	1,543	1,543	7,971
当期末残高	5,349	5,349	104,956

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当期変動額									
剰余金の配当							38,407	38,407	38,407
当期純利益							25,637	25,637	25,637
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	12,769	12,769	12,769
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

(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	5,349	5,349	104,956
当期変動額			
剰余金の配当			38,407
当期純利益			25,637
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	5,308	5,308	5,308
当期変動額合計	5,308	5,308	18,078
当期末残高	41	41	86,878

[重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算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</p>								
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	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	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	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>								

<p>5．消費税等の会計処理方法</p> <p>6．連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、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。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	---

[会計方針の変更]

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号平成28年6月17日）を当会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。
 なお、この変更による損益に与える影響は軽微であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (平成28年3月31日)	当事業年度末 (平成29年3月31日)
1．関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払金 5,894百万円 未払費用 1,151	1．関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払金 4,438百万円 未払費用 938
2．有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 641百万円 器具備品 3,132 合計 3,774	2．有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 681百万円 器具備品 3,331 合計 4,013

損益計算書関係

前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 7,081百万円 支払利息 -	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 5,252百万円 支払利息 17
2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損 建物 1百万円 器具備品 4 ソフトウェア 54 ア 合計 60	3. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 0 ソフトウェア 9 ア 合計 9

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28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

(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28年 5月13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	34,973百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	6,790円
基準日	平成28年 3月31日
効力発生日	平成28年 6月24日

当事業年度(自 平成28年 4月 1日 至 平成29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

配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

平成28年5月13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 34,973百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 6,790円

基準日 平成28年3月31日

効力発生日 平成28年6月24日

配当財産が金銭以外である場合における当該財産の総額

平成28年10月27日開催の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当財産の種類 株式会社野村総合研究所の株式

配当財産の帳簿価額 3,064百万円

1株当たり配当額 594円87銭

効力発生日 平成28年10月27日

配当財産の種類 株式会社ジャフコの株式

配当財産の帳簿価額 282百万円

1株当たり配当額 54円93銭

効力発生日 平成28年10月27日

配当財産の種類 朝日火災海上保険株式会社の株式

配当財産の帳簿価額 87百万円

1株当たり配当額 16円89銭

効力発生日 平成28年10月27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29年5月12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 25,598百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 4,970円

基準日 平成29年3月31日

効力発生日 平成29年6月23日

金融商品関係

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28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	208	208	-
(2)金銭の信託	55,341	55,341	-
(3)未収委託者報酬	14,131	14,131	-
(4)未収運用受託報酬	7,309	7,309	-

(5)有価証券及び投資有価証券	32,071	32,071	-
その他有価証券	32,071	32,071	-
(6)関係会社株式	3,064	180,880	177,816
資産計	112,127	289,944	177,816
(7)未払金	11,855	11,855	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	4,537	4,537	-
その他未払金	7,284	7,284	-
(8)未払費用	8,872	8,872	-
(9)未払法人税等	1,838	1,838	-
負債計	22,566	22,566	-

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、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。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。

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 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1,245百万円、関係会社株式7,894百万円）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。

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	208	-	-	-
金銭の信託	55,341	-	-	-
未収委託者報酬	14,131	-	-	-
未収運用受託報酬	7,309	-	-	-
有価証券	24,100	-	-	-
合計	101,091	-	-	-

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29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	127	127	-
(2)金銭の信託	52,247	52,247	-
(3)未収委託者報酬	16,287	16,287	-
(4)未収運用受託報酬	7,481	7,481	-
(5)有価証券及び投資有価証券	15,700	15,700	-
その他有価証券	15,700	15,700	-
資産計	91,843	91,843	-
(6)未払金	10,401	10,401	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	5,242	5,242	-
その他未払金	5,126	5,126	-
(7)未払費用	9,461	9,461	-
(8)未払法人税等	714	714	-
負債計	20,578	20,578	-

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、(4)未収運用受託報酬

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

ます。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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。

(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1,233百万円、関係会社株式8,124百万円）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。

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	127	-	-	-
金銭の信託	52,247	-	-	-
未収委託者報酬	16,287	-	-	-
未収運用受託報酬	7,481	-	-	-
有価証券	15,700	-	-	-
合計	91,843	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成28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28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28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	180,880	177,816
合計	3,064	180,880	177,816

4. その他有価証券(平成28年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	7,971	282	7,688
小計	7,971	282	7,688
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	24,100	24,100	-
小計	24,100	24,100	-
合計	32,071	24,382	7,688

5. 事業年度中に売却したその他有価証券(自平成27年4月1日至平成28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	135	-	95
合計	135	-	95

当事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

1. 売買目的有価証券(平成29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29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29年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(平成29年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			

