

【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】	2018年7月26日提出
【計算期間】	第17期(自 2017年5月11日至 2018年5月10日)
【ファンド名】	バランスセレクト70（確定拠出年金向け）
【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】

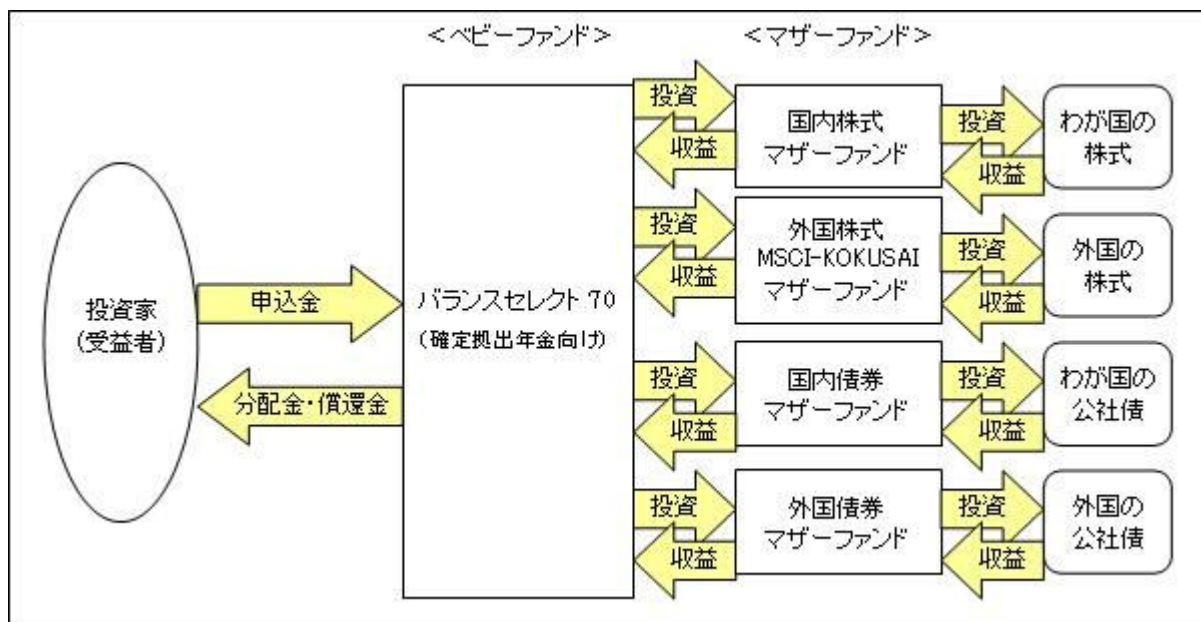
ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

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

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

《ファミリーファンド方式について》

ファンドは、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用を行いません。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。

分配金は、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。

<商品分類>

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(確定拠出年金向け))

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

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

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。（2013年2月21日現在）

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

- (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すべてのものをいう。
- (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すべてのものをいう。
- (2) 公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (3) 社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (4) その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (5) 格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[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...上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

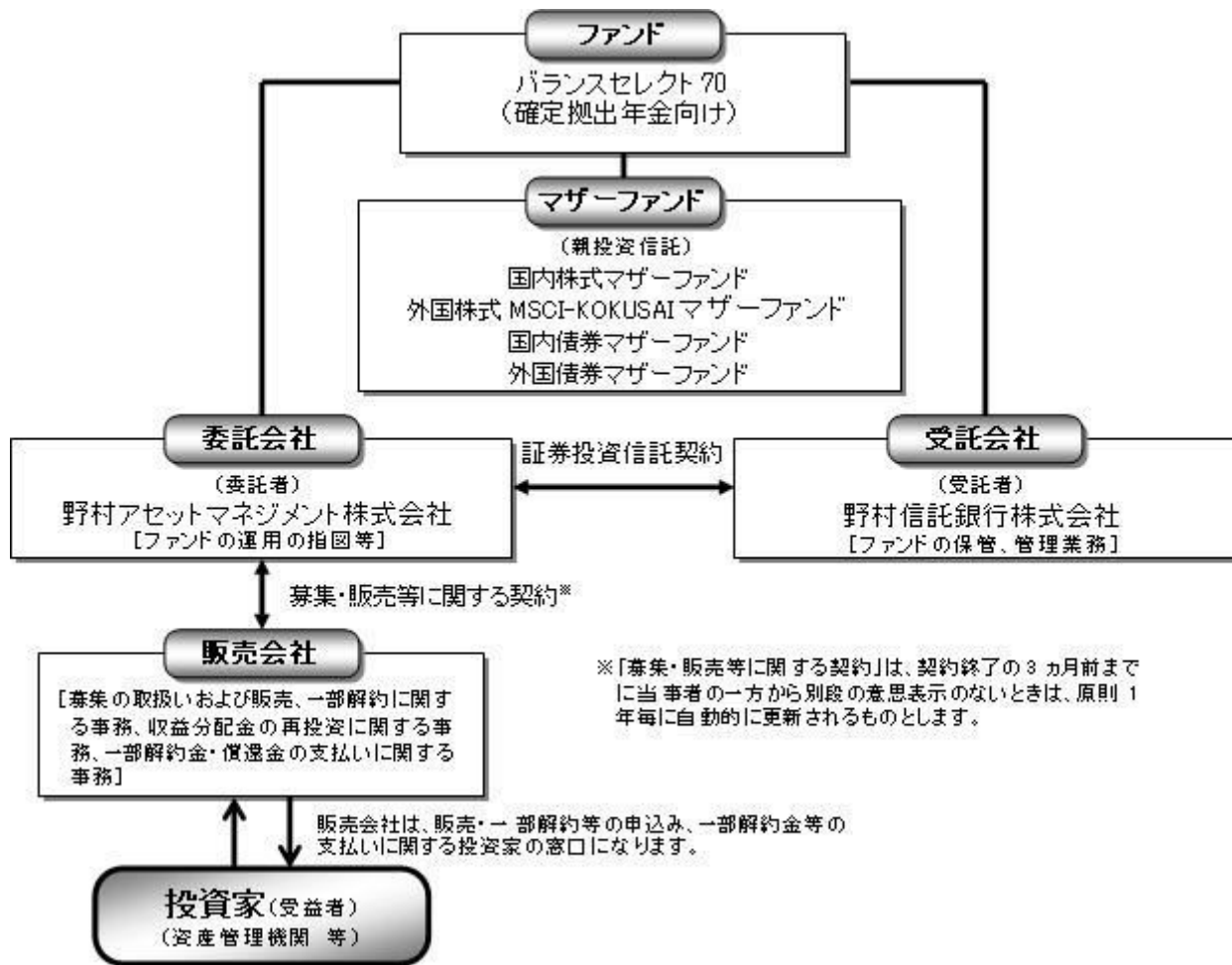
[特殊型]

- (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、仕組債への投資又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】

2001年11月22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(2018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

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
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
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
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」^(1)「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」^(2)
「国内債券マザーファンド」^(3)「外国債券マザーファンド」^(4)の各受益証券に投資を行ないま
す。

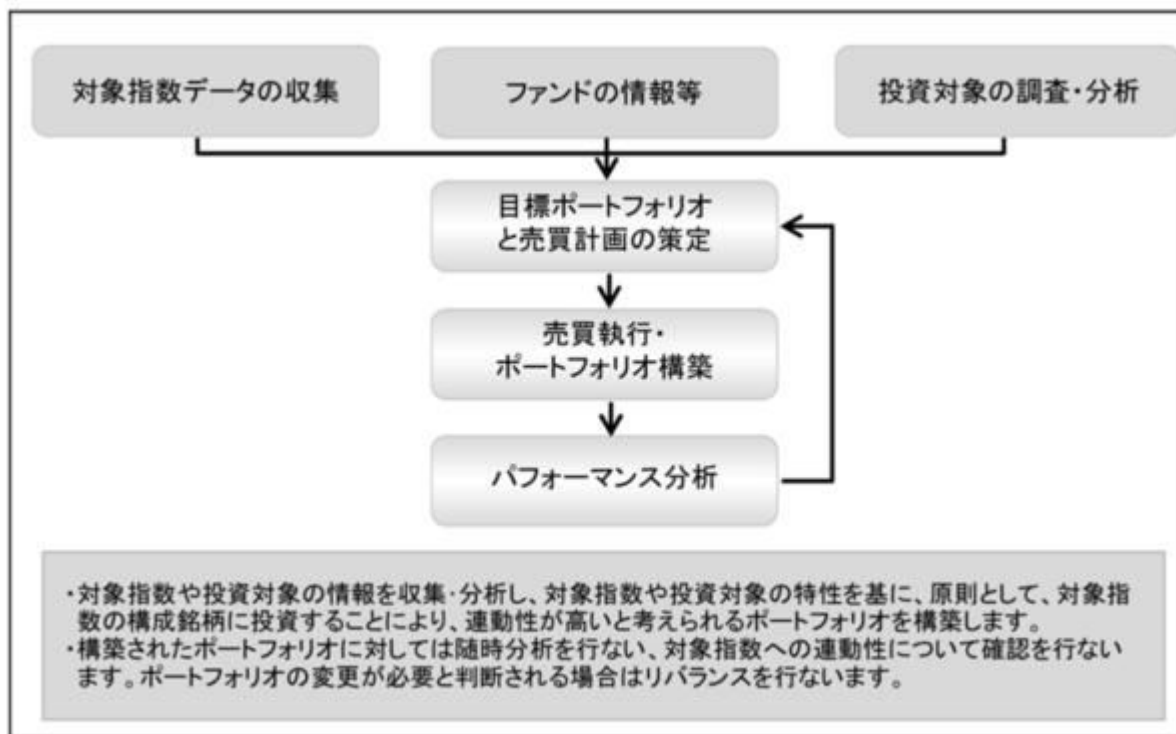
各マザーファンドへの投資比率は以下を基本とし、原則として3ヵ月毎にリバランスを行ないます。

国内株式マザーファンド受益証券	： 45%
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド受益証券	： 25%
国内債券マザーファンド受益証券	： 20%
外国債券マザーファンド受益証券	： 10%

株式への実質的な投資比率(国内株式+外国株式)は、70%程度となります。

- (1) 「国内株式マザーファンド」は、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。「国内株式マザーファンド」の運用方針等については、「(参考)各マザーファンドの概要」をご参照ください。
- (2) 「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」は、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。「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」の運用方針等については、「(参考)各マザーファンドの概要」をご参照ください。
* MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。
- (3) 「国内債券マザーファンド」は、主としてわが国の公社債に投資することにより、「NOMURA-BPI国債」の動きに連動する投資成果を目指します。「国内債券マザーファンド」の運用方針等については、「(参考)各マザーファンドの概要」をご参照ください。
- (4) 「外国債券マザーファンド」は、主として外国の公社債に投資することにより、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。「外国債券マザーファンド」の運用方針等については、「(参考)各マザーファンドの概要」をご参照ください。

■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証券株式会社に帰属しております。

また、野村証券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率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す。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income 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

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。

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。

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。

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17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)投資制限及び」に定めるものに限ります。)に係る権利
 - ハ 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)
 - ニ 金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)

- 2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

有価証券の指図範囲(約款第18条第1項)

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

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

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

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

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

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

- 1 株券または新株引受権証書
- 2 国債証券
- 3 地方債証券
- 4 特別の法律により法人の発行する債券(金融商品取引法第2条第1項第3号で定めるものをいいます。)
- 5 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10 コマーシャル・ペーパー
- 11 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 12 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14 投資証券、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18条第2項)

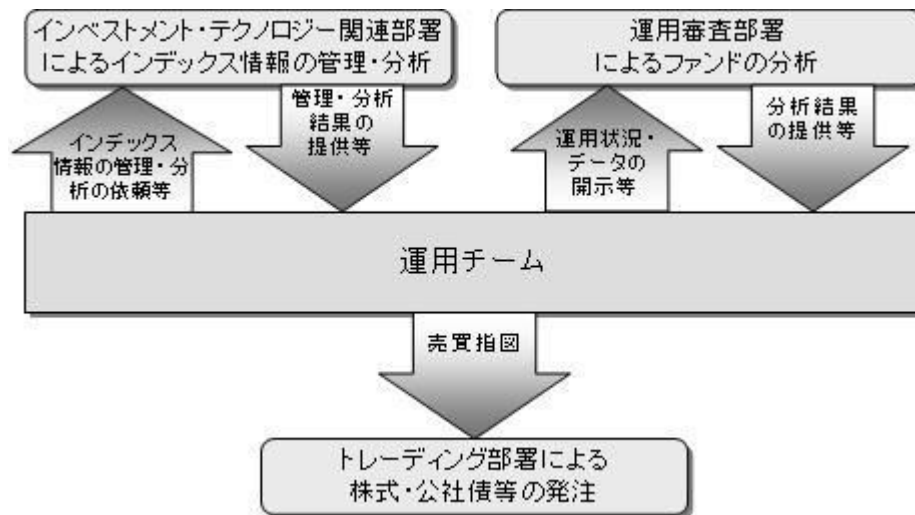
委託者は、信託金を、次の金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同

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】

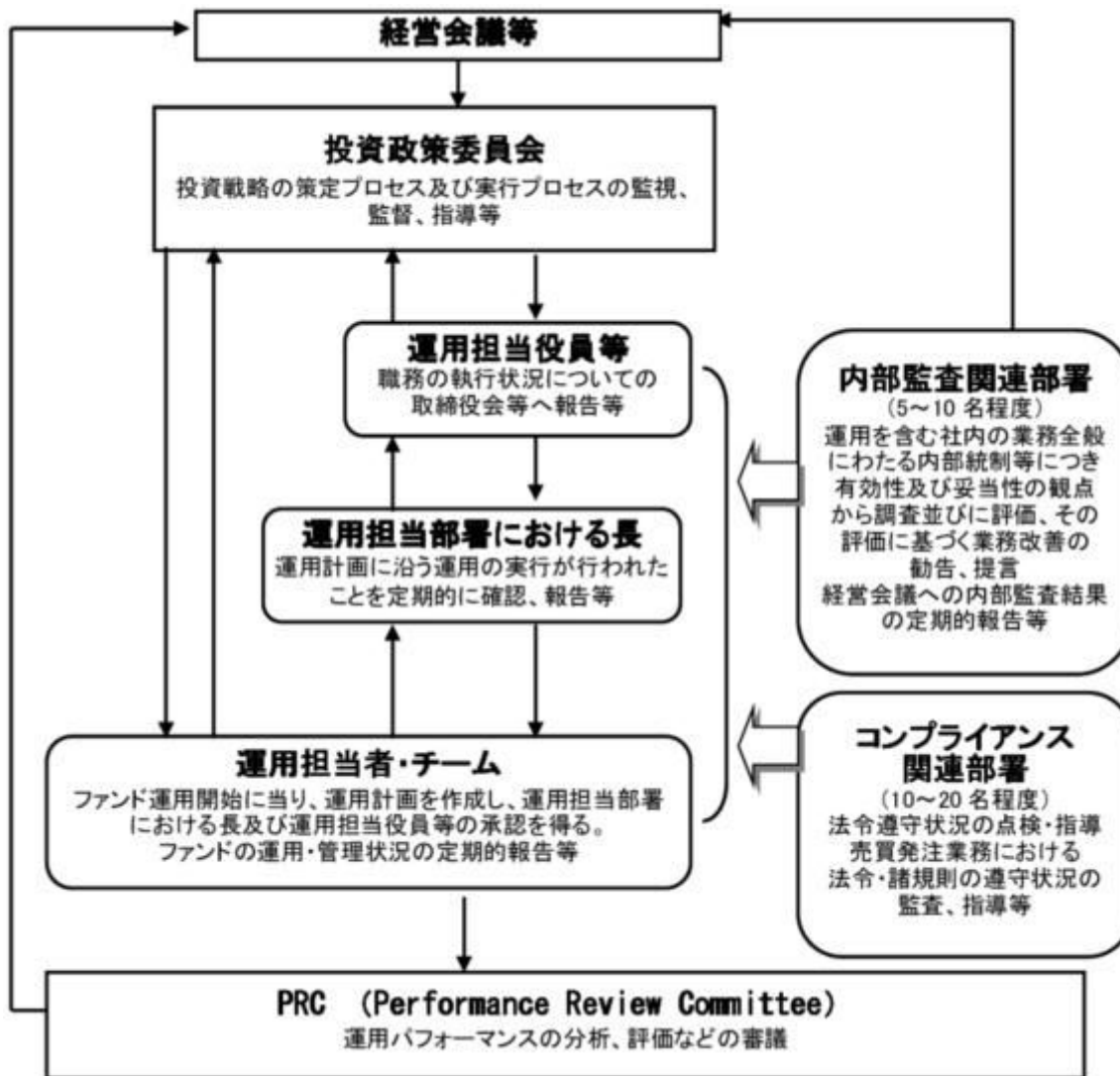
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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24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、為替の売予約と合わ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、為替の買予約と合わせて、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て、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第25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20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て、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、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23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27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29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30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39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。

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。(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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。

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、次のものとしします。

1. 基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

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、投資者の皆様は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

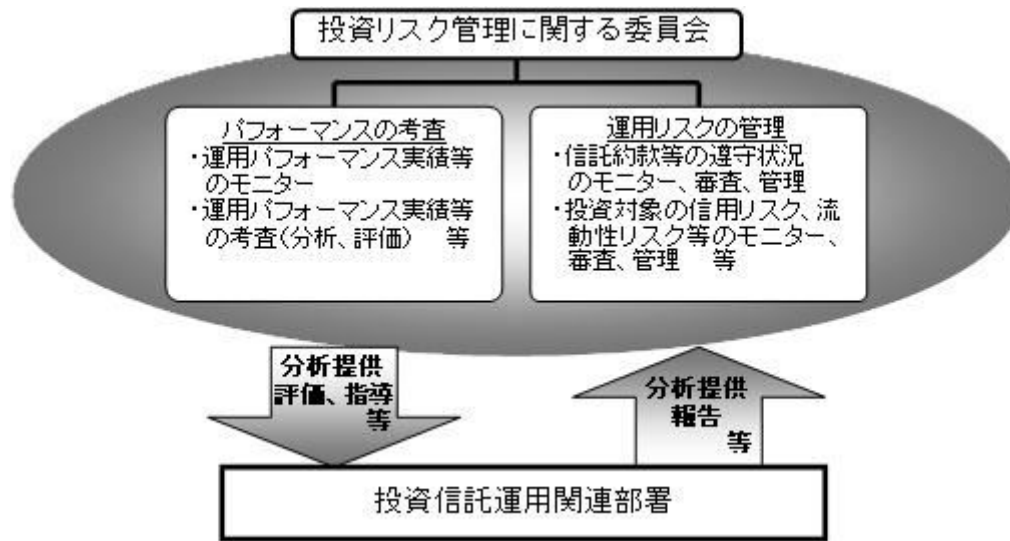
パフォーマンスの考査

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

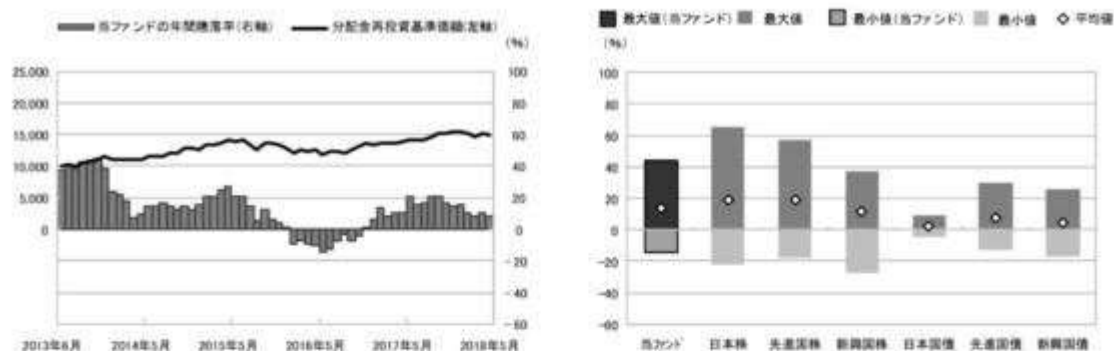


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

リスクの定量的比較

(2013年6月末～2018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(%)	44.1	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	26.1
最小値(%)	△14.7	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値(%)	13.3	18.8	18.8	12.1	2.2	7.2	4.5

- ＊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。2013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、2013年6月から2018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。
- ＊2013年6月から2018年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- ＊決算日に対応した数値とは異なります。
- ＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

＜代表的な資産クラスの指数＞

- 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
- 先進国株:MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債:NOMURA-BPI国債
- 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
- 新興国債: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・ディバースファイド(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(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、株式会社東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株式会社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、株式会社東京証券取引所は、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、責任を負いません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率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す。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income 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・ディバースファイド(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・ディバースファイド(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損益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も法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。英国のJ.P. 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)についての勧誘、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ、NYSE、SPCC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、FTSE Fixed Income LLC 他)

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

（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72.36（税抜年10,000分の67）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33	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	口座内でのファンドの管理および事務手続き、購入後の情報提供、各種書類の送付等	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る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。

*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。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかります。

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

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(所得税及び復興特別所得税)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。

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。

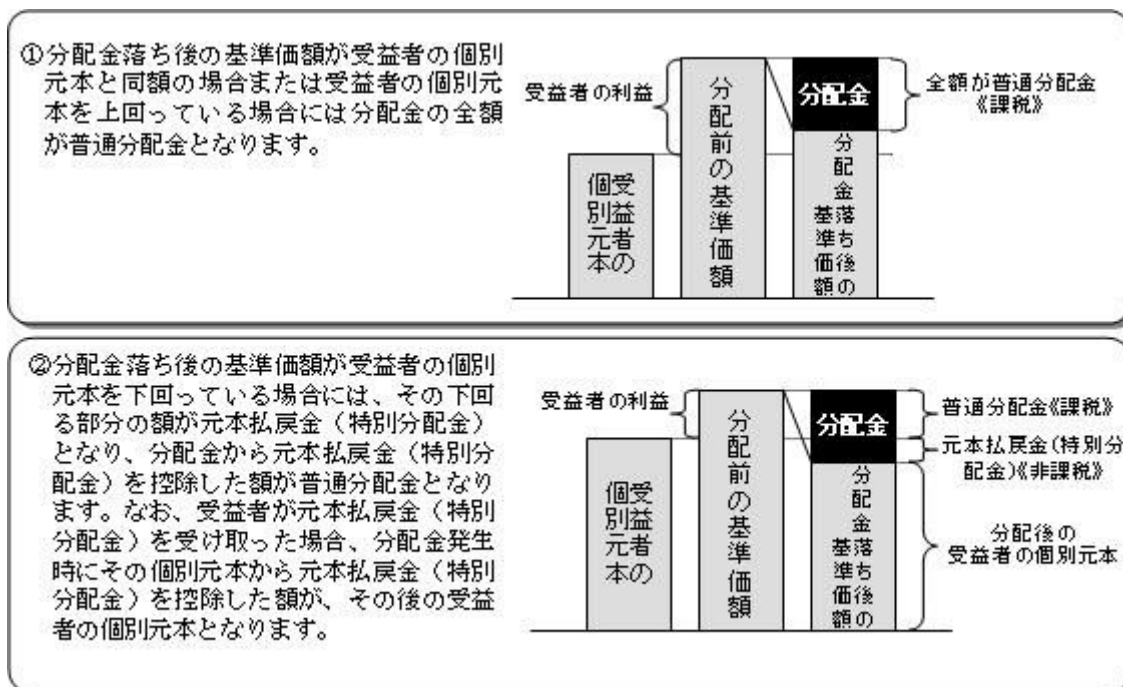
換金(解約)時および償還時の課税について

換金(解約)時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

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。

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(2018年5月末現在)が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2018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（確定拠出年金向け）

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	156,271,970	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		155,397	0.09
合計（純資産総額）		156,427,367	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	367,583,152,590	97.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,874,278,676	2.09
合計（純資産総額）		375,457,431,266	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	日本	7,850,250,000	2.09

(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	305,141,259,264	63.22
	カナダ	17,769,775,114	3.68
	ドイツ	17,951,079,935	3.71
	イタリア	4,363,761,637	0.90
	フランス	19,489,346,797	4.03
	オランダ	6,281,713,049	1.30
	スペイン	5,525,455,458	1.14
	ベルギー	1,933,911,713	0.40
	オーストリア	457,332,198	0.09
	ルクセンブルグ	114,304,504	0.02

	フィンランド	1,942,862,906	0.40
	アイルランド	916,401,485	0.18
	ポルトガル	292,121,522	0.06
	イギリス	33,223,188,116	6.88
	スイス	14,092,650,399	2.92
	スウェーデン	4,830,811,705	1.00
	ノルウェー	1,285,765,778	0.26
	デンマーク	3,167,642,159	0.65
	オーストラリア	11,665,071,964	2.41
	ニュージーランド	336,555,034	0.06
	香港	6,118,287,380	1.26
	シンガポール	2,292,124,626	0.47
	イスラエル	517,666,874	0.10
	小計	459,709,089,617	95.25
投資信託受益証券	アメリカ	16,321,848	0.00
投資証券	アメリカ	8,612,361,958	1.78
	カナダ	74,210,539	0.01
	フランス	686,298,774	0.14
	イギリス	413,268,850	0.08
	オーストラリア	938,561,890	0.19
	香港	278,972,240	0.05
	シンガポール	197,594,710	0.04
	小計	11,201,268,961	2.32
現金・預金・その他資産（負債控除後）		11,681,613,973	2.42
合計（純資産総額）		482,608,294,399	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	7,848,058,470	1.62
	買建	カナダ	447,891,752	0.09
	買建	ドイツ	1,500,498,399	0.31
	買建	イギリス	829,900,879	0.17
	買建	スイス	359,099,746	0.07
	買建	オーストラリア	308,555,151	0.06

（参考）国内債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	25,340,458,790	99.54

現金・預金・その他資産（負債控除後）		116,258,738	0.45
合計（純資産総額）		25,456,717,528	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	262,660,375,095	43.52
	カナダ	12,981,452,195	2.15
	メキシコ	4,676,006,571	0.77
	ドイツ	38,779,574,798	6.42
	イタリア	57,594,244,681	9.54
	フランス	59,878,130,987	9.92
	オランダ	12,162,211,509	2.01
	スペイン	40,023,701,102	6.63
	ベルギー	14,639,518,816	2.42
	オーストリア	8,067,837,730	1.33
	フィンランド	3,070,792,416	0.50
	アイルランド	6,135,633,660	1.01
	イギリス	42,322,577,641	7.01
	スイス	1,060,499,576	0.17
	スウェーデン	2,358,029,474	0.39
	ノルウェー	1,821,877,271	0.30
	デンマーク	3,626,222,593	0.60
	ポーランド	3,744,455,962	0.62
	オーストラリア	13,059,879,594	2.16
	シンガポール	2,483,395,665	0.41
マレーシア	2,956,950,303	0.48	
南アフリカ	3,804,125,869	0.63	
	小計	597,907,493,508	99.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,598,421,620	0.92
合計（純資産総額）		603,505,915,128	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（確定拠出年金向け）

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	41,040,604	1.7298	70,995,095	1.7009	69,805,963	44.62

2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	15,031,678	2.6251	39,459,657	2.5961	39,023,739	24.94
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド	23,619,321	1.3481	31,841,207	1.3502	31,890,807	20.38
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	7,104,368	2.2324	15,860,417	2.1890	15,551,461	9.94

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	1,788,800	7,591.91	13,580,419,400	6,921.00	12,380,284,800	3.29
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,160,300	718.99	7,305,174,500	655.80	6,663,124,740	1.77
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,036,200	5,265.98	5,456,618,000	5,106.00	5,290,837,200	1.40
4	日本	株式	ソニー	電気機器	985,000	5,109.01	5,032,380,000	5,160.00	5,082,600,000	1.35
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	653,700	8,354.90	5,461,602,700	7,765.00	5,075,980,500	1.35
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,098,500	4,491.99	4,934,459,900	4,503.00	4,946,545,500	1.31
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	72,200	67,690.00	4,887,218,000	66,830.00	4,825,126,000	1.28
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,324,100	3,549.98	4,700,528,600	3,447.00	4,564,172,700	1.21
9	日本	株式	任天堂	その他製品	90,600	45,500.00	4,122,300,000	45,000.00	4,077,000,000	1.08
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,300,200	2,884.01	3,749,790,400	2,945.50	3,829,739,100	1.02
11	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,718,700	198.09	3,906,252,910	189.70	3,740,637,390	0.99
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,084,700	2,771.01	3,005,720,450	3,030.00	3,286,641,000	0.87
13	日本	株式	ファナック	電気機器	139,800	23,030.00	3,219,594,000	23,270.00	3,253,146,000	0.86
14	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,017,000	3,186.98	3,241,159,650	3,031.00	3,082,527,000	0.82
15	日本	株式	花王	化学	361,800	7,663.00	2,772,473,400	8,442.00	3,054,315,600	0.81
16	日本	株式	日本電産	電気機器	177,100	16,929.87	2,998,280,000	16,885.00	2,990,333,500	0.79
17	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	131,800	21,350.87	2,814,045,000	22,510.00	2,966,818,000	0.79
18	日本	株式	キヤノン	電気機器	792,100	3,789.98	3,002,049,600	3,714.00	2,941,859,400	0.78
19	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	607,500	4,762.00	2,892,920,900	4,821.00	2,928,757,500	0.78
20	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,036,800	2,792.50	2,895,265,900	2,818.00	2,921,702,400	0.77
21	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	546,800	5,248.98	2,870,145,700	5,240.00	2,865,232,000	0.76
22	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	264,300	10,709.96	2,830,643,000	10,755.00	2,842,546,500	0.75
23	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,533,000	864.30	3,053,571,900	796.60	2,814,387,800	0.74
24	日本	株式	信越化学工業	化学	256,600	11,270.00	2,891,882,000	10,890.00	2,794,374,000	0.74

25	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	913,700	2,993.98	2,735,608,550	2,936.00	2,682,623,200	0.71
26	日本	株式	小松製作所	機械	710,500	3,581.99	2,545,008,300	3,587.00	2,548,563,500	0.67
27	日本	株式	ダイキン工業	機械	200,900	13,119.64	2,635,737,500	12,580.00	2,527,322,000	0.67
28	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,512,200	1,655.50	2,503,448,600	1,664.50	2,517,056,900	0.67
29	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,681,000	1,561.99	2,625,708,400	1,489.50	2,503,849,500	0.66
30	日本	株式	村田製作所	電気機器	154,400	14,440.00	2,229,536,000	16,185.00	2,498,964,000	0.66

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	3.06
		食料品	4.33
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.37
		医薬品	4.52
		石油・石炭製品	0.67
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.03
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.64
		機械	5.19
		電気機器	13.29
		輸送用機器	8.32
		精密機器	1.67
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.70
		陸運業	4.21
		海運業	0.19
		空運業	0.60
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	7.23
		卸売業	4.70
		小売業	4.89
銀行業	6.69		
証券、商品先物取引業	0.91		
保険業	2.23		
その他金融業	1.20		
不動産業	2.39		
サービス業	4.39		

合 計	97.90
-----	-------

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	605,500	18,237.38	11,042,735,577	20,381.25	12,340,846,875	2.55
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	864,400	9,918.52	8,573,573,260	10,755.86	9,297,369,706	1.92
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	48,310	157,234.22	7,595,985,242	176,625.54	8,532,779,982	1.76
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	281,400	17,364.18	4,886,280,456	20,399.72	5,740,483,741	1.18
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	409,400	11,951.25	4,892,844,507	11,777.64	4,821,767,863	0.99
6	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	500,100	8,108.28	4,054,954,888	8,859.05	4,430,410,905	0.91
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	37,120	112,127.37	4,162,168,326	116,069.85	4,308,513,203	0.89
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	317,000	13,925.19	4,414,287,955	13,149.43	4,168,372,163	0.86
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	35,200	112,707.99	3,967,321,575	117,120.98	4,122,658,813	0.85
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,169,500	3,259.22	3,811,657,909	3,205.56	3,748,905,929	0.77
11	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	552,600	5,656.19	3,125,611,960	6,052.41	3,344,565,082	0.69
12	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	552,300	5,695.71	3,145,741,575	5,894.80	3,255,698,592	0.67
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	149,900	21,678.57	3,249,617,981	21,098.67	3,162,690,633	0.65
14	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	224,300	12,393.58	2,779,880,490	13,604.89	3,051,577,276	0.63
15	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア・プロ バイダー/ ヘルスケ ア・サー ビス	114,430	23,272.06	2,663,022,637	26,624.97	3,046,696,233	0.63
16	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	367,400	8,321.12	3,057,183,046	8,282.36	3,042,940,166	0.63
17	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	214,100	13,001.55	2,783,632,801	14,200.56	3,040,341,609	0.62
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	137,900	19,366.09	2,670,584,350	20,336.68	2,804,428,586	0.58
19	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	703,900	3,857.16	2,715,060,001	3,918.63	2,758,327,176	0.57
20	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	583,800	4,659.83	2,720,412,031	4,657.79	2,719,220,721	0.56
21	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇 宙・防衛	66,830	35,634.94	2,381,483,650	38,935.25	2,602,042,958	0.53
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	487,100	5,197.13	2,531,522,836	5,282.82	2,573,261,622	0.53

23	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	724,900	3,874.37	2,808,531,190	3,540.35	2,566,406,239	0.53
24	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	2,362,000	961.90	2,272,010,366	1,049.21	2,478,249,326	0.51
25	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	299,600	8,615.10	2,581,085,596	8,140.54	2,438,906,683	0.50
26	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	111,000	19,035.51	2,112,942,535	20,844.31	2,313,718,632	0.47
27	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	312,300	7,338.07	2,291,679,885	7,248.11	2,263,586,627	0.46
28	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	478,100	4,720.15	2,256,705,681	4,688.23	2,241,443,241	0.46
29	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	262,700	8,501.60	2,233,372,812	8,200.92	2,154,383,260	0.44
30	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	188,700	10,284.60	1,940,704,733	11,197.18	2,112,909,187	0.43

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	0.53
		エネルギー設備・サービス	0.54
		石油・ガス・消耗燃料	6.47
		化学	2.60
		建設資材	0.31
		容器・包装	0.27
		金属・鉱業	1.61
		紙製品・林産品	0.12
		航空宇宙・防衛	2.33
		建設関連製品	0.38
		建設・土木	0.33
		電気設備	0.77
		コングロマリット	1.49
		機械	1.58
		商社・流通業	0.33
		商業サービス・用品	0.37
		航空貨物・物流サービス	0.58
		旅客航空輸送業	0.12
		海運業	0.06
		陸運・鉄道	1.01
		運送インフラ	0.20
		自動車部品	0.46
		自動車	0.98
		家庭用耐久財	0.41
レジャー用品	0.05		
繊維・アパレル・贅沢品	1.36		
ホテル・レストラン・レジャー	1.84		
メディア	2.01		
販売	0.06		

インターネット販売・通信販売	2.54
複合小売り	0.41
専門小売り	1.57
食品・生活必需品小売り	1.59
飲料	1.88
食品	1.70
タバコ	1.04
家庭用品	1.09
パーソナル用品	0.72
ヘルスケア機器・用品	2.23
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.97
バイオテクノロジー	2.06
医薬品	4.95
銀行	8.89
各種金融サービス	0.94
保険	3.84
インターネットソフトウェア・サービス	3.31
情報技術サービス	3.25
ソフトウェア	4.49
通信機器	0.91
コンピュータ・周辺機器	2.89
電子装置・機器・部品	0.43
半導体・半導体製造装置	3.17
各種電気通信サービス	1.89
無線通信サービス	0.31
電力	1.69
ガス	0.14
総合公益事業	0.95
水道	0.07
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01
消費者金融	0.49
資本市場	2.98
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	0.06
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	0.58
専門サービス	0.66
投資信託受益証券	0.00
投資証券	2.32
合計	97.57

(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	460,000,000	100.59	462,743,400	100.61	462,829,000	0.1	2020/12/20	1.81
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	430,000,000	100.53	432,287,600	100.55	432,382,200	0.1	2020/9/20	1.69
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	390,000,000	100.65	392,535,500	100.66	392,574,000	0.1	2021/3/20	1.54
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	350,000,000	100.68	352,401,000	100.72	352,520,000	0.1	2021/6/20	1.38
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	335,000,000	103.28	346,008,100	103.33	346,175,600	0.4	2025/9/20	1.35
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 49回	340,000,000	100.63	342,162,800	100.76	342,590,800	0.1	2027/12/20	1.34
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	330,000,000	100.79	332,626,800	100.88	332,904,000	0.1	2027/3/20	1.30
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	330,000,000	100.78	332,577,900	100.82	332,709,300	0.1	2021/12/20	1.30
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	320,000,000	103.86	332,360,200	103.85	332,323,200	0.6	2023/12/20	1.30
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	320,000,000	100.47	321,520,000	100.49	321,577,600	0.1	2020/6/20	1.26
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	300,000,000	104.11	312,330,000	104.13	312,405,000	0.6	2024/6/20	1.22
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	300,000,000	100.74	302,226,000	100.76	302,289,000	0.1	2021/9/20	1.18
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第37 9回	300,000,000	100.30	300,900,000	100.30	300,903,000	0.1	2019/8/15	1.18
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	280,000,000	104.59	292,866,000	104.62	292,944,400	0.8	2023/6/20	1.15
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	290,000,000	100.57	291,681,100	100.68	291,980,700	0.1	2028/3/20	1.14
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	280,000,000	103.21	288,988,000	103.25	289,119,600	0.4	2025/6/20	1.13
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	280,000,000	101.02	282,864,400	101.09	283,066,000	0.1	2026/3/20	1.11
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	280,000,000	100.93	282,616,400	100.99	282,794,400	0.1	2026/9/20	1.11
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	280,000,000	100.81	282,289,400	100.85	282,405,200	0.1	2022/3/20	1.10
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	280,000,000	100.72	282,036,800	100.78	282,209,200	0.1	2027/9/20	1.10
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	280,000,000	100.41	281,170,400	100.42	281,187,200	0.1	2020/3/20	1.10
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	270,000,000	102.59	277,006,500	102.65	277,163,100	0.3	2025/12/20	1.08

23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	260,000,000	100.72	261,890,200	100.81	262,113,800	0.1	2027/6/20	1.02
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	260,000,000	100.36	260,959,000	100.37	260,969,800	0.1	2019/12/20	1.02
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 4回	250,000,000	100.94	252,372,500	101.03	252,575,000	0.1	2022/12/20	0.99
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	250,000,000	100.86	252,152,500	100.94	252,352,500	0.1	2026/12/20	0.99
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	210,000,000	119.56	251,084,400	119.76	251,500,200	1.6	2033/12/20	0.98
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	240,000,000	104.00	249,602,400	103.99	249,580,800	0.6	2024/3/20	0.98
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 26回	240,000,000	103.70	248,892,000	103.73	248,952,000	0.7	2022/12/20	0.97
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	240,000,000	103.13	247,514,400	103.17	247,622,400	0.4	2025/3/20	0.97

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.54
合計	99.54

(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	11,079.33	5,739,094,124	11,095.46	5,747,451,713	3.625	2020/2/15	0.95
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	10,870.00	5,717,620,000	10,904.81	5,735,934,109	2.625	2020/11/15	0.95
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,800,000	11,018.18	5,597,239,776	11,030.07	5,603,279,144	3.375	2019/11/15	0.92
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,300,000	10,342.63	5,202,345,074	10,460.67	5,261,720,038	2.25	2025/11/15	0.87
5	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	15,676.50	5,188,921,831	15,803.23	5,230,869,461	3.5	2026/4/25	0.86
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	39,200,000	13,160.34	5,158,854,338	13,274.13	5,203,461,887	6	2026/2/15	0.86
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,600,000	10,317.15	5,117,310,528	10,404.62	5,160,695,550	1.75	2023/5/15	0.85
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,200,000	11,071.26	5,114,924,232	11,092.06	5,124,536,225	3.5	2020/5/15	0.84
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	11,149.39	5,106,421,855	11,185.90	5,123,146,494	3.625	2021/2/15	0.84
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	47,100,000	10,530.73	4,959,976,858	10,631.36	5,007,374,665	2.375	2024/8/15	0.82
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000	15,537.73	4,863,310,006	15,611.86	4,886,514,903	4.25	2023/10/25	0.80
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,007.20	4,689,068,117	11,050.45	4,707,495,238	3.125	2021/5/15	0.78
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000	18,879.41	4,625,455,855	19,014.56	4,658,569,454	5.5	2029/4/25	0.77
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,700,000	10,239.87	4,577,225,977	10,348.57	4,625,814,877	2	2025/2/15	0.76
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,400,000	10,448.78	4,012,334,400	10,517.57	4,038,748,395	1.75	2022/4/30	0.66

16	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,100,000	19,281.41	3,875,563,973	19,978.19	4,015,616,592	3.5	2045/1/22	0.66
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	10,587.20	3,906,680,247	10,848.76	4,003,195,656	3	2044/11/15	0.66
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,200,000	10,753.65	3,892,823,550	10,789.32	3,905,735,269	2.125	2020/8/31	0.64
19	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	20,300,000	18,409.71	3,737,172,348	19,054.45	3,868,054,081	3.25	2044/1/22	0.64
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	13,702.93	4,001,256,935	13,226.17	3,862,043,523	4.25	2020/3/1	0.63
21	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000	19,566.98	3,795,995,142	19,840.46	3,849,050,910	6.5	2027/7/4	0.63
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	10,647.92	3,726,775,206	10,760.44	3,766,157,488	2.625	2025/3/31	0.62
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	10,680.62	3,631,412,142	10,732.42	3,649,024,846	2.125	2021/6/30	0.60
24	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,700,000	13,589.25	3,628,331,859	13,575.31	3,624,609,799	2.5	2020/10/25	0.60
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,200,000	10,430.10	3,567,095,618	10,532.01	3,601,947,555	2.25	2024/11/15	0.59
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	10,575.32	3,563,883,117	10,638.16	3,585,060,751	2	2022/2/15	0.59
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,400,000	11,033.47	3,574,845,553	11,040.69	3,577,184,434	3.625	2019/8/15	0.59
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000	17,941.55	3,552,428,674	18,043.76	3,572,665,808	6	2025/10/25	0.59
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000	20,314.48	3,555,035,663	20,385.66	3,567,490,687	4.5	2041/4/25	0.59
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,400,000	10,248.37	3,525,439,925	10,334.99	3,555,237,126	1.625	2023/5/31	0.58

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.07
合計	99.07

【投資不動産物件】

バランスセレクト70(確定拠出年金向け)

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

バランスセレクト70(確定拠出年金向け)

