

**【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24年6月26日提出

**【計算期間】** 第5期（自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日）

**【ファンド名】** マイバランスDC50  
(以下「ファンド」といいます。)

**【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】** CEO兼執行役会長 岩崎俊博

**【本店の所在の場所】** 東京都中央区日本橋一丁目12番1号

**【事務連絡者氏名】** 松井 秀仁

**【連絡場所】** 東京都中央区日本橋一丁目12番1号

**【電話番号】** 03-3241-9511

**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

## 第一部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

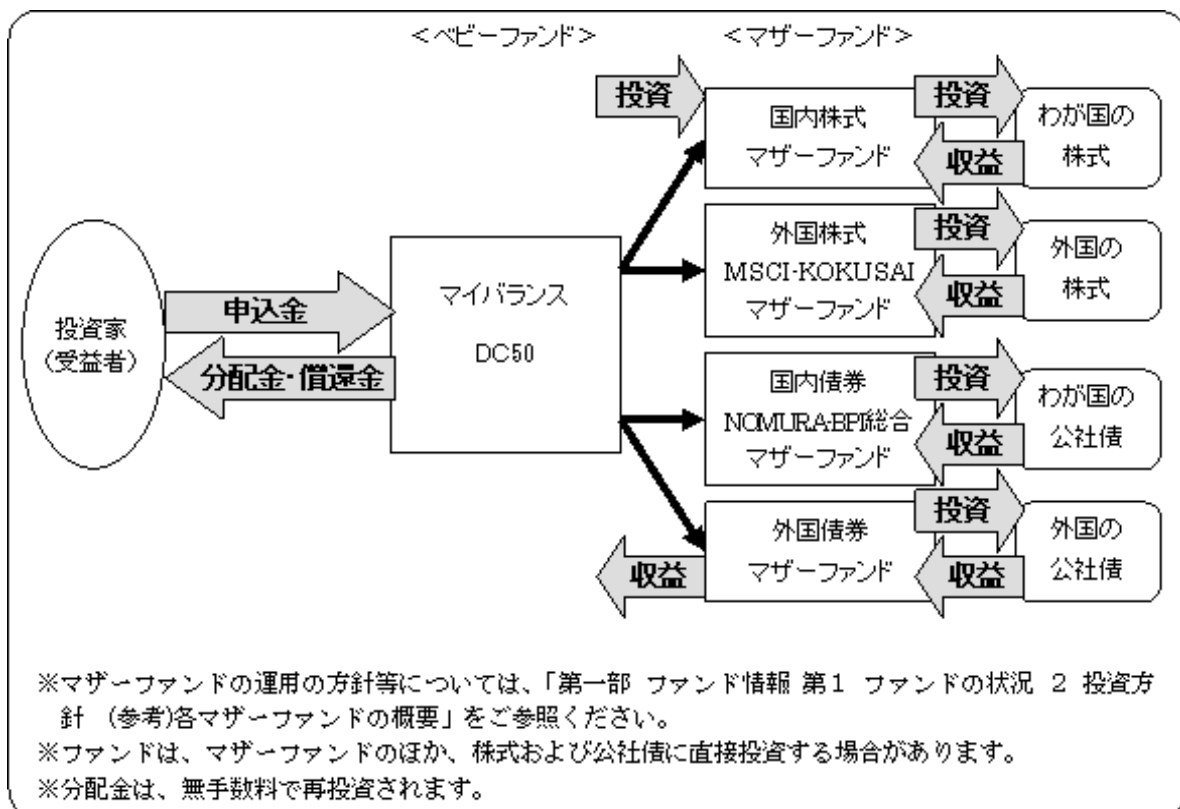
ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

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

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

##### 《ファミリーファンド方式について》

ファンドは「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」「外国債券マザーファンド」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用を行ないます。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。



## 信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

## &lt; 商品分類 &gt;

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。

(マイバランスDC50)

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

## 《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス

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

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。

《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/>

社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（平成22年7月1日現在）

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

[ 投資対象地域による区分 ]

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

[ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨

の記載があるものをいう。

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

[ 独立した区分 ]

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

[ 補足分類 ]

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

< 属性区分表定義 >

[ 投資対象資産による属性区分 ]

株式

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

債券

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

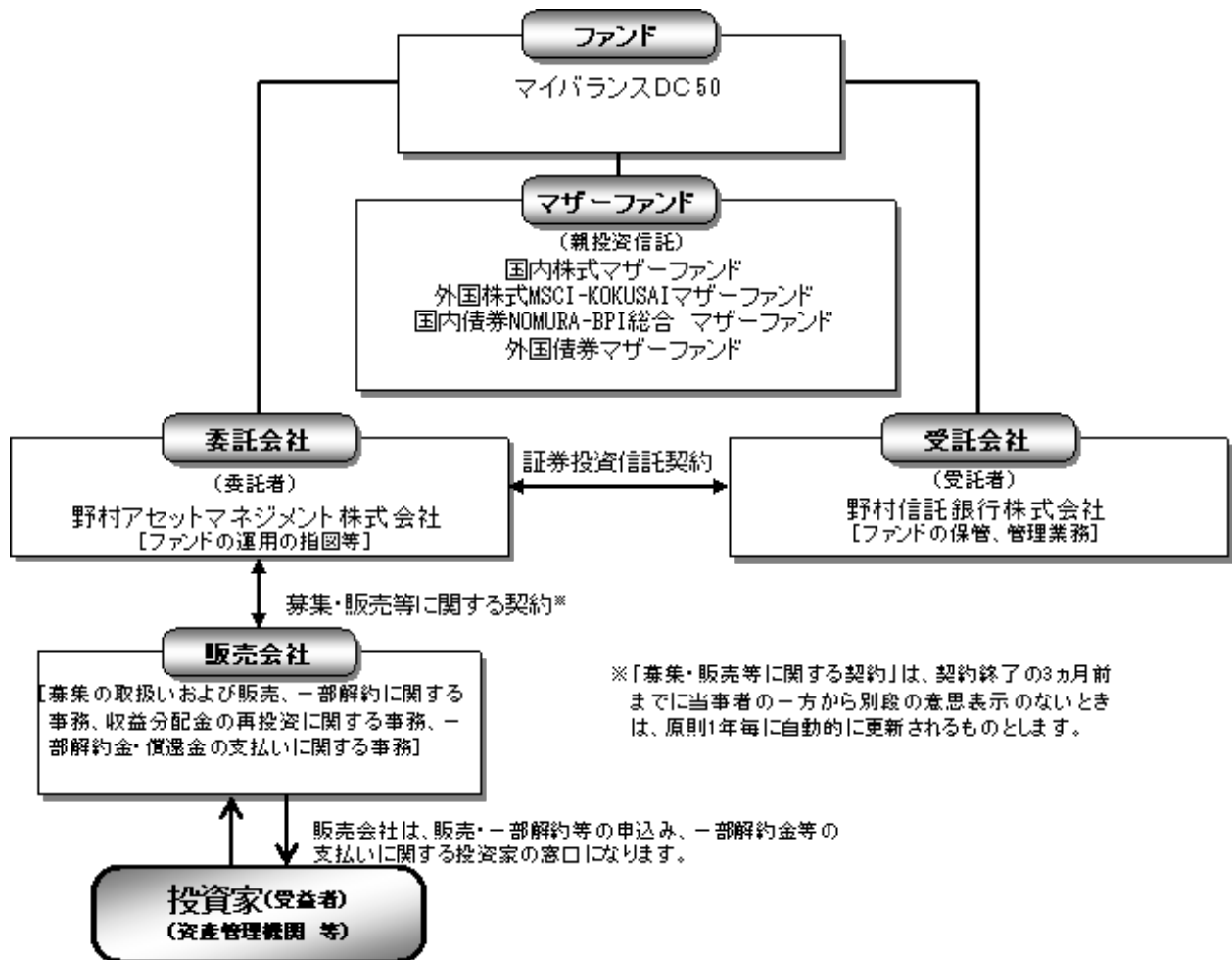
## [ 特殊型 ]

- (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19年9月27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

## 委託会社

- ・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  
平成24年5月末現在、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(平成24年5月末現在)

