

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年7月27日提出
【計算期間】	第15期(自 平成27年5月12日至 平成28年5月10日)
【ファンド名】	国内債券・株式バランスファンド（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】

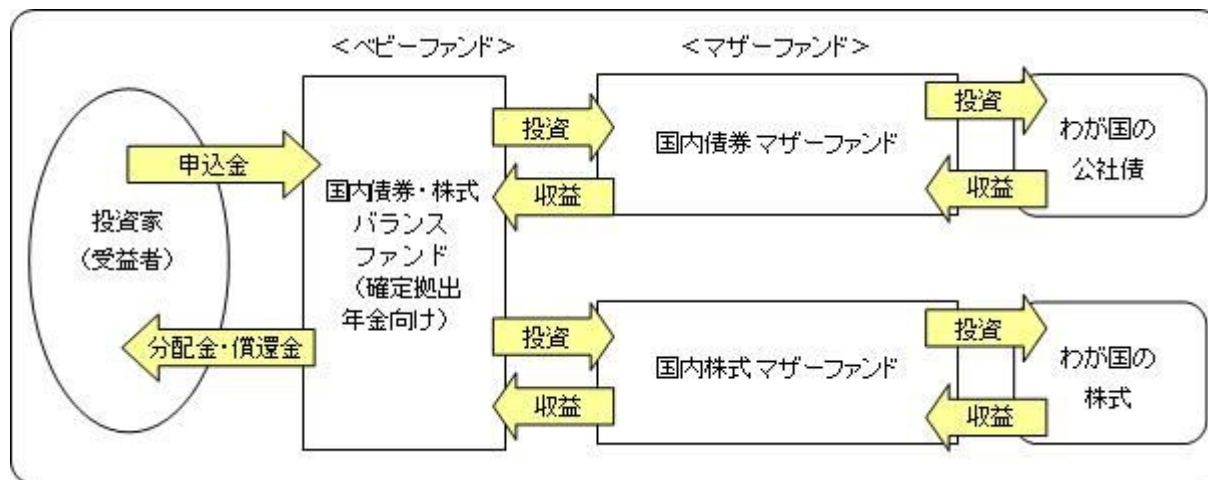
ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

わが国の公社債および株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目指して運用を行います。

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



分配金は無手数料で再投資されます。  
 ファンドは、マザーファンドのほかに、公社債および株式に直接投資する場合があります。  
 各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。

## 信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、2,000億円です。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。

## &lt;商品分類&gt;

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。

(国内債券・株式バランスファンド(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	<b>国内</b>	株式	<b>インデックス型</b>
	海外	債券	
<b>追加型</b>	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		<b>資産複合</b>	

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	<b>年1回</b>	グローバル		
一般				
大型株	年2回	<b>日本</b>		日経225
中小型株	年4回	北米	<b>ファミリーファンド</b>	
債券	年6回	欧州		
一般	(隔月)	アジア		TOPIX
公債	年12回	オセアニア		
社債	(毎月)	中南米		
その他債券	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	<b>その他</b>
クレジット属性 ( )	その他	アフリカ		<b>(合成指数)</b>
不動産投信	( )	中近東 (中東)		
<b>その他資産</b> <b>(投資信託証券</b> <b>(資産複合</b> <b>(株式、債券)</b> <b>資産配分固定型))</b>		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。

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は

以下の通りです。（平成22年7月1日現在）

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

[ 投資対象地域による区分 ]

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

[ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

[ 独立した区分 ]

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

[ 補足分類 ]

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

< 属性区分表定義 >

[ 投資対象資産による属性区分 ]

株式

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

債券

- (1) 一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- (2) 公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (3) 社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (4) その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (5) 格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

- (1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[ 投資形態による属性区分 ]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

[ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

[ 特殊型 ]

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

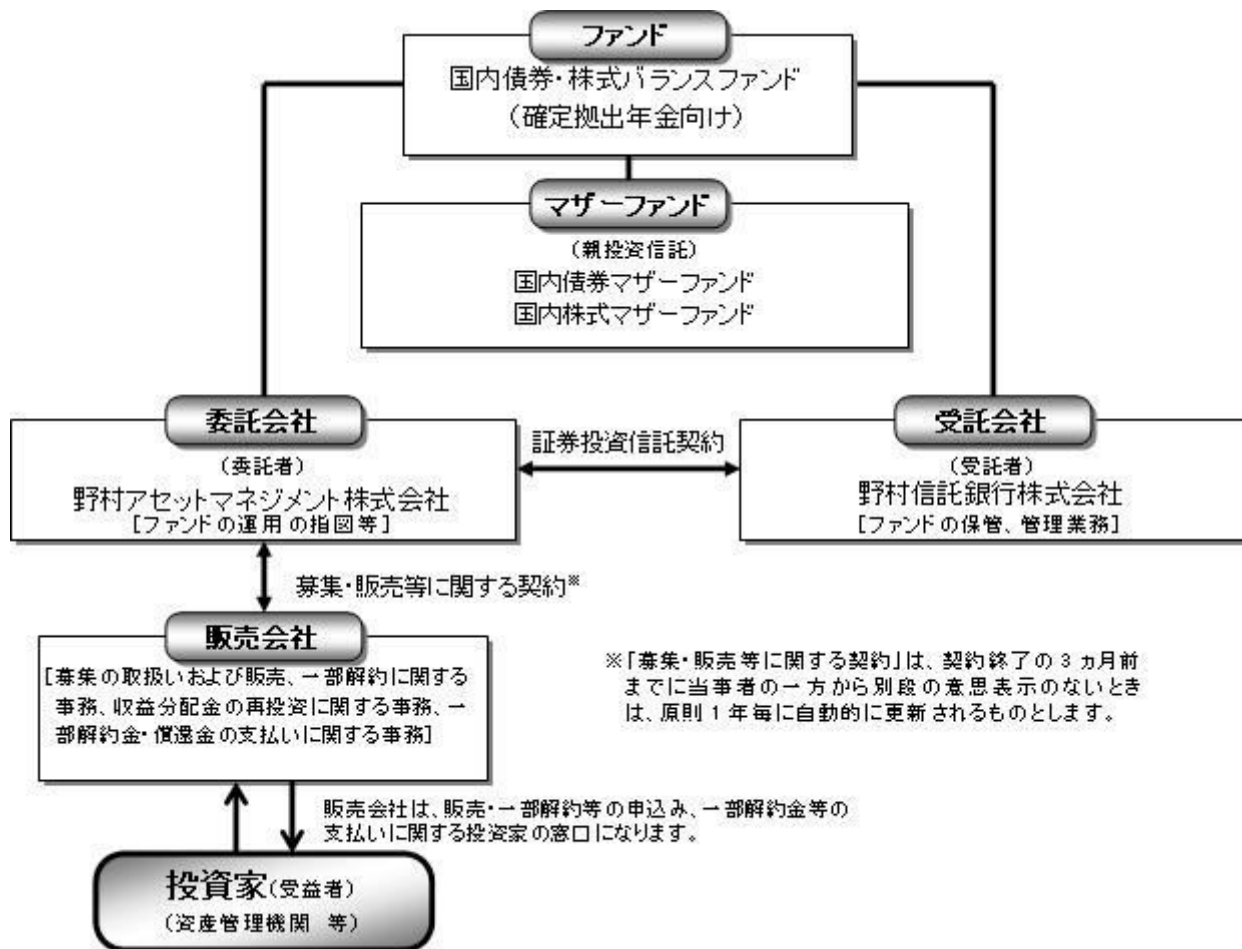
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

## (2)【ファンドの沿革】

平成14年4月12日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】



### 委託会社の概況(平成28年6月末現在)

#### ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

#### ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

#### ・資本金の額

17,180百万円

#### ・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

平成9年(1997年)10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

平成12年(2000年)11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

平成15年(2003年)6月27日

委員会等設置会社へ移行

## ・大株主の状況

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

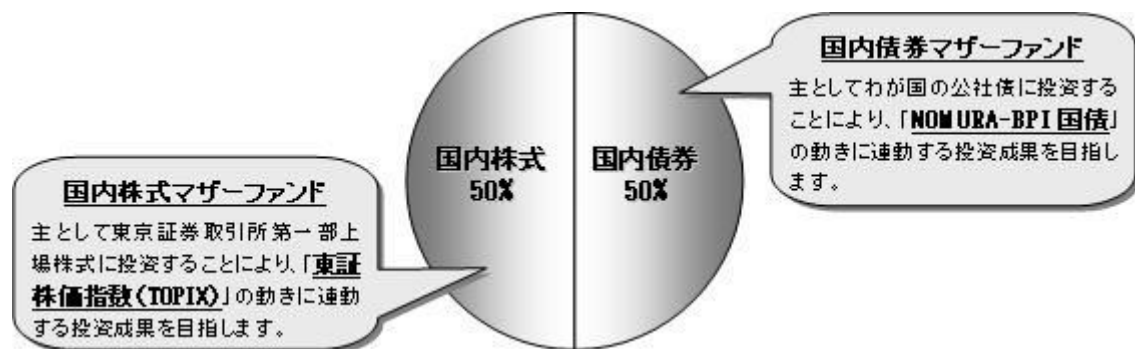
## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

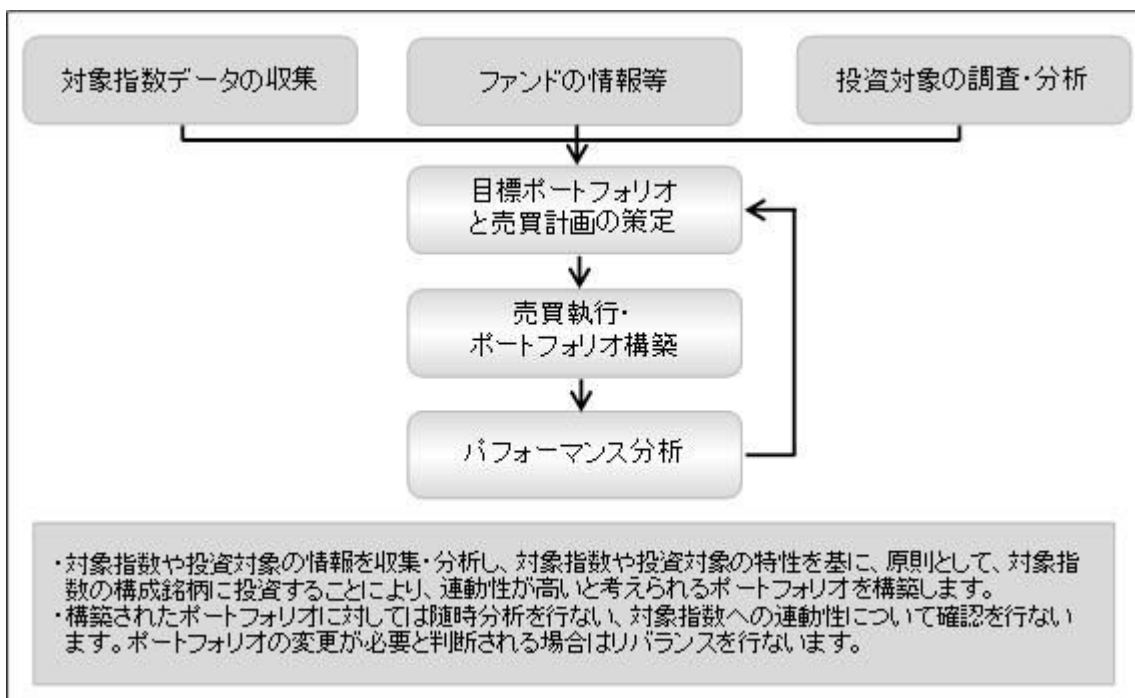
わが国の公社債および株式を実質的な主要投資対象とし、これらに分散投資するバランス運用を行なうことで、キャピタルゲインとインカムゲインを総合したトータルリターンを獲得を目指します。

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

各マザーファンドへの投資比率は50%：50%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。



## 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。

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。

各マザーファンドが対象とするインデックスについて

国内債券マザーファンド：NOMURA-BPI国債

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

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

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。

## (2)【投資対象】

わが国の公社債および株式を実質的な主要投資対象とします。

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

各マザーファンドの主要投資対象

### [1] 国内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。

### [2] 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。

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(本邦通貨表示のものに限ります。)の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ 有価証券

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

ハ 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)

二 金銭債権（イ及び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。)および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。)のほか、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くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

- 1 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2 国債証券
- 3 地方債証券
- 4 特別の法律により法人の発行する債券
- 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を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債 に限ります。)

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。

6 コマーシャル・ペーパー

7 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第2号から第6号までの証券または証書の性質を有するもの

8 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

9 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

10 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。)

11 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を「株式」といい、第2号から第5号までの証券および第7号のうち第2号から第5号までの証券の性質を有するものを「公社債」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、次に掲げる金融商品(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。

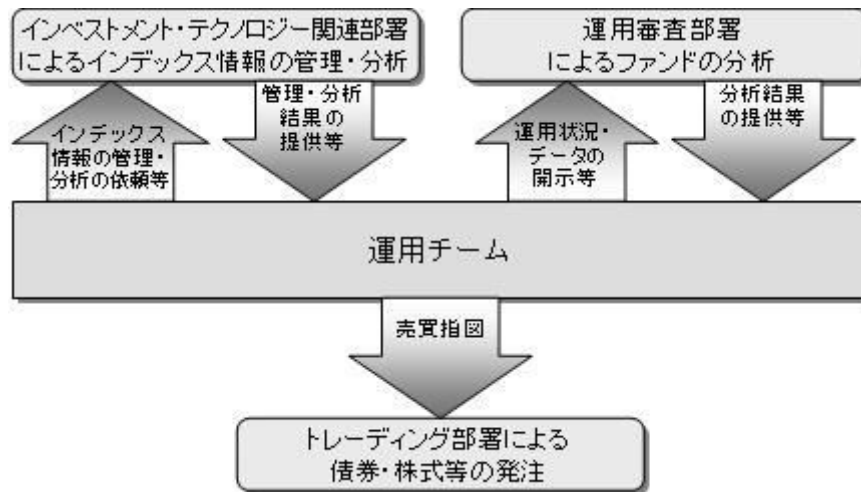
- 1 預金
- 2 指定金銭信託(上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。)
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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】

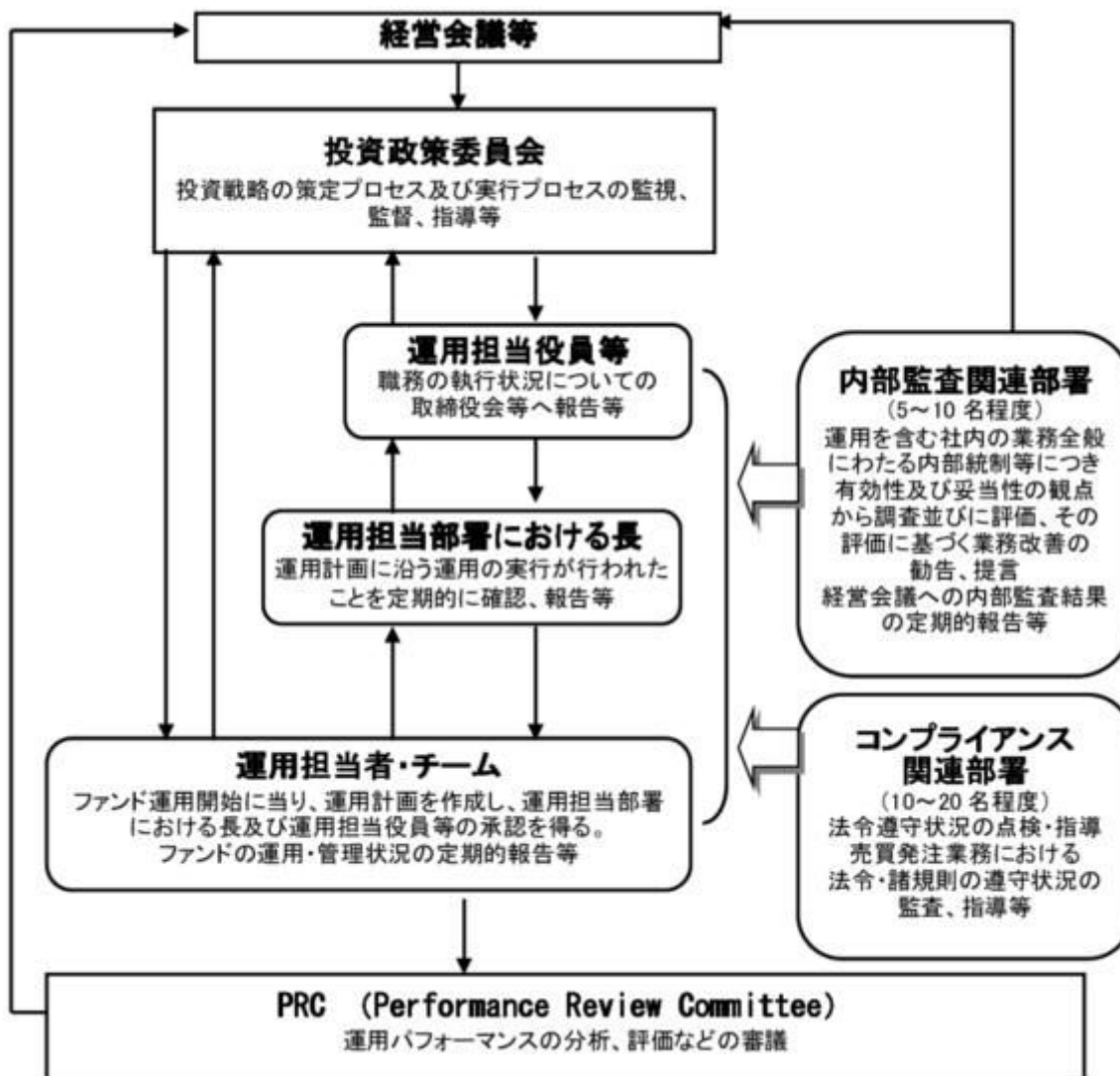
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

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)

外貨建資産への投資は行ないません。

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)

投資信託証券への投資割合

投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への投資は行ないません。

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第23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け取る組入公社債、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け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わが国の金利に係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け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24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を回避するため、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(以下「スワップ取引」といいます。)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、当該取引が当該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の信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

## 投資する株式の範囲(約款第20条)

委託者が投資することを指図する株式は、わが国の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とします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

## 同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%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。

## 信用取引の指図範囲(約款第22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、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

## 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信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%を超えないものとします。
- 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。

## 資金の借入れ(約款第34条)

( )委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

( )一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間と

し、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

( )収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

( )借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

( )委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数

( )当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

## (参考)各マザーファンドの概要

### (国内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。

### (国内株式マザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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。

### 3 【投資リスク】

#### **基準価額の変動要因**

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

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

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

#### [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。

## 委託会社におけるリスクマネジメント体制

### リスク管理関連の委員会

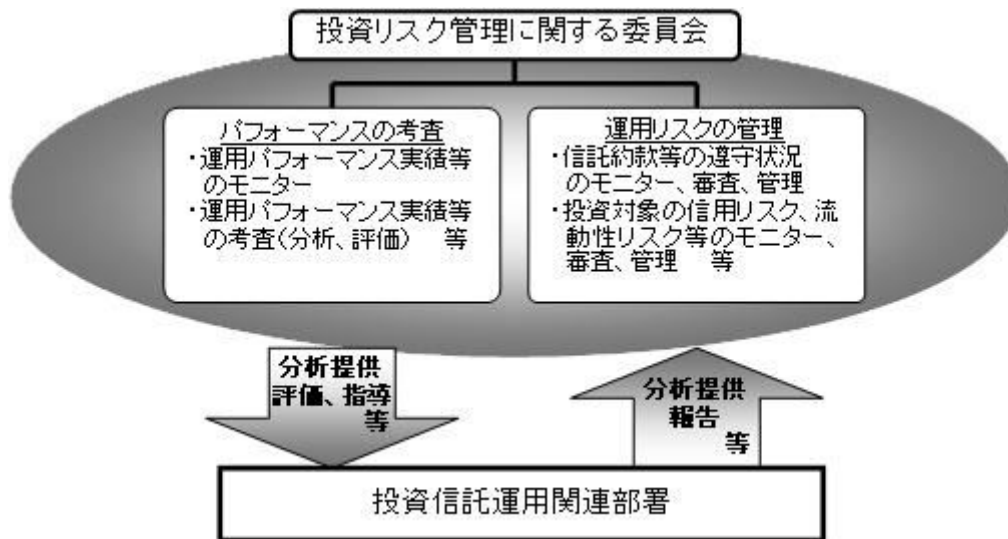
#### パフォーマンスの考査

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

#### 運用リスクの管理

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

## リスク管理体制図

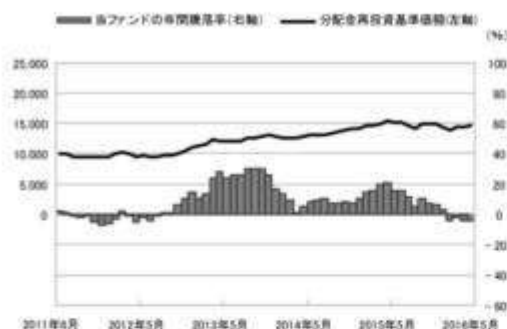


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

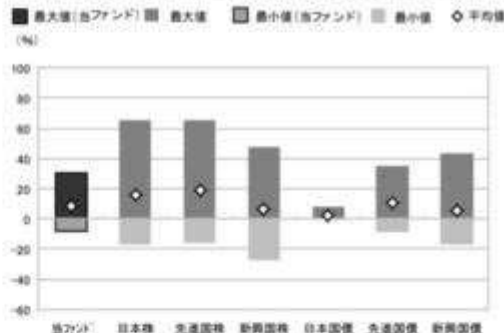
## リスクの定量的比較

(2011年6月末～2016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(%)	30.3	65.0	65.7	47.4	7.7	34.9	43.7
最小値(%)	△ 7.7	△ 17.0	△ 15.6	△ 27.4	0.4	△ 8.6	△ 17.4
平均値(%)	8.5	15.9	19.0	6.1	2.6	10.2	5.6

- 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。2011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、2011年6月から2016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。
- 2011年6月から2016年5月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

## ＜代表的な資産クラスの指数＞

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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56.16（税抜年10,000分の52）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22	年10,000分の25	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から支払われます。

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

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

りません。

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。

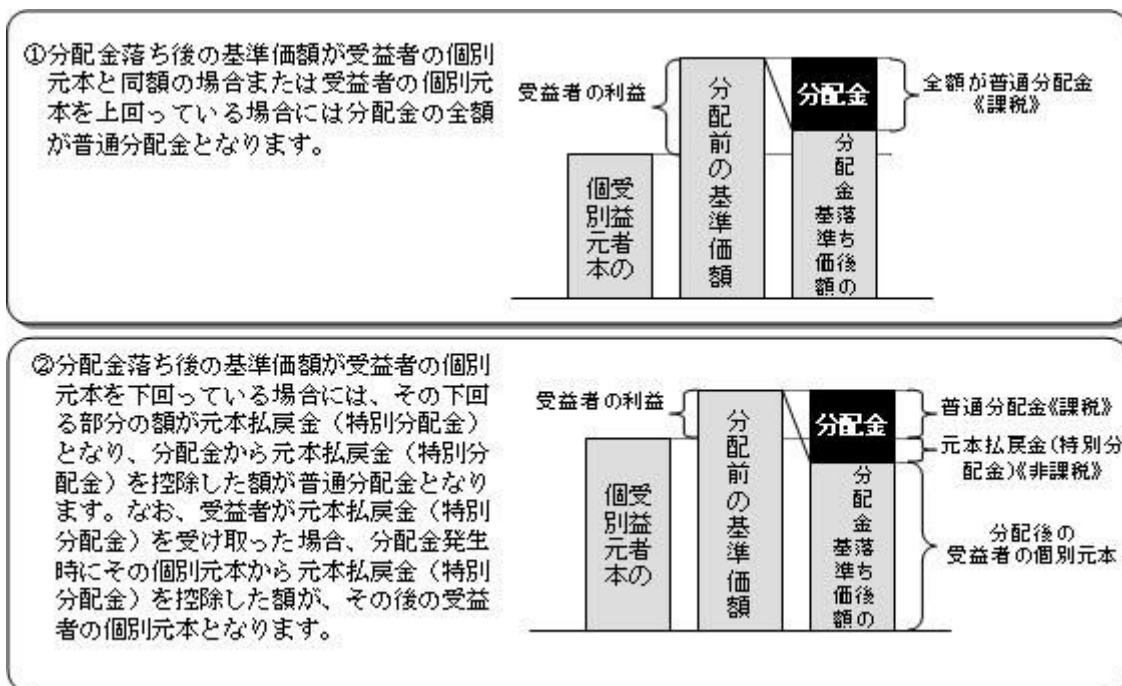
## 換金(解約)時および償還時の課税について

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(平成28年5月末現在)が変更となる場合があります。

## 5【運用状況】

以下は平成28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】

国内債券・株式バランスファンド（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	248,331,942	99.96
現金・預金・その他資産（負債控除後）		98,824	0.03
合計（純資産総額）		248,430,766	100.00

## (参考)国内債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	8,382,914,210	99.26
現金・預金・その他資産（負債控除後）		61,772,894	0.73
合計（純資産総額）		8,444,687,104	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	282,866,444,940	97.38
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,603,894,711	2.61
合計（純資産総額）		290,470,339,651	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	6,292,890,000	2.16

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

国内債券・株式バランスファンド（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	97,740,402	1.2438	121,569,513	1.2861	125,703,931	50.59
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド	89,359,478	1.3700	122,423,017	1.3723	122,628,011	49.36

## 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	99.96
合計	99.96

## (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 3回	200,000,000	101.31	202,632,300	101.30	202,604,000	0.1	2020/3/20	2.39
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	160,000,000	104.84	167,745,600	105.04	168,068,800	0.4	2025/3/20	1.99
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第9 9回	130,000,000	124.95	162,435,000	125.05	162,565,000	2.1	2027/12/20	1.92
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第36 0回	130,000,000	100.61	130,799,500	100.58	130,761,800	0.1	2018/1/15	1.54
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	120,000,000	105.70	126,843,300	105.80	126,964,800	0.6	2023/3/20	1.50
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 40回	100,000,000	125.65	125,650,900	125.86	125,865,000	1.7	2032/9/20	1.49
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	110,000,000	105.58	116,145,300	105.49	116,045,600	1.3	2019/12/20	1.37
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 89回	100,000,000	102.85	102,850,000	102.73	102,732,000	1.5	2017/12/20	1.21
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第35 7回	100,000,000	100.54	100,544,000	100.50	100,508,000	0.1	2017/10/15	1.19
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 20回	90,000,000	107.01	96,310,600	106.97	96,277,500	1	2021/12/20	1.14
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 18回	80,000,000	106.70	85,361,600	106.65	85,326,400	1	2021/9/20	1.01
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	80,000,000	102.10	81,684,300	102.18	81,744,800	0.1	2026/3/20	0.96
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	80,000,000	101.41	81,128,000	101.39	81,112,000	0.1	2020/6/20	0.96
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	80,000,000	101.29	81,034,400	101.26	81,013,600	0.2	2019/3/20	0.95