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(2018年06月限)	買建	450	日本円	7,990,900,572	7,850,250,000	2.09

(参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2018 年06月限)	買建	530	米ドル	70,600,950	7,674,323,264	72,199,250	7,848,058,470	1.62
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2018年06 月限)	買建	28	カナダド ル	5,164,240	435,603,644	5,309,920	447,891,752	0.09
	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(2018年06 月限)	買建	346	ユーロ	11,744,290	1,488,353,874	11,840,120	1,500,498,399	0.31
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200株価指数先 物(2018年06月限)	買建	25	豪ドル	3,682,575	303,260,051	3,746,875	308,555,151	0.06
	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(2018年06月限)	買建	75	英ポンド	5,504,710	795,760,878	5,740,875	829,900,879	0.17
	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 (2018年06月限)	買建	38	スイスフ ラン	3,300,890	363,262,941	3,263,060	359,099,746	0.07

(参考)国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（ 3 ） 【運用実績】

【純資産の推移】

バランスセレクト70（確定拠出年金向け）

2018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8計算期間	(2009年 5月11日)	52	52	0.9894	0.9894
第9計算期間	(2010年 5月10日)	62	62	1.0434	1.0439
第10計算期間	(2011年 5月10日)	68	69	1.0332	1.0337
第11計算期間	(2012年 5月10日)	69	69	0.9814	0.9814
第12計算期間	(2013年 5月10日)	97	97	1.4047	1.4052
第13計算期間	(2014年 5月12日)	82	82	1.4577	1.4582
第14計算期間	(2015年 5月11日)	109	109	1.8263	1.8268
第15計算期間	(2016年 5月10日)	109	109	1.6411	1.6416
第16計算期間	(2017年 5月10日)	124	124	1.8736	1.8741
第17計算期間	(2018年 5月10日)	156	156	2.0314	2.0319
	2017年 5月末日	124		1.8567	
	6月末日	128		1.8894	
	7月末日	129		1.8953	
	8月末日	123		1.8969	
	9月末日	127		1.9555	
	10月末日	132		2.0135	
	11月末日	135		2.0306	
	12月末日	146		2.0621	
	2018年 1月末日	150		2.0711	
	2月末日	145		2.0089	
	3月末日	143		1.9703	
	4月末日	150		2.0248	
	5月末日	156		2.0065	

【分配の推移】

バランスセレクト70（確定拠出年金向け）

	計算期間	1口当たりの分配金
第8計算期間	2008年 5月13日～2009年 5月11日	0.0000円
第9計算期間	2009年 5月12日～2010年 5月10日	0.0005円
第10計算期間	2010年 5月11日～2011年 5月10日	0.0005円

第11計算期間	2011年 5月11日～2012年 5月10日	0.0000円
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	0.0005円
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	0.0005円
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	0.0005円
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	0.0005円
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	0.0005円
第17計算期間	2017年 5月11日～2018年 5月10日	0.0005円

【収益率の推移】

バランスセレクト70(確定拠出年金向け)

	計算期間	収益率
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	5.5%
第10計算期間	2010年 5月11日～2011年 5月10日	0.9%
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	43.2%
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	3.8%
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	10.1%
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	14.2%
第17計算期間	2017年 5月11日～2018年 5月10日	8.4%

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(確定拠出年金向け)

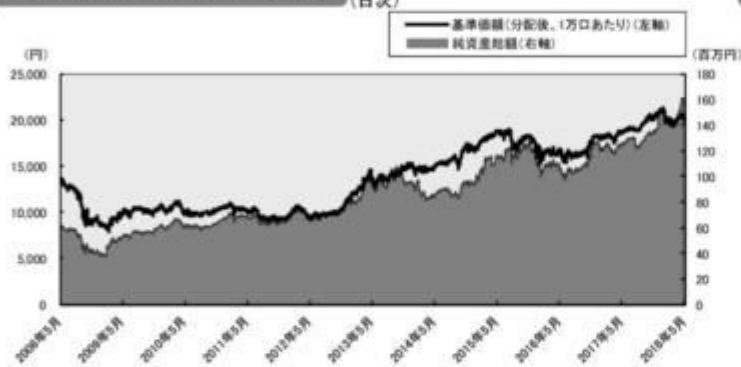
	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第8計算期間	2008年 5月13日～2009年 5月11日	18,155,237	10,514,173	52,856,214
第9計算期間	2009年 5月12日～2010年 5月10日	10,128,136	2,675,129	60,309,221
第10計算期間	2010年 5月11日～2011年 5月10日	9,945,392	3,501,962	66,752,651
第11計算期間	2011年 5月11日～2012年 5月10日	8,338,981	4,703,910	70,387,722
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	16,507,979	17,803,929	69,091,772
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	18,129,739	30,374,297	56,847,214
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	26,548,644	23,661,640	59,734,218
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	15,486,501	8,782,589	66,438,130
第16計算期間	2016年 5月11日～2017年 5月10日	12,984,557	13,007,209	66,415,478
第17計算期間	2017年 5月11日～2018年 5月10日	19,361,847	8,932,707	76,844,618

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 (2018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)

2018年5月	5 円
2017年5月	5 円
2016年5月	5 円
2015年5月	5 円
2014年5月	5 円
設定来累計	90 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	44.6
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	24.9
3	国内債券マザーファンド	20.4
4	外国債券マザーファンド	9.9

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1.5
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.8
3	日本電信電話	情報・通信業	0.6
4	ソニー	電気機器	0.6
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	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	0.5
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.4
4	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	0.3
5	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.2

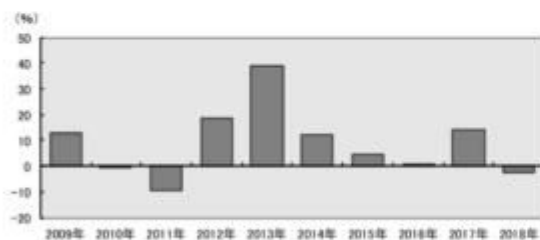
・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国債債券 利付(5年)第126回	国債証券	0.4
2	国債債券 利付(5年)第125回	国債証券	0.3
3	国債債券 利付(5年)第127回	国債証券	0.3
4	国債債券 利付(5年)第128回	国債証券	0.3
5	国債債券 利付(10年)第340回	国債証券	0.3

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
5	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	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。
・2018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時までに、買付のお申込みが行なわれかつその買付のお申込み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。

ファンドの申込（販売）手続についてご不明な点がある場合に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、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

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。

購入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。

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、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け付けを中止すること、および既に受け付けた取得申込みの受け付けを取り消す場合があります。

<申込手数料>

なし

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

2【換金（解約）手続等】

受益者は、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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となります。

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、大口解約には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。

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。

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、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。

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(2001年11月22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。

なお、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。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、やむを得ない事情が発生したとき等は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。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続

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

収益分配金は、自動けいぞく投資契約に基づいて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。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

換金(解約)の単位

受益者は、受益権を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。

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17期計算期間(2017年5月11日から2018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（確定拠出年金向け）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 (2017年 5月10日現在)	第17期 (2018年 5月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	552,059	709,381
親投資信託受益証券	124,314,475	155,946,368
未収入金	42,149	21,716
流動資産合計	124,908,683	156,677,465
資産合計	124,908,683	156,677,465
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	33,207	38,422
未払解約金	-	18,943
未払受託者報酬	32,474	38,388
未払委託者報酬	402,590	475,940
未払利息	-	1
その他未払費用	1,891	2,242
流動負債合計	470,162	573,936
負債合計	470,162	573,936
純資産の部		
元本等		
元本	66,415,478	76,844,618
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	58,023,043	79,258,911
（分配準備積立金）	24,112,367	30,718,309
元本等合計	124,438,521	156,103,529
純資産合計	124,438,521	156,103,529
負債純資産合計	124,908,683	156,677,465

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期		第17期	
	自	2016年 5月11日 至 2017年 5月10日	自	2017年 5月11日 至 2018年 5月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		16,355,963		11,142,507
営業収益合計		16,355,963		11,142,507
営業費用				
支払利息		23		53
受託者報酬		61,074		72,996
委託者報酬		757,133		904,986
その他費用		3,550		4,261
営業費用合計		821,780		982,296
営業利益又は営業損失()		15,534,183		10,160,211
経常利益又は経常損失()		15,534,183		10,160,211
当期純利益又は当期純損失()		15,534,183		10,160,211
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()		1,034,872		557,720
期首剰余金又は期首欠損金()		42,594,970		58,023,043
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,316,741		19,558,400
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,316,741		19,558,400
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,354,772		7,886,601
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,354,772		7,886,601
分配金		33,207		38,422
期末剰余金又は期末欠損金()		58,023,043		79,258,911

(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、2017年5月11日から2018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16期 2017年5月10日現在	第17期 2018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 66,415,478口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 76,844,618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 1.8736円 (10,000口当たり純資産額) (18,736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 2.0314円 (10,000口当たり純資産額) (20,314円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2016年 5月11日 至 2017年 5月10日	第17期 自 2017年 5月11日 至 2018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>2,148,460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>1,664,892円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>47,470,527円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>20,332,222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>71,616,101円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>66,415,478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>10,783円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>33,207円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,148,460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	1,664,892円	収益調整金額	C	47,470,527円	分配準備積立金額	D	20,332,222円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	71,616,101円	当ファンドの期末残存口数	F	66,415,478口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,783円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	33,207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>2,366,913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>7,235,578円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>61,719,941円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>21,154,240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>92,476,672円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>76,844,618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>12,034円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>38,422円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,366,913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	7,235,578円	収益調整金額	C	61,719,941円	分配準備積立金額	D	21,154,240円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,476,672円	当ファンドの期末残存口数	F	76,844,618口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	12,034円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	38,422円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,148,460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	1,664,892円																																																											
収益調整金額	C	47,470,527円																																																											
分配準備積立金額	D	20,332,222円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	71,616,101円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	66,415,478口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,783円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	33,207円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,366,913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	7,235,578円																																																											
収益調整金額	C	61,719,941円																																																											
分配準備積立金額	D	21,154,240円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,476,672円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	76,844,618口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	12,034円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	38,422円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第16期 自 2016年 5月11日 至 2017年 5月10日	第17期 自 2017年 5月11日 至 2018年 5月10日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及び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なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第16期 2017年 5月10日現在	第17期 2018年 5月10日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第16期 自 2016年 5月11日 至 2017年 5月10日	第17期 自 2017年 5月11日 至 2018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16期 自 2016年 5月11日 至 2017年 5月10日	第17期 自 2017年 5月11日 至 2018年 5月10日
期首元本額 66,438,130円	期首元本額 66,415,478円
期中追加設定元本額 12,984,557円	期中追加設定元本額 19,361,847円
期中一部解約元本額 13,007,209円	期中一部解約元本額 8,932,707円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第16期 自 2016年 5月11日 至 2017年 5月10日	第17期 自 2017年 5月11日 至 2018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	15,087,520	10,464,706
合計	15,087,520	10,464,706

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(2018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(2018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	40,372,293	69,840,029	
		国内債券マザーファンド	23,038,550	31,060,573	
		外国債券マザーファンド	6,981,460	15,586,109	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	15,031,678	39,459,657	
	小計	銘柄数: 4 組入時価比率: 99.9%	85,423,981	155,946,368 100.0%	
合計				155,946,368	

(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)

(2018年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,536,774,796
株式	373,917,977,030
派生商品評価勘定	16,329,728

未収入金	44,146
未収配当金	3,324,430,603
未収利息	422,785
その他未収収益	64,575,485
差入委託証拠金	150,037,830
流動資産合計	401,010,592,403
資産合計	401,010,592,403
負債の部	
流動負債	
未払金	7,041,974,024
未払解約金	414,972,081
未払利息	33,228
有価証券貸借取引受入金	13,639,676,924
流動負債合計	21,096,656,257
負債合計	21,096,656,257
純資産の部	
元本等	
元本	219,619,412,649
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	160,294,523,497
元本等合計	379,913,936,146
純資産合計	379,913,936,146
負債純資産合計	401,010,592,403

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る場合、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)

2018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	1.7299円
(10,000口当たり純資産額)	(17,299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	12,950,788,900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 2017年 5月11日 至 2018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

2018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 ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2018年 5月10日現在		2017年 5月11日
期首		2017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		221,965,622,884円
同期中における追加設定元本額		37,786,584,546円
同期中における一部解約元本額		40,132,794,781円
期末元本額		219,619,412,649円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		158,614,130円
バランスセレクト50		364,923,277円
バランスセレクト70		461,604,109円
野村世界6資産分散投信(安定コース)		1,338,139,453円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		3,391,134,768円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		6,783,681,358円
野村資産設計ファンド2015		53,107,592円
野村資産設計ファンド2020		63,410,638円
野村資産設計ファンド2025		92,084,461円
野村資産設計ファンド2030		97,588,105円
野村資産設計ファンド2035		74,432,386円
野村資産設計ファンド2040		185,786,276円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)		79,863,358,943円
のむらップ・ファンド(保守型)		2,441,723,184円
のむらップ・ファンド(普通型)		5,578,789,436円
のむらップ・ファンド(積極型)		1,608,832,227円
野村資産設計ファンド2045		24,356,783円
野村インデックスファンド・TOPIX		1,591,052,619円
マイ・ロード		3,433,307,510円
ネクストコア		138,179,820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		638,976,686円
野村日本株インデックス(野村SMA・EW向け)		1,254,213,994円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)		1,177,430,172円
野村資産設計ファンド2050		36,922,406円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		12,609,204円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		3,889,326円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		2,673,975円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		1,543,616円
のむらップ・ファンド(やや保守型)		217,642,950円
のむらップ・ファンド(やや積極型)		173,853,069円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,946,666円
インデックス・ブレンド(タイプ)		5,693,366円
インデックス・ブレンド(タイプ)		14,682,972円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,896,586円
インデックス・ブレンド(タイプ)		14,294,383円
野村6資産均等バランス		67,168,288円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式		165,773,906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)		502,246,294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)		455,296,560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)	1,133,358,861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)	805,332,287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)	3,774,755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)	15,656,876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)	2,636,335円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,188,637,674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)	100,010,921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)	673,497,312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)	910,611,686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)	1,519,180,180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)	296,862,970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)	115,892,510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)	291,755,012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)	4,825,569,698円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	648,640,191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)	503,152,527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)	1,759,810,349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)	1,196,608,362円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,080,997,465円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	6,950,216円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,281,604円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	40,372,293円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	101,497,894円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,079,682,525円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,714,941,149円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	17,342,524,183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)	31,966,520,764円
マイバランスDC30	2,685,575,422円
マイバランスDC50	3,659,982,029円
マイバランスDC70	3,563,828,748円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,516,569,907円
野村DC運用戦略ファンド	866,934,587円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	26,928,880円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	352,015,902円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	28,821,444円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	58,142,923円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	583,078円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	544,634円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	3,448,300円
野村資産設計ファンド(DC)2030	399,265円
野村資産設計ファンド(DC)2040	594,220円
野村資産設計ファンド(DC)2050	1,177,955円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	1,552,970円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	1,792,873円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	551,585円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	1,349,834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(2018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	6,500	3,815.00	24,797,500	貸付有価証券 2,000株
		日本水産	185,500	602.00	111,671,000	貸付有価証券 300株
		マルハニチロ	31,300	4,010.00	125,513,000	貸付有価証券 100株
		カネコ種苗	5,600	1,655.00	9,268,000	
		サカタのタネ	24,300	3,990.00	96,957,000	貸付有価証券 6,200株(4,600株)
		ホクト	16,800	1,953.00	32,810,400	
		ホクリヨウ	2,700	1,234.00	3,331,800	貸付有価証券 100株(100株)
		住石ホールディングス	43,000	171.00	7,353,000	貸付有価証券 19,800株(14,800株)
		日鉄鉱業	4,600	6,440.00	29,624,000	
		三井松島産業	8,400	1,564.00	13,137,600	貸付有価証券 100株
		国際石油開発帝石	801,600	1,449.00	1,161,518,400	貸付有価証券 9,100株
		日本海洋掘削	5,800	1,924.00	11,159,200	貸付有価証券 2,600株(300株)
		石油資源開発	26,100	2,780.00	72,558,000	貸付有価証券 1,700株(900株)
		K&Oエナジーグループ	9,700	1,863.00	18,071,100	
		ヒノキヤグループ	4,200	3,230.00	13,566,000	
		ショーボンドホールディングス	15,600	8,190.00	127,764,000	貸付有価証券 1,100株
		ミライト・ホールディングス	50,700	1,712.00	86,798,400	貸付有価証券 22,200株(16,700株)
タマホーム	12,400	1,220.00	15,128,000	貸付有価証券 5,600株(1,600株)		

サンヨーホームズ	2,900	1,189.00	3,448,100	貸付有価証券 1,300株
日本アクア	4,700	422.00	1,983,400	
ファーストコーポレーション	5,500	1,308.00	7,194,000	
ベストセラ	3,100	1,659.00	5,142,900	貸付有価証券 1,000株
TATERU	15,700	1,914.00	30,049,800	貸付有価証券 6,700株(4,000株)
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,094.00	4,157,200	貸付有価証券 1,700株
第一カッター興業	2,200	2,412.00	5,306,400	
安藤・間	128,200	810.00	103,842,000	
東急建設	63,400	1,173.00	74,368,200	貸付有価証券 1,300株
コムシスホールディングス	58,000	3,085.00	178,930,000	貸付有価証券 100株
ミサワホーム	13,800	940.00	12,972,000	貸付有価証券 100株
ビーアールホールディングス	16,300	420.00	6,846,000	
高松コンストラクショングループ	10,700	2,965.00	31,725,500	
東建コーポレーション	6,200	10,620.00	65,844,000	貸付有価証券 900株
ソネック	2,100	846.00	1,776,600	
ヤマウラ	7,700	896.00	6,899,200	貸付有価証券 700株
大成建設	164,100	5,970.00	979,677,000	
大林組	494,400	1,225.00	605,640,000	
清水建設	504,300	1,082.00	545,652,600	
飛島建設	150,000	187.00	28,050,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
長谷工コーポレーション	192,400	1,663.00	319,961,200	
松井建設	18,200	893.00	16,252,600	
銭高組	2,400	5,680.00	13,632,000	
鹿島建設	724,000	1,034.00	748,616,000	
不動テトラ	124,700	185.00	23,069,500	
大未建設	5,300	1,019.00	5,400,700	
鉄建建設	10,000	3,360.00	33,600,000	

西松建設	38,100	3,150.00	120,015,000	
三井住友建設	118,900	647.00	76,928,300	
大豊建設	60,000	666.00	39,960,000	
前田建設工業	117,600	1,287.00	151,351,200	
佐田建設	10,600	489.00	5,183,400	
ナカノフドー建設	12,600	645.00	8,127,000	
奥村組	27,100	4,500.00	121,950,000	貸付有価証券 3,200株
東鉄工業	19,800	3,545.00	70,191,000	
イチケン	3,000	2,490.00	7,470,000	
浅沼組	58,000	442.00	25,636,000	
戸田建設	192,000	899.00	172,608,000	貸付有価証券 9,000株
熊谷組	25,900	3,680.00	95,312,000	
青木あすなろ建設	10,800	1,024.00	11,059,200	
北野建設	34,000	401.00	13,634,000	
植木組	2,000	2,675.00	5,350,000	
三井ホーム	21,000	750.00	15,750,000	
矢作建設工業	22,400	899.00	20,137,600	
ピーエス三菱	19,500	720.00	14,040,000	
日本ハウスホールディングス	31,500	586.00	18,459,000	貸付有価証券 8,300株（1,200株）
大東建託	58,700	18,645.00	1,094,461,500	
新日本建設	19,600	1,249.00	24,480,400	
N I P P O	38,200	2,481.00	94,774,200	
東亜道路工業	3,300	3,885.00	12,820,500	
前田道路	51,600	2,355.00	121,518,000	貸付有価証券 700株
日本道路	4,500	5,360.00	24,120,000	
東亜建設工業	13,400	2,852.00	38,216,800	貸付有価証券 500株
若築建設	8,900	1,720.00	15,308,000	
東洋建設	51,700	535.00	27,659,500	貸付有価証券 100株（100株）
五洋建設	196,000	852.00	166,992,000	
世紀東急工業	22,200	711.00	15,784,200	
福田組	5,300	6,320.00	33,496,000	
住友林業	105,300	1,783.00	187,749,900	貸付有価証券

				2,300株
日本基礎技術	18,300	404.00	7,393,200	
日成ビルド工業	24,400	1,347.00	32,866,800	
ヤマダ・エスバイエル ホーム	75,000	70.00	5,250,000	貸付有価証券 34,000株
巴コーポレーション	20,500	604.00	12,382,000	
大和ハウス工業	486,900	4,071.00	1,982,169,900	
ライト工業	31,700	1,186.00	37,596,200	
積水ハウス	536,300	1,989.50	1,066,968,850	
日特建設	14,000	629.00	8,806,000	
北陸電気工事	9,100	1,282.00	11,666,200	
ユアテック	23,100	1,011.00	23,354,100	
西部電気工業	2,700	3,770.00	10,179,000	
四電工	2,500	2,847.00	7,117,500	
中電工	21,200	2,983.00	63,239,600	
関電工	65,600	1,266.00	83,049,600	
きんでん	109,600	1,868.00	204,732,800	
東京エネシス	18,700	1,312.00	24,534,400	
トーエネック	4,600	3,285.00	15,111,000	
住友電設	13,000	2,079.00	27,027,000	
日本電設工業	25,300	2,468.00	62,440,400	
協和エクシオ	59,200	2,969.00	175,764,800	貸付有価証券 1,200株
新日本空調	12,700	1,632.00	20,726,400	
N D S	2,600	6,030.00	15,678,000	
九電工	32,500	5,290.00	171,925,000	貸付有価証券 200株
三機工業	34,900	1,175.00	41,007,500	貸付有価証券 200株
日揮	142,000	2,506.00	355,852,000	貸付有価証券 3,700株
中外炉工業	5,000	2,806.00	14,030,000	
ヤマト	13,500	722.00	9,747,000	
太平電業	11,200	2,805.00	31,416,000	
高砂熱学工業	45,400	2,015.00	91,481,000	
三晃金属工業	1,800	3,610.00	6,498,000	
朝日工業社	3,400	3,475.00	11,815,000	
明星工業	29,800	804.00	23,959,200	

大気社	20,800	3,840.00	79,872,000	
ダイダン	11,000	2,664.00	29,304,000	
日比谷総合設備	18,400	2,233.00	41,087,200	
東芝プラントシステム	35,700	2,216.00	79,111,200	
OSJBホールディングス	72,800	307.00	22,349,600	貸付有価証券 7,400株
東洋エンジニアリング	19,400	1,048.00	20,331,200	貸付有価証券 8,900株（8,600株）
千代田化工建設	107,000	1,056.00	112,992,000	貸付有価証券 19,300株（1,400株）
新興プランテック	31,700	1,053.00	33,380,100	
日本製粉	49,000	1,776.00	87,024,000	
日清製粉グループ本社	180,700	2,422.00	437,655,400	貸付有価証券 900株
日東富士製粉	1,100	5,220.00	5,742,000	
昭和産業	13,600	2,917.00	39,671,200	
鳥越製粉	13,100	974.00	12,759,400	
中部飼料	18,000	2,101.00	37,818,000	
フィード・ワン	99,200	244.00	24,204,800	
東洋精糖	2,500	1,275.00	3,187,500	
日本甜菜製糖	8,400	2,404.00	20,193,600	
三井製糖	11,600	4,245.00	49,242,000	
塩水港精糖	17,600	264.00	4,646,400	
日新製糖	7,000	2,119.00	14,833,000	
森永製菓	34,700	5,260.00	182,522,000	貸付有価証券 1,600株
中村屋	3,800	4,825.00	18,335,000	
江崎グリコ	41,200	5,800.00	238,960,000	貸付有価証券 1,300株
名糖産業	7,100	1,751.00	12,432,100	
井村屋グループ	5,800	3,550.00	20,590,000	貸付有価証券 1,000株
不二家	9,400	2,701.00	25,389,400	
山崎製パン	120,700	2,335.00	281,834,500	貸付有価証券 1,400株
第一屋製パン	2,500	1,210.00	3,025,000	
モロゾフ	2,500	6,660.00	16,650,000	
亀田製菓	9,200	5,800.00	53,360,000	貸付有価証券 100株

寿スピリッツ	14,200	5,080.00	72,136,000	貸付有価証券 2,000株
カルビー	67,300	3,795.00	255,403,500	貸付有価証券 31,000株
森永乳業	29,600	4,475.00	132,460,000	
六甲バター	9,800	2,489.00	24,392,200	貸付有価証券 2,900株
ヤクルト本社	85,900	7,300.00	627,070,000	貸付有価証券 800株
明治ホールディングス	97,600	8,610.00	840,336,000	
雪印メグミルク	35,600	2,973.00	105,838,800	
プリマハム	104,000	672.00	69,888,000	
日本ハム	63,800	4,695.00	299,541,000	貸付有価証券 800株
林兼産業	5,300	840.00	4,452,000	
丸大食品	79,000	525.00	41,475,000	
S Foods	10,300	4,555.00	46,916,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	95,100	1,036.00	98,523,600	貸付有価証券 2,200株
サッポロホールディングス	54,000	3,080.00	166,320,000	貸付有価証券 6,500株
アサヒグループホールディングス	309,300	5,845.00	1,807,858,500	貸付有価証券 19,600株
キリンホールディングス	709,800	2,988.00	2,120,882,400	貸付有価証券 31,700株
宝ホールディングス	110,600	1,311.00	144,996,600	貸付有価証券 5,000株
オエノンホールディングス	41,900	476.00	19,944,400	
養命酒製造	4,500	2,487.00	11,191,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	103,600	4,475.00	463,610,000	貸付有価証券 2,900株
サントリー食品インターナショナル	112,900	4,950.00	558,855,000	
ダイドーグループホールディングス	7,600	6,290.00	47,804,000	
伊藤園	48,900	4,360.00	213,204,000	貸付有価証券 5,800株
キーコーヒー	14,500	2,162.00	31,349,000	
ユニカフェ	4,400	1,130.00	4,972,000	
ジャパンフーズ	2,100	1,466.00	3,078,600	

日清オイリオグループ	17,400	3,355.00	58,377,000	
不二製油グループ本社	40,000	3,590.00	143,600,000	
かどや製油	1,600	6,320.00	10,112,000	
J - オイルミルズ	7,700	3,755.00	28,913,500	
キッコーマン	115,300	4,925.00	567,852,500	貸付有価証券 1,500株
味の素	339,600	2,104.00	714,518,400	貸付有価証券 3,100株
キューピー	82,200	2,642.00	217,172,400	
ハウス食品グループ本社	56,300	3,830.00	215,629,000	
カゴメ	59,200	3,745.00	221,704,000	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
焼津水産化学工業	7,200	1,256.00	9,043,200	
アリアケジャパン	13,500	9,350.00	126,225,000	
ピエトロ	1,900	1,646.00	3,127,400	貸付有価証券 700株
エバラ食品工業	3,200	2,116.00	6,771,200	
ニチレイ	70,300	2,955.00	207,736,500	貸付有価証券 100株
東洋水産	81,000	4,235.00	343,035,000	
イトアアンド	4,100	2,121.00	8,696,100	貸付有価証券 600株
大冷	1,600	2,029.00	3,246,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,000	944.00	2,832,000	貸付有価証券 1,300株
日清食品ホールディングス	64,400	8,000.00	515,200,000	
永谷園ホールディングス	16,000	1,487.00	23,792,000	
一正蒲鉾	5,700	1,366.00	7,786,200	貸付有価証券 800株
フジッコ	16,000	2,515.00	40,240,000	
ロック・フィールド	15,900	2,041.00	32,451,900	貸付有価証券 400株
日本たばこ産業	913,600	2,994.00	2,735,318,400	貸付有価証券 153,000株
ケンコーマヨネーズ	9,800	3,815.00	37,387,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,700	2,744.00	26,616,800	貸付有価証券 600株
なとり	8,200	2,018.00	16,547,600	貸付有価証券 100株（100株）

イフジ産業	2,600	802.00	2,085,200	
ピクルスコーポレーション	2,900	2,050.00	5,945,000	貸付有価証券 200株
北の達人コーポレーション	45,100	792.00	35,719,200	貸付有価証券 20,800株(400株)
ユーグレナ	58,800	991.00	58,270,800	貸付有価証券 27,100株(2,700株)
ミヨシ油脂	5,600	1,413.00	7,912,800	
理研ビタミン	5,600	4,035.00	22,596,000	
片倉工業	17,700	1,375.00	24,337,500	貸付有価証券 8,100株
グンゼ	11,500	6,790.00	78,085,000	
東洋紡	56,900	2,034.00	115,734,600	
ユニチカ	44,800	708.00	31,718,400	貸付有価証券 4,900株
富士紡ホールディングス	8,600	4,130.00	35,518,000	
倉敷紡績	155,000	359.00	55,645,000	
シキボウ	7,600	1,359.00	10,328,400	
日本毛織	43,500	1,141.00	49,633,500	
ダイトウボウ	23,300	104.00	2,423,200	貸付有価証券 10,300株(100株)
トーア紡コーポレーション	6,500	590.00	3,835,000	
ダイドーリミテッド	17,200	469.00	8,066,800	
帝国繊維	16,100	2,355.00	37,915,500	貸付有価証券 300株
帝人	126,600	2,128.00	269,404,800	
東レ	1,117,900	943.00	1,054,179,700	貸付有価証券 6,000株
サカイオーベックス	3,800	2,410.00	9,158,000	
住江織物	3,900	2,895.00	11,290,500	貸付有価証券 600株
日本フェルト	8,200	519.00	4,255,800	
イチカワ	10,000	373.00	3,730,000	
日東製網	1,700	1,770.00	3,009,000	貸付有価証券 400株
アツギ	10,300	1,224.00	12,607,200	
ダイニック	5,800	1,039.00	6,026,200	
セーレン	35,400	1,884.00	66,693,600	

ソトー	5,700	1,052.00	5,996,400	
東海染工	2,100	1,450.00	3,045,000	
小松精練	23,600	1,066.00	25,157,600	
ワコールホールディングス	42,600	3,285.00	139,941,000	
ホギメディカル	19,400	4,575.00	88,755,000	
レナウン	41,600	163.00	6,780,800	貸付有価証券 9,800株(6,900株)
クラウディアホールディングス	3,500	568.00	1,988,000	
T S Iホールディングス	53,200	851.00	45,273,200	貸付有価証券 100株
マツオカコーポレーション	3,600	3,220.00	11,592,000	貸付有価証券 300株
三陽商会	8,100	2,390.00	19,359,000	貸付有価証券 3,700株(1,900株)
ナイガイ	5,600	586.00	3,281,600	貸付有価証券 100株(100株)
オンワードホールディングス	92,000	906.00	83,352,000	
ルックホールディングス	26,000	371.00	9,646,000	貸付有価証券 12,000株(2,000株)
キムラタン	70,400	41.00	2,886,400	貸付有価証券 32,100株(600株)
ゴールドウイン	8,700	7,200.00	62,640,000	貸付有価証券 600株
デサント	35,100	1,948.00	68,374,800	
キング	7,600	567.00	4,309,200	
ヤマトインターナショナル	9,500	676.00	6,422,000	
特種東海製紙	8,400	4,340.00	36,456,000	
王子ホールディングス	649,000	748.00	485,452,000	貸付有価証券 3,000株
日本製紙	69,000	2,082.00	143,658,000	貸付有価証券 4,600株
三菱製紙	21,900	681.00	14,913,900	
北越紀州製紙	86,000	626.00	53,836,000	貸付有価証券 9,100株(6,900株)
中越パルプ工業	6,100	1,972.00	12,029,200	
巴川製紙所	24,000	284.00	6,816,000	
大王製紙	61,400	1,508.00	92,591,200	貸付有価証券

				26,600株(9,200株)
阿波製紙	3,700	648.00	2,397,600	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
レンゴー	148,600	949.00	141,021,400	
トーモク	8,800	2,169.00	19,087,200	貸付有価証券 400株(400株)
ザ・パック	10,900	3,765.00	41,038,500	
クラレ	259,400	1,799.00	466,660,600	
旭化成	961,000	1,518.50	1,459,278,500	
共和レザー	9,000	1,027.00	9,243,000	
昭和電工	102,600	4,255.00	436,563,000	貸付有価証券 6,100株
住友化学	1,134,000	644.00	730,296,000	貸付有価証券 2,000株
住友精化	6,400	5,330.00	34,112,000	
日産化学工業	89,700	4,915.00	440,875,500	貸付有価証券 400株
ラサ工業	5,400	2,328.00	12,571,200	
クレハ	13,300	7,620.00	101,346,000	
多木化学	2,100	4,675.00	9,817,500	
テイカ	11,700	3,155.00	36,913,500	
石原産業	27,700	1,252.00	34,680,400	貸付有価証券 200株
片倉コープアグリ	3,700	1,243.00	4,599,100	
日東エフシー	9,000	752.00	6,768,000	貸付有価証券 700株
日本曹達	107,000	633.00	67,731,000	
東ソー	222,700	1,952.00	434,710,400	
トクヤマ	44,700	3,905.00	174,553,500	貸付有価証券 14,000株
セントラル硝子	31,400	2,585.00	81,169,000	貸付有価証券 7,200株
東亜合成	90,400	1,224.00	110,649,600	
大阪ソーダ	14,900	3,150.00	46,935,000	貸付有価証券 6,000株
関東電化工業	36,800	1,028.00	37,830,400	貸付有価証券 14,700株(3,100株)
デンカ	56,600	4,195.00	237,437,000	貸付有価証券 300株
信越化学工業	256,600	11,270.00	2,891,882,000	貸付有価証券

				800株
日本カーバイド工業	4,900	2,160.00	10,584,000	
堺化学工業	10,500	2,912.00	30,576,000	
エア・ウォーター	127,100	2,122.00	269,706,200	
大陽日酸	118,700	1,658.00	196,804,600	
日本化学工業	5,700	3,275.00	18,667,500	
東邦アセチレン	2,200	1,436.00	3,159,200	
日本パーカライジング	78,700	1,740.00	136,938,000	
高压ガス工業	22,800	1,000.00	22,800,000	
チタン工業	1,700	2,749.00	4,673,300	貸付有価証券 700株
四国化成工業	22,200	1,592.00	35,342,400	
戸田工業	3,100	3,780.00	11,718,000	貸付有価証券 1,400株
ステラ ケミファ	7,800	3,565.00	27,807,000	貸付有価証券 3,600株
保土谷化学工業	5,000	4,710.00	23,550,000	貸付有価証券 1,900株
日本触媒	24,200	7,160.00	173,272,000	
大日精化工業	11,900	4,480.00	53,312,000	
カネカ	208,000	1,085.00	225,680,000	
三菱瓦斯化学	127,000	2,798.00	355,346,000	
三井化学	140,100	3,160.00	442,716,000	貸付有価証券 3,700株
J S R	154,900	2,083.00	322,656,700	貸付有価証券 2,900株
東京応化工業	26,800	4,015.00	107,602,000	貸付有価証券 2,200株
大阪有機化学工業	13,300	1,453.00	19,324,900	
三菱ケミカルホールディングス	1,032,100	1,039.00	1,072,351,900	
K Hネオケム	23,600	3,205.00	75,638,000	貸付有価証券 900株
ダイセル	207,800	1,232.00	256,009,600	
住友ベークライト	125,000	989.00	123,625,000	貸付有価証券 3,000株
積水化学工業	320,100	1,823.00	583,542,300	貸付有価証券 9,000株
日本ゼオン	130,000	1,403.00	182,390,000	
アイカ工業	43,200	4,075.00	176,040,000	

宇部興産	77,600	3,330.00	258,408,000	
積水樹脂	23,800	2,309.00	54,954,200	
タキロンシーアイ	31,200	707.00	22,058,400	
旭有機材	9,000	1,814.00	16,326,000	
日立化成	76,100	2,410.00	183,401,000	貸付有価証券 7,900株
ニチバン	7,600	3,425.00	26,030,000	
リケンテクノス	33,200	568.00	18,857,600	貸付有価証券 2,200株
大倉工業	37,000	624.00	23,088,000	貸付有価証券 1,000株
積水化成成品工業	19,300	1,374.00	26,518,200	貸付有価証券 1,700株（100株）
群栄化学工業	3,700	3,685.00	13,634,500	
タイガースポリマー	7,600	873.00	6,634,800	
ミライアル	5,100	1,617.00	8,246,700	貸付有価証券 1,600株
ダイキアクシス	5,100	1,497.00	7,634,700	貸付有価証券 2,200株
ダイキョーニシカワ	30,400	1,912.00	58,124,800	貸付有価証券 100株
竹本容器	2,300	3,230.00	7,429,000	
森六ホールディングス	7,700	3,105.00	23,908,500	貸付有価証券 500株
日本化薬	100,000	1,373.00	137,300,000	貸付有価証券 2,500株
カーリットホールディングス	14,300	1,076.00	15,386,800	貸付有価証券 6,100株
日本精化	12,700	1,221.00	15,506,700	
扶桑化学工業	14,600	2,602.00	37,989,200	貸付有価証券 800株
トリケミカル研究所	3,600	4,570.00	16,452,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
A D E K A	66,300	1,983.00	131,472,900	貸付有価証券 400株
日油	59,500	3,300.00	196,350,000	
新日本理化	24,300	262.00	6,366,600	貸付有価証券 11,200株
ハリマ化成グループ	11,900	921.00	10,959,900	
花王	361,800	7,663.00	2,772,473,400	貸付有価証券

				18,500株
第一工業製薬	29,000	769.00	22,301,000	
石原ケミカル	3,600	2,038.00	7,336,800	
日華化学	4,900	1,245.00	6,100,500	貸付有価証券 100株
ニイタカ	2,200	1,842.00	4,052,400	貸付有価証券 1,000株
三洋化成工業	9,700	5,320.00	51,604,000	
有機合成薬品工業	10,000	308.00	3,080,000	
大日本塗料	17,600	1,569.00	27,614,400	
日本ペイントホールディングス	118,900	4,715.00	560,613,500	貸付有価証券 54,800株
関西ペイント	161,900	2,422.00	392,121,800	貸付有価証券 21,400株(5,300株)
神東塗料	11,300	235.00	2,655,500	
中国塗料	44,200	1,075.00	47,515,000	貸付有価証券 3,200株
日本特殊塗料	9,700	2,189.00	21,233,300	
藤倉化成	19,400	701.00	13,599,400	
太陽ホールディングス	11,800	4,585.00	54,103,000	
D I C	60,900	3,685.00	224,416,500	
サカタインクス	31,500	1,603.00	50,494,500	貸付有価証券 800株
東洋インキ S C ホールディングス	152,000	691.00	105,032,000	
T & K T O K A	10,300	1,246.00	12,833,800	
富士フイルムホールディングス	305,600	4,221.00	1,289,937,600	貸付有価証券 4,100株
資生堂	274,100	7,201.00	1,973,794,100	貸付有価証券 400株
ライオン	204,900	2,142.00	438,895,800	
高砂香料工業	9,200	3,470.00	31,924,000	
マンダム	28,700	3,545.00	101,741,500	
ミルボン	19,700	5,040.00	99,288,000	
ファンケル	35,700	4,495.00	160,471,500	
コーセー	24,900	20,660.00	514,434,000	
コタ	7,000	1,573.00	11,011,000	
シーズ・ホールディングス	17,800	5,660.00	100,748,000	

シーボン	1,800	3,205.00	5,769,000	貸付有価証券 300株
ポーラ・オルビスホールディングス	62,800	5,070.00	318,396,000	
ノエビアホールディングス	9,400	7,650.00	71,910,000	
アジュバンコスメジャパン	3,300	982.00	3,240,600	貸付有価証券 1,500株(400株)
エステー	10,500	2,679.00	28,129,500	
アグロ カネショウ	6,000	2,702.00	16,212,000	
コニシ	24,200	1,855.00	44,891,000	
長谷川香料	17,600	2,409.00	42,398,400	貸付有価証券 1,000株
星光PMC	8,400	1,214.00	10,197,600	貸付有価証券 3,700株(900株)
小林製薬	41,200	9,650.00	397,580,000	
荒川化学工業	13,200	1,917.00	25,304,400	
メック	10,100	1,913.00	19,321,300	貸付有価証券 1,300株
日本高純度化学	4,000	2,542.00	10,168,000	
タカラバイオ	38,500	2,133.00	82,120,500	貸付有価証券 2,200株(700株)
JCU	17,800	2,663.00	47,401,400	
新田ゼラチン	10,100	890.00	8,989,000	
OATアグリオ	2,300	3,720.00	8,556,000	
デクセリアルズ	37,800	1,104.00	41,731,200	
アース製薬	11,100	5,420.00	60,162,000	
北興化学工業	15,100	675.00	10,192,500	貸付有価証券 500株
大成ラミック	4,500	3,150.00	14,175,000	貸付有価証券 100株
クミアイ化学工業	66,900	701.00	46,896,900	貸付有価証券 21,800株
日本農薬	35,200	687.00	24,182,400	貸付有価証券 6,900株
アキレス	11,200	2,248.00	25,177,600	
有沢製作所	24,700	1,243.00	30,702,100	
日東電工	111,100	8,382.00	931,240,200	貸付有価証券 300株
レック	8,700	4,045.00	35,191,500	貸付有価証券

				4,000株
きもと	25,000	319.00	7,975,000	貸付有価証券 4,800株
藤森工業	12,300	3,640.00	44,772,000	
前澤化成工業	10,100	1,237.00	12,493,700	
J S P	8,600	3,410.00	29,326,000	貸付有価証券 600株
エフピコ	12,100	6,750.00	81,675,000	貸付有価証券 5,500株
天馬	11,400	2,058.00	23,461,200	
信越ポリマー	30,200	1,089.00	32,887,800	
東リ	36,600	372.00	13,615,200	
ニフコ	54,000	3,865.00	208,710,000	貸付有価証券 2,700株
日本バルカー工業	12,000	3,075.00	36,900,000	
ユニ・チャーム	311,900	3,188.00	994,337,200	
協和発酵キリン	184,300	2,232.00	411,357,600	貸付有価証券 1,300株
武田薬品工業	542,000	4,621.00	2,504,582,000	貸付有価証券 244,400株(14,700 株)
アステラス製薬	1,512,000	1,655.50	2,503,116,000	貸付有価証券 6,700株
大日本住友製薬	109,100	1,930.00	210,563,000	貸付有価証券 35,900株
塩野義製薬	207,300	5,668.00	1,174,976,400	
田辺三菱製薬	179,500	1,911.00	343,024,500	
わかもと製薬	17,500	297.00	5,197,500	
あすか製薬	16,800	1,645.00	27,636,000	
日本新薬	38,500	7,830.00	301,455,000	貸付有価証券 1,700株
ピオフェルミン製薬	2,500	2,813.00	7,032,500	
中外製薬	153,400	5,770.00	885,118,000	
科研製薬	26,600	6,160.00	163,856,000	貸付有価証券 700株
エーザイ	176,100	7,339.00	1,292,397,900	
ロート製薬	80,800	3,145.00	254,116,000	貸付有価証券 400株
小野薬品工業	347,500	2,513.50	873,441,250	
久光製薬	43,500	8,630.00	375,405,000	貸付有価証券