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

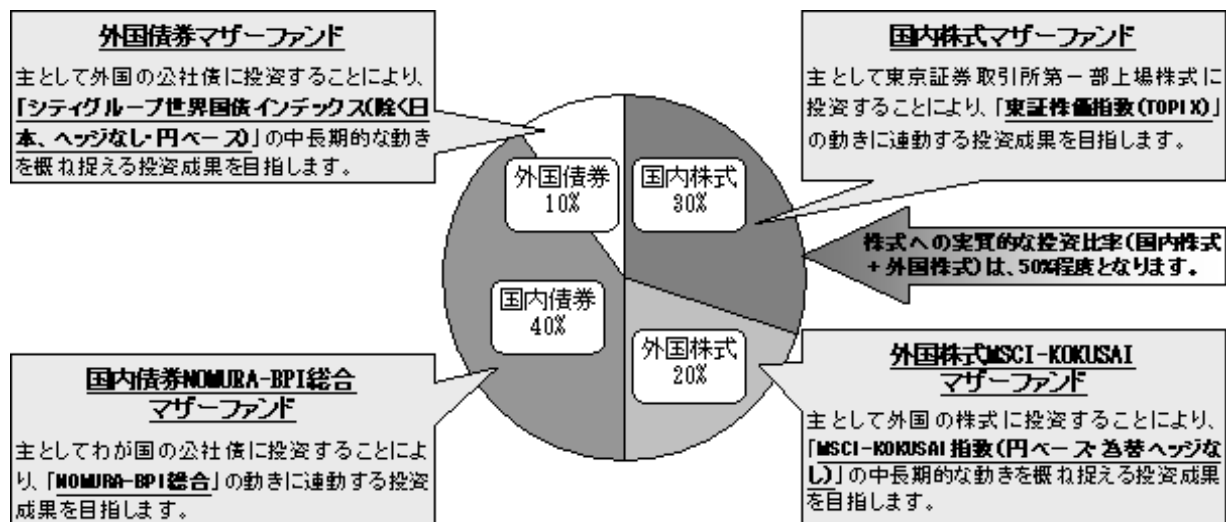
## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

【1】内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

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

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



各マザーファンドが対象とするインデックスについて

国内株式マザーファンド：東証株価指数(TOPIX)

東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした指数です。新規上場銘柄や有償増資などに対しては、修正を加えることで指数の連続性を維持しています。

東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(以下「(株)東京証券取引所」という。)の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行なう権利を有しています。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド：MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)

MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

MSCI-KOKUSAI指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。同指数の著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI

に帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド：NOMURA-BPI総合

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

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

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

シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行わない円ベースの指数)です。

シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが有しています。

[2] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

外貨建資産に投資するマザーファンドにおいても、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2) 【投資対象】

内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券を主要投資対象とします。なお、株式および公社債に直接投資する場合があります。

マザーファンドの主要投資対象

### [1] 国内株式マザーファンド

わが国の株式を主要投資対象とします。

### [2] 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

外国の株式を主要投資対象とします。

### [3] 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

わが国の公社債を主要投資対象とします。

### [4] 外国債券マザーファンド

外国の公社債を主要投資対象とします。

なお、デリバティブの利用は、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15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ 有価証券

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

ハ 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ 金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

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

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

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

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

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

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

1 株券または新株引受権証書

2 国債証券

3 地方債証券

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

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

- 6 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 8 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 9 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 10 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 11 コマーシャル・ペーパー
- 12 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 13 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 14 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 15 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 16 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 17 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19 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
- 20 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
- 21 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。)
- 22 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、第1号の証券または証書、第13号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを「株式」といい、第2号から第7号までの証券および第13号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを「公社債」といい、第14号および第15号の証券を「投資信託証券」といいます。

## 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

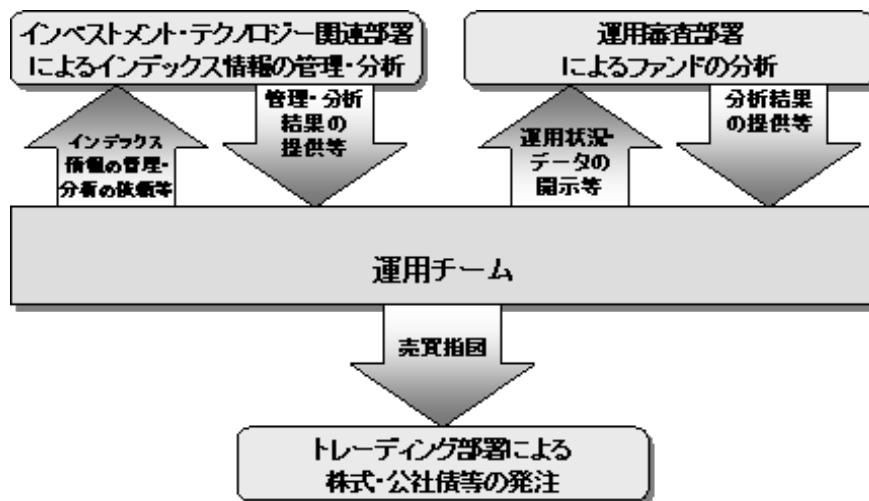
- 1 預金
- 2 指定金銭信託(上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。)
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

- 1 先物取引等
- 2 スワップ取引

## (3) 【運用体制】

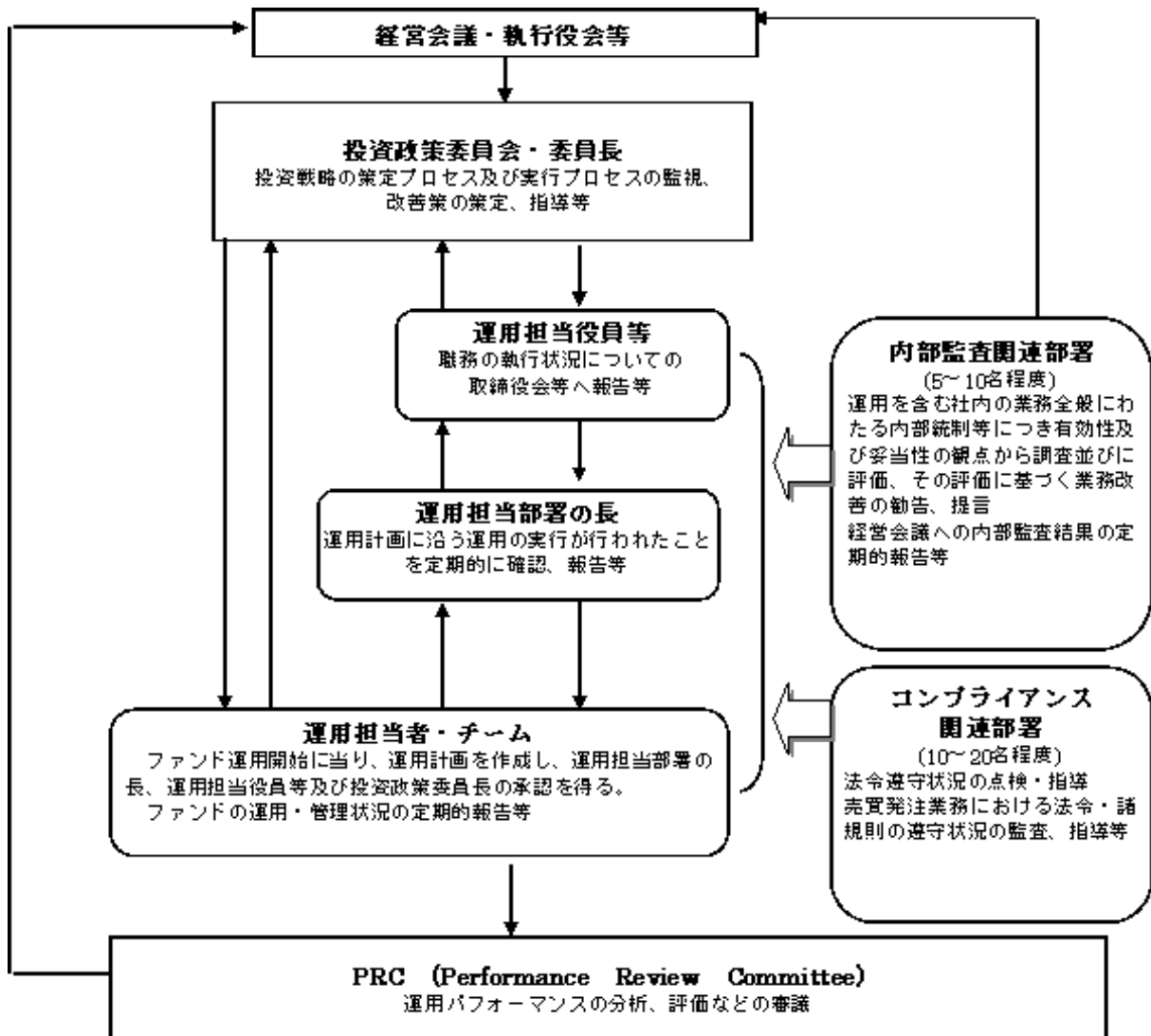
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

当社では、ファンドの運用に関する社内規程として、投資信託業務に係るファンドマネージャー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、SAS70(受託業務にかかわる内部統制について評価する監査人の業務に関する基準)に基づく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。

ファンドの運用体制等は有価証券届出書提出日現在のものであり、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(評価益を含みません。)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および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)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3月31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。

同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定します。

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第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取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等(株式、株価指数に係る先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

( )委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額と各マザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する各マザーファンドの時価総額に各マザーファンドの信託財産純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

( )委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に

掲げる金融商品で運用している額(以下本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、信託財産の外貨建て資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建て資産の時価総額を差引いた額、以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建て組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建て組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建て資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建て組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第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および為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(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。

外貨建て資産への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外貨建て資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以内とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債等への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）をいいます。

投資信託証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

投資する株式等の範囲(約款第19条)

- ( )委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、運用の基本方針の範囲内(新株引受権証券および新株予約権証券については、運用の基本方針に特別の規定がない場合、株式の範囲と同じものとする。)で、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ( )上記( )にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