15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	80,000,000	101.25	81,004,000	101.23	80,988,000	0.1	2019/12/20	0.95
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 46回	60,000,000	126.33	75,798,000	126.67	76,003,200	1.7	2033/9/20	0.90
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	70,000,000	107.28	75,100,200	107.41	75,192,600	0.8	2023/6/20	0.89
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 15回	70,000,000	107.41	75,190,700	107.33	75,132,400	1.2	2021/6/20	0.88
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	70,000,000	106.64	74,652,200	106.65	74,657,800	0.8	2022/9/20	0.88
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	70,000,000	106.68	74,679,500	106.60	74,620,000	1.2	2020/12/20	0.88
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 24回	70,000,000	106.37	74,465,300	106.38	74,468,100	0.8	2022/6/20	0.88
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 53回	60,000,000	120.02	72,013,800	120.18	72,111,000	1.3	2035/6/20	0.85
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	70,000,000	101.56	71,092,000	101.56	71,094,800	0.1	2020/12/20	0.84
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	70,000,000	101.47	71,032,500	101.47	71,033,900	0.1	2020/9/20	0.84
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 96回	65,000,000	104.16	67,706,600	104.03	67,624,700	1.5	2018/9/20	0.80
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 88回	65,000,000	102.68	66,745,900	102.55	66,663,350	1.7	2017/9/20	0.78
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	60,000,000	106.13	63,683,400	106.29	63,777,600	0.6	2023/12/20	0.75
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 31回	60,000,000	106.01	63,608,400	106.16	63,697,800	0.6	2023/9/20	0.75
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	60,000,000	101.59	60,957,300	101.62	60,975,000	0.1	2021/3/20	0.72
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	60,000,000	101.09	60,654,600	101.05	60,631,800	0.2	2018/9/20	0.71

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.26
合計	99.26

## (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	1,722,000	5,676.84	9,775,530,000	5,783.00	9,958,326,000	3.42

2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,964,200	508.85	5,579,133,170	553.80	6,071,973,960	2.09
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,056,200	5,032.62	5,315,462,200	4,855.00	5,127,851,000	1.76
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	774,200	5,992.11	4,639,091,562	6,228.00	4,821,717,600	1.65
5	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,388,200	3,273.81	4,544,716,800	3,237.00	4,493,603,400	1.54
6	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	917,100	4,592.50	4,211,790,700	4,402.00	4,037,074,200	1.38
7	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,094,200	3,358.25	3,674,601,000	3,617.00	3,957,721,400	1.36
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,246,000	3,044.96	3,794,030,400	3,151.00	3,926,146,000	1.35
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,372,900	165.81	3,212,237,520	174.40	3,378,633,760	1.16
10	日本	株式	ソニー	電気機器	977,000	2,682.23	2,620,539,200	3,100.00	3,028,700,000	1.04
11	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,021,100	2,799.87	2,858,955,800	2,779.00	2,837,636,900	0.97
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	577,600	5,288.06	3,054,385,200	4,797.00	2,770,747,200	0.95
13	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	571,600	4,762.88	2,722,467,800	4,744.00	2,711,670,400	0.93
14	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	253,100	9,846.15	2,492,061,000	10,135.00	2,565,168,500	0.88
15	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,623,800	1,478.47	2,400,752,050	1,517.00	2,463,304,600	0.84
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	124,000	19,449.76	2,411,771,000	19,630.00	2,434,120,000	0.83
17	日本	株式	ファナック	電気機器	141,700	16,200.31	2,295,585,000	16,980.00	2,406,066,000	0.82
18	日本	株式	キヤノン	電気機器	745,400	3,075.09	2,292,177,800	3,212.00	2,394,224,800	0.82
19	日本	株式	花王	化学	390,000	6,101.73	2,379,675,000	6,101.00	2,379,390,000	0.81
20	日本	株式	キーエンス	電気機器	31,400	66,159.84	2,077,419,000	70,400.00	2,210,560,000	0.76
21	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,932,300	1,004.10	1,940,234,900	1,125.00	2,173,837,500	0.74
22	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,016,000	2,149.88	2,184,286,000	2,139.50	2,173,732,000	0.74
23	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	553,600	3,713.20	2,055,628,400	3,839.00	2,125,270,400	0.73
24	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,025,400	1,798.21	1,843,887,900	1,967.00	2,016,961,800	0.69
25	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,477,000	1,238.58	1,829,389,000	1,339.50	1,978,441,500	0.68
26	日本	株式	三井不動産	不動産業	725,000	2,728.29	1,978,013,500	2,721.50	1,973,087,500	0.67
27	日本	株式	ダイキン工業	機械	201,600	8,822.72	1,778,661,300	9,496.00	1,914,393,600	0.65
28	日本	株式	村田製作所	電気機器	146,000	12,878.85	1,880,313,500	12,950.00	1,890,700,000	0.65
29	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	489,400	4,137.18	2,024,737,600	3,826.00	1,872,444,400	0.64
30	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	437,500	3,743.36	1,637,722,100	4,150.00	1,815,625,000	0.62

## 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	3.14
		食料品	4.97
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.08
		医薬品	5.54

石油・石炭製品	0.49
ゴム製品	0.86
ガラス・土石製品	0.91
鉄鋼	1.17
非鉄金属	0.84
金属製品	0.61
機械	4.68
電気機器	11.44
輸送用機器	9.28
精密機器	1.55
その他製品	1.59
電気・ガス業	1.90
陸運業	4.41
海運業	0.21
空運業	0.63
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	8.20
卸売業	4.07
小売業	4.72
銀行業	7.42
証券、商品先物取引業	0.99
保険業	2.25
その他金融業	1.27
不動産業	2.70
サービス業	3.73
合 計	97.38

#### 【投資不動産物件】

国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）

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）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）

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）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(2016年06月限)	買建	457	日本円	6,111,983,384	6,292,890,000	2.16

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）

平成28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6計算期間 (2007年 5月10日)	114	114	1.3203	1.3208
第7計算期間 (2008年 5月12日)	113	113	1.1859	1.1864
第8計算期間 (2009年 5月11日)	97	97	1.0091	1.0091
第9計算期間 (2010年 5月10日)	122	122	1.0551	1.0556
第10計算期間 (2011年 5月10日)	120	120	1.0277	1.0282
第11計算期間 (2012年 5月10日)	122	122	0.9968	0.9973
第12計算期間 (2013年 5月10日)	178	178	1.2813	1.2818
第13計算期間 (2014年 5月12日)	191	191	1.2771	1.2776
第14計算期間 (2015年 5月11日)	238	238	1.5315	1.5320
第15計算期間 (2016年 5月10日)	243	243	1.4691	1.4696
2015年 5月末日	242		1.5668	
6月末日	241		1.5461	
7月末日	243		1.5619	
8月末日	242		1.5070	
9月末日	235		1.4517	
10月末日	239		1.5284	
11月末日	243		1.5386	
12月末日	242		1.5282	
2016年 1月末日	236		1.4829	

2月末日	228		1.4272
3月末日	239		1.4678
4月末日	242		1.4710
5月末日	248		1.4946

## 【分配の推移】

国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）

	計算期間	1口当たりの分配金
第6計算期間	2006年 5月11日～2007年 5月10日	0.0005円
第7計算期間	2007年 5月11日～2008年 5月12日	0.0005円
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	0.0005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

## 【収益率の推移】

国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）

	計算期間	収益率
第6計算期間	2006年 5月11日～2007年 5月10日	2.4%
第7計算期間	2007年 5月11日～2008年 5月12日	10.1%
第8計算期間	2008年 5月13日～2009年 5月11日	14.9%
第9計算期間	2009年 5月12日～2010年 5月10日	4.6%
第10計算期間	2010年 5月11日～2011年 5月10日	2.5%
第11計算期間	2011年 5月11日～2012年 5月10日	3.0%
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	28.6%
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	0.3%
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	20.0%
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	4.0%

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## 国内債券・株式バランスファンド（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6計算期間	2006年 5月11日～2007年 5月10日	23,196,661	6,114,920	86,809,457
第7計算期間	2007年 5月11日～2008年 5月12日	19,151,429	9,995,502	95,965,384
第8計算期間	2008年 5月13日～2009年 5月11日	16,481,086	15,737,118	96,709,352
第9計算期間	2009年 5月12日～2010年 5月10日	29,361,698	9,991,869	116,079,181
第10計算期間	2010年 5月11日～2011年 5月10日	12,058,995	10,660,167	117,478,009
第11計算期間	2011年 5月11日～2012年 5月10日	14,548,753	9,458,399	122,568,363
第12計算期間	2012年 5月11日～2013年 5月10日	31,125,189	14,361,282	139,332,270
第13計算期間	2013年 5月11日～2014年 5月12日	41,250,065	31,004,888	149,577,447
第14計算期間	2014年 5月13日～2015年 5月11日	30,439,217	24,076,918	155,939,746
第15計算期間	2015年 5月12日～2016年 5月10日	29,413,290	19,933,186	165,419,850

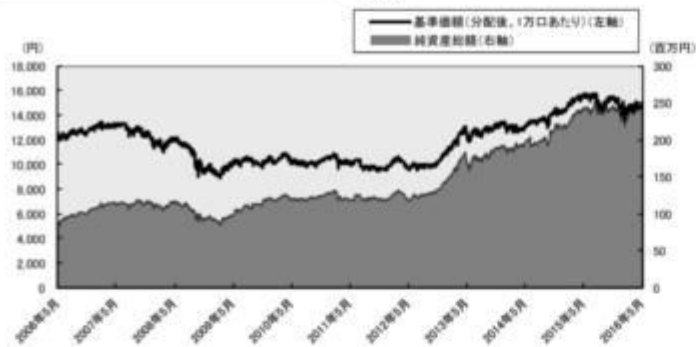
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

## 参考情報

## 運用実績（2016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）

2016年5月	5 円
2015年5月	5 円
2014年5月	5 円
2013年5月	5 円
2012年5月	5 円
設定未累計	80 円

### 主要な資産の状況

#### 実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

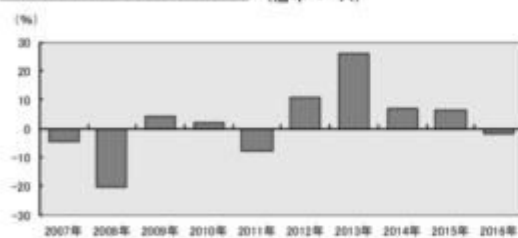
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	国債債券 利付(5年)第123回	国債証券	1.2
2	国債債券 利付(10年)第338回	国債証券	1.0
3	国債債券 利付(20年)第99回	国債証券	0.9
4	国債債券 利付(2年)第360回	国債証券	0.8
5	国債債券 利付(10年)第328回	国債証券	0.7
6	国債債券 利付(20年)第140回	国債証券	0.7
7	国債債券 利付(10年)第305回	国債証券	0.7
8	国債債券 利付(10年)第289回	国債証券	0.6
9	国債債券 利付(2年)第357回	国債証券	0.6
10	国債債券 利付(10年)第320回	国債証券	0.6

・「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	1.7
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.1
3	日本電信電話	情報・通信業	0.9
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.8
5	KDDI	情報・通信業	0.8
6	日本たばこ産業	食料品	0.7
7	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.7
8	本田技研工業	輸送用機器	0.7
9	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	0.6
10	ソニー	電気機器	0.5

### 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。  
・2016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。

取得申込みの受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受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、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ます。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

## 2【換金(解約)手続等】

受益者は、委託者に1口単位で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基準価額から、信託財産留保額を差し引いた価額となります。

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

&lt; 受付時間 &gt; 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、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を中止した場合には、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。

一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用する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いいます。

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
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 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
株式	原則として、基準価額計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)に

よる評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

## (2) 【保管】

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

## (3) 【信託期間】

無期限とします(平成14年4月12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、最終計算期間は、下記「(5) その他 (a) ファンドの繰上償還条項 等」による解約の日までとします。

## (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、信託を終了させる場合があります。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

### (b) 信託期間の終了

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

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

( ) 上記( )の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。

( ) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

( )上記( )から( )までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記( )の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

( )委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

( )委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更( )」に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

( )受託者が委託者の承諾を受けてその任務を辞任する場合、または、委託者または受益者が裁判所に受託者の解任を請求し裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### (c) 運用報告書

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

#### (d) 信託約款の変更

( )委託者は、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

( )委託者は、上記( )の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

( )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、公告を行ないません。

( )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なう場合において、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15期計算期間(平成27年5月12日から平成28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】

## 【国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 (平成27年 5月11日現在)	第15期 (平成28年 5月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	689,821	747,005
親投資信託受益証券	238,719,372	242,917,965
未収入金	111,075	97,754
未収利息	1	-
流動資産合計	239,520,269	243,762,724
資産合計	239,520,269	243,762,724
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	77,969	82,709
未払受託者報酬	60,030	63,659
未払委託者報酬	564,209	598,347
未払利息	-	1
その他未払費用	3,549	3,762
流動負債合計	705,757	748,478
負債合計	705,757	748,478
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	155,939,746	165,419,850
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	82,874,766	77,594,396
（分配準備積立金）	54,804,770	50,787,202
元本等合計	238,814,512	243,014,246
純資産合計	238,814,512	243,014,246
負債純資産合計	239,520,269	243,762,724

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日	自	平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日
営業収益				
受取利息		106		90
有価証券売買等損益		39,273,804		8,854,537
営業収益合計		39,273,910		8,854,447
営業費用				
支払利息		-		47
受託者報酬		113,178		128,687
委託者報酬		1,063,726		1,209,568
その他費用		6,674		7,612
営業費用合計		1,183,578		1,345,914
営業利益又は営業損失（ ）		38,090,332		10,200,361
経常利益又は経常損失（ ）		38,090,332		10,200,361
当期純利益又は当期純損失（ ）		38,090,332		10,200,361
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（ ）		2,580,238		385,795
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		41,447,736		82,874,766
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,766,014		15,134,439
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,766,014		15,134,439
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,771,109		10,517,534
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,771,109		10,517,534
分配金		77,969		82,709
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		82,874,766		77,594,396

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成27年 5月12日から平成28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14期 平成27年 5月11日現在	第15期 平成28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 155,939,746口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 165,419,850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 1.5315円 (10,000口当たり純資産額) (15,315円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.4691円 (10,000口当たり純資産額) (14,691円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日	第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28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>3,241,251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>30,355,906円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>66,354,606円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>21,285,582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>121,237,345円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>155,939,746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>7,774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>77,969円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,241,251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	30,355,906円	収益調整金額	C	66,354,606円	分配準備積立金額	D	21,285,582円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	121,237,345円	当ファンドの期末残存口数	F	155,939,746口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	7,774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	77,969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>2,474,675円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>80,283,958円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>48,395,236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>131,153,869円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>165,419,850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>7,928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>82,709円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,474,675円	費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	80,283,958円	分配準備積立金額	D	48,395,236円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	131,153,869円	当ファンドの期末残存口数	F	165,419,850口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	7,928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	82,709円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	3,241,251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	30,355,906円																																																											
収益調整金額	C	66,354,606円																																																											
分配準備積立金額	D	21,285,582円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	121,237,345円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	155,939,746口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	7,774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	77,969円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,474,675円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	80,283,958円																																																											
分配準備積立金額	D	48,395,236円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	131,153,869円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	165,419,850口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F × 10,000	7,928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	82,709円																																																											
	2. 追加情報																																																												

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

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日	第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、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</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第14期 平成27年 5月11日現在	第15期 平成28年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日	第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28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14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日	第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日
期首元本額 149,577,447円	期首元本額 155,939,746円
期中追加設定元本額 30,439,217円	期中追加設定元本額 29,413,290円
期中一部解約元本額 24,076,918円	期中一部解約元本額 19,933,186円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第14期 自 平成26年 5月13日 至 平成27年 5月11日	第15期 自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日
	損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	35,680,196	8,884,307
合計	35,680,196	8,884,307

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 5月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28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		121,646,559	
		国内債券マザーファンド		121,271,406	
	小計	銘柄数: 2 組入時価比率: 100.0%		242,917,965 100.0%	
合計				242,917,965	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは「国内債券マザーファンド」および「国内株式マザーファンド」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。

## 国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成28年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,873,533
国債証券	8,184,897,560
未収入金	20,265,000
未収利息	22,169,261
前払費用	375,662
流動資産合計	8,242,581,016

(平成28年 5月10日現在)

資産合計	8,242,581,016
負債の部	
流動負債	
未払解約金	19,079,214
未払利息	26
流動負債合計	19,079,240
負債合計	19,079,240
純資産の部	
元本等	
元本	6,001,927,033
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,221,574,743
元本等合計	8,223,501,776
純資産合計	8,223,501,776
負債純資産合計	8,242,581,016

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28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	1.3701円
(10,000口当たり純資産額)	(13,701円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年 5月10日現在

### 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2.時価の算定方法

#### 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### （その他の注記）

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 5月10日現在

期首	平成27年 5月12日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	5,438,368,348円
同期中における追加設定元本額	2,803,082,707円
同期中における一部解約元本額	2,239,524,022円
期末元本額	6,001,927,033円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	507,631,703円
バランスセレクト50	572,334,158円
バランスセレクト70	215,604,730円
ネクストコア	24,852,591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）	529,127,742円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	25,311,797円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	48,371,723円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	15,911,757円
野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）	3,929,439,417円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	88,512,814円

野村DC運用戦略ファンド	41,300,927円
野村DC運用戦略ファンドM	3,253,380円
野村DC運用戦略ファンドA	274,294円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成28年 5月10日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(平成28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355回	60,000,000	60,284,400	
		国庫債券 利付(2年)第357回	100,000,000	100,544,000	
		国庫債券 利付(2年)第360回	130,000,000	130,799,500	
		国庫債券 利付(5年)第105回	50,000,000	50,255,000	
		国庫債券 利付(5年)第106回	40,000,000	40,253,600	
		国庫債券 利付(5年)第107回	40,000,000	40,300,400	
		国庫債券 利付(5年)第108回	60,000,000	60,353,400	
		国庫債券 利付(5年)第110回	20,000,000	20,208,600	
		国庫債券 利付(5年)第111回	40,000,000	40,492,000	
		国庫債券 利付(5年)第112回	30,000,000	30,419,400	
		国庫債券 利付(5年)第113回	50,000,000	50,593,000	
		国庫債券 利付(5年)第114回	20,000,000	20,265,800	
		国庫債券 利付(5年)第115回	60,000,000	60,654,600	
		国庫債券 利付(5年)第116回	50,000,000	50,597,000	
		国庫債券 利付(5年)第117回	80,000,000	81,034,400	
		国庫債券 利付(5年)第118回	50,000,000	50,704,500	
		国庫債券 利付(5年)第119回	40,000,000	40,438,000	
		国庫債券 利付(5年)第120回	20,000,000	20,301,400	
		国庫債券 利付(5年)第121回	40,000,000	40,467,200	
		国庫債券 利付(5年)第122回	80,000,000	81,004,000	

国庫債券 利付(5年)第123回	170,000,000	172,247,400	
国庫債券 利付(5年)第124回	80,000,000	81,128,000	
国庫債券 利付(5年)第125回	70,000,000	71,032,500	
国庫債券 利付(5年)第126回	70,000,000	71,092,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	10,000,000	16,223,900	
国庫債券 利付(40年)第2回	10,000,000	15,776,700	
国庫債券 利付(40年)第3回	20,000,000	31,825,200	
国庫債券 利付(40年)第4回	15,000,000	24,069,150	
国庫債券 利付(40年)第5回	28,000,000	43,479,520	
国庫債券 利付(40年)第6回	20,000,000	30,619,400	
国庫債券 利付(40年)第7回	30,000,000	44,127,300	
国庫債券 利付(40年)第8回	20,000,000	27,417,000	
国庫債券 利付(10年)第287回	50,000,000	51,204,500	
国庫債券 利付(10年)第288回	65,000,000	66,745,900	
国庫債券 利付(10年)第289回	100,000,000	102,850,000	
国庫債券 利付(10年)第290回	50,000,000	51,542,000	
国庫債券 利付(10年)第291回	20,000,000	20,579,400	
国庫債券 利付(10年)第292回	35,000,000	36,275,050	
国庫債券 利付(10年)第293回	30,000,000	31,305,600	
国庫債券 利付(10年)第294回	40,000,000	41,656,400	
国庫債券 利付(10年)第295回	25,000,000	25,929,250	
国庫債券 利付(10年)第296回	65,000,000	67,706,600	
国庫債券 利付(10年)第297回	40,000,000	41,727,200	
国庫債券 利付(10年)第298回	20,000,000	20,811,000	
国庫債券 利付(10年)第299回	45,000,000	46,998,450	
国庫債券 利付(10年)第300回	35,000,000	36,755,600	
国庫債券 利付(10年)第301回	45,000,000	47,458,350	

回			
国庫債券 利付(10年)第302回	40,000,000	42,059,600	
国庫債券 利付(10年)第303回	45,000,000	47,498,850	
国庫債券 利付(10年)第304回	30,000,000	31,564,200	
国庫債券 利付(10年)第305回	90,000,000	95,044,500	
国庫債券 利付(10年)第306回	45,000,000	47,871,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	30,000,000	31,797,300	
国庫債券 利付(10年)第308回	30,000,000	31,916,100	
国庫債券 利付(10年)第309回	40,000,000	42,222,800	
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	31,631,400	
国庫債券 利付(10年)第311回	20,000,000	20,911,600	
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	74,679,500	
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	31,958,700	
国庫債券 利付(10年)第315回	50,000,000	53,708,500	
国庫債券 利付(10年)第316回	10,000,000	10,690,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	32,173,500	
国庫債券 利付(10年)第318回	80,000,000	85,361,600	
国庫債券 利付(10年)第319回	30,000,000	32,275,800	
国庫債券 利付(10年)第320回	110,000,000	117,719,800	
国庫債券 利付(10年)第321回	40,000,000	42,932,400	
国庫債券 利付(10年)第322回	30,000,000	32,021,100	
国庫債券 利付(10年)第323回	20,000,000	21,399,800	

国庫債券 利付(10年)第324回	70,000,000	74,465,300	
国庫債券 利付(10年)第325回	70,000,000	74,652,200	
国庫債券 利付(10年)第326回	40,000,000	42,481,600	
国庫債券 利付(10年)第327回	40,000,000	42,750,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	90,000,000	95,135,400	
国庫債券 利付(10年)第329回	70,000,000	75,100,200	
国庫債券 利付(10年)第330回	50,000,000	53,754,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	60,000,000	63,608,400	
国庫債券 利付(10年)第332回	60,000,000	63,683,400	
国庫債券 利付(10年)第333回	20,000,000	21,251,200	
国庫債券 利付(10年)第334回	40,000,000	42,549,200	
国庫債券 利付(10年)第335回	50,000,000	52,818,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	40,000,000	42,285,600	
国庫債券 利付(10年)第337回	10,000,000	10,396,900	
国庫債券 利付(10年)第338回	160,000,000	167,745,600	
国庫債券 利付(10年)第339回	50,000,000	52,442,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	25,000,000	26,230,250	
国庫債券 利付(10年)第341回	40,000,000	41,592,400	
国庫債券 利付(10年)第342回	20,000,000	20,398,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	10,000,000	13,169,600	
国庫債券 利付(30年)第5回	10,000,000	13,185,900	
国庫債券 利付(30年)第6回	10,000,000	13,557,800	
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	20,235,750	

国庫債券 利付（30年）第8回	20,000,000	25,467,000	
国庫債券 利付（30年）第9回	20,000,000	24,168,600	
国庫債券 利付（30年）第10回	10,000,000	11,599,800	
国庫債券 利付（30年）第11回	10,000,000	12,616,700	
国庫債券 利付（30年）第12回	10,000,000	13,321,600	
国庫債券 利付（30年）第13回	10,000,000	13,173,600	
国庫債券 利付（30年）第14回	30,000,000	41,701,200	
国庫債券 利付（30年）第15回	10,000,000	14,105,200	
国庫債券 利付（30年）第16回	10,000,000	14,148,100	
国庫債券 利付（30年）第17回	10,000,000	13,997,100	
国庫債券 利付（30年）第18回	20,000,000	27,681,400	
国庫債券 利付（30年）第19回	10,000,000	13,864,700	
国庫債券 利付（30年）第20回	10,000,000	14,273,200	
国庫債券 利付（30年）第21回	10,000,000	13,909,800	
国庫債券 利付（30年）第22回	10,000,000	14,323,800	
国庫債券 利付（30年）第23回	10,000,000	14,348,700	
国庫債券 利付（30年）第24回	10,000,000	14,400,700	
国庫債券 利付（30年）第25回	20,000,000	28,090,400	
国庫債券 利付（30年）第26回	20,000,000	28,551,400	
国庫債券 利付（30年）第27回	20,000,000	29,153,800	
国庫債券 利付（30年）第28回	30,000,000	43,987,500	
国庫債券 利付（30年）第29回	20,000,000	29,074,400	
国庫債券 利付（30年）第30回	30,000,000	43,202,400	
国庫債券 利付（30年）第31回	30,000,000	42,769,200	
国庫債券 利付（30年）第32回	40,000,000	58,263,200	
国庫債券 利付（30年）第33回	20,000,000	27,908,000	
国庫債券 利付（30年）第34回	40,000,000	58,048,800	
国庫債券 利付（30年）第35回	42,000,000	59,244,780	
国庫債券 利付（30年）第36回	30,000,000	42,594,300	
国庫債券 利付（30年）第37回	20,000,000	28,022,000	
国庫債券 利付（30年）第38回	20,000,000	27,662,000	
国庫債券 利付（30年）第39回	20,000,000	28,269,800	
国庫債券 利付（30年）第40回	20,000,000	27,795,800	
国庫債券 利付（30年）第41回	20,000,000	27,313,000	
国庫債券 利付（30年）第42回	20,000,000	27,338,400	
国庫債券 利付（30年）第43回	10,000,000	13,699,900	

国庫債券	利付（30年）第44回	20,000,000	27,461,400
国庫債券	利付（30年）第45回	40,000,000	52,855,200
国庫債券	利付（30年）第46回	10,000,000	13,239,400
国庫債券	利付（30年）第47回	20,000,000	27,068,600
国庫債券	利付（30年）第48回	20,000,000	26,006,200
国庫債券	利付（30年）第49回	30,000,000	39,079,800
国庫債券	利付（30年）第50回	20,000,000	22,677,800
国庫債券	利付（20年）第37回	30,000,000	31,378,800
国庫債券	利付（20年）第41回	30,000,000	31,509,300
国庫債券	利付（20年）第42回	10,000,000	10,819,400
国庫債券	利付（20年）第43回	10,000,000	11,061,300
国庫債券	利付（20年）第44回	10,000,000	11,059,600
国庫債券	利付（20年）第45回	10,000,000	11,020,700
国庫債券	利付（20年）第46回	5,000,000	5,504,400
国庫債券	利付（20年）第47回	15,000,000	16,605,900
国庫債券	利付（20年）第49回	40,000,000	44,558,800
国庫債券	利付（20年）第52回	25,000,000	28,162,000
国庫債券	利付（20年）第53回	10,000,000	11,323,700
国庫債券	利付（20年）第54回	10,000,000	11,380,600
国庫債券	利付（20年）第55回	10,000,000	11,324,000
国庫債券	利付（20年）第56回	10,000,000	11,377,700
国庫債券	利付（20年）第57回	10,000,000	11,315,700
国庫債券	利付（20年）第58回	10,000,000	11,370,800
国庫債券	利付（20年）第59回	30,000,000	33,862,200
国庫債券	利付（20年）第60回	10,000,000	11,090,000
国庫債券	利付（20年）第61回	10,000,000	10,849,000
国庫債券	利付（20年）第62回	10,000,000	10,732,500
国庫債券	利付（20年）第63回	10,000,000	11,450,100
国庫債券	利付（20年）第64回	10,000,000	11,568,400
国庫債券	利付（20年）第65回	10,000,000	11,613,400
国庫債券	利付（20年）第66回	20,000,000	23,072,400
国庫債券	利付（20年）第67回	10,000,000	11,657,200
国庫債券	利付（20年）第68回	10,000,000	11,896,200
国庫債券	利付（20年）第69回	30,000,000	35,449,500
国庫債券	利付（20年）第70回	10,000,000	12,107,500
国庫債券	利付（20年）第71回	10,000,000	11,943,200