				10,300株(100株)
持田製薬	10,200	7,620.00	77,724,000	
参天製薬	278,800	1,926.00	536,968,800	
扶桑薬品工業	5,200	2,947.00	15,324,400	
日本ケミファ	1,900	4,790.00	9,101,000	
ツムラ	52,600	3,935.00	206,981,000	
日医工	38,800	1,737.00	67,395,600	貸付有価証券 16,300株
キッセイ薬品工業	26,000	2,855.00	74,230,000	
生化学工業	28,500	1,787.00	50,929,500	
栄研化学	23,900	2,317.00	55,376,300	貸付有価証券 300株(200株)
日水製薬	6,200	1,411.00	8,748,200	
鳥居薬品	9,200	2,802.00	25,778,400	
JCRファーマ	10,400	5,490.00	57,096,000	
東和薬品	7,100	6,650.00	47,215,000	
富士製薬工業	5,000	4,485.00	22,425,000	
沢井製薬	29,600	4,625.00	136,900,000	貸付有価証券 1,000株
ゼリア新薬工業	31,500	2,326.00	73,269,000	貸付有価証券 600株(600株)
第一三共	421,000	3,835.00	1,614,535,000	貸付有価証券 2,500株
キョーリン製薬ホールディングス	41,100	2,171.00	89,228,100	
大幸薬品	7,800	2,110.00	16,458,000	
ダイト	8,600	3,680.00	31,648,000	
大塚ホールディングス	305,800	5,291.00	1,617,987,800	
大正製薬ホールディングス	32,900	10,290.00	338,541,000	貸付有価証券 400株
ペプチドリーム	67,300	4,390.00	295,447,000	貸付有価証券 13,600株
日本コークス工業	124,300	116.00	14,418,800	貸付有価証券 1,800株
昭和シェル石油	137,700	1,628.00	224,175,600	貸付有価証券 700株
ニチレキ	18,800	1,187.00	22,315,600	
ユシロ化学工業	8,300	1,835.00	15,230,500	
ビーピー・カストロール	6,300	1,709.00	10,766,700	貸付有価証券

				1,400株
富士石油	35,700	405.00	14,458,500	貸付有価証券 200株
MORESCO	5,300	1,976.00	10,472,800	貸付有価証券 200株
出光興産	123,500	4,060.00	501,410,000	
JXTGホールディングス	2,348,000	719.20	1,688,681,600	
コスモエネルギーホールディングス	42,600	3,885.00	165,501,000	貸付有価証券 900株
横浜ゴム	85,200	2,548.00	217,089,600	貸付有価証券 100株
東洋ゴム工業	87,100	1,751.00	152,512,100	
ブリヂストン	487,000	4,511.00	2,196,857,000	貸付有価証券 46,700株
住友ゴム工業	151,500	1,883.00	285,274,500	
藤倉ゴム工業	12,900	775.00	9,997,500	
オカモト	51,000	1,096.00	55,896,000	
フコク	6,400	993.00	6,355,200	
ニッタ	15,200	4,265.00	64,828,000	
住友理工	28,500	1,200.00	34,200,000	貸付有価証券 100株
三ツ星ベルト	36,000	1,280.00	46,080,000	
バンドー化学	28,000	1,316.00	36,848,000	
日東紡績	21,900	2,232.00	48,880,800	
旭硝子	148,300	4,775.00	708,132,500	
日本板硝子	74,400	942.00	70,084,800	貸付有価証券 21,000株(2,700株)
石塚硝子	2,000	2,580.00	5,160,000	
日本山村硝子	61,000	188.00	11,468,000	
日本電気硝子	63,600	3,215.00	204,474,000	
オハラ	5,800	2,459.00	14,262,200	貸付有価証券 2,600株(800株)
住友大阪セメント	286,000	504.00	144,144,000	貸付有価証券 51,000株
太平洋セメント	92,900	4,105.00	381,354,500	
日本ヒューム	14,700	837.00	12,303,900	
日本コンクリート工業	31,700	451.00	14,296,700	
三谷セキサン	7,700	2,532.00	19,496,400	

アジアパイルホールディングス	18,900	651.00	12,303,900	
東海カーボン	133,600	1,729.00	230,994,400	貸付有価証券 14,800株
日本カーボン	7,600	5,720.00	43,472,000	貸付有価証券 400株（300株）
東洋炭素	9,600	3,625.00	34,800,000	
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	4,895.00	39,649,500	
TOTO	113,200	5,730.00	648,636,000	貸付有価証券 200株
日本碍子	179,500	2,091.00	375,334,500	
日本特殊陶業	126,200	3,000.00	378,600,000	
ダントーホールディングス	11,000	141.00	1,551,000	貸付有価証券 4,000株
MARUWA	5,100	9,370.00	47,787,000	
品川リフラクトリーズ	3,900	3,080.00	12,012,000	
黒崎播磨	2,900	5,110.00	14,819,000	
ヨータイ	11,700	797.00	9,324,900	貸付有価証券 4,000株
イソライト工業	7,500	859.00	6,442,500	貸付有価証券 2,800株
東京窯業	18,700	466.00	8,714,200	貸付有価証券 8,600株
ニッカトー	6,700	1,115.00	7,470,500	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレーテッド	13,100	2,325.00	30,457,500	貸付有価証券 500株
クニミネ工業	4,000	1,033.00	4,132,000	
エーアンドエーマテリアル	3,200	1,293.00	4,137,600	貸付有価証券 100株
ニチアス	81,000	1,463.00	118,503,000	
ニチハ	22,200	4,780.00	106,116,000	
新日鐵住金	651,100	2,443.00	1,590,637,300	
神戸製鋼所	266,300	1,177.00	313,435,100	
中山製鋼所	20,200	743.00	15,008,600	
合同製鐵	7,800	2,437.00	19,008,600	貸付有価証券 2,200株
ジェイ エフ イー ホールディングス	392,900	2,345.50	921,546,950	

日新製鋼	40,100	1,475.00	59,147,500	
東京製鐵	77,900	894.00	69,642,600	貸付有価証券 35,900株
共英製鋼	16,400	2,185.00	35,834,000	貸付有価証券 7,500株（100株）
大和工業	30,900	3,705.00	114,484,500	貸付有価証券 200株
東京鐵鋼	6,000	1,758.00	10,548,000	
大阪製鐵	9,700	2,319.00	22,494,300	
淀川製鋼所	21,300	3,190.00	67,947,000	
東洋鋼鈹	36,800	717.00	26,385,600	
丸一鋼管	51,500	3,870.00	199,305,000	貸付有価証券 8,300株
モリ工業	4,700	3,465.00	16,285,500	
大同特殊鋼	25,800	5,870.00	151,446,000	
日本高周波鋼業	5,400	834.00	4,503,600	貸付有価証券 1,700株
日本冶金工業	120,300	331.00	39,819,300	貸付有価証券 200株
山陽特殊製鋼	16,800	2,752.00	46,233,600	貸付有価証券 7,700株
愛知製鋼	8,200	4,680.00	38,376,000	
日立金属	156,700	1,322.00	207,157,400	貸付有価証券 7,600株
日本金属	3,700	2,378.00	8,798,600	
大平洋金属	8,900	3,630.00	32,307,000	貸付有価証券 4,100株（100株）
新日本電工	87,100	337.00	29,352,700	貸付有価証券 40,100株（300株）
栗本鐵工所	7,300	2,034.00	14,848,200	
虹技	2,200	2,013.00	4,428,600	
日本鑄鉄管	15,000	169.00	2,535,000	
三菱製鋼	10,800	2,522.00	27,237,600	
日亜鋼業	21,300	355.00	7,561,500	
日本精線	2,400	4,845.00	11,628,000	貸付有価証券 200株
シンニッタン	22,600	488.00	11,028,800	
新家工業	3,300	2,165.00	7,144,500	
大紀アルミニウム工業所	23,900	741.00	17,709,900	貸付有価証券

				11,000株
日本軽金属ホールディングス	424,800	296.00	125,740,800	
三井金属鉱業	39,300	4,840.00	190,212,000	
東邦亜鉛	8,100	4,905.00	39,730,500	貸付有価証券 100株
三菱マテリアル	96,100	3,325.00	319,532,500	貸付有価証券 200株
住友金属鉱山	186,000	4,701.00	874,386,000	
DOWAホールディングス	36,800	4,110.00	151,248,000	
古河機械金属	24,000	1,865.00	44,760,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,100	1,994.00	30,109,400	貸付有価証券 6,100株
東邦チタニウム	26,000	1,222.00	31,772,000	貸付有価証券 6,400株(100株)
UACJ	22,100	2,650.00	58,565,000	貸付有価証券 10,100株(100株)
CKサンエツ	2,700	4,765.00	12,865,500	
古河電気工業	48,400	4,815.00	233,046,000	
住友電気工業	544,000	1,664.00	905,216,000	
フジクラ	175,700	743.00	130,545,100	
昭和電線ホールディングス	18,300	915.00	16,744,500	
東京特殊電線	1,900	2,814.00	5,346,600	
タツタ電線	28,800	697.00	20,073,600	
カナレ電気	2,400	2,401.00	5,762,400	
平河ヒューテック	7,200	1,499.00	10,792,800	
リョービ	17,900	2,848.00	50,979,200	貸付有価証券 900株
アーレスティ	17,800	1,063.00	18,921,400	
アサヒホールディングス	24,900	2,023.00	50,372,700	
稲葉製作所	8,200	1,426.00	11,693,200	
宮地エンジニアリンググループ	4,100	2,072.00	8,495,200	
トーカロ	40,400	1,379.00	55,711,600	
アルファC o	5,100	1,883.00	9,603,300	
SUMCO	134,000	2,847.00	381,498,000	
川田テクノロジーズ	2,900	6,190.00	17,951,000	貸付有価証券

				800株
RS Technologies	2,300	6,890.00	15,847,000	貸付有価証券 300株
東洋製罐グループホールディングス	99,500	1,716.00	170,742,000	貸付有価証券 200株
ホッカンホールディングス	37,000	393.00	14,541,000	
コロナ	8,000	1,280.00	10,240,000	
横河ブリッジホールディングス	27,100	2,433.00	65,934,300	
駒井ハルテック	3,200	2,497.00	7,990,400	
高田機工	1,300	3,460.00	4,498,000	
三和ホールディングス	139,500	1,400.00	195,300,000	
文化シャッター	42,900	1,078.00	46,246,200	
三協立山	20,200	1,643.00	33,188,600	貸付有価証券 200株
アルインコ	10,600	1,086.00	11,511,600	
東洋シャッター	3,800	661.00	2,511,800	
LIXILグループ	214,500	2,498.00	535,821,000	貸付有価証券 2,900株
日本ファイルコン	11,100	639.00	7,092,900	
ノーリツ	32,500	2,027.00	65,877,500	
長府製作所	16,400	2,531.00	41,508,400	貸付有価証券 1,700株
リンナイ	25,900	10,730.00	277,907,000	貸付有価証券 200株
ダイニチ工業	7,800	847.00	6,606,600	
日東精工	20,100	786.00	15,798,600	
三洋工業	1,800	2,109.00	3,796,200	
岡部	29,500	1,026.00	30,267,000	
ジーテクト	16,100	2,114.00	34,035,400	
中国工業	2,200	754.00	1,658,800	貸付有価証券 900株
東プレ	27,100	3,395.00	92,004,500	
高周波熱錬	28,000	1,105.00	30,940,000	
東京製綱	10,400	2,349.00	24,429,600	貸付有価証券 3,100株
サンコール	8,200	733.00	6,010,600	
モリテック スチール	11,300	740.00	8,362,000	貸付有価証券

				3,900株
パイオラックス	21,500	3,125.00	67,187,500	
エイチワン	14,300	1,280.00	18,304,000	
日本発條	144,900	1,207.00	174,894,300	貸付有価証券 9,600株
中央発條	1,800	3,605.00	6,489,000	
アドバネクス	2,300	2,315.00	5,324,500	
立川ブラインド工業	6,400	1,546.00	9,894,400	貸付有価証券 200株
三益半導体工業	11,400	1,930.00	22,002,000	
日本ドライケミカル	2,000	2,519.00	5,038,000	
日本製鋼所	47,500	3,495.00	166,012,500	
三浦工業	63,000	3,230.00	203,490,000	貸付有価証券 700株
タクマ	49,300	1,185.00	58,420,500	
ツガミ	39,000	1,287.00	50,193,000	
オークマ	17,000	6,880.00	116,960,000	貸付有価証券 100株
東芝機械	82,000	622.00	51,004,000	
アマダホールディングス	224,500	1,304.00	292,748,000	
アイダエンジニアリング	37,000	1,277.00	47,249,000	貸付有価証券 800株
滝澤鉄工所	4,500	2,011.00	9,049,500	
F U J I	43,600	1,844.00	80,398,400	貸付有価証券 14,200株(14,200株)
牧野フライス製作所	74,000	1,045.00	77,330,000	
オーエスジー	67,000	2,509.00	168,103,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
ダイジェット工業	1,800	1,943.00	3,497,400	貸付有価証券 100株(100株)
旭ダイヤモンド工業	43,300	1,059.00	45,854,700	
D M G 森精機	80,500	2,156.00	173,558,000	
ソディック	31,700	1,275.00	40,417,500	貸付有価証券 11,400株(9,100株)
ディスコ	19,700	20,590.00	405,623,000	
日東工器	9,000	2,914.00	26,226,000	
日進工具	3,900	2,934.00	11,442,600	貸付有価証券 300株
パンチ工業	12,100	1,208.00	14,616,800	

富士ダイス	7,300	1,012.00	7,387,600	
豊和工業	8,000	1,104.00	8,832,000	貸付有価証券 600株
OKK	5,600	1,142.00	6,395,200	
東洋機械金属	11,300	779.00	8,802,700	
津田駒工業	34,000	243.00	8,262,000	貸付有価証券 6,000株
エンシュウ	38,000	161.00	6,118,000	
島精機製作所	18,400	5,830.00	107,272,000	貸付有価証券 200株
オプトラ	14,200	2,970.00	42,174,000	貸付有価証券 5,100株
NCホールディングス	4,700	836.00	3,929,200	
フリー	10,300	982.00	10,114,600	貸付有価証券 200株
ヤマシンフィルタ	22,100	1,171.00	25,879,100	貸付有価証券 10,100株(5,200株)
日阪製作所	20,900	1,179.00	24,641,100	
やまびこ	28,200	1,548.00	43,653,600	貸付有価証券 300株
平田機工	5,400	10,360.00	55,944,000	貸付有価証券 1,800株
ペガサスミシン製造	13,600	782.00	10,635,200	貸付有価証券 1,200株
ナプテスコ	80,000	3,635.00	290,800,000	貸付有価証券 300株
三井海洋開発	15,500	3,070.00	47,585,000	
レオン自動機	13,000	2,091.00	27,183,000	
SMC	46,200	41,600.00	1,921,920,000	
新川	11,900	1,046.00	12,447,400	貸付有価証券 5,400株
ホソカワミクロン	5,100	7,400.00	37,740,000	
ユニオンツール	6,600	4,295.00	28,347,000	
オイレス工業	18,800	2,432.00	45,721,600	貸付有価証券 300株(200株)
日精エー・エス・ビー機 械	4,200	5,420.00	22,764,000	貸付有価証券 300株
サトーホールディングス	19,100	3,005.00	57,395,500	
技研製作所	10,000	2,501.00	25,010,000	貸付有価証券 3,300株

日本エアテック	5,000	924.00	4,620,000	
カワタ	3,000	1,806.00	5,418,000	貸付有価証券 1,300株
日精樹脂工業	12,200	1,303.00	15,896,600	
オカダアイヨン	4,900	1,593.00	7,805,700	貸付有価証券 1,200株
ワイエイシイホールディングス	4,900	1,073.00	5,257,700	貸付有価証券 2,200株
小松製作所	710,400	3,582.00	2,544,652,800	貸付有価証券 200株
住友重機械工業	84,200	4,165.00	350,693,000	貸付有価証券 300株
日立建機	68,800	3,970.00	273,136,000	貸付有価証券 1,900株
日工	4,000	2,504.00	10,016,000	
巴工業	6,300	2,107.00	13,274,100	
井関農機	14,700	2,208.00	32,457,600	貸付有価証券 200株（200株）
TOWA	11,400	1,450.00	16,530,000	貸付有価証券 700株（700株）
丸山製作所	3,200	1,930.00	6,176,000	
北川鉄工所	7,100	2,809.00	19,943,900	
ローツェ	7,300	2,613.00	19,074,900	貸付有価証券 3,300株
タカキタ	5,100	805.00	4,105,500	貸付有価証券 400株
クボタ	789,200	1,845.00	1,456,074,000	貸付有価証券 172,200株
荏原実業	4,300	2,422.00	10,414,600	
三菱化工機	5,100	2,288.00	11,668,800	
月島機械	29,200	1,539.00	44,938,800	
帝国電機製作所	10,300	1,643.00	16,922,900	
東京機械製作所	5,800	528.00	3,062,400	貸付有価証券 2,400株
新東工業	34,900	1,161.00	40,518,900	
澁谷工業	12,900	3,805.00	49,084,500	
アイチ コーポレーション	25,400	749.00	19,024,600	貸付有価証券 11,400株
小森コーポレーション	37,000	1,387.00	51,319,000	
鶴見製作所	12,400	2,101.00	26,052,400	

住友精密工業	24,000	384.00	9,216,000	
酒井重工業	2,700	4,560.00	12,312,000	貸付有価証券 1,000株
荏原製作所	60,500	4,150.00	251,075,000	
石井鐵工所	2,200	1,940.00	4,268,000	
西島製作所	15,000	1,044.00	15,660,000	
北越工業	16,500	1,124.00	18,546,000	
ダイキン工業	200,800	13,120.00	2,634,496,000	貸付有価証券 1,100株
オルガノ	5,300	3,505.00	18,576,500	
トーヨーカネツ	6,200	3,345.00	20,739,000	貸付有価証券 1,100株
栗田工業	79,600	3,225.00	256,710,000	
椿本チエイン	87,000	909.00	79,083,000	貸付有価証券 2,000株
大同工業	5,600	1,493.00	8,360,800	
木村化工機	12,200	507.00	6,185,400	
アネスト岩田	24,800	1,158.00	28,718,400	
ダイフク	74,900	5,920.00	443,408,000	
サムコ	4,000	1,303.00	5,212,000	貸付有価証券 500株
加藤製作所	7,000	2,596.00	18,172,000	
油研工業	2,900	2,949.00	8,552,100	
タダノ	71,000	1,497.00	106,287,000	貸付有価証券 9,300株
フジテック	47,100	1,487.00	70,037,700	貸付有価証券 900株
C K D	40,900	2,226.00	91,043,400	貸付有価証券 400株
キトー	11,100	2,133.00	23,676,300	
平和	45,600	2,186.00	99,681,600	
理想科学工業	14,600	2,344.00	34,222,400	
SANKYO	36,800	3,870.00	142,416,000	貸付有価証券 1,500株
日本金銭機械	13,500	1,219.00	16,456,500	貸付有価証券 5,700株(900株)
マースエンジニアリング	9,300	2,493.00	23,184,900	貸付有価証券 100株(100株)
福島工業	9,100	4,965.00	45,181,500	

オーイズミ	6,200	565.00	3,503,000	貸付有価証券 800株
ダイコク電機	6,800	1,768.00	12,022,400	貸付有価証券 1,800株(100株)
竹内製作所	24,600	2,493.00	61,327,800	
アマノ	45,500	2,790.00	126,945,000	貸付有価証券 1,500株
J U K I	21,800	1,220.00	26,596,000	
サンデンホールディングス	17,900	1,560.00	27,924,000	貸付有価証券 1,800株
蛇の目ミシン工業	13,400	734.00	9,835,600	
マックス	22,600	1,474.00	33,312,400	
グローリー	43,900	3,670.00	161,113,000	
新晃工業	14,900	1,738.00	25,896,200	
大和冷機工業	23,600	1,262.00	29,783,200	
セガサミーホールディングス	145,900	1,814.00	264,662,600	貸付有価証券 2,800株
日本ピストンリング	5,400	2,240.00	12,096,000	
リケン	6,800	6,160.00	41,888,000	
T P R	16,500	3,255.00	53,707,500	
ツバキ・ナカシマ	14,800	2,583.00	38,228,400	貸付有価証券 100株
ホシザキ	46,300	10,330.00	478,279,000	貸付有価証券 100株
大豊工業	12,000	1,506.00	18,072,000	
日本精工	302,200	1,427.00	431,239,400	
N T N	340,500	477.00	162,418,500	貸付有価証券 8,800株
ジェイテクト	156,800	1,731.00	271,420,800	
不二越	137,000	564.00	77,268,000	貸付有価証券 25,000株(1,000株)
日本トムソン	47,000	796.00	37,412,000	貸付有価証券 300株
T H K	91,700	3,765.00	345,250,500	
ユーシン精機	13,000	1,419.00	18,447,000	貸付有価証券 3,900株(200株)
前澤給装工業	5,800	1,947.00	11,292,600	
イーグル工業	18,200	1,975.00	35,945,000	
前澤工業	10,800	479.00	5,173,200	

日本ピラー工業	14,900	1,691.00	25,195,900	
キッツ	59,600	1,047.00	62,401,200	貸付有価証券 500株
マキタ	191,900	4,855.00	931,674,500	
日立造船	116,600	599.00	69,843,400	貸付有価証券 3,900株
三菱重工業	246,600	4,114.00	1,014,512,400	貸付有価証券 7,500株
I H I	113,000	3,930.00	444,090,000	
スター精密	23,500	1,935.00	45,472,500	貸付有価証券 5,600株（5,600株）
日清紡ホールディングス	89,800	1,478.00	132,724,400	貸付有価証券 2,400株
イビデン	90,100	1,667.00	150,196,700	貸付有価証券 24,100株
コニカミノルタ	344,400	956.00	329,246,400	貸付有価証券 38,000株
ブラザー工業	179,700	2,448.00	439,905,600	
ミネベアミツミ	273,100	2,152.00	587,711,200	
日立製作所	3,533,000	864.30	3,053,571,900	
三菱電機	1,471,200	1,634.00	2,403,940,800	
富士電機	443,000	788.00	349,084,000	貸付有価証券 3,000株
東洋電機製造	5,800	1,874.00	10,869,200	貸付有価証券 400株
安川電機	170,500	4,495.00	766,397,500	貸付有価証券 65,100株
シンフォニアテクノロジー	95,000	417.00	39,615,000	貸付有価証券 44,000株（20,000株）
明電舎	125,000	422.00	52,750,000	
オリジン電気	4,300	1,815.00	7,804,500	
山洋電気	7,100	9,750.00	69,225,000	
デンヨー	13,600	1,982.00	26,955,200	
東芝テック	105,000	637.00	66,885,000	貸付有価証券 1,000株
芝浦メカトロニクス	21,000	436.00	9,156,000	貸付有価証券 1,000株
マブチモーター	41,000	5,290.00	216,890,000	貸付有価証券 16,600株
日本電産	177,000	16,930.00	2,996,610,000	

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,400	3,230.00	17,442,000	貸付有価証券 2,400株
トレックス・セミコンダクター	4,200	1,408.00	5,913,600	貸付有価証券 1,700株
東光高岳	7,400	1,919.00	14,200,600	貸付有価証券 1,300株
ダブル・スコープ	21,400	1,629.00	34,860,600	貸付有価証券 9,100株(800株)
ダイヘン	80,000	850.00	68,000,000	
田淵電機	20,400	292.00	5,956,800	貸付有価証券 9,200株
ヤーマン	21,300	2,528.00	53,846,400	貸付有価証券 9,800株
JVCケンウッド	107,900	354.00	38,196,600	
ミマキエンジニアリング	13,200	900.00	11,880,000	
第一精工	6,900	2,173.00	14,993,700	
日新電機	34,500	1,155.00	39,847,500	
大崎電気工業	31,500	812.00	25,578,000	
オムロン	156,400	6,030.00	943,092,000	貸付有価証券 300株
日東工業	23,600	1,887.00	44,533,200	貸付有価証券 200株(100株)
I D E C	18,200	2,652.00	48,266,400	貸付有価証券 1,600株
不二電機工業	1,600	1,404.00	2,246,400	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサコーポレーション	264,000	560.00	147,840,000	貸付有価証券 13,000株(6,000株)
サクサホールディングス	3,700	2,153.00	7,966,100	貸付有価証券 1,500株
メルコホールディングス	7,100	4,230.00	30,033,000	
テクノメディカ	3,600	2,034.00	7,322,400	
日本電気	190,400	3,060.00	582,624,000	貸付有価証券 1,900株
富士通	1,513,000	679.30	1,027,780,900	
沖電気工業	59,800	1,348.00	80,610,400	貸付有価証券 2,600株
岩崎通信機	6,400	835.00	5,344,000	
電気興業	8,400	3,255.00	27,342,000	
サンケン電気	86,000	736.00	63,296,000	

ナカヨ	2,800	1,940.00	5,432,000	
アイホン	8,300	1,857.00	15,413,100	
ルネサスエレクトロニクス	76,200	1,109.00	84,505,800	貸付有価証券 35,100株(1,200株)
セイコーエプソン	219,100	2,040.00	446,964,000	
ワコム	114,100	561.00	64,010,100	貸付有価証券 11,400株
アルバック	33,800	6,250.00	211,250,000	
アクセル	6,100	832.00	5,075,200	貸付有価証券 600株(500株)
E I Z O	13,500	5,020.00	67,770,000	
ジャパンディスプレイ	302,200	141.00	42,610,200	貸付有価証券 131,900株(16,400株)
日本信号	40,600	1,087.00	44,132,200	
京三製作所	34,400	730.00	25,112,000	
能美防災	19,500	2,488.00	48,516,000	
ホーチキ	10,700	2,194.00	23,475,800	
星和電機	5,000	650.00	3,250,000	貸付有価証券 600株
エレコム	12,800	3,025.00	38,720,000	
パナソニック	1,680,800	1,562.00	2,625,409,600	
シャープ	136,600	3,180.00	434,388,000	貸付有価証券 61,600株(10,400株)
アンリツ	107,300	1,411.00	151,400,300	
富士通ゼネラル	44,900	1,735.00	77,901,500	貸付有価証券 20,700株
ソニー	983,500	5,109.00	5,024,701,500	貸付有価証券 900株
T D K	77,000	9,860.00	759,220,000	貸付有価証券 200株
帝国通信工業	6,500	1,295.00	8,417,500	
タムラ製作所	56,700	846.00	47,968,200	貸付有価証券 4,900株
アルプス電気	126,800	2,660.00	337,288,000	貸付有価証券 7,900株
池上通信機	47,000	172.00	8,084,000	貸付有価証券 13,000株
パイオニア	245,100	178.00	43,627,800	貸付有価証券 113,100株

日本電波工業	13,300	695.00	9,243,500	貸付有価証券 4,900株(1,400株)
鈴木	6,400	1,089.00	6,969,600	貸付有価証券 2,900株
日本トリム	3,200	4,515.00	14,448,000	貸付有価証券 1,300株(300株)
ローランド ディー . ジー .	7,500	2,591.00	19,432,500	
フォスター電機	17,200	1,948.00	33,505,600	
クラリオン	77,000	301.00	23,177,000	貸付有価証券 6,000株
S M K	38,000	394.00	14,972,000	貸付有価証券 3,000株(2,000株)
ヨコオ	9,500	2,067.00	19,636,500	貸付有価証券 400株
ティアック	106,000	42.00	4,452,000	貸付有価証券 48,000株(3,000株)
ホシデン	37,100	1,310.00	48,601,000	貸付有価証券 8,600株(8,600株)
ヒロセ電機	25,000	14,490.00	362,250,000	貸付有価証券 600株
日本航空電子工業	38,000	1,837.00	69,806,000	
T O A	15,800	1,264.00	19,971,200	
マクセルホールディング ス	29,200	1,721.00	50,253,200	貸付有価証券 2,600株
古野電気	17,500	966.00	16,905,000	
ユニデンホールディング ス	40,000	274.00	10,960,000	
アルパイン	35,100	2,211.00	77,606,100	貸付有価証券 300株
スミダコーポレーション	15,000	1,398.00	20,970,000	貸付有価証券 6,500株
アイコム	8,100	2,729.00	22,104,900	
リオン	6,200	2,267.00	14,055,400	
本多通信工業	11,400	1,169.00	13,326,600	貸付有価証券 4,400株
船井電機	14,900	754.00	11,234,600	貸付有価証券 6,800株
横河電機	147,200	2,040.00	300,288,000	貸付有価証券 1,100株
新電元工業	5,200	6,800.00	35,360,000	

アズビル	44,100	5,030.00	221,823,000	
東亜ディーケーケー	7,300	1,457.00	10,636,100	貸付有価証券 100株
日本光電工業	61,500	3,005.00	184,807,500	
チノー	5,100	1,639.00	8,358,900	
共和電業	16,700	443.00	7,398,100	
日本電子材料	5,800	846.00	4,906,800	
堀場製作所	29,100	9,310.00	270,921,000	
アドバンテスト	82,000	2,757.00	226,074,000	貸付有価証券 10,900株
小野測器	6,300	842.00	5,304,600	
エスペック	13,000	2,704.00	35,152,000	
キーエンス	72,200	67,690.00	4,887,218,000	貸付有価証券 200株
日置電機	7,700	4,245.00	32,686,500	
シスメックス	114,500	8,950.00	1,024,775,000	貸付有価証券 1,000株
日本マイクロニクス	23,800	1,291.00	30,725,800	貸付有価証券 10,800株
メガチップス	11,600	3,555.00	41,238,000	貸付有価証券 5,300株
O B A R A G R O U P	8,600	6,330.00	54,438,000	
澤藤電機	1,600	1,972.00	3,155,200	貸付有価証券 600株(600株)
コーセル	20,400	1,460.00	29,784,000	
イリソ電子工業	12,400	6,790.00	84,196,000	
新日本無線	8,900	950.00	8,455,000	貸付有価証券 4,100株(100株)
オブテックスグループ	24,000	2,813.00	67,512,000	貸付有価証券 4,100株(1,200株)
千代田インテグレ	6,800	2,449.00	16,653,200	
アイ・オー・データ機器	6,100	1,121.00	6,838,100	貸付有価証券 1,400株(900株)
レーザーテック	30,100	3,785.00	113,928,500	貸付有価証券 1,800株
スタンレー電気	112,600	3,930.00	442,518,000	
岩崎電気	5,700	1,690.00	9,633,000	
ウシオ電機	89,300	1,597.00	142,612,100	貸付有価証券 600株(600株)
岡谷電機産業	10,500	631.00	6,625,500	貸付有価証券

				3,600株(100株)
ヘリオス テクノ ホールディング	12,500	786.00	9,825,000	貸付有価証券 5,700株(5,200株)
日本セラミック	14,900	2,888.00	43,031,200	
遠藤照明	7,400	996.00	7,370,400	貸付有価証券 300株
古河電池	10,500	998.00	10,479,000	貸付有価証券 4,800株
双信電機	6,400	639.00	4,089,600	貸付有価証券 2,100株
山一電機	10,700	1,992.00	21,314,400	貸付有価証券 4,900株
図研	9,600	1,701.00	16,329,600	
日本電子	54,000	967.00	52,218,000	貸付有価証券 1,000株
カシオ計算機	118,300	1,723.00	203,830,900	貸付有価証券 39,000株
ファナック	139,800	23,030.00	3,219,594,000	
日本シイエムケイ	25,900	841.00	21,781,900	貸付有価証券 11,900株
エンプラス	6,700	3,305.00	22,143,500	
大真空	5,400	1,358.00	7,333,200	
ローム	66,000	10,700.00	706,200,000	
浜松ホトニクス	107,100	4,375.00	468,562,500	
三井ハイテック	19,400	1,568.00	30,419,200	貸付有価証券 8,900株
新光電気工業	55,600	933.00	51,874,800	
京セラ	241,500	6,750.00	1,630,125,000	
太陽誘電	66,000	2,012.00	132,792,000	貸付有価証券 3,000株(500株)
村田製作所	154,400	14,440.00	2,229,536,000	
ユーシン	22,100	733.00	16,199,300	貸付有価証券 10,100株(5,200株)
双葉電子工業	24,100	2,274.00	54,803,400	
北陸電気工業	5,900	1,420.00	8,378,000	
ニチコン	46,300	1,280.00	59,264,000	
日本ケミコン	11,900	2,703.00	32,165,700	
K O A	20,300	2,435.00	49,430,500	貸付有価証券 2,000株
市光工業	22,000	1,481.00	32,582,000	貸付有価証券

				4,000株(3,900株)
小糸製作所	88,100	7,490.00	659,869,000	
ミツバ	27,100	1,354.00	36,693,400	貸付有価証券 12,400株(3,300株)
S C R E E Nホールディングス	27,800	9,740.00	270,772,000	
キヤノン電子	13,500	2,527.00	34,114,500	
キヤノン	792,000	3,790.00	3,001,680,000	貸付有価証券 149,700株
リコー	442,300	1,042.00	460,876,600	貸付有価証券 1,600株
象印マホービン	27,400	1,581.00	43,319,400	貸付有価証券 12,600株
M U T O Hホールディングス	2,000	2,487.00	4,974,000	貸付有価証券 200株(200株)
東京エレクトロン	98,100	21,245.00	2,084,134,500	
トヨタ紡織	42,900	2,262.00	97,039,800	
芦森工業	3,000	2,519.00	7,557,000	貸付有価証券 1,400株
ユニプレス	28,400	2,583.00	73,357,200	
豊田自動織機	119,100	6,990.00	832,509,000	
モリタホールディングス	23,600	2,256.00	53,241,600	
三櫻工業	18,600	780.00	14,508,000	
デンソー	326,400	5,518.00	1,801,075,200	
東海理化電機製作所	38,700	2,206.00	85,372,200	貸付有価証券 2,900株
三井E & Sホールディングス	53,100	1,669.00	88,623,900	貸付有価証券 18,300株(6,700株)
川崎重工業	114,500	3,495.00	400,177,500	貸付有価証券 5,400株
名村造船所	44,200	640.00	28,288,000	貸付有価証券 3,800株(1,500株)
サノヤスホールディングス	17,900	270.00	4,833,000	貸付有価証券 7,900株
日本車輛製造	54,000	293.00	15,822,000	貸付有価証券 13,000株(1,000株)
三菱ロジスネクスト	17,500	1,199.00	20,982,500	貸付有価証券 2,400株
近畿車輛	2,200	2,755.00	6,061,000	貸付有価証券 300株
日産自動車	1,735,200	1,110.50	1,926,939,600	

いすゞ自動車	426,300	1,645.50	701,476,650	貸付有価証券 2,300株
トヨタ自動車	1,788,600	7,592.00	13,579,051,200	貸付有価証券 300株
日野自動車	210,000	1,279.00	268,590,000	貸付有価証券 3,400株
三菱自動車工業	544,600	858.00	467,266,800	貸付有価証券 134,800株(80,400 株)
エフテック	9,400	1,436.00	13,498,400	
レシップホールディングス	5,300	843.00	4,467,900	
GMB	2,400	1,550.00	3,720,000	
ファルテック	2,600	1,347.00	3,502,200	
武蔵精密工業	15,700	4,170.00	65,469,000	貸付有価証券 6,400株(5,000株)
日産車体	57,500	1,109.00	63,767,500	貸付有価証券 200株
新明和工業	63,900	1,267.00	80,961,300	貸付有価証券 14,700株
極東開発工業	27,300	1,736.00	47,392,800	貸付有価証券 900株(900株)
日信工業	29,900	2,081.00	62,221,900	貸付有価証券 100株(100株)
トピー工業	12,100	3,475.00	42,047,500	
ティラド	5,300	3,945.00	20,908,500	
曙ブレーキ工業	68,300	251.00	17,143,300	貸付有価証券 31,500株(600株)
タチエス	25,000	2,038.00	50,950,000	
NOK	79,100	2,267.00	179,319,700	
フタバ産業	45,000	860.00	38,700,000	
KYB	15,300	5,140.00	78,642,000	
大同メタル工業	18,500	1,287.00	23,809,500	貸付有価証券 100株
プレス工業	78,100	616.00	48,109,600	
ミクニ	18,700	641.00	11,986,700	
太平洋工業	30,800	1,554.00	47,863,200	
ケーヒン	33,800	2,230.00	75,374,000	貸付有価証券 8,400株
河西工業	18,000	1,495.00	26,910,000	

アイシン精機	121,100	5,960.00	721,756,000	
マツダ	461,800	1,448.50	668,917,300	
今仙電機製作所	13,600	1,220.00	16,592,000	
本田技研工業	1,323,900	3,550.00	4,699,845,000	
スズキ	291,600	5,638.00	1,644,040,800	貸付有価証券 5,600株(100株)
S U B A R U	456,800	3,692.00	1,686,505,600	
安永	7,100	2,372.00	16,841,200	貸付有価証券 3,200株(1,500株)
ヤマハ発動機	207,800	3,410.00	708,598,000	貸付有価証券 18,500株
ショーワ	38,200	1,969.00	75,215,800	
T B K	17,500	550.00	9,625,000	
エクセディ	17,800	3,675.00	65,415,000	
豊田合成	53,400	2,889.00	154,272,600	貸付有価証券 2,200株
愛三工業	25,900	1,151.00	29,810,900	
盟和産業	2,200	1,345.00	2,959,000	
日本プラスト	8,000	1,007.00	8,056,000	貸付有価証券 2,600株
ヨロズ	14,900	1,844.00	27,475,600	貸付有価証券 100株
エフ・シー・シー	24,000	2,934.00	70,416,000	
シマノ	59,300	14,890.00	882,977,000	貸付有価証券 3,800株
テイ・エス テック	34,200	5,000.00	171,000,000	貸付有価証券 1,800株
ジャムコ	7,400	2,263.00	16,746,200	貸付有価証券 3,200株
テルモ	225,500	6,080.00	1,371,040,000	貸付有価証券 3,300株
クリエートメディック	4,900	1,398.00	6,850,200	
日機装	50,900	1,149.00	58,484,100	
島津製作所	175,800	2,957.00	519,840,600	貸付有価証券 1,000株
J M S	13,600	648.00	8,812,800	
クボテック	3,200	546.00	1,747,200	貸付有価証券 1,400株
長野計器	11,500	1,332.00	15,318,000	
バイ・テクノロジー	3,400	27,550.00	93,670,000	貸付有価証券

				1,500株
東京計器	9,400	1,211.00	11,383,400	貸付有価証券 3,100株
愛知時計電機	1,900	4,260.00	8,094,000	
インターアクション	7,800	1,156.00	9,016,800	貸付有価証券 2,600株
オーバル	14,400	306.00	4,406,400	
東京精密	26,600	4,295.00	114,247,000	
マニー	17,900	4,525.00	80,997,500	
ニコン	256,400	1,834.00	470,237,600	
トプコン	79,000	2,016.00	159,264,000	貸付有価証券 100株
オリンパス	219,200	4,040.00	885,568,000	
理研計器	14,100	2,560.00	36,096,000	
タムロン	11,900	2,276.00	27,084,400	
H O Y A	296,200	5,897.00	1,746,691,400	
シード	2,100	6,760.00	14,196,000	貸付有価証券 700株
ノーリツ鋼機	14,900	2,865.00	42,688,500	貸付有価証券 6,800株(100株)
エー・アンド・デイ	13,400	738.00	9,889,200	
シチズン時計	175,600	832.00	146,099,200	貸付有価証券 4,300株
リズム時計工業	5,600	2,404.00	13,462,400	
大研医器	13,100	748.00	9,798,800	貸付有価証券 4,500株(400株)
メニコン	20,200	2,882.00	58,216,400	
シンシア	1,600	726.00	1,161,600	貸付有価証券 500株
松風	7,200	1,427.00	10,274,400	
セイコーホールディングス	22,700	2,956.00	67,101,200	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
ニプロ	101,800	1,303.00	132,645,400	貸付有価証券 7,000株(2,100株)
中本パックス	3,700	1,819.00	6,730,300	
スノーピーク	4,500	1,472.00	6,624,000	貸付有価証券 2,000株(1,000株)
パラマウントベッドホールディングス	15,500	5,160.00	79,980,000	
トランザクション	8,000	994.00	7,952,000	貸付有価証券

				2,900株
SHO - B I	4,300	440.00	1,892,000	貸付有価証券 1,000株
ニホンフラッシュ	6,900	2,889.00	19,934,100	
前田工織	16,200	1,828.00	29,613,600	
永大産業	19,200	558.00	10,713,600	
アートネイチャー	15,700	730.00	11,461,000	
バンダイナムコホールディングス	152,100	4,095.00	622,849,500	
アイフィスジャパン	3,300	710.00	2,343,000	
共立印刷	24,400	369.00	9,003,600	
SHOEI	7,100	4,200.00	29,820,000	貸付有価証券 2,700株
フランスベッドホールディングス	17,400	985.00	17,139,000	
パイロットコーポレーション	25,700	6,200.00	159,340,000	
萩原工業	8,200	2,002.00	16,416,400	
トッパン・フォームズ	31,500	1,202.00	37,863,000	
フジシールインターナショナル	33,000	4,325.00	142,725,000	
タカラトミー	61,600	1,113.00	68,560,800	
廣済堂	13,700	540.00	7,398,000	
As - me エステール	4,300	880.00	3,784,000	
アーク	74,900	121.00	9,062,900	貸付有価証券 34,500株
タカノ	6,500	994.00	6,461,000	
プロネクサス	13,700	1,350.00	18,495,000	
ホクシン	10,400	176.00	1,830,400	
ウッドワン	4,900	1,565.00	7,668,500	
大建工業	11,500	2,818.00	32,407,000	
凸版印刷	415,000	912.00	378,480,000	
大日本印刷	192,500	2,345.00	451,412,500	貸付有価証券 8,800株(7,700株)
図書印刷	9,900	1,027.00	10,167,300	貸付有価証券 3,600株
共同印刷	4,500	3,400.00	15,300,000	
N I S S H A	30,200	2,764.00	83,472,800	貸付有価証券 3,700株