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、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第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。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図(約款第29条)

委託者は、信託財産に属する外貨建資産と外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドおよび外国債券マザーファンドの時価総額に外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

資金の借入れ(約款第37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(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

委託者は、同一の法人の発行する株式を、次の( )の数が( )の数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

- ( )その運用の指図を行なうすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数
- ( )当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

## (参考)各マザーファンドの概要

### (国内株式マザーファンド)

#### 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

##### 1. 基本方針

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

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

###### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

### (外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド)

#### 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

##### 1. 基本方針

この投資信託は、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

###### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

20%以内とします。

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

（国内債券NOMURA-BPI総合 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総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）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

主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合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

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

（外国債券マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1．基本方針

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

### 2．運用方法

#### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

## 3 【投資リスク】

### 基準価額の変動要因

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

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

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

#### [為替変動リスク]

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

#### [債券価格変動リスク]

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

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

### その他の留意点

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

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

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

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

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

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

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

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

準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

#### 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて

##### 「MSCI」の著作権等について

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

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

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

#### 委託会社におけるリスクマネジメント体制

##### リスク管理関連の委員会

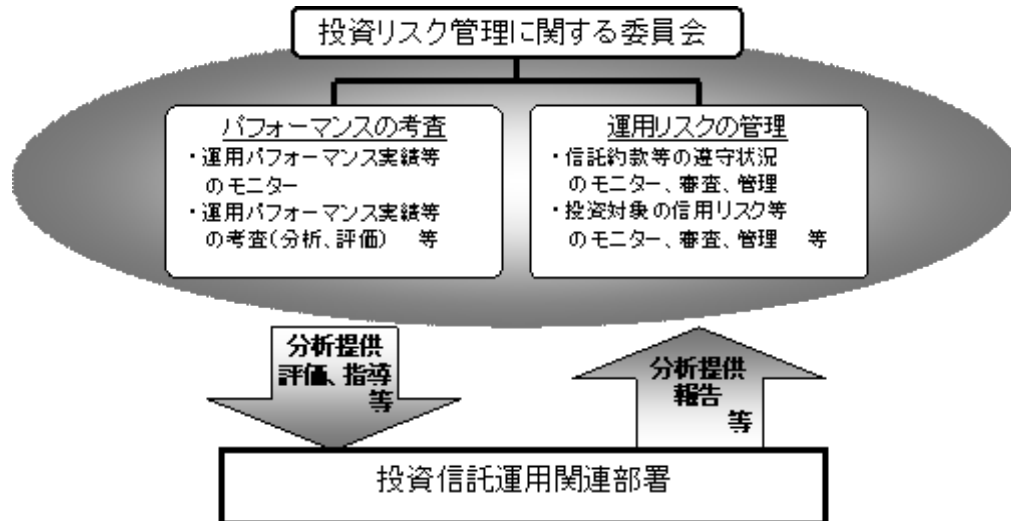
##### パフォーマンスの考査

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

## 運用リスクの管理

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

## リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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35.7(税抜年10,000分の34)以内(平成24年6月26日現在年10,000分の24.15(税抜年10,000分の23))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14	年10,000分の6	年10,000分の3

\* 上記配分は、平成24年6月26日現在の信託報酬率における配分です。

上記の信託報酬の総額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。

## (4) 【その他の手数料等】

信託財産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。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息

は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産から支払われます。

信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は信託報酬支払いのときに信託財産から支払われます。

これらの費用等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

#### (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。

[平成24年12月31日までの間]

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、7%(所得税7%)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。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

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、7.147%(所得税7.147%)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。

上記7.147%の税率は平成26年1月1日以後、15.315%(所得税15.315%)となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 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。

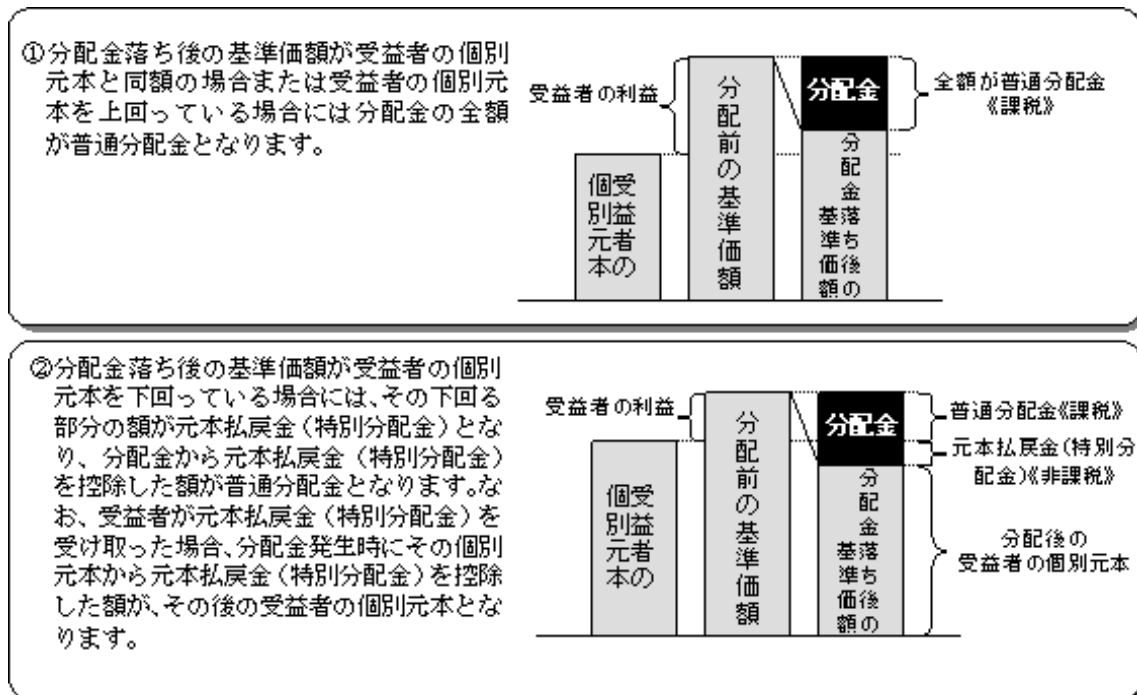
#### 換金(解約)時および償還時の課税について

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。

(ご参考)

お客様に直接ご負担いただく費用・税金

時期	項目	費用	税金
分配時	所得税および地方税		かかりません
換金時 (解約請求制)	所得税および地方税		かかりません
償還時	所得税および地方税		かかりません

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以外の場合は、所要の税金がかかります。詳しくは上述の「課税上の取扱い」をご覧ください。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容が変更になる場合があります。

## 5 【運用状況】

以下は平成24年4月27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】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	4,622,216,239	99.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,849,030	0.03
合計(純資産総額)		4,624,065,269	100.00

<ご参考>

「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	137,620,871,195	96.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,544,948,479	3.19
合計(純資産総額)		142,165,819,674	100.00

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。評価にあたっては取引所の発表する清算値段を用いております。

名称	取引所	種類	買建 /売建	通貨	枚数	簿価	評価額 (時価)	投資比率 (%)
TOPIX先物(2012年6月限)	東京証券取引所	株価指数先物	買建	円	545	4,608,894,350	4,373,625,000	3.07

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	120,455,891,924	56.60
	カナダ	11,548,548,912	5.42
	イギリス	22,001,119,485	10.33
	スイス	8,205,227,264	3.85
	スウェーデン	2,978,533,589	1.39
	ノルウェー	924,600,315	0.43
	デンマーク	1,130,860,261	0.53
	ドイツ	8,127,741,476	3.81
	イタリア	2,069,453,734	0.97
	フランス	8,141,580,973	3.82
	オランダ	2,423,660,172	1.13
	スペイン	2,475,084,605	1.16
	ベルギー	984,579,711	0.46
	オーストリア	237,222,962	0.11
	フィンランド	777,285,411	0.36
	アイルランド	271,299,129	0.12
	ギリシャ	81,575,535	0.03
	ポルトガル	184,430,854	0.08
	香港	2,729,813,516	1.28
	シンガポール	1,668,500,641	0.78
オーストラリア	7,812,207,283	3.67	
ニュージーランド	120,973,260	0.05	
イスラエル	634,030,690	0.29	
小計		205,984,221,702	96.79
投資信託受益証券	アメリカ	37,022,640	0.01
投資証券	アメリカ	2,976,702,977	1.39
	カナダ	48,439,686	0.02
	イギリス	248,839,549	0.11
	フランス	259,181,650	0.12
	オランダ	23,661,701	0.01
	香港	83,249,309	0.03
	シンガポール	57,707,389	0.02
	オーストラリア	608,568,105	0.28
小計		4,306,350,366	2.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,471,344,577	1.16
合計(純資産総額)		212,798,939,285	100.00

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場で評価しております。

名称	取引所	種類	買建 /売建	通貨	枚数	簿価 (現地通貨)	評価額(時価 ・現地通貨)	評価額 (時価・円)	投資 比率 (%)
E-mini S&P500株価指数先物(2012年6月限)	シカゴ・マーカンタ イル取引所	株価指 数先物	買建	米ドル	247	17,328,575	17,249,862.5	1,400,516,336	0.65