国庫債券 利付(20年)第72回	20,000,000	23,819,200	
国庫債券 利付(20年)第73回	30,000,000	35,624,700	
国庫債券 利付(20年)第74回	10,000,000	11,962,100	
国庫債券 利付(20年)第75回	40,000,000	48,011,600	
国庫債券 利付(20年)第76回	17,000,000	20,100,290	
国庫債券 利付(20年)第77回	15,000,000	17,869,950	
国庫債券 利付(20年)第78回	10,000,000	11,865,300	
国庫債券 利付(20年)第79回	10,000,000	11,957,400	
国庫債券 利付(20年)第80回	10,000,000	12,049,600	
国庫債券 利付(20年)第81回	10,000,000	12,000,900	
国庫債券 利付(20年)第82回	15,000,000	18,143,250	
国庫債券 利付(20年)第83回	15,000,000	18,201,450	
国庫債券 利付(20年)第84回	10,000,000	12,037,300	
国庫債券 利付(20年)第85回	13,000,000	15,822,820	
国庫債券 利付(20年)第86回	10,000,000	12,370,200	
国庫債券 利付(20年)第88回	20,000,000	24,862,600	
国庫債券 利付(20年)第90回	20,000,000	24,750,200	
国庫債券 利付(20年)第91回	10,000,000	12,479,500	
国庫債券 利付(20年)第92回	30,000,000	36,957,600	
国庫債券 利付(20年)第93回	20,000,000	24,514,800	
国庫債券 利付(20年)第94回	20,000,000	24,733,400	
国庫債券 利付(20年)第95回	10,000,000	12,631,700	
国庫債券 利付(20年)第96回	15,000,000	18,612,300	
国庫債券 利付(20年)第97回	10,000,000	12,563,100	
国庫債券 利付(20年)第99回	140,000,000	174,939,800	
国庫債券 利付(20年)第100回	20,000,000	25,321,000	
国庫債券 利付(20年)第101回	20,000,000	25,797,200	
国庫債券 利付(20年)第102回	20,000,000	25,889,600	
国庫債券 利付(20年)第103回	15,000,000	19,234,950	
国庫債券 利付(20年)第104回	10,000,000	12,580,500	
国庫債券 利付(20年)第105回	20,000,000	25,237,400	
国庫債券 利付(20年)第106回	10,000,000	12,742,500	

回			
国庫債券 利付(20年)第107回	20,000,000	25,327,200	
国庫債券 利付(20年)第108回	10,000,000	12,411,200	
国庫債券 利付(20年)第109回	10,000,000	12,442,400	
国庫債券 利付(20年)第110回	20,000,000	25,399,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	12,866,600	
国庫債券 利付(20年)第112回	35,000,000	44,574,950	
国庫債券 利付(20年)第113回	40,000,000	51,084,800	
国庫債券 利付(20年)第114回	30,000,000	38,442,300	
国庫債券 利付(20年)第115回	10,000,000	12,949,700	
国庫債券 利付(20年)第116回	10,000,000	12,994,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	10,000,000	12,758,300	
国庫債券 利付(20年)第119回	10,000,000	12,477,600	
国庫債券 利付(20年)第120回	25,000,000	30,492,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	20,000,000	25,007,600	
国庫債券 利付(20年)第123回	10,000,000	12,972,900	
国庫債券 利付(20年)第124回	20,000,000	25,655,800	
国庫債券 利付(20年)第125回	10,000,000	13,150,800	
国庫債券 利付(20年)第126回	30,000,000	38,568,900	
国庫債券 利付(20年)第127回	20,000,000	25,418,200	
国庫債券 利付(20年)第128回	20,000,000	25,490,200	
国庫債券 利付(20年)第129回	20,000,000	25,191,000	

国庫債券 利付(20年)第130回	20,000,000	25,238,400	
国庫債券 利付(20年)第131回	15,000,000	18,700,950	
国庫債券 利付(20年)第132回	10,000,000	12,497,300	
国庫債券 利付(20年)第134回	10,000,000	12,673,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	15,000,000	18,775,050	
国庫債券 利付(20年)第137回	10,000,000	12,536,200	
国庫債券 利付(20年)第138回	10,000,000	12,219,200	
国庫債券 利付(20年)第139回	10,000,000	12,377,700	
国庫債券 利付(20年)第140回	80,000,000	100,520,800	
国庫債券 利付(20年)第141回	30,000,000	37,749,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	20,000,000	25,492,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	10,000,000	12,434,700	
国庫債券 利付(20年)第144回	10,000,000	12,269,700	
国庫債券 利付(20年)第145回	10,000,000	12,616,700	
国庫債券 利付(20年)第146回	70,000,000	88,431,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	20,000,000	24,953,400	
国庫債券 利付(20年)第148回	10,000,000	12,315,400	
国庫債券 利付(20年)第149回	20,000,000	24,650,800	
国庫債券 利付(20年)第150回	20,000,000	24,314,600	
国庫債券 利付(20年)第151回	40,000,000	47,218,400	
国庫債券 利付(20年)第152回	30,000,000	35,418,600	
国庫債券 利付(20年)第153回	60,000,000	72,013,800	

	回			
	国庫債券 利付（20年）第154回	50,000,000	59,098,000	
	回			
	国庫債券 利付（20年）第155回	40,000,000	45,735,600	
	回			
	国庫債券 利付（20年）第156回	10,000,000	10,264,300	
	回			
小計	銘柄数：241 組入時価比率：99.5%	7,160,000,000	8,184,897,560 100.0%	
合計			8,184,897,560	

(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。

## 国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 5月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,676,445,531
株式	273,159,048,910
派生商品評価勘定	54,986,474
未収入金	2,896,198,200
未収配当金	2,755,194,960
未収利息	698,546
その他未収収益	2,242,816
差入委託証拠金	381,575,990
流動資産合計	304,926,391,427
資産合計	304,926,391,427
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,638,372
未払金	154,972
未払解約金	3,275,021,197
未払利息	45,549
有価証券貸借取引受入金	22,110,321,973
流動負債合計	25,434,182,063
負債合計	25,434,182,063
純資産の部	
元本等	
元本	224,682,172,660
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	54,810,036,704
元本等合計	279,492,209,364
純資産合計	279,492,209,364

(平成28年 5月10日現在)

負債純資産合計

304,926,391,427

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28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	1,2439円
(10,000口当たり純資産額)	(12,439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	21,684,042,880円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 5月12日 至 平成28年 5月10日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成28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。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 5月10日現在	
期首	平成27年 5月12日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	178,095,641,491円
同期中における追加設定元本額	75,955,719,903円
同期中における一部解約元本額	29,369,188,734円
期末元本額	224,682,172,660円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	202,918,016円
バランスセレクト50	469,388,376円
バランスセレクト70	530,861,503円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,523,794,516円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	5,311,571,751円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	9,260,029,578円

野村資産設計ファンド2015	100,629,740円
野村資産設計ファンド2020	109,239,024円
野村資産設計ファンド2025	134,620,850円
野村資産設計ファンド2030	128,079,526円
野村資産設計ファンド2035	93,518,788円
野村資産設計ファンド2040	314,083,726円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	77,277,849,552円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,688,102,560円
のむラップ・ファンド（普通型）	3,844,336,574円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,228,404,374円
野村資産設計ファンド2045	30,204,723円
野村インデックスファンド・T O P I X	1,580,532,805円
マイ・ロード	2,939,611,705円
ネクストコア	28,959,499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	329,004,882円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,248,594,557円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	468,696,415円
野村資産設計ファンド2050	17,717,072円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	7,217,593円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	783,143円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	433,737円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	343,932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）	913,559,958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）	710,209,195円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	4,855,577,506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）	1,260,205,192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）	15,307,770円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	48,290,202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）	19,426,085円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,641,562,531円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	504,787,804円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	3,330,219,910円
野村日本株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,281,554,849円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,320,011,299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）	490,441,659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）	79,240,330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）	419,192,654円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	6,463,310,792円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	972,383,375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）	558,570,457円
ノムラFOFs用インデックスファンド・T O P I X（適格機関投資家専用）	533,273,405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）	33,561,471円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	10,136,612円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	39,678,696円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	39,785,596円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	97,794,485円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	4,313,238,920円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	12,778,491,507円

マイバランス70(確定拠出年金向け)	17,327,003,764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)	31,998,627,541円
マイバランスDC30	2,320,362,707円
マイバランスDC50	3,022,781,736円
マイバランスDC70	2,740,408,083円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,533,816,104円
野村DC運用戦略ファンド	45,415,062円
野村DC運用戦略ファンドM	314,962円
野村DC運用戦略ファンドA	472,950円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	91,136,796円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	988,801円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,503,377円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1)株式(平成28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	66,000	262.00	17,292,000	貸付有価証券 22,000株
		日本水産	178,400	628.00	112,035,200	
		マルハニチロ	31,600	2,560.00	80,896,000	貸付有価証券 100株
		サカタのタネ	22,900	2,747.00	62,906,300	貸付有価証券 10,900株
		ホクト	15,700	2,108.00	33,095,600	
		ホクリヨウ	1,400	1,088.00	1,523,200	貸付有価証券 600株(500株)
		住石ホールディングス	45,500	94.00	4,277,000	貸付有価証券 14,200株(12,600株)
		日鉄鉱業	43,000	424.00	18,232,000	
		三井松島産業	101,000	113.00	11,413,000	
		国際石油開発帝石	815,800	825.70	673,606,060	
		日本海洋掘削	4,600	2,446.00	11,251,600	貸付有価証券 2,200株(300株)
		石油資源開発	24,500	2,400.00	58,800,000	
K&Oエナジーグループ	10,400	1,304.00	13,561,600			

ショーボンドホールディングス	16,200	4,805.00	77,841,000	貸付有価証券 7,700株
ミライト・ホールディングス	47,600	1,026.00	48,837,600	
タマホーム	11,600	444.00	5,150,400	貸付有価証券 5,500株(1,300株)
サンヨーホームズ	3,200	500.00	1,600,000	貸付有価証券 1,500株
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,159.00	4,172,400	貸付有価証券 1,500株
安藤・間	103,300	548.00	56,608,400	
東急建設	50,400	907.00	45,712,800	貸付有価証券 23,200株
コムシスホールディングス	66,600	1,779.00	118,481,400	貸付有価証券 400株
ミサワホーム	18,300	756.00	13,834,800	貸付有価証券 8,700株
ビーアールホールディングス	6,100	441.00	2,690,100	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
高松コンストラクショングループ	11,700	2,431.00	28,442,700	
東建コーポレーション	6,400	8,880.00	56,832,000	
ソネック	1,700	560.00	952,000	貸付有価証券 700株(700株)
ヤマウラ	7,200	524.00	3,772,800	
大成建設	804,000	746.00	599,784,000	
大林組	464,400	1,075.00	499,230,000	
清水建設	474,000	982.00	465,468,000	貸付有価証券 33,000株
飛島建設	124,300	182.00	22,622,600	貸付有価証券 59,400株(1,400株)
長谷工コーポレーション	180,700	1,015.00	183,410,500	
松井建設	17,100	785.00	13,423,500	
銭高組	22,000	459.00	10,098,000	
鹿島建設	726,000	697.00	506,022,000	
不動テトラ	109,400	136.00	14,878,400	貸付有価証券 52,200株
大末建設	5,900	859.00	5,068,100	
鉄建建設	94,000	277.00	26,038,000	貸付有価証券 45,000株(1,000株)
西松建設	179,000	458.00	81,982,000	貸付有価証券

				28,000株
三井住友建設	593,400	97.00	57,559,800	貸付有価証券 98,900株
大豊建設	60,000	476.00	28,560,000	貸付有価証券 14,000株
前田建設工業	95,000	838.00	79,610,000	貸付有価証券 31,000株(10,000株)
佐田建設	10,700	418.00	4,472,600	貸付有価証券 200株
ナカノフドー建設	11,800	518.00	6,112,400	
奥村組	147,000	596.00	87,612,000	
東鉄工業	18,600	3,205.00	59,613,000	
イチケン	17,000	269.00	4,573,000	貸付有価証券 3,000株
浅沼組	50,000	250.00	12,500,000	貸付有価証券 2,000株
戸田建設	180,000	514.00	92,520,000	
熊谷組	227,000	296.00	67,192,000	
青木あすなろ建設	10,100	673.00	6,797,300	
北野建設	32,000	265.00	8,480,000	
植木組	19,000	223.00	4,237,000	
三井ホーム	20,000	485.00	9,700,000	
矢作建設工業	21,100	889.00	18,757,900	貸付有価証券 6,800株(700株)
ピーエス三菱	18,300	417.00	7,631,100	貸付有価証券 6,200株(1,100株)
日本ハウスホールディングス	31,600	362.00	11,439,200	貸付有価証券 14,900株
大東建託	57,000	16,585.00	945,345,000	
新日本建設	18,400	510.00	9,384,000	
N I P P O	36,000	1,834.00	66,024,000	
東亜道路工業	29,000	368.00	10,672,000	
前田道路	48,000	2,026.00	97,248,000	
日本道路	46,000	492.00	22,632,000	
東亜建設工業	135,000	171.00	23,085,000	
若築建設	89,000	150.00	13,350,000	貸付有価証券 42,000株(2,000株)
東洋建設	48,600	483.00	23,473,800	貸付有価証券 9,000株
五洋建設	171,800	502.00	86,243,600	

大林道路	18,100	758.00	13,719,800	貸付有価証券 8,400株
世紀東急工業	24,300	475.00	11,542,500	
福田組	25,000	1,310.00	32,750,000	
住友林業	106,600	1,265.00	134,849,000	
日本基礎技術	17,200	419.00	7,206,800	
日成ビルド工業	43,000	434.00	18,662,000	貸付有価証券 20,000株
ヤマダ・エスバイエル ホーム	79,000	91.00	7,189,000	貸付有価証券 37,000株
巴コーポレーション	19,200	350.00	6,720,000	貸付有価証券 100株
パナホーム	58,000	871.00	50,518,000	
大和ハウス工業	457,500	3,033.00	1,387,597,500	
ライト工業	29,800	1,163.00	34,657,400	
積水ハウス	517,700	1,926.00	997,090,200	
日特建設	17,000	418.00	7,106,000	
北陸電気工事	7,500	852.00	6,390,000	
ユアテック	24,000	792.00	19,008,000	
西部電気工業	13,000	437.00	5,681,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
四電工	12,000	407.00	4,884,000	
中電工	22,400	2,221.00	49,750,400	貸付有価証券 500株
関電工	62,000	880.00	54,560,000	貸付有価証券 5,000株
きんでん	93,600	1,315.00	123,084,000	
東京エネシス	18,000	1,082.00	19,476,000	
トーエネック	22,000	595.00	13,090,000	
住友電設	12,200	1,425.00	17,385,000	
日本電設工業	25,200	1,998.00	50,349,600	
協和エクシオ	60,700	1,450.00	88,015,000	
新日本空調	13,000	1,026.00	13,338,000	貸付有価証券 800株
N D S	24,000	292.00	7,008,000	
九電工	28,300	3,250.00	91,975,000	貸付有価証券 13,400株（11,000株）
三機工業	34,300	892.00	30,595,600	貸付有価証券 3,300株

日揮	156,000	1,852.00	288,912,000	
中外炉工業	47,000	198.00	9,306,000	貸付有価証券 13,000株
ヤマト	13,900	474.00	6,588,600	
太平電業	23,000	938.00	21,574,000	貸付有価証券 5,000株
高砂熱学工業	46,200	1,373.00	63,432,600	貸付有価証券 9,400株
三晃金属工業	15,000	304.00	4,560,000	
朝日工業社	18,000	442.00	7,956,000	
明星工業	28,000	501.00	14,028,000	
大気社	18,900	2,479.00	46,853,100	貸付有価証券 700株
ダイダン	21,000	771.00	16,191,000	
日比谷総合設備	18,600	1,588.00	29,536,800	
東芝プラントシステム	25,100	1,375.00	34,512,500	貸付有価証券 12,000株（4,400株）
OSJBホールディングス	31,500	259.00	8,158,500	
東洋エンジニアリング	83,000	294.00	24,402,000	貸付有価証券 27,000株
千代田化工建設	112,000	827.00	92,624,000	貸付有価証券 6,000株
新興プランテック	31,800	866.00	27,538,800	
日本製粉	99,000	855.00	84,645,000	
日清製粉グループ本社	169,800	1,854.00	314,809,200	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
日東富士製粉	12,000	334.00	4,008,000	
昭和産業	64,000	500.00	32,000,000	
鳥越製粉	12,300	635.00	7,810,500	
中部飼料	14,300	851.00	12,169,300	
フィード・ワン	93,200	124.00	11,556,800	
東洋精糖	23,000	106.00	2,438,000	
日本甜菜製糖	79,000	189.00	14,931,000	
三井製糖	61,000	515.00	31,415,000	
塩水港精糖	16,500	263.00	4,339,500	貸付有価証券 400株
日新製糖	6,600	1,387.00	9,154,200	
森永製菓	140,000	547.00	76,580,000	

中村屋	36,000	457.00	16,452,000	
江崎グリコ	35,800	5,650.00	202,270,000	
名糖産業	6,800	1,335.00	9,078,000	
不二家	89,000	192.00	17,088,000	
山崎製パン	113,000	2,728.00	308,264,000	貸付有価証券 2,000株
第一屋製パン	24,000	109.00	2,616,000	
モロゾフ	24,000	428.00	10,272,000	
亀田製菓	8,600	4,455.00	38,313,000	
寿スピリッツ	11,000	2,310.00	25,410,000	貸付有価証券 5,200株
カルビー	57,400	4,270.00	245,098,000	
森永乳業	139,000	614.00	85,346,000	
六甲バター	6,900	1,946.00	13,427,400	貸付有価証券 2,900株
ヤクルト本社	83,000	5,210.00	432,430,000	貸付有価証券 33,600株（15,500株）
明治ホールディングス	91,700	8,840.00	810,628,000	
雪印メグミルク	36,400	2,811.00	102,320,400	貸付有価証券 1,100株
プリマハム	98,000	304.00	29,792,000	
日本ハム	114,000	2,629.00	299,706,000	
林兼産業	50,000	97.00	4,850,000	貸付有価証券 4,000株
丸大食品	80,000	460.00	36,800,000	
S Foods	9,700	2,894.00	28,071,800	貸付有価証券 4,600株（3,300株）
伊藤ハム米久ホールディングス	92,500	847.00	78,347,500	貸付有価証券 14,000株
サッポロホールディングス	237,000	609.00	144,333,000	貸付有価証券 12,000株
アサヒグループホールディングス	290,500	3,577.00	1,039,118,500	貸付有価証券 50,100株
キリンホールディングス	627,600	1,784.00	1,119,638,400	貸付有価証券 124,200株
宝ホールディングス	112,100	964.00	108,064,400	
オエノンホールディングス	42,000	220.00	9,240,000	
養命酒製造	4,800	1,928.00	9,254,400	
コカ・コーラウエスト	52,500	3,200.00	168,000,000	

コカ・コーライースト ジャパン	54,800	2,143.00	117,436,400	
サントリー食品インター ナショナル	106,100	5,320.00	564,452,000	
ダイトードリンコ	7,800	5,600.00	43,680,000	貸付有価証券 100株（100株）
伊藤園	45,900	3,535.00	162,256,500	貸付有価証券 14,100株（1,600株）
キーコーヒー	13,600	1,874.00	25,486,400	貸付有価証券 600株
ユニカフェ	4,200	897.00	3,767,400	
ジャパンフーズ	2,000	1,205.00	2,410,000	貸付有価証券 900株
日清オイリオグループ	82,000	475.00	38,950,000	
不二製油グループ本社	41,300	2,068.00	85,408,400	
かどや製油	1,500	2,788.00	4,182,000	貸付有価証券 300株
J - オイルミルズ	65,000	353.00	22,945,000	
キッコーマン	117,000	3,635.00	425,295,000	
味の素	325,700	2,606.00	848,774,200	
キューピー	78,800	2,970.00	234,036,000	
ハウス食品グループ本社	52,900	2,142.00	113,311,800	貸付有価証券 24,000株（1,800株）
カゴメ	55,600	2,468.00	137,220,800	貸付有価証券 26,300株（14,300株）
焼津水産化学工業	7,300	997.00	7,278,100	
アリアケジャパン	12,700	6,370.00	80,899,000	
ピエトロ	1,400	1,940.00	2,716,000	貸付有価証券 600株（300株）
エバラ食品工業	3,700	1,963.00	7,263,100	
ニチレイ	165,000	988.00	163,020,000	
東洋水産	76,100	4,050.00	308,205,000	
イトアンド	1,700	2,133.00	3,626,100	貸付有価証券 600株
日清食品ホールディング ス	65,500	5,300.00	347,150,000	貸付有価証券 31,300株
永谷園ホールディングス	15,000	1,105.00	16,575,000	
一正蒲鉾	5,400	1,013.00	5,470,200	貸付有価証券 1,400株
フジッコ	15,000	2,407.00	36,105,000	

ロック・フィールド	16,100	1,692.00	27,241,200	
日本たばこ産業	915,500	4,593.00	4,204,891,500	貸付有価証券 256,000株
ケンコーマヨネーズ	5,000	2,330.00	11,650,000	
わらべや日洋	8,300	2,098.00	17,413,400	
なとり	7,700	1,708.00	13,151,600	
北の達人コーポレーション	2,800	508.00	1,422,400	
ユーグレナ	49,600	1,559.00	77,326,400	貸付有価証券 22,500株
ミヨシ油脂	53,000	130.00	6,890,000	貸付有価証券 1,000株
理研ビタミン	4,600	4,245.00	19,527,000	貸付有価証券 2,100株
片倉工業	18,100	1,204.00	21,792,400	
ゲンゼ	117,000	308.00	36,036,000	
東洋紡	573,000	186.00	106,578,000	
ユニチカ	421,000	54.00	22,734,000	貸付有価証券 136,000株
富士紡ホールディングス	70,000	225.00	15,750,000	
倉敷紡績	148,000	195.00	28,860,000	
シキボウ	88,000	108.00	9,504,000	
日本毛織	44,500	763.00	33,953,500	貸付有価証券 21,000株
大東紡織	21,000	63.00	1,323,000	
トーア紡コーポレーション	6,100	485.00	2,958,500	貸付有価証券 1,600株
ダイドーリミテッド	16,200	466.00	7,549,200	貸付有価証券 300株
帝国繊維	15,100	1,507.00	22,755,700	
帝人	592,000	367.00	217,264,000	貸付有価証券 56,000株（56,000株）
東レ	1,050,000	916.80	962,640,000	貸付有価証券 15,000株
サカイオーベックス	38,000	170.00	6,460,000	
住江織物	36,000	267.00	9,612,000	
日本フェルト	7,700	444.00	3,418,800	
イチカワ	10,000	275.00	2,750,000	
日東製網	16,000	138.00	2,208,000	貸付有価証券

				2,000株
芦森工業	31,000	158.00	4,898,000	貸付有価証券 15,000株
アツギ	111,000	113.00	12,543,000	
ダイニック	27,000	150.00	4,050,000	
セーレン	36,100	1,100.00	39,710,000	
東海染工	20,000	133.00	2,660,000	
小松精練	22,200	621.00	13,786,200	貸付有価証券 8,200株
ワコールホールディングス	86,000	1,195.00	102,770,000	
ホギメディカル	9,100	6,240.00	56,784,000	貸付有価証券 4,300株（2,400株）
レナウン	39,100	120.00	4,692,000	貸付有価証券 18,700株（7,000株）
クラウドピア	3,300	520.00	1,716,000	貸付有価証券 1,400株
T S Iホールディングス	64,600	694.00	44,832,400	貸付有価証券 200株
三陽商会	81,000	251.00	20,331,000	貸付有価証券 37,000株
ナイガイ	53,000	48.00	2,544,000	貸付有価証券 13,000株
オンワードホールディングス	94,000	760.00	71,440,000	貸付有価証券 44,000株
ルック	26,000	158.00	4,108,000	貸付有価証券 5,000株
キムラタン	610,000	7.00	4,270,000	貸付有価証券 193,000株
ゴールドウイン	6,100	4,340.00	26,474,000	貸付有価証券 2,900株（900株）
デサント	33,000	1,442.00	47,586,000	
キング	7,200	371.00	2,671,200	
ヤマトインターナショナル	8,900	392.00	3,488,800	貸付有価証券 2,900株
特種東海製紙	84,000	357.00	29,988,000	
王子ホールディングス	594,000	436.00	258,984,000	貸付有価証券 12,000株
日本製紙	74,800	2,108.00	157,678,400	
三菱製紙	221,000	81.00	17,901,000	
北越紀州製紙	89,800	674.00	60,525,200	貸付有価証券

				10,000株
中越パルプ工業	57,000	206.00	11,742,000	貸付有価証券 24,000株(18,000株)
巴川製紙所	22,000	194.00	4,268,000	
大王製紙	64,100	1,129.00	72,368,900	貸付有価証券 30,400株(8,000株)
レンゴー	128,000	578.00	73,984,000	
トーモク	46,000	295.00	13,570,000	
ザ・パック	10,200	2,614.00	26,662,800	
クラレ	228,400	1,422.00	324,784,800	貸付有価証券 67,200株
旭化成	903,000	754.40	681,223,200	
共和レザー	9,500	822.00	7,809,000	
昭和電工	964,000	110.00	106,040,000	貸付有価証券 304,000株
住友化学	1,066,000	492.00	524,472,000	
日本化成	27,000	111.00	2,997,000	
住友精化	30,000	530.00	15,900,000	貸付有価証券 13,000株
日産化学工業	87,000	2,952.00	256,824,000	
ラサ工業	55,000	107.00	5,885,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
クレハ	109,000	375.00	40,875,000	貸付有価証券 32,000株
多木化学	9,000	632.00	5,688,000	
テイカ	24,000	495.00	11,880,000	
石原産業	260,000	74.00	19,240,000	貸付有価証券 31,000株
片倉コープアグリ	17,000	216.00	3,672,000	
日東エフシー	8,500	908.00	7,718,000	貸付有価証券 600株
日本曹達	94,000	580.00	54,520,000	
東ソー	391,000	510.00	199,410,000	
トクヤマ	240,000	175.00	42,000,000	貸付有価証券 98,000株
セントラル硝子	157,000	636.00	99,852,000	
東亜合成	90,600	1,013.00	91,777,800	
大阪ソーダ	62,000	413.00	25,606,000	貸付有価証券 22,000株
関東電化工業	35,000	774.00	27,090,000	

				貸付有価証券 16,000株
デンカ	300,000	458.00	137,400,000	
信越化学工業	259,600	6,215.00	1,613,414,000	貸付有価証券 100株
日本カーバイド工業	49,000	163.00	7,987,000	貸付有価証券 23,000株
堺化学工業	59,000	312.00	18,408,000	
エア・ウォーター	119,000	1,629.00	193,851,000	
大陽日酸	111,500	1,010.00	112,615,000	貸付有価証券 46,000株
日本化学工業	54,000	218.00	11,772,000	
日本パーカライジング	74,000	978.00	72,372,000	
高圧ガス工業	21,000	636.00	13,356,000	
チタン工業	17,000	189.00	3,213,000	
四国化成工業	21,000	850.00	17,850,000	
戸田工業	29,000	307.00	8,903,000	貸付有価証券 13,000株
ステラ ケミファ	7,400	2,951.00	21,837,400	貸付有価証券 700株
保土谷化学工業	43,000	231.00	9,933,000	貸付有価証券 18,000株
日本触媒	21,000	5,240.00	110,040,000	
大日精化工業	56,000	460.00	25,760,000	
カネカ	195,000	912.00	177,840,000	
三菱瓦斯化学	249,000	580.00	144,420,000	
三井化学	614,000	371.00	227,794,000	
J S R	135,800	1,549.00	210,354,200	
東京応化工業	29,000	3,080.00	89,320,000	
大阪有機化学工業	10,300	650.00	6,695,000	
三菱ケミカルホールディングス	969,600	572.00	554,611,200	
日本合成化学工業	34,000	668.00	22,712,000	貸付有価証券 15,000株(15,000株)
ダイセル	203,600	1,330.00	270,788,000	
住友ベークライト	135,000	441.00	59,535,000	
積水化学工業	328,600	1,376.00	452,153,600	
日本ゼオン	122,000	794.00	96,868,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)