光村印刷	1,300	2,437.00	3,168,100	
宝印刷	7,700	2,042.00	15,723,400	
アシックス	146,100	1,788.00	261,226,800	貸付有価証券 48,900株
ツツミ	4,600	2,096.00	9,641,600	
小松ウオール工業	5,000	2,420.00	12,100,000	
ヤマハ	99,100	5,850.00	579,735,000	貸付有価証券 700株
河合楽器製作所	4,900	3,915.00	19,183,500	
クリナップ	13,700	824.00	11,288,800	
ピジョン	88,900	5,220.00	464,058,000	貸付有価証券 400株
兼松サステック	1,100	2,183.00	2,401,300	
キングジム	12,200	1,103.00	13,456,600	
リンテック	35,000	3,315.00	116,025,000	
イトーキ	31,000	686.00	21,266,000	
任天堂	90,600	45,500.00	4,122,300,000	
三菱鉛筆	24,200	2,260.00	54,692,000	貸付有価証券 400株
タカラスタンダード	30,400	1,862.00	56,604,800	貸付有価証券 13,300株
コクヨ	70,600	2,049.00	144,659,400	
ナカバヤシ	14,500	635.00	9,207,500	
グローブライド	6,600	3,260.00	21,516,000	
オカムラ	51,300	1,690.00	86,697,000	貸付有価証券 2,700株
美津濃	14,600	4,025.00	58,765,000	
東京電力ホールディングス	1,174,500	545.00	640,102,500	貸付有価証券 18,800株
中部電力	450,100	1,735.50	781,148,550	貸付有価証券 800株
関西電力	600,300	1,589.00	953,876,700	
中国電力	203,400	1,403.00	285,370,200	貸付有価証券 75,400株(18,700株)
北陸電力	144,100	1,106.00	159,374,600	貸付有価証券 64,800株(100株)
東北電力	344,600	1,438.00	495,534,800	貸付有価証券 8,100株
四国電力	132,500	1,368.00	181,260,000	

九州電力	324,900	1,303.00	423,344,700	貸付有価証券 109,100株(108,800株)
北海道電力	147,500	776.00	114,460,000	貸付有価証券 2,200株
沖縄電力	23,800	3,165.00	75,327,000	
電源開発	117,100	2,989.00	350,011,900	
エフオン	7,400	1,452.00	10,744,800	貸付有価証券 3,300株
イーレックス	23,200	864.00	20,044,800	貸付有価証券 10,600株
レノバ	7,600	1,040.00	7,904,000	貸付有価証券 3,500株(100株)
東京瓦斯	313,900	2,871.50	901,363,850	貸付有価証券 3,700株
大阪瓦斯	285,500	2,396.50	684,200,750	
東邦瓦斯	72,900	3,420.00	249,318,000	貸付有価証券 200株
北海道瓦斯	40,000	306.00	12,240,000	
広島ガス	30,300	377.00	11,423,100	
西部瓦斯	17,800	2,950.00	52,510,000	
静岡ガス	41,800	980.00	40,964,000	
メタウォーター	8,300	3,030.00	25,149,000	
SBSホールディングス	14,500	1,429.00	20,720,500	貸付有価証券 500株
東武鉄道	155,200	3,380.00	524,576,000	
相鉄ホールディングス	47,100	3,165.00	149,071,500	
東京急行電鉄	399,600	1,854.00	740,858,400	貸付有価証券 1,200株
京浜急行電鉄	201,500	1,831.00	368,946,500	貸付有価証券 2,200株
小田急電鉄	218,800	2,352.00	514,617,600	
京王電鉄	82,200	4,900.00	402,780,000	貸付有価証券 1,800株(100株)
京成電鉄	102,400	3,550.00	363,520,000	貸付有価証券 1,200株
富士急行	20,100	3,250.00	65,325,000	貸付有価証券 400株
新京成電鉄	3,800	2,291.00	8,705,800	
東日本旅客鉄道	264,200	10,710.00	2,829,582,000	貸付有価証券

				200株
西日本旅客鉄道	132,700	8,011.00	1,063,059,700	貸付有価証券 2,300株
東海旅客鉄道	131,700	21,350.00	2,811,795,000	
西武ホールディングス	187,500	1,876.00	351,750,000	
鴻池運輸	20,800	1,929.00	40,123,200	
西日本鉄道	40,800	3,050.00	124,440,000	貸付有価証券 1,500株
ハマキョウレックス	10,400	3,675.00	38,220,000	
サカイ引越センター	7,700	6,020.00	46,354,000	貸付有価証券 400株
近鉄グループホールディングス	139,300	4,415.00	615,009,500	
阪急阪神ホールディングス	185,800	4,265.00	792,437,000	貸付有価証券 200株
南海電気鉄道	66,000	3,055.00	201,630,000	貸付有価証券 600株
京阪ホールディングス	62,000	3,615.00	224,130,000	貸付有価証券 200株
神戸電鉄	3,300	3,980.00	13,134,000	貸付有価証券 200株
名古屋鉄道	110,900	2,802.00	310,741,800	貸付有価証券 2,000株
山陽電気鉄道	10,700	2,776.00	29,703,200	
日本通運	54,700	8,200.00	448,540,000	貸付有価証券 1,000株
ヤマトホールディングス	244,300	2,898.50	708,103,550	
山九	35,700	5,750.00	205,275,000	貸付有価証券 400株
丸運	7,900	349.00	2,757,100	
丸全昭和運輸	49,000	520.00	25,480,000	
センコーグループホールディングス	83,800	914.00	76,593,200	貸付有価証券 100株
トナミホールディングス	3,300	7,360.00	24,288,000	
ニッコンホールディングス	53,000	3,055.00	161,915,000	
日本石油輸送	1,700	3,335.00	5,669,500	
福山通運	20,400	5,310.00	108,324,000	貸付有価証券 100株(100株)
セイノーホールディングス	104,400	2,126.00	221,954,400	

エスライン	3,800	1,228.00	4,666,400	
神奈川中央交通	3,500	3,705.00	12,967,500	
日立物流	30,600	3,100.00	94,860,000	
丸和運輸機関	7,300	4,390.00	32,047,000	貸付有価証券 1,700株(1,600株)
C & F ロジホールディングス	15,300	1,446.00	22,123,800	
九州旅客鉄道	116,900	3,440.00	402,136,000	
S Gホールディングス	131,600	2,339.00	307,812,400	貸付有価証券 4,200株
日本郵船	116,500	2,406.00	280,299,000	貸付有価証券 1,200株
商船三井	88,200	3,270.00	288,414,000	貸付有価証券 600株
川崎汽船	64,400	2,415.00	155,526,000	貸付有価証券 28,900株(700株)
N S ユナイテッド海運	6,600	2,248.00	14,836,800	
明治海運	14,800	449.00	6,645,200	
飯野海運	71,000	522.00	37,062,000	
共栄タンカー	1,000	1,900.00	1,900,000	貸付有価証券 400株
乾汽船	10,700	855.00	9,148,500	
日本航空	258,500	3,985.00	1,030,122,500	
A N Aホールディングス	270,600	4,123.00	1,115,683,800	貸付有価証券 40,500株(38,600株)
パスコ	13,000	336.00	4,368,000	貸付有価証券 1,000株
トランコム	3,900	8,290.00	32,331,000	
日新	12,000	2,753.00	33,036,000	
三菱倉庫	48,200	2,495.00	120,259,000	貸付有価証券 3,600株
三井倉庫ホールディングス	80,000	358.00	28,640,000	
住友倉庫	97,000	737.00	71,489,000	
澁澤倉庫	7,600	1,860.00	14,136,000	
東陽倉庫	25,100	376.00	9,437,600	
日本トランスシティ	33,700	529.00	17,827,300	
ケイヒン	2,700	1,650.00	4,455,000	
中央倉庫	8,500	1,144.00	9,724,000	

川西倉庫	2,800	2,040.00	5,712,000	貸付有価証券 700株
安田倉庫	12,500	999.00	12,487,500	
東洋埠頭	4,200	1,725.00	7,245,000	
宇徳	11,900	513.00	6,104,700	
上組	85,900	2,448.00	210,283,200	
サンリツ	3,600	799.00	2,876,400	
キムラユニティー	3,700	1,163.00	4,303,100	
キューソー流通システム	4,100	2,812.00	11,529,200	貸付有価証券 100株
近鉄エクスプレス	26,300	2,067.00	54,362,100	
東海運	7,900	399.00	3,152,100	貸付有価証券 400株
エーアイティー	9,900	1,246.00	12,335,400	
内外トランスライン	4,900	1,770.00	8,673,000	
日本コンセプト	2,700	1,507.00	4,068,900	
NEC ネットエスアイ	15,900	2,755.00	43,804,500	
システナ	11,600	5,020.00	58,232,000	
デジタルアーツ	7,100	5,480.00	38,908,000	貸付有価証券 3,200株(2,900株)
新日鉄住金ソリューションズ	21,600	3,045.00	65,772,000	
キューブシステム	8,400	839.00	7,047,600	
エイジア	2,900	1,464.00	4,245,600	貸付有価証券 900株
コア	6,100	1,509.00	9,204,900	貸付有価証券 900株
ソリトンシステムズ	6,300	1,600.00	10,080,000	貸付有価証券 2,900株
ソフトクリエイティブホールディングス	6,900	1,707.00	11,778,300	
T I S	48,100	4,400.00	211,640,000	
ネオス	4,300	405.00	1,741,500	
電算システム	5,000	2,015.00	10,075,000	
グリー	77,400	633.00	48,994,200	貸付有価証券 200株
コーエーテクモホールディングス	24,600	2,222.00	54,661,200	貸付有価証券 100株
三菱総合研究所	5,600	4,405.00	24,668,000	

ポルテージ	2,800	899.00	2,517,200	貸付有価証券 1,100株(200株)
電算	1,600	2,363.00	3,780,800	
A G S	8,100	924.00	7,484,400	
ファインデックス	11,900	820.00	9,758,000	貸付有価証券 5,400株(2,800株)
ヒト・コミュニケーションズ	3,300	2,057.00	6,788,100	貸付有価証券 1,500株(200株)
ブレインパッド	3,100	2,694.00	8,351,400	貸付有価証券 1,400株(100株)
K L a b	27,400	1,871.00	51,265,400	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	10,400	2,008.00	20,883,200	
イーブックイニシアティブジャパン	2,300	1,253.00	2,881,900	
ネクソン	324,300	1,581.00	512,718,300	貸付有価証券 1,200株
アイスタイル	36,700	1,160.00	42,572,000	貸付有価証券 16,900株(100株)
エムアップ	4,800	1,448.00	6,950,400	貸付有価証券 2,200株(1,800株)
エイチーム	9,000	2,248.00	20,232,000	
テクノスジャパン	13,000	993.00	12,909,000	貸付有価証券 4,400株
e n i s h	4,900	1,043.00	5,110,700	貸付有価証券 2,100株(200株)
コロプラ	41,200	826.00	34,031,200	貸付有価証券 18,800株
モバイルクリエイト	11,600	382.00	4,431,200	貸付有価証券 300株
オルトプラス	8,200	846.00	6,937,200	貸付有価証券 3,100株(100株)
ブロードリーフ	71,500	540.00	38,610,000	
クロス・マーケティンググループ	4,000	629.00	2,516,000	
ハーツユナイテッドグループ	7,600	1,820.00	13,832,000	貸付有価証券 1,600株
メディアドゥホールディングス	4,700	2,051.00	9,639,700	貸付有価証券 2,100株
ブイキューブ	8,900	604.00	5,375,600	貸付有価証券 4,000株(1,000株)

サイバーリンクス	2,200	1,188.00	2,613,600	
ディー・エル・イー	9,300	464.00	4,315,200	貸付有価証券 3,500株(200株)
フィックスターズ	13,800	1,376.00	18,988,800	貸付有価証券 6,300株(800株)
VOYAGE GROUP	7,600	1,149.00	8,732,400	貸付有価証券 1,000株
オブティム	2,500	2,623.00	6,557,500	貸付有価証券 1,100株
セレス	4,400	2,020.00	8,888,000	貸付有価証券 2,000株
ベリサーブ	1,900	3,250.00	6,175,000	貸付有価証券 700株
ティーガイア	14,400	2,955.00	42,552,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
セック	1,900	2,838.00	5,392,200	貸付有価証券 500株
日本アジアグループ	15,200	562.00	8,542,400	
豆蔵ホールディングス	10,700	1,330.00	14,231,000	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	7,900	2,039.00	16,108,100	貸付有価証券 3,500株
プロシップ	2,100	2,759.00	5,793,900	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	391,400	290.00	113,506,000	貸付有価証券 179,900株
GMOペイメントゲートウェイ	11,900	11,460.00	136,374,000	貸付有価証券 4,700株
ザップラス	6,900	378.00	2,608,200	
システムリサーチ	1,900	2,320.00	4,408,000	
インターネットイニシアティブ	23,500	2,022.00	47,517,000	貸付有価証券 4,400株
さくらインターネット	17,200	860.00	14,792,000	貸付有価証券 7,900株
ヴィンクス	4,000	1,579.00	6,316,000	貸付有価証券 1,800株(1,500株)
GMOクラウド	3,200	2,560.00	8,192,000	貸付有価証券 1,400株(500株)
SRAホールディングス	7,700	3,145.00	24,216,500	
Minorityソリューションズ	2,800	1,715.00	4,802,000	
システムインテグレータ	2,000	1,115.00	2,230,000	

朝日ネット	13,200	549.00	7,246,800	
e B A S E	3,800	1,444.00	5,487,200	貸付有価証券 200株
アバント	3,900	969.00	3,779,100	
アドソル日進	5,500	1,323.00	7,276,500	貸付有価証券 100株
フリービット	9,600	1,156.00	11,097,600	貸付有価証券 4,200株（4,200株）
コムチュア	7,300	3,875.00	28,287,500	貸付有価証券 2,900株（2,900株）
サイバーコム	2,600	2,438.00	6,338,800	貸付有価証券 1,100株
インフォテリア	7,200	1,336.00	9,619,200	貸付有価証券 3,300株（2,900株）
メディカル・データ・ビ ジョン	11,000	1,527.00	16,797,000	貸付有価証券 5,000株（3,200株）
g u m i	16,600	995.00	16,517,000	貸付有価証券 6,200株
ショーケース・ティー ビー	2,800	1,431.00	4,006,800	貸付有価証券 1,200株
モバイルファクトリー	3,500	1,399.00	4,896,500	貸付有価証券 1,600株
デジタル・インフォーメー ション・テクノロジー	6,400	1,227.00	7,852,800	貸付有価証券 1,800株（800株）
P C Iホールディングス	2,500	3,045.00	7,612,500	貸付有価証券 100株
パイブドHD	2,200	1,019.00	2,241,800	貸付有価証券 400株
アイビーシー	2,300	1,309.00	3,010,700	貸付有価証券 100株
ネオジャパン	3,400	1,349.00	4,586,600	貸付有価証券 1,100株
オープンドア	5,700	2,040.00	11,628,000	貸付有価証券 400株
マイネット	3,800	1,253.00	4,761,400	貸付有価証券 1,700株（1,000株）
アカツキ	3,800	4,790.00	18,202,000	貸付有価証券 1,300株（100株）
ベネフィットジャパン	800	1,196.00	956,800	
U b i c o mホールディ ングス	2,100	899.00	1,887,900	貸付有価証券 700株（100株）
L I N E	43,600	4,005.00	174,618,000	貸付有価証券

				20,100株(17,500株)
シンクロ・フード	4,900	1,025.00	5,022,500	
オークネット	6,100	1,423.00	8,680,300	貸付有価証券 1,900株
AOI TYO Holdings	11,800	1,587.00	18,726,600	
マクロミル	18,100	2,641.00	47,802,100	貸付有価証券 2,100株
ビーグリー	3,300	1,723.00	5,685,900	
オロ	1,400	2,057.00	2,879,800	
ソルクシーズ	5,500	1,295.00	7,122,500	貸付有価証券 2,500株(2,400株)
フェイス	5,100	1,124.00	5,732,400	
ハイマックス	1,900	1,840.00	3,496,000	
野村総合研究所	91,700	5,600.00	513,520,000	
サイバネットシステム	11,800	888.00	10,478,400	貸付有価証券 400株(200株)
CEホールディングス	3,700	913.00	3,378,100	貸付有価証券 1,600株
日本システム技術	2,300	1,359.00	3,125,700	
インテージホールディングス	17,000	1,227.00	20,859,000	
東邦システムサイエンス	4,800	876.00	4,204,800	
ソースネクスト	20,300	814.00	16,524,200	貸付有価証券 9,400株(7,900株)
フォーカスシステムズ	8,200	939.00	7,699,800	貸付有価証券 300株
クレスコ	3,300	3,770.00	12,441,000	
フジ・メディア・ホールディングス	151,200	1,841.00	278,359,200	貸付有価証券 56,000株
オービック	45,500	9,360.00	425,880,000	貸付有価証券 600株
ジャストシステム	23,500	2,542.00	59,737,000	
TDCソフト	6,300	1,441.00	9,078,300	
ヤフー	1,040,900	407.00	423,646,300	貸付有価証券 480,200株(16,300株)
トレンドマイクロ	70,500	6,500.00	458,250,000	貸付有価証券 1,600株
インフォメーション・ディベロプメント	4,500	1,408.00	6,336,000	貸付有価証券 1,800株

日本オラクル	23,400	8,980.00	210,132,000	
アルファシステムズ	4,700	2,482.00	11,665,400	
フューチャー	19,600	1,423.00	27,890,800	
C A C H o l d i n g s	10,800	1,098.00	11,858,400	
ソフトバンク・テクノロジー	6,100	1,686.00	10,284,600	貸付有価証券 2,700株
トーセ	3,900	1,206.00	4,703,400	貸付有価証券 1,700株(1,600株)
オービックビジネスコンサルティング	7,400	7,760.00	57,424,000	貸付有価証券 700株
伊藤忠テクノソリューションズ	65,800	2,060.00	135,548,000	
アイティフォー	17,500	1,216.00	21,280,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
東計電算	2,600	3,175.00	8,255,000	
エクスネット	2,300	892.00	2,051,600	
大塚商会	86,800	4,435.00	384,958,000	
サイボウズ	19,300	558.00	10,769,400	
ソフトブレーン	11,300	529.00	5,977,700	貸付有価証券 5,100株
電通国際情報サービス	8,900	3,250.00	28,925,000	貸付有価証券 100株
デジタルガレージ	25,900	3,815.00	98,808,500	貸付有価証券 2,300株
E Mシステムズ	10,000	1,036.00	10,360,000	貸付有価証券 1,600株
ウェザーニューズ	4,900	3,540.00	17,346,000	貸付有価証券 1,800株(200株)
C I J	11,300	757.00	8,554,100	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,869.00	2,616,600	
日本エンタープライズ	14,800	230.00	3,404,000	貸付有価証券 2,000株
WOWOW	6,900	3,470.00	23,943,000	貸付有価証券 3,100株
スカラ	11,600	819.00	9,500,400	貸付有価証券 100株(100株)
イマジカ・ロボットホールディングス	12,200	1,020.00	12,444,000	貸付有価証券 2,100株(2,000株)
ネットワンシステムズ	58,900	1,828.00	107,669,200	

システムソフト	34,200	143.00	4,890,600	貸付有価証券 15,300株(200株)
アルゴグラフィックス	6,600	3,835.00	25,311,000	
マーベラス	24,500	960.00	23,520,000	貸付有価証券 3,900株(600株)
エイベックス	26,800	1,499.00	40,173,200	
日本ユニシス	40,100	2,630.00	105,463,000	
兼松エレクトロニクス	9,200	3,675.00	33,810,000	
東京放送ホールディングス	79,800	2,353.00	187,769,400	
日本テレビホールディングス	132,600	1,857.00	246,238,200	貸付有価証券 6,100株
朝日放送グループホールディングス	14,300	840.00	12,012,000	
テレビ朝日ホールディングス	39,700	2,378.00	94,406,600	貸付有価証券 14,500株
スカパーJ S A Tホールディングス	110,200	497.00	54,769,400	貸付有価証券 8,300株(8,300株)
テレビ東京ホールディングス	11,800	2,929.00	34,562,200	
日本BS放送	4,900	1,463.00	7,168,700	貸付有価証券 100株(100株)
ビジョン	3,700	3,175.00	11,747,500	
USEN-NEXT HOLDINGS	3,800	931.00	3,537,800	貸付有価証券 1,700株
ワイヤレスゲート	6,800	1,600.00	10,880,000	貸付有価証券 2,900株
コネクシオ	10,200	2,170.00	22,134,000	
日本通信	130,200	115.00	14,973,000	貸付有価証券 48,200株(2,700株)
クロップス	3,100	944.00	2,926,400	貸付有価証券 1,300株(200株)
日本電信電話	1,036,100	5,266.00	5,456,102,600	
KDDI	1,300,000	2,884.00	3,749,200,000	貸付有価証券 1,500株
光通信	17,400	17,210.00	299,454,000	
NTTドコモ	1,036,600	2,792.50	2,894,705,500	
エムティーアイ	16,700	684.00	11,422,800	貸付有価証券 7,700株(5,200株)
GMOインターネット	52,600	2,183.00	114,825,800	貸付有価証券 24,200株(200株)

アイドママーケティング コミュニケーション	3,100	668.00	2,070,800	
カドカワ	42,100	1,157.00	48,709,700	貸付有価証券 11,900株（2,100株）
学研ホールディングス	4,800	5,010.00	24,048,000	
ゼンリン	26,200	2,532.00	66,338,400	貸付有価証券 10,100株（3,700株）
昭文社	6,600	849.00	5,603,400	
インプレスホールディン グス	11,900	202.00	2,403,800	貸付有価証券 5,400株
アイネット	8,200	1,651.00	13,538,200	
松竹	9,500	16,010.00	152,095,000	貸付有価証券 100株
東宝	95,000	3,840.00	364,800,000	
東映	5,400	12,120.00	65,448,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	448,400	1,241.00	556,464,400	貸付有価証券 5,100株
ピー・シー・エー	2,100	1,774.00	3,725,400	
ビジネスブレイン太田昭 和	2,500	2,219.00	5,547,500	
D T S	15,000	4,015.00	60,225,000	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	67,100	4,840.00	324,764,000	
シーイーシー	8,600	3,445.00	29,627,000	
カプコン	61,900	2,410.00	149,179,000	貸付有価証券 500株
アイ・エス・ピー	2,800	2,163.00	6,056,400	
ジャステック	8,400	1,229.00	10,323,600	
S C S K	33,300	5,020.00	167,166,000	
日本システムウエア	4,800	2,586.00	12,412,800	
アイネス	18,300	1,194.00	21,850,200	貸付有価証券 100株（100株）
T K C	12,200	4,235.00	51,667,000	
富士ソフト	20,000	4,325.00	86,500,000	
N S D	23,700	2,327.00	55,149,900	
コナミホールディングス	59,000	5,520.00	325,680,000	貸付有価証券 100株
福井コンピュータホール ディングス	4,200	2,189.00	9,193,800	貸付有価証券 1,600株（400株）
J B C Cホールディング	11,400	1,078.00	12,289,200	

ス				
ミロク情報サービス	12,700	3,080.00	39,116,000	
ソフトバンクグループ	653,600	8,355.00	5,460,828,000	
ハウスイ	1,100	1,170.00	1,287,000	
高千穂交易	5,600	1,301.00	7,285,600	貸付有価証券 200株
伊藤忠食品	3,600	6,180.00	22,248,000	
エレマテック	6,800	2,561.00	17,414,800	
JALUX	4,100	2,894.00	11,865,400	
あらた	7,200	7,610.00	54,792,000	
トーメンデバイス	2,200	2,914.00	6,410,800	貸付有価証券 800株（100株）
東京エレクトロン デバ イス	5,200	2,114.00	10,992,800	
フィールズ	11,100	1,168.00	12,964,800	貸付有価証券 3,100株
双日	857,500	419.00	359,292,500	
アルフレッサ ホール ディングス	161,000	2,460.00	396,060,000	
横浜冷凍	36,700	1,100.00	40,370,000	貸付有価証券 15,700株（12,500株）
神栄	2,000	1,446.00	2,892,000	貸付有価証券 400株
ラサ商事	6,400	950.00	6,080,000	貸付有価証券 200株
ラクーン	8,500	657.00	5,584,500	貸付有価証券 2,800株
アルコニックス	15,400	1,992.00	30,676,800	貸付有価証券 2,700株
神戸物産	9,400	5,180.00	48,692,000	貸付有価証券 4,300株
ペッパーフードサービス	10,400	6,010.00	62,504,000	貸付有価証券 3,600株（2,700株）
あい ホールディングス	23,300	2,957.00	68,898,100	
ディービーエックス	5,200	1,378.00	7,165,600	
ダイワボウホールディン グス	12,300	5,020.00	61,746,000	
マクニカ・富士エレホー ルディングス	27,700	1,948.00	53,959,600	
ラクト・ジャパン	2,700	5,190.00	14,013,000	貸付有価証券 1,200株

バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,300	1,069.00	29,183,700	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
八洲電機	11,200	963.00	10,785,600	
メディアスホールディングス	8,000	1,037.00	8,296,000	
UKCホールディングス	9,300	2,293.00	21,324,900	貸付有価証券 200株
ジューテックホールディングス	3,300	1,151.00	3,798,300	
大光	3,600	892.00	3,211,200	貸付有価証券 1,600株
OCHIホールディングス	4,200	1,616.00	6,787,200	
TOKAIホールディングス	76,600	1,180.00	90,388,000	
Cominix	2,200	1,005.00	2,211,000	
三洋貿易	7,300	2,279.00	16,636,700	
ビューティガレージ	1,900	2,335.00	4,436,500	
ウイン・パートナーズ	10,500	1,485.00	15,592,500	
ミタチ産業	3,400	1,160.00	3,944,000	貸付有価証券 1,500株
シップヘルスケアホールディングス	30,200	3,740.00	112,948,000	
明治電機工業	5,000	2,039.00	10,195,000	
デリカフーズホールディングス	2,800	1,641.00	4,594,800	
スターティアホールディングス	3,300	916.00	3,022,800	貸付有価証券 100株
コメダホールディングス	26,800	2,139.00	57,325,200	
富士興産	5,600	662.00	3,707,200	
協栄産業	1,800	2,051.00	3,691,800	貸付有価証券 700株
小野建	12,800	1,879.00	24,051,200	
佐鳥電機	10,700	1,143.00	12,230,100	
エコトレーディング	3,300	731.00	2,412,300	貸付有価証券 800株
伯東	8,800	1,856.00	16,332,800	貸付有価証券 200株
コンドーテック	11,500	939.00	10,798,500	貸付有価証券 100株
中山福	8,300	745.00	6,183,500	

ナガイレーベン	21,000	2,855.00	59,955,000	
三菱食品	15,900	3,110.00	49,449,000	
松田産業	10,600	1,898.00	20,118,800	
第一興商	21,600	5,760.00	124,416,000	
メディopalホールディングス	145,200	2,327.00	337,880,400	
S P K	3,100	2,810.00	8,711,000	
萩原電気ホールディングス	5,200	3,105.00	16,146,000	貸付有価証券 100株
アズワン	11,300	7,150.00	80,795,000	
スズデン	5,000	1,712.00	8,560,000	
尾家産業	4,200	1,382.00	5,804,400	
シモジマ	8,900	1,129.00	10,048,100	
ドウシシャ	15,400	2,533.00	39,008,200	
小津産業	3,200	2,358.00	7,545,600	貸付有価証券 1,400株
高速	8,600	1,365.00	11,739,000	
たけびし	5,100	1,738.00	8,863,800	
リックス	3,300	2,106.00	6,949,800	
丸文	12,800	961.00	12,300,800	
ハピネット	9,900	1,568.00	15,523,200	
橋本総業ホールディングス	3,000	1,762.00	5,286,000	
日本ライフライン	41,300	2,568.00	106,058,400	貸付有価証券 6,900株
エクセル	5,800	2,875.00	16,675,000	貸付有価証券 200株
マルカキカイ	4,700	2,068.00	9,719,600	
I D O M	43,900	797.00	34,988,300	貸付有価証券 15,400株(14,000株)
日本エム・ディ・エム	9,700	1,141.00	11,067,700	
進和	8,600	2,574.00	22,136,400	貸付有価証券 2,900株
エスケイジャパン	3,500	560.00	1,960,000	貸付有価証券 1,600株
ダイترون	6,600	2,397.00	15,820,200	
シークス	18,400	2,146.00	39,486,400	貸付有価証券 8,100株(7,400株)
田中商事	4,400	742.00	3,264,800	

オーハシテクニカ	8,200	1,788.00	14,661,600	
白銅	5,200	2,350.00	12,220,000	
伊藤忠商事	1,063,400	2,033.50	2,162,423,900	
丸紅	1,190,800	866.90	1,032,304,520	
高島	2,500	2,247.00	5,617,500	
長瀬産業	87,300	1,961.00	171,195,300	
蝶理	9,200	2,106.00	19,375,200	
豊田通商	161,700	4,065.00	657,310,500	
三共生興	24,700	497.00	12,275,900	
兼松	61,800	1,727.00	106,728,600	貸付有価証券 300株
ツカモトコーポレーション	2,600	1,276.00	3,317,600	
三井物産	1,230,900	1,934.50	2,381,176,050	
日本紙パルプ商事	7,500	4,490.00	33,675,000	
日立ハイテクノロジーズ	50,300	5,050.00	254,015,000	
カメイ	18,900	1,566.00	29,597,400	
東都水産	2,200	1,880.00	4,136,000	
OUGホールディングス	2,300	2,678.00	6,159,400	
スターゼン	5,700	5,450.00	31,065,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
山善	56,600	1,118.00	63,278,800	
椿本興業	3,300	4,075.00	13,447,500	
住友商事	914,000	1,925.50	1,759,907,000	
内田洋行	6,700	3,040.00	20,368,000	
三菱商事	1,016,900	3,187.00	3,240,860,300	貸付有価証券 600株
第一実業	6,600	3,225.00	21,285,000	
キャノンマーケティング ジャパン	41,400	2,408.00	99,691,200	貸付有価証券 800株
西華産業	8,800	2,875.00	25,300,000	
佐藤商事	12,900	1,197.00	15,441,300	
菱洋エレクトロ	13,500	1,909.00	25,771,500	貸付有価証券 500株
東京産業	14,400	563.00	8,107,200	
ユアサ商事	13,800	3,575.00	49,335,000	
神鋼商事	3,200	3,385.00	10,832,000	
小林産業	9,600	360.00	3,456,000	貸付有価証券

				100株
阪和興業	27,100	4,795.00	129,944,500	
正栄食品工業	8,000	4,400.00	35,200,000	貸付有価証券 2,500株
カナデン	13,800	1,362.00	18,795,600	
菱電商事	10,400	1,807.00	18,792,800	
フルサト工業	8,000	1,853.00	14,824,000	
岩谷産業	32,100	4,020.00	129,042,000	貸付有価証券 3,900株(3,400株)
すてきナイスグループ	6,200	1,453.00	9,008,600	
昭光通商	51,000	110.00	5,610,000	貸付有価証券 2,000株
ニチモウ	2,200	1,817.00	3,997,400	
極東貿易	21,000	502.00	10,542,000	貸付有価証券 2,000株
イワキ	20,400	401.00	8,180,400	貸付有価証券 1,700株
三菱石油	38,900	1,756.00	68,308,400	
稲畑産業	34,800	1,691.00	58,846,800	
G S イクレオス	3,800	1,687.00	6,410,600	貸付有価証券 1,300株
明和産業	13,400	534.00	7,155,600	
ワキタ	30,900	1,201.00	37,110,900	
東邦ホールディングス	42,900	2,778.00	119,176,200	貸付有価証券 19,700株(19,700株)
サンゲツ	48,300	2,248.00	108,578,400	
ミツウロコグループホールディングス	21,000	943.00	19,803,000	
シナネンホールディングス	6,000	2,748.00	16,488,000	
伊藤忠エネクス	32,000	1,091.00	34,912,000	
サンリオ	40,700	2,040.00	83,028,000	貸付有価証券 18,300株(7,500株)
サンワテクノス	9,400	1,675.00	15,745,000	貸付有価証券 3,900株
リョーサン	18,200	4,265.00	77,623,000	貸付有価証券 500株
新光商事	15,900	1,906.00	30,305,400	
トーヨー	6,500	2,600.00	16,900,000	
三信電気	13,400	2,193.00	29,386,200	貸付有価証券

				600株
東陽テクニカ	16,700	960.00	16,032,000	
モスフードサービス	19,000	3,275.00	62,225,000	貸付有価証券 200株
加賀電子	13,100	2,616.00	34,269,600	
ソーダニッカ	14,900	785.00	11,696,500	貸付有価証券 100株
立花エレテック	9,800	2,045.00	20,041,000	
フォーバル	6,300	878.00	5,531,400	
PALTA C	20,300	6,200.00	125,860,000	
三谷産業	15,700	426.00	6,688,200	貸付有価証券 3,400株
太平洋興発	6,000	1,041.00	6,246,000	
西本Wismettac ホールディングス	3,900	4,715.00	18,388,500	貸付有価証券 500株
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,200	1,567.00	1,880,400	貸付有価証券 500株
ヤマタネ	7,300	1,961.00	14,315,300	
丸紅建材リース	14,000	242.00	3,388,000	
日鉄住金物産	11,300	6,080.00	68,704,000	
泉州電業	4,800	3,110.00	14,928,000	貸付有価証券 100株
トラスコ中山	30,200	2,835.00	85,617,000	
オートバックスセブン	57,600	2,053.00	118,252,800	
モリト	11,600	1,042.00	12,087,200	
加藤産業	22,700	4,010.00	91,027,000	
イノテック	12,500	1,387.00	17,337,500	
イエローハット	13,700	3,300.00	45,210,000	
J Kホールディングス	14,500	918.00	13,311,000	
日伝	12,000	2,095.00	25,140,000	
北沢産業	12,000	301.00	3,612,000	
杉本商事	7,800	2,029.00	15,826,200	
因幡電機産業	19,200	4,790.00	91,968,000	
バイテックホールディン グス	6,600	2,678.00	17,674,800	貸付有価証券 1,600株
東テク	4,800	2,694.00	12,931,200	貸付有価証券 600株
ミスミグループ本社	168,300	3,065.00	515,839,500	
アルテック	12,400	361.00	4,476,400	貸付有価証券

				5,700株
タキヒヨー	4,800	2,398.00	11,510,400	
蔵王産業	2,400	1,777.00	4,264,800	
スズケン	66,100	4,885.00	322,898,500	貸付有価証券 800株
ジェコス	10,000	1,148.00	11,480,000	
ルネサスイーストン	13,300	684.00	9,097,200	貸付有価証券 200株(200株)
ローソン	36,700	6,940.00	254,698,000	貸付有価証券 16,800株
サンエー	11,000	5,630.00	61,930,000	
カワチ薬品	11,200	2,628.00	29,433,600	貸付有価証券 400株
エービーシー・マート	26,400	7,180.00	189,552,000	
ハードオフコーポレーション	6,400	1,127.00	7,212,800	
アスクル	12,600	3,445.00	43,407,000	貸付有価証券 5,800株(400株)
ゲオホールディングス	26,500	1,640.00	43,460,000	貸付有価証券 9,700株(800株)
アダストリア	22,300	1,665.00	37,129,500	貸付有価証券 10,200株
ジーフット	8,700	797.00	6,933,900	貸付有価証券 300株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	1,900	794.00	1,508,600	
くらコーポレーション	8,500	7,820.00	66,470,000	貸付有価証券 3,900株
キャンドウ	6,900	1,832.00	12,640,800	貸付有価証券 3,100株
パルグループホールディングス	7,400	2,910.00	21,534,000	
エディオン	56,300	1,120.00	63,056,000	貸付有価証券 5,100株
サーラコーポレーション	24,900	708.00	17,629,200	
ワッツ	4,800	1,181.00	5,668,800	
ハローズ	5,400	2,729.00	14,736,600	貸付有価証券 2,100株
あみやき亭	3,100	5,430.00	16,833,000	
ひらまつ	20,000	500.00	10,000,000	貸付有価証券 9,200株

大黒天物産	3,500	5,890.00	20,615,000	貸付有価証券 1,500株
ハニーズホールディングス	14,000	1,050.00	14,700,000	貸付有価証券 6,400株
ファーマライズホールディングス	3,300	723.00	2,385,900	貸付有価証券 1,400株
アルペン	11,100	2,317.00	25,718,700	
ハブ	3,600	1,148.00	4,132,800	貸付有価証券 400株
クオール	16,000	2,098.00	33,568,000	貸付有価証券 200株
ジンス	9,900	5,860.00	58,014,000	貸付有価証券 4,500株
ビックカメラ	77,100	1,832.00	141,247,200	
DCMホールディングス	78,100	1,070.00	83,567,000	貸付有価証券 36,000株（600株）
Monotaro	51,500	4,210.00	216,815,000	貸付有価証券 23,700株（5,900株）
東京一番フーズ	3,600	670.00	2,412,000	貸付有価証券 800株（800株）
DDホールディングス	3,200	2,858.00	9,145,600	貸付有価証券 1,500株
きちり	3,900	730.00	2,847,000	貸付有価証券 1,700株
アークランドサービスホールディングス	12,100	2,457.00	29,729,700	
J.フロントリテイリング	173,000	1,788.00	309,324,000	
ドトール・日レスホールディングス	25,400	2,333.00	59,258,200	
マツモトキヨシホールディングス	59,900	4,915.00	294,408,500	
ブロンコビリー	7,600	4,390.00	33,364,000	
スタートトゥデイ	142,400	3,625.00	516,200,000	
トレジャー・ファクトリー	4,200	791.00	3,322,200	貸付有価証券 1,900株
物語コーポレーション	4,100	12,750.00	52,275,000	貸付有価証券 300株
ココカラファイン	15,100	7,720.00	116,572,000	
三越伊勢丹ホールディングス	271,000	1,322.00	358,262,000	貸付有価証券 15,300株
Hamee	3,700	1,613.00	5,968,100	

				貸付有価証券 1,600株(100株)
ウエルシアホールディングス	38,300	5,760.00	220,608,000	貸付有価証券 300株
クリエイティブSDホールディングス	21,400	3,255.00	69,657,000	貸付有価証券 5,100株
丸善CHIホールディングス	16,900	357.00	6,033,300	貸付有価証券 3,800株
ミサワ	2,600	427.00	1,110,200	貸付有価証券 200株
ティーライフ	1,900	1,343.00	2,551,700	
エー・ピーカンパニー	2,700	788.00	2,127,600	貸付有価証券 900株(100株)
チムニー	4,400	2,844.00	12,513,600	
シュッピン	8,700	1,473.00	12,815,100	貸付有価証券 4,000株(400株)
ネクステージ	15,300	1,172.00	17,931,600	貸付有価証券 7,000株
ジョイフル本田	21,200	3,985.00	84,482,000	
鳥貴族	4,800	2,780.00	13,344,000	貸付有価証券 2,200株(500株)
キリン堂ホールディングス	5,200	3,085.00	16,042,000	
ホットランド	8,400	1,362.00	11,440,800	貸付有価証券 3,900株
すかいらーく	90,000	1,592.00	143,280,000	貸付有価証券 41,500株
綿半ホールディングス	5,400	3,925.00	21,195,000	貸付有価証券 1,400株
ヨシックス	2,400	3,340.00	8,016,000	貸付有価証券 1,000株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	48,100	1,417.00	68,157,700	
ブックオフコーポレーション	8,200	825.00	6,765,000	貸付有価証券 700株(700株)
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,349.00	7,824,200	貸付有価証券 2,600株
B E E N O S	3,400	1,553.00	5,280,200	貸付有価証券 400株
あさひ	10,800	1,312.00	14,169,600	貸付有価証券 100株
日本調剤	5,100	3,295.00	16,804,500	貸付有価証券

				1,000株
コスモス薬品	7,300	24,750.00	180,675,000	貸付有価証券 3,100株
トーエル	7,000	1,051.00	7,357,000	
一六堂	3,100	420.00	1,302,000	
オンリー	2,500	987.00	2,467,500	
セブン & アイ・ホールディングス	607,400	4,762.00	2,892,438,800	貸付有価証券 36,900株
薬王堂	6,300	3,975.00	25,042,500	貸付有価証券 1,700株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	38,900	1,350.00	52,515,000	貸付有価証券 200株
ツルハホールディングス	31,400	16,090.00	505,226,000	
サンマルクホールディングス	10,400	3,105.00	32,292,000	
フェリシモ	3,700	1,367.00	5,057,900	
トリドールホールディングス	17,900	3,715.00	66,498,500	貸付有価証券 800株
T O K Y O B A S E	12,900	1,044.00	13,467,600	貸付有価証券 4,800株
ウイルプラスホールディングス	1,300	1,142.00	1,484,600	
サツドラホールディングス	2,400	2,375.00	5,700,000	貸付有価証券 1,000株
ダイユー・リックホールディングス	6,800	1,095.00	7,446,000	
バロックジャパンリミテッド	11,600	1,147.00	13,305,200	貸付有価証券 3,700株(700株)
クスリのアオキホールディングス	11,500	7,700.00	88,550,000	貸付有価証券 5,300株
力の源ホールディングス	3,200	1,900.00	6,080,000	貸付有価証券 300株
スシローグローバルホールディングス	15,900	5,640.00	89,676,000	
L I X I L ビバ	18,400	1,926.00	35,438,400	
メディカルシステムネットワーク	16,700	489.00	8,166,300	貸付有価証券 7,300株
総合メディカル	12,600	2,435.00	30,681,000	貸付有価証券 900株
はるやまホールディングス	6,800	1,093.00	7,432,400	

ノジマ	25,500	2,711.00	69,130,500	
カップ・クリエイト	18,100	1,474.00	26,679,400	
ライトオン	12,200	1,025.00	12,505,000	貸付有価証券 4,900株
ジーンズメイト	4,400	851.00	3,744,400	貸付有価証券 700株
良品計画	19,200	37,950.00	728,640,000	
三城ホールディングス	17,900	516.00	9,236,400	
アドヴァン	14,700	1,009.00	14,832,300	貸付有価証券 100株
アルビス	4,700	3,870.00	18,189,000	
コナカ	18,500	592.00	10,952,000	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,815.00	3,267,000	貸付有価証券 100株
G - 7ホールディングス	4,300	2,453.00	10,547,900	
イオン北海道	14,600	809.00	11,811,400	貸付有価証券 600株
コジマ	21,400	460.00	9,844,000	貸付有価証券 1,100株
ヒマラヤ	4,500	1,182.00	5,319,000	貸付有価証券 300株(300株)
コーナン商事	20,600	2,765.00	56,959,000	貸付有価証券 2,000株(1,600株)
エコス	5,900	1,847.00	10,897,300	貸付有価証券 2,500株
ワタミ	17,100	1,500.00	25,650,000	貸付有価証券 2,500株(500株)
マルシェ	3,800	814.00	3,093,200	貸付有価証券 1,700株
ドンキホーテホールディングス	93,900	5,410.00	507,999,000	
西松屋チェーン	31,800	1,297.00	41,244,600	貸付有価証券 2,300株
ゼンショーホールディングス	75,200	2,679.00	201,460,800	貸付有価証券 2,600株
幸楽苑ホールディングス	9,200	1,794.00	16,504,800	貸付有価証券 4,000株
ハークスレイ	3,500	1,137.00	3,979,500	
サイゼリヤ	23,900	2,534.00	60,562,600	貸付有価証券 300株
V Tホールディングス	49,100	492.00	24,157,200	貸付有価証券