S&P TSX60株価指数先物(2012年6月限)	モンテリオール取引所	株価指数先物	買建	カナダドル	12	1,689,100	1,652,160	136,104,940	0.06
ユーロ50株価指数先物(2012年6月限)	EUREX	株価指数先物	買建	ユーロ	121	2,913,990	2,738,230	293,647,785	0.13
FT100株価指数先物(2012年6月限)	ロンドン国際金融先物取引所	株価指数先物	買建	英ポンド	33	1,890,735	1,883,970	247,572,497	0.11
SMI 株価指数先物(2012年6月限)	EUREX	株価指数先物	買建	スイスフラン	17	1,041,250	1,035,130	92,375,001	0.04

## 「国内債券NOMURA-BPI総合 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	173,087,150,870	73.93
地方債証券	日本	16,892,280,211	7.21
特殊債証券	日本	21,359,466,768	9.12
社債証券	日本	16,529,986,000	7.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,233,677,738	2.66
合計(純資産総額)		234,102,561,587	100.00

## 「外国債券マザーファンド」

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	116,350,532,285	40.67
	カナダ	8,231,840,132	2.87
	イギリス	22,834,180,048	7.98
	スイス	956,957,108	0.33
	スウェーデン	1,692,667,115	0.59
	ノルウェー	927,265,142	0.32
	デンマーク	2,472,368,843	0.86
	ドイツ	25,854,775,439	9.03
	イタリア	26,014,633,623	9.09
	フランス	27,509,320,882	9.61
	オランダ	7,429,439,421	2.59
	スペイン	12,524,533,752	4.37
	ベルギー	7,390,590,734	2.58
	オーストリア	4,933,479,060	1.72
	フィンランド	1,761,822,902	0.61
	アイルランド	2,105,915,416	0.73
	ポーランド	2,189,064,492	0.76
	シンガポール	1,124,345,196	0.39
	マレーシア	1,528,355,579	0.53
	オーストラリア	4,339,021,340	1.51
メキシコ	2,585,768,879	0.90	
小計		280,756,877,388	98.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,290,649,977	1.84
合計(純資産総額)		286,047,527,365	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

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	投資信託受益証券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	1,625,486,358	1.1591	1,884,101,238	1.1668	1,896,617,482	41.01
2	日本	投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	1,940,031,514	0.7354	1,426,839,183	0.6913	1,341,143,785	29.00
3	日本	投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	891,796,225	1.0652	949,941,338	1.0281	916,855,698	19.82
4	日本	投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	310,903,773	1.5404	478,916,172	1.5040	467,599,274	10.11

## &lt;ご参考&gt;

## 「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	1,625,700	3,198.18	5,199,281,226	3,305.00	5,372,938,500	3.77
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,367,300	394.11	3,691,746,603	387.00	3,625,145,100	2.54
3	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,057,700	3,015.02	3,188,986,654	2,896.00	3,063,099,200	2.15
4	日本	株式	キヤノン	電気機器	778,800	3,760.29	2,928,513,852	3,670.00	2,858,196,000	2.01
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	939,500	2,560.16	2,405,270,320	2,584.00	2,427,668,000	1.70
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	569,800	3,835.13	2,185,257,074	3,625.00	2,065,525,000	1.45
7	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	15,914,800	131.98	2,100,544,053	127.00	2,021,179,600	1.42
8	日本	株式	ファナック	電気機器	130,500	13,052.59	1,703,362,995	13,590.00	1,773,495,000	1.24
9	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	491,900	3,870.12	1,903,712,028	3,485.00	1,714,271,500	1.20
10	日本	株式	三菱商事	卸売業	901,200	2,124.52	1,914,617,424	1,743.00	1,570,791,600	1.10
11	日本	株式	日立製作所	電気機器	2,889,000	450.84	1,302,485,880	512.00	1,479,168,000	1.04
12	日本	株式	小松製作所	機械	612,400	2,762.04	1,691,473,296	2,315.00	1,417,706,000	0.99
13	日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	10,195	147,609.27	1,504,876,507	136,200.00	1,388,559,000	0.97
14	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	3,114	335,382.26	1,044,380,357	443,500.00	1,381,059,000	0.97
15	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	560,600	3,084.33	1,729,075,398	2,396.00	1,343,197,600	0.94
16	日本	株式	三井物産	卸売業	1,068,100	1,397.02	1,492,157,062	1,254.00	1,339,397,400	0.94
17	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,595,100	763.41	1,217,715,291	836.00	1,333,503,600	0.93
18	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	517,600	2,023.35	1,047,285,960	2,423.00	1,254,144,800	0.88
19	日本	株式	三菱地所	不動産業	866,000	1,440.50	1,247,473,000	1,424.00	1,233,184,000	0.86
20	日本	株式	信越化学工業	化学	235,500	4,285.70	1,009,282,350	4,640.00	1,092,720,000	0.76
21	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	218,000	4,636.58	1,010,774,440	4,980.00	1,085,640,000	0.76
22	日本	株式	ソニー	電気機器	782,200	2,205.67	1,725,275,074	1,316.00	1,029,375,200	0.72
23	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,920	553,968.86	1,063,620,211	525,000.00	1,008,000,000	0.70
24	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	469,800	2,228.53	1,046,963,394	2,059.00	967,318,200	0.68
25	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	291,500	3,100.37	903,757,855	3,245.00	945,917,500	0.66
26	日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	1,708	567,495.90	969,282,997	530,000.00	905,240,000	0.63
27	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	987,200	853.01	842,091,472	906.00	894,403,200	0.62
28	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,432,400	981.03	1,405,227,372	622.00	890,952,800	0.62
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,254,000	873.90	1,095,870,600	707.00	886,578,000	0.62
30	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,678,500	399.22	1,069,310,770	330.00	883,905,000	0.62

## 「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺 機器	107,680	48,670.96	5,240,889,974	49,339.16	5,312,841,071	2.49
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃 料	555,300	7,041.60	3,910,205,311	6,988.02	3,880,449,338	1.82
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	876,700	2,618.37	2,295,531,554	2,607.01	2,285,566,456	1.07
4	アメリカ	株式	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	情報技術サービス	136,480	16,940.29	2,312,011,256	16,691.04	2,277,993,166	1.07
5	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃 料	230,600	8,706.81	2,007,791,677	8,624.00	1,988,694,815	0.93
6	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コングロマリット	1,222,400	1,629.48	1,991,880,385	1,592.94	1,947,219,390	0.91
7	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	382,070	5,068.83	1,936,648,642	4,961.74	1,895,733,530	0.89
8	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービ ス	686,000	2,535.56	1,739,396,698	2,633.80	1,806,789,269	0.84
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	318,500	5,456.77	1,737,984,398	5,429.17	1,729,192,333	0.81
10	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	889,800	1,839.76	1,637,023,252	1,872.24	1,665,920,397	0.78
11	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	316,100	5,355.29	1,692,807,927	5,257.05	1,661,754,295	0.78
12	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	商業銀行	579,900	2,771.82	1,607,382,245	2,747.46	1,593,257,621	0.74
13	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融サービス	439,900	3,733.11	1,642,197,816	3,556.12	1,564,338,067	0.73
14	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	商業銀行	2,068,100	729.06	1,507,774,528	726.17	1,501,795,610	0.70
15	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	インターネットソフ トウェア	29,630	52,062.27	1,542,605,226	49,970.00	1,480,611,375	0.69
16	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	236,600	6,008.87	1,421,699,091	6,146.89	1,454,355,333	0.68
17	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	201,000	7,194.24	1,446,043,425	7,189.37	1,445,064,274	0.67
18	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造 装置	589,300	2,282.25	1,344,930,455	2,291.18	1,350,193,434	0.63
19	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	無線通信サービス	5,817,800	226.28	1,316,498,442	226.15	1,315,733,925	0.61
20	イギリス	株式	BP PLC	石油・ガス・消耗燃 料	2,194,500	607.83	1,333,898,197	583.78	1,281,124,795	0.60
21	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	石油・ガス・消耗燃 料	421,300	2,869.33	1,208,851,825	2,885.10	1,215,495,389	0.57
22	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	270,030	4,458.43	1,203,909,960	4,466.46	1,206,078,733	0.56
23	スイス	株式	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	医薬品	81,280	14,019.60	1,139,513,413	14,769.21	1,200,442,201	0.56
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	352,600	3,117.69	1,099,299,609	3,123.37	1,101,303,541	0.51
25	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア	466,900	2,367.50	1,105,385,936	2,356.13	1,100,078,871	0.51
26	オーストラ リア	株式	BHP BILLITON LIMITED	金属・鉱業	371,500	2,917.62	1,083,896,944	2,958.93	1,099,242,495	0.51
27	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品	583,900	1,835.14	1,071,538,625	1,866.02	1,089,570,245	0.51
28	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービ ス	327,500	3,103.89	1,016,525,186	3,258.96	1,067,311,561	0.50
29	アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小 売り	219,300	4,968.82	1,089,663,980	4,786.15	1,049,602,804	0.49
30	アメリカ	株式	QUALCOMM INC	通信機器	194,500	5,522.54	1,074,134,769	5,188.85	1,009,231,889	0.47