アイカ工業	43,500	2,457.00	106,879,500	
宇部興産	775,000	217.00	168,175,000	
積水樹脂	22,300	1,542.00	34,386,600	
タキロン	34,000	552.00	18,768,000	
旭有機材	47,000	202.00	9,494,000	
日立化成	71,500	1,970.00	140,855,000	
ニチバン	14,000	642.00	8,988,000	
リケンテクノス	31,200	435.00	13,572,000	貸付有価証券 7,600株(500株)
大倉工業	35,000	283.00	9,905,000	
積水化成成品工業	37,000	356.00	13,172,000	
群栄化学工業	39,000	298.00	11,622,000	
タイガースポリマー	7,100	610.00	4,331,000	
ミライアル	5,200	742.00	3,858,400	
ダイキアクシス	2,700	878.00	2,370,600	
ダイキョーニシカワ	18,600	1,484.00	27,602,400	貸付有価証券 8,800株
日本化薬	94,000	1,174.00	110,356,000	
カーリットホールディングス	13,400	487.00	6,525,800	
日本精化	12,000	763.00	9,156,000	
扶桑化学工業	9,100	1,698.00	15,451,800	貸付有価証券 700株
A D E K A	71,200	1,532.00	109,078,400	
日油	109,000	906.00	98,754,000	
新日本理化	22,800	185.00	4,218,000	貸付有価証券 10,600株(6,800株)
ハリマ化成グループ	12,300	537.00	6,605,100	
花王	389,300	6,102.00	2,375,508,600	貸付有価証券 40,300株(1,900株)
第一工業製薬	32,000	336.00	10,752,000	貸付有価証券 12,000株
ニイタカ	2,100	1,402.00	2,944,200	
三洋化成工業	45,000	837.00	37,665,000	
大日本塗料	83,000	196.00	16,268,000	
日本ペイントホールディングス	111,700	2,727.00	304,605,900	貸付有価証券 27,400株
関西ペイント	163,800	1,982.00	324,651,600	貸付有価証券 78,200株

神東塗料	11,000	167.00	1,837,000	
中国塗料	41,000	698.00	28,618,000	貸付有価証券 2,000株
日本特殊塗料	10,100	866.00	8,746,600	
藤倉化成	19,700	493.00	9,712,100	
太陽ホールディングス	10,600	3,435.00	36,411,000	
D I C	572,000	252.00	144,144,000	
サカタインクス	29,600	1,241.00	36,733,600	
東洋インキ S C ホール ディングス	143,000	436.00	62,348,000	
T & K T O K A	10,500	881.00	9,250,500	
富士フィルムホールディ ングス	331,300	4,589.00	1,520,335,700	
資生堂	274,700	2,445.50	671,778,850	貸付有価証券 41,200株
ライオン	167,000	1,548.00	258,516,000	
高砂香料工業	9,500	2,610.00	24,795,000	
マンダム	13,500	5,060.00	68,310,000	
ミルボン	8,500	4,825.00	41,012,500	貸付有価証券 100株
ファンケル	33,600	1,533.00	51,508,800	貸付有価証券 15,900株(9,700株)
コーセー	23,400	9,000.00	210,600,000	
コタ	4,900	1,093.00	5,355,700	
シーズ・ホールディング ス	18,200	2,183.00	39,730,600	貸付有価証券 2,300株
シーボン	1,600	2,334.00	3,734,400	貸付有価証券 700株
ポーラ・オルビスホール ディングス	14,700	9,320.00	137,004,000	
ノエビアホールディング ス	9,100	3,105.00	28,255,500	
アジュバンコスメジャパ ン	2,700	972.00	2,624,400	
エステー	9,900	1,168.00	11,563,200	
アグロ カネショウ	5,600	1,021.00	5,717,600	貸付有価証券 300株
コニシ	22,700	1,416.00	32,143,200	
長谷川香料	18,300	1,832.00	33,525,600	貸付有価証券 100株

星光 P M C	7,900	1,197.00	9,456,300	貸付有価証券 3,700株（200株）
小林製薬	21,900	8,820.00	193,158,000	
荒川化学工業	12,300	958.00	11,783,400	
メック	11,200	774.00	8,668,800	貸付有価証券 3,800株
日本高純度化学	4,100	2,038.00	8,355,800	貸付有価証券 1,900株
タカラバイオ	31,000	1,425.00	44,175,000	
J C U	4,200	3,485.00	14,637,000	貸付有価証券 1,800株
新田ゼラチン	9,500	735.00	6,982,500	貸付有価証券 2,300株（2,000株）
O A T アグリオ	1,700	1,499.00	2,548,300	
デクセリアルズ	43,300	881.00	38,147,300	貸付有価証券 14,100株（100株）
アース製薬	10,400	4,880.00	50,752,000	貸付有価証券 4,600株（2,900株）
イハラケミカル工業	22,300	1,403.00	31,286,900	
北興化学工業	15,000	322.00	4,830,000	
大成ラミック	4,100	2,723.00	11,164,300	
クミアイ化学工業	29,900	948.00	28,345,200	貸付有価証券 13,200株（10,600株）
日本農薬	33,100	572.00	18,933,200	貸付有価証券 13,800株（500株）
アキレス	118,000	139.00	16,402,000	
有沢製作所	21,400	552.00	11,812,800	
日東電工	111,900	6,840.00	765,396,000	貸付有価証券 400株
レック	4,500	1,336.00	6,012,000	
きもと	23,500	163.00	3,830,500	貸付有価証券 900株
藤森工業	12,400	2,577.00	31,954,800	貸付有価証券 100株
前澤化成工業	10,100	1,011.00	10,211,100	
J S P	9,400	2,155.00	20,257,000	
エフピコ	12,800	4,850.00	62,080,000	
天馬	11,100	1,699.00	18,858,900	貸付有価証券 100株
信越ポリマー	28,400	677.00	19,226,800	

東リ	37,000	338.00	12,506,000	
ニフコ	27,700	5,340.00	147,918,000	貸付有価証券 100株
日本バルカー工業	56,000	287.00	16,072,000	
ユニ・チャーム	293,100	2,303.50	675,155,850	貸付有価証券 81,900株（4,700株）
協和発酵キリン	173,200	2,026.00	350,903,200	貸付有価証券 45,400株
武田薬品工業	576,500	5,289.00	3,049,108,500	貸付有価証券 14,600株
アステラス製薬	1,620,900	1,478.50	2,396,500,650	
大日本住友製薬	102,500	1,418.00	145,345,000	貸付有価証券 47,600株
塩野義製薬	211,000	5,584.00	1,178,224,000	
田辺三菱製薬	168,700	1,990.00	335,713,000	
わかもと製薬	16,000	254.00	4,064,000	
あすか製薬	18,400	1,435.00	26,404,000	貸付有価証券 4,500株
日本新薬	33,200	5,070.00	168,324,000	貸付有価証券 15,800株
ビオフェルミン製薬	2,300	3,465.00	7,969,500	
中外製薬	144,100	3,680.00	530,288,000	
科研製薬	24,900	6,020.00	149,898,000	
エーザイ	178,200	6,640.00	1,183,248,000	貸付有価証券 3,000株
ロート製薬	70,900	1,884.00	133,575,600	
小野薬品工業	328,700	5,210.00	1,712,527,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
久光製薬	44,900	5,470.00	245,603,000	
有機合成薬品工業	9,000	252.00	2,268,000	
持田製薬	9,900	8,150.00	80,685,000	
参天製薬	266,600	1,620.00	431,892,000	
扶桑薬品工業	49,000	265.00	12,985,000	貸付有価証券 1,000株
日本ケミファ	20,000	472.00	9,440,000	
ツムラ	45,600	2,886.00	131,601,600	貸付有価証券 21,700株
日医工	33,800	2,651.00	89,603,800	
キッセイ薬品工業	25,600	2,577.00	65,971,200	

生化学工業	27,700	1,743.00	48,281,100	貸付有価証券 6,400株
栄研化学	12,100	1,967.00	23,800,700	
日水製薬	5,800	1,155.00	6,699,000	
鳥居薬品	9,900	2,623.00	25,967,700	
J C R ファーマ	11,100	2,751.00	30,536,100	貸付有価証券 100株
東和薬品	6,600	4,985.00	32,901,000	
富士製薬工業	4,700	1,959.00	9,207,300	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	24,600	7,240.00	178,104,000	貸付有価証券 11,700株
ゼリア新薬工業	29,600	1,394.00	41,262,400	貸付有価証券 100株
第一三共	486,800	2,739.00	1,333,345,200	
キョーリン製薬ホールディングス	38,600	2,171.00	83,800,600	
大幸薬品	7,100	1,485.00	10,543,500	貸付有価証券 3,300株
ダイト	8,100	2,910.00	23,571,000	
大塚ホールディングス	311,200	4,325.00	1,345,940,000	
大正製薬ホールディングス	34,800	9,220.00	320,856,000	貸付有価証券 1,300株
ペプチドリーム	24,100	6,670.00	160,747,000	貸付有価証券 4,400株
日本コークス工業	116,800	75.00	8,760,000	
昭和シェル石油	145,600	1,110.00	161,616,000	貸付有価証券 18,700株
ニチレキ	17,700	743.00	13,151,100	
東燃ゼネラル石油	218,000	996.00	217,128,000	
ユシロ化学工業	7,800	1,243.00	9,695,400	
ビーピー・カストロール	5,900	1,289.00	7,605,100	貸付有価証券 100株
富士石油	33,600	342.00	11,491,200	
MORESCO	4,600	1,126.00	5,179,600	貸付有価証券 200株
出光興産	75,500	2,263.00	170,856,500	貸付有価証券 35,900株
J Xホールディングス	1,713,500	447.70	767,133,950	
コスモエネルギーホール	43,700	1,352.00	59,082,400	

ディングス				
横浜ゴム	87,300	1,900.00	165,870,000	貸付有価証券 30,900株
東洋ゴム工業	65,500	1,631.00	106,830,500	
ブリヂストン	488,500	4,138.00	2,021,413,000	貸付有価証券 146,500株
住友ゴム工業	135,500	1,717.00	232,653,500	貸付有価証券 52,200株
藤倉ゴム工業	12,100	443.00	5,360,300	
オカモト	45,000	911.00	40,995,000	貸付有価証券 2,000株
フコク	5,300	873.00	4,626,900	
ニッタ	15,600	2,735.00	42,666,000	
住友理工	31,300	934.00	29,234,200	
三ツ星ベルト	35,000	861.00	30,135,000	
バンドー化学	53,000	521.00	27,613,000	
日東紡績	96,000	337.00	32,352,000	
旭硝子	764,000	674.00	514,936,000	貸付有価証券 365,000株（63,000 株）
日本板硝子	698,000	87.00	60,726,000	貸付有価証券 333,000株
石塚硝子	20,000	180.00	3,600,000	
日本山村硝子	57,000	163.00	9,291,000	
日本電気硝子	299,000	516.00	154,284,000	貸付有価証券 9,000株（9,000株）
オハラ	5,500	510.00	2,805,000	貸付有価証券 2,500株（800株）
住友大阪セメント	287,000	464.00	133,168,000	
太平洋セメント	903,000	286.00	258,258,000	
デイ・シー	13,400	354.00	4,743,600	
日本ヒューム	13,900	591.00	8,214,900	
日本コンクリート工業	29,800	295.00	8,791,000	貸付有価証券 400株
三谷セキサン	7,200	1,689.00	12,160,800	貸付有価証券 100株
アジアパイルホールディ ングス	17,800	419.00	7,458,200	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	125,000	288.00	36,000,000	
日本カーボン	71,000	225.00	15,975,000	貸付有価証券

				33,000株(7,000株)
東洋炭素	8,000	1,384.00	11,072,000	貸付有価証券 1,700株(200株)
ノリタケカンパニーリミ テド	82,000	246.00	20,172,000	貸付有価証券 20,000株
TOTO	106,300	3,840.00	408,192,000	貸付有価証券 2,700株
日本碍子	183,000	2,395.00	438,285,000	
日本特殊陶業	124,700	1,952.00	243,414,400	
ダントーホールディング ス	17,000	182.00	3,094,000	貸付有価証券 8,000株(4,000株)
MARUWA	5,300	3,125.00	16,562,500	貸付有価証券 100株
品川リフラクトリーズ	36,000	189.00	6,804,000	
黒崎播磨	31,000	252.00	7,812,000	
ヨータイ	8,000	286.00	2,288,000	貸付有価証券 1,000株
イソライト工業	7,100	222.00	1,576,200	
東京窯業	17,600	168.00	2,956,800	
ニッカトー	5,100	373.00	1,902,300	
フジインコーポレー テッド	12,700	1,490.00	18,923,000	貸付有価証券 6,100株
エーアンドエーマテリア ル	30,000	81.00	2,430,000	
ニチアス	74,000	794.00	58,756,000	貸付有価証券 11,000株
ニチハ	19,200	1,656.00	31,795,200	
新日鐵住金	652,500	2,193.50	1,431,258,750	貸付有価証券 22,800株(22,800株)
神戸製鋼所	2,658,000	102.00	271,116,000	貸付有価証券 1,125,000株(619,000 株)
中山製鋼所	162,000	63.00	10,206,000	貸付有価証券 10,000株
合同製鐵	81,000	189.00	15,309,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	395,500	1,464.00	579,012,000	
日新製鋼	66,000	1,474.00	97,284,000	貸付有価証券 2,100株
東京製鐵	79,900	632.00	50,496,800	貸付有価証券 4,400株

共英製鋼	15,400	1,598.00	24,609,200	貸付有価証券 2,200株
大和工業	31,900	2,490.00	79,431,000	
東京鐵鋼	30,000	340.00	10,200,000	
大阪製鐵	9,100	1,823.00	16,589,300	
淀川製鋼所	21,500	2,463.00	52,954,500	
東洋鋼鈹	34,600	353.00	12,213,800	
丸一鋼管	48,400	3,265.00	158,026,000	
モリ工業	23,000	299.00	6,877,000	
大同特殊鋼	242,000	363.00	87,846,000	
日本高周波鋼業	57,000	78.00	4,446,000	
日本冶金工業	106,400	157.00	16,704,800	貸付有価証券 50,600株
山陽特殊製鋼	86,000	458.00	39,388,000	
愛知製鋼	85,000	429.00	36,465,000	
日立金属	165,700	1,169.00	193,703,300	貸付有価証券 25,200株（25,200株）
日本金属	37,000	98.00	3,626,000	貸付有価証券 5,000株
大平洋金属	101,000	332.00	33,532,000	貸付有価証券 43,000株（7,000株）
新日本電工	81,900	169.00	13,841,100	貸付有価証券 16,500株
栗本鐵工所	69,000	169.00	11,661,000	貸付有価証券 6,000株
虹技	20,000	163.00	3,260,000	
日本鑄鉄管	16,000	154.00	2,464,000	貸付有価証券 7,000株（7,000株）
三菱製鋼	101,000	178.00	17,978,000	
日亜鋼業	20,000	227.00	4,540,000	
日本精線	10,000	453.00	4,530,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	13,000	619.00	8,047,000	貸付有価証券 1,000株
新家工業	29,000	127.00	3,683,000	貸付有価証券 4,000株
大紀アルミニウム工業所	22,000	273.00	6,006,000	
日本輕金属ホールディングス	327,500	191.00	62,552,500	貸付有価証券 128,100株
三井金属鉱業	369,000	191.00	70,479,000	

東邦亜鉛	76,000	285.00	21,660,000	貸付有価証券 34,000株
三菱マテリアル	903,000	334.00	301,602,000	
住友金属鉱山	399,000	1,137.00	453,663,000	
DOWAホールディングス	186,000	677.00	125,922,000	
古河機械金属	226,000	161.00	36,386,000	貸付有価証券 1,000株
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,200	1,366.00	19,397,200	貸付有価証券 6,700株
東邦チタニウム	24,500	735.00	18,007,500	貸付有価証券 11,100株
UACJ	202,000	215.00	43,430,000	貸付有価証券 96,000株（1,000株）
古河電気工業	455,000	262.00	119,210,000	
住友電気工業	579,200	1,305.50	756,145,600	
フジクラ	201,000	524.00	105,324,000	
昭和電線ホールディングス	172,000	65.00	11,180,000	貸付有価証券 82,000株
東京特殊電線	2,000	866.00	1,732,000	
タツタ電線	30,100	339.00	10,203,900	
沖電線	17,000	193.00	3,281,000	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
カナレ電気	2,300	1,944.00	4,471,200	
平河ヒューテック	6,800	875.00	5,950,000	
リョービ	88,000	410.00	36,080,000	
アーレスティ	16,800	826.00	13,876,800	
アサヒホールディングス	21,800	1,477.00	32,198,600	
稲葉製作所	7,700	1,331.00	10,248,700	貸付有価証券 3,600株
宮地エンジニアリンググループ	45,000	157.00	7,065,000	貸付有価証券 21,000株
トーカロ	10,200	1,836.00	18,727,200	
アルファC o	4,800	1,005.00	4,824,000	
SUMCO	113,300	716.00	81,122,800	貸付有価証券 54,100株
川田テクノロジーズ	2,700	3,530.00	9,531,000	貸付有価証券 1,300株
東洋製罐グループホールディングス	102,800	2,159.00	221,945,200	

ホッカホールディングス	38,000	318.00	12,084,000	
コロナ	7,600	1,100.00	8,360,000	
横河ブリッジホールディングス	27,400	1,006.00	27,564,400	貸付有価証券 13,000株(200株)
駒井ハルテック	26,000	247.00	6,422,000	
高田機工	12,000	196.00	2,352,000	
三和ホールディングス	143,600	875.00	125,650,000	
文化シャッター	40,300	927.00	37,358,100	
三協立山	19,000	1,522.00	28,918,000	貸付有価証券 1,500株
アルインコ	10,800	989.00	10,681,200	貸付有価証券 500株
東洋シャッター	3,600	542.00	1,951,200	
LIXILグループ	201,500	2,156.00	434,434,000	
日本フィルコン	10,500	434.00	4,557,000	貸付有価証券 300株(300株)
ノーリツ	28,300	1,857.00	52,553,100	貸付有価証券 4,500株(3,900株)
長府製作所	15,400	2,585.00	39,809,000	貸付有価証券 2,500株
リンナイ	26,900	9,930.00	267,117,000	
ダイニチ工業	7,400	613.00	4,536,200	
日東精工	21,000	281.00	5,901,000	
三洋工業	18,000	167.00	3,006,000	
岡部	30,000	742.00	22,260,000	貸付有価証券 10,100株
ジーテクト	15,100	1,334.00	20,143,400	
中国工業	2,200	768.00	1,689,600	貸付有価証券 900株
東プレ	27,800	2,197.00	61,076,600	貸付有価証券 11,800株(11,800株)
高周波熱錬	26,900	728.00	19,583,200	貸付有価証券 2,800株
東京製綱	98,000	147.00	14,406,000	貸付有価証券 4,000株
サンコール	7,700	477.00	3,672,900	
モリテック スチール	7,300	248.00	1,810,400	
パイオラックス	7,300	5,800.00	42,340,000	
日本発條	136,200	977.00	133,067,400	貸付有価証券

				7,700株(7,700株)
中央発條	18,000	300.00	5,400,000	
アドバネクス	2,700	1,236.00	3,337,200	
立川ブラインド工業	6,000	703.00	4,218,000	貸付有価証券 400株
三益半導体工業	10,700	1,032.00	11,042,400	
日本ドライケミカル	1,800	2,271.00	4,087,800	貸付有価証券 200株
日本製鋼所	239,000	417.00	99,663,000	
三浦工業	64,500	2,010.00	129,645,000	
タクマ	53,000	921.00	48,813,000	
ツガミ	42,000	425.00	17,850,000	貸付有価証券 9,000株
オークマ	94,000	810.00	76,140,000	貸付有価証券 36,000株(4,000株)
東芝機械	79,000	346.00	27,334,000	
アマダホールディングス	210,900	1,082.00	228,193,800	
アイダエンジニアリング	37,900	1,003.00	38,013,700	貸付有価証券 2,600株
滝澤鉄工所	45,000	124.00	5,580,000	
富士機械製造	47,200	1,120.00	52,864,000	貸付有価証券 18,700株(5,400株)
牧野フライス製作所	72,000	666.00	47,952,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
オーエスジー	65,900	1,940.00	127,846,000	貸付有価証券 31,300株(28,200株)
ダイジェット工業	17,000	138.00	2,346,000	
旭ダイヤモンド工業	38,900	1,049.00	40,806,100	
D M G 森精機	79,900	1,211.00	96,758,900	貸付有価証券 38,100株
ソディック	36,700	858.00	31,488,600	貸付有価証券 1,600株(400株)
ディスコ	18,400	9,590.00	176,456,000	貸付有価証券 5,600株
日東工器	8,400	2,153.00	18,085,200	
パンチ工業	5,700	726.00	4,138,200	
豊和工業	8,100	529.00	4,284,900	貸付有価証券 1,200株
O K K	56,000	110.00	6,160,000	
東洋機械金属	10,700	396.00	4,237,200	

津田駒工業	35,000	123.00	4,305,000	貸付有価証券 13,000株
エンシュウ	35,000	72.00	2,520,000	貸付有価証券 3,000株
島精機製作所	20,400	2,247.00	45,838,800	貸付有価証券 9,700株
N C ホールディングス	4,700	1,231.00	5,785,700	貸付有価証券 800株(800株)
フリー	2,800	2,713.00	7,596,400	
ヤマシンフィルタ	2,800	452.00	1,265,600	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
日阪製作所	18,300	785.00	14,365,500	
やまびこ	26,500	772.00	20,458,000	
ペガサスマシン製造	14,900	533.00	7,941,700	貸付有価証券 500株(400株)
ナプテスコ	75,200	2,562.00	192,662,400	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
三井海洋開発	16,900	1,843.00	31,146,700	貸付有価証券 5,500株(400株)
レオン自動機	12,200	594.00	7,246,800	貸付有価証券 700株
S M C	43,400	27,045.00	1,173,753,000	
新川	12,900	438.00	5,650,200	貸付有価証券 1,100株(200株)
ホソカワミクロン	24,000	562.00	13,488,000	
ユニオンツール	6,200	2,875.00	17,825,000	貸付有価証券 2,900株
オイレス工業	18,700	1,754.00	32,799,800	
日精エー・エス・ビー機 械	4,600	2,138.00	9,834,800	貸付有価証券 2,200株(100株)
サトーホールディングス	19,500	2,267.00	44,206,500	
日本エアテック	5,100	624.00	3,182,400	貸付有価証券 400株
日精樹脂工業	10,500	612.00	6,426,000	貸付有価証券 400株
オカダアイヨン	2,800	829.00	2,321,200	
ワイエイシイ	5,800	1,117.00	6,478,600	貸付有価証券 2,700株
小松製作所	709,100	1,806.00	1,280,634,600	
住友重機械工業	422,000	471.00	198,762,000	
日立建機	64,600	1,732.00	111,887,200	貸付有価証券

				15,500株(1,700株)
日工	22,000	324.00	7,128,000	
巴工業	5,900	1,482.00	8,743,800	
井関農機	148,000	239.00	35,372,000	貸付有価証券 69,000株(2,000株)
TOWA	14,000	732.00	10,248,000	
丸山製作所	30,000	164.00	4,920,000	
北川鉄工所	66,000	195.00	12,870,000	
タカキタ	4,800	553.00	2,654,400	貸付有価証券 1,600株
クボタ	694,500	1,647.00	1,143,841,500	貸付有価証券 205,600株
荏原実業	4,300	1,276.00	5,486,800	
三菱化工機	48,000	221.00	10,608,000	貸付有価証券 16,000株
月島機械	27,400	945.00	25,893,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
帝国電機製作所	10,500	766.00	8,043,000	
東京機械製作所	54,000	42.00	2,268,000	貸付有価証券 21,000株
新東工業	32,800	918.00	30,110,400	
澁谷工業	12,100	1,339.00	16,201,900	貸付有価証券 2,600株(500株)
アイチ コーポレーシ ョン	20,500	813.00	16,666,500	
小森コーポレーション	35,200	1,261.00	44,387,200	
鶴見製作所	10,700	1,479.00	15,825,300	
住友精密工業	23,000	328.00	7,544,000	
酒井重工業	27,000	185.00	4,995,000	
荏原製作所	320,000	490.00	156,800,000	
石井鐵工所	21,000	150.00	3,150,000	
西島製作所	15,400	1,050.00	16,170,000	貸付有価証券 6,400株(1,300株)
北越工業	15,500	663.00	10,276,500	
ダイキン工業	201,300	8,822.00	1,775,868,600	貸付有価証券 2,300株
オルガノ	25,000	415.00	10,375,000	
トーヨーカネツ	77,000	223.00	17,171,000	
栗田工業	86,900	2,594.00	225,418,600	

椿本チエイン	82,000	725.00	59,450,000	
大同工業	28,000	191.00	5,348,000	
木村化工機	12,400	371.00	4,600,400	
アネスト岩田	23,300	1,063.00	24,767,900	
ダイフク	74,300	1,975.00	146,742,500	
サムコ	3,500	932.00	3,262,000	貸付有価証券 500株
加藤製作所	33,000	412.00	13,596,000	貸付有価証券 15,000株
油研工業	27,000	180.00	4,860,000	
タダノ	66,700	1,015.00	67,700,500	
フジテック	40,200	1,102.00	44,300,400	貸付有価証券 13,100株(13,100株)
C K D	38,400	869.00	33,369,600	
キトー	17,400	780.00	13,572,000	貸付有価証券 5,000株
平和	42,800	2,286.00	97,840,800	
理想科学工業	15,300	1,520.00	23,256,000	
S A N K Y O	38,500	4,095.00	157,657,500	
日本金銭機械	12,700	867.00	11,010,900	貸付有価証券 5,000株(1,200株)
マースエンジニアリング	7,800	1,964.00	15,319,200	
福島工業	8,500	2,549.00	21,666,500	
オーイズミ	5,800	465.00	2,697,000	貸付有価証券 2,700株
ダイコク電機	5,700	1,367.00	7,791,900	貸付有価証券 2,700株
竹内製作所	27,300	1,688.00	46,082,400	貸付有価証券 7,500株
アマノ	42,800	1,835.00	78,538,000	
J U K I	20,500	1,045.00	21,422,500	貸付有価証券 9,400株
サンデンホールディングス	84,000	321.00	26,964,000	貸付有価証券 40,000株
蛇の目ミシン工業	13,400	593.00	7,946,200	貸付有価証券 1,300株
マックス	21,000	1,270.00	26,670,000	
グローリー	47,100	3,655.00	172,150,500	
新晃工業	9,600	1,492.00	14,323,200	

大和冷機工業	22,200	939.00	20,845,800	
セガサミーホールディングス	148,500	1,199.00	178,051,500	貸付有価証券 7,600株
日本ピストンリング	5,700	1,461.00	8,327,700	
リケン	64,000	363.00	23,232,000	
T P R	17,000	2,799.00	47,583,000	貸付有価証券 300株
ツバキ・ナカシマ	17,100	1,465.00	25,051,500	貸付有価証券 6,000株
ホシザキ電機	30,300	10,000.00	303,000,000	貸付有価証券 500株
大豊工業	11,100	1,185.00	13,153,500	
日本精工	283,900	959.00	272,260,100	貸付有価証券 5,100株
N T N	343,000	341.00	116,963,000	
ジェイテクト	147,300	1,414.00	208,282,200	
不二越	128,000	349.00	44,672,000	貸付有価証券 61,000株
日本トムソン	47,300	399.00	18,872,700	貸付有価証券 5,700株
T H K	91,900	2,131.00	195,838,900	貸付有価証券 43,800株
ユースン精機	5,400	1,838.00	9,925,200	貸付有価証券 100株
前澤給装工業	5,600	1,427.00	7,991,200	
イーグル工業	17,100	1,436.00	24,555,600	
前澤工業	10,100	295.00	2,979,500	
日本ピラー工業	14,000	940.00	13,160,000	
キッツ	61,600	498.00	30,676,800	貸付有価証券 3,900株
日立工機	37,000	736.00	27,232,000	
マキタ	90,100	6,930.00	624,393,000	
日立造船	109,600	559.00	61,266,400	貸付有価証券 2,600株
三菱重工業	2,461,000	403.20	992,275,200	
I H I	1,062,000	237.00	251,694,000	貸付有価証券 275,000株（21,000 株）
日清紡ホールディングス	76,700	1,186.00	90,966,200	
イビデン	84,600	1,321.00	111,756,600	貸付有価証券