				13,400株
魚力	4,000	1,433.00	5,732,000	
ポブラ	3,800	900.00	3,420,000	
フジ・コーポレーション	2,500	2,538.00	6,345,000	
ユニテッドアローズ	17,900	4,000.00	71,600,000	
ハイデイ日高	19,000	2,795.00	53,105,000	
京都きもの友禅	9,200	707.00	6,504,400	貸付有価証券 3,700株
コロワイド	48,100	3,020.00	145,262,000	貸付有価証券 700株
ピーシーデポコーポレーション	21,600	713.00	15,400,800	貸付有価証券 2,200株
壱番屋	10,200	4,515.00	46,053,000	
トップカルチャー	5,200	492.00	2,558,400	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
P L A N T	3,300	1,346.00	4,441,800	貸付有価証券 600株
スギホールディングス	31,800	6,550.00	208,290,000	
ヴィア・ホールディングス	17,400	694.00	12,075,600	貸付有価証券 5,900株
スクロール	22,300	561.00	12,510,300	
ヨンドシーホールディングス	14,700	2,733.00	40,175,100	貸付有価証券 100株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	46,300	10,870.00	503,281,000	貸付有価証券 21,300株（2,300株）
木曽路	17,800	2,870.00	51,086,000	
S R S ホールディングス	17,100	977.00	16,706,700	貸付有価証券 7,100株
千趣会	26,200	575.00	15,065,000	貸付有価証券 1,800株
タカキュー	11,200	218.00	2,441,600	貸付有価証券 300株
ケーヨー	26,800	566.00	15,168,800	貸付有価証券 9,800株（1,400株）
上新電機	17,100	4,430.00	75,753,000	
日本瓦斯	26,600	5,450.00	144,970,000	
ロイヤルホールディングス	25,700	2,837.00	72,910,900	貸付有価証券 200株
東天紅	1,100	1,923.00	2,115,300	貸付有価証券 400株

いなげや	16,200	1,765.00	28,593,000	
島忠	32,800	3,475.00	113,980,000	貸付有価証券 900株
チヨダ	17,100	2,655.00	45,400,500	貸付有価証券 200株
ライフコーポレーション	11,000	2,823.00	31,053,000	貸付有価証券 300株
リンガーハット	17,900	2,658.00	47,578,200	貸付有価証券 900株
さが美グループホールディングス	13,000	149.00	1,937,000	貸付有価証券 6,000株(3,000株)
MrMaxHD	18,100	711.00	12,869,100	貸付有価証券 200株
テンアライド	13,400	481.00	6,445,400	貸付有価証券 1,500株
AOKIホールディングス	29,000	1,670.00	48,430,000	
オークワ	21,000	1,165.00	24,465,000	
コメリ	22,400	2,914.00	65,273,600	
青山商事	27,800	4,205.00	116,899,000	
しまむら	16,900	12,410.00	209,729,000	
はせがわ	7,700	492.00	3,788,400	貸付有価証券 400株(400株)
高島屋	227,000	916.00	207,932,000	貸付有価証券 24,000株(13,000株)
松屋	29,200	1,382.00	40,354,400	貸付有価証券 12,200株(1,700株)
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,600	2,066.00	141,727,600	
近鉄百貨店	5,500	3,955.00	21,752,500	
パルコ	13,900	1,358.00	18,876,200	
丸井グループ	138,800	2,242.00	311,189,600	貸付有価証券 4,000株
アクシアル リテイリング	12,000	4,150.00	49,800,000	
井筒屋	7,900	355.00	2,804,500	
イオン	557,600	2,147.50	1,197,446,000	貸付有価証券 80,600株
イズミ	26,200	6,900.00	180,780,000	貸付有価証券 1,100株
東武ストア	1,700	3,065.00	5,210,500	

平和堂	29,400	2,600.00	76,440,000	
フジ	17,300	2,299.00	39,772,700	
ヤオコー	16,400	6,300.00	103,320,000	
ゼビオホールディングス	19,700	1,971.00	38,828,700	貸付有価証券 500株(500株)
ケーズホールディングス	127,100	1,371.00	174,254,100	
Olympicグループ	8,500	563.00	4,785,500	
日産東京販売ホールディングス	21,300	400.00	8,520,000	
Genky Drug Stores	5,700	4,320.00	24,624,000	貸付有価証券 2,400株
アインホールディングス	19,400	7,230.00	140,262,000	貸付有価証券 7,900株(7,000株)
元気寿司	3,700	2,961.00	10,955,700	
ヤマダ電機	485,600	567.00	275,335,200	貸付有価証券 205,300株(50,700株)
アークランドサカモト	24,600	1,738.00	42,754,800	
ニトリホールディングス	57,500	18,300.00	1,052,250,000	
グルメ杵屋	10,000	1,182.00	11,820,000	
愛眼	11,600	498.00	5,776,800	貸付有価証券 5,300株(3,700株)
ケーユーホールディングス	7,600	1,127.00	8,565,200	
吉野家ホールディングス	47,600	2,014.00	95,866,400	貸付有価証券 100株
松屋フーズ	7,000	3,750.00	26,250,000	貸付有価証券 200株
サガミチェーン	19,400	1,423.00	27,606,200	
関西スーパーマーケット	10,900	1,142.00	12,447,800	貸付有価証券 1,500株(1,300株)
王将フードサービス	10,600	5,540.00	58,724,000	
プレナス	16,200	1,899.00	30,763,800	貸付有価証券 7,300株
ミニストップ	10,700	2,230.00	23,861,000	貸付有価証券 800株
アークス	27,200	2,989.00	81,300,800	
バローホールディングス	33,700	2,779.00	93,652,300	
藤久	1,200	1,536.00	1,843,200	
ベルク	6,400	5,780.00	36,992,000	

大庄	7,700	1,732.00	13,336,400	貸付有価証券 100株
ファーストリテイリング	19,400	48,650.00	943,810,000	貸付有価証券 900株
サンドラッグ	61,400	5,510.00	338,314,000	
サックスパーホールディングス	13,600	1,168.00	15,884,800	貸付有価証券 2,800株
ヤマザワ	3,000	1,798.00	5,394,000	
やまや	3,000	3,930.00	11,790,000	貸付有価証券 900株
ペルーナ	35,500	1,264.00	44,872,000	
島根銀行	3,100	1,325.00	4,107,500	
じもとホールディングス	98,000	191.00	18,718,000	
めぶきフィナンシャルグループ	754,000	427.00	321,958,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,600	2,924.00	57,310,400	
九州フィナンシャルグループ	238,100	556.00	132,383,600	貸付有価証券 59,500株
ゆうちょ銀行	411,100	1,512.00	621,583,200	貸付有価証券 15,800株
富山第一銀行	36,900	499.00	18,413,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	866,500	626.00	542,429,000	貸付有価証券 25,200株
西日本フィナンシャルホールディングス	93,000	1,322.00	122,946,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	63,500	867.00	55,054,500	貸付有価証券 1,100株
三十三フィナンシャルグループ	12,200	2,267.00	27,657,400	
新生銀行	125,600	1,742.00	218,795,200	貸付有価証券 33,200株
あおぞら銀行	86,500	4,410.00	381,465,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,158,900	719.00	7,304,249,100	
りそなホールディングス	1,592,400	619.00	985,695,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	285,300	4,681.00	1,335,489,300	
三井住友フィナンシャルグループ	1,098,400	4,492.00	4,934,012,800	
第四銀行	17,800	4,905.00	87,309,000	

北越銀行	14,600	2,424.00	35,390,400	
千葉銀行	514,000	854.00	438,956,000	貸付有価証券 6,400株
群馬銀行	294,700	655.00	193,028,500	貸付有価証券 1,300株
武蔵野銀行	23,200	3,620.00	83,984,000	
千葉興業銀行	39,800	504.00	20,059,200	
筑波銀行	60,300	390.00	23,517,000	
七十七銀行	45,500	2,729.00	124,169,500	貸付有価証券 200株
青森銀行	11,200	3,380.00	37,856,000	貸付有価証券 900株(500株)
秋田銀行	9,300	3,055.00	28,411,500	
山形銀行	16,300	2,452.00	39,967,600	貸付有価証券 7,000株(2,100株)
岩手銀行	10,100	4,315.00	43,581,500	
東邦銀行	129,800	417.00	54,126,600	貸付有価証券 2,100株(1,200株)
東北銀行	7,400	1,497.00	11,077,800	
みちのく銀行	9,300	1,769.00	16,451,700	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
ふくおかフィナンシャル グループ	589,000	587.00	345,743,000	貸付有価証券 5,000株
静岡銀行	383,100	1,127.00	431,753,700	貸付有価証券 4,000株
十六銀行	19,500	2,844.00	55,458,000	貸付有価証券 200株
スルガ銀行	148,500	1,596.00	237,006,000	貸付有価証券 26,700株
八十二銀行	262,600	547.00	143,642,200	貸付有価証券 14,100株
山梨中央銀行	90,000	486.00	43,740,000	
大垣共立銀行	22,900	2,822.00	64,623,800	
福井銀行	12,400	2,516.00	31,198,400	貸付有価証券 500株
北國銀行	16,400	4,405.00	72,242,000	
清水銀行	4,900	3,220.00	15,778,000	
富山銀行	2,800	4,270.00	11,956,000	
滋賀銀行	136,000	555.00	75,480,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)

南都銀行	17,000	2,947.00	50,099,000	
百五銀行	139,300	504.00	70,207,200	
京都銀行	55,400	6,470.00	358,438,000	貸付有価証券 7,500株
紀陽銀行	54,600	1,794.00	97,952,400	
ほくほくフィナンシャル グループ	96,600	1,647.00	159,100,200	貸付有価証券 700株（300株）
広島銀行	214,200	846.00	181,213,200	
山陰合同銀行	86,000	1,056.00	90,816,000	貸付有価証券 1,300株
中国銀行	100,300	1,297.00	130,089,100	
鳥取銀行	4,600	1,741.00	8,008,600	
伊予銀行	207,100	862.00	178,520,200	貸付有価証券 2,500株
百十四銀行	154,000	363.00	55,902,000	
四国銀行	22,300	1,536.00	34,252,800	
阿波銀行	116,000	716.00	83,056,000	貸付有価証券 2,000株
大分銀行	8,300	4,055.00	33,656,500	貸付有価証券 3,700株
宮崎銀行	9,700	3,580.00	34,726,000	
佐賀銀行	8,800	2,518.00	22,158,400	貸付有価証券 100株
十八銀行	89,000	300.00	26,700,000	
沖縄銀行	14,100	4,545.00	64,084,500	
琉球銀行	28,100	1,686.00	47,376,600	
セブン銀行	544,300	370.00	201,391,000	貸付有価証券 251,100株
みずほフィナンシャルグ ループ	19,715,900	198.10	3,905,719,790	
高知銀行	5,300	1,316.00	6,974,800	
山口フィナンシャルグ ループ	181,000	1,405.00	254,305,000	貸付有価証券 68,000株
長野銀行	4,800	1,845.00	8,856,000	貸付有価証券 2,100株（300株）
名古屋銀行	11,700	4,105.00	48,028,500	貸付有価証券 5,400株（900株）
北洋銀行	218,700	375.00	82,012,500	貸付有価証券 700株
愛知銀行	4,900	5,240.00	25,676,000	

中京銀行	6,000	2,322.00	13,932,000	
大光銀行	5,000	2,395.00	11,975,000	
愛媛銀行	20,300	1,287.00	26,126,100	貸付有価証券 7,200株(300株)
トマト銀行	5,600	1,533.00	8,584,800	
京葉銀行	128,000	506.00	64,768,000	
栃木銀行	75,100	412.00	30,941,200	貸付有価証券 800株
北日本銀行	4,500	2,927.00	13,171,500	
東和銀行	25,500	1,366.00	34,833,000	
福島銀行	13,700	809.00	11,083,300	貸付有価証券 4,400株
大東銀行	7,000	1,345.00	9,415,000	
トモニホールディングス	119,700	496.00	59,371,200	貸付有価証券 6,300株(1,900株)
フィデアホールディングス	140,900	193.00	27,193,700	
池田泉州ホールディングス	154,000	432.00	66,528,000	
F P G	46,400	1,446.00	67,094,400	貸付有価証券 1,000株
マーキュリアインベストメント	4,000	1,069.00	4,276,000	貸付有価証券 1,300株
S B Iホールディングス	164,100	2,908.00	477,202,800	貸付有価証券 65,400株(52,800株)
日本アジア投資	13,100	370.00	4,847,000	貸付有価証券 4,100株
ジャフコ	20,800	4,730.00	98,384,000	
大和証券グループ本社	1,242,000	654.50	812,889,000	
野村ホールディングス	2,496,500	610.00	1,522,865,000	
岡三証券グループ	124,000	588.00	72,912,000	
丸三証券	46,200	1,016.00	46,939,200	貸付有価証券 20,900株
東洋証券	52,000	284.00	14,768,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	160,700	744.00	119,560,800	
光世証券	3,500	1,409.00	4,931,500	貸付有価証券 1,500株
水戸証券	42,000	408.00	17,136,000	貸付有価証券 6,400株

いちよし証券	30,400	1,288.00	39,155,200	
松井証券	71,100	1,016.00	72,237,600	
だいこう証券ビジネス	7,000	592.00	4,144,000	
マネックスグループ	147,800	693.00	102,425,400	貸付有価証券 68,200株(31,800株)
カブドットコム証券	92,800	403.00	37,398,400	
極東証券	19,500	1,521.00	29,659,500	貸付有価証券 800株
岩井コスモホールディングス	14,900	1,534.00	22,856,600	
藍澤証券	27,100	799.00	21,652,900	
マネーパートナーズグループ	18,500	449.00	8,306,500	貸付有価証券 8,400株
小林洋行	4,100	296.00	1,213,600	貸付有価証券 300株
かんぼ生命保険	54,800	2,607.00	142,863,600	貸付有価証券 100株
SOMPOホールディングス	284,600	4,690.00	1,334,774,000	貸付有価証券 5,300株
アニコムホールディングス	9,900	3,570.00	35,343,000	貸付有価証券 4,500株
MS&ADインシュアランスグループホール	379,400	3,699.00	1,403,400,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	119,200	2,069.00	246,624,800	貸付有価証券 5,000株
第一生命ホールディングス	820,900	2,133.00	1,750,979,700	
東京海上ホールディングス	546,700	5,249.00	2,869,628,300	貸付有価証券 1,400株
アドバンテッジリスクマネジメント	4,700	1,393.00	6,547,100	貸付有価証券 1,500株
T&Dホールディングス	448,800	1,809.50	812,103,600	貸付有価証券 6,400株
アドバンスクリエイト	3,400	2,045.00	6,953,000	貸付有価証券 100株
全国保証	40,900	5,060.00	206,954,000	貸付有価証券 200株(200株)
ジェイリース	2,700	736.00	1,987,200	
イントラスト	3,000	703.00	2,109,000	
アルヒ	16,500	1,501.00	24,766,500	
クレディセゾン	110,100	1,924.00	211,832,400	貸付有価証券

				700株
アクリーティブ	7,900	336.00	2,654,400	貸付有価証券 1,300株(200株)
芙蓉総合リース	16,600	8,070.00	133,962,000	
興銀リース	27,300	3,100.00	84,630,000	
東京センチュリー	29,200	7,330.00	214,036,000	貸付有価証券 1,500株
日本証券金融	59,400	682.00	40,510,800	貸付有価証券 100株
アイフル	243,500	395.00	96,182,500	貸付有価証券 112,300株
リコーリース	11,400	3,770.00	42,978,000	貸付有価証券 2,400株
イオンフィナンシャル サービス	103,000	2,710.00	279,130,000	貸付有価証券 400株
アコム	291,700	499.00	145,558,300	貸付有価証券 134,100株
ジャックス	17,600	2,473.00	43,524,800	
オリентコーポレー ション	314,000	170.00	53,380,000	貸付有価証券 142,200株(200株)
日立キャピタル	39,900	2,955.00	117,904,500	
アプラスフィナンシャル	69,600	118.00	8,212,800	貸付有価証券 32,100株
オリックス	968,000	1,950.50	1,888,084,000	
三菱UFJリース	368,300	751.00	276,593,300	貸付有価証券 6,700株
九州リースサービス	6,200	791.00	4,904,200	
日本取引所グループ	416,500	2,064.00	859,656,000	
イー・ギャランティ	7,700	2,355.00	18,133,500	
アサックス	2,000	1,857.00	3,714,000	
NECキャピタルソ リューション	5,900	2,050.00	12,095,000	
いちご	207,400	488.00	101,211,200	貸付有価証券 30,900株
日本駐車場開発	175,100	183.00	32,043,300	貸付有価証券 200株
ヒューリック	302,900	1,193.00	361,359,700	
三栄建築設計	5,800	1,912.00	11,089,600	貸付有価証券 800株
スター・マイカ	7,000	2,589.00	18,123,000	貸付有価証券 2,300株(100株)

野村不動産ホールディングス	96,600	2,766.00	267,195,600	貸付有価証券 700株
三重交通グループホールディングス	29,400	542.00	15,934,800	貸付有価証券 1,700株（500株）
サムティ	12,400	2,086.00	25,866,400	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
ディア・ライフ	16,200	596.00	9,655,200	貸付有価証券 400株
コーセーアールイー	3,200	977.00	3,126,400	貸付有価証券 800株
エー・ディー・ワークス	192,400	41.00	7,888,400	貸付有価証券 88,700株
日本商業開発	8,200	1,829.00	14,997,800	貸付有価証券 3,700株（500株）
プレサンスコーポレーション	19,900	1,692.00	33,670,800	
ユニゾホールディングス	16,900	2,215.00	37,433,500	貸付有価証券 100株
THEグローバル社	6,800	842.00	5,725,600	貸付有価証券 3,100株（100株）
日本管理センター	9,600	1,607.00	15,427,200	貸付有価証券 1,300株
サンセイランディック	4,200	1,344.00	5,644,800	貸付有価証券 100株
エストラスト	2,000	1,014.00	2,028,000	貸付有価証券 100株
フージャースホールディングス	35,200	789.00	27,772,800	貸付有価証券 1,300株
オープンハウス	23,600	6,030.00	142,308,000	
東急不動産ホールディングス	351,300	849.00	298,253,700	
飯田グループホールディングス	121,000	2,089.00	252,769,000	貸付有価証券 55,800株
イーランド	2,300	1,218.00	2,801,400	貸付有価証券 100株
ムゲンエステート	8,900	1,196.00	10,644,400	
ビーロット	2,200	2,153.00	4,736,600	
ファーストブラザーズ	4,000	1,396.00	5,584,000	
ハウズドゥ	2,300	5,620.00	12,926,000	貸付有価証券 400株（100株）
シーアールイー	2,400	1,799.00	4,317,600	

ケイアイスター不動産	5,200	2,862.00	14,882,400	
パーク24	81,000	3,100.00	251,100,000	貸付有価証券 6,000株
パラカ	3,700	2,425.00	8,972,500	
三井不動産	724,600	2,789.50	2,021,271,700	貸付有価証券 8,100株
三菱地所	1,080,100	2,005.50	2,166,140,550	貸付有価証券 2,500株
平和不動産	25,600	2,327.00	59,571,200	
東京建物	158,600	1,601.00	253,918,600	
ダイビル	37,400	1,203.00	44,992,200	
京阪神ビルディング	24,000	914.00	21,936,000	
住友不動産	348,000	4,402.00	1,531,896,000	
大京	23,100	2,488.00	57,472,800	貸付有価証券 2,600株
テーオーシー	50,000	981.00	49,050,000	貸付有価証券 800株
東京楽天地	2,400	5,640.00	13,536,000	
レオパレス21	173,100	980.00	169,638,000	
スターツコーポレーション	19,700	3,075.00	60,577,500	貸付有価証券 1,900株
フジ住宅	18,500	948.00	17,538,000	
空港施設	14,500	651.00	9,439,500	
明和地所	8,000	767.00	6,136,000	
ゴールドクレスト	11,400	2,119.00	24,156,600	
日本エスリード	5,700	2,055.00	11,713,500	
日神不動産	19,300	848.00	16,366,400	
日本エスコン	26,200	813.00	21,300,600	貸付有価証券 2,000株
タカラレーベン	68,000	460.00	31,280,000	貸付有価証券 8,300株
サンヨーハウジング名古屋	8,200	1,223.00	10,028,600	
イオンモール	93,500	2,160.00	201,960,000	貸付有価証券 5,600株
ファースト住建	5,400	1,612.00	8,704,800	貸付有価証券 200株
カチタス	19,800	3,675.00	72,765,000	貸付有価証券 6,800株
トーセイ	17,700	1,348.00	23,859,600	

穴吹興産	1,600	3,270.00	5,232,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	90,200	1,226.00	110,585,200	
サンフロンティア不動産	17,500	1,447.00	25,322,500	貸付有価証券 4,500株
エフ・ジェー・ネクスト	11,100	985.00	10,933,500	貸付有価証券 100株(100株)
インテリックス	4,100	1,105.00	4,530,500	
ランドビジネス	7,300	341.00	2,489,300	貸付有価証券 2,300株
グランディハウス	12,700	512.00	6,502,400	
日本空港ビルデング	42,400	4,615.00	195,676,000	
日本工営	9,400	3,235.00	30,409,000	貸付有価証券 100株
L I F U L L	48,800	799.00	38,991,200	
ジェイエイシーリクルートメント	11,300	2,273.00	25,684,900	貸付有価証券 3,300株
日本M&Aセンター	97,300	3,280.00	319,144,000	
メンバーズ	4,600	1,147.00	5,276,200	貸付有価証券 100株
中広	1,400	746.00	1,044,400	
タケエイ	14,600	1,331.00	19,432,600	貸付有価証券 200株
トラスト・テック	6,600	3,805.00	25,113,000	貸付有価証券 1,300株
コシダカホールディングス	9,400	6,890.00	64,766,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
パソナグループ	13,300	1,760.00	23,408,000	貸付有価証券 6,200株(1,600株)
C D S	3,800	1,480.00	5,624,000	貸付有価証券 200株
リンクアンドモチベーション	25,800	1,153.00	29,747,400	貸付有価証券 11,900株(200株)
G C A	16,000	993.00	15,888,000	貸付有価証券 2,200株(1,300株)
エス・エム・エス	27,800	3,805.00	105,779,000	貸付有価証券 5,800株
パーソルホールディングス	129,700	2,602.00	337,479,400	
リニカル	9,000	1,768.00	15,912,000	貸付有価証券 1,900株

クックパッド	44,200	631.00	27,890,200	貸付有価証券 20,300株(1,000株)
エスクリ	4,900	912.00	4,468,800	
アイ・ケイ・ケイ	8,200	801.00	6,568,200	貸付有価証券 2,500株
学情	6,400	1,354.00	8,665,600	貸付有価証券 1,600株
スタジオアリス	7,100	2,460.00	17,466,000	
シミックホールディングス	7,800	2,381.00	18,571,800	貸付有価証券 400株
N J S	3,400	1,710.00	5,814,000	
総合警備保障	55,900	5,530.00	309,127,000	貸付有価証券 500株
カカコム	105,800	2,255.00	238,579,000	
セントケア・ホールディング	6,000	796.00	4,776,000	貸付有価証券 2,400株
サイネックス	2,100	868.00	1,822,800	貸付有価証券 100株
ルネサンス	6,800	1,917.00	13,035,600	
ディップ	19,800	2,617.00	51,816,600	貸付有価証券 300株
オプトホールディング	9,800	1,691.00	16,571,800	貸付有価証券 4,500株
新日本科学	17,100	550.00	9,405,000	貸付有価証券 7,700株
ツクイ	33,100	849.00	28,101,900	
キャリアデザインセンター	3,500	2,178.00	7,623,000	
エムスリー	148,000	4,270.00	631,960,000	貸付有価証券 1,100株
ツカダ・グローバルホールディング	11,200	651.00	7,291,200	貸付有価証券 1,100株
プラス	1,000	906.00	906,000	
アウトソーシング	41,900	2,034.00	85,224,600	貸付有価証券 14,800株
ウェルネット	14,200	1,283.00	18,218,600	貸付有価証券 6,500株(1,300株)
ワールドホールディングス	4,600	3,620.00	16,652,000	貸付有価証券 500株(500株)
ディー・エヌ・エー	75,800	2,178.00	165,092,400	貸付有価証券 5,400株

博報堂D Yホールディングス	195,300	1,541.00	300,957,300	
ぐるなび	22,200	1,167.00	25,907,400	貸付有価証券 10,200株
エスアールジータカミヤ	16,600	664.00	11,022,400	貸付有価証券 700株（500株）
ジャパンベストレスキューシステム	11,100	836.00	9,279,600	貸付有価証券 5,100株
ファンコミュニケーションズ	39,100	716.00	27,995,600	貸付有価証券 700株
ライク	5,500	2,109.00	11,599,500	貸付有価証券 2,500株
ビジネス・ブレイクスルー	6,500	484.00	3,146,000	貸付有価証券 1,100株
W D Bホールディングス	6,400	3,605.00	23,072,000	貸付有価証券 200株
ティア	6,500	1,069.00	6,948,500	貸付有価証券 500株（500株）
C D G	1,300	1,939.00	2,520,700	貸付有価証券 400株
パリュウコマース	12,600	1,641.00	20,676,600	貸付有価証券 500株
インフォマート	71,100	1,053.00	74,868,300	貸付有価証券 9,100株
J Pホールディングス	44,100	361.00	15,920,100	貸付有価証券 7,700株
E P Sホールディングス	21,200	2,043.00	43,311,600	
レッグス	3,500	1,013.00	3,545,500	
プレステージ・インターナショナル	29,200	1,269.00	37,054,800	貸付有価証券 1,300株
アミューズ	9,400	3,135.00	29,469,000	貸付有価証券 100株
ドリームインキュベータ	4,700	2,559.00	12,027,300	
クイック	8,700	1,714.00	14,911,800	
T A C	8,500	310.00	2,635,000	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
ケネディクス	186,200	658.00	122,519,600	
電通	171,300	5,170.00	885,621,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,600	1,186.00	7,827,600	貸付有価証券 3,000株
ぴあ	4,700	6,130.00	28,811,000	貸付有価証券

				1,000株
イオンファンタジー	4,500	6,350.00	28,575,000	貸付有価証券 800株(800株)
シーティーエス	13,900	845.00	11,745,500	貸付有価証券 200株
ネクシィーズグループ	4,300	1,655.00	7,116,500	貸付有価証券 400株
みらかホールディングス	41,900	4,180.00	175,142,000	
アルプス技研	12,300	2,300.00	28,290,000	貸付有価証券 2,200株
ダイオーズ	2,800	1,400.00	3,920,000	
日本空調サービス	14,700	819.00	12,039,300	
オリエンタルランド	166,100	11,225.00	1,864,472,500	貸付有価証券 1,400株(1,300株)
ダスキン	37,800	2,840.00	107,352,000	貸付有価証券 300株
明光ネットワークジャパン	17,800	1,238.00	22,036,400	
ファルコホールディングス	7,200	1,851.00	13,327,200	
秀英予備校	3,100	490.00	1,519,000	貸付有価証券 200株
田谷	2,600	669.00	1,739,400	
ラウンドワン	43,600	1,955.00	85,238,000	
リゾートトラスト	59,500	2,308.00	137,326,000	
ピー・エム・エル	18,100	2,726.00	49,340,600	
ワタベウェディング	2,300	577.00	1,327,100	
りらいあコミュニケーションズ	22,200	1,398.00	31,035,600	
リソー教育	23,800	838.00	19,944,400	貸付有価証券 8,500株
早稲田アカデミー	2,000	1,992.00	3,984,000	
ユー・エス・エス	171,700	2,329.00	399,889,300	
東京個別指導学院	5,000	1,254.00	6,270,000	貸付有価証券 2,200株
サイバーエージェント	86,600	5,870.00	508,342,000	貸付有価証券 2,400株
楽天	720,800	813.90	586,659,120	貸付有価証券 94,500株
クリーク・アンド・リバー社	7,200	1,170.00	8,424,000	貸付有価証券 3,300株

テー・オー・ダブリュー	13,400	919.00	12,314,600	
セントラルスポーツ	5,200	3,915.00	20,358,000	
フルキャストホールディングス	12,300	2,431.00	29,901,300	貸付有価証券 3,500株
リソルホールディングス	1,500	4,455.00	6,682,500	
テクノプロ・ホールディングス	26,500	6,720.00	178,080,000	貸付有価証券 1,000株
アトラ	2,400	1,050.00	2,520,000	
インターワークス	3,100	1,067.00	3,307,700	
Keepers 技研	4,500	1,435.00	6,457,500	
ファーストロジック	2,700	873.00	2,357,100	貸付有価証券 1,000株（600株）
三機サービス	2,100	1,790.00	3,759,000	貸付有価証券 700株
Gunosy	8,400	1,689.00	14,187,600	貸付有価証券 2,900株（100株）
デザインワン・ジャパン	2,800	1,418.00	3,970,400	貸付有価証券 1,100株
イー・ガーディアン	6,700	3,185.00	21,339,500	貸付有価証券 3,000株（2,300株）
リブセンス	9,000	490.00	4,410,000	貸付有価証券 2,700株（2,400株）
ジャパンマテリアル	38,400	1,516.00	58,214,400	貸付有価証券 17,600株（600株）
ベクトル	16,900	2,138.00	36,132,200	貸付有価証券 7,700株（1,700株）
ウチヤマホールディングス	6,900	649.00	4,478,100	
ライクキッズネクスト	2,900	1,030.00	2,987,000	貸付有価証券 600株
キャリアリンク	4,600	581.00	2,672,600	貸付有価証券 1,500株
I B J	11,300	994.00	11,232,200	貸付有価証券 5,200株（600株）
アサンテ	5,100	2,026.00	10,332,600	
N・フィールド	7,800	1,774.00	13,837,200	貸付有価証券 2,500株
バリューHR	3,200	1,965.00	6,288,000	貸付有価証券 1,200株
M&Aキャピタルパートナーズ	3,600	8,970.00	32,292,000	貸付有価証券 1,500株

ライドオンエクスプレス ホールディングス	5,800	1,063.00	6,165,400	貸付有価証券 1,700株
E R Iホールディングス	3,900	1,092.00	4,258,800	貸付有価証券 900株
アピスト	2,200	5,180.00	11,396,000	貸付有価証券 600株(600株)
シグマクシス	7,500	1,712.00	12,840,000	貸付有価証券 1,200株
ウィルグループ	6,100	1,382.00	8,430,200	貸付有価証券 2,800株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	19,300	450.00	8,685,000	貸付有価証券 8,800株(100株)
日本ビューホテル	4,400	1,506.00	6,626,400	貸付有価証券 2,000株
リクルートホールディン グス	1,084,600	2,771.00	3,005,426,600	貸付有価証券 300株
エラン	3,400	1,934.00	6,575,600	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
土木管理総合試験所	4,600	592.00	2,723,200	貸付有価証券 1,800株
日本郵政	797,700	1,316.00	1,049,773,200	
ベルシステム24ホール ディングス	23,500	1,697.00	39,879,500	
鎌倉新書	2,500	3,825.00	9,562,500	貸付有価証券 1,100株
一蔵	1,800	1,027.00	1,848,600	
L I T A L I C O	3,200	1,627.00	5,206,400	貸付有価証券 1,100株(400株)
グローバルグループ	1,600	1,260.00	2,016,000	貸付有価証券 600株
エポラブルアジア	4,000	2,023.00	8,092,000	貸付有価証券 1,800株(600株)
ストライク	1,800	6,870.00	12,366,000	貸付有価証券 600株(400株)
ソラスト	8,500	3,010.00	25,585,000	貸付有価証券 100株
セラク	3,100	820.00	2,542,000	貸付有価証券 1,200株
インソース	4,600	2,211.00	10,170,600	貸付有価証券 700株
キャリアインデックス	1,900	2,340.00	4,446,000	貸付有価証券 100株

MS - J a p a n	1,400	7,350.00	10,290,000	
船場	2,700	1,302.00	3,515,400	
フルテック	1,500	1,249.00	1,873,500	
グリーンズ	3,000	1,673.00	5,019,000	
日総工産	2,300	4,650.00	10,695,000	
キュービーネットホールディングス	7,000	1,952.00	13,664,000	
リログループ	76,900	2,552.00	196,248,800	
東祥	8,800	4,100.00	36,080,000	貸付有価証券 700株(700株)
エイチ・アイ・エス	21,900	3,720.00	81,468,000	貸付有価証券 3,000株(2,300株)
ラックランド	2,700	2,585.00	6,979,500	
共立メンテナンス	25,100	5,230.00	131,273,000	貸付有価証券 400株(400株)
イチネンホールディングス	15,700	1,458.00	22,890,600	
建設技術研究所	9,700	1,471.00	14,268,700	
スペース	9,100	1,489.00	13,549,900	
長大	5,600	778.00	4,356,800	貸付有価証券 1,800株(200株)
燦ホールディングス	3,300	2,834.00	9,352,200	
スバル興業	1,000	7,020.00	7,020,000	
東京テアトル	5,900	1,464.00	8,637,600	
タナベ経営	2,700	2,108.00	5,691,600	
ナガワ	2,800	4,570.00	12,796,000	
よみうりランド	3,100	5,000.00	15,500,000	
東京都競馬	10,500	4,725.00	49,612,500	
常磐興産	5,600	1,893.00	10,600,800	貸付有価証券 2,000株
カナモト	21,400	3,695.00	79,073,000	
東京ドーム	56,900	1,074.00	61,110,600	貸付有価証券 700株(300株)
西尾レントオール	14,300	3,425.00	48,977,500	貸付有価証券 800株(800株)
トランス・コスモス	15,600	2,490.00	38,844,000	
乃村工藝社	32,900	2,203.00	72,478,700	貸付有価証券 5,600株
藤田観光	5,600	3,220.00	18,032,000	貸付有価証券

				2,500株
KNT - CTホールディングス	8,700	1,747.00	15,198,900	
日本管財	15,000	2,146.00	32,190,000	
トーカイ	13,600	2,452.00	33,347,200	
白洋舎	1,600	3,275.00	5,240,000	
セコム	149,200	8,417.00	1,255,816,400	貸付有価証券 200株
セントラル警備保障	6,800	3,915.00	26,622,000	
丹青社	28,800	1,302.00	37,497,600	
メイテック	16,400	5,540.00	90,856,000	
応用地質	15,100	1,567.00	23,661,700	
船井総研ホールディングス	29,200	2,640.00	77,088,000	貸付有価証券 500株
進学会ホールディングス	6,400	628.00	4,019,200	
オオバ	11,000	660.00	7,260,000	貸付有価証券 5,000株
いであ	2,800	1,161.00	3,250,800	
学究社	5,100	1,806.00	9,210,600	貸付有価証券 100株
ベネッセホールディングス	51,500	4,140.00	213,210,000	
イオンディライト	17,300	3,870.00	66,951,000	貸付有価証券 1,700株
ナック	9,400	929.00	8,732,600	貸付有価証券 200株
ニチイ学館	26,700	1,205.00	32,173,500	貸付有価証券 800株
ダイセキ	23,600	3,460.00	81,656,000	貸付有価証券 1,000株
ステップ	5,100	1,722.00	8,782,200	
小計	銘柄数：2,072		373,917,977,030	
	組入時価比率：98.4%		100.0%	
合計			373,917,977,030	

(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(2018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	2018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				
株価指数先物取引				
買建	5,923,697,948	-	5,940,190,000	16,329,728
合計	5,923,697,948	-	5,940,190,000	16,329,728

（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）

(2018年 5月10日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	4,686,187,291
コール・ローン	989,570,652
株式	466,657,145,037
投資信託受益証券	19,309,525
投資証券	11,323,287,145
派生商品評価勘定	246,677,896
未収入金	20,033,061
未収配当金	591,347,859
差入委託証拠金	1,559,052,105
流動資産合計	486,092,610,571
資産合計	
486,092,610,571	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,204
未払金	43,868,801
未払解約金	390,703,792
未払利息	1,397
その他未払費用	5,249,600
流動負債合計	439,831,794
負債合計	
439,831,794	

純資産の部	
元本等	
元本	185,000,858,707
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	300,651,920,070
元本等合計	485,652,778,777
純資産合計	485,652,778,777
負債純資産合計	486,092,610,571

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>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)

2018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	2.6251円
(10,000口当たり純資産額)	(26,251円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 5月11日 至 2018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、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <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

2018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

2018年 5月10日現在	
期首	2017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	158,337,887,741円
同期中における追加設定元本額	50,177,100,750円
同期中における一部解約元本額	23,514,129,784円
期末元本額	185,000,858,707円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	53,304,237円
バランスセレクト50	163,529,944円
バランスセレクト70	171,121,394円
野村外国株式インデックスファンド	546,913,763円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,688,029,090円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,811,493,924円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,542,206,274円
野村資産設計ファンド2015	21,333,694円
野村資産設計ファンド2020	25,471,927円
野村資産設計ファンド2025	36,995,501円
野村資産設計ファンド2030	39,203,658円
野村資産設計ファンド2035	29,903,670円
野村資産設計ファンド2040	74,618,032円
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	32,428,784,845円
のむラップ・ファンド(保守型)	1,026,870,115円
のむラップ・ファンド(普通型)	6,115,505,974円
のむラップ・ファンド(積極型)	4,473,244,329円
野村資産設計ファンド2045	9,784,752円
野村インデックスファンド・外国株式	3,655,187,741円
マイ・ロード	1,513,128,779円
ネクストコア	74,298,440円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	96,395,149円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	894,029,504円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	847,762,993円
野村資産設計ファンド2050	14,832,387円

野村ターゲットデートファンド2016	2026 - 2028年目標型	5,072,187円
野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	1,570,375円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	1,074,089円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	623,520円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)		165,703,206円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)		233,158,574円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,712,217円
インデックス・ブレンド(タイプ)		3,942,777円
インデックス・ブレンド(タイプ)		11,743,662円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,488,668円
インデックス・ブレンド(タイプ)		12,457,934円
野村6資産均等バランス		44,975,216円
野村つみたて外国株投信		624,949,571円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)		2,117,518,497円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI - KOKUSA I 指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信		210,271,053円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式		297,522,197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)		336,300,923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)		304,839,009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)		2,278,486,419円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)		2,698,378,464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)		2,527,347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)		12,812,429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)		3,883,287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)		26,786,657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)		300,646,110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)		406,248,464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)		149,071,101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)		51,729,738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)		195,357,267円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)		3,692,766,422円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)		433,248,603円
野村MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)		67,449,626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)		608,840,453円
野村FOFs用・外国株式MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)		7,920,599,863円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)		2,329,636円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)		13,078,441円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)		15,031,678円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I(確定拠出年金向け)		60,604,256,974円
マイバランス30(確定拠出年金向け)		1,380,299,254円
マイバランス50(確定拠出年金向け)		5,696,022,776円
マイバランス70(確定拠出年金向け)		6,472,344,115円
マイバランスDC30		910,615,648円
マイバランスDC50		1,640,999,130円
マイバランスDC70		1,320,514,615円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I		16,706,974,430円

野村DC運用戦略ファンド	468,680,130円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	14,522,071円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	132,686,664円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	12,425,161円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	23,844,614円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,171,276円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,093,881円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	2,308,961円
野村資産設計ファンド(DC)2030	160,408円
野村資産設計ファンド(DC)2040	238,732円
野村資産設計ファンド(DC)2050	473,246円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	670,477円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	703,023円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	205,189円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	502,136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(2018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	APERGY CORP	9,050	40.91	370,235.50	
		BAKER HUGHES, A GE CO, LLC	47,300	36.37	1,720,301.00	
		HALLIBURTON CO	102,300	52.70	5,391,210.00	
		HELMERICH & PAYNE	12,800	68.12	871,936.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	44,200	40.37	1,784,354.00	
		SCHLUMBERGER LTD	164,000	70.88	11,624,320.00	
		TECHNIPFMC PLC	51,600	33.51	1,729,116.00	
		ANADARKO PETE	65,200	67.44	4,397,088.00	
		ANDEAVOR	17,700	140.28	2,482,956.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	27,000	18.97	512,190.00	
		APACHE CORPORATION	43,900	41.25	1,810,875.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	53,300	23.10	1,231,230.00	
		CHENIERE ENERGY INC	24,300	62.40	1,516,320.00	
		CHEVRON CORP	224,300	128.72	28,871,896.00	
		CIMAREX ENERGY CO	10,600	97.73	1,035,938.00	

CONCHO RESOURCES INC	17,200	159.47	2,742,884.00
CONOCOPHILLIPS	141,700	68.70	9,734,790.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	11,400	68.06	775,884.00
DEVON ENERGY CORP	57,300	40.22	2,304,606.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	10,400	136.52	1,419,808.00
EOG RESOURCES INC	67,600	117.79	7,962,604.00
EQT CORP	30,700	51.24	1,573,068.00
EXXON MOBIL CORP	500,100	79.93	39,972,993.00
HESS CORP	34,600	62.35	2,157,310.00
HOLLYFRONTIER CORP	19,700	67.97	1,339,009.00
KINDER MORGAN INC	233,000	16.45	3,832,850.00
MARATHON OIL CORP	99,000	21.26	2,104,740.00
MARATHON PETROLEUM CORP	58,200	77.11	4,487,802.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	22,900	28.19	645,551.00
NOBLE ENERGY INC	55,900	34.90	1,950,910.00
OCCIDENTAL PETE CORP	89,600	82.40	7,383,040.00
ONEOK INC	45,900	64.71	2,970,189.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	26,100	32.49	847,989.00
PHILLIPS 66	51,700	117.50	6,074,750.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,800	201.52	3,990,096.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	24.86	472,340.00
RANGE RESOURCES CORP	31,000	14.79	458,490.00
TARGA RESOURCES CORP	24,900	47.59	1,184,991.00
VALERO ENERGY CORP	52,000	114.82	5,970,640.00
WILLIAMS COS	97,600	26.52	2,588,352.00
AIR PRODUCTS	26,000	164.89	4,287,140.00
ALBEMARLE CORP	13,500	101.75	1,373,625.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	24,900	32.08	798,792.00
CELANESE CORP-SERIES A	15,500	109.19	1,692,445.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	26,400	38.75	1,023,000.00
CHEMOURS CO/THE	20,600	50.67	1,043,802.00
DOWDUPONT INC	276,500	66.03	18,257,295.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	17,100	107.45	1,837,395.00
ECOLAB INC	30,300	146.98	4,453,494.00
FMC CORP	16,400	86.38	1,416,632.00

INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	9,600	130.39	1,251,744.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	39,900	109.90	4,385,010.00
MONSANTO CO	51,500	124.69	6,421,535.00
MOSAIC CO/THE	39,400	25.80	1,016,520.00
PPG INDUSTRIES	29,900	107.05	3,200,795.00
PRAXAIR INC	34,000	155.51	5,287,340.00
SHERWIN-WILLIAMS	10,030	380.81	3,819,524.30
WR GRACE & CO	8,300	71.67	594,861.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7,500	212.61	1,594,575.00
VULCAN MATERIALS CO	15,300	127.06	1,944,018.00
AVERY DENNISON CORP	9,900	106.21	1,051,479.00
BALL CORP	39,700	38.59	1,532,023.00
CROWN HOLDINGS INC	16,700	44.97	750,999.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	47,100	52.19	2,458,149.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	10,900	115.45	1,258,405.00
SEALED AIR CORP	21,900	44.06	964,914.00
WESTROCK CO	29,200	60.48	1,766,016.00
FREEMONT-MCMORAN INC	165,000	15.68	2,587,200.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	63,900	39.96	2,553,444.00
NUCOR CORP	36,600	62.71	2,295,186.00
STEEL DYNAMICS	27,100	46.92	1,271,532.00
ARCONIC INC	51,600	18.02	929,832.00
BOEING CO	66,830	344.50	23,022,935.00
GENERAL DYNAMICS	30,110	201.05	6,053,615.50
HARRIS CORP	14,300	155.39	2,222,077.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,120	221.54	1,134,284.80
L3 TECHNOLOGIES INC	9,000	193.75	1,743,750.00
LOCKHEED MARTIN	30,550	326.12	9,962,966.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,340	327.59	6,335,590.60
RAYTHEON COMPANY	34,280	212.23	7,275,244.40
ROCKWELL COLLINS INC	19,200	133.93	2,571,456.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	13,200	84.92	1,120,944.00
TEXTRON INC	31,300	65.17	2,039,821.00
TRANSDIGM GROUP INC	6,090	334.48	2,036,983.20
UNITED TECHNOLOGIES	89,800	123.11	11,055,278.00

ALLEGION PLC	10,800	76.28	823,824.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	17,100	55.25	944,775.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	108,600	36.27	3,938,922.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,500	202.52	911,340.00	
MASCO CORP	35,700	37.63	1,343,391.00	
OWENS CORNING INC	12,400	66.37	822,988.00	
SMITH (A.O.) CORP	16,500	63.35	1,045,275.00	
FLUOR CORP	16,400	45.42	744,888.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,100	62.86	886,326.00	
ACUITY BRANDS INC	5,000	113.90	569,500.00	
AMETEK INC	26,800	74.80	2,004,640.00	
EATON CORP PLC	52,500	75.66	3,972,150.00	
EMERSON ELEC	76,300	71.93	5,488,259.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,400	177.20	2,728,880.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	19,400	51.51	999,294.00	
3M CORP	70,410	203.42	14,322,802.20	
GENERAL ELEC CO	1,025,000	14.62	14,985,500.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	85,600	145.69	12,471,064.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	25,500	60.96	1,554,480.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	26,600	37.17	988,722.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,940	275.07	3,284,335.80	
AGCO CORP	7,800	63.45	494,910.00	
CATERPILLAR INC DEL	70,400	152.61	10,743,744.00	
CUMMINS INC	18,900	146.52	2,769,228.00	
DEERE & COMPANY	32,500	145.16	4,717,700.00	
DOVER CORP	18,100	76.89	1,391,709.00	
FLOWSERVE CORP	15,000	47.82	717,300.00	
FORTIVE CORP	36,900	75.22	2,775,618.00	
IDEX CORP	9,300	136.60	1,270,380.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	36,600	146.47	5,360,802.00	
INGERSOLL-RAND PLC	29,300	88.56	2,594,808.00	
MIDDLEBY CORP	6,500	108.55	705,607.50	
PACCAR	41,500	64.05	2,658,075.00	
PARKER HANNIFIN CORP	15,700	174.54	2,740,278.00	

PENTAIR PLC	20,500	44.55	913,275.00
SNAP-ON INC	6,700	148.04	991,868.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,100	141.92	2,568,752.00
WABCO HOLDINGS INC	6,000	130.50	783,000.00
WABTEC CORP	10,300	93.49	962,947.00
XYLEM INC	20,600	71.92	1,481,552.00
AERCAP HOLDINGS NV	14,900	55.37	825,013.00
FASTENAL CO	34,100	51.51	1,756,491.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,200	295.83	1,834,146.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	39.28	899,512.00
UNITED RENTALS INC	10,100	162.32	1,639,432.00
CINTAS CORP	10,700	178.88	1,914,016.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	27,600	67.63	1,866,588.00
ROLLINS INC	12,000	49.64	595,680.00
STERICYCLE INC	10,800	64.01	691,308.00
WASTE CONNECTIONS INC	30,300	75.64	2,291,892.00
WASTE MANAGEMENT INC	51,700	83.01	4,291,617.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	16,900	83.49	1,410,981.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	21,300	70.54	1,502,502.00
FEDEX CORPORATION	29,770	244.17	7,268,940.90
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	81,400	111.40	9,067,960.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	41.50	605,900.00
DELTA AIR LINES INC	20,100	51.62	1,037,562.00
SOUTHWEST AIRLINES	17,600	51.56	907,456.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,200	65.80	605,360.00
AMERCO	680	336.91	229,098.80
CSX CORP	100,900	62.25	6,281,025.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	10,700	120.71	1,291,597.00
KANSAS CITY SOUTHERN	11,800	109.51	1,292,218.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,700	40.01	668,167.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	33,500	150.93	5,056,155.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,900	144.77	998,913.00
UNION PAC CORP	93,100	139.90	13,024,690.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE	9,500	38.80	368,600.00

CORPORATION			
APTIV PLC	31,900	94.39	3,011,041.00
AUTOLIV INC	10,500	139.56	1,465,380.00
BORGWARNER INC	23,600	49.93	1,178,348.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	28,300	25.19	712,877.00
LEAR CORP	7,700	191.20	1,472,240.00
FORD MOTOR COMPANY	441,000	11.06	4,877,460.00
GENERAL MOTORS CO	149,800	36.27	5,433,246.00
HARLEY-DAVIDSON INC	19,400	40.10	777,940.00
TESLA INC	15,610	306.85	4,789,928.50
DR HORTON INC	42,000	43.63	1,832,460.00
GARMIN LTD	13,300	59.41	790,153.00
LEGGETT & PLATT INC	15,900	41.60	661,440.00
LENNAR CORP-A	32,600	53.61	1,747,686.00
MOHAWK INDUSTRIES	7,260	210.38	1,527,358.80
NEWELL BRANDS INC	56,500	26.96	1,523,240.00
NVR INC	433	3,022.99	1,308,954.67
PULTEGROUP INC	29,300	30.76	901,268.00
TOLL BROTHERS INC	18,500	42.26	781,810.00
WHIRLPOOL CORP	8,200	154.60	1,267,720.00
HASBRO INC	12,600	86.68	1,092,168.00
MATTEL INC	40,000	14.49	579,600.00
POLARIS INDUSTRIES INC	7,100	107.14	760,694.00
HANESBRANDS INC	43,300	16.56	717,048.00
LULULEMON ATHLETICA INC	12,100	98.96	1,197,416.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	17,900	62.38	1,116,602.00
NIKE INC-B	155,300	67.95	10,552,635.00
PVH CORP	9,000	153.06	1,377,540.00
RALPH LAUREN CORPORATION	6,800	109.85	746,980.00
TAPESTRY INC	33,000	45.40	1,498,200.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	18,400	18.29	336,536.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	18,700	16.51	308,737.00
V F CORP	39,300	78.13	3,070,509.00
ARAMARK	28,600	37.47	1,071,642.00
CARNIVAL CORP	41,100	63.95	2,628,345.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,890	424.69	1,227,354.10

DARDEN RESTAURANTS INC	14,300	91.84	1,313,312.00	
DOMINOS PIZZA INC	5,270	249.91	1,317,025.70	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,200	82.85	2,833,470.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	46,500	77.89	3,621,885.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	36,200	137.90	4,991,980.00	
MCDONALD'S CORP	94,200	164.24	15,471,408.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	28,300	31.68	896,544.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	53,500	32.90	1,760,150.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	24,500	51.16	1,253,420.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,600	105.17	2,166,502.00	
STARBUCKS CORP	168,500	57.04	9,611,240.00	
VAIL RESORTS INC	4,950	231.40	1,145,430.00	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,900	110.86	1,319,234.00	
WYNN RESORTS LTD	11,700	199.21	2,330,757.00	
YUM BRANDS INC	37,700	84.45	3,183,765.00	
CBS CORP-CL B	40,000	51.44	2,057,600.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	22,120	270.13	5,975,275.60	
COMCAST CORP-CL A	551,100	30.73	16,935,303.00	
DISCOVERY INC - A	19,300	22.28	430,004.00	
DISCOVERY INC - C	35,331	21.11	745,837.41	
DISH NETWORK CORP-A	28,000	31.12	871,360.00	
DISNEY (WALT) CO	178,500	99.97	17,844,645.00	
INTERPUBRIC GROUP	44,300	23.72	1,050,796.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	12,400	71.12	881,888.00	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,600	29.52	1,906,992.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	30.34	728,160.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,400	30.68	687,232.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	19,700	43.37	854,389.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	9,870	43.28	427,173.60	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	16,100	42.87	690,207.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	46,000	16.51	759,460.00	
OMNICOM GROUP	26,800	74.29	1,990,972.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	182,000	6.77	1,232,140.00	
TIME WARNER INC	92,200	92.38	8,517,436.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	122,500	37.70	4,618,250.00	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	51,000	37.24	1,899,240.00
VIACOM INC-CLASS B	41,300	30.06	1,241,478.00
GENUINE PARTS CO	17,200	90.19	1,551,268.00
LKQ CORP	36,300	30.20	1,096,260.00
AMAZON.COM INC	48,310	1,608.00	77,682,480.00
BOOKING HOLDINGS INC	5,770	2,183.59	12,599,314.30
EXPEDIA GROUP INC	14,400	112.22	1,615,968.00
NETFLIX INC	51,160	330.30	16,898,148.00
QURATE RETAIL GROUP INC QVC GROUP	53,200	24.55	1,306,060.00
TRIPADVISOR INC	12,300	47.62	585,726.00
DOLLAR GENERAL CORP	32,700	93.52	3,058,104.00
DOLLAR TREE INC	28,000	93.55	2,619,400.00
KOHL'S CORP	19,600	61.39	1,203,244.00
MACYS INC	35,900	30.14	1,082,026.00
NORDSTROM INC	15,000	49.27	739,050.00
TARGET CORP	61,500	69.93	4,300,695.00
ADVANCE AUTO PARTS	8,300	117.99	979,317.00
AUTONATION INC	7,100	46.61	330,931.00
AUTOZONE	3,240	658.33	2,132,989.20
BEST BUY COMPANY INC	31,900	76.22	2,431,418.00
CARMAX INC	22,200	64.11	1,423,242.00
GAP INC	27,100	29.21	791,591.00
HOME DEPOT	137,900	186.36	25,699,044.00
L BRANDS, INC	27,000	34.12	921,240.00
LOWES COS INC	98,500	84.42	8,315,370.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,880	265.41	2,622,250.80
ROSS STORES INC	46,000	81.85	3,765,100.00
TIFFANY & CO	15,100	103.36	1,560,736.00
TJX COS INC	74,000	83.89	6,207,860.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	14,900	66.69	993,681.00
ULTA BEAUTY INC	7,000	248.90	1,742,300.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	51,700	196.04	10,135,268.00
CVS HEALTH CORP	120,100	61.21	7,351,321.00
KROGER CO	105,700	24.36	2,574,852.00

SYSCO CORP	57,400	63.50	3,644,900.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	99,900	62.94	6,287,706.00	
WALMART INC	176,600	83.06	14,668,396.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	30,900	56.97	1,760,373.00	
COCA COLA CO	478,100	41.78	19,975,018.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	26,700	38.17	1,019,139.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	20,490	221.97	4,548,165.30	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	21,100	119.92	2,530,312.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	22,000	61.07	1,343,540.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	45,400	49.11	2,229,594.00	
PEPSICO INC	168,000	96.16	16,154,880.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	66,900	43.70	2,923,530.00	
BUNGE LIMITED	17,200	69.92	1,202,624.00	
CAMPBELL SOUP CO	21,600	41.36	893,376.00	
CONAGRA BRANDS INC	47,200	37.67	1,778,024.00	
GENERAL MILLS	67,900	42.51	2,886,429.00	
HERSHEY CO/THE	16,600	92.61	1,537,326.00	
HORMEL FOODS CORP	32,800	36.09	1,183,752.00	
INGREDION INC	8,400	111.12	933,408.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	13,500	113.79	1,536,165.00	
KELLOGG CO	30,200	60.33	1,821,966.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	72,500	58.48	4,239,800.00	
MCCORMICK & CO INC.	13,900	105.36	1,464,504.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	177,200	38.77	6,870,044.00	
TYSON FOODS INC-CL A	34,900	67.27	2,347,723.00	
ALTRIA GROUP INC	225,600	55.92	12,615,552.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	183,500	81.99	15,045,165.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	28,700	47.75	1,370,425.00	
CLOROX CO	15,000	120.33	1,804,950.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	98,900	61.91	6,122,899.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	40,900	103.06	4,215,154.00	
PROCTER & GAMBLE CO	299,600	72.37	21,682,052.00	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,600	72.89	189,514.00	
COTY INC-CL A	55,000	15.01	825,550.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	26,200	137.81	3,610,622.00	

ABBOTT LABORATORIES	205,900	59.40	12,230,460.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,860	268.00	2,374,480.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	57,100	69.32	3,958,172.00	
BECTON,DICKINSON	30,970	223.39	6,918,388.30	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	161,100	29.83	4,805,613.00	
DANAHER CORP	73,200	99.54	7,286,328.00	
DENTSPLY SIRONA INC	27,200	44.58	1,212,576.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,900	135.23	3,367,227.00	
HOLOGIC INC	31,100	36.91	1,147,901.00	
IDEXX LABORATORIES INC	10,200	206.62	2,107,524.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	13,120	462.27	6,064,982.40	
MEDTRONIC PLC	160,100	84.06	13,458,006.00	
RESMED INC	16,900	98.16	1,658,904.00	
STRYKER CORP	39,400	167.39	6,595,166.00	
TELEFLEX INC	5,360	267.09	1,431,602.40	
THE COOPER COMPANIES, INC.	5,630	226.49	1,275,138.70	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,700	117.36	1,255,752.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23,900	116.21	2,777,419.00	
AETNA INC	38,100	170.57	6,498,717.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,200	84.72	1,626,624.00	
ANTHEM INC	30,460	221.77	6,755,114.20	
CARDINAL HEALTH INC	36,300	52.76	1,915,188.00	
CENTENE CORP	24,300	112.83	2,741,769.00	
CIGNA CORP	29,300	169.58	4,968,694.00	
DAVITA INC	17,500	64.80	1,134,000.00	
ENVISION HEALTHCARE CORP	14,900	40.71	606,579.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	66,100	68.63	4,536,443.00	
HCA HEALTHCARE INC	33,300	100.12	3,333,996.00	
HENRY SCHEIN INC	19,100	71.58	1,367,178.00	
HUMANA INC	16,660	273.25	4,552,345.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,800	171.86	2,027,948.00	
MCKESSON CORP	24,900	144.81	3,605,769.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	16,500	100.64	1,660,560.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	114,430	229.21	26,228,500.30	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9,800	117.27	1,149,246.00	

ABBVIE INC	188,700	101.18	19,092,666.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26,300	116.77	3,071,051.00
ALKERMES PLC	17,400	44.70	777,780.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,900	97.09	961,191.00
AMGEN INC	79,700	169.64	13,520,308.00
BIOGEN INC	24,720	274.03	6,774,021.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,200	88.45	1,786,690.00
CELGENE CORP	93,300	82.80	7,725,240.00
GILEAD SCIENCES INC	154,600	65.69	10,155,674.00
INCYTE CORP	21,200	64.35	1,364,220.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,250	284.60	2,632,550.00
SEATTLE GENETICS INC	13,400	55.50	743,700.00
TESARO INC	3,700	45.82	169,534.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	5,200	103.51	538,252.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	29,600	149.07	4,412,472.00
ALLERGAN PLC	39,500	146.28	5,778,060.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	193,600	51.09	9,891,024.00
ELI LILLY & CO.	117,400	79.27	9,306,298.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,000	156.31	1,094,170.00
JOHNSON & JOHNSON	317,000	123.51	39,152,670.00
MERCK & CO INC	322,000	57.95	18,659,900.00
MYLAN NV	52,400	36.72	1,924,128.00
PERRIGO CO PLC	14,200	73.45	1,042,990.00
PFIZER INC	703,900	35.17	24,756,163.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	105,000	19.33	2,029,650.00
ZOETIS INC	56,700	82.33	4,668,111.00
BANK OF AMERICA CORP	1,169,500	30.72	35,927,040.00
BB&T CORPORATION	93,800	54.92	5,151,496.00
CIT GROUP INC	16,400	53.76	881,664.00
CITIGROUP	312,300	71.95	22,469,985.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	57,800	42.17	2,437,426.00
COMERICA INC	20,400	97.32	1,985,328.00
EAST WEST BANCORP INC	16,200	69.41	1,124,442.00
FIFTH THIRD BANCORP	81,300	33.67	2,737,371.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	18,500	97.13	1,796,905.00

HUNTINGTON BANCSHARES INC	126,000	15.09	1,901,340.00
JPMORGAN CHASE & CO	409,400	113.41	46,430,054.00
KEYCORP	124,000	20.06	2,487,440.00
M & T BANK CORP	15,700	184.11	2,890,527.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	41,000	18.64	764,240.00
PNC FINANCIAL	56,400	150.29	8,476,356.00
REGIONS FINANCIAL CORP	137,000	19.22	2,633,140.00
SIGNATURE BANK	6,500	130.24	846,560.00
SUNTRUST BKS INC.	56,700	68.55	3,886,785.00
SVB FINANCIAL GROUP	6,400	317.12	2,029,568.00
US BANCORP	196,500	50.83	9,988,095.00
WELLS FARGO CO	552,300	53.76	29,691,648.00
ZIONS BANCORPORATION	22,600	57.28	1,294,528.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	149,900	199.87	29,960,513.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,600	24.64	901,824.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	52.77	1,145,109.00
AFLAC INC	92,400	44.75	4,134,900.00
ALLEGHANY CORP	1,720	577.23	992,835.60
ALLSTATE CORP	42,700	96.41	4,116,707.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,400	110.88	931,392.00
AMERICAN INTL GROUP	105,200	52.82	5,556,664.00
AON PLC	29,800	141.29	4,210,442.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,900	79.38	1,262,142.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,400	68.66	1,469,324.00
ASSURANT INC	6,300	86.39	544,257.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	18,900	46.63	881,307.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	10,500	57.59	604,695.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,200	49.01	499,902.00
CHUBB LTD	55,000	134.69	7,407,950.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	18,400	71.21	1,310,264.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,010	227.95	1,142,029.50
FNF GROUP	29,900	37.67	1,126,333.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	42,400	52.67	2,233,208.00
LINCOLN NATIONAL CORP	25,800	67.59	1,743,822.00
LOEWS CORP	33,300	51.61	1,718,613.00

MARKEL CORP	1,630	1,145.49	1,867,148.70
MARSH & MCLENNAN COS	60,700	81.25	4,931,875.00
METLIFE INC	106,400	46.59	4,957,176.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	33,400	57.72	1,927,848.00
PROGRESSIVE CO	67,700	61.79	4,183,183.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	49,700	100.13	4,976,461.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	7,200	150.60	1,084,320.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,000	127.31	636,550.00
TORCHMARK CORP	12,500	85.02	1,062,750.00
TRAVELERS COS INC/THE	32,600	129.75	4,229,850.00
UNUM GROUP	27,300	37.76	1,030,848.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,800	152.21	2,252,708.00
WR BERKLEY CORP	11,500	75.27	865,605.00
XL GROUP LTD	30,900	55.08	1,701,972.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	19,100	77.30	1,476,430.00
ALPHABET INC-CL A	35,200	1,088.95	38,331,040.00
ALPHABET INC-CL C	37,120	1,082.76	40,192,051.20
EBAY INC	115,700	38.23	4,423,211.00
FACEBOOK INC-A	281,400	182.66	51,400,524.00
IAC/INTERACTIVE CORP	9,100	138.76	1,262,716.00
MERCADOLIBRE INC	4,980	325.31	1,620,043.80
TWITTER INC	74,100	32.46	2,405,286.00
VERISIGN INC	10,100	123.33	1,245,633.00
ZILLOW GROUP INC - C	13,300	56.38	749,854.00
ACCENTURE PLC-CL A	72,700	154.62	11,240,874.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,960	203.88	1,215,124.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	52,600	127.04	6,682,304.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	14,100	113.88	1,605,708.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	70,000	75.03	5,252,100.00
DXC TECHNOLOGY CO	33,300	103.44	3,444,552.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	39,800	103.91	4,135,618.00
FIRST DATA CORP- CLASS A	56,000	19.50	1,092,000.00
FISERV INC	49,700	71.49	3,553,053.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,800	204.11	2,204,388.00
GARTNER INC	11,000	133.54	1,468,940.00

GLOBAL PAYMENTS INC	18,900	114.60	2,165,940.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	104,000	142.61	14,831,440.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,800	122.73	1,080,024.00
LEIDOS HOLDINGS INC	16,100	62.53	1,006,733.00
MASTERCARD INC	111,000	190.63	21,159,930.00
PAYCHEX INC	37,400	62.21	2,326,654.00
PAYPAL HOLDINGS INC	135,200	77.01	10,411,752.00
SABRE CORP	26,000	22.97	597,220.00
SQUARE INC - A	31,900	54.26	1,730,894.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	19,500	87.82	1,712,490.00
VISA INC-CLASS A SHARES	214,100	130.84	28,012,844.00
WESTERN UNION CO	52,800	19.92	1,051,776.00
WORLDPAY INC - CL A	35,000	84.49	2,957,150.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	84,000	71.31	5,990,040.00
ADOBE SYSTEMS INC.	58,310	239.74	13,979,239.40
ANSYS INC	9,900	171.50	1,697,850.00
AUTODESK INC.	23,600	135.32	3,193,552.00
CA INC	38,300	34.40	1,317,520.00
CADENCE DESIGN SYS INC	32,100	41.76	1,340,496.00
CDK GLOBAL INC	14,600	64.70	944,620.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	15,300	99.80	1,526,940.00
CITRIX SYSTEMS INC	17,300	107.78	1,864,594.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	23,300	72.72	1,694,376.00
ELECTRONIC ARTS	36,100	131.01	4,729,461.00
FORTINET INC	17,000	59.02	1,003,340.00
INTUIT INC	28,900	192.67	5,568,163.00
MICROSOFT CORP	864,400	96.94	83,794,936.00
ORACLE CORPORATION	369,900	46.58	17,229,942.00
RED HAT INC	21,100	171.16	3,611,476.00
SALESFORCE.COM INC	81,300	129.73	10,547,049.00
SERVICENOW INC	20,200	180.04	3,636,808.00
SPLUNK INC	16,200	114.84	1,860,408.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25,500	49.00	1,249,500.00
SYMANTEC CORP	71,300	28.75	2,049,875.00

SYNOPSYS INC	18,000	90.83	1,634,940.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	13,500	115.99	1,565,865.00
VMWARE INC - CLASS A	8,400	138.57	1,163,988.00
WORKDAY INC-CLASS A	16,500	136.50	2,252,250.00
ARISTA NETWORKS INC	5,640	259.42	1,463,128.80
CISCO SYSTEMS	583,800	46.04	26,878,152.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	29.58	674,424.00
F5 NETWORKS INC	7,300	172.00	1,255,600.00
JUNIPER NETWORKS INC	42,400	26.17	1,109,608.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,000	105.78	2,009,820.00
PALO ALTO NETWORKS INC	10,700	206.61	2,210,727.00
APPLE INC	605,500	187.36	113,446,480.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	186,000	17.60	3,273,600.00
HP INC	194,200	22.58	4,385,036.00
NETAPP INC	32,200	71.17	2,291,674.00
SEAGATE TECHNOLOGY	34,300	57.23	1,962,989.00
WESTERN DIGITAL CORP	34,200	78.45	2,682,990.00
XEROX CORP	24,400	28.83	703,452.00
AMPHENOL CORP-CL A	35,900	86.31	3,098,529.00
ARROW ELECTRS INC	10,500	75.62	794,010.00
AVNET	15,000	40.00	600,000.00
CDW CORPORATION	18,200	77.69	1,413,958.00
COGNEX CORP	19,200	48.23	926,016.00
CORNING INC	104,000	27.08	2,816,320.00
FLEX LTD	62,000	14.34	889,080.00
FLIR SYSTEMS INC	15,600	55.39	864,084.00
IPG PHOTONICS CORP	4,200	244.50	1,026,900.00
TE CONNECTIVITY LTD	41,300	93.46	3,859,898.00
TRIMBLE INC	28,400	33.94	963,896.00
ADVANCED MICRO DEVICES	101,000	11.95	1,206,950.00
ANALOG DEVICES INC	43,300	92.62	4,010,446.00
APPLIED MATERIALS	126,500	54.13	6,847,445.00
BROADCOM INC	48,280	238.05	11,493,054.00
INTEL CORP	552,600	54.34	30,028,284.00
KLA TENCOR CORP	18,300	109.17	1,997,811.00

LAM RESEARCH	18,800	199.72	3,754,736.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	46,500	21.29	989,985.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32,900	57.33	1,886,157.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	28,100	91.86	2,581,266.00	
MICRON TECHNOLOGY	136,800	51.01	6,978,168.00	
NVIDIA CORP	71,630	255.78	18,321,521.40	
NXP SEMICONDUCTORS NV	38,600	98.64	3,807,504.00	
QORVO INC	14,200	80.21	1,138,982.00	
QUALCOMM INC	174,600	53.17	9,283,482.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	21,100	95.55	2,016,105.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	116,600	107.54	12,539,164.00	
XILINX INC	30,200	68.43	2,066,586.00	
AT & T INC	724,900	31.40	22,761,860.00	
CENTURYLINK INC	116,000	18.04	2,092,640.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	487,100	46.38	22,591,698.00	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	22,200	34.12	757,464.00	
SPRINT CORP	90,000	5.18	466,200.00	
T-MOBILE US INC	33,400	56.32	1,881,088.00	
ALLIANT ENERGY CORP	28,300	41.26	1,167,658.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	57,300	66.27	3,797,271.00	
DUKE ENERGY CORP	81,900	77.64	6,358,716.00	
EDISON INTERNATIONAL	39,100	60.42	2,362,422.00	
ENTERGY CORP	21,000	78.02	1,638,420.00	
EVERSOURCE ENERGY	36,300	57.00	2,069,100.00	
EXELON CORPORATION	114,300	39.97	4,568,571.00	
FIRSTENERGY CORP	52,000	33.52	1,743,040.00	
NEXTERA ENERGY INC	55,700	158.29	8,816,753.00	
OGE ENERGY CORP	22,500	33.60	756,000.00	
PG&E CORP	61,600	42.59	2,623,544.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	12,400	77.41	959,884.00	
PPL CORPORATION	81,500	27.89	2,273,035.00	
SOUTHERN CO.	119,300	43.79	5,224,147.00	
WESTAR ENERGY INC	15,800	52.96	836,768.00	
XCEL ENERGY INC	60,000	44.81	2,688,600.00	
ATMOS ENERGY CORP	13,000	87.68	1,139,840.00	

UGI CORP	20,400	48.36	986,544.00	
AMEREN CORPORATION	28,700	56.22	1,613,514.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,800	26.27	1,308,246.00	
CMS ENERGY CORP	33,000	44.73	1,476,090.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	35,900	75.43	2,707,937.00	
DOMINION ENERGY INC	76,500	62.67	4,794,255.00	
DTE ENERGY COMPANY	20,600	100.24	2,064,944.00	
NISOURCE INC	38,200	24.65	941,630.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	59,700	50.57	3,019,029.00	
SCANA CORP	17,100	35.13	600,723.00	
SEMPRA ENERGY	27,900	105.14	2,933,406.00	
WEC ENERGY GROUP INC	37,900	61.44	2,328,576.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,800	83.23	1,731,184.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	56,000	11.69	654,640.00	
ALLY FINANCIAL INC	52,700	27.07	1,426,589.00	
AMERICAN EXPRESS CO	87,400	100.50	8,783,700.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,600	92.11	5,305,536.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	42,800	74.12	3,172,336.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	92,000	33.73	3,103,160.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	6,500	163.53	1,062,945.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,300	134.24	2,322,352.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	119,700	56.86	6,806,142.00	
BLACKROCK INC	14,260	531.35	7,577,051.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,200	103.91	1,267,702.00	
CME GROUP INC	39,800	161.47	6,426,506.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	30,700	64.00	1,964,800.00	
EATON VANCE CORP	13,800	56.32	777,216.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	39,700	32.66	1,296,602.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	42,410	241.73	10,251,769.30	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	68,500	71.87	4,923,095.00	
INVESCO LTD	46,900	27.98	1,312,262.00	
MOODYS CORP	20,200	170.55	3,445,110.00	
MORGAN STANLEY	160,600	54.14	8,694,884.00	
MSCI INC	10,400	156.63	1,628,952.00	
NASDAQ INC	14,000	90.09	1,261,260.00	

	NORTHERN TRUST CORP	25,900	106.23	2,751,357.00	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,900	92.43	1,377,207.00	
	S&P GLOBAL INC	30,300	197.41	5,981,523.00	
	SCHWAB(CHARLES)CORP	143,100	58.73	8,404,263.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	15,000	63.35	950,250.00	
	STATE STREET CORP	43,500	101.11	4,398,285.00	
	T ROWE PRICE GROUP INC	28,500	116.66	3,324,810.00	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	33,400	61.41	2,051,094.00	
	H & R BLOCK INC	23,500	27.39	643,665.00	
	AES CORP	74,000	12.07	893,180.00	
	VISTRA ENERGY CORP	43,000	22.99	988,570.00	
	CERNER CORP	34,200	59.35	2,029,770.00	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	14,100	76.16	1,073,856.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	38,600	68.13	2,629,818.00	
	ILLUMINA INC	17,000	262.52	4,462,840.00	
	IQVIA HOLDINGS INC	15,500	99.39	1,540,545.00	
	METTLER-TOLEDO INTL	3,010	549.66	1,654,476.60	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	47,500	208.69	9,912,775.00	
	WATERS CORP	9,300	193.38	1,798,434.00	
	COSTAR GROUP INC	4,110	390.28	1,604,050.80	
	EQUIFAX INC	13,900	113.86	1,582,654.00	
	IHS MARKIT LTD	46,900	51.19	2,400,811.00	
	MANPOWERGROUP INC	8,000	95.67	765,360.00	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	42,700	30.21	1,289,967.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	15,100	63.11	952,961.00	
	TRUNION	21,800	68.60	1,495,480.00	
	VERISK ANALYTICS INC	18,400	104.78	1,927,952.00	
	CBRE GROUP INC	35,500	46.71	1,658,205.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	143,000	7.39	1,056,770.00	
	JONES LANG LASALLE INC	5,400	173.03	934,362.00	
小計	銘柄数：601			2,781,387,930.28	
				(305,841,416,813)	
	組入時価比率：63.0%			65.6%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	20,800	25.47	529,776.00	
	ARC RESOURCES LTD	40,000	13.59	543,600.00	
		48,000	14.67	704,160.00	

CAMECO CORP			
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	130,600	45.90	5,994,540.00
CENOVUS ENERGY INC	117,000	14.11	1,650,870.00
CRESCENT POINT ENERGY CORP	65,000	10.35	672,750.00
ENBRIDGE INC	193,400	41.48	8,022,232.00
ENCANA CORP	117,000	17.19	2,011,230.00
HUSKY ENERGY INC	43,000	18.13	779,590.00
IMPERIAL OIL	34,400	41.00	1,410,400.00
INTER PIPELINE LTD	46,000	23.68	1,089,280.00
KEYERA CORP	24,500	35.38	866,810.00
PEMBINA PIPELINE CORP	60,600	44.00	2,666,400.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24,600	27.20	669,120.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	29,000	16.24	470,960.00
SUNCOR ENERGY INC	196,300	50.18	9,850,334.00
TOURMALINE OIL CORP	26,500	24.02	636,530.00
TRANSCANADA CORP	103,700	55.89	5,795,793.00
VERMILION ENERGY INC	12,000	44.25	531,000.00
METHANEX CORP	10,300	87.53	901,559.00
NUTRIEN LTD	76,800	62.37	4,790,016.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15,500	61.25	949,375.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	28,100	56.12	1,576,972.00
BARRICK GOLD	134,000	17.14	2,296,760.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	80,000	19.92	1,593,600.00
FRANCO-NEVADA CORP	22,200	96.38	2,139,636.00
GOLDCORP INC	101,000	17.33	1,750,330.00
KINROSS GOLD CORP	140,000	4.73	662,200.00
LUNDIN MINING CORP	73,000	8.32	607,360.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	66,500	34.16	2,271,640.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	126,000	3.78	476,280.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	51,200	27.72	1,419,264.00
WEST FRASER TIMBER	8,400	90.22	757,848.00
BOMBARDIER B SHEARS	232,000	4.21	976,720.00
CAE INC	31,000	24.32	753,920.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	19,700	56.06	1,104,382.00
FINNING INTERNATIONAL INC	19,600	33.21	650,916.00

CANADIAN NATL RAILWAY CO	88,500	102.20	9,044,700.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	17,300	238.76	4,130,548.00
LINAMAR CORP	6,500	73.19	475,735.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	41,200	78.16	3,220,192.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	24,100	36.99	891,459.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,900	71.67	1,856,253.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	52,000	26.07	1,355,640.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,700	175.37	1,350,349.00
DOLLARAMA INC	12,800	147.43	1,887,104.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	50,600	53.59	2,711,654.00
EMPIRE CO LTD A	21,000	25.05	526,050.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	24.50	230,300.00
LOBLAW COMPANIES	24,000	65.33	1,567,920.00
METRO INC	26,700	40.54	1,082,418.00
WESTON(GEORGE)LTD	5,900	103.12	608,408.00
SAPUTO INC	23,900	42.28	1,010,492.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	38,000	26.10	991,800.00
BANK OF MONTREAL	77,000	100.14	7,710,780.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	142,100	80.00	11,368,000.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	51,900	114.07	5,920,233.00
NATIONAL BANK OF CANADA	39,200	62.56	2,452,352.00
ROYAL BANK OF CANADA	172,400	99.63	17,176,212.00
TORONTO DOMINION BANK	218,600	74.24	16,228,864.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	49,000	4.85	237,650.00
ONEX CORPORATION	9,200	93.88	863,696.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,240	711.00	2,303,640.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	33,200	33.58	1,114,856.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	12,100	52.91	640,211.00
INTACT FINANCIAL CORP	16,300	95.15	1,550,945.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	236,000	24.75	5,841,000.00
POWER CORPORATION OF CANADA	40,900	29.75	1,216,775.00
POWER FINANCIAL CORP	27,800	32.46	902,388.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	72,100	52.42	3,779,482.00
	10,400	187.60	1,951,040.00

	SHOPIFY INC - CLASS A				
	CGI GROUP INC - CLASS A	30,000	77.78	2,333,400.00	
	BLACKBERRY LTD	60,000	14.89	893,400.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,400	973.25	2,335,800.00	
	OPEN TEXT CORP	32,500	47.26	1,535,950.00	
	BCE INC	17,400	53.28	927,072.00	
	TELUS CORP	19,300	45.93	886,449.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	43,600	61.08	2,663,088.00	
	EMERA INC	7,600	40.71	309,396.00	
	FORTIS INC	49,000	42.50	2,082,500.00	
	HYDRO ONE LTD	35,000	20.23	708,050.00	
	ATCO LTD CL1	9,600	39.06	374,976.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	32.13	504,441.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	100,100	51.41	5,146,141.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	26.29	883,344.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	38.60	397,580.00	
	THOMSON REUTERS CORP	34,100	49.96	1,703,636.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	18,000	20.48	368,640.00	
小計	銘柄数：88			208,827,162.00	
				(17,873,516,795)	
	組入時価比率：3.7%			3.8%	
ユーロ	TENARIS SA	53,000	16.39	868,935.00	
	ENAGAS	26,700	24.39	651,213.00	
	ENI SPA	302,000	16.68	5,039,172.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	57,000	16.44	937,080.00	
	NESTE OYJ	14,600	66.66	973,236.00	
	OMV AG	17,100	54.50	931,950.00	
	REPSOL SA	150,000	16.54	2,481,000.00	
	SNAM SPA	274,000	3.86	1,059,558.00	
	TOTAL SA	283,900	52.78	14,984,242.00	
	VOPAK	9,000	41.31	371,790.00	
	AIR LIQUIDE	50,100	108.20	5,420,820.00	
	AKZO NOBEL	29,700	75.80	2,251,260.00	
	ARKEMA	7,700	108.40	834,680.00	
	BASF SE	108,700	86.14	9,363,418.00	
	COVESTRO AG	23,200	77.70	1,802,640.00	

EVONIK INDUSTRIES AG	19,500	31.16	607,620.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	8,200	45.14	370,148.00
K+S AG	23,400	24.54	574,236.00
KONINKLIJKE DSM NV	20,900	85.60	1,789,040.00
LANXESS	10,300	67.88	699,164.00
LINDE AG - TENDER	22,090	189.70	4,190,473.00
SOLVAY SA	8,700	115.10	1,001,370.00
SYMRISE AG	15,100	71.32	1,076,932.00
UMICORE	24,700	47.70	1,178,190.00
CRH PLC	99,600	31.00	3,087,600.00
HEIDELBERGCEMENT AG	17,300	83.96	1,452,508.00
IMERYS	3,800	75.00	285,000.00
ARCELORMITTAL	79,600	29.41	2,341,036.00
THYSSENKRUPP AG	51,800	22.82	1,182,076.00
VOESTALPINE AG	14,300	45.98	657,514.00
STORA ENSO OYJ-R	67,000	16.75	1,122,250.00
UPM-KYMMENE OYJ	64,000	30.62	1,959,680.00
AIRBUS SE	68,800	99.16	6,822,208.00
DASSAULT AVIATION SA	270	1,705.00	460,350.00
LEONARDO SPA	47,000	9.94	467,368.00
MTU AERO ENGINES AG	5,800	153.90	892,620.00
SAFRAN SA	39,700	98.90	3,926,330.00
THALES SA	12,400	111.00	1,376,400.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	58,300	44.43	2,590,269.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	28,272	36.22	1,024,011.84
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	9,602	24.40	234,288.80
BOUYGUES	25,700	43.08	1,107,156.00
EIFFAGE SA	8,700	100.15	871,305.00
FERROVIAL SA	59,000	18.07	1,066,425.00
HOCHTIEF AG	2,000	151.40	302,800.00
VINCI	59,400	85.16	5,058,504.00
LEGRAND SA	31,900	66.14	2,109,866.00
OSRAM LICHT AG	11,600	52.14	604,824.00
PRYSMIAN SPA	23,000	25.42	584,660.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	66,300	75.22	4,987,086.00

SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	30,000	14.10	423,000.00
SIEMENS AG	90,500	114.60	10,371,300.00
ALSTOM	18,100	38.59	698,479.00
ANDRITZ AG	9,200	43.76	402,592.00
CNH INDUSTRIAL NV	121,000	10.44	1,263,845.00
GEA GROUP AG	20,700	33.24	688,068.00
KION GROUP AG	8,000	73.02	584,160.00
KONE OYJ	40,700	42.10	1,713,470.00
MAN SE	3,700	96.90	358,530.00
METSO OYJ	12,400	30.12	373,488.00
WARTSILA OYJ	52,500	18.01	945,525.00
BRENNTAG AG	18,600	50.80	944,880.00
REXEL SA	35,000	13.10	458,500.00
EDENRED	25,300	28.90	731,170.00
SOCIETE BIC SA	3,800	85.15	323,570.00
BOLLORE	106,000	4.30	455,800.00
DEUTSCHE POST AG-REG	113,800	34.13	3,883,994.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	26,700	24.26	647,742.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	75,000	7.93	594,900.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	80,900	18.24	1,475,616.00
ADP	3,400	182.50	620,500.00
AENA SME SA	8,000	177.95	1,423,600.00
ATLANTIA SPA	53,200	28.40	1,510,880.00
FRAPORT AG	4,900	83.70	410,130.00
GETLINK	53,000	11.82	626,725.00
CONTINENTAL AG	12,820	226.40	2,902,448.00
FAURECIA	8,500	70.96	603,160.00
MICHELIN (CGDE)	20,000	117.65	2,353,000.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,400	31.57	423,038.00
SCHAEFFLER AG	21,000	13.43	282,135.00
VALEO SA	27,600	57.54	1,588,104.00
BAYER MOTOREN WERK	39,400	91.96	3,623,224.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	6,400	80.05	512,320.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	114,000	67.10	7,649,400.00