## 「国内債券NOMURA-BPI総合 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102回	3,400,000,000	99.90	3,396,838,000	100.29	3,410,132,000	0.3	2016/12/20	1.45
2	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第305回	2,600,000,000	104.35	2,713,100,000	105.38	2,739,880,000	1.3	2019/12/20	1.17
3	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第90回	2,700,000,000	100.38	2,710,314,000	100.51	2,713,878,000	0.3	2015/6/20	1.15
4	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第312回	2,450,000,000	102.83	2,519,531,000	103.94	2,546,628,000	1.2	2020/12/20	1.08
5	日本	国債証券	国庫債券 利付(2年)第312回	2,500,000,000	99.98	2,499,550,000	99.99	2,499,775,000	0.1	2014/1/15	1.06
6	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第311回	2,450,000,000	99.80	2,445,149,000	100.91	2,472,344,000	0.8	2020/9/20	1.05
7	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第295回	2,000,000,000	106.08	2,121,700,000	106.71	2,134,260,000	1.5	2018/6/20	0.91
8	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第306回	2,000,000,000	104.95	2,099,180,000	106.02	2,120,420,000	1.4	2020/3/20	0.90
9	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第309回	2,000,000,000	102.46	2,049,360,000	103.51	2,070,320,000	1.1	2020/6/20	0.88
10	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第284回	1,900,000,000	106.42	2,022,113,000	106.74	2,028,098,000	1.7	2016/12/20	0.86
11	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第89回	2,000,000,000	100.70	2,014,020,000	100.82	2,016,540,000	0.4	2015/6/20	0.86
12	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第101回	2,000,000,000	100.37	2,007,420,000	100.75	2,015,120,000	0.4	2016/12/20	0.86
13	日本	国債証券	国庫債券 利付(2年)第313回	2,000,000,000	99.98	1,999,620,000	99.99	1,999,820,000	0.1	2014/2/15	0.85
14	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第313回	1,900,000,000	103.48	1,966,234,000	104.62	1,987,837,000	1.3	2021/3/20	0.84
15	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第81回	1,900,000,000	101.34	1,925,574,000	101.30	1,924,795,000	0.8	2014/3/20	0.82
16	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第320回	1,900,000,000	100.13	1,902,508,000	101.29	1,924,510,000	1	2021/12/20	0.82
17	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第88回	1,900,000,000	100.98	1,918,715,000	101.07	1,920,444,000	0.5	2015/3/20	0.82
18	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第299回	1,800,000,000	104.67	1,884,132,000	105.49	1,898,964,000	1.3	2019/3/20	0.81
19	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第86回	1,800,000,000	101.12	1,820,286,000	101.15	1,820,772,000	0.6	2014/9/20	0.77
20	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第319回	1,750,000,000	101.06	1,768,574,000	102.22	1,788,955,000	1.1	2021/12/20	0.76
21	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第96回	1,700,000,000	100.97	1,716,643,000	101.23	1,720,961,000	0.5	2016/3/20	0.73
22	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第97回	1,700,000,000	100.52	1,708,840,000	100.84	1,714,280,000	0.4	2016/6/20	0.73
23	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第287回	1,550,000,000	107.92	1,672,884,000	108.28	1,678,355,500	1.9	2017/6/20	0.71
24	日本	国債証券	国庫債券 利付(20年)第33回	1,410,000,000	115.48	1,628,282,100	115.62	1,630,354,800	3.8	2016/9/20	0.69
25	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第99回	1,600,000,000	100.44	1,607,040,000	100.80	1,612,848,000	0.4	2016/9/20	0.68
26	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第282回	1,500,000,000	106.16	1,592,415,000	106.45	1,596,780,000	1.7	2016/9/20	0.68
27	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第82回	1,500,000,000	101.54	1,523,130,000	101.49	1,522,395,000	0.9	2014/3/20	0.65
28	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第321回	1,500,000,000	100.27	1,504,175,000	101.04	1,515,675,000	1	2022/3/20	0.64
29	日本	国債証券	国庫債券 利付(2年)第311回	1,500,000,000	100.16	1,502,400,000	100.15	1,502,295,000	0.2	2013/12/15	0.64
30	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第283回	1,400,000,000	106.60	1,492,428,000	106.91	1,496,740,000	1.8	2016/9/20	0.63

## 「外国債券マザーファンド」

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	イギリス	国債証券	UK TREASURY	14,800,000	13,891.35	2,055,919,962	16,162.11	2,391,993,153	4.5	2042/12/7	0.83
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	22,000,000	8,701.50	1,914,330,170	9,018.75	1,984,125,003	3.125	2021/5/15	0.69
3	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	17,700,000	11,011.40	1,949,018,366	10,924.53	1,933,643,367	4.25	2013/8/1	0.67
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,500,000	8,497.58	1,742,004,365	9,373.00	1,921,465,967	3.625	2021/2/15	0.67
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,000,000	8,550.11	1,710,023,780	9,377.44	1,875,489,000	3.625	2020/2/15	0.65
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	21,500,000	8,840.19	1,900,641,998	8,621.67	1,853,661,149	4.25	2013/11/15	0.64
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,000,000	8,438.07	1,603,234,573	9,304.50	1,767,855,124	3.5	2020/5/15	0.61
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,000,000	8,458.98	1,691,796,625	8,520.50	1,704,101,943	2.375	2014/9/30	0.59
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,000,000	8,206.85	1,641,370,003	8,202.09	1,640,418,456	1.125	2013/6/15	0.57
10	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,500,000	11,216.23	1,514,191,266	11,951.36	1,613,433,843	3.5	2016/1/4	0.56
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,500,000	8,308.97	1,620,249,463	8,241.10	1,607,014,819	1.75	2013/4/15	0.56
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,550,000	8,788.81	1,630,325,646	8,543.66	1,584,849,124	4.25	2013/8/15	0.55
13	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	14,500,000	10,681.10	1,548,760,080	10,532.04	1,527,145,858	3.75	2016/8/1	0.53
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	14,000,000	10,761.53	1,506,614,760	10,707.91	1,499,107,960	3.75	2015/8/1	0.52
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,000,000	8,581.75	1,458,898,666	8,433.92	1,433,767,741	3.125	2013/8/31	0.50
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	17,000,000	8,622.63	1,465,847,323	8,410.14	1,429,724,081	3.625	2013/5/15	0.49
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,000,000	8,215.61	1,150,186,254	10,128.45	1,417,983,350	4.375	2039/11/15	0.49
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,000,000	8,210.33	1,149,447,425	10,128.45	1,417,983,350	4.375	2040/5/15	0.49
19	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,000,000	11,415.69	1,369,883,760	11,683.26	1,401,991,416	4.25	2014/7/4	0.49
20	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A. T	11,400,000	11,823.41	1,347,869,532	12,121.33	1,381,832,440	4.5	2041/4/25	0.48
21	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,300,000	14,699.38	1,514,036,840	13,363.17	1,376,407,169	9	2023/11/1	0.48
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	12,000,000	11,161.18	1,339,342,716	11,299.36	1,355,923,695	8.75	2017/5/15	0.47
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A. T	12,000,000	11,237.00	1,348,441,122	11,280.57	1,353,669,072	4	2013/10/25	0.47
24	イギリス	国債証券	UK TREASURY	8,500,000	13,259.26	1,127,037,865	15,401.25	1,309,106,420	4.25	2036/3/7	0.45
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,000,000	7,524.66	1,053,452,850	9,336.85	1,307,159,000	3.875	2040/8/15	0.45
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	14,700,000	8,967.05	1,318,157,043	8,847.17	1,300,534,403	4.25	2014/8/15	0.45
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A. T	10,500,000	11,943.16	1,254,031,851	12,309.00	1,292,445,756	5	2016/10/25	0.45
28	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,500,000	11,174.67	1,285,087,483	11,191.56	1,287,030,136	3.75	2013/7/4	0.44
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,000,000	8,470.71	1,270,607,633	8,452.32	1,267,848,344	2.25	2014/5/31	0.44
30	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,000,000	11,369.04	1,250,595,346	11,474.68	1,262,214,800	4.25	2014/1/4	0.44

## 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
投資信託受益証券		99.96
合計		99.96

&lt;ご参考&gt;

「国内株式マザーファンド」

種類	業種	投資比率(%)
株式	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.71
	建設業	2.28
	食料品	3.62
	繊維製品	0.91
	パルプ・紙	0.35
	化学	5.76
	医薬品	4.62
	石油・石炭製品	0.77
	ゴム製品	0.77
	ガラス・土石製品	1.05
	鉄鋼	1.71
	非鉄金属	1.14
	金属製品	0.67
	機械	5.00
	電気機器	13.13
	輸送用機器	10.36
	精密機器	1.41
	その他製品	1.48
	電気・ガス業	2.84
	陸運業	3.77
	海運業	0.39
	空運業	0.27
	倉庫・運輸関連業	0.22
	情報・通信業	6.06
	卸売業	5.41
	小売業	4.18
	銀行業	9.20
	証券、商品先物取引業	1.11
	保険業	2.22
	その他金融業	0.80
不動産業	2.44	
サービス業	1.88	
	小計	96.80
合計		96.80