株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	15,700	15,700	-
小計	15,700	15,700	-
合計	15,700	15,700	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）
該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	17,218 百万円
勤務費用	811
利息費用	181
数理計算上の差異の発生額	1,150
退職給付の支払額	654
その他	13
退職給付債務の期末残高	18,692
(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	16,117 百万円
期待運用収益	402
数理計算上の差異の発生額	711
事業主からの拠出額	511
退職給付の支払額	555
年金資産の期末残高	15,764
(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	15,775 百万円
年金資産	15,764
	11
非積立型制度の退職給付債務	2,917
未積立退職給付債務	2,928
未認識数理計算上の差異	3,409
未認識過去勤務費用	411
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69
退職給付引当金	2,708
前払年金費用	2,777
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	811 百万円
利息費用	181
期待運用収益	402
数理計算上の差異の費用処理額	314
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	863
(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	43%
株式	43%
生保一般勘定	13%
その他	1%
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	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.5%
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、191百万円でした。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 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	18,692 百万円
勤務費用	889
利息費用	125
数理計算上の差異の発生額	464
退職給付の支払額	634
その他	8
退職給付債務の期末残高	19,546

(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	15,764 百万円
期待運用収益	394
数理計算上の差異の発生額	468
事業主からの拠出額	507
退職給付の支払額	562
年金資産の期末残高	16,572

(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	16,578 百万円
年金資産	16,572
	5
非積立型制度の退職給付債務	2,967
未積立退職給付債務	2,973
未認識数理計算上の差異	2,992
未認識過去勤務費用	371
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
退職給付引当金	2,947
前払年金費用	2,594
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	889 百万円
利息費用	125
期待運用収益	394
数理計算上の差異の費用処理額	412
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	993
(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	49%
株式	39%
生保一般勘定	12%
その他	0%
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	
確定給付型企业年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%
3. 確定拠出制度	
当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。	

税効果会計関係

前事業年度末 (平成28年3月31日)	当事業年度末 (平成29年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	百万円		百万円
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	1,490	賞与引当金	1,345
退職給付引当金	839	退職給付引当金	913
投資有価証券評価減	460	投資有価証券評価減	417
関係会社株式評価減	1,676	関係会社株式評価減	247
ゴルフ会員権評価減	240	ゴルフ会員権評価減	212
減価償却超過額	177	減価償却超過額	171
時効後支払損引当金	163	時効後支払損引当金	166
子会社株式売却損	148	子会社株式売却損	148
未払事業税	350	未払事業税	110
関係会社株式譲渡益	120	関係会社株式譲渡益	88
未払社会保険料	89	未払社会保険料	85
その他	251	その他	274
繰延税金資産小計	6,678	繰延税金資産小計	4,183
評価性引当額	1,453	評価性引当額	739
繰延税金資産合計	5,224	繰延税金資産合計	3,444
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	2,403	その他有価証券評価差額金	18
前払年金費用	861	前払年金費用	804
繰延税金負債合計	3,264	繰延税金負債合計	822
繰延税金資産の純額	1,959	繰延税金資産の純額	2,621
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	33.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%
タックスヘイブン税制	0.8%	タックスヘイブン税制	0.7%
外国税額控除	0.2%	外国税額控除	0.2%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.5%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.4%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-
その他	0.4%	その他	0.2%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.7%
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		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	
<p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律13号)が平成28年3月29日に成立し、平成28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32%から31%となります。この税率変更による財務諸表に与える影響は軽微であります。</p>		<p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律13号)が平成28年3月29日に成立し、平成28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32%から31%となります。この税率変更による財務諸表に与える影響は軽微であります。</p>	

セグメント情報等

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成29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27年4月1日 至 平成28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20.8%	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)	5,058	未払費用	279

(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)	39,084	未払手数料	3,865
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)	2,412	未払費用	669

(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(株)(東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

(株)野村総合研究所

流動資産合計 239,155

固定資産合計 324,634

流動負債合計	122,933
固定負債合計	55,456
純資産合計	385,400
売上高	352,003
税引前当期純利益	56,508
当期純利益	40,179

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	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%	資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任	資金の借入(*1)	24,500	短期借入金	-
							資金の返済	24,500		
							借入金利息の支払	17	未払費用	-

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
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	-	サービス・製品の購入	自社利用ソフトウェア開発の委託等(*2)	787	未払費用	-

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3)	33,019	未払手数料	4,486

(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。なお、株式会社野村総合研究所は、平成28年10月27日より関連当事者に該当しないこととなったため、取引金額は関連当事者であった期間について、期末残高は関連当事者でなくなった時点について記載しております。

(* 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。

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

該当はありません。

1 株当たり情報

前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)		当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	
1株当たり純資産額	20,377円23銭	1株当たり純資産額	16,867円41銭
1株当たり当期純利益	4,977円07銭	1株当たり当期純利益	4,977円49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いません。		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いません。	
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	25,635百万円	損益計算書上の当期純利益	25,637百万円
普通株式に係る当期純利益	25,635百万円	普通株式に係る当期純利益	25,637百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委

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

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	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29年5月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 島根銀行	6,636百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社 十八銀行	24,404百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社 筑波銀行	48,868百万円	
株式会社 トマト銀行	17,810百万円	
株式会社 沖縄海邦銀行	4,537百万円	

* 平成29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28年 7月28日	有価証券届出書
平成28年 7月28日	有価証券報告書
平成29年 1月26日	有価証券届出書の訂正届出書
平成29年 1月26日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成29年6月5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 櫻井雄一郎

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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58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29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29年6月23日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 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28年5月11日から平成29年5月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、バランスセレクト70の平成29年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記は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。