				35,800株(30,700株)
コニカミノルタ	345,100	946.00	326,464,600	
ブラザー工業	178,700	1,253.00	223,911,100	貸付有価証券 20,700株
ミネベア	222,700	874.00	194,639,800	貸付有価証券 4,000株
日立製作所	3,526,000	480.20	1,693,185,200	
東芝	2,910,000	220.60	641,946,000	貸付有価証券 1,387,000株
三菱電機	1,474,000	1,238.50	1,825,549,000	
富士電機	416,000	471.00	195,936,000	
東洋電機製造	27,000	316.00	8,532,000	貸付有価証券 7,000株
安川電機	171,700	1,259.00	216,170,300	貸付有価証券 32,400株(3,800株)
シンフォニアテクノロ ジー	89,000	149.00	13,261,000	
明電舎	127,000	449.00	57,023,000	
オリジン電気	20,000	274.00	5,480,000	
山洋電気	36,000	555.00	19,980,000	
デンヨー	12,800	1,194.00	15,283,200	
東芝テック	99,000	401.00	39,699,000	
芝浦メカトロニクス	22,000	217.00	4,774,000	貸付有価証券 10,000株
マブチモーター	39,600	5,610.00	222,156,000	
日本電産	166,300	8,180.00	1,360,334,000	貸付有価証券 66,300株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	1,600	1,900.00	3,040,000	貸付有価証券 700株(700株)
東光高岳	7,700	1,760.00	13,552,000	
ダブル・スコープ	5,500	5,950.00	32,725,000	貸付有価証券 1,900株
ダイヘン	81,000	547.00	44,307,000	貸付有価証券 1,000株
田淵電機	15,600	470.00	7,332,000	貸付有価証券 7,400株
ヤーマン	1,800	2,087.00	3,756,600	
JVCケンウッド	101,400	271.00	27,479,400	貸付有価証券 43,900株(200株)
ミマキエンジニアリング	12,400	535.00	6,634,000	貸付有価証券

				3,300株(200株)
第一精工	5,700	1,169.00	6,663,300	貸付有価証券 400株(400株)
日新電機	32,400	1,178.00	38,167,200	
大崎電気工業	25,000	760.00	19,000,000	貸付有価証券 10,000株
オムロン	156,100	3,320.00	518,252,000	
日東工業	22,100	1,670.00	36,907,000	
I D E C	18,000	1,016.00	18,288,000	貸付有価証券 100株
不二電機工業	1,300	1,428.00	1,856,400	貸付有価証券 200株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	266,000	449.00	119,434,000	貸付有価証券 4,000株
サクサホールディングス	35,000	210.00	7,350,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
メルコホールディングス	7,600	2,158.00	16,400,800	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
テクノメディカ	3,100	2,074.00	6,429,400	
日本電気	1,900,000	257.00	488,300,000	
富士通	1,333,000	388.40	517,737,200	
沖電気工業	599,000	155.00	92,845,000	貸付有価証券 18,000株
岩崎通信機	65,000	72.00	4,680,000	貸付有価証券 8,000株
電気興業	36,000	481.00	17,316,000	貸付有価証券 17,000株
サンケン電気	75,000	314.00	23,550,000	貸付有価証券 35,000株
ナカヨ	13,000	315.00	4,095,000	貸付有価証券 2,000株
アイホン	7,800	1,664.00	12,979,200	
ルネサスエレクトロニクス	71,500	646.00	46,189,000	貸付有価証券 9,500株
セイコーエプソン	205,800	1,834.00	377,437,200	
ワコム	108,800	447.00	48,633,600	貸付有価証券 48,000株
アルバック	25,400	3,355.00	85,217,000	
アクセル	6,200	846.00	5,245,200	貸付有価証券 1,600株
E I Z O	13,700	3,000.00	41,100,000	貸付有価証券

				1,900株
ジャパンディスプレイ	258,100	212.00	54,717,200	貸付有価証券 118,300株(59,600株)
日本信号	38,100	917.00	34,937,700	
京三製作所	32,000	354.00	11,328,000	
能美防災	15,700	1,414.00	22,199,800	
ホーチキ	10,000	1,266.00	12,660,000	
エレコム	12,000	2,039.00	24,468,000	
日本無線	40,000	265.00	10,600,000	
パナソニック	1,579,100	952.40	1,503,934,840	貸付有価証券 154,800株
シャープ	1,168,000	133.00	155,344,000	貸付有価証券 527,000株(59,000株)
アンリツ	83,000	602.00	49,966,000	貸付有価証券 3,500株
富士通ゼネラル	42,000	1,985.00	83,370,000	
日立国際電気	31,600	1,194.00	37,730,400	
ソニー	975,200	2,681.50	2,614,998,800	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
T D K	83,400	5,940.00	495,396,000	
帝国通信工業	33,000	169.00	5,577,000	
ミツミ電機	52,600	518.00	27,246,800	貸付有価証券 20,200株(9,000株)
タムラ製作所	53,000	304.00	16,112,000	
アルプス電気	119,100	1,825.00	217,357,500	
池上通信機	44,000	120.00	5,280,000	貸付有価証券 20,000株
パイオニア	223,600	293.00	65,514,800	貸付有価証券 106,800株(12,600株)
日本電波工業	12,500	723.00	9,037,500	
鈴木	5,300	574.00	3,042,200	
日本トリム	3,700	7,490.00	27,713,000	貸付有価証券 1,700株(800株)
ローランド ディー . ジー .	6,800	2,084.00	14,171,200	
フォスター電機	17,300	1,936.00	33,492,800	貸付有価証券 8,200株

クラリオン	73,000	302.00	22,046,000	貸付有価証券 26,000株
S M K	41,000	452.00	18,532,000	
ヨコオ	9,800	500.00	4,900,000	
ティアック	99,000	40.00	3,960,000	貸付有価証券 46,000株
ホシデン	41,900	676.00	28,324,400	貸付有価証券 8,200株
ヒロセ電機	22,300	12,750.00	284,325,000	
日本航空電子工業	40,000	1,331.00	53,240,000	貸付有価証券 5,000株
T O A	16,300	977.00	15,925,100	貸付有価証券 1,400株
日立マクセル	22,900	1,608.00	36,823,200	貸付有価証券 1,300株
古野電気	16,400	589.00	9,659,600	
ユニデンホールディングス	43,000	125.00	5,375,000	貸付有価証券 12,000株
アルパイン	32,900	1,219.00	40,105,100	
スミダコーポレーション	11,300	674.00	7,616,200	貸付有価証券 3,700株(900株)
アイコム	7,600	2,078.00	15,792,800	
リオン	5,300	1,695.00	8,983,500	
本多通信工業	3,600	931.00	3,351,600	貸付有価証券 1,600株(700株)
船井電機	14,000	906.00	12,684,000	貸付有価証券 6,600株
横河電機	138,300	1,154.00	159,598,200	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
新電元工業	49,000	397.00	19,453,000	
アズビル	45,100	2,769.00	124,881,900	
東亜ディーケーケー	7,700	491.00	3,780,700	
日本光電工業	57,800	2,881.00	166,521,800	貸付有価証券 12,800株(2,300株)
チノー	4,900	1,014.00	4,968,600	
共和電業	16,900	370.00	6,253,000	
日本電子材料	5,500	434.00	2,387,000	
堀場製作所	25,600	4,040.00	103,424,000	貸付有価証券 12,200株
アドバンテスト	94,200	1,069.00	100,699,800	貸付有価証券

				37,400株(5,900株)
小野測器	6,700	815.00	5,460,500	貸付有価証券 100株
エスペック	14,300	1,500.00	21,450,000	
パナソニック デバイス SUNX	12,100	571.00	6,909,100	
キーエンス	31,300	66,150.00	2,070,495,000	貸付有価証券 13,800株(100株)
日置電機	7,200	2,361.00	16,999,200	
シスメックス	107,300	7,210.00	773,633,000	
日本マイクロニクス	25,800	964.00	24,871,200	貸付有価証券 12,200株(5,200株)
メガチップス	13,800	1,181.00	16,297,800	貸付有価証券 6,600株(100株)
OBARA GROUP	8,100	3,705.00	30,010,500	
澤藤電機	7,000	173.00	1,211,000	貸付有価証券 3,000株
コーセル	19,200	1,077.00	20,678,400	貸付有価証券 2,900株
新日本無線	10,100	431.00	4,353,100	貸付有価証券 3,100株(3,000株)
オブテックス	10,200	3,080.00	31,416,000	貸付有価証券 3,400株
千代田インテグレ	7,300	2,235.00	16,315,500	
アイ・オー・データ機器	4,300	629.00	2,704,700	貸付有価証券 2,100株
レーザーテック	16,200	1,265.00	20,493,000	貸付有価証券 400株
スタンレー電気	98,800	2,281.00	225,362,800	貸付有価証券 30,200株
岩崎電気	47,000	190.00	8,930,000	貸付有価証券 3,000株
ウシオ電機	83,900	1,470.00	123,333,000	
岡谷電機産業	7,400	375.00	2,775,000	貸付有価証券 400株(100株)
ヘリオス テクノ ホールディング	11,700	359.00	4,200,300	貸付有価証券 700株
日本セラミック	7,900	1,934.00	15,278,600	貸付有価証券 3,700株(3,500株)
遠藤照明	7,000	1,072.00	7,504,000	貸付有価証券 500株

日本デジタル研究所	11,700	1,506.00	17,620,200	
古河電池	10,000	675.00	6,750,000	貸付有価証券 4,000株（3,000株）
双信電機	6,700	291.00	1,949,700	貸付有価証券 300株
山一電機	12,000	540.00	6,480,000	貸付有価証券 5,600株
図研	10,000	1,064.00	10,640,000	貸付有価証券 300株（300株）
日本電子	55,000	471.00	25,905,000	
カシオ計算機	138,500	1,954.00	270,629,000	貸付有価証券 65,200株
ファナック	141,400	16,200.00	2,290,680,000	
日本シイエムケイ	29,800	421.00	12,545,800	貸付有価証券 14,200株（100株）
エンプラス	7,000	3,060.00	21,420,000	貸付有価証券 200株（200株）
大真空	25,000	240.00	6,000,000	貸付有価証券 8,000株
ローム	68,100	4,205.00	286,360,500	
浜松ホトニクス	107,800	2,795.00	301,301,000	貸付有価証券 51,600株
三井ハイテック	20,000	687.00	13,740,000	
新光電気工業	52,200	588.00	30,693,600	貸付有価証券 13,900株
京セラ	226,900	5,277.00	1,197,351,300	
太陽誘電	67,200	1,042.00	70,022,400	
村田製作所	145,756	12,880.00	1,877,337,280	
ユーシン	18,300	696.00	12,736,800	貸付有価証券 8,500株（5,200株）
双葉電子工業	22,600	1,649.00	37,267,400	貸付有価証券 3,200株
北陸電気工業	56,000	132.00	7,392,000	貸付有価証券 2,000株
ニチコン	43,500	728.00	31,668,000	
日本ケミコン	112,000	144.00	16,128,000	貸付有価証券 12,000株
K O A	19,100	769.00	14,687,900	
市光工業	33,000	247.00	8,151,000	貸付有価証券 15,000株
小糸製作所	82,800	4,880.00	404,064,000	

ミツバ	23,500	1,584.00	37,224,000	
スター精密	26,200	1,214.00	31,806,800	貸付有価証券 6,600株
S C R E E Nホールディングス	142,000	838.00	118,996,000	
キヤノン電子	12,700	1,588.00	20,167,600	
キヤノン	744,100	3,075.00	2,288,107,500	貸付有価証券 55,900株
リコー	447,500	969.00	433,627,500	貸付有価証券 201,800株
M U T O Hホールディングス	16,000	232.00	3,712,000	貸付有価証券 7,000株
東京エレクトロン	113,400	7,150.00	810,810,000	
トヨタ紡織	48,300	2,241.00	108,240,300	
鬼怒川ゴム工業	32,000	771.00	24,672,000	貸付有価証券 1,000株
ユニプレス	28,700	1,980.00	56,826,000	
豊田自動織機	125,800	4,685.00	589,373,000	
モリタホールディングス	24,200	1,404.00	33,976,800	
三櫻工業	17,500	574.00	10,045,000	
デンソー	341,500	4,122.00	1,407,663,000	
東海理化電機製作所	40,400	1,926.00	77,810,400	
三井造船	535,000	168.00	89,880,000	貸付有価証券 61,000株
川崎重工業	1,076,000	314.00	337,864,000	貸付有価証券 265,000株
名村造船所	41,500	792.00	32,868,000	貸付有価証券 200株（200株）
サノヤスホールディングス	16,800	217.00	3,645,600	
日本車輛製造	57,000	260.00	14,820,000	貸付有価証券 26,000株（8,000株）
ニチユ三菱フォークリフト	15,900	522.00	8,299,800	
近畿車輛	21,000	307.00	6,447,000	貸付有価証券 9,000株
日産自動車	1,928,900	1,004.00	1,936,615,600	貸付有価証券 259,700株
いすゞ自動車	400,500	1,162.00	465,381,000	
トヨタ自動車	1,719,000	5,677.00	9,758,763,000	貸付有価証券

				2,700株(2,700株)
日野自動車	197,300	1,050.00	207,165,000	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
三菱自動車工業	548,800	484.00	265,619,200	貸付有価証券 118,600株
エフテック	7,300	1,026.00	7,489,800	貸付有価証券 3,100株(1,700株)
レシップホールディングス	4,500	715.00	3,217,500	貸付有価証券 1,900株
G M B	2,200	749.00	1,647,800	
ファルテック	2,400	1,253.00	3,007,200	貸付有価証券 300株
武蔵精密工業	14,700	2,092.00	30,752,400	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日産車体	67,500	1,088.00	73,440,000	貸付有価証券 9,700株
新明和工業	60,000	737.00	44,220,000	貸付有価証券 3,000株
極東開発工業	27,500	1,029.00	28,297,500	
日信工業	30,900	1,512.00	46,720,800	貸付有価証券 7,300株
トピー工業	114,000	195.00	22,230,000	
ティラド	54,000	176.00	9,504,000	
曙ブレーキ工業	70,000	268.00	18,760,000	貸付有価証券 22,400株
タチエス	21,900	1,495.00	32,740,500	
N O K	66,900	1,836.00	122,828,400	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
フタバ産業	42,100	540.00	22,734,000	貸付有価証券 4,600株
K Y B	155,000	370.00	57,350,000	
大同メタル工業	19,300	816.00	15,748,800	貸付有価証券 4,900株
プレス工業	73,400	388.00	28,479,200	
ミクニ	17,500	353.00	6,177,500	
カルソニックカンセイ	106,000	783.00	82,998,000	
太平洋工業	30,700	1,098.00	33,708,600	貸付有価証券 14,500株(12,000株)
ケーヒン	31,800	1,603.00	50,975,400	貸付有価証券 13,000株
河西工業	17,000	1,148.00	19,516,000	

アイシン精機	141,700	4,305.00	610,018,500	
富士機工	16,000	404.00	6,464,000	
マツダ	437,600	1,750.50	766,018,800	
ダイハツ工業	165,000	1,483.00	244,695,000	貸付有価証券 78,300株(26,900株)
今仙電機製作所	12,600	988.00	12,448,800	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,243,800	3,045.00	3,787,371,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
スズキ	252,900	2,928.50	740,617,650	
富士重工業	436,800	3,743.00	1,634,942,400	
安永	4,600	479.00	2,203,400	貸付有価証券 1,400株
ヤマハ発動機	195,200	1,824.00	356,044,800	貸付有価証券 86,600株
ショーワ	35,900	788.00	28,289,200	
T B K	16,400	379.00	6,215,600	
エクセディ	18,800	2,586.00	48,616,800	
豊田合成	50,200	2,042.00	102,508,400	
愛三工業	24,200	878.00	21,247,600	
盟和産業	2,300	1,027.00	2,362,100	
ヨロズ	12,900	2,238.00	28,870,200	
エフ・シー・シー	22,600	1,897.00	42,872,200	
シマノ	55,700	16,650.00	927,405,000	貸付有価証券 5,000株
タカタ	25,000	315.00	7,875,000	貸付有価証券 11,900株(2,600株)
テイ・エス テック	32,100	2,876.00	92,319,600	
ジャムコ	8,100	2,695.00	21,829,500	貸付有価証券 3,300株(100株)
テルモ	211,900	4,250.00	900,575,000	
クリエートメディック	4,600	857.00	3,942,200	
日機装	49,800	854.00	42,529,200	貸付有価証券 1,700株
島津製作所	178,000	1,680.00	299,040,000	
J M S	25,000	294.00	7,350,000	
クボテック	3,000	493.00	1,479,000	貸付有価証券 1,300株(1,000株)
長野計器	8,300	623.00	5,170,900	

ブイ・テクノロジー	3,300	4,685.00	15,460,500	貸付有価証券 1,500株
東京計器	44,000	157.00	6,908,000	
愛知時計電機	18,000	311.00	5,598,000	
オーバル	13,500	234.00	3,159,000	貸付有価証券 6,100株
東京精密	26,700	2,350.00	62,745,000	貸付有価証券 4,300株
マニー	18,400	1,727.00	31,776,800	貸付有価証券 6,700株
ニコン	258,100	1,563.00	403,410,300	貸付有価証券 114,700株（6,600株）
トプコン	46,400	1,058.00	49,091,200	貸付有価証券 22,000株
オリンパス	205,900	4,175.00	859,632,500	貸付有価証券 8,300株
理研計器	11,200	1,048.00	11,737,600	
タムロン	11,100	1,572.00	17,449,200	貸付有価証券 5,300株（5,300株）
HOYA	312,500	4,041.00	1,262,812,500	
ノーリツ鋼機	12,400	619.00	7,675,600	貸付有価証券 5,900株
エー・アンド・デイ	12,500	384.00	4,800,000	
シチズンホールディングス	170,100	632.00	107,503,200	貸付有価証券 400株（400株）
リズム時計工業	60,000	149.00	8,940,000	貸付有価証券 4,000株
大研医器	10,900	878.00	9,570,200	貸付有価証券 5,100株（400株）
メニコン	9,300	3,800.00	35,340,000	
松風	6,700	1,363.00	9,132,100	貸付有価証券 2,200株
セイコーホールディングス	89,000	407.00	36,223,000	
ニプロ	103,000	1,090.00	112,270,000	貸付有価証券 800株
スノーピーク	1,500	3,645.00	5,467,500	貸付有価証券 700株（400株）
パラマウントベッドホールディングス	14,600	4,080.00	59,568,000	
トランザクション	2,800	726.00	2,032,800	貸付有価証券

				100株
SHO - B I	4,600	398.00	1,830,800	貸付有価証券 200株
ニホンフラッシュ	5,400	1,160.00	6,264,000	貸付有価証券 1,900株(100株)
前田工織	13,800	1,086.00	14,986,800	貸付有価証券 4,800株
永大産業	20,000	424.00	8,480,000	
アートネイチャー	14,800	923.00	13,660,400	
ダンロップスポーツ	8,700	1,015.00	8,830,500	貸付有価証券 3,900株(100株)
バンダイナムコホールディングス	142,900	2,292.00	327,526,800	
アイフィスジャパン	3,100	481.00	1,491,100	
共立印刷	23,000	277.00	6,371,000	
SHOEI	6,200	1,610.00	9,982,000	
フランスベッドホールディングス	19,300	987.00	19,049,100	
パイロットコーポレーション	24,100	4,920.00	118,572,000	
萩原工業	3,800	2,607.00	9,906,600	
トッパン・フォームズ	24,700	1,156.00	28,553,200	
フジシールインターナショナル	16,800	3,695.00	62,076,000	貸付有価証券 1,000株
タカラトミー	45,500	765.00	34,807,500	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
廣済堂	12,800	343.00	4,390,400	貸付有価証券 100株
As-me エステール	3,700	623.00	2,305,100	
アーク	58,100	85.00	4,938,500	貸付有価証券 17,100株
タカノ	6,100	644.00	3,928,400	
プロネクサス	12,900	957.00	12,345,300	
ホクシン	11,000	133.00	1,463,000	
ウッドワン	25,000	252.00	6,300,000	
大建工業	54,000	310.00	16,740,000	
凸版印刷	390,000	943.00	367,770,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
大日本印刷	409,000	1,027.00	420,043,000	
図書印刷	26,000	541.00	14,066,000	貸付有価証券

				6,000株
共同印刷	46,000	318.00	14,628,000	貸付有価証券 7,000株
日本写真印刷	23,200	1,681.00	38,999,200	貸付有価証券 10,900株
光村印刷	14,000	201.00	2,814,000	
宝印刷	6,700	1,390.00	9,313,000	
アシックス	128,700	2,362.00	303,989,400	貸付有価証券 56,200株
ツツミ	6,900	2,322.00	16,021,800	
小松ウオール工業	4,700	1,693.00	7,957,100	
ヤマハ	101,600	3,095.00	314,452,000	貸付有価証券 3,700株(1,300株)
河合楽器製作所	5,100	1,937.00	9,878,700	貸付有価証券 1,400株(300株)
クリナップ	16,200	779.00	12,619,800	
ビジョン	78,300	2,901.00	227,148,300	貸付有価証券 37,400株
兼松日産農林	14,000	146.00	2,044,000	
キングジム	11,500	857.00	9,855,500	
リンテック	32,900	2,197.00	72,281,300	
T A S A K I	2,600	1,577.00	4,100,200	貸付有価証券 1,200株(100株)
イトーキ	29,100	627.00	18,245,700	貸付有価証券 13,900株(11,100株)
任天堂	85,100	15,170.00	1,290,967,000	貸付有価証券 7,900株
三菱鉛筆	10,300	5,360.00	55,208,000	貸付有価証券 1,000株
タカラスタンダード	57,000	961.00	54,777,000	
コクヨ	71,800	1,476.00	105,976,800	
ナカバヤシ	28,000	278.00	7,784,000	
グローブライド	6,700	1,341.00	8,984,700	
岡村製作所	48,200	1,011.00	48,730,200	
美津濃	74,000	566.00	41,884,000	
アデランス	24,000	556.00	13,344,000	貸付有価証券 11,300株(5,700株)
東京電力ホールディングス	1,172,400	538.00	630,751,200	貸付有価証券 52,000株
中部電力	422,900	1,493.50	631,601,150	貸付有価証券

				14,200株(14,200株)
関西電力	564,000	1,016.50	573,306,000	
中国電力	191,100	1,421.00	271,553,100	貸付有価証券 71,200株(59,300株)
北陸電力	135,400	1,412.00	191,184,800	
東北電力	345,300	1,406.00	485,491,800	
四国電力	124,500	1,342.00	167,079,000	貸付有価証券 50,200株(3,200株)
九州電力	305,200	1,121.00	342,129,200	貸付有価証券 127,600株
北海道電力	129,300	965.00	124,774,500	貸付有価証券 13,900株(13,900株)
沖縄電力	14,700	2,994.00	44,011,800	
電源開発	117,800	3,105.00	365,769,000	貸付有価証券 16,500株(16,500株)
ファーストエスコ	5,600	531.00	2,973,600	貸付有価証券 100株
イーレックス	4,100	1,879.00	7,703,900	貸付有価証券 1,900株(100株)
東京瓦斯	1,543,000	441.20	680,771,600	
大阪瓦斯	1,431,000	408.70	584,849,700	貸付有価証券 349,000株
東邦瓦斯	348,000	777.00	270,396,000	
北海道瓦斯	34,000	281.00	9,554,000	貸付有価証券 14,000株
広島ガス	24,100	348.00	8,386,800	貸付有価証券 4,700株(2,700株)
西部瓦斯	156,000	274.00	42,744,000	
静岡ガス	39,200	756.00	29,635,200	
メタウォーター	8,900	2,984.00	26,557,600	貸付有価証券 4,200株
SBSホールディングス	13,600	695.00	9,452,000	貸付有価証券 2,600株
東武鉄道	739,000	563.00	416,057,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
相鉄ホールディングス	237,000	677.00	160,449,000	
東京急行電鉄	804,000	972.00	781,488,000	
京浜急行電鉄	379,000	1,000.00	379,000,000	
小田急電鉄	443,000	1,173.00	519,639,000	貸付有価証券 22,000株(3,000株)

京王電鉄	386,000	934.00	360,524,000	貸付有価証券 7,000株
京成電鉄	207,000	1,456.00	301,392,000	貸付有価証券 3,000株(1,000株)
富士急行	38,000	1,445.00	54,910,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
新京成電鉄	18,000	420.00	7,560,000	
東日本旅客鉄道	252,700	9,846.00	2,488,084,200	貸付有価証券 14,700株(14,700株)
西日本旅客鉄道	133,000	6,668.00	886,844,000	
東海旅客鉄道	123,800	19,450.00	2,407,910,000	
西武ホールディングス	146,800	2,202.00	323,253,600	
鴻池運輸	19,500	1,239.00	24,160,500	
西日本鉄道	179,000	576.00	103,104,000	
ハマキョウレックス	10,600	2,208.00	23,404,800	
サカイ引越センター	5,400	2,950.00	15,930,000	貸付有価証券 2,500株
近鉄グループホールディングス	1,391,000	451.00	627,341,000	
阪急阪神ホールディングス	928,000	683.00	633,824,000	
南海電気鉄道	310,000	563.00	174,530,000	
京阪ホールディングス	310,000	754.00	233,740,000	貸付有価証券 75,000株
神戸電鉄	34,000	362.00	12,308,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
名古屋鉄道	503,000	545.00	274,135,000	貸付有価証券 23,000株
山陽電気鉄道	50,000	508.00	25,400,000	
日本通運	535,000	472.00	252,520,000	
ヤマトホールディングス	247,100	2,176.00	537,689,600	
山九	182,000	541.00	98,462,000	
丸運	7,500	244.00	1,830,000	
丸全昭和運輸	46,000	408.00	18,768,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
センコー	62,200	686.00	42,669,200	貸付有価証券 19,700株(1,000株)
トナミホールディングス	28,000	274.00	7,672,000	
ニッコンホールディングス	43,900	2,300.00	100,970,000	

日本石油輸送	16,000	233.00	3,728,000	
福山通運	84,000	551.00	46,284,000	貸付有価証券 39,000株(29,000株)
セイノーホールディングス	98,000	1,125.00	110,250,000	
神奈川中央交通	16,000	582.00	9,312,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日立物流	28,800	1,831.00	52,732,800	
丸和運輸機関	4,100	2,796.00	11,463,600	貸付有価証券 100株
C & F ロジホールディングス	13,200	831.00	10,969,200	
日本郵船	1,241,000	203.00	251,923,000	
商船三井	673,000	229.00	154,117,000	貸付有価証券 319,000株
川崎汽船	605,000	212.00	128,260,000	貸付有価証券 288,000株(1,000株)
N S ユナイテッド海運	62,000	149.00	9,238,000	
明治海運	12,400	379.00	4,699,600	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
飯野海運	71,500	390.00	27,885,000	
共栄タンカー	11,000	147.00	1,617,000	
乾汽船	10,900	911.00	9,929,900	貸付有価証券 1,900株
日本航空	264,600	4,044.00	1,070,042,400	
A N A ホールディングス	2,565,000	333.20	854,658,000	
パスコ	13,000	388.00	5,044,000	貸付有価証券 6,000株
トランコム	4,000	6,340.00	25,360,000	
日新	57,000	331.00	18,867,000	
三菱倉庫	98,000	1,480.00	145,040,000	貸付有価証券 10,000株
三井倉庫ホールディングス	80,000	291.00	23,280,000	貸付有価証券 11,000株(9,000株)
住友倉庫	101,000	539.00	54,439,000	
澁澤倉庫	36,000	275.00	9,900,000	
東陽倉庫	24,000	225.00	5,400,000	
日本トランスシティ	32,000	345.00	11,040,000	
ケイヒン	25,000	143.00	3,575,000	
中央倉庫	8,000	901.00	7,208,000	