## 「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー設備・サービス	1.58
	石油・ガス・消耗燃料	10.19
	化学	2.88
	建設資材	0.29
	容器・包装	0.17
	金属・鉱業	3.53
	紙製品・林産品	0.17
	航空宇宙・防衛	1.78
	建設関連製品	0.17
	建設・土木	0.37
	電気設備	0.75
	コングロマリット	2.13
	機械	1.88
	商社・流通業	0.24
	商業・専門サービス	0.42
	航空貨物・物流サービス	0.55
	旅客航空輸送業	0.08
	海運業	0.09
	陸運・鉄道	0.86
	運送インフラ	0.15
	自動車部品	0.38
	自動車	0.94
	家庭用耐久財	0.17
	レジャー用品	0.06
	繊維・アパレル・贅沢品	1.05
	ホテル・レストラン・レジャー	1.72
	メディア	2.56
	販売	0.11
	インターネット販売カタログ販売	0.56
	複合小売り	0.65
	専門小売り	1.53
	食品・生活必需品小売り	2.20
	飲料	2.36
	食品	2.86
	タバコ	1.77
	家庭用品	1.51
	パーソナル用品	0.30
	ヘルスケア機器・用品	1.26
	ヘルスケアプロバイダ・サービス	1.35
	バイオテクノロジー	0.93
	医薬品	6.52
	商業銀行	7.16
	各種金融サービス	2.22
	保険	3.98
	不動産管理・開発	0.62
	インターネットソフトウェア	1.06
	情報技術サービス	2.39
	ソフトウェア	2.59
	通信機器	1.40
	コンピュータ・周辺機器	3.29
	電子装置・機器・部品	0.32
	事務用電子機器	0.05
	半導体・半導体製造装置	1.66
	各種電気通信サービス	2.98
	無線通信サービス	0.88
	電力	1.83
	ガス	0.17
	総合公益事業	1.35
	水道	0.08
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.05
	消費者金融	0.51
資本市場	1.83	
各種消費者サービス	0.03	
独立系発電事業・エネルギー販売	0.15	
ヘルスケア・テクノロジー	0.04	
ライフサイエンスツールサービス	0.28	

	専門サービス	0.40
	小計	96.79
投資信託受益証券		0.01
投資証券		2.02
合計		98.83

## 「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		73.93
地方債証券		7.21
特殊債券		9.12
社債券		7.06
合計		97.33

## 「外国債券マザーファンド」

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		98.15
合計		98.15

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## &lt;ご参考&gt;

## 「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。評価にあたっては取引所の発表する清算値段を用いております。

名称	取引所	種類	買建 / 売建	通貨	枚数	簿価	評価額 (時価)	投資比率 (%)
TOPIX先物(2012年6月限)	東京証券取引所	株価指数先物	買建	円	545	4,608,894,350	4,373,625,000	3.07

## 「外国株式MSCI-KOKUSA1 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。

名称	取引所	種類	買建 / 売建	通貨	枚数	簿価 (現地通貨)	評価額(時価 ・ 現地通貨)	評価額 (時価・円)	投資 比率 (%)
E-mini S&P500株価指数先物(2012年6月限)	シカゴ・マーカン タイル取引所	株価指数 先物	買建	米ドル	247	17,328,575	17,249,862.5	1,400,516,336	0.65
S&P TSX60株価指数先物(2012年6月限)	モントリオール取引 所	株価指数 先物	買建	カナダ ドル	12	1,689,100	1,652,160	136,104,940	0.06
ユーロ50株価指数先物(2012年6月限)	EUREX	株価指数 先物	買建	ユーロ	121	2,913,990	2,738,230	293,647,785	0.13
FT100株価指数先物(2012年6月限)	ロンドン国際金融先 物取引所	株価指数 先物	買建	英ポ ンド	33	1,890,735	1,883,970	247,572,497	0.11
SMI 株価指数先物(2012年6月限)	EUREX	株価指数 先物	買建	スイ ス フラン	17	1,041,250	1,035,130	92,375,001	0.04

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

平成24年4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。

計算期間	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1期 (2008年3月31日)	2	2	0.8874	0.8874
第2期 (2009年3月31日)	872	872	0.7019	0.7019
第3期 (2010年3月31日)	2,095	2,095	0.8296	0.8296
第4期 (2011年3月31日)	3,241	3,241	0.8149	0.8149
第5期 (2012年4月2日)	4,755	4,755	0.8354	0.8354
2011年4月末日	3,275		0.8167	
5月末日	3,296		0.8066	
6月末日	3,729		0.8070	
7月末日	3,766		0.7966	
8月末日	3,788		0.7644	
9月末日	3,831		0.7532	
10月末日	4,033		0.7755	
11月末日	3,966		0.7488	
12月末日	4,093		0.7566	
2012年1月末日	4,204		0.7706	
2月末日	4,552		0.8187	
3月末日	4,733		0.8315	
4月末日	4,624		0.8146	

## 【分配の推移】

期	1口当たりの分配金
第1期	0.0000 円
第2期	0.0000 円
第3期	0.0000 円
第4期	0.0000 円
第5期	0.0000 円

## 【収益率の推移】

期	収益率
第1期	11.3 %
第2期	20.9 %
第3期	18.2 %
第4期	1.8 %
第5期	2.5 %

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。

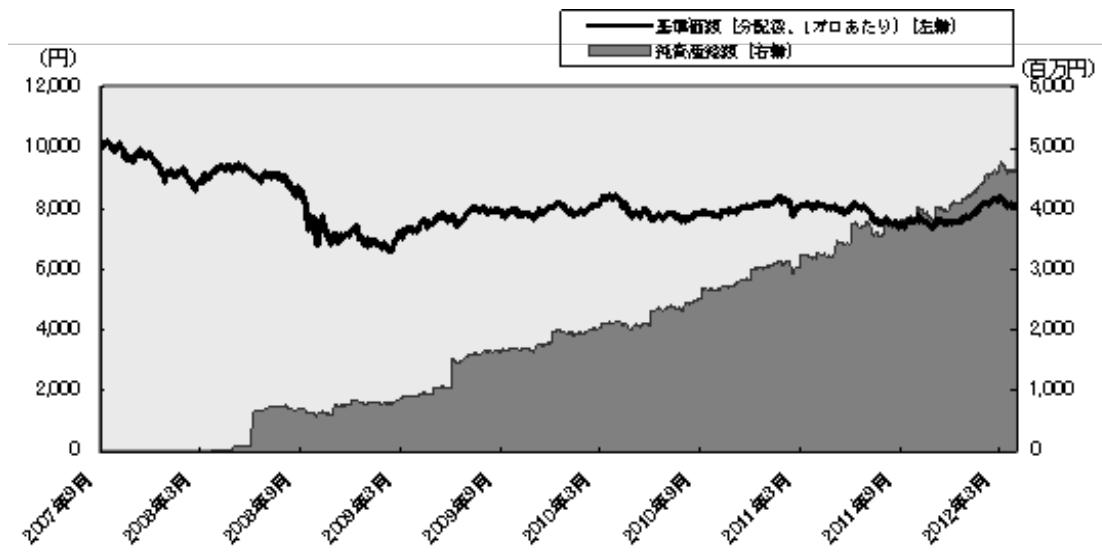
## (4)【設定及び解約の実績】

期	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1期	2,350,162		2,350,162
第2期	1,307,259,088	66,922,087	1,242,687,163
第3期	1,397,185,710	113,891,145	2,525,981,728
第4期	1,649,177,092	197,029,082	3,978,129,738
第5期	2,065,250,862	350,574,826	5,692,805,774

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

## &lt; 参考情報 &gt; 運用実績（2012年4月27日現在）

[ 基準価額・純資産の推移 ]（日次：設定来）



[ 分配の推移 ]（1万口あたり、課税前）

2012年4月	0 円
2011年3月	0 円
2010年3月	0 円
2009年3月	0 円
2008年3月	0 円
設定来累計	0 円

## [ 主要な資産の状況 ]

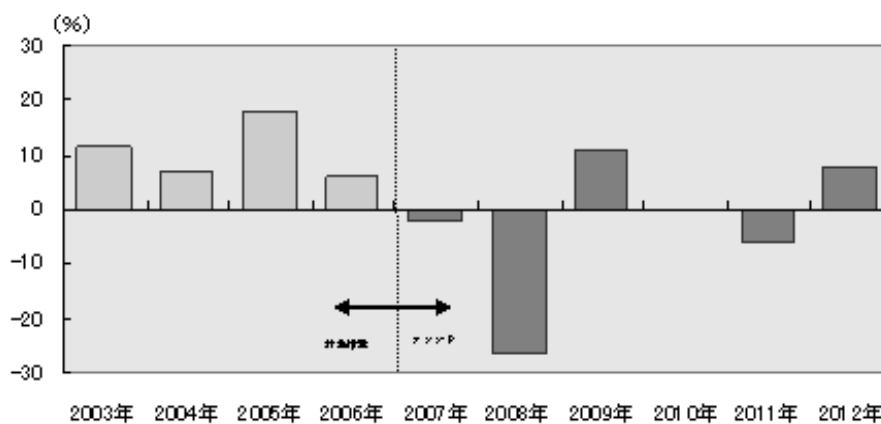
銘柄別投資比率		
順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	41.0
2	国内株式マザーファンド	29.0
3	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	19.8
4	外国債券マザーファンド	10.1