FERRARI NV	14,300	114.05	1,630,915.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	129,000	18.74	2,417,976.00
PEUGEOT CITROEN	67,400	20.01	1,348,674.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	18,600	70.46	1,310,556.00
RENAULT SA	22,700	88.54	2,009,858.00
VOLKSWAGEN AG	3,810	168.20	640,842.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	21,600	170.80	3,689,280.00
SEB SA	2,450	159.80	391,510.00
ADIDAS AG	22,370	190.35	4,258,129.50
HERMES INTERNATIONAL	3,800	572.00	2,173,600.00
HUGO BOSS AG	7,600	74.98	569,848.00
KERING SA	9,020	480.60	4,335,012.00
LUXOTTICA GROUP SPA	20,300	52.88	1,073,464.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	33,010	292.05	9,640,570.50
ACCOR SA	21,400	47.84	1,023,776.00
PADDY POWER PLC	10,100	80.90	817,090.00
SODEXO	11,100	83.50	926,850.00
ALTICE NV - A	64,000	7.41	474,240.00
AXEL SPRINGER SE	5,900	66.70	393,530.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	20,000	17.97	359,500.00
JC DECAUX SA	9,300	29.58	275,094.00
LAGARDERE S.C.A	14,800	22.95	339,660.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	28,700	28.22	809,914.00
PUBLICIS GROUPE	23,900	62.32	1,489,448.00
RTL GROUP	3,900	70.50	274,950.00
SES FDR	43,000	13.27	570,610.00
TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	49.26	330,042.00
VIVENDI SA	120,900	22.90	2,768,610.00
ZALANDO SE	13,400	43.81	587,054.00
INDITEX SA	127,000	27.10	3,441,700.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	67,400	16.54	1,114,796.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	41.87	247,033.00
COLRUYT SA	7,300	47.06	343,538.00
JERONIMO MARTINS	31,000	13.53	419,430.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	149,500	19.37	2,896,712.00

METRO AG	18,200	11.80	214,851.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	90,200	82.72	7,461,344.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	65,000	6.26	406,900.00
HEINEKEN HOLDING NV	13,500	84.75	1,144,125.00
HEINEKEN NV	30,300	87.78	2,659,734.00
PERNOD RICARD SA	25,300	137.80	3,486,340.00
REMY COINTREAU	3,000	116.80	350,400.00
DANONE	71,700	64.72	4,640,424.00
KERRY GROUP PLC-A	19,300	89.30	1,723,490.00
HENKEL AG & CO KGAA	12,300	97.00	1,193,100.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	20,800	104.20	2,167,360.00
BEIERSDORF AG	11,800	97.34	1,148,612.00
LOREAL-ORD	29,470	201.10	5,926,417.00
UNILEVER NV-CVA	192,800	47.48	9,154,144.00
BIOMERIEUX	4,600	69.60	320,160.00
ESSILOR INTERNATIONAL	24,200	115.35	2,791,470.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	112,000	35.27	3,950,240.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,400	33.00	574,200.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	25,500	84.90	2,164,950.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	48,400	67.30	3,257,320.00
GRIFOLS SA	36,600	24.80	907,680.00
BAYER AG-REG	97,900	102.16	10,001,464.00
IPSEN	4,700	131.80	619,460.00
MERCK KGAA	15,100	82.08	1,239,408.00
ORION OYJ	13,000	25.18	327,340.00
RECORDATI SPA	11,200	30.71	343,952.00
SANOFI	134,500	66.26	8,911,970.00
UCB SA	15,100	63.24	954,924.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	48,900	25.94	1,268,466.00
AIB GROUP PLC	105,000	5.03	528,150.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	791,000	6.80	5,383,546.00
BANCO DE SABADELL SA	625,000	1.71	1,069,062.50
BANCO SANTANDER SA	1,908,000	5.43	10,369,980.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	119,000	7.49	891,310.00
BANKIA SA	151,000	3.62	547,828.00

BANKINTER S.A.	75,000	9.04	678,600.00	
BNP PARIBAS	133,000	62.65	8,332,450.00	
CAIXABANK	413,000	4.22	1,742,860.00	
COMMERZBANK AG	124,000	10.85	1,346,392.00	
CREDIT AGRICOLE SA	137,000	13.44	1,841,280.00	
ERSTE GROUP BANK AG	35,300	38.17	1,347,401.00	
ING GROEP NV	461,000	13.50	6,226,266.00	
INTESA SANPAOLO	1,578,000	3.16	4,986,480.00	
INTESA SANPAOLO-RSP	118,000	3.29	388,456.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	30,000	71.20	2,136,000.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	77,000	10.00	770,000.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	16,900	28.53	482,157.00	
SOCIETE GENERALE	91,200	42.33	3,860,496.00	
UNICREDIT SPA	235,000	17.53	4,121,430.00	
EURAZEO SE	5,670	70.05	397,183.50	
EXOR NV	13,400	65.14	872,876.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	8,900	91.66	815,774.00	
WENDEL	3,400	127.80	434,520.00	
AEGON NV	208,000	6.03	1,254,240.00	
AGEAS	21,300	44.45	946,785.00	
ALLIANZ SE-REG	52,770	198.54	10,476,955.80	
ASSICURAZIONI GENERALI	147,000	16.56	2,434,320.00	
AXA	230,400	22.34	5,147,136.00	
CNP ASSURANCES	21,200	20.74	439,688.00	
HANNOVER RUECK SE	7,100	113.70	807,270.00	
MAPFRE SA	126,000	2.91	366,660.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	18,460	192.50	3,553,550.00	
NN GROUP NV	37,100	39.10	1,450,610.00	
POSTE ITALIANE SPA	64,000	8.10	518,784.00	
SAMPO OYJ-A SHS	52,700	44.00	2,318,800.00	
SCOR SE	20,600	33.25	684,950.00	
UNIPOLSAI SPA	107,000	2.20	235,400.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	14,400	57.16	823,104.00	
AMADEUS IT GROUP SA	51,100	63.08	3,223,388.00	

ATOS SE	11,200	111.20	1,245,440.00
CAPGEMINI SA	19,000	115.40	2,192,600.00
WIRECARD AG	14,000	120.50	1,687,000.00
DASSAULT SYSTEMES SA	15,000	110.00	1,650,000.00
SAP SE	116,300	96.74	11,250,862.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,700	85.50	829,350.00
NOKIA OYJ	680,000	5.30	3,604,000.00
INGENICO GROUP	6,700	74.28	497,676.00
ASML HOLDING NV	46,000	165.60	7,617,600.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	132,400	23.92	3,167,008.00
STMICROELECTRONICS NV	75,300	19.88	1,497,340.50
DEUTSCHE TELEKOM-REG	390,000	14.30	5,577,000.00
ELISA OYJ	17,200	36.71	631,412.00
ILIAD SA	3,150	169.15	532,822.50
KONINKLIJKE KPN NV	400,000	2.59	1,038,400.00
ORANGE SA	234,000	15.22	3,562,650.00
PROXIMUS	18,400	24.44	449,696.00
TELECOM ITALIA SPA	1,360,000	0.82	1,127,440.00
TELECOM ITALIA-RNC	680,000	0.71	485,656.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	97,000	4.13	401,095.00
TELEFONICA SA	555,000	8.33	4,626,480.00
1&1 DRILLISCH AG	5,900	63.20	372,880.00
ELECTRICITE DE FRANCE	67,000	11.86	794,620.00
ENDESA S.A.	35,600	19.47	693,132.00
ENEL SPA	966,000	5.24	5,061,840.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	291,000	3.05	889,296.00
FORTUM OYJ	50,000	19.73	986,500.00
IBERDROLA SA	681,000	6.53	4,452,378.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	48,200	17.22	830,245.00
TERNA SPA	163,000	4.96	808,643.00
GAS NATURAL SDG	41,200	21.47	884,564.00
E.ON SE	260,000	9.52	2,477,280.00
ENGIE	213,000	14.60	3,109,800.00
INNOGY SE	17,100	36.50	624,150.00
RWE AG	62,800	19.97	1,254,430.00

	SUEZ	45,000	11.93	536,850.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	56,900	20.57	1,170,433.00	
	AMUNDI SA	6,700	71.72	480,524.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	241,000	11.54	2,781,140.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	23,100	115.60	2,670,360.00	
	NATIXIS	111,000	6.81	756,576.00	
	UNIPER SE	22,400	26.90	602,560.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,430	447.20	639,496.00	
	QIAGEN NV	24,500	29.18	714,910.00	
	BUREAU VERITAS SA	30,100	21.86	657,986.00	
	RANDSTAD NV	13,500	53.16	717,660.00	
	RELX NV	116,000	18.00	2,088,000.00	
	TELEPERFORMANCE	7,100	136.80	971,280.00	
	WOLTERS KLUWER	35,100	45.19	1,586,169.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	41,300	39.66	1,637,958.00	
	VONOVIA SE	58,000	40.72	2,361,760.00	
	小計銘柄数：240			484,140,739.44	
				(63,049,648,497)	
	組入時価比率：13.0%			13.6%	
英ボンド	WOOD GROUP (JOHN) PLC	73,000	5.97	435,810.00	
	BP PLC	2,338,000	5.72	13,373,360.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	537,000	26.33	14,141,895.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	442,800	27.22	12,053,016.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	15,500	45.97	712,535.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	21,800	34.07	742,726.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	155,400	17.50	2,719,500.00	
	ANTOFAGASTA PLC	48,000	10.13	486,480.00	
	BHP BILLITON PLC	251,000	16.31	4,095,818.00	
	FRESNILLO PLC	26,000	12.99	337,870.00	
	GLENCORE PLC	1,451,000	3.66	5,322,993.50	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	10,900	61.00	664,900.00	
	RIO TINTO PLC-REG	143,700	41.27	5,930,499.00	
	MONDI PLC	44,800	20.01	896,448.00	
	BAE SYSTEMS PLC	372,000	6.14	2,284,080.00	
	COBHAM PLC	254,000	1.17	298,958.00	

MEGGITT PLC	95,000	4.82	457,900.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	199,000	8.30	1,651,700.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC -C	14,129,000	0.00	14,129.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	584,000	2.33	1,360,720.00
DCC PLC	11,000	73.95	813,450.00
SMITHS GROUP PLC	47,000	16.55	777,850.00
IMI PLC	32,000	10.77	344,640.00
WEIR GROUP PLC	26,600	22.56	600,096.00
ASHTED GROUP PLC	59,000	22.00	1,298,000.00
BUNZLE	40,500	22.02	891,810.00
FERGUSON PLC	29,100	56.14	1,633,674.00
TRAVIS PERKINS PLC	30,200	13.04	393,959.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	7.55	195,596.80
G4S PLC	179,000	2.57	460,030.00
ROYAL MAIL PLC	108,000	6.03	652,104.00
EASYJET PLC	16,300	16.58	270,254.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	113,000	5.68	642,066.00
PERSIMMON PLC	35,500	27.73	984,415.00
TAYLOR WIMPEY PLC	366,000	1.93	709,491.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	14,800	41.42	613,016.00
BURBERRY GROUP PLC	50,400	17.70	892,080.00
CARNIVAL PLC	22,000	47.97	1,055,340.00
COMPASS GROUP PLC	184,300	15.08	2,779,244.00
GVC HOLDINGS PLC	63,000	8.72	549,675.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	21,300	47.94	1,021,122.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	89,000	3.72	331,347.00
TUI AG-DI	53,900	17.27	931,122.50
WHITBREAD PLC	20,600	42.42	873,852.00
ITV PLC	400,000	1.51	604,800.00
PEARSON	91,000	9.14	831,922.00
SKY PLC	121,000	13.54	1,638,340.00
WPP PLC	151,000	12.70	1,918,455.00
MARKS & SPENCER PLC	181,000	2.93	530,692.00
NEXT PLC	17,900	52.46	939,034.00
KINGFISHER PLC	246,000	2.88	709,218.00

MORRISON SUPERMARKETS	246,000	2.45	603,684.00
SAINSBURY	199,000	2.99	596,005.00
TESCO PLC	1,161,000	2.41	2,807,298.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	22,300	24.66	549,918.00
DIAGEO PLC	295,400	26.59	7,856,163.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,200	27.41	1,156,702.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	271,100	39.09	10,597,299.00
IMPERIAL BRANDS PLC	111,100	27.80	3,088,580.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	78,200	57.26	4,477,732.00
UNILEVER PLC	146,000	40.93	5,976,510.00
CONVATEC GROUP PLC-WI	157,000	2.33	366,752.00
SMITH & NEPHEW PLC	102,000	12.99	1,324,980.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	7.06	264,900.00
SHIRE PLC	107,900	39.78	4,292,262.00
ASTRAZENECA PLC	149,800	52.57	7,874,986.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	582,000	14.78	8,605,452.00
BARCLAYS PLC	2,024,000	2.10	4,269,628.00
HSBC HOLDINGS PLC	2,362,000	7.19	16,994,590.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,530,000	0.66	5,675,862.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	425,000	2.76	1,173,425.00
STANDARD CHARTERED PLC	383,000	7.49	2,869,436.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	311,000	3.69	1,148,212.00
ADMIRAL GROUP PLC	22,900	20.12	460,748.00
AVIVA PLC	479,000	5.40	2,589,474.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	157,000	3.71	582,784.00
LEGAL & GENERAL	704,000	2.79	1,965,568.00
OLD MUTUAL PLC	574,000	2.55	1,463,700.00
PRUDENTIAL PLC	306,500	19.34	5,929,242.50
RSA INSURANCE GROUP PLC	124,000	6.35	787,896.00
AUTO TRADER GROUP PLC	119,000	3.70	440,300.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	51,600	12.58	649,128.00
SAGE GROUP PLC (THE)	129,000	6.62	854,238.00
BT GROUP PLC	993,000	2.38	2,369,298.00
VODAFONE GROUP PLC	3,160,000	2.08	6,594,920.00
SSE PLC	122,000	14.04	1,712,880.00

	CENTRICA PLC	650,000	1.55	1,010,425.00	
	NATIONAL GRID PLC	397,000	8.44	3,351,871.00	
	SEVERN TRENT PLC	27,700	20.11	557,047.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	76,000	7.75	589,000.00	
	3I GROUP PLC	114,000	9.56	1,090,524.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	30,300	18.66	565,549.50	
	INVESTEC PLC	75,000	5.74	430,500.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	36,300	44.02	1,597,926.00	
	SCHRODERS PLC	13,300	34.17	454,461.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	62,000	11.75	728,500.00	
	CAPITA PLC	76,000	2.00	152,152.00	
	EXPERIAN PLC	106,700	17.38	1,854,446.00	
	INTERTEK GROUP PLC	19,700	50.58	996,426.00	
	RELX PLC	127,000	15.83	2,011,045.00	
小計	銘柄数：100			229,228,457.80	
				(34,132,117,366)	
	組入時価比率：7.0%			7.3%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	24.04	622,636.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	980	629.00	616,420.00	
	GIVAUDAN-REG	1,091	2,266.00	2,472,206.00	
	SIKA AG-BR	249	7,505.00	1,868,745.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	53,700	55.02	2,954,574.00	
	GEBERIT AG-REG	4,360	445.60	1,942,816.00	
	ABB LTD	215,900	23.92	5,164,328.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,450	208.00	509,600.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,990	214.80	1,071,852.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6,500	156.55	1,017,575.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	62,000	96.38	5,975,560.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,540	476.10	1,685,394.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,000	88.40	530,400.00	
	DUFREY AG-REG	4,400	147.00	646,800.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	230	1,842.00	423,660.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	125	6,340.00	792,500.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	12	74,200.00	890,400.00	
	NESTLE SA-REG	367,400	77.40	28,436,760.00	

	SONOVA HOLDING AG-REG	5,800	165.90	962,220.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,280	686.00	878,080.00
	NOVARTIS-REG	262,700	77.70	20,411,790.00
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	83,000	226.00	18,758,000.00
	VIFOR PHARMA AG	5,700	157.00	894,900.00
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	4,300	93.55	402,265.00
	BALOISE HOLDING AG	5,800	155.70	903,060.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,860	357.90	1,381,494.00
	SWISS RE LTD	37,500	94.64	3,549,000.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,720	318.30	5,640,276.00
	SWISSCOM AG-REG	2,990	458.90	1,372,111.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	289,000	16.80	4,855,200.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,900	61.58	1,594,922.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,060	744.00	1,532,640.00
	UBS GROUP AG	434,000	16.21	7,037,310.00
	LONZA AG-REG	8,540	263.20	2,247,728.00
	ADECCO GROUP AG-REG	19,300	64.12	1,237,516.00
	SGS SA-REG	647	2,506.00	1,621,382.00
	SWISS PRIME SITE-REG	8,100	94.10	762,210.00
小計	銘柄数：37			133,664,330.00 (14,614,857,842)
	組入時価比率：3.0%			3.1%
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	21,700	264.60	5,741,820.00
	BOLIDEN AB	32,700	318.20	10,405,140.00
	ASSA ABLOY AB-B	118,400	191.05	22,620,320.00
	SKANSKA AB-B SHS	38,200	166.45	6,358,390.00
	ALFA LAVAL AB	35,000	229.20	8,022,000.00
	ATLAS COPCO AB-A	78,300	352.70	27,616,410.00
	ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	78,300	8.00	626,400.00
	ATLAS COPCO AB-B	45,000	318.20	14,319,000.00
	ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	45,000	8.00	360,000.00
	SANDVIK AB	131,000	159.70	20,920,700.00
	SKF AB-B SHARES	42,700	186.65	7,969,955.00
	VOLVO AB-B SHS	182,000	157.90	28,737,800.00
	SECURITAS AB-B SHS	39,000	141.40	5,514,600.00

	ELECTROLUX AB-B	29,700	231.80	6,884,460.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	45,000	86.50	3,892,500.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	115,000	145.24	16,702,600.00	
	ICA GRUPPEN AB	10,500	273.80	2,874,900.00	
	SWEDISH MATCH AB	21,500	412.60	8,870,900.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	73,000	233.50	17,045,500.00	
	GETINGE AB-B SHS	26,800	87.38	2,341,784.00	
	NORDEA BANK AB	362,000	90.64	32,811,680.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	175,000	86.14	15,074,500.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	181,000	100.50	18,190,500.00	
	SWEDBANK AB	106,900	195.70	20,920,330.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	20,600	197.20	4,062,320.00	
	INVESTOR AB-B SHS	53,900	386.00	20,805,400.00	
	KINNEVIK AB - B	26,600	320.30	8,519,980.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,600	605.50	2,785,300.00	
	ERICSSON LM-B	369,000	70.40	25,977,600.00	
	HEXAGON AB-B SHS	30,200	479.70	14,486,940.00	
	TELIA CO AB	330,000	43.80	14,454,000.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	8,200	563.00	4,616,600.00	
	TELE 2 AB-B SHS	42,000	113.95	4,785,900.00	
小計	銘柄数：33			405,316,229.00	
				(5,115,090,809)	
	組入時価比率：1.1%				1.1%
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	136,300	214.60	29,249,980.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	20,600	341.60	7,036,960.00	
	NORSK HYDRO	161,000	48.64	7,831,040.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	211.00	2,721,900.00	
	MARINE HARVEST ASA	46,700	175.50	8,195,850.00	
	ORKLA ASA	91,000	74.12	6,744,920.00	
	DNB ASA	117,000	155.75	18,222,750.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,000	128.00	3,200,000.00	
	TELENOR ASA	90,300	174.50	15,757,350.00	
小計	銘柄数：9			98,960,750.00	
				(1,346,855,807)	

	組入時価比率：0.3%			0.3%
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	11,400	578.20	6,591,480.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	27,100	316.90	8,587,990.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25,200	440.10	11,090,520.00
	ISS A/S	18,600	220.90	4,108,740.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	440	9,930.00	4,369,200.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S	800	10,535.00	8,428,000.00
	DSV A/S	22,100	514.40	11,368,240.00
	PANDORA A/S	12,400	692.80	8,590,720.00
	CARLSBERG B	12,600	713.20	8,986,320.00
	COLOPLAST-B	14,200	594.60	8,443,320.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	237.60	3,088,800.00
	GENMAB A/S	6,900	1,244.00	8,583,600.00
	H LUNDBECK A/S	8,200	411.30	3,372,660.00
	NOVO NORDISK A/S-B	220,600	300.20	66,224,120.00
	DANSKE BANK AS	88,100	215.20	18,959,120.00
	TRYG A/S	16,000	146.50	2,344,000.00
	ORSTED A/S	21,800	400.80	8,737,440.00
小計	銘柄数：17			191,874,270.00 (3,353,962,239)
	組入時価比率：0.7%			0.7%
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	29,100	30.43	885,513.00
	OIL SEARCH LTD	162,000	8.09	1,310,580.00
	ORIGIN ENERGY LTD	205,000	9.94	2,037,700.00
	SANTOS LTD.	212,000	6.25	1,325,000.00
	WOODSIDE PETROLEUM	110,700	32.35	3,581,145.00
	INCITEC PIVOT LTD	196,000	3.55	695,800.00
	ORICA LTD	42,000	18.62	782,040.00
	BORAL LTD	133,000	6.50	864,500.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	52,000	23.46	1,219,920.00
	AMCOR	134,000	13.97	1,871,980.00
	ALUMINA LTD	290,000	2.79	809,100.00
	BHP BILLITON LIMITED	380,500	32.19	12,248,295.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	67,000	17.35	1,162,450.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	187,000	4.83	903,210.00

NEWCREST MINING	89,000	21.92	1,950,880.00
RIO TINTO LTD	48,000	81.67	3,920,160.00
SOUTH32 LTD	614,000	3.85	2,363,900.00
CIMIC GROUP LTD	11,700	43.97	514,449.00
BRAMBLES LTD	189,000	9.97	1,884,330.00
AURIZON HOLDINGS LTD	239,000	4.42	1,056,380.00
SYDNEY AIRPORT	125,000	7.30	912,500.00
TRANSURBAN GROUP	267,000	12.04	3,214,680.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	63,000	27.29	1,719,270.00
CROWN RESORTS LTD	43,000	13.31	572,330.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	5,900	42.33	249,747.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	60.03	438,219.00
TABCORP HOLDINGS	218,400	4.28	934,752.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	3.45	182,850.00
WESFARMERS LIMITED	135,000	44.12	5,956,200.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	152,200	28.56	4,346,832.00
COCA-COLA AMATIL LTD	60,000	9.34	560,400.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	89,000	19.63	1,747,070.00
COCHLEAR LTD	6,700	194.22	1,301,274.00
HEALTHSCOPE LTD	230,000	2.48	570,400.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,800	65.33	1,032,214.00
SONIC HEALTHCARE LTD	49,000	23.65	1,158,850.00
CSL LIMITED	53,700	173.24	9,302,988.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	348,000	27.95	9,726,600.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	42,000	10.19	427,980.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	54,000	10.82	584,280.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	207,400	71.41	14,810,434.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	318,500	28.72	9,147,320.00
WESTPAC BANKING CORP	402,000	29.75	11,959,500.00
AMP LIMITED	344,000	4.08	1,403,520.00
CHALLENGER LIMITED	66,000	12.52	826,320.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	277,000	8.14	2,254,780.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	308,000	3.00	924,000.00
QBE INSURANCE	166,000	10.20	1,693,200.00
SUNCORP GROUP LTD	149,000	14.05	2,093,450.00

	REA GROUP LTD	6,900	83.62	576,978.00	
	COMPUTERSHARE LTD	56,000	17.82	997,920.00	
	TELSTRA CORP LTD	487,000	3.25	1,582,750.00	
	TPG TELECOM LTD	35,964	5.74	206,433.36	
	AUSNET SERVICES	230,000	1.75	402,500.00	
	APA GROUP	144,000	8.45	1,216,800.00	
	AGL ENERGY LTD	79,000	22.13	1,748,270.00	
	ASX LTD	21,900	61.95	1,356,705.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	37,800	112.87	4,266,486.00	
	SEEK LTD	40,000	20.67	826,800.00	
	小計 銘柄数：59			144,620,934.36	
				(11,864,701,454)	
	組入時価比率：2.4%			2.5%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	92,000	6.45	593,400.00	
	FLETCHER BUILDING LTD RTS	20,627	1.65	34,034.55	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	108,000	6.60	712,800.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	64,000	12.80	819,200.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	45,000	10.99	494,550.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	229,000	3.49	799,210.00	
	MERCURY NZ LTD	88,000	3.24	285,120.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	2.98	474,615.00	
	小計 銘柄数：8			4,212,929.55	
			(321,320,136)		
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	322,040	91.80	29,563,272.00	
	NWS HOLDINGS LTD	159,500	14.74	2,351,030.00	
	MTR CORP	181,000	45.10	8,163,100.00	
	MINTH GROUP LTD	82,000	37.90	3,107,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	156,000	46.35	7,230,600.00	
	LI & FUNG LTD	749,600	4.19	3,140,824.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	22.70	2,201,900.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	284,000	67.90	19,283,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	124,000	23.30	2,889,200.00	
	SANDS CHINA LTD	286,400	45.90	13,145,760.00	

SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	14.54	2,331,241.82	
SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	8.90	2,403,000.00	
WYNN MACAU LTD	184,000	29.90	5,501,600.00	
WH GROUP LIMITED	1,020,000	7.93	8,088,600.00	
BANK OF EAST ASIA	140,060	33.90	4,748,034.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	445,000	40.75	18,133,750.00	
HANG SENG BANK	92,000	196.50	18,078,000.00	
FIRST PACIFIC CO	226,000	3.90	881,400.00	
AIA GROUP LTD	1,428,000	69.70	99,531,600.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	38,000	102.60	3,898,800.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	449,600	10.40	4,675,840.00	
PCCW LTD	550,000	4.91	2,700,500.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	75,000	62.30	4,672,500.00	
CLP HLDGS	198,000	81.85	16,206,300.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	163,000	59.20	9,649,600.00	
HONG KONG & CHINA GAS	960,289	16.62	15,960,003.18	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	138,000	257.00	35,466,000.00	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	450,000	3.95	1,777,500.00	
CK ASSET HOLDINGS LTD	298,040	67.15	20,013,386.00	
HANG LUNG GROUP LTD	103,000	24.15	2,487,450.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	18.56	4,658,560.00	
HENDERSON LAND	132,599	49.80	6,603,430.20	
HYSAN DEVELOPMENT	65,000	44.40	2,886,000.00	
KERRY PROPERTIES	79,000	38.00	3,002,000.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	679,666	11.28	7,666,632.48	
SINO LAND CO.LTD	360,000	13.20	4,752,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	173,000	124.90	21,607,700.00	
SWIRE PACIFIC-A	53,500	77.25	4,132,875.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	146,000	28.80	4,204,800.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	147,000	59.70	8,775,900.00	
WHARF(HOLDING)	134,000	25.35	3,396,900.00	
WHEELOK & COMPANY LTD	98,000	56.00	5,488,000.00	
小計銘柄数：42			445,456,988.68	
			(6,240,852,411)	
組入時価比率：1.3%				1.3%

シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	198,000	3.48	689,040.00	
	KEPPEL CORP.	178,000	8.20	1,459,600.00	
	SEBACORP INDUSTRIES	99,040	3.09	306,033.60	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	270,000	1.19	321,300.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	63,040	11.11	700,374.40	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	250,000	2.34	585,000.00	
	SATS LTD	77,000	5.57	428,890.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	720,000	1.16	835,200.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	187,000	2.71	506,770.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	33.88	338,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.36	338,407.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	175,000	3.25	568,750.00	
	DBS GROUP HLDGS	214,000	28.76	6,154,640.00	
	OCBC-ORD	367,000	13.14	4,822,380.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	160,000	29.28	4,684,800.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	965,000	3.54	3,416,100.00	
	STARHUB LTD	69,000	2.22	153,180.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	93,000	7.72	717,960.00	
	CAPITALAND LIMITED	285,000	3.62	1,031,700.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	51,000	12.52	638,520.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	8.58	557,700.00	
小計	銘柄数：21			29,255,145.20	
				(2,386,342,193)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シケル	FRUTAROM	4,800	339.30	1,628,640.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	16.33	1,486,030.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,800	411.60	1,152,480.00	
	BANK HAPOLIM BM	125,000	25.74	3,217,500.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	178,000	21.94	3,905,320.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	67.71	1,151,070.00	
	NICE LTD	6,800	355.90	2,420,120.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	280,000	4.25	1,191,120.00	
	AZRIELI GROUP	4,100	164.90	676,090.00	
	小計	銘柄数：9			16,828,370.00

				(516,462,675)	
		組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計				466,657,145,037	(466,657,145,037)

(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(2018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	175,605.00	
		小計	509,000	175,605.00	
		銘柄数：1		(19,309,525)	
		組入時価比率：0.0%		0.2%	
	合計			19,309,525	(19,309,525)
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	42,800	804,640.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,000	1,428,240.00	
		AMERICAN TOWER CORP	50,800	7,007,860.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	132,000	1,342,440.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,300	2,701,236.00	
		BOSTON PROPERTIES	17,700	2,199,225.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	37,000	543,900.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,500	915,075.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	59,000	374,650.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	48,300	5,013,057.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,300	2,573,856.00	
		DUKE REALTY CORP	43,600	1,251,320.00	
		EQUINIX INC	9,120	3,540,110.40	
		EQUITY RESIDENTIAL	43,400	2,715,104.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,590	1,851,201.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,300	1,442,943.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,900	1,055,629.00	
		GGP INC	68,200	1,384,460.00	

	HCP INC	57,100	1,363,548.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	88,000	1,813,680.00	
	INVITATION HOMES INC	34,000	806,820.00	
	IRON MOUNTAIN INC	31,300	1,046,046.00	
	KIMCO REALTY CORP	51,000	737,970.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,900	734,981.00	
	MACERICH CO /THE	14,200	816,216.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,700	1,267,250.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	17,100	685,881.00	
	PROLOGIS INC	63,400	4,134,948.00	
	PUBLIC STORAGE	18,300	3,871,182.00	
	REALTY INCOME CORP	32,100	1,697,127.00	
	REGENCY CENTERS CORP	17,000	997,050.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	13,800	2,193,372.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	36,900	5,901,786.00	
	SL GREEN REALTY CORP	11,000	1,110,010.00	
	UDR INC	30,800	1,121,120.00	
	VENTAS INC	42,800	2,274,820.00	
	VEREIT INC	109,000	761,910.00	
	VORNADO REALTY TRUST	20,500	1,433,565.00	
	WELLTOWER INC	43,500	2,409,030.00	
	WEYERHAEUSER CO	88,200	3,214,890.00	
小計	銘柄数：40	1,496,410	78,538,148.40	
			(8,636,054,798)	
	組入時価比率：1.8%		76.1%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	281,520.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	396,305.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6,900	198,030.00	
小計	銘柄数：3	37,400	875,855.00	
			(74,964,429)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	4,000	380,400.00	
	GECINA SA	5,600	809,760.00	
	ICADE	3,700	292,855.00	
	KLEPIERRE	24,900	855,813.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	11,680	2,296,872.00	

小計	銘柄数：5	49,880	4,635,700.00 (603,707,211)	5.3%
	組入時価比率：0.1%			
英ポンド	BRITISH LAND	114,000	780,672.00	
	HAMMERSON PLC	89,000	492,170.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	89,000	873,624.00	
	SEGRO PLC	118,000	762,516.00	
小計	銘柄数：4	410,000	2,908,982.00 (433,147,419)	3.8%
	組入時価比率：0.1%			
豪ドル	DEXUS	126,000	1,234,800.00	
	GOODMAN GROUP	214,000	1,964,520.00	
	GPT GROUP	203,000	1,004,850.00	
	LENDLEASE GROUP	69,000	1,248,900.00	
	MIRVAC GROUP	430,000	993,300.00	
	SCENTRE GROUP	642,000	2,664,300.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	274,000	1,169,980.00	
	VICINITY CENTRES	373,000	954,880.00	
	WESTFIELD CORP	234,000	2,143,440.00	
小計	銘柄数：9	2,565,000	13,378,970.00 (1,097,610,698)	9.7%
	組入時価比率：0.2%			
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,900,600.00	
	LINK REIT	264,000	17,688,000.00	
小計	銘柄数：2	524,000	19,588,600.00 (274,436,286)	2.4%
	組入時価比率：0.1%			
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	282,000	747,300.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	299,972	527,950.72	
	CAPITALAND MALL TRUST	310,000	647,900.00	
	SUNTEC REIT	300,000	570,000.00	
小計	銘柄数：4	1,191,972	2,493,150.72 (203,366,304)	1.8%
	組入時価比率：0.0%			
合計			11,323,287,145 (11,323,287,145)	

合計		11,342,596,670	
		(11,342,596,670)	

(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	2018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				
株価指数先物取引				
買建	7,115,694,359	-	7,357,799,411	242,105,052
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	545,169,360	-	549,734,000	4,564,640
米ドル	545,169,360	-	549,734,000	4,564,640
合計	-	-	-	246,669,692

(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)

(2018年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	67,587,941
国債証券	23,375,637,570
未収利息	40,721,930
前払費用	5,803,855
流動資産合計	23,489,751,296
資産合計	23,489,751,296
負債の部	
流動負債	
未払解約金	18,866,929
未払利息	95
流動負債合計	18,867,024
負債合計	18,867,024
純資産の部	
元本等	
元本	17,409,321,655
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,061,562,617
元本等合計	23,470,884,272
純資産合計	23,470,884,272
負債純資産合計	23,489,751,296

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)

2018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	1.3482円
(10,000口当たり純資産額)	(13,482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 2017年 5月11日 至 2018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

2018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 ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2018年 5月10日現在	2017年 5月11日
期首	12,541,631,820円
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	12,541,631,820円
同期中における追加設定元本額	23,462,757,889円
同期中における一部解約元本額	18,595,068,054円
期末元本額	17,409,321,655円
期末元本額の内訳*	

バランスセレクト30	559,648,333円
バランスセレクト50	624,671,139円
バランスセレクト70	262,490,528円
ネクストコア	297,879,584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）	8,975,496,449円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	24,456,198円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	50,014,102円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	23,038,550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）	4,449,027,531円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	129,862,802円
野村DC運用戦略ファンド	1,880,490,046円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	132,246,393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(2018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(2018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378回	260,000,000	260,735,800	
		国庫債券 利付(2年)第379回	380,000,000	381,151,400	
		国庫債券 利付(2年)第380回	100,000,000	100,324,000	
		国庫債券 利付(2年)第381回	100,000,000	100,343,000	
		国庫債券 利付(2年)第382回	100,000,000	100,364,000	
		国庫債券 利付(2年)第383回	100,000,000	100,384,000	
		国庫債券 利付(2年)第385回	100,000,000	100,425,000	
		国庫債券 利付(2年)第386回	170,000,000	170,753,100	
		国庫債券 利付(2年)第387回	100,000,000	100,464,000	
		国庫債券 利付(5年)第118回	110,000,000	110,414,700	
		国庫債券 利付(5年)第120回	110,000,000	110,501,600	
		国庫債券 利付(5年)第121回	80,000,000	80,256,000	
		国庫債券 利付(5年)第122回	120,000,000	120,445,200	
		国庫債券 利付(5年)第123回	280,000,000	281,170,400	

国庫債券 利付（5年）第124回	320,000,000	321,520,000	
国庫債券 利付（5年）第125回	430,000,000	432,287,600	
国庫債券 利付（5年）第126回	360,000,000	362,120,400	
国庫債券 利付（5年）第127回	310,000,000	311,999,500	
国庫債券 利付（5年）第128回	350,000,000	352,401,000	
国庫債券 利付（5年）第129回	300,000,000	302,226,000	
国庫債券 利付（5年）第130回	210,000,000	211,635,900	
国庫債券 利付（5年）第131回	180,000,000	181,463,400	
国庫債券 利付（5年）第132回	210,000,000	211,776,600	
国庫債券 利付（5年）第133回	200,000,000	201,796,000	
国庫債券 利付（5年）第134回	250,000,000	252,372,500	
国庫債券 利付（5年）第135回	80,000,000	80,800,000	
国庫債券 利付（40年）第1回	10,000,000	14,429,900	
国庫債券 利付（40年）第2回	30,000,000	41,897,700	
国庫債券 利付（40年）第3回	60,000,000	84,211,200	
国庫債券 利付（40年）第4回	35,000,000	49,353,850	
国庫債券 利付（40年）第5回	40,000,000	54,232,400	
国庫債券 利付（40年）第6回	60,000,000	79,727,400	
国庫債券 利付（40年）第7回	50,000,000	63,422,500	
国庫債券 利付（40年）第8回	60,000,000	70,548,000	
国庫債券 利付（40年）第9回	90,000,000	76,751,100	
国庫債券 利付（40年）第10回	110,000,000	110,958,100	
国庫債券 利付（10年）第301回	45,000,000	45,819,900	
国庫債券 利付（10年）第302回	40,000,000	40,684,400	
国庫債券 利付（10年）第303回	45,000,000	45,945,000	
国庫債券 利付（10年）第304回	30,000,000	30,589,200	
国庫債券 利付（10年）第305回	110,000,000	112,547,600	
国庫債券 利付（10年）第306回	45,000,000	46,281,600	
国庫債券 利付（10年）第307回	30,000,000	30,798,600	
国庫債券 利付（10年）第308回	30,000,000	30,907,500	
国庫債券 利付（10年）第309回	130,000,000	133,381,300	

回			
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	30,799,200	
国庫債券 利付(10年)第311回	190,000,000	194,161,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	72,429,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	31,053,900	
国庫債券 利付(10年)第315回	70,000,000	72,895,200	
国庫債券 利付(10年)第316回	130,000,000	134,971,200	
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	31,235,100	
国庫債券 利付(10年)第318回	80,000,000	83,024,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	70,000,000	73,083,500	
国庫債券 利付(10年)第320回	90,000,000	93,638,700	
国庫債券 利付(10年)第321回	150,000,000	156,450,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	130,000,000	135,085,600	
国庫債券 利付(10年)第323回	70,000,000	72,903,600	
国庫債券 利付(10年)第324回	150,000,000	155,602,500	
国庫債券 利付(10年)第325回	210,000,000	218,278,200	
国庫債券 利付(10年)第326回	240,000,000	248,892,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	180,000,000	187,504,200	
国庫債券 利付(10年)第328回	230,000,000	237,856,800	
国庫債券 利付(10年)第329回	280,000,000	292,866,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	220,000,000	230,549,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	120,000,000	124,460,400	

国庫債券 利付（10年）第332回	220,000,000	228,494,200	
国庫債券 利付（10年）第333回	240,000,000	249,602,400	
国庫債券 利付（10年）第334回	200,000,000	208,222,000	
国庫債券 利付（10年）第335回	230,000,000	238,300,700	
国庫債券 利付（10年）第336回	60,000,000	62,229,600	
国庫債券 利付（10年）第337回	150,000,000	153,583,500	
国庫債券 利付（10年）第338回	240,000,000	247,514,400	
国庫債券 利付（10年）第339回	280,000,000	288,988,000	
国庫債券 利付（10年）第340回	335,000,000	346,008,100	
国庫債券 利付（10年）第341回	270,000,000	277,006,500	
国庫債券 利付（10年）第342回	280,000,000	282,864,400	
国庫債券 利付（10年）第343回	230,000,000	232,240,200	
国庫債券 利付（10年）第344回	240,000,000	242,208,000	
国庫債券 利付（10年）第345回	250,000,000	252,152,500	
国庫債券 利付（10年）第346回	330,000,000	332,626,800	
国庫債券 利付（10年）第347回	260,000,000	261,890,200	
国庫債券 利付（10年）第348回	160,000,000	161,120,000	
国庫債券 利付（10年）第349回	220,000,000	221,368,400	
国庫債券 利付（10年）第350回	190,000,000	191,024,100	
国庫債券 利付（30年）第3回	40,000,000	50,276,400	
国庫債券 利付（30年）第5回	10,000,000	12,594,700	
国庫債券 利付（30年）第6回	10,000,000	12,923,400	
国庫債券 利付（30年）第7回	15,000,000	19,270,800	

国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	24,398,800	
国庫債券 利付(30年)第9回	20,000,000	23,274,800	
国庫債券 利付(30年)第10回	30,000,000	33,628,800	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	12,093,500	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	12,699,200	
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	12,563,200	
国庫債券 利付(30年)第14回	30,000,000	39,596,400	
国庫債券 利付(30年)第15回	10,000,000	13,380,700	
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	13,410,200	
国庫債券 利付(30年)第17回	20,000,000	26,561,200	
国庫債券 利付(30年)第18回	20,000,000	26,270,800	
国庫債券 利付(30年)第19回	10,000,000	13,169,100	
国庫債券 利付(30年)第20回	10,000,000	13,518,900	
国庫債券 利付(30年)第21回	10,000,000	13,201,900	
国庫債券 利付(30年)第22回	20,000,000	27,135,800	
国庫債券 利付(30年)第23回	40,000,000	54,368,000	
国庫債券 利付(30年)第24回	10,000,000	13,615,400	
国庫債券 利付(30年)第25回	20,000,000	26,536,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	80,000,000	107,772,000	
国庫債券 利付(30年)第27回	20,000,000	27,375,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	30,000,000	41,172,900	
国庫債券 利付(30年)第29回	120,000,000	163,038,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	50,000,000	67,189,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	60,000,000	79,686,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	90,000,000	121,800,600	
国庫債券 利付(30年)第33回	130,000,000	168,373,400	
国庫債券 利付(30年)第34回	60,000,000	80,510,400	
国庫債券 利付(30年)第35回	122,000,000	158,950,140	
国庫債券 利付(30年)第36回	70,000,000	91,406,000	
国庫債券 利付(30年)第37回	80,000,000	102,869,600	
国庫債券 利付(30年)第38回	90,000,000	113,977,800	
国庫債券 利付(30年)第39回	80,000,000	103,144,800	
国庫債券 利付(30年)第40回	30,000,000	38,007,900	
国庫債券 利付(30年)第41回	60,000,000	74,651,400	
国庫債券 利付(30年)第42回	60,000,000	74,689,800	
国庫債券 利付(30年)第43回	60,000,000	74,729,400	

国庫債券 利付(30年)第44回	50,000,000	62,376,500	
国庫債券 利付(30年)第45回	90,000,000	107,967,600	
国庫債券 利付(30年)第46回	100,000,000	119,984,000	
国庫債券 利付(30年)第47回	60,000,000	73,476,000	
国庫債券 利付(30年)第48回	80,000,000	94,047,200	
国庫債券 利付(30年)第49回	60,000,000	70,534,200	
国庫債券 利付(30年)第50回	110,000,000	112,695,000	
国庫債券 利付(30年)第51回	50,000,000	44,776,500	
国庫債券 利付(30年)第52回	40,000,000	37,793,600	
国庫債券 利付(30年)第53回	60,000,000	58,153,800	
国庫債券 利付(30年)第54回	70,000,000	71,423,100	
国庫債券 利付(30年)第55回	80,000,000	81,540,000	
国庫債券 利付(30年)第56回	80,000,000	81,452,000	
国庫債券 利付(30年)第57回	60,000,000	61,022,400	
国庫債券 利付(30年)第58回	80,000,000	81,272,800	
国庫債券 利付(20年)第43回	10,000,000	10,414,000	
国庫債券 利付(20年)第44回	10,000,000	10,489,700	
国庫債券 利付(20年)第45回	10,000,000	10,471,000	
国庫債券 利付(20年)第46回	5,000,000	5,247,050	
国庫債券 利付(20年)第47回	15,000,000	15,826,950	
国庫債券 利付(20年)第48回	30,000,000	32,064,900	
国庫債券 利付(20年)第49回	40,000,000	42,557,200	
国庫債券 利付(20年)第52回	25,000,000	26,874,750	
国庫債券 利付(20年)第53回	10,000,000	10,803,100	
国庫債券 利付(20年)第54回	10,000,000	10,839,400	
国庫債券 利付(20年)第55回	10,000,000	10,817,900	
国庫債券 利付(20年)第56回	10,000,000	10,868,800	
国庫債券 利付(20年)第57回	10,000,000	10,827,500	
国庫債券 利付(20年)第58回	10,000,000	10,878,500	
国庫債券 利付(20年)第59回	30,000,000	32,501,400	
国庫債券 利付(20年)第60回	10,000,000	10,694,800	
国庫債券 利付(20年)第61回	10,000,000	10,534,300	
国庫債券 利付(20年)第62回	10,000,000	10,459,500	
国庫債券 利付(20年)第63回	10,000,000	10,972,900	
国庫債券 利付(20年)第64回	10,000,000	11,069,100	
国庫債券 利付(20年)第65回	10,000,000	11,115,900	