安田倉庫	10,700	701.00	7,500,700	
東洋埠頭	40,000	148.00	5,920,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	11,200	313.00	3,505,600	
上組	165,000	983.00	162,195,000	
サンリツ	3,400	487.00	1,655,800	
キムラユニティー	3,500	1,079.00	3,776,500	
キューソー流通システム	3,800	2,595.00	9,861,000	
郵船ロジスティクス	12,700	1,098.00	13,944,600	貸付有価証券 4,800株（600株）
近鉄エクスプレス	24,700	1,374.00	33,937,800	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
東海運	7,400	268.00	1,983,200	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
エーアイティー	8,500	910.00	7,735,000	貸付有価証券 2,600株
内外トランスライン	4,600	965.00	4,439,000	
NEC ネットズエスアイ	17,100	1,850.00	31,635,000	
システナ	13,300	1,802.00	23,966,600	
デジタルアーツ	6,700	2,254.00	15,101,800	貸付有価証券 2,900株（2,600株）
新日鉄住金ソリューションズ	22,700	1,745.00	39,611,500	
キューブシステム	5,900	612.00	3,610,800	貸付有価証券 2,800株（2,700株）
コア	5,700	1,299.00	7,404,300	貸付有価証券 2,700株
ソフトクリエイトホールディングス	6,500	920.00	5,980,000	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
ITホールディングス	45,200	2,601.00	117,565,200	
ネオス	4,000	560.00	2,240,000	貸付有価証券 1,900株（800株）
電算システム	4,700	1,541.00	7,242,700	貸付有価証券 2,000株
グリー	82,800	653.00	54,068,400	貸付有価証券 25,400株（4,000株）
コーエーテックモホールディングス	32,400	1,860.00	60,264,000	貸付有価証券 100株（100株）
三菱総合研究所	5,300	3,395.00	17,993,500	
ボルテージ	2,700	1,177.00	3,177,900	貸付有価証券

				200株
電算	1,500	2,401.00	3,601,500	
A G S	3,100	996.00	3,087,600	貸付有価証券 700株
ファインデックス	8,900	1,822.00	16,215,800	貸付有価証券 4,200株(2,800株)
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	2,056.00	6,373,600	貸付有価証券 1,400株(400株)
ブレインパッド	2,000	780.00	1,560,000	貸付有価証券 400株
K L a b	21,100	585.00	12,343,500	貸付有価証券 8,900株
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	9,000	919.00	8,271,000	貸付有価証券 4,200株
イーブックイニシアティブジャパン	3,000	750.00	2,250,000	貸付有価証券 1,300株
ネクソン	130,700	1,545.00	201,931,500	
アイスタイル	20,800	890.00	18,512,000	貸付有価証券 9,900株
エムアップ	3,500	540.00	1,890,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
エイチーム	7,500	1,644.00	12,330,000	貸付有価証券 200株(200株)
テクノスジャパン	3,900	3,075.00	11,992,500	貸付有価証券 1,800株
e n i s h	4,000	640.00	2,560,000	貸付有価証券 1,700株
コロプラ	37,900	2,123.00	80,461,700	
モバイルクリエイト	8,900	450.00	4,005,000	貸付有価証券 4,200株(400株)
オルトプラス	5,000	420.00	2,100,000	貸付有価証券 1,300株(300株)
ブロードリーフ	13,700	1,078.00	14,768,600	
ハーツユニテッドグループ	4,100	2,576.00	10,561,600	貸付有価証券 1,900株(1,100株)
メディアドゥ	2,900	2,031.00	5,889,900	貸付有価証券 1,300株
ブイキューブ	8,900	1,347.00	11,988,300	貸付有価証券 4,200株(200株)
サイバーリンクス	2,100	1,088.00	2,284,800	貸付有価証券 700株
VOYAGE GROU	4,600	1,251.00	5,754,600	貸付有価証券

P				200株
オブティム	1,100	5,530.00	6,083,000	貸付有価証券 400株(100株)
ベリサーブ	1,600	5,050.00	8,080,000	貸付有価証券 700株(400株)
ティーガイア	13,600	1,370.00	18,632,000	貸付有価証券 6,400株
日本アジアグループ	15,400	503.00	7,746,200	
豆蔵ホールディングス	10,800	736.00	7,948,800	貸付有価証券 2,900株
テクマトリックス	5,800	2,046.00	11,866,800	貸付有価証券 2,700株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	317,800	278.00	88,348,400	貸付有価証券 151,500株(1,400株)
GMOペイメントゲート ウェイ	11,200	7,090.00	79,408,000	
ザッパラス	7,600	405.00	3,078,000	貸付有価証券 2,600株
インターネットイニシア ティブ	22,100	2,254.00	49,813,400	
さくらインターネット	8,900	1,305.00	11,614,500	貸付有価証券 4,200株(2,100株)
GMOクラウド	3,000	1,251.00	3,753,000	貸付有価証券 1,400株(700株)
SRAホールディングス	7,800	2,546.00	19,858,800	
Minorityソリューションズ	2,600	914.00	2,376,400	
システムインテグレータ	1,900	714.00	1,356,600	貸付有価証券 300株
朝日ネット	12,400	477.00	5,914,800	
コムチュア	2,300	2,713.00	6,239,900	
gumi	14,000	900.00	12,600,000	貸付有価証券 6,600株
パイブドHD	1,700	1,345.00	2,286,500	貸付有価証券 400株
フェイス	3,600	1,346.00	4,845,600	貸付有価証券 1,700株
ハイマックス	1,800	1,150.00	2,070,000	
野村総合研究所	95,600	4,005.00	382,878,000	貸付有価証券 100株(100株)
サイバネットシステム	11,100	804.00	8,924,400	貸付有価証券

				5,300株(4,900株)
C Eホールディングス	2,100	906.00	1,902,600	
インテージホールディングス	7,100	1,410.00	10,011,000	
東邦システムサイエンス	4,000	607.00	2,428,000	
ソースネクスト	6,800	523.00	3,556,400	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
ティー・ワイ・オー	26,800	171.00	4,582,800	貸付有価証券 700株(700株)
フォーカスシステムズ	5,200	589.00	3,062,800	貸付有価証券 2,400株(2,300株)
クレスコ	3,100	1,896.00	5,877,600	
フジ・メディア・ホールディングス	142,000	1,260.00	178,920,000	貸付有価証券 40,500株
オービック	47,000	5,970.00	280,590,000	貸付有価証券 1,700株
ジャストシステム	24,800	943.00	23,386,400	
T D Cソフトウェアエンジニアリング	5,900	631.00	3,722,900	
ヤフー	977,600	505.00	493,688,000	貸付有価証券 456,600株
トレンドマイクロ	66,200	4,170.00	276,054,000	貸付有価証券 5,100株
インフォメーション・ディベロプメント	2,600	988.00	2,568,800	
日本オラクル	21,900	6,130.00	134,247,000	
アルファシステムズ	4,500	1,761.00	7,924,500	
フューチャー	16,400	733.00	12,021,200	
C A C H o l d i n g s	10,200	810.00	8,262,000	
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	1,774.00	6,563,800	
トーセ	3,700	677.00	2,504,900	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルティング	6,900	4,695.00	32,395,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	30,900	2,523.00	77,960,700	貸付有価証券 6,200株
アイティフォー	17,700	512.00	9,062,400	
東計電算	2,400	1,936.00	4,646,400	
エックスネット	1,200	1,550.00	1,860,000	

大塚商会	36,700	5,500.00	201,850,000	
サイボウズ	18,100	347.00	6,280,700	
ソフトブレーン	19,900	170.00	3,383,000	貸付有価証券 300株
電通国際情報サービス	8,400	2,014.00	16,917,600	貸付有価証券 800株
E Mシステムズ	4,600	1,226.00	5,639,600	貸付有価証券 1,000株（200株）
ウェザーニューズ	4,600	3,920.00	18,032,000	貸付有価証券 100株（100株）
C I J	12,300	504.00	6,199,200	
東洋ビジネスエンジニア リング	1,400	1,369.00	1,916,600	
日本エンタープライズ	13,900	258.00	3,586,200	貸付有価証券 4,900株（400株）
WOWOW	6,500	2,454.00	15,951,000	貸付有価証券 3,000株（1,200株）
フュージョンパートナー	8,500	548.00	4,658,000	貸付有価証券 900株
日本コロムビア	4,600	432.00	1,987,200	貸付有価証券 1,500株
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,500	398.00	4,577,000	貸付有価証券 5,300株
ネットワンシステムズ	59,100	615.00	36,346,500	
アルゴグラフィックス	6,200	1,727.00	10,707,400	
マーベラス	23,000	853.00	19,619,000	貸付有価証券 10,900株（800株）
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	25,100	1,429.00	35,867,900	貸付有価証券 7,900株
日本ユニシス	37,600	1,328.00	49,932,800	貸付有価証券 11,900株（10,300株）
兼松エレクトロニクス	8,600	1,954.00	16,804,400	
東京放送ホールディング ス	81,700	1,534.00	125,327,800	貸付有価証券 22,200株
日本テレビホールディ ングス	124,500	1,821.00	226,714,500	
朝日放送	13,500	640.00	8,640,000	
テレビ朝日ホールディ ングス	37,300	1,872.00	69,825,600	貸付有価証券 4,600株
スカパーJ S A Tホール ディングス	103,500	618.00	63,963,000	貸付有価証券 1,000株

テレビ東京ホールディングス	12,400	1,983.00	24,589,200	貸付有価証券 200株
日本BS放送	3,100	1,007.00	3,121,700	貸付有価証券 1,100株(700株)
U-NEXT	4,200	1,039.00	4,363,800	貸付有価証券 1,500株
ワイヤレスゲート	4,000	2,308.00	9,232,000	
コネクシオ	12,000	1,398.00	16,776,000	貸付有価証券 5,700株(3,500株)
日本通信	96,600	220.00	21,252,000	貸付有価証券 46,000株(29,400株)
クロップス	2,500	515.00	1,287,500	
日本電信電話	1,054,400	5,033.00	5,306,795,200	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
KDDI	1,385,700	3,274.00	4,536,781,800	貸付有価証券 56,800株
光通信	16,400	8,420.00	138,088,000	
NTTドコモ	1,019,300	2,800.00	2,854,040,000	貸付有価証券 81,000株
エムティーアイ	20,700	841.00	17,408,700	貸付有価証券 4,300株(100株)
GMOインターネット	49,800	1,365.00	67,977,000	
カドカワ	42,600	1,597.00	68,032,200	
学研ホールディングス	45,000	252.00	11,340,000	
ゼンリン	18,000	2,594.00	46,692,000	
昭文社	7,400	623.00	4,610,200	貸付有価証券 800株
インプレスホールディングス	11,200	148.00	1,657,600	貸付有価証券 1,800株(100株)
アイネット	7,600	1,128.00	8,572,800	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
松竹	90,000	1,056.00	95,040,000	
東宝	97,300	2,895.00	281,683,500	
東映	51,000	851.00	43,401,000	
AOI Pro.	6,900	896.00	6,182,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	84,300	5,750.00	484,725,000	
ピー・シー・エー	1,700	1,302.00	2,213,400	
ビジネスブレイン太田昭和	2,100	936.00	1,965,600	

DT S	15,200	2,200.00	33,440,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	57,700	2,801.00	161,617,700	
シーイーシー	8,900	1,604.00	14,275,600	
カブコン	34,900	2,427.00	84,702,300	
アイ・エス・ビー	2,200	897.00	1,973,400	貸付有価証券 400株
ジャステック	8,600	974.00	8,376,400	貸付有価証券 3,800株
S C S K	32,400	4,020.00	130,248,000	
日本システムウエア	5,100	1,058.00	5,395,800	貸付有価証券 1,100株
アイネス	19,300	1,148.00	22,156,400	
T K C	12,600	3,050.00	38,430,000	
富士ソフト	20,200	2,488.00	50,257,600	貸付有価証券 300株
N S D	28,900	1,726.00	49,881,400	
コナミホールディングス	61,600	3,480.00	214,368,000	貸付有価証券 7,900株(100株)
福井コンピュータホールディングス	3,900	1,631.00	6,360,900	
J B C Cホールディングス	11,400	688.00	7,843,200	
ミロク情報サービス	10,100	1,173.00	11,847,300	
ソフトバンクグループ	772,900	5,992.00	4,631,216,800	貸付有価証券 56,700株(1,100株)
ハウスイ	11,000	120.00	1,320,000	貸付有価証券 2,000株
高千穂交易	5,200	906.00	4,711,200	
伊藤忠食品	3,400	3,935.00	13,379,000	貸付有価証券 800株(800株)
エレマテック	6,400	1,963.00	12,563,200	
J A L U X	4,400	1,982.00	8,720,800	貸付有価証券 1,600株(900株)
あらた	6,100	2,472.00	15,079,200	
トーメンデバイス	2,000	1,767.00	3,534,000	
東京エレクトロン デバイス	4,900	1,509.00	7,394,100	
フィールズ	11,900	1,590.00	18,921,000	貸付有価証券 3,100株

双日	859,300	234.00	201,076,200	
アルフレッサホールディングス	171,500	2,117.00	363,065,500	
横浜冷凍	33,800	1,085.00	36,673,000	貸付有価証券 14,800株(11,900株)
神栄	19,000	109.00	2,071,000	貸付有価証券 8,000株
山下医科器械	1,100	1,887.00	2,075,700	貸付有価証券 400株
ラサ商事	6,400	515.00	3,296,000	
ラクーン	5,800	539.00	3,126,200	貸付有価証券 2,700株
アルコニックス	7,700	1,563.00	12,035,100	
神戸物産	8,800	2,466.00	21,700,800	貸付有価証券 1,100株(200株)
あいホールディングス	24,300	3,290.00	79,947,000	貸付有価証券 1,200株
ディービーエックス	4,800	1,132.00	5,433,600	
ダイワボウホールディングス	124,000	215.00	26,660,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	24,600	1,163.00	28,609,800	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	23,600	964.00	22,750,400	貸付有価証券 11,100株(9,300株)
八洲電機	10,500	554.00	5,817,000	
U K Cホールディングス	8,800	1,895.00	16,676,000	
O C H Iホールディングス	3,900	1,043.00	4,067,700	
T O K A Iホールディングス	59,900	612.00	36,658,800	貸付有価証券 28,600株(13,100株)
三洋貿易	7,500	1,433.00	10,747,500	
ウイン・パートナーズ	4,900	1,508.00	7,389,200	貸付有価証券 300株
ミタチ産業	3,500	648.00	2,268,000	
シップヘルスケアホールディングス	27,700	2,813.00	77,920,100	
明治電機工業	4,300	1,052.00	4,523,600	貸付有価証券 1,800株
デリカフーズ	2,900	941.00	2,728,900	貸付有価証券 1,300株
スターティア	2,600	777.00	2,020,200	貸付有価証券

				1,200株(1,100株)
富士興産	5,300	417.00	2,210,100	
協栄産業	18,000	126.00	2,268,000	
小野建	11,900	1,130.00	13,447,000	貸付有価証券 5,600株
佐鳥電機	10,800	750.00	8,100,000	貸付有価証券 200株
エコートレーディング	3,100	568.00	1,760,800	貸付有価証券 100株
伯東	10,400	926.00	9,630,400	
コンドーテック	10,800	882.00	9,525,600	
中山福	8,500	743.00	6,315,500	貸付有価証券 100株
ナガイレーベン	19,700	2,237.00	44,068,900	貸付有価証券 2,200株
三菱食品	15,000	2,691.00	40,365,000	
松田産業	9,900	1,185.00	11,731,500	貸付有価証券 100株
第一興商	24,100	4,780.00	115,198,000	
メディカルホールディングス	136,400	1,749.00	238,563,600	
アドヴァン	13,900	1,057.00	14,692,300	貸付有価証券 700株
S P K	3,100	1,983.00	6,147,300	
萩原電気	4,600	1,947.00	8,956,200	
アズワン	10,700	4,020.00	43,014,000	貸付有価証券 900株
スズデン	4,400	1,022.00	4,496,800	貸付有価証券 300株
尾家産業	4,400	859.00	3,779,600	
シモジマ	9,400	986.00	9,268,400	
ドウシシャ	16,000	2,195.00	35,120,000	
小津産業	3,000	2,161.00	6,483,000	
高速	8,100	879.00	7,119,900	
たけびし	4,800	996.00	4,780,800	貸付有価証券 1,200株
黒田電気	25,400	1,658.00	42,113,200	
丸文	12,000	652.00	7,824,000	
ハピネット	12,400	898.00	11,135,200	貸付有価証券 2,800株

橋本総業ホールディングス	2,800	1,490.00	4,172,000	
エクセル	6,600	1,368.00	9,028,800	貸付有価証券 2,300株
マルカキカイ	4,400	1,271.00	5,592,400	
ガリバーインターナショナル	36,700	1,112.00	40,810,400	貸付有価証券 17,500株(14,000株)
日本エム・ディ・エム	11,400	746.00	8,504,400	貸付有価証券 5,100株(200株)
進和	8,000	1,458.00	11,664,000	
エスケイジャパン	3,300	302.00	996,600	貸付有価証券 1,300株(1,100株)
ダイトエレクトロン	6,200	653.00	4,048,600	
シークス	8,700	3,425.00	29,797,500	
田中商事	4,200	628.00	2,637,600	
オーハシテクニカ	7,700	1,188.00	9,147,600	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
白銅	3,900	1,016.00	3,962,400	
伊藤忠商事	1,070,400	1,382.00	1,479,292,800	
丸紅	1,342,500	530.60	712,330,500	貸付有価証券 16,900株
高島	25,000	171.00	4,275,000	
長瀬産業	82,000	1,182.00	96,924,000	
蝶理	8,700	1,573.00	13,685,100	貸付有価証券 100株
豊田通商	151,900	2,397.00	364,104,300	
三共生興	20,600	371.00	7,642,600	貸付有価証券 100株
兼松	290,000	177.00	51,330,000	
ツカモトコーポレーション	24,000	109.00	2,616,000	
三井物産	1,233,500	1,284.50	1,584,430,750	
日本紙パルプ商事	71,000	323.00	22,933,000	
日立ハイテクノロジーズ	47,300	2,979.00	140,906,700	
カメイ	17,700	943.00	16,691,100	
東都水産	22,000	175.00	3,850,000	
OUGホールディングス	20,000	230.00	4,600,000	
スターゼン	4,900	3,325.00	16,292,500	
山善	52,400	865.00	45,326,000	

椿本興業	15,000	291.00	4,365,000	
住友商事	858,700	1,087.50	933,836,250	
内田洋行	34,000	464.00	15,776,000	
三菱商事	1,023,600	1,798.00	1,840,432,800	
第一実業	31,000	495.00	15,345,000	
キャノンマーケティング ジャパン	38,900	2,034.00	79,122,600	
西華産業	44,000	216.00	9,504,000	
佐藤商事	12,200	644.00	7,856,800	
菱洋エレクトロ	15,400	1,305.00	20,097,000	貸付有価証券 1,700株
東京産業	13,500	373.00	5,035,500	
ユアサ商事	12,900	2,460.00	31,734,000	
神鋼商事	30,000	187.00	5,610,000	
小林産業	9,000	186.00	1,674,000	
阪和興業	136,000	481.00	65,416,000	貸付有価証券 1,000株
カナデン	13,000	836.00	10,868,000	
菱電商事	22,000	637.00	14,014,000	
フルサト工業	7,500	1,483.00	11,122,500	
岩谷産業	162,000	634.00	102,708,000	
すてきナイスグループ	58,000	133.00	7,714,000	
昭光通商	48,000	75.00	3,600,000	貸付有価証券 23,000株
二チモウ	21,000	179.00	3,759,000	貸付有価証券 9,000株
極東貿易	20,000	216.00	4,320,000	
イワキ	21,000	204.00	4,284,000	
三愛石油	33,500	749.00	25,091,500	
稲畑産業	32,700	1,078.00	35,250,600	
G S I クレオス	36,000	115.00	4,140,000	
明和産業	12,600	368.00	4,636,800	
ワキタ	29,000	761.00	22,069,000	
東邦ホールディングス	43,700	2,507.00	109,555,900	貸付有価証券 20,800株（17,900株）
サンゲツ	47,500	1,979.00	94,002,500	
ミツウロコグループホー ルディングス	21,900	524.00	11,475,600	

シナネンホールディングス	29,000	420.00	12,180,000	
伊藤忠エネクス	35,100	949.00	33,309,900	
サンリオ	42,000	2,172.00	91,224,000	貸付有価証券 19,200株
サンワテクノス	8,700	735.00	6,394,500	
リョーサン	21,600	2,660.00	57,456,000	
新光商事	16,000	1,090.00	17,440,000	
トーホー	6,100	2,403.00	14,658,300	
三信電気	18,800	893.00	16,788,400	貸付有価証券 1,100株
東陽テクニカ	18,100	1,078.00	19,511,800	
モスフードサービス	17,900	3,020.00	54,058,000	貸付有価証券 100株(100株)
加賀電子	12,300	1,328.00	16,334,400	
ソーダニッカ	14,000	467.00	6,538,000	
立花エレテック	10,100	1,177.00	11,887,700	貸付有価証券 4,700株
フォーバル	7,100	778.00	5,523,800	
PALTA C	21,800	1,891.00	41,223,800	
三谷産業	14,500	364.00	5,278,000	貸付有価証券 6,800株(100株)
太平洋興発	57,000	74.00	4,218,000	貸付有価証券 19,000株
ヤマタネ	63,000	150.00	9,450,000	
丸紅建材リース	12,000	188.00	2,256,000	貸付有価証券 5,000株
日鉄住金物産	120,000	383.00	45,960,000	貸付有価証券 8,000株
トラスコ中山	15,600	4,765.00	74,334,000	
オートバックスセブン	52,200	1,978.00	103,251,600	貸付有価証券 22,200株
加藤産業	21,300	2,760.00	58,788,000	
イノテック	12,500	430.00	5,375,000	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	12,900	2,309.00	29,786,100	
J Kホールディングス	13,700	456.00	6,247,200	
日伝	5,600	2,995.00	16,772,000	
北沢産業	11,200	161.00	1,803,200	

杉本商事	7,800	1,177.00	9,180,600	
因幡電機産業	19,100	3,515.00	67,136,500	
バイテックホールディングス	5,600	978.00	5,476,800	貸付有価証券 2,600株
ミスミグループ本社	153,200	1,567.00	240,064,400	貸付有価証券 67,300株
アルテック	11,600	147.00	1,705,200	貸付有価証券 3,800株
タキヒヨー	23,000	427.00	9,821,000	
蔵王産業	2,200	1,316.00	2,895,200	
スズケン	62,100	3,740.00	232,254,000	
ジェコス	9,400	1,184.00	11,129,600	
ルネサスイーストン	11,300	419.00	4,734,700	
ローソン	51,700	8,710.00	450,307,000	
サンエー	9,300	5,190.00	48,267,000	貸付有価証券 400株
ダイユーエイト	3,600	685.00	2,466,000	貸付有価証券 1,400株
カワチ薬品	10,500	2,535.00	26,617,500	
エービーシー・マート	17,700	7,370.00	130,449,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
ハードオフコーポレーション	6,600	1,480.00	9,768,000	
アスクル	16,600	4,275.00	70,965,000	貸付有価証券 600株
ゲオホールディングス	22,800	1,806.00	41,176,800	貸付有価証券 10,800株(200株)
アダストリア	25,100	3,620.00	90,862,000	
ジーフット	8,200	778.00	6,379,600	
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	20,000	91.00	1,820,000	
くらコーポレーション	8,000	4,815.00	38,520,000	
キャンドウ	7,200	1,620.00	11,664,000	貸付有価証券 2,200株(1,800株)
パル	7,900	2,665.00	21,053,500	貸付有価証券 3,800株
エディオン	57,700	892.00	51,468,400	貸付有価証券 26,700株(9,800株)
サーラコーポレーション	11,700	561.00	6,563,700	
ワッツ	5,800	922.00	5,347,600	貸付有価証券

				1,300株
ハローズ	4,400	2,337.00	10,282,800	
あみやき亭	2,600	4,365.00	11,349,000	
ひらまつ	18,800	704.00	13,235,200	貸付有価証券 8,900株(600株)
ゲンキー	2,700	3,460.00	9,342,000	貸付有価証券 1,300株(800株)
サッポロドラッグストア	1,800	2,141.00	3,853,800	貸付有価証券 600株
大黒天物産	3,200	4,830.00	15,456,000	貸付有価証券 1,500株
ハニーズ	12,000	1,164.00	13,968,000	貸付有価証券 5,700株
ファーマライズホールディングス	3,100	554.00	1,717,400	
アルペン	12,200	1,804.00	22,008,800	貸付有価証券 5,800株
クオール	13,800	1,599.00	22,066,200	貸付有価証券 4,700株
ジェイアイエヌ	9,300	3,950.00	36,735,000	貸付有価証券 4,400株(3,400株)
ビックカメラ	78,300	1,085.00	84,955,500	
D C Mホールディングス	67,100	793.00	53,210,300	貸付有価証券 17,500株(15,000株)
Monotaro	48,200	3,455.00	166,531,000	貸付有価証券 22,900株(4,400株)
東京一番フーズ	3,400	489.00	1,662,600	貸付有価証券 800株(800株)
ダイヤモンドダイニング	2,800	1,015.00	2,842,000	貸付有価証券 900株
きちり	3,600	651.00	2,343,600	貸付有価証券 1,700株(1,200株)
アークランドサービス	4,300	3,230.00	13,889,000	貸付有価証券 700株
J・フロントリテイリング	172,600	1,283.00	221,445,800	
ドトール・日レスホールディングス	23,900	1,893.00	45,242,700	
マツモトキヨシホールディングス	28,100	5,560.00	156,236,000	
ブロンコビリー	7,100	3,115.00	22,116,500	貸付有価証券 700株(700株)

スタートトゥデイ	41,500	5,220.00	216,630,000	
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,141.00	4,335,800	
物語コーポレーション	3,600	5,250.00	18,900,000	
ココカラファイン	14,200	5,120.00	72,704,000	
三越伊勢丹ホールディングス	271,300	1,129.00	306,297,700	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
ウエルシアホールディングス	11,800	5,900.00	69,620,000	
クリエイティブSDホールディングス	20,100	2,670.00	53,667,000	
丸善CHIホールディングス	15,900	370.00	5,883,000	
ミサワ	2,100	515.00	1,081,500	貸付有価証券 200株
エー・ピーカンパニー	2,200	1,104.00	2,428,800	貸付有価証券 900株
チムニー	3,300	2,992.00	9,873,600	
シュッピン	5,100	1,339.00	6,828,900	貸付有価証券 1,800株(100株)
ネクステージ	2,200	645.00	1,419,000	貸付有価証券 900株
ジョイフル本田	22,100	2,418.00	53,437,800	
キリン堂ホールディングス	4,400	1,073.00	4,721,200	
ホットランド	4,700	1,003.00	4,714,100	貸付有価証券 2,200株
すかいらーく	41,700	1,356.00	56,545,200	貸付有価証券 19,900株
綿半ホールディングス	5,100	1,471.00	7,502,100	貸付有価証券 1,800株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	45,200	1,048.00	47,369,600	
ブックオフコーポレーション	7,700	841.00	6,475,700	貸付有価証券 3,400株(700株)
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,800	991.00	3,765,800	貸付有価証券 1,300株
あさひ	10,100	1,672.00	16,887,200	
日本調剤	3,400	3,915.00	13,311,000	貸付有価証券 1,600株(400株)
コスモス薬品	6,900	19,070.00	131,583,000	貸付有価証券