実質的な銘柄別投資比率(上位)							
・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄				・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄			
順位	銘柄	業種	投資比率(%)	順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1.1	1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.5
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.7	2	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.4
3	本田技研工業	輸送用機器	0.6	3	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.2
4	キヤノン	電気機器	0.6	4	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	情報技術サービス	0.2
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.5	5	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.2

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄				・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄			
順位	銘柄	種類	投資比率(%)	順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付(5年)第102回	国債証券	0.6	1	UK TREASURY	国債証券	0.1
2	国庫債券 利付(10年)第305回	国債証券	0.5	2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
3	国庫債券 利付(5年)第90回	国債証券	0.5	3	BUONIPOLIENNAI DEL TES	国債証券	0.1
4	国庫債券 利付(10年)第312回	国債証券	0.4	4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
5	国庫債券 利付(2年)第312回	国債証券	0.4	5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1

## [ 年間収益率の推移 ] (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2003年から2006年は対象指数（合成指数）の年間収益率。（出所：MSCI他）
- ・2007年は設定日（2007年9月27日）から年末までのファンドの収益率。
- ・2012年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

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。  
 対象指数（合成指数）の情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
 ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれます。

取得申込の受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込み分とします。

ファンドの申込(販売)手続についてご不明な点がある場合には下記の照会先までお問い合わせ下さい。

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

販売の単位は、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

<申込手数料>

なし

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとし、振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。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口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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付けについては、午後3時までに、一部解約の実行の請求が行なわれかつ当該請求の受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。

換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

換金時の税金につきましては「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口解約には制限を設ける場合があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

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

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受付けた一部解約の実行の請求の受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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、当該証券の一部解約の価額は、当該受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付けたものとします。

換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。



### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### <基準価額の計算方法>

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を法令および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<sup>\*</sup>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
株式	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> の金融商品取引所の終値で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup> 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値) 第一種金融商品取引業者、銀行等の提示する価額 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。

1 外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日とします。

2 残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)による評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

無期限とします(平成19年9月27日設定)。

## (4) 【計算期間】

原則として、毎年4月1日から翌年3月31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、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

## (b) 信託期間の終了

- ( )委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」にしたがい信託を終了させる場合は、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ( )上記( )の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ( )上記( )の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。
- ( )委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ( )上記( )から( )までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記( )の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
- ( )委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ( )委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更( )」に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。
- ( )受託者が委託者の承諾を受けてその任務を辞任する場合、または、委託者または受益者が裁判所に受託者の解任を請求し裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解

約し、信託を終了させます。

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更

- ( )委託者は、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- ( )委託者は、上記( )の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ( )上記( )の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ( )上記( )の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記( )の信託約款の変更をしません。
- ( )委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ( )委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記( )から( )までの規定にしたがいます。

(e) 公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nomura-am.co.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(f) 反対者の買取請求権

ファンドの信託契約の解約または信託約款の変更を行なう場合において、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

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て)に、原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

換金(解約)の単位

受益者は、受益権を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】

#### マイバランスDC50

- (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5期計算期間(平成23年4月1日から平成24年4月2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】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成23年 3月31日現在	第5期 平成24年 4月 2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,544,651	8,127,094
親投資信託受益証券	3,240,444,364	4,753,803,384
未収入金	346,754	786,369
未収利息	14	20
流動資産合計	3,246,335,783	4,762,716,867
資産合計	3,246,335,783	4,762,716,867
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,077,048	1,888,075
未払受託者報酬	455,383	659,389
未払委託者報酬	3,035,807	4,395,865
その他未払費用	45,476	65,876
流動負債合計	4,613,714	7,009,205
負債合計	4,613,714	7,009,205
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,978,129,738	5,692,805,774
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	736,407,669	937,098,112
（分配準備積立金）	85,176,466	211,818,145
元本等合計	3,241,722,069	4,755,707,662
純資産合計	3,241,722,069	4,755,707,662
負債純資産合計	3,246,335,783	4,762,716,867

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自平成22年 4月 1日 至平成23年 3月31日	第5期 自平成23年 4月 1日 至平成24年 4月 2日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2,952	3,792
有価証券売買等損益	3,574,915	175,374,281
その他収益	-	60,278
<b>営業収益合計</b>	<b>3,577,867</b>	<b>175,438,351</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	809,735	1,210,694
委託者報酬	5,398,130	8,071,198
その他費用	80,844	120,949
<b>営業費用合計</b>	<b>6,288,709</b>	<b>9,402,841</b>
<b>営業利益</b>	<b>2,710,842</b>	<b>166,035,510</b>
経常利益	2,710,842	166,035,510
<b>当期純利益</b>	<b>2,710,842</b>	<b>166,035,510</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	3,523,079	6,970,704
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	430,430,327	736,407,669
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,637,529	66,836,286
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,637,529	66,836,286
剰余金減少額又は欠損金増加額	342,427,108	440,532,943
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	342,427,108	440,532,943
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	736,407,669	937,098,112

## (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	(1) 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	(1) 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期末が休日のため、平成23年4月1日から平成24年4月2日までとなっております。

## (追加情報)

第5期 自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

第4期 平成23年3月31日現在	第5期 平成24年4月2日現在
1 計算期間の末日における受益権の総数 3,978,129,738 口	1 計算期間の末日における受益権の総数 5,692,805,774 口
2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 736,407,669 円	2 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 937,098,112 円
3 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 0.8149 円 (10,000口当たり純資産額 8,149 円)	3 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 0.8354 円 (10,000口当たり純資産額 8,354 円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 平成22年4月 1 日 至 平成23年3月31日	第5期 自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日
1 分配金の計算過程 該当事項はございません。	1 分配金の計算過程 該当事項はございません。

## (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4期 自 平成22年4月 1 日 至 平成23年3月31日	第5期 自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2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。	1 金融商品に対する取組方針 同左
2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 同左
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。	3 金融商品に係るリスク管理体制 同左

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 平成23年3月31日現在	第5期 平成24年4月2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。	1 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。 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。	2 時価の算定方法 同左

## (関連当事者との取引に関する注記)

第4期 自 平成22年4月 1 日 至 平成23年3月31日	第5期 自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2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4期 自 平成22年4月 1 日 至 平成23年3月31日	第5期 自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日
期首元本額 2,525,981,728 円	期首元本額 3,978,129,738 円
期中追加設定元本額 1,649,177,092 円	期中追加設定元本額 2,065,250,862 円
期中一部解約元本額 197,029,082 円	期中一部解約元本額 350,574,826 円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

	第4期 自 平成22年4月 1 日 至 平成23年3月31日	第5期 自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日
種類	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,109,125	184,778,361
合計	5,109,125	184,778,361

## 3 デリバティブ取引関係

第4期(平成23年3月31日現在)

該当事項はございません。

第5期(平成24年4月2日現在)

該当事項はございません。

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成24年4月2日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券 (平成24年4月2日現在)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド		1,418,336,441	
	外国債券マザーファンド		479,100,790	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド		949,941,338	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド		1,906,424,815	
親投資信託受益証券計	銘柄数：4		4,753,803,384	
	組入時価比率：100.0%		100.0%	
合計			4,753,803,384	

(注) 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

該当事項はございません。

[次へ](#)

## 参考

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

尚、同親投資信託の状況は次の通りです。

## 1 「国内株式マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## (1) 貸借対照表

科目	対象年月日	平成24年4月2日現在 金額(円)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン		9,795,710,581
株式		146,502,278,629
派生商品評価勘定		79,785,100
未収入金		825,207,907
未収配当金		1,628,310,991
未収利息		7,490
その他未収収益		2,323,206
差入委託証拠金		19,900,000
流動資産合計		158,853,523,904
<b>資産合計</b>		
158,853,523,904		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定		11,385,460
未払金		36,465,762
未払解約金		408,539,241
未払利息		351,415
有価証券貸借取引受入金		6,843,123,289
流動負債合計		7,299,865,167
<b>負債合計</b>		
7,299,865,167		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本		205,997,734,799
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		54,444,076,062
元本等合計		151,553,658,737
<b>純資産合計</b>		
151,553,658,737		
<b>負債純資産合計</b>		
158,853,523,904		

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (追加情報)

自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

平成24年4月2日現在	
1 元本の欠損の額	54,444,076,062 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 (10,000口当たり純資産額)	0.7357 円 7,357 円)
3 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	6,525,728,382 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23年4月1日 至 平成24年4月2日	
1	<p>金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2	<p>金融商品の内容及び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、(3)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。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p>
3	<p>金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成24年4月2日現在	
1	<p>貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2	<p>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、(3)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。</p>