国庫債券 利付（20年）第66回	20,000,000	22,119,200	
国庫債券 利付（20年）第67回	10,000,000	11,161,900	
国庫債券 利付（20年）第68回	10,000,000	11,338,400	
国庫債券 利付（20年）第69回	30,000,000	33,828,900	
国庫債券 利付（20年）第70回	40,000,000	46,048,000	
国庫債券 利付（20年）第71回	10,000,000	11,389,300	
国庫債券 利付（20年）第72回	20,000,000	22,751,400	
国庫債券 利付（20年）第73回	10,000,000	11,359,700	
国庫債券 利付（20年）第74回	10,000,000	11,426,000	
国庫債券 利付（20年）第75回	40,000,000	45,901,600	
国庫債券 利付（20年）第76回	17,000,000	19,274,430	
国庫債券 利付（20年）第77回	15,000,000	17,110,050	
国庫債券 利付（20年）第78回	10,000,000	11,387,200	
国庫債券 利付（20年）第79回	10,000,000	11,458,500	
国庫債券 利付（20年）第80回	10,000,000	11,529,900	
国庫債券 利付（20年）第81回	10,000,000	11,506,200	
国庫債券 利付（20年）第82回	15,000,000	17,370,000	
国庫債券 利付（20年）第83回	15,000,000	17,443,800	
国庫債券 利付（20年）第84回	50,000,000	57,764,500	
国庫債券 利付（20年）第85回	13,000,000	15,174,900	
国庫債券 利付（20年）第86回	10,000,000	11,830,400	
国庫債券 利付（20年）第88回	20,000,000	23,768,800	
国庫債券 利付（20年）第90回	20,000,000	23,698,800	
国庫債券 利付（20年）第91回	10,000,000	11,933,100	
国庫債券 利付（20年）第92回	30,000,000	35,409,600	
国庫債券 利付（20年）第93回	20,000,000	23,522,000	
国庫債券 利付（20年）第94回	20,000,000	23,699,000	
国庫債券 利付（20年）第95回	10,000,000	12,073,200	
国庫債券 利付（20年）第96回	15,000,000	17,836,950	
国庫債券 利付（20年）第97回	50,000,000	60,157,000	
国庫債券 利付（20年）第99回	30,000,000	35,934,000	
国庫債券 利付（20年）第100回	20,000,000	24,229,800	
国庫債券 利付（20年）第101回	20,000,000	24,622,200	
国庫債券 利付（20年）第102回	20,000,000	24,715,000	

国庫債券 利付(20年)第103回	25,000,000	30,642,500
国庫債券 利付(20年)第104回	10,000,000	12,055,900
国庫債券 利付(20年)第105回	70,000,000	84,660,800
国庫債券 利付(20年)第106回	10,000,000	12,197,400
国庫債券 利付(20年)第107回	20,000,000	24,263,400
国庫債券 利付(20年)第108回	80,000,000	95,369,600
国庫債券 利付(20年)第109回	30,000,000	35,857,800
国庫債券 利付(20年)第110回	90,000,000	109,509,300
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	12,314,100
国庫債券 利付(20年)第112回	35,000,000	42,714,700
国庫債券 利付(20年)第113回	110,000,000	134,638,900
国庫債券 利付(20年)第114回	130,000,000	159,567,200
国庫債券 利付(20年)第115回	50,000,000	61,944,500
国庫債券 利付(20年)第116回	10,000,000	12,424,500
国庫債券 利付(20年)第117回	60,000,000	73,845,600
国庫債券 利付(20年)第118回	40,000,000	48,888,400
国庫債券 利付(20年)第119回	50,000,000	59,919,000
国庫債券 利付(20年)第120回	110,000,000	129,200,500
国庫債券 利付(20年)第121回	100,000,000	121,312,000
国庫債券 利付(20年)第122回	20,000,000	24,019,600
国庫債券 利付(20年)第123回	100,000,000	124,134,000
国庫債券 利付(20年)第124回	20,000,000	24,564,200

回			
国庫債券 利付(20年)第125回	100,000,000	125,621,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	30,000,000	36,930,900	
国庫債券 利付(20年)第127回	20,000,000	24,368,800	
国庫債券 利付(20年)第128回	70,000,000	85,474,200	
国庫債券 利付(20年)第129回	20,000,000	24,165,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	70,000,000	84,740,600	
国庫債券 利付(20年)第131回	35,000,000	41,913,900	
国庫債券 利付(20年)第132回	30,000,000	35,962,500	
国庫債券 利付(20年)第133回	70,000,000	84,896,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	30,000,000	36,447,600	
国庫債券 利付(20年)第135回	30,000,000	36,043,200	
国庫債券 利付(20年)第136回	30,000,000	35,639,100	
国庫債券 利付(20年)第137回	40,000,000	48,134,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	50,000,000	58,798,500	
国庫債券 利付(20年)第139回	10,000,000	11,896,600	
国庫債券 利付(20年)第140回	140,000,000	168,728,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	140,000,000	168,852,600	
国庫債券 利付(20年)第142回	20,000,000	24,421,400	
国庫債券 利付(20年)第143回	130,000,000	155,140,700	
国庫債券 利付(20年)第144回	30,000,000	35,371,800	
国庫債券 利付(20年)第145回	80,000,000	96,748,000	

	国庫債券 利付(20年)第146回	110,000,000	133,103,300	
	国庫債券 利付(20年)第147回	210,000,000	251,084,400	
	国庫債券 利付(20年)第148回	70,000,000	82,652,500	
	国庫債券 利付(20年)第149回	140,000,000	165,433,800	
	国庫債券 利付(20年)第150回	90,000,000	105,030,000	
	国庫債券 利付(20年)第151回	120,000,000	136,225,200	
	国庫債券 利付(20年)第152回	100,000,000	113,440,000	
	国庫債券 利付(20年)第153回	120,000,000	138,068,400	
	国庫債券 利付(20年)第154回	90,000,000	102,019,500	
	国庫債券 利付(20年)第155回	100,000,000	109,961,000	
	国庫債券 利付(20年)第156回	80,000,000	79,668,000	
	国庫債券 利付(20年)第157回	120,000,000	115,072,800	
	国庫債券 利付(20年)第158回	110,000,000	111,026,300	
	国庫債券 利付(20年)第159回	110,000,000	112,735,700	
	国庫債券 利付(20年)第160回	80,000,000	83,259,200	
	国庫債券 利付(20年)第161回	70,000,000	71,470,000	
	国庫債券 利付(20年)第162回	140,000,000	142,597,000	
	国庫債券 利付(20年)第163回	90,000,000	91,525,500	
	国庫債券 利付(20年)第164回	90,000,000	89,676,000	
小計	銘柄数：257 組入時価比率：99.6%	21,612,000,000	23,375,637,570 100.0%	
合計			23,375,637,570	

(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)

(2018年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	70,468,283
コール・ローン	4,293,159,346
国債証券	610,338,447,382
派生商品評価勘定	20,264,241
未収利息	5,900,191,511
前払費用	220,573,004
流動資産合計	620,843,103,767
資産合計	620,843,103,767
負債の部	
流動負債	
未払金	3,620,006,591
未払解約金	642,037,447
未払利息	6,061
その他未払費用	7,834,200
流動負債合計	4,269,884,299
負債合計	4,269,884,299
純資産の部	
元本等	
元本	276,186,579,860
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	340,386,639,608
元本等合計	616,573,219,468
純資産合計	616,573,219,468
負債純資産合計	620,843,103,767

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <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)

2018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	2.2325円
(10,000口当たり純資産額)	(22,325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 2017年 5月11日 至 2018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、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2018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

2018年 5月10日現在	
期首	2017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	302,031,601,625円
同期中における追加設定元本額	30,697,775,468円
同期中における一部解約元本額	56,542,797,233円
期末元本額	276,186,579,860円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	91,988,817円
バランスセレクト50	94,062,808円
バランスセレクト70	78,743,549円
野村外国債券インデックスファンド	289,090,123円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,057,545,159円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	26,079,236,407円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,490,687,361円
野村資産設計ファンド2015	33,497,454円
野村資産設計ファンド2020	40,139,034円
野村資産設計ファンド2025	48,376,731円
野村資産設計ファンド2030	42,936,105円
野村資産設計ファンド2035	29,327,373円
野村資産設計ファンド2040	62,777,476円
野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	156,845,660,313円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	5,377,925,941円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	8,759,668,164円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	1,922,556,267円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	1,096,013,046円
野村資産設計ファンド2045	6,601,120円
野村インデックスファンド・外国債券	763,635,039円
マイ・ロード	8,721,369,818円
ネクストコア	498,613,002円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	110,681,254円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,872,007,163円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	664,341,689円
野村資産設計ファンド2050	7,517,517円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,811,097円

野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	1,530,317円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	1,258,110円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	922,539円
のむらップ・ファンド(やや保守型)		407,883,922円
のむらップ・ファンド(やや積極型)		193,325,509円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,222,782円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,536,664円
インデックス・ブレンド(タイプ)		4,079,352円
インデックス・ブレンド(タイプ)		704,372円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,917,626円
野村6資産均等バランス		51,647,278円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)		5,616,286,529円
NEXT FUNDS 外国債券・シティ世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信		287,384,725円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券		229,462,754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)		11,479,625円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)		1,853,428,064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)		560,319,155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)		3,049,671,026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)		1,547,863,471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)		2,903,420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)		16,057,021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)		811,114円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)		5,367,089,850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)		138,399,327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)		517,783,138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)		171,253,090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)		207,995,190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)		224,302,890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)		2,119,961,341円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)		995,516,422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)		1,716,212,474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)		942,037,923円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)		4,014,450円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)		7,513,925円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)		6,981,460円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)		546,770,118円
マイバランス30(確定拠出年金向け)		2,321,785,728円
マイバランス50(確定拠出年金向け)		3,208,836,041円
マイバランス70(確定拠出年金向け)		2,944,450,873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)		13,213,433,425円
マイバランスDC30		1,524,923,135円
マイバランスDC50		916,838,883円
マイバランスDC70		608,200,515円
野村DC外国債券インデックスファンド		4,111,162,995円
野村DC運用戦略ファンド		3,138,164,454円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)		211,880,272円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)		61,310,350円

マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	8,043,709円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	11,750,613円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	896,553円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	4,189,734円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	757,455円
野村資産設計ファンド(DC)2030	175,627円
野村資産設計ファンド(DC)2040	200,703円
野村資産設計ファンド(DC)2050	239,787円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	342,147円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	335,196円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	94,241円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	230,624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(2018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(2018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	19,840,000.00	21,260,573.76	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	14,419,955.92	
		US TREASURY BOND	22,100,000.00	25,984,764.52	
		US TREASURY BOND	13,800,000.00	16,093,170.84	
		US TREASURY BOND	47,100,000.00	45,629,961.90	
		US TREASURY BOND	39,200,000.00	47,459,561.52	
		US TREASURY BOND	18,800,000.00	23,772,451.48	
		US TREASURY BOND	21,400,000.00	26,926,380.94	
		US TREASURY BOND	17,000,000.00	20,733,358.10	
		US TREASURY BOND	6,300,000.00	7,570,827.81	
		US TREASURY BOND	800,000.00	964,437.44	
		US TREASURY BOND	100,000.00	119,359.37	
		US TREASURY BOND	19,500,000.00	18,613,358.40	
		US TREASURY BOND	16,000,000.00	17,698,748.80	

US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,950,390.50	
US TREASURY N/B	6,600,000.00	6,558,233.88	
US TREASURY N/B	27,600,000.00	27,819,936.12	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,844,089.60	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,382,500.00	
US TREASURY N/B	23,600,000.00	23,396,263.56	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,076,620.91	
US TREASURY N/B	900,000.00	885,902.31	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,378,835.92	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,836,429.49	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,876,769.46	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	10,303,945.05	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,365,194.95	
US TREASURY N/B	600,000.00	592,804.68	
US TREASURY N/B	32,400,000.00	32,887,263.60	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,796,484.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,945,976.30	
US TREASURY N/B	26,750,000.00	26,477,273.05	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,941,757.70	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,328,007.35	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,268,105.44	
US TREASURY N/B	50,800,000.00	51,492,546.24	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,601,655.92	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,773,140.58	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,741,718.00	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,326,171.74	
US TREASURY N/B	600,000.00	589,007.76	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,962,343.60	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,286,937.50	
US TREASURY N/B	51,800,000.00	52,797,554.04	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,195,862.95	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,639,882.61	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,899,218.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,918,945.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,896,562.40	

US TREASURY N/B	21,300,000.00	20,850,702.06	
US TREASURY N/B	600,000.00	588,257.76	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,549,773.27	
US TREASURY N/B	46,200,000.00	47,055,420.72	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,089,906.12	
US TREASURY N/B	500,000.00	489,121.05	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,358,131.36	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,156,843.44	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,771,484.00	
US TREASURY N/B	13,400,000.00	13,229,359.04	
US TREASURY N/B	32,180,000.00	32,211,423.77	
US TREASURY N/B	36,200,000.00	35,812,544.16	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,914,687.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,027.34	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,566,374.88	
US TREASURY N/B	700,000.00	679,109.34	
US TREASURY N/B	52,600,000.00	52,600,000.00	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,483,796.19	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	975,078.10	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,752,718.24	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,368,171.84	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,268,015.51	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,836,320.17	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	46,977,201.98	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,964,218.60	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,396,093.75	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,663,562.50	
US TREASURY N/B	600,000.00	576,328.08	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,764,601.29	
US TREASURY N/B	39,300,000.00	39,785,107.41	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,038,572.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	288,398.43	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	33,407,655.40	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,559,803.96	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	24,823,646.54	

US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,131,757.63	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,682,499.20	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,387,874.16	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	24,677,382.18	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,767,187.20	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,575,413.97	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,130,686.88	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,790,624.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,642,500.00	
US TREASURY N/B	13,600,000.00	13,172,874.32	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	32,786,413.22	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,032,522.89	
US TREASURY N/B	500,000.00	483,906.25	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,526,429.44	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,256,937.50	
US TREASURY N/B	38,400,000.00	36,912,000.00	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	20,574,468.75	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,747,656.25	
US TREASURY N/B	27,100,000.00	26,394,974.53	
US TREASURY N/B	600,000.00	575,671.86	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	963,281.20	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	9,813,566.02	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,912,812.40	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,658,593.00	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,402,679.44	
US TREASURY N/B	29,800,000.00	28,896,687.50	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	20,956,718.20	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,371,795.60	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	22,755,562.50	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,169,287.99	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,331,405.70	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,718,750.00	
US TREASURY N/B	49,600,000.00	47,077,373.76	
US TREASURY N/B	34,400,000.00	32,432,750.00	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	19,275,351.04	

US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,062,015.14	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	12,882,475.52	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,698,936.24	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,038,234.06	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	26,603,186.16	
US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,611,331.60	
US TREASURY N/B	30,100,000.00	29,427,451.62	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,548,828.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,719,218.60	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,374,468.40	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	32,815,967.04	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,330,605.25	
US TREASURY N/B	44,700,000.00	42,108,794.64	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,358,562.50	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	34,284,960.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,158,241.70	
US TREASURY N/B	24,500,000.00	22,961,093.75	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	47,859,660.29	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,811,875.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	722,624.96	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,782,656.20	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,031,093.10	
US TREASURY N/B	26,200,000.00	24,693,500.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,711,828.08	
US TREASURY N/B	500,000.00	489,375.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,973,125.00	
US TREASURY N/B	11,100,000.00	13,861,557.90	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,602,500.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	6,401,953.00	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,400,468.68	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,065,312.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	118,062.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	122,031.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	120,195.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	124,210.93	

	US TREASURY N/B	13,500,000.00	16,245,350.55	
	US TREASURY N/B	200,000.00	224,765.62	
	US TREASURY N/B	12,800,000.00	15,166,999.04	
	US TREASURY N/B	14,000,000.00	17,737,343.40	
	US TREASURY N/B	6,700,000.00	8,089,726.06	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,506,093.75	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,504,218.75	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,407,187.50	
	US TREASURY N/B	9,200,000.00	8,607,750.00	
	US TREASURY N/B	17,600,000.00	16,450,500.00	
	US TREASURY N/B	24,200,000.00	24,158,405.04	
	US TREASURY N/B	15,400,000.00	16,699,375.00	
	US TREASURY N/B	13,200,000.00	14,320,967.76	
	US TREASURY N/B	18,900,000.00	19,676,670.93	
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,946,249.60	
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	35,940,020.67	
	US TREASURY N/B	27,600,000.00	24,378,561.12	
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,128,678.06	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,899,843.60	
	US TREASURY N/B	15,100,000.00	14,687,108.62	
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	14,073,748.80	
	US TREASURY N/B	15,700,000.00	13,796,375.00	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	1,913,132.64	
	US TREASURY N/B	12,700,000.00	12,037,218.75	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,122,468.75	
	US TREASURY N/B	900,000.00	830,109.33	
小計	銘柄数：180	2,387,670,000.00	2,389,838,361.40	
			(262,786,626,219)	
	組入時価比率：42.6%		43.0%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,626,775.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	396,396.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	8,168,880.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	550,000.00	543,207.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	7,992,720.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,055,324.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	16,300,000.00	16,172,534.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,039,772.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,402,945.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	7,909,638.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,050,000.00	10,396,222.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	287,106.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,632,168.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,378,333.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,441,438.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	7,998,592.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,373,162.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,250,360.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,650,000.00	5,313,305.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	710,568.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	96,525.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,180,000.00	9,500,073.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	5,948,628.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	8,594,812.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,100,000.00	7,741,022.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	11,839,184.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	319,530.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	218,804.00	
小計	銘柄数：28	142,030,000.00	153,348,024.40 (13,125,057,408)	
	組入時価比率：2.1%		2.2%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	107,000,000.00	103,072,030.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,600,000.00	53,146,514.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	126,000,000.00	122,180,940.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	71,100,000.00	68,305,059.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	39,000,000.00	43,806,750.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,000,000.00	7,098,800.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	86,300,000.00	85,147,895.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,600,000.00	52,372,144.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	46,375,845.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,933,500.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	55,683,000.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	41,300,000.00	44,008,454.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	63,381,450.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	15,215,055.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	84,406,850.00	
	銘柄数：15 組入時価比率：0.8%	845,600,000.00	854,134,286.00 (4,800,234,687) 0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	3,985,364.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	6,383,817.56	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,002,360.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	2,095,812.36	
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	7,618,560.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,565,040.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	7,994,000.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,024,300.00	
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,020,002.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,033,902.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,017,192.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	995,900.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	991,490.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,827,865.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,004,500.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,009,871.40	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,083,358.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,400,000.00	8,335,818.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	8,126,745.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	988,971.20	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,342,992.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,077,743.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,900,000.00	15,890,401.50	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,000,000.00	15,766,939.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	103,099.85	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,700,000.00	9,238,218.54	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,900,000.00	12,726,098.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,800,000.00	3,915,066.66		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	25,250,000.00	27,397,547.85
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	206,374.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,900,000.00	12,271,975.37
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,600,000.00	3,619,707.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,900,000.00	12,729,018.91
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,062,848.26
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	17,724,868.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,250,000.00	5,319,142.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,900,000.00	14,785,559.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,400,000.00	8,990,931.92
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,900,000.00	17,290,752.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,700,000.00	7,968,980.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	510,134.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	951,264.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	19,811,032.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,458,605.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,441,742.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,494,156.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,161,396.43
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,736,350.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,088,134.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	427,400.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	8,040,556.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	12,290,502.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	11,474,286.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	3,903,443.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	4,224,290.00
BUNDES OblIGATION	100,000.00	101,253.00
BUNDES OblIGATION	800,000.00	808,816.00
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,036,940.00
BUNDES OblIGATION	1,600,000.00	1,620,352.00
BUNDES OblIGATION	3,300,000.00	3,333,429.00
BUNDES OblIGATION	900,000.00	906,525.00
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,003,020.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	523,985.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,700,000.00	7,133,155.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,414,224.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,161,973.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,360,409.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	7,811,230.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	9,134,328.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,300,000.00	15,512,640.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	7,037,355.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,368,400.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,603,780.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,610,124.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,600,000.00	12,836,212.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,400,000.00	20,807,094.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	5,159,237.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,626,840.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,300,000.00	10,861,968.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,500,000.00	10,719,345.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,323,286.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	304,407.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	969,710.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	689,304.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	29,953,406.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,000,660.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	8,901,480.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	994,380.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	4,812,530.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	10,602,865.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,371,403.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,800,000.00	12,320,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000.00	7,261,104.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	11,250,267.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	12,433,161.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	5,654,945.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	8,425,657.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	8,116,172.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,001,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,242,035.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,840,716.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,630,000.00	16,569,831.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	408,416.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	8,765,982.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	31,573,084.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,819,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	17,735,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,036,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,593,639.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,996,610.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000,000.00	11,085,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,090.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,924,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	16,571,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,550,000.00	2,561,602.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,493,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,760,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	309,390.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	828,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	8,973,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,182,110.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,100,000.00	24,469,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	709,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,303,246.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	8,789,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	16,789,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	19,049,790.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,140,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,668,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	8,541,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,919,044.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,033,777.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,118,200.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	12,839,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	17,660,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	23,289,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	9,203,110.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	26,135,990.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	26,128,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	465,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	11,233,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,028,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,900,000.00	11,962,490.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,062,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	940,221.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,948,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000.00	18,171,790.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,600,000.00	15,592,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,692,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,190,983.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	2,947,840.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,735.60	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,504.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,019,084.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,226,536.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,440,192.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,286,541.60	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,385,393.60	
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,206,820.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,256,100.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,033,977.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,002,552.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,700,000.00	3,238,242.30	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	682,710.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,072,683.20	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	7,113,414.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,300,000.00	10,467,375.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	2,825,859.68	

FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,110,952.04	
FRANCE (GOVT OF)	2,700,000.00	2,726,792.10	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	2,993,250.00	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	7,066,331.30	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,058,680.00	
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	14,115,504.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,005,822.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	98,780.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,125,106.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,158,756.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	500,000.00	566,050.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,500,000.00	5,846,065.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	15,962,202.56	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,700,000.00	28,630,410.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,033,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	13,236,650.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	16,938,047.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	16,324,593.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,420,931.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	10,231,077.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000.00	38,375,365.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,282,315.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	28,031,473.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,246,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	40,944,700.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,200,000.00	10,942,480.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000.00	36,498,507.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,000,000.00	9,503,325.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,100,000.00	26,248,065.06	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,300,000.00	11,308,795.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	7,831,810.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	28,052,045.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,700,000.00	24,236,610.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,200,000.00	8,419,762.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,700,000.00	6,149,030.00	

IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	100,000.00	105,411.00	
IRISH GOVERNMENT	400,000.00	437,088.00	
IRISH GOVERNMENT	680,000.00	745,912.40	
IRISH GOVERNMENT	500,000.00	566,000.00	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,234,208.50	
IRISH GOVERNMENT	600,000.00	595,746.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	3,600,000.00	3,723,840.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	1,800,000.00	1,847,160.00	
IRISH TSY 1% 2026	3,000,000.00	3,073,620.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,239,860.00	
IRISH TSY 2% 2045	3,500,000.00	3,710,238.00	
IRISH TSY 2022	1,800,000.00	1,795,680.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,600,000.00	7,792,620.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,223,733.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,900,000.00	2,941,923.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,800,000.00	5,224,560.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,350,000.00	7,086,345.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	403,472.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,652,626.65	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,946,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	5,831,632.48	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,525,588.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	992,298.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	14,978,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	993,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,004,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,028,411.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,666,760.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,004,150.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	5,337,380.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	6,019,960.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,200,000.00	9,565,581.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,900,000.00	5,321,420.91	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,410,245.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	102,755.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	505,525.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,519,190.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,254,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,448,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	5,787,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,989,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,550,000.00	2,777,342.95	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,200,000.00	4,566,660.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,372,215.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,227,900.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,026,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,100,000.00	9,168,958.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,183,050.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,200,000.00	7,785,991.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,477,207.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,001,550.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	756,945.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	6,150,000.00	7,285,659.00	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,426,224.00	
	SPANISH GOVERNMENT	12,500,000.00	18,955,000.00	
	SPANISH GOVERNMENT	3,000,000.00	4,053,177.00	
小計	銘柄数：259	1,571,790,000.00	1,933,713,929.78 (251,827,565,075)	
	組入時価比率：40.8%		41.3%	
英ポンド	UK TREASURY	1,880,000.00	1,903,086.40	
	UK TREASURY	100,000.00	104,010.00	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,072,470.00	
	UK TREASURY	19,890,000.00	20,402,764.20	
	UK TREASURY	7,050,000.00	7,529,893.50	
	UK TREASURY	3,300,000.00	3,355,737.00	
	UK TREASURY	7,540,000.00	9,173,390.20	
	UK TREASURY	670,000.00	732,229.60	
	UK TREASURY	4,250,000.00	4,734,882.50	
	UK TREASURY	9,200,000.00	8,994,196.00	
	UK TREASURY	10,100,000.00	10,398,556.00	

	UK TREASURY	2,100,000.00	2,055,711.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,386,518.00	
	UK TREASURY	9,750,000.00	10,648,462.50	
	UK TREASURY	11,850,000.00	14,738,319.00	
	UK TREASURY	10,030,000.00	12,518,643.60	
	UK TREASURY	6,100,000.00	8,754,720.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,691,580.00	
	UK TREASURY	5,750,000.00	7,553,200.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,118,560.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	3,970,100.00	
	UK TREASURY	2,500,000.00	2,449,250.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	3,438,270.00	
	UK TREASURY	5,800,000.00	8,227,880.00	
	UK TREASURY	2,800,000.00	4,024,160.00	
	UK TREASURY	5,900,000.00	8,933,190.00	
	UK TREASURY	20,100,000.00	26,809,380.00	
	UK TREASURY	6,400,000.00	9,732,480.00	
	UK TREASURY	3,600,000.00	3,300,120.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,429,995.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,113,625.00	
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,516,800.00	
	UK TREASURY	400,000.00	509,800.00	
	UK TREASURY	4,750,000.00	7,714,950.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	20,300,000.00	25,852,050.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	7,100,000.00	12,013,200.00	
小計	銘柄数：36	228,410,000.00	286,902,179.50	
			(42,719,734,527)	
	組入時価比率：6.9%		7.0%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	4,800,000.00	5,181,120.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,150,000.00	4,389,210.00	
小計	銘柄数：2	7,950,000.00	9,570,330.00	
			(1,046,419,882)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	9,700,000.00	11,090,010.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	48,850,000.00	56,096,897.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	28,300,000.00	30,459,870.15	

小計	SWEDISH GOVERNMENT	33,750,000.00	38,802,375.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,468,009.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,100,000.00	14,147,729.91	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,800,000.00	24,762,373.88	
	銘柄数：7 組入時価比率：0.4%	164,500,000.00	187,827,266.04 (2,370,380,097) 0.4%	
小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	21,200,000.00	22,002,420.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	29,726,580.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	16,000,000.00	16,412,000.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	48,447,100.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,723,500.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,612,815.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,527,520.00	
	銘柄数：7 組入時価比率：0.3%	128,700,000.00	135,451,935.00 (1,843,500,835) 0.3%	
小計	KINGDOM OF DENMARK	10,300,000.00	11,019,970.00	
	KINGDOM OF DENMARK	5,000,000.00	5,092,250.00	
	KINGDOM OF DENMARK	37,100,000.00	41,351,660.00	
	KINGDOM OF DENMARK	32,470,000.00	35,072,470.50	
	KINGDOM OF DENMARK	31,400,000.00	34,753,520.00	
	KINGDOM OF DENMARK	12,200,000.00	12,122,530.00	
	KINGDOM OF DENMARK	42,000,000.00	69,947,220.00	
	銘柄数：7 組入時価比率：0.6%	170,470,000.00	209,359,620.50 (3,659,606,166) 0.6%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	102,230.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	6,034,020.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,094,022.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	33,318,710.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	15,166,575.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	700,000.00	700,630.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,404,250.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000.00	3,399,660.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,354,375.00	

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	19,700,000.00	19,916,700.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,500,000.00	9,065,375.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,071,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,114,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,559,880.00	
	銘柄数：14	120,000,000.00	127,301,927.00	(3,889,073,869)
	組入時価比率：0.6%			0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	303,463.89	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,850,000.00	13,450,851.86	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,300,000.00	12,190,756.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	11,370,167.94	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,055,843.18	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,995,920.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	298,275.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,263,164.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,283,880.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,994,073.75	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	14,187,078.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,700,000.00	13,548,702.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,193,722.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	9,814,870.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,195,033.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,520,382.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,387,260.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,891,094.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,728,271.62	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,907,651.84	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,415,960.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,210,280.00	
小計	銘柄数：22	147,930,000.00	157,206,702.49	(12,897,237,872)
	組入時価比率：2.1%			2.1%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,500,000.00	2,518,766.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,200,000.00	4,316,765.04	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	2,992,516.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	971,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	295,140.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,456,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,057,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,271,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,091,310.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,176,900.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,424,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	850,000.00	902,317.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,179,550.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	766,104.00	
小計	銘柄数：14	29,930,000.00	30,419,668.54	
			(2,481,332,362)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	802,732.72	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	400,372.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,401,200.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,708,215.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,600,000.00	6,573,600.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,407,680.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,063,955.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,758,363.95	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,516,698.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	498,062.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,000,000.00	12,704,900.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,182,005.54	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,823,780.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	590,400.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	8,912,695.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,591,877.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,740,477.78	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,881,295.82	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,713,050.15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,248,200.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,498,468.70	

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	367,240.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	840,150.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	9,771,456.99
	銘柄数：24 組入時価比率：0.5%	109,700,000.00	108,996,879.55 (3,034,473,126) 0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,300,000.00	9,295,425.33
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	20,300,000.00	19,911,955.35
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,700,000.00	26,633,930.85
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	71,300,000.00	80,129,941.73
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	28,000,000.00	26,236,803.60
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	25,563,000.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,400,000.00	43,524,703.36
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	6,624,292.08
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00	28,323,825.75
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	29,833,600.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	8,523,419.52
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	22,470,522.48
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	71,100,000.00	66,676,214.88
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	50,200,000.00	47,075,823.08
	小計	銘柄数：14 組入時価比率：0.6%	469,600,000.00
合計			610,338,447,382 (610,338,447,382)

(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	2018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)
市場取引以外の取引			
為替予約取引			

買建	3,552,564,759	-	3,572,829,000	20,264,241
米ドル	1,536,852,840	-	1,550,277,000	13,424,160
カナダドル	84,429,300	-	85,580,000	1,150,700
ユーロ	1,597,975,683	-	1,601,829,000	3,853,317
英ポンド	251,496,436	-	253,113,000	1,616,564
豪ドル	81,810,500	-	82,030,000	219,500
合計	3,552,564,759	-	3,572,829,000	20,264,241

(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（確定拠出年金向け）

2018年5月31日現在

資産総額	156,499,217円
負債総額	71,850円
純資産総額（ - ）	156,427,367円
発行済口数	77,960,678口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0065円

（参考）国内株式マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	407,205,888,253円
負債総額	31,748,456,987円
純資産総額（ - ）	375,457,431,266円
発行済口数	220,736,199,224口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7009円

（参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	484,522,640,018円
負債総額	1,914,345,619円
純資産総額（ - ）	482,608,294,399円
発行済口数	185,900,056,903口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5961円

（参考）国内債券マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	26,108,525,752円
負債総額	651,808,224円
純資産総額（ - ）	25,456,717,528円
発行済口数	18,854,286,821口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3502円

（参考）外国債券マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	605,342,550,242円
負債総額	1,836,635,114円
純資産総額（ - ）	603,505,915,128円
発行済口数	275,693,761,638口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1890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、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

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

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる一部解約の実行の請求の受け、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

2018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2018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	1,004	26,560,834
単位型株式投資信託	118	632,408
追加型公社債投資信託	14	5,560,843
単位型公社債投資信託	388	1,771,029
合計	1,524	34,525,115

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(2017年4月1日から2018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 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018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			127		919
金銭の信託			52,247		47,936
有価証券			15,700		22,600
前払金			33		0
前払費用			2		26
未収入金			495		464
未収委託者報酬			16,287		24,059
未収運用受託報酬			7,481		6,764
繰延税金資産			1,661		2,111
その他			42		181
貸倒引当金			11		15
流動資産計			94,066		105,048
固定資産					
有形固定資産					
建物	2	377		348	
器具備品	2	624		525	
無形固定資産					
ソフトウェア		7,184		7,156	

その他		0		0
投資その他の資産			13,165	13,825
投資有価証券		1,233		1,184
関係会社株式		8,124		9,033
従業員長期貸付金		-		36
長期差入保証金		44		54
長期前払費用		37		36
前払年金費用		2,594		2,350
繰延税金資産		960		962
その他		170		168
貸倒引当金		-		0
固定資産計			21,353	21,857
資産合計			115,419	126,906

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018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			98		133
未払金	1		10,401		17,853
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		31		31	
未払手数料		5,242		7,884	
関係会社未払金		4,438		7,930	
その他未払金		687		2,005	
未払費用	1		9,461		12,441
未払法人税等			714		2,241
前受収益			39		33
賞与引当金			4,339		4,626
流動負債計			25,055		37,329
固定負債					
退職給付引当金			2,947		2,938
時効後支払損引当金			538		548
固定負債計			3,485		3,486
負債合計			28,540		40,816
(純資産の部)					
株主資本			86,837		86,078
資本金			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			55,927		55,168
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,242		54,483	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,635		29,876	
評価・換算差額等			41		11
その他有価証券評価差額金			41		11
純資産合計			86,878		86,090

負債・純資産合計		115,419	126,906
----------	--	---------	---------

(2)【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		96,594	115,907
運用受託報酬		28,466	26,200
その他営業収益		266	338
営業収益計		125,327	142,447
営業費用			
支払手数料		39,785	45,252
広告宣伝費		1,011	1,079
公告費		0	0
調査費		26,758	30,516
調査費		5,095	5,830
委託調査費		21,662	24,685
委託計算費		1,290	1,376
営業雑経費		4,408	5,464
通信費		162	125
印刷費		940	966
協会費		76	79
諸経費		3,228	4,293
営業費用計		73,254	83,689
一般管理費			
給料		11,269	11,716
役員報酬	2	301	425
給料・手当		6,923	6,856
賞与		4,044	4,433
交際費		126	132
旅費交通費		469	482
租税公課		898	1,107
不動産賃借料		1,222	1,221
退職給付費用		1,223	1,119
固定資産減価償却費		2,730	2,706
諸経費		8,118	9,122
一般管理費計		26,059	27,609
営業利益		26,012	31,148

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	(自 2017年4月1日 至 2018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	7,397		4,031	
受取利息		0		4	
金銭の信託運用益		684		-	
その他		379		362	
営業外収益計			8,461		4,398
営業外費用					
支払利息		17		2	
金銭の信託運用損		-		312	
時効後支払損引当金繰入額		16		13	
為替差損		33		46	
その他		9		31	
営業外費用計			77		405
經常利益			34,397		35,141
特別利益					
投資有価証券等売却益		26		20	
関係会社清算益		41		-	
株式報酬受入益		59		75	
特別利益計			126		95
特別損失					
投資有価証券等評価損		6		2	
固定資産除却損	3	9		58	
特別損失計			15		60
税引前当期純利益			34,507		35,176
法人税、住民税及び事業税			7,147		10,775
法人税等調整額			1,722		439
当期純利益			25,637		24,840

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金		利益 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	30,635	55,927	86,837
当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(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	41	41	86,878
当期変動額			
剰余金の配当			25,598
当期純利益			24,840
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	29	29	29
当期変動額合計	29	29	788
当期末残高	11	11	86,090

[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、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016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 style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <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业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付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 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	---

[未適用の会計基準等]

- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)
- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日)

日)

(1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異の取扱いが見直され、また(分類1)に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

(2) 適用予定日

2019年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[表示方法の変更に関する注記]

(貸借対照表)

前事業年度において、流動負債の「その他未払金」に含めて表示していた「関係会社未払金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より区分掲記しております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「その他未払金」に表示していた4,438百万円は、「関係会社未払金」4,438百万円として組み替えております。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2017年3月31日)	当事業年度末 (2018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。 未払費用 938百万円	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。 未払費用 1,781百万円
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	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 708百万円 器具備品 3,491 合計 4,200

損益計算書関係

前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018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 5,252百万円 支払利息 17	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 4,026百万円 支払利息 2
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		3. 固定資産除却損	
建物	-百万円	建物	4百万円
器具備品	0	器具備品	0
ソフトウェア	9	ソフトウェア	53
ア		ア	
合計	9	合計	58

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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

2016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	2016年3月31日
効力発生日	2016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

2016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	2016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	2016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	2016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

2017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	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017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	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

金融商品関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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、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

2017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	-
関係会社未払金	4,438	4,438	-
その他未払金	687	687	-
(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	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	15,700	-	-	-

合計	91,843	-	-	-
----	--------	---	---	---

当事業年度（自 2017年 4月 1日 至 2018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

2018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	919	919	-
(2)金銭の信託	47,936	47,936	-
(3)未収委託者報酬	24,059	24,059	-
(4)未収運用受託報酬	6,764	6,764	-
(5)有価証券及び投資有価証券	22,600	22,600	-
その他有価証券	22,600	22,600	-
資産計	102,279	102,279	-
(6)未払金	17,853	17,853	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	7,884	7,884	-
関係会社未払金	7,930	7,930	-
その他未払金	2,005	2,005	-
(7)未払費用	12,441	12,441	-
(8)未払法人税等	2,241	2,241	-
負債計	32,536	32,536	-

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1,184百万円、関係会社株式9,033百万円）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	919	-	-	-
金銭の信託	47,936	-	-	-
未収委託者報酬	24,059	-	-	-
未収運用受託報酬	6,764	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	22,600	-	-	-
合計	102,279	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2016年 4月 1日 至 2017年 3月 31日）

1．売買目的有価証券(2017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(2017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(2017年 3月 31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2017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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 売買目的有価証券(2018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(2018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(2018年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2018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	22,600	22,600	-
小計	22,600	22,600	-
合計	22,600	22,600	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券(自 2017年4月1日 至 2018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 2016年4月1日 至 2017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	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

確定給付型企業年金制度の割引率	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。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398

(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	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373

(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	18,163 百万円
年金資産	17,373
	790
非積立型制度の退職給付債務	3,235
未積立退職給付債務	4,025
未認識数理計算上の差異	3,768
未認識過去勤務費用	331
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588
退職給付引当金	2,938
前払年金費用	2,350
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	929 百万円
利息費用	167
期待運用収益	414
数理計算上の差異の費用処理額	244
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	887

(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	47%
株式	41%
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

確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
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、195百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2017年3月31日)	当事業年度末 (2018年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,345	賞与引当金 1,434
退職給付引当金 913	退職給付引当金 910
投資有価証券評価減 417	投資有価証券評価減 417
未払事業税 110	未払事業税 409
関係会社株式評価減 247	関係会社株式評価減 247
ゴルフ会員権評価減 212	ゴルフ会員権評価減 207
減価償却超過額 171	減価償却超過額 171
時効後支払損引当金 166	時効後支払損引当金 169
子会社株式売却損 148	子会社株式売却損 148
未払子会社役務提供費用 -	未払子会社役務提供費用 121
未払社会保険料 85	未払社会保険料 107
関係会社株式譲渡益 88	関係会社株式譲渡益 -
その他 274	その他 197
繰延税金資産小計 4,183	繰延税金資産小計 4,543
評価性引当額 739	評価性引当額 735
繰延税金資産合計 3,444	繰延税金資産合計 3,808
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 18	その他有価証券評価差額金 5
前払年金費用 804	前払年金費用 728
繰延税金負債合計 822	繰延税金負債合計 733
繰延税金資産の純額 2,621	繰延税金資産の純額 3,074
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 31.0%	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 0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 6.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 3.4%
タックスヘイブン税制 0.7%	タックスヘイブン税制 1.8%
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 0.5%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.3%
その他 0.2%	その他 0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 25.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.3%

セグメント情報等

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017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 2017年4月1日 至 2018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 2016年4月1日 至 2017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 hands 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、2016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 hands 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。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018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)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息 の支払	2	未払費用	-

(イ) 子会社等

該当はありません。

(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)	37,482	未払手数料	6,691

(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) 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 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,867円41銭	1株当たり純資産額	16,714円33銭
1株当たり当期純利益	4,977円49銭	1株当たり当期純利益	4,822円68銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,637百万円	損益計算書上の当期純利益	24,840百万円
普通株式に係る当期純利益	25,637百万円	普通株式に係る当期純利益	24,840百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

【重要な後発事象】

当社は、2018年4月6日付で、香港の金融持株会社である8 Limited(エイト・リミテッド、以下「エイト・リミテッド」)の株式の14.9%を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社(以下「エイト証券」)の株式の78.3%を取得しました。当社のエイト・リミテッド及びエイト証券に対する出資額は、それぞれ約11億円及び約16億円であり、いずれも4月上旬に払込みを行っております。

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。

* 2018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 西日本シティ銀行	85,745百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

* 2018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

取扱販売会社として、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・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

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
2017年 7月27日	有価証券届出書
2017年 7月27日	有価証券報告書
2018年 1月25日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年 1月25日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2018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 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 郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津 村 健 二 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2017年4月1日から2018年3月31日までの第59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2018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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は2018年4月6日付でエイト・リミテッドの株式を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社の株式を取得している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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

2018年6月22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	伊藤志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスセレクト70（確定拠出年金向け）の2017年5月11日から2018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（確定拠出年金向け）の2018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。