				3,200株(2,300株)
トーエル	6,600	775.00	5,115,000	貸付有価証券 2,300株
一六堂	3,300	334.00	1,102,200	
セブン & アイ・ホールディングス	570,600	4,763.00	2,717,767,800	貸付有価証券 230,900株(1,500株)
薬王堂	2,500	3,900.00	9,750,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	36,600	1,014.00	37,112,400	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
ツルハホールディングス	31,300	11,010.00	344,613,000	貸付有価証券 200株
サンマルクホールディングス	10,800	2,870.00	30,996,000	
フェリシモ	3,900	1,017.00	3,966,300	
トリドール	16,700	2,044.00	34,134,800	
クスリのアオキ	12,100	6,090.00	73,689,000	貸付有価証券 4,900株
メディカルシステムネットワーク	15,400	637.00	9,809,800	貸付有価証券 7,300株
総合メディカル	6,600	3,245.00	21,417,000	貸付有価証券 1,900株
はるやま商事	5,700	759.00	4,326,300	
カップ・クリエイト	19,100	1,238.00	23,645,800	貸付有価証券 9,100株
ライトオン	10,200	1,470.00	14,994,000	貸付有価証券 4,800株
ジーンズメイト	4,300	183.00	786,900	貸付有価証券 2,000株(1,000株)
良品計画	15,700	25,880.00	406,316,000	貸付有価証券 700株
三城ホールディングス	16,800	443.00	7,442,400	
アルピス	3,600	2,084.00	7,502,400	
コナカ	17,400	513.00	8,926,200	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,429.00	2,429,300	貸付有価証券 700株(100株)
G - 7ホールディングス	4,000	1,235.00	4,940,000	
イオン北海道	9,100	518.00	4,713,800	貸付有価証券 600株
コジマ	20,100	247.00	4,964,700	貸付有価証券 900株
ヒマラヤ	4,200	1,015.00	4,263,000	貸付有価証券

				300株
コーナン商事	19,300	1,949.00	37,615,700	貸付有価証券 9,200株
エコス	5,200	1,406.00	7,311,200	貸付有価証券 200株(100株)
ワタミ	16,100	990.00	15,939,000	貸付有価証券 7,200株(5,400株)
マルシェ	3,300	832.00	2,745,600	貸付有価証券 1,300株
ドンキホーテホールディングス	88,200	3,895.00	343,539,000	貸付有価証券 4,800株
西松屋チェーン	26,900	1,268.00	34,109,200	
ゼンショーホールディングス	70,200	1,418.00	99,543,600	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
幸楽苑ホールディングス	8,600	1,498.00	12,882,800	貸付有価証券 3,700株(1,800株)
ハークスレイ	3,800	1,038.00	3,944,400	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
サイゼリヤ	22,400	2,020.00	45,248,000	貸付有価証券 10,700株
V Tホールディングス	46,100	581.00	26,784,100	貸付有価証券 21,800株
魚力	4,200	1,291.00	5,422,200	
ポブラ	3,400	462.00	1,570,800	
ユナイテッドアローズ	19,500	3,730.00	72,735,000	
ハイデイ日高	12,400	2,627.00	32,574,800	貸付有価証券 400株
京都きもの友禅	9,300	902.00	8,388,600	貸付有価証券 4,400株
コロワイド	45,200	1,884.00	85,156,800	貸付有価証券 20,300株(100株)
ピーシーデポコーポレーション	15,100	1,210.00	18,271,000	貸付有価証券 4,200株(200株)
壱番屋	6,200	7,220.00	44,764,000	貸付有価証券 2,900株
トップカルチャー	4,900	462.00	2,263,800	貸付有価証券 2,300株
P L A N T	3,100	1,220.00	3,782,000	
スギホールディングス	24,500	5,630.00	137,935,000	
スクロール	20,600	467.00	9,620,200	貸付有価証券 8,900株

ヨンドシーホールディングス	10,400	2,710.00	28,184,000	貸付有価証券 4,900株(3,000株)
ファミリーマート	41,900	5,950.00	249,305,000	貸付有価証券 20,000株
木曽路	16,700	2,246.00	37,508,200	貸付有価証券 6,900株(5,500株)
サトレストランシステムズ	16,000	809.00	12,944,000	貸付有価証券 7,500株
千趣会	26,900	759.00	20,417,100	貸付有価証券 2,200株
タカキュー	10,500	188.00	1,974,000	
ケーヨー	23,000	525.00	12,075,000	貸付有価証券 9,800株(900株)
上新電機	32,000	887.00	28,384,000	
日本瓦斯	20,800	2,536.00	52,748,800	貸付有価証券 3,900株
ベスト電器	43,900	116.00	5,092,400	貸付有価証券 14,100株(14,100株)
ロイヤルホールディングス	22,600	2,102.00	47,505,200	貸付有価証券 1,000株
東天紅	10,000	130.00	1,300,000	貸付有価証券 1,000株
いなげや	15,200	1,480.00	22,496,000	
島忠	35,300	2,509.00	88,567,700	
チヨダ	16,100	2,857.00	45,997,700	貸付有価証券 600株
ライフコーポレーション	8,600	3,025.00	26,015,000	貸付有価証券 3,300株(100株)
リンガーハット	12,300	2,309.00	28,400,700	貸付有価証券 100株
さが美	11,000	89.00	979,000	貸付有価証券 4,000株(2,000株)
MrMax	11,900	312.00	3,712,800	
テナライド	12,500	368.00	4,600,000	貸付有価証券 100株
AOKIホールディングス	31,100	1,242.00	38,626,200	
オークワ	21,000	1,182.00	24,822,000	
コメリ	21,000	2,806.00	58,926,000	
青山商事	26,100	4,180.00	109,098,000	貸付有価証券 100株

しまむら	15,800	15,120.00	238,896,000	
はせがわ	6,400	418.00	2,675,200	貸付有価証券 900株(900株)
高島屋	198,000	788.00	156,024,000	貸付有価証券 7,000株(6,000株)
松屋	27,400	863.00	23,646,200	貸付有価証券 13,100株(300株)
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,800	1,786.00	124,662,800	
近鉄百貨店	52,000	310.00	16,120,000	貸付有価証券 24,000株
丸栄	28,000	98.00	2,744,000	貸付有価証券 13,000株
ニッセンホールディング ス	20,000	118.00	2,360,000	貸付有価証券 9,500株(3,300株)
パルコ	13,100	932.00	12,209,200	貸付有価証券 1,800株
丸井グループ	167,400	1,714.00	286,923,600	貸付有価証券 19,600株(2,500株)
アクシアル リテイリン グ	10,500	3,590.00	37,695,000	
井筒屋	74,000	53.00	3,922,000	貸付有価証券 28,000株
イオン	561,300	1,674.50	939,896,850	貸付有価証券 268,100株(10,400 株)
ユニグループ・ホール ディングス	130,600	821.00	107,222,600	
イズミ	27,100	4,330.00	117,343,000	貸付有価証券 1,400株
東武ストア	16,000	309.00	4,944,000	
平和堂	27,600	2,347.00	64,777,200	
フジ	15,100	2,432.00	36,723,200	
ヤオコー	15,500	4,930.00	76,415,000	
ゼビオホールディングス	18,500	1,705.00	31,542,500	貸付有価証券 300株
ケーズホールディングス	28,800	3,765.00	108,432,000	貸付有価証券 13,700株(300株)
O l y m p i c グループ	8,000	573.00	4,584,000	貸付有価証券 200株
日産東京販売ホールディ ングス	22,900	261.00	5,976,900	

アインホールディングス	16,400	5,630.00	92,332,000	貸付有価証券 7,800株
元気寿司	3,800	2,131.00	8,097,800	
ヤマダ電機	414,800	556.00	230,628,800	貸付有価証券 198,100株（93,800株）
アークランドサカモト	23,100	1,157.00	26,726,700	
ニトリホールディングス	58,900	10,670.00	628,463,000	
グルメ杵屋	10,000	999.00	9,990,000	貸付有価証券 4,000株
愛眼	10,900	215.00	2,343,500	貸付有価証券 4,500株（3,500株）
ケーユーホールディングス	7,100	739.00	5,246,900	貸付有価証券 100株
吉野家ホールディングス	50,300	1,442.00	72,532,600	貸付有価証券 24,000株
松屋フーズ	6,500	2,818.00	18,317,000	貸付有価証券 200株（200株）
サガミチェーン	18,200	1,230.00	22,386,000	貸付有価証券 8,600株（6,000株）
関西スーパーマーケット	11,100	923.00	10,245,300	貸付有価証券 5,300株（5,200株）
王将フードサービス	10,000	3,585.00	35,850,000	貸付有価証券 4,700株
プレナス	15,200	1,988.00	30,217,600	貸付有価証券 6,800株
ミニストップ	10,100	1,790.00	18,079,000	貸付有価証券 4,700株（200株）
アークス	25,500	2,551.00	65,050,500	
バローホールディングス	29,400	2,857.00	83,995,800	
藤久	1,100	1,739.00	1,912,900	
ベルク	6,700	4,360.00	29,212,000	
大庄	7,300	1,459.00	10,650,700	貸付有価証券 600株
ファーストリテイリング	22,800	28,895.00	658,806,000	貸付有価証券 700株（300株）
サンドラッグ	28,800	7,940.00	228,672,000	
サックスパーホールディングス	12,800	1,335.00	17,088,000	貸付有価証券 2,100株
ヤマザワ	2,800	1,653.00	4,628,400	貸付有価証券 200株

やまや	2,800	1,982.00	5,549,600	
ペルーナ	34,000	570.00	19,380,000	
島根銀行	2,900	1,145.00	3,320,500	貸付有価証券 900株
じもとホールディングス	97,900	141.00	13,803,900	
足利ホールディングス	100,100	319.00	31,931,900	
東京ＴＹフィナンシャル グループ	18,800	2,798.00	52,602,400	
九州フィナンシャルグ ループ	208,800	558.00	116,510,400	
ゆうちょ銀行	349,500	1,325.00	463,087,500	貸付有価証券 125,200株
富山第一銀行	34,700	530.00	18,391,000	貸付有価証券 16,400株
コンコルディア・フィナ ンシャルグループ	950,300	487.00	462,796,100	
新生銀行	1,180,000	158.00	186,440,000	貸付有価証券 564,000株
あおぞら銀行	863,000	389.00	335,707,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャ ル・グループ	10,944,900	508.80	5,568,765,120	
りそなホールディングス	1,595,800	386.40	616,617,120	貸付有価証券 130,300株(130,300 株)
三井住友トラスト・ホー ルディングス	2,848,000	335.00	954,080,000	
三井住友フィナンシャル グループ	1,092,300	3,358.00	3,667,943,400	
第四銀行	173,000	376.00	65,048,000	
北越銀行	147,000	189.00	27,783,000	
西日本シティ銀行	444,000	194.00	86,136,000	
千葉銀行	526,000	542.00	285,092,000	
常陽銀行	493,000	380.00	187,340,000	貸付有価証券 193,000株(193,000 株)
群馬銀行	303,000	433.00	131,199,000	貸付有価証券 22,000株(22,000株)
武蔵野銀行	21,800	2,763.00	60,233,400	
千葉興業銀行	37,400	471.00	17,615,400	
筑波銀行	56,700	278.00	15,762,600	
七十七銀行	214,000	380.00	81,320,000	

青森銀行	99,000	326.00	32,274,000	貸付有価証券 37,000株（34,000株）
秋田銀行	89,000	290.00	25,810,000	
山形銀行	77,000	402.00	30,954,000	貸付有価証券 35,000株（8,000株）
岩手銀行	9,500	4,130.00	39,235,000	貸付有価証券 4,300株（2,100株）
東邦銀行	122,000	370.00	45,140,000	
東北銀行	69,000	143.00	9,867,000	
みちのく銀行	68,000	177.00	12,036,000	貸付有価証券 22,000株（18,000株）
ふくおかフィナンシャル グループ	590,000	358.00	211,220,000	
静岡銀行	400,000	795.00	318,000,000	
十六銀行	171,000	321.00	54,891,000	
スルガ銀行	129,500	2,200.00	284,900,000	貸付有価証券 7,500株（7,500株）
八十二銀行	246,800	471.00	116,242,800	
山梨中央銀行	84,000	406.00	34,104,000	貸付有価証券 1,000株
大垣共立銀行	182,000	333.00	60,606,000	貸付有価証券 13,000株
福井銀行	117,000	216.00	25,272,000	
北國銀行	145,000	311.00	45,095,000	貸付有価証券 3,000株
清水銀行	4,600	2,275.00	10,465,000	
富山銀行	2,600	3,515.00	9,139,000	貸付有価証券 1,200株
滋賀銀行	128,000	476.00	60,928,000	貸付有価証券 56,000株（5,000株）
南都銀行	132,000	315.00	41,580,000	貸付有価証券 5,000株
百五銀行	123,000	401.00	49,323,000	貸付有価証券 28,000株
京都銀行	260,000	720.00	187,200,000	貸付有価証券 15,000株（15,000株）
紀陽銀行	53,500	1,314.00	70,299,000	
三重銀行	61,000	198.00	12,078,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	928,000	138.00	128,064,000	
広島銀行	402,000	393.00	157,986,000	

山陰合同銀行	82,000	696.00	57,072,000	
中国銀行	96,700	1,106.00	106,950,200	
鳥取銀行	43,000	167.00	7,181,000	
伊予銀行	145,900	723.00	105,485,700	
百十四銀行	150,000	320.00	48,000,000	貸付有価証券 8,000株
四国銀行	105,000	210.00	22,050,000	貸付有価証券 16,000株
阿波銀行	109,000	559.00	60,931,000	
大分銀行	78,000	321.00	25,038,000	貸付有価証券 35,000株
宮崎銀行	91,000	289.00	26,299,000	
佐賀銀行	83,000	215.00	17,845,000	
十八銀行	84,000	253.00	21,252,000	貸付有価証券 4,000株
沖縄銀行	10,400	3,695.00	38,428,000	貸付有価証券 4,500株
琉球銀行	28,100	1,277.00	35,883,700	貸付有価証券 1,900株
セブン銀行	511,100	472.00	241,239,200	貸付有価証券 244,200株
みずほフィナンシャルグループ	19,335,100	165.80	3,205,759,580	
高知銀行	53,000	110.00	5,830,000	
山口フィナンシャルグループ	128,000	1,062.00	135,936,000	貸付有価証券 53,000株（24,000株）
長野銀行	45,000	188.00	8,460,000	貸付有価証券 21,000株（3,000株）
名古屋銀行	114,000	363.00	41,382,000	貸付有価証券 54,000株（4,000株）
北洋銀行	205,500	279.00	57,334,500	
愛知銀行	4,600	4,970.00	22,862,000	
第三銀行	77,000	152.00	11,704,000	貸付有価証券 26,000株（2,000株）
中京銀行	56,000	214.00	11,984,000	
大光銀行	48,000	198.00	9,504,000	
愛媛銀行	80,000	230.00	18,400,000	貸付有価証券 38,000株（28,000株）
トマト銀行	53,000	145.00	7,685,000	
みなと銀行	123,000	158.00	19,434,000	

京葉銀行	112,000	404.00	45,248,000	
関西アーバン銀行	19,000	1,037.00	19,703,000	
栃木銀行	71,000	424.00	30,104,000	
北日本銀行	4,200	2,656.00	11,155,200	
東和銀行	255,000	90.00	22,950,000	
福島銀行	168,000	86.00	14,448,000	貸付有価証券 41,000株
大東銀行	82,000	176.00	14,432,000	貸付有価証券 8,000株
トモニホールディングス	104,700	315.00	32,980,500	
フィデアホールディングス	111,300	171.00	19,032,300	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
池田泉州ホールディングス	144,700	416.00	60,195,200	
F P G	48,600	1,154.00	56,084,400	貸付有価証券 21,900株（15,900株）
S B Iホールディングス	163,800	1,227.00	200,982,600	
日本アジア投資	9,200	268.00	2,465,600	貸付有価証券 4,400株（2,100株）
ジャフコ	22,800	3,130.00	71,364,000	
大和証券グループ本社	1,276,000	627.70	800,945,200	
野村ホールディングス	2,624,700	460.30	1,208,149,410	
岡三証券グループ	116,000	569.00	66,004,000	貸付有価証券 6,000株
丸三証券	40,500	994.00	40,257,000	貸付有価証券 16,400株
東洋証券	52,000	245.00	12,740,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,500	552.00	86,388,000	貸付有価証券 1,200株
光世証券	33,000	130.00	4,290,000	貸付有価証券 15,000株
水戸証券	42,200	285.00	12,027,000	貸付有価証券 3,200株
いちよし証券	30,500	918.00	27,999,000	貸付有価証券 10,100株
松井証券	66,800	967.00	64,595,600	
だいこう証券ビジネス	6,600	738.00	4,870,800	貸付有価証券 200株
マネックスグループ	158,500	290.00	45,965,000	貸付有価証券 32,200株（19,200株）

カブドットコム証券	116,300	351.00	40,821,300	
極東証券	18,300	1,314.00	24,046,200	貸付有価証券 8,700株
岩井コスモホールディングス	12,900	1,017.00	13,119,300	貸付有価証券 200株（200株）
藍澤證券	25,500	593.00	15,121,500	貸付有価証券 1,400株
マネースクウェアHD	4,700	1,051.00	4,939,700	貸付有価証券 400株（100株）
マネーパートナーズグループ	12,700	669.00	8,496,300	貸付有価証券 6,000株（100株）
小林洋行	3,900	242.00	943,800	貸付有価証券 1,800株（1,500株）
かんぽ生命保険	55,500	2,437.00	135,253,500	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	303,000	2,876.00	871,428,000	
アニコムホールディングス	9,200	2,869.00	26,394,800	貸付有価証券 4,400株（100株）
MS & ADインシュアランスグループホール	407,700	2,959.50	1,206,588,150	
ソニーフィナンシャルホールディングス	130,700	1,350.00	176,445,000	
第一生命保険	874,000	1,343.00	1,173,782,000	
東京海上ホールディングス	552,700	3,713.00	2,052,175,100	
T & Dホールディングス	497,200	1,039.50	516,839,400	
全国保証	35,500	3,755.00	133,302,500	
クレディセゾン	103,500	2,072.00	214,452,000	
アクリーティブ	11,200	527.00	5,902,400	貸付有価証券 1,300株（100株）
芙蓉総合リース	15,600	4,845.00	75,582,000	
興銀リース	25,600	1,895.00	48,512,000	
東京センチュリーリース	32,000	3,740.00	119,680,000	貸付有価証券 300株
日本証券金融	60,100	432.00	25,963,200	
アイフル	228,400	396.00	90,446,400	貸付有価証券 109,000株（2,500株）
ポケットカード	13,600	561.00	7,629,600	貸付有価証券 4,300株
リコーリース	10,700	3,160.00	33,812,000	
イオンフィナンシャル	89,500	2,532.00	226,614,000	

サービス				
アコム	274,000	632.00	173,168,000	貸付有価証券 97,200株
ジャックス	75,000	455.00	34,125,000	貸付有価証券 1,000株
オリエントコーポレーション	589,800	228.00	134,474,400	
日立キャピタル	32,100	2,326.00	74,664,600	
アプラスフィナンシャル	65,400	104.00	6,801,600	貸付有価証券 31,200株
オリックス	966,000	1,600.50	1,546,083,000	
三菱UFJリース	346,000	468.00	161,928,000	
日本取引所グループ	400,600	1,646.00	659,387,600	
イー・ギャランティ	4,400	2,431.00	10,696,400	貸付有価証券 1,400株
アサックス	2,400	1,371.00	3,290,400	
NECキャピタルソリューション	5,500	1,542.00	8,481,000	
いちごグループホールディングス	151,000	487.00	73,537,000	貸付有価証券 55,500株
日本駐車場開発	164,000	124.00	20,336,000	貸付有価証券 71,300株
ヒューリック	284,400	1,114.00	316,821,600	貸付有価証券 23,500株（22,900株）
三栄建築設計	5,500	1,293.00	7,111,500	
野村不動産ホールディングス	90,500	1,995.00	180,547,500	貸付有価証券 2,800株
三重交通グループホールディングス	24,200	589.00	14,253,800	貸付有価証券 5,500株（4,600株）
サムティ	9,800	1,139.00	11,162,200	貸付有価証券 3,400株（3,000株）
ディア・ライフ	9,200	407.00	3,744,400	
エー・ディー・ワークス	124,900	45.00	5,620,500	貸付有価証券 7,100株
日本商業開発	6,000	2,324.00	13,944,000	貸付有価証券 1,500株
プレサンスコーポレーション	4,600	4,035.00	18,561,000	
ユニゾホールディングス	8,500	5,590.00	47,515,000	貸付有価証券 4,000株
日本管理センター	8,900	1,779.00	15,833,100	貸付有価証券

				200株
サンセイランディック	3,100	970.00	3,007,000	貸付有価証券 100株
エストラスト	2,400	548.00	1,315,200	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
フージャースホールディングス	19,000	498.00	9,462,000	貸付有価証券 7,700株
オープンハウス	19,700	2,648.00	52,165,600	貸付有価証券 8,700株
東急不動産ホールディングス	330,000	748.00	246,840,000	
飯田グループホールディングス	126,400	2,145.00	271,128,000	
ムゲンエステート	2,000	2,255.00	4,510,000	
パーク24	68,900	3,135.00	216,001,500	貸付有価証券 20,000株(1,500株)
パラカ	3,900	1,481.00	5,775,900	
三井不動産	723,000	2,728.50	1,972,705,500	
三菱地所	1,014,000	2,150.00	2,180,100,000	貸付有価証券 177,000株
平和不動産	25,800	1,373.00	35,423,400	
東京建物	149,000	1,424.00	212,176,000	
ダイビル	35,100	1,030.00	36,153,000	
京阪神ビルディング	22,600	592.00	13,379,200	
住友不動産	327,000	3,207.00	1,048,689,000	
大京	253,000	176.00	44,528,000	貸付有価証券 15,000株
テーオーシー	52,900	886.00	46,869,400	
東京楽天地	22,000	482.00	10,604,000	
レオパレス21	160,700	709.00	113,936,300	
スターツコーポレーション	15,600	2,182.00	34,039,200	
フジ住宅	17,400	680.00	11,832,000	貸付有価証券 7,500株
空港施設	16,500	482.00	7,953,000	
明和地所	7,500	630.00	4,725,000	
住友不動産販売	9,800	2,191.00	21,471,800	
ゴールドクレスト	10,700	1,578.00	16,884,600	貸付有価証券 300株
日本エスリード	5,300	1,006.00	5,331,800	

日神不動産	18,100	365.00	6,606,500	
タカラレーベン	59,500	754.00	44,863,000	貸付有価証券 28,100株(9,600株)
サンヨーハウジング名古屋	7,000	975.00	6,825,000	貸付有価証券 1,200株
イオンモール	88,000	1,469.00	129,272,000	
ファースト住建	5,100	1,296.00	6,609,600	
トーセイ	20,700	794.00	16,435,800	貸付有価証券 9,800株(500株)
穴吹興産	15,000	256.00	3,840,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	84,700	1,059.00	89,697,300	
サンフロンティア不動産	16,500	1,090.00	17,985,000	貸付有価証券 7,800株(5,800株)
エフ・ジェー・ネクスト	11,900	508.00	6,045,200	
ランドビジネス	8,000	259.00	2,072,000	
グランディハウス	11,900	352.00	4,188,800	
日本空港ビルデング	43,500	3,640.00	158,340,000	貸付有価証券 20,700株(300株)
日本工営	48,000	353.00	16,944,000	貸付有価証券 12,000株
ネクスト	40,800	1,254.00	51,163,200	貸付有価証券 19,500株
ジェイエシーリクルートメント	8,900	1,410.00	12,549,000	貸付有価証券 3,100株(100株)
日本M&Aセンター	22,300	6,610.00	147,403,000	
ノバレーゼ	3,700	831.00	3,074,700	貸付有価証券 1,500株(1,000株)
アコーディア・ゴルフ	40,000	1,054.00	42,160,000	
中広	1,400	630.00	882,000	
タケエイ	12,600	993.00	12,511,800	貸付有価証券 6,000株
トラスト・テック	5,800	1,368.00	7,934,400	
パソナグループ	12,500	713.00	8,912,500	貸付有価証券 5,900株(4,500株)
CDS	3,300	876.00	2,890,800	貸付有価証券 1,500株
リンクアンドモチベーション	29,100	141.00	4,103,100	貸付有価証券 13,600株(200株)
GCAサヴィアン	12,800	1,017.00	13,017,600	貸付有価証券

				700株
エス・エム・エス	18,000	2,264.00	40,752,000	貸付有価証券 3,600株
テンプホールディングス	101,200	1,629.00	164,854,800	貸付有価証券 5,300株
リニカル	8,500	2,251.00	19,133,500	貸付有価証券 4,000株
クックパッド	32,200	1,689.00	54,385,800	貸付有価証券 100株
エスクリ	6,100	623.00	3,800,300	貸付有価証券 2,900株(1,900株)
アイ・ケイ・ケイ	7,700	628.00	4,835,600	貸付有価証券 1,800株
学情	5,300	1,100.00	5,830,000	貸付有価証券 2,500株(500株)
スタジオアリス	6,600	2,816.00	18,585,600	
シミックホールディングス	7,300	1,642.00	11,986,600	貸付有価証券 3,100株(2,400株)
N J S	2,900	1,206.00	3,497,400	
総合警備保障	48,200	5,990.00	288,718,000	
カカココム	103,600	2,053.00	212,690,800	貸付有価証券 49,200株(33,700株)
ルネサンス	7,300	1,223.00	8,927,900	貸付有価証券 3,100株
ディップ	16,000	2,823.00	45,168,000	貸付有価証券 5,800株
オプトホールディング	9,000	741.00	6,669,000	貸付有価証券 1,600株
新日本科学	13,700	557.00	7,630,900	貸付有価証券 6,500株
ツクイ	17,100	1,365.00	23,341,500	貸付有価証券 7,200株(1,500株)
キャリアデザインセンター	3,000	983.00	2,949,000	貸付有価証券 1,100株(1,000株)
エムスリー	125,000	3,205.00	400,625,000	貸付有価証券 59,700株
ツカダ・グローバルホールディング	10,500	713.00	7,486,500	貸付有価証券 2,700株
アウトソーシング	6,700	3,805.00	25,493,500	貸付有価証券 3,100株(1,600株)
ウェルネット	5,400	3,960.00	21,384,000	貸付有価証券 2,500株(2,200株)

ディー・エヌ・エー	64,700	1,836.00	118,789,200	貸付有価証券 30,900株
博報堂D Yホールディングス	200,100	1,276.00	255,327,600	
ぐるなび	16,700	2,747.00	45,874,900	
エスアールジータカミヤ	15,600	514.00	8,018,400	貸付有価証券 6,000株
ジャパンベストレスキューシステム	17,900	229.00	4,099,100	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
ファンコミュニケーションズ	33,300	797.00	26,540,100	貸付有価証券 7,300株（4,000株）
ジェイコムホールディングス	2,900	2,653.00	7,693,700	貸付有価証券 1,400株
WDBホールディングス	5,200	926.00	4,815,200	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
ティア	6,900	671.00	4,629,900	貸付有価証券 2,800株（500株）
バリューコマース	13,300	360.00	4,788,000	
インフォマート	27,800	983.00	27,327,400	貸付有価証券 9,900株（200株）
J Pホールディングス	35,800	347.00	12,422,600	貸付有価証券 17,000株（1,400株）
E P Sホールディングス	17,900	1,397.00	25,006,300	
レグス	2,800	703.00	1,968,400	
プレステージ・インターナショナル	12,100	1,271.00	15,379,100	
アミューズ	8,000	2,498.00	19,984,000	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
ドリームインキュベータ	4,800	2,382.00	11,433,600	貸付有価証券 2,300株
クイック	7,400	774.00	5,727,600	
T A C	7,900	194.00	1,532,600	貸付有価証券 3,300株
ケネディクス	193,800	481.00	93,217,800	
電通	160,900	5,730.00	921,957,000	貸付有価証券 28,800株（600株）
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,700	466.00	3,122,200	
ぴあ	4,400	2,080.00	9,152,000	貸付有価証券 2,000株
イオンファンタジー	5,100	2,575.00	13,132,500	貸付有価証券

				2,300株
シーティーエス	4,300	753.00	3,237,900	
ネクシィーズグループ	5,200	2,699.00	14,034,800	貸付有価証券 2,400株(1,900株)
みらかホールディングス	36,900	4,620.00	170,478,000	
アルプス技研	5,300	2,181.00	11,559,300	貸付有価証券 2,200株
ダイオーズ	2,600	1,079.00	2,805,400	
日本空調サービス	12,700	534.00	6,781,800	貸付有価証券 400株
オリエンタルランド	156,100	7,371.00	1,150,613,100	貸付有価証券 74,500株(2,500株)
ダスキン	37,000	2,005.00	74,185,000	
明光ネットワークジャパン	17,900	1,222.00	21,873,800	貸付有価証券 4,500株(4,300株)
ファルコホールディングス	6,300	1,407.00	8,864,100	
秀英予備校	2,600	419.00	1,089,400	
田谷	2,400	697.00	1,672,800	
ラウンドワン	45,100	688.00	31,028,800	貸付有価証券 21,500株(20,300株)
リゾートトラスト	60,500	2,358.00	142,659,000	貸付有価証券 700株
ビー・エム・エル	8,500	4,675.00	39,737,500	
ワタベウエディング	4,300	472.00	2,029,600	
りらいあコミュニケーションズ	23,900	1,114.00	26,624,600	
リソー教育	26,800	413.00	11,068,400	貸付有価証券 3,500株(1,600株)
早稲田アカデミー	1,900	858.00	1,630,200	
ユー・エス・エス	174,800	1,653.00	288,944,400	
東京個別指導学院	7,000	700.00	4,900,000	貸付有価証券 100株
サイバーエージェント	38,000	5,180.00	196,840,000	貸付有価証券 17,200株(14,400株)
楽天	675,500	1,253.50	846,739,250	貸付有価証券 322,700株
テー・オー・ダブリュー	11,600	708.00	8,212,800	貸付有価証券 3,600株
セントラルスポーツ	4,900	2,284.00	11,191,600	

フルキャストホールディングス	13,200	732.00	9,662,400	貸付有価証券 6,200株
リゾートソリューション	14,000	307.00	4,298,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
テクノプロ・ホールディングス	23,400	3,175.00	74,295,000	貸付有価証券 100株(100株)
インターワークス	2,500	940.00	2,350,000	
Keepers 技研	1,600	1,948.00	3,116,800	
ファーストロジック	700	2,583.00	1,808,100	貸付有価証券 200株(200株)
リブセンス	9,600	497.00	4,771,200	貸付有価証券 4,300株(2,400株)
ジャパンマテリアル	6,000	2,802.00	16,812,000	貸付有価証券 2,800株
ベクトル	4,500	3,125.00	14,062,500	貸付有価証券 2,100株(1,500株)
ウチヤマホールディングス	7,400	577.00	4,269,800	貸付有価証券 2,500株
サクセスホールディングス	1,300	1,532.00	1,991,600	
キャリアリンク	1,900	1,834.00	3,484,600	貸付有価証券 600株
I B J	11,200	587.00	6,574,400	貸付有価証券 1,500株
アサンテ	5,300	1,368.00	7,250,400	
N・フィールド	6,800	1,909.00	12,981,200	貸付有価証券 3,200株
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	1,932.00	3,477,600	貸付有価証券 500株
ライドオン・エクスプレス	3,100	1,566.00	4,854,600	貸付有価証券 1,100株(800株)
E R Iホールディングス	3,700	881.00	3,259,700	貸付有価証券 1,400株(500株)
アビスト	2,200	2,154.00	4,738,800	貸付有価証券 700株(700株)
ウィルグループ	3,300	1,009.00	3,329,700	
日本ビューホテル	2,100	1,640.00	3,444,000	貸付有価証券 500株
リクルートホールディングス	291,100	3,485.00	1,014,483,500	
エラン	1,600	1,386.00	2,217,600	貸付有価証券 500株

日本郵政	424,500	1,436.00	609,582,000	貸付有価証券 152,100株
ベルシステム24ホールディングス	28,200	967.00	27,269,400	貸付有価証券 13,400株
リロ・ホールディング	5,400	14,760.00	79,704,000	
東祥	4,300	4,075.00	17,522,500	
エイチ・アイ・エス	23,500	2,819.00	66,246,500	貸付有価証券 11,200株（2,300株）
ラックランド	2,000	1,707.00	3,414,000	貸付有価証券 100株
共立メンテナンス	10,900	8,730.00	95,157,000	貸付有価証券 1,700株
イチネンホールディングス	15,100	1,022.00	15,432,200	貸付有価証券 100株
建設技術研究所	8,500	895.00	7,607,500	貸付有価証券 4,000株
スペース	7,800	1,313.00	10,241,400	
燦ホールディングス	2,900	1,375.00	3,987,500	
スバル興業	10,000	380.00	3,800,000	
東京テアトル	55,000	119.00	6,545,000	貸付有価証券 11,000株
ナガワ	2,600	3,105.00	8,073,000	
よみうりランド	29,000	498.00	14,442,000	貸付有価証券 13,000株
東京都競馬	99,000	222.00	21,978,000	貸付有価証券 20,000株
常磐興産	53,000	152.00	8,056,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
カナモト	20,100	2,644.00	53,144,400	貸付有価証券 9,500株
東京ドーム	115,000	452.00	51,980,000	
西尾レントオール	11,600	2,784.00	32,294,400	貸付有価証券 400株
トランス・コスモス	16,800	3,090.00	51,912,000	貸付有価証券 4,400株
乃村工藝社	30,900	1,796.00	55,496,400	貸付有価証券 5,300株
藤田観光	52,000	515.00	26,780,000	貸付有価証券 24,000株
日本管財	12,400	1,536.00	19,046,400	
トーカイ	6,400	3,245.00	20,768,000	

白洋舎	15,000	255.00	3,825,000	
セコム	150,200	8,484.00	1,274,296,800	
セントラル警備保障	6,400	2,125.00	13,600,000	
丹青社	27,000	887.00	23,949,000	貸付有価証券 12,700株（9,400株）
メイテック	17,500	3,825.00	66,937,500	貸付有価証券 5,100株
アサツー ディ・ケイ	25,300	2,748.00	69,524,400	
応用地質	13,600	1,143.00	15,544,800	
船井総研ホールディングス	20,100	1,654.00	33,245,400	
進学会	6,900	556.00	3,836,400	
オオバ	10,500	475.00	4,987,500	貸付有価証券 400株
学究社	2,100	1,190.00	2,499,000	貸付有価証券 500株（300株）
ベネッセホールディングス	48,400	2,451.00	118,628,400	貸付有価証券 1,500株
イオンディライト	13,900	3,055.00	42,464,500	
ナック	8,800	918.00	8,078,400	貸付有価証券 3,600株
ニチイ学館	25,100	709.00	17,795,900	貸付有価証券 11,900株（9,100株）
ダイセキ	27,100	2,068.00	56,042,800	
ステップ	4,800	1,059.00	5,083,200	
小計	銘柄数：1,937 組入時価比率：97.7%		273,159,048,910 100.0%	
合計			273,159,048,910	

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成28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

	平成28年 5月10日現在
--	---------------

種類	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	6,317,432,020	-	6,324,010,000	6,348,102
合計	6,317,432,020	-	6,324,010,000	6,348,102

## (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ありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）

平成28年 5月31日現在

資産総額	248,637,248円
負債総額	206,482円
純資産総額（ - ）	248,430,766円
発行済口数	166,216,661口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4946円

## （参考）国内債券マザーファンド

平成28年 5月31日現在

資産総額	8,579,617,258円
負債総額	134,930,154円
純資産総額（ - ）	8,444,687,104円
発行済口数	6,153,596,935口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3723円

## （参考）国内株式マザーファンド

平成28年 5月31日現在

資産総額	344,947,814,031円
負債総額	54,477,474,380円
純資産総額（ - ）	290,470,339,651円
発行済口数	225,848,129,851口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2861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ないません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる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

平成28年6月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)会社の機構

###### (a)会社の意思決定機構

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

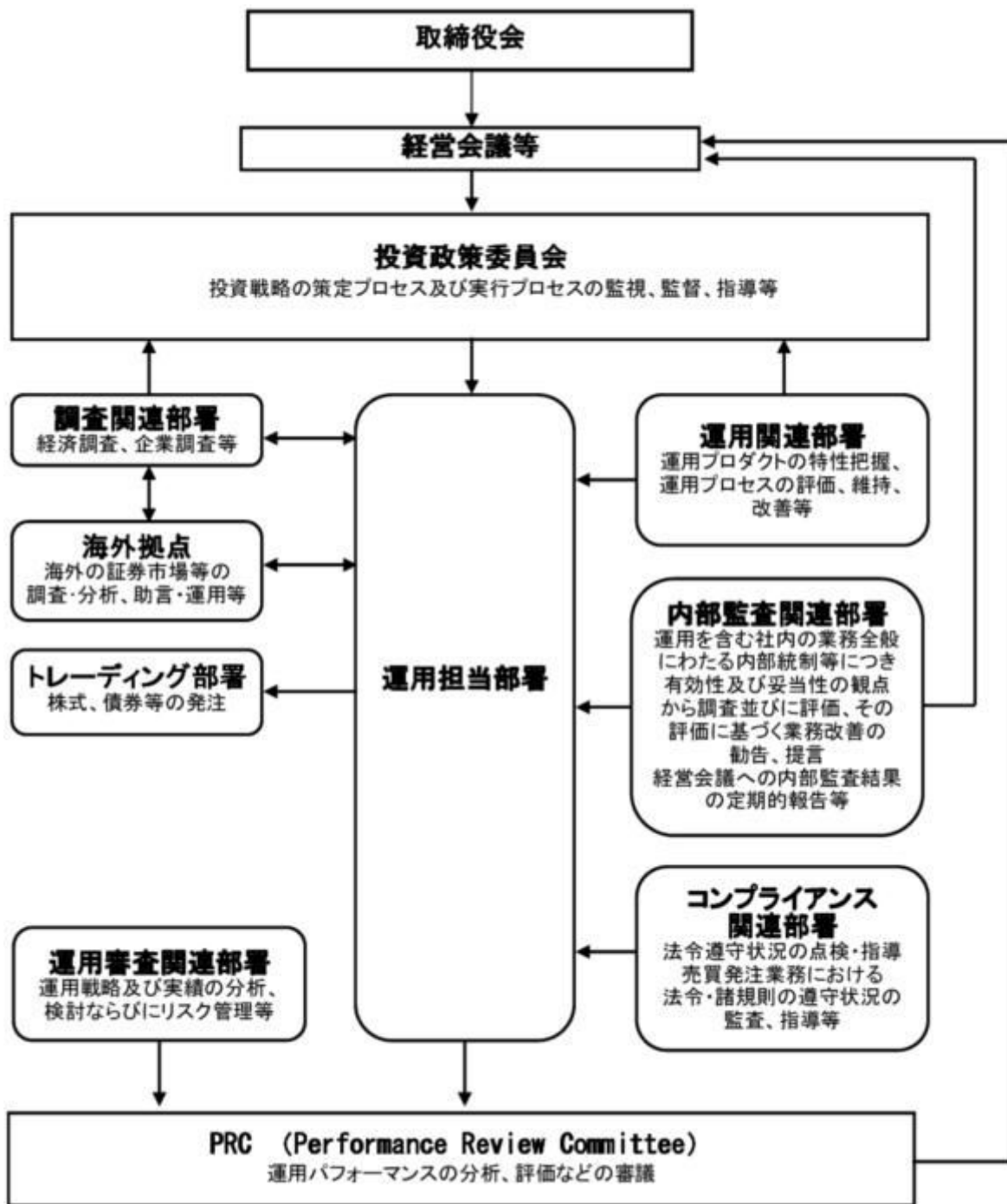
###### 代表執行役・執行役

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

###### 委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成28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	909	17,955,808
単位型株式投資信託	56	216,302
追加型公社債投資信託	18	6,015,996
単位型公社債投資信託	231	1,645,127
合計	1,214	25,833,233

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成27年4月1日から平成28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	当事業年度
		(平成27年3月31日)	(平成28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		411	208
金銭の信託		56,824	55,341
有価証券		17,100	24,100
前払金		15	34
前払費用		29	2
未収入金		330	511
未収委託者報酬		12,679	14,131
未収運用受託報酬		7,436	7,309
繰延税金資産		2,594	2,028
その他		73	56
貸倒引当金		9	10
流動資産計		97,486	103,715
固定資産			
有形固定資産		1,322	1,176
建物	2	413	403
器具備品	2	909	773
無形固定資産		7,254	7,681
ソフトウェア		7,253	7,680

その他		1		0	
投資その他の資産			24,840		23,225
投資有価証券		11,593		9,216	
関係会社株式		10,149		10,958	
従業員長期貸付金		30		-	
長期差入保証金		49		45	
長期前払費用		60		49	
前払年金費用		2,776		2,777	
その他		179		176	
貸倒引当金		0		-	
固定資産計			33,417		32,083
資産合計			130,903		135,799

区分	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
<b>流動負債</b>					
預り金			118		118
未払金	1		11,602		11,855
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		32		31	
未払手数料		4,883		4,537	
その他未払金		6,684		7,284	
未払費用	1		10,221		8,872
未払法人税等			1,961		1,838
前受収益			-		45
賞与引当金			4,558		4,809
外国税支払損失引当金			1,721		-
流動負債計			30,182		27,538
<b>固定負債</b>					
退職給付引当金			2,467		2,708
時効後支払損失引当金			521		526
繰延税金負債			747		68
固定負債計			3,735		3,303
負債合計			33,918		30,842
<b>(純資産の部)</b>					
<b>株主資本</b>					
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			11,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		-		2,000	
利益剰余金			61,182		68,696
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		60,497		68,011	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		35,890		43,405	
評価・換算差額等			6,893		5,349
その他有価証券評価差額金			6,893		5,349
純資産合計			96,985		104,956

負債・純資産合計			130,903		135,799
----------	--	--	---------	--	---------

## (2)【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			96,159		104,445
運用受託報酬			31,466		31,351
その他営業収益			221		219
営業収益計			127,847		136,016
営業費用					
支払手数料			47,060		46,531
広告宣伝費			823		1,008
公告費			-		0
受益証券発行費			5		5
調査費			28,326		28,068
調査費		1,299		4,900	
委託調査費		27,027		23,167	
委託計算費			1,156		1,148
営業雑経費			3,275		3,899
通信費		193		185	
印刷費		951		969	
協会費		77		78	
諸経費		2,053		2,666	
営業費用計			80,648		80,662
一般管理費					
給料			11,660		11,835
役員報酬	2	289		367	
給料・手当		6,874		6,928	
賞与		4,496		4,539	
交際費			131		124
旅費交通費			472		488
租税公課			501		695
不動産賃借料			1,218		1,230
退職給付費用			723		1,063
固定資産減価償却費			3,120		2,589
諸経費			6,815		7,801
一般管理費計			24,643		25,827
営業利益			22,555		29,526

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	

営業外収益					
受取配当金	1	4,038		7,323	
受取利息		5		4	
金銭の信託運用益		347		-	
為替差益		-		281	
その他		366		382	
営業外収益計			4,756		7,991
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,196	
時効後支払損引当金繰入額		28		72	
その他		137		52	
営業外費用計			166		1,321
經常利益			27,146		36,196
特別利益					
投資有価証券等売却益		794		50	
株式報酬受入益		142		96	
特別利益計			936		146
特別損失					
投資有価証券売却損		-		95	
投資有価証券等評価損		91		-	
固定資産除却損	3	357		60	
外国税支払損失引当金繰入額		1,721		-	
特別損失計			2,169		156
税引前当期純利益			25,913		36,186
法人税、住民税及び事業税			8,433		9,806
法人税等調整額			2,488		744
当期純利益			19,967		25,635

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249
会計方針の変更による累積的影響額						81	81	81

会計方針の変更を反映した当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	25,966	51,258	80,168
当期変動額								
剰余金の配当						10,043	10,043	10,043
当期純利益						19,967	19,967	19,967
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	9,923	9,923	9,923
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	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		その他利益剰余金			
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	-	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092
当期変動額									

剰余金の配当							19,933	19,933	19,933
当期純利益							25,635	25,635	25,635
合併による増加			2,000	2,000			144	144	2,144
吸収分割による増加							1,668	1,668	1,668
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	2,000	2,000	-	-	7,514	7,514	9,514
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	6,893	6,893	96,985
当期変動額			
剰余金の配当			19,933
当期純利益			25,635
合併による増加			2,144
吸収分割による増加			1,668
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,543	1,543	1,543
当期変動額合計	1,543	1,543	7,971
当期末残高	5,349	5,349	104,956

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法  (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法

<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産  定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法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。  <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <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								
<p>4. 引当金の計上基準</p>	<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>(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>(5) 外国税支払損失引当金  将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p>								
<p>5. 消費税等の会計処理方法</p>	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p>								
<p>6. 連結納税制度の適用</p>	<p>連結納税制度を適用しております。</p>								

[注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成27年3月31日)	当事業年度末 (平成28年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。
未払金 4,979百万円	未払金 5,894百万円
未払費用 1,411	未払費用 1,151
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額
建物 607百万円	建物 641百万円
器具備品 3,052	器具備品 3,132
合計 3,659	合計 3,774

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28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。	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。
受取配当金 3,966百万円	受取配当金 7,081百万円
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 円 - 百万	建物 1百万円
器具備品 15	器具備品 4
ソフトウェア 342	ソフトウェア 54
ア	ア
合計 357	合計 60

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 10,043百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額	1,950円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月2日

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

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項	
配当金の総額	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月26日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項	
配当金の総額	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月26日

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

平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項	
配当金の総額	34,973百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	6,790円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

## 金融商品関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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

ティプ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成27年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	411	411	-
(2)金銭の信託	56,824	56,824	-
(3)未収委託者報酬	12,679	12,679	-
(4)有価証券及び投資有価証券	27,398	27,398	-
その他有価証券	27,398	27,398	-
(5)関係会社株式	3,064	196,109	193,045
資産計	100,378	293,423	193,045
(6)未払金	11,602	11,602	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	32	32	-
未払手数料	4,883	4,883	-
その他未払金	6,684	6,684	-
(7)未払費用	10,221	10,221	-
(8)未払法人税等	1,961	1,961	-
負債計	23,784	23,784	-

## 注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 未収委託者報酬

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

## (4) 有価証券及び投資有価証券

## その他有価証券

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

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

## (5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

## (6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,294百万円、関係会社株式7,085百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について90百万円減損処理を行っております。

## 注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	411	-	-	-
金銭の信託	56,824	-	-	-
未収委託者報酬	12,679	-	-	-
有価証券	17,100	-	-	-

合計	87,015	-	-	-
----	--------	---	---	---

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### （1）金融商品に対する取組方針

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

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

### （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	208	208	-
(2)金銭の信託	55,341	55,341	-
(3)未収委託者報酬	14,131	14,131	-
(4)未収運用受託報酬	7,309	7,309	-
(5)有価証券及び投資有価証券	32,071	32,071	-
その他有価証券	32,071	32,071	-

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,245百万円、関係会社株式7,894百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

## 注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	208	-	-	-
金銭の信託	55,341	-	-	-
未収委託者報酬	14,131	-	-	-
未収運用受託報酬	7,309	-	-	-
有価証券	24,100	-	-	-
合計	101,091	-	-	-

## 有価証券関係

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	196,109	193,045
合計	3,064	196,109	193,045

## 4．その他有価証券(平成27年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	10,298	282	10,015
小計	10,298	282	10,015
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	17,100	17,100	-
小計	17,100	17,100	-
合計	27,398	17,382	10,015

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	800	790	-
合計	800	790	-

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

## 当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(平成28年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	180,880	177,816
合計	3,064	180,880	177,816

## 4．その他有価証券(平成28年3月31日)

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

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	135	-	95
合計	135	-	95

## 退職給付関係

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	15,680 百万円
会計方針の変更による累積的影響額	127
会計方針の変更を反映した期首残高	15,808
勤務費用	746
利息費用	213
数理計算上の差異の発生額	1,128
退職給付の支払額	724
その他	46
退職給付債務の期末残高	17,218
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	14,786 百万円
期待運用収益	369
数理計算上の差異の発生額	975
事業主からの拠出額	558
退職給付の支払額	573
年金資産の期末残高	16,117
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	14,474 百万円
年金資産	16,117
	1,643
非積立型制度の退職給付債務	2,743
未積立退職給付債務	1,100
未認識数理計算上の差異	1,861
未認識過去勤務費用	451
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309
退職給付引当金	2,467
前払年金費用	2,776
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	746 百万円
利息費用	213
期待運用収益	369
数理計算上の差異の費用処理額	24
過去勤務費用の費用処理額	40
その他	24
確定給付制度に係る退職給付費用	550

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	31%
株式	13%
受益証券等	29%
生保一般勘定	21%
その他	6%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	1.1%
退職一時金制度の割引率	0.8%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	17,218 百万円
勤務費用	811
利息費用	181
数理計算上の差異の発生額	1,150
退職給付の支払額	654
その他	13
退職給付債務の期末残高	18,692

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	16,117 百万円
期待運用収益	402
数理計算上の差異の発生額	711
事業主からの拠出額	511
退職給付の支払額	555
年金資産の期末残高	15,764

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金

## 及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	15,775 百万円
年金資産	15,764
	11
非積立型制度の退職給付債務	2,917
未積立退職給付債務	2,928
未認識数理計算上の差異	3,409
未認識過去勤務費用	411
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69
退職給付引当金	2,708
前払年金費用	2,777
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	811 百万円
利息費用	181
期待運用収益	402
数理計算上の差異の費用処理額	314
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	863

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	43%
株式	43%
生保一般勘定	13%
その他	1%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、191百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (平成27年3月31日)	当事業年度末 (平成28年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
関係会社株式評価減	1,784	関係会社株式評価減	1,676
賞与引当金	1,504	賞与引当金	1,490
退職給付引当金	789	退職給付引当金	839
所有株式税務簿価通算差異	690	所有株式税務簿価通算差異	669
投資有価証券評価減	475	投資有価証券評価減	460
未払事業税	387	未払事業税	350
ゴルフ会員権評価減	296	ゴルフ会員権評価減	240
減価償却超過額	186	減価償却超過額	177
時効後支払損引当金	166	時効後支払損引当金	163
子会社株式売却損	153	子会社株式売却損	148
関連会社株式譲渡益	169	関連会社株式譲渡益	120
未払社会保険料	92	未払社会保険料	89
外国税支払損失引当金	567	外国税支払損失引当金	-
その他	214	その他	251
繰延税金資産小計	7,479	繰延税金資産小計	6,678
評価性引当額	1,500	評価性引当額	1,453
繰延税金資産合計	5,979	繰延税金資産合計	5,224
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	3,243	その他有価証券評価差額金	2,403
前払年金費用	888	前払年金費用	861
繰延税金負債合計	4,132	繰延税金負債合計	3,264
繰延税金負債の純額	1,847	繰延税金資産の純額	1,959
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	36.0%	法定実効税率	33.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%
住民税等均等割	0.0%	住民税等均等割	0.0%
タックスヘイブン税制	1.2%	タックスヘイブン税制	0.8%
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	-%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.8%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.4%
評価性引当額	7.3%	評価性引当額	0.0%
その他	2.8%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%
3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正		3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正	
「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の36%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33%に、平成28年4月1日に開始する前事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32%となります。		「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律13号)が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32%から31%となります。	
この税率変更により、繰延税金資産の純額は73百万円減少し、法人税等調整額が479百万円、その他有価証券評価差額金が405百万円、それぞれ増加しております。		この税率変更による財務諸表に与える影響は軽微であります。	

## 企業結合等関係

## 1. 会社分割について

当社は、野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社(以下「NFR&T」)との、平成27年2月18日付吸収分割契約に基づき、NFR&Tの機関投資家顧問事業及びリテール運用関連事業を会社分割により承継いたしました。

## (1) 企業結合の概要

### 会社分割の目的

本件会社分割により、当社は、NFR&Tが行ってきた投資信託の運用・管理に係る事務および機関投資家向けの顧問関連事業をNFR&Tから承継し、野村グループのアセット・マネジメント部門内における営業、運用、管理業務を集約します。ファンドおよび運用会社の分析・評価業務は、NFR&Tが集約して行います。これらの再編により、運用オペレーションの効率化と堅牢性の向上を図り、顧客に対する質の高いサービスの提供が可能となります。また、再編後の当社及びNFR&T両社は、それぞれの専門性を発揮することにより、品質の高い運用商品の提供を行い、投資家の多様なニーズに応えられると判断いたしました。

### 会社分割日程

吸収分割契約締結日	平成27年 2月 18日
機関投資家顧問事業の吸収分割効力発生日	平成27年 7月 1日
リテール運用関連事業の吸収分割効力発生日	平成27年 10月 1日

### 会社分割の方法

当社を分割承継会社とし、NFR&Tを分割会社とする無対価による吸収分割方式であります。

## (2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

## 2. 吸収合併について

当社は、野村プライベート・エクイティ・キャピタル株式会社(以下「NPEC」)との、平成27年2月18日付吸収合併契約に基づき、NPECを吸収合併いたしました。

## (1) 企業結合の概要

### 吸収合併の目的

運用オペレーションの効率化と堅牢性の向上を図り、顧客に対する質の高いサービスの提供を可能とするためであります。

### 吸収合併日程

吸収合併契約締結日	平成27年 2月 18日
吸収合併効力発生日	平成27年 12月 1日

### 吸収合併の方法

当社を吸収合併存続会社とし、NPECを吸収合併消滅会社とする無対価による吸収合併方式であります。

## (2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

### セグメント情報等

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製

品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## （２）地域ごとの情報

### 売上高

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

### 有形固定資産

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

## （３）主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### （１）製品・サービスごとの情報

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

### （２）地域ごとの情報

#### 売上高

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

#### 有形固定資産

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

### （３）主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### （ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

### （イ）子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)

関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接 21.4%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*1)	3,990	未払費用	547
------	-------------	---------	-----------------	---------	-----------------	------------	-----------------------	-------	------	-----

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	39,273	未払手数料	4,182
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*3)	1,976	未払費用	815

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*3) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

㈱野村総合研究所

流動資産合計 229,418

固定資産合計 273,220

流動負債合計 87,832

固定負債合計 65,965

純資産合計	348,841
売上高	358,952
税引前当期純利益	51,509
当期純利益	34,167

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

### (イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接20.8%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*1)	5,058	未払費用	279

### (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	39,084	未払手数料	3,865
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*3)	2,412	未払費用	669

### (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*3) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

	(百万円)
(株)野村総合研究所	
流動資産合計	239,155
固定資産合計	324,634
流動負債合計	122,933
固定負債合計	55,456
純資産合計	385,400
売上高	352,003
税引前当期純利益	56,508
当期純利益	40,179

### 1株当たり情報

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	18,829円58銭	1株当たり純資産額	20,377円23銭
1株当たり当期純利益	3,876円72銭	1株当たり当期純利益	4,977円07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	19,967百万円	損益計算書上の当期純利益	25,635百万円
普通株式に係る当期純利益	19,967百万円	普通株式に係る当期純利益	25,635百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

## 4【利害関係人との取引制限】

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

止されています。

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

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

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

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

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

## 5【その他】

### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2)訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

\* 平成28年5月末現在

#### (2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

株式会社 常陽銀行	85,113百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
-----------	-----------	--------------------

\* 平成28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

ファンドの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
平成27年 7月29日	有価証券届出書
平成27年 7月29日	有価証券報告書
平成28年 1月26日	有価証券届出書の訂正届出書
平成28年 1月26日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月6日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 岩部俊夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月24日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 岩部 俊夫  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）の平成27年5月12日から平成28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、国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）の平成28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。