## (その他の注記)

平成24年4月2日現在	
1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成23年4月1日
期首元本額	196,789,007,890 円
期首より平成24年4月2日までの期中追加設定元本額	50,327,432,404 円
期首より平成24年4月2日までの期中一部解約元本額	41,118,705,495 円
期末元本額	205,997,734,799 円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	360,027,308 円
バランスセレクト50	844,562,784 円
バランスセレクト70	708,040,289 円
国内債券・株式バランスファンド	2,070,224,827 円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,040,287,410 円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	16,782,401,701 円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	20,315,340,723 円
野村資産設計ファンド2015	487,625,284 円
野村資産設計ファンド2020	249,777,909 円
野村資産設計ファンド2025	273,518,935 円
野村資産設計ファンド2030	243,442,778 円
野村資産設計ファンド2035	187,264,695 円
野村資産設計ファンド2040	768,350,985 円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	1,338,024,617 円
のむらップ・ファンド(保守型)	963,455,022 円
のむらップ・ファンド(普通型)	1,431,615,796 円
のむらップ・ファンド(積極型)	993,953,980 円
野村資産設計ファンド2045	17,222,281 円
野村インデックスファンド・TOPIX	124,011,829 円
マイ・ロード	186,347,434 円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	11,228,392,260 円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	1,999,611,375 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)	13,866,073,151 円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,804,829,088 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)	25,457,024 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)	90,722,475 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)	48,828,930 円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	15,864,920,277 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)	1,031,806,806 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)	7,159,387,314 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)	2,217,155,752 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)	4,792,415,881 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)	1,588,140,392 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)	108,388,464 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)	769,007,679 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)	11,768,001,926 円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,773,940,906 円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,285,638,798 円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	8,292,997 円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	43,139,432 円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	45,713,654 円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	91,889,624 円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,132,708,901 円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	11,752,782,917 円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,228,653,543 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)	34,369,774,226 円
マイバランスDC30	1,586,634,227 円
マイバランスDC50	1,927,873,375 円
マイバランスDC70	1,482,072,505 円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	3,519,984,313 円

\*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

(3) 附属明細表  
第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(平成24年4月2日現在)

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	極洋	55,000	195.00	10,725,000	貸付株式数	21,000
	日本水産	161,900	277.00	44,846,300		
	マルハニチロホールディングス	278,000	144.00	40,032,000		
	サカタのタネ	20,700	1,134.00	23,473,800		
	ホクト	14,300	1,732.00	24,767,600		
	住石ホールディングス	41,300	97.00	4,006,100	貸付株式数	18,400
	日鉄鉱業	36,000	386.00	13,896,000		
	三井松島産業	92,000	174.00	16,008,000		
	国際石油開発帝石	1,708	564,000.00	963,312,000		
	日本海洋掘削	3,500	2,617.00	9,159,500	貸付株式数	1,500 (300)
	関東天然瓦斯開発	14,000	433.00	6,062,000		
	石油資源開発	20,000	3,850.00	77,000,000		
	ショーボンドホールディングス	12,500	2,074.00	25,925,000		
	ミライト・ホールディングス	39,900	608.00	24,259,200		
	ダイセキ環境ソリューション	12	188,700.00	2,264,400	貸付株式数	1
	間組	50,600	243.00	12,295,800	貸付株式数	22,200
	東急建設	49,880	207.00	10,325,160		
	コムシスホールディングス	68,200	887.00	60,493,400	貸付株式数	800
	ミサワホーム	13,600	931.00	12,661,600		
	高松コンストラクショングループ	10,600	1,270.00	13,462,000	貸付株式数	3,700
	東建コーポレーション	5,250	3,215.00	16,878,750		
	ヤマウラ	6,000	235.00	1,410,000		
	大成建設	710,000	213.00	151,230,000		
	大林組	421,000	359.00	151,139,000		
	清水建設	430,000	326.00	140,180,000		
	飛島建設	86,000	102.00	8,772,000	貸付株式数	29,600 (23,600)
	長谷工コーポレーション	878,500	69.00	60,616,500		
	松井建設	15,000	323.00	4,845,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
	鹿島建設	659,000	247.00	162,773,000		
	不動テトラ	99,200	157.00	15,574,400	貸付株式数	34,600
	大末建設	54,000	63.00	3,402,000	貸付株式数	23,000 (23,000)
	鉄建建設	79,000	132.00	10,428,000		
	安藤建設	47,000	127.00	5,969,000		
	太平工業	24,000	448.00	10,752,000	貸付株式数	11,000
	西松建設	184,000	189.00	34,776,000		
	三井住友建設	90,000	76.00	6,840,000	貸付株式数	39,800
	大豊建設	37,000	120.00	4,440,000		
	前田建設工業	87,000	362.00	31,494,000		
	佐田建設	48,000	80.00	3,840,000	貸付株式数	22,000 (20,000)
	ナカノフドー建設	10,500	181.00	1,900,500	貸付株式数	1,000
	奥村組	133,000	323.00	42,959,000		
	大和小田急建設	7,000	212.00	1,484,000		
	東鉄工業	18,000	888.00	15,984,000		

	イチケン	15,000	186.00	2,790,000	貸付株式数	3,000
	浅沼組	42,000	71.00	2,982,000		
	戸田建設	151,000	273.00	41,223,000		
	熊谷組	102,000	89.00	9,078,000		
	青木あすなろ建設	9,500	436.00	4,142,000		
	北野建設	31,000	183.00	5,673,000		
	植木組	17,000	195.00	3,315,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
	三井ホーム	18,000	441.00	7,938,000		
	矢作建設工業	17,400	422.00	7,342,800		
	ピーエス三菱	8,900	419.00	3,729,100	貸付株式数	3,900
	大東建託	53,400	7,290.00	389,286,000		
	新日本建設	16,700	220.00	3,674,000	貸付株式数	7,400
	N I P P O	33,000	913.00	30,129,000		
	東亜道路工業	26,000	251.00	6,526,000		
	前田道路	40,000	1,017.00	40,680,000		
	日本道路	42,000	349.00	14,658,000		
	東亜建設工業	123,000	157.00	19,311,000	貸付株式数	1,000
	若築建設	76,000	110.00	8,360,000	貸付株式数	24,000
	東洋建設	218,000	88.00	19,184,000	貸付株式数	28,000
	五洋建設	178,000	268.00	47,704,000	貸付株式数	77,500

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	大林道路	16,000	260.00	4,160,000		
	世紀東急工業	36,000	66.00	2,376,000	貸付株式数	4,000
	福田組	21,000	295.00	6,195,000	貸付株式数	9,000
	住友林業	96,700	737.00	71,267,900		
	日本基礎技術	15,600	323.00	5,038,800	貸付株式数	1,100
	日成ビルド工業	42,000	186.00	7,812,000	貸付株式数	18,000
	エス・バイ・エル	71,000	224.00	15,904,000	貸付株式数	32,000
	巴コーポレーション	17,500	322.00	5,635,000	貸付株式数	5,100
	パナホーム	53,000	555.00	29,415,000		
	大和ハウス工業	350,000	1,080.00	378,000,000		
	ライト工業	29,300	486.00	14,239,800	貸付株式数	12,800
	積水ハウス	395,000	799.00	315,605,000		
	日特建設	34,000	124.00	4,216,000	貸付株式数	15,000
	北陸電気工事	7,000	234.00	1,638,000		
	ユアテック	19,000	417.00	7,923,000		
	西部電気工業	12,000	358.00	4,296,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
	四電工	12,000	342.00	4,104,000		
	中電工	20,300	837.00	16,991,100		
	関電工	64,000	398.00	25,472,000		
	きんでん	93,000	627.00	58,311,000		
	東京エネシス	15,000	482.00	7,230,000		
	トーエネック	20,000	465.00	9,300,000		
	住友電設	9,700	644.00	6,246,800	貸付株式数	1,300
	日本電設工業	25,000	813.00	20,325,000		
	協和エクシオ	45,900	734.00	33,690,600		
	新日本空調	10,800	492.00	5,313,600		
	日本電話施設	23,000	259.00	5,957,000		
	九電工	26,000	482.00	12,532,000		
	三機工業	32,000	446.00	14,272,000		
	日揮	131,000	2,575.00	337,325,000		
	中外炉工業	45,000	277.00	12,465,000		
	ヤマト	13,000	316.00	4,108,000		
	太平電業	18,000	650.00	11,700,000		
	高砂熱学工業	40,100	631.00	25,303,100		
	三晃金属工業	15,000	277.00	4,155,000	貸付株式数	6,000
	朝日工業社	15,000	333.00	4,995,000		
	大気社	21,500	1,697.00	36,485,500		
	ダイダン	19,000	516.00	9,804,000	貸付株式数	2,000
	日比谷総合設備	17,200	894.00	15,376,800		
	東芝プラントシステム	23,000	947.00	21,781,000		
	東洋エンジニアリング	75,000	387.00	29,025,000		
	千代田化工建設	112,000	1,059.00	118,608,000		
	新興プランテック	28,900	700.00	20,230,000		
	日本製粉	86,000	378.00	32,508,000		
	日清製粉グループ本社	127,500	992.00	126,480,000		
	日東富士製粉	11,000	302.00	3,322,000		
	昭和産業	58,000	257.00	14,906,000	貸付株式数	3,000

	鳥越製粉	12,200	668.00	8,149,600		
	協同飼料	49,000	97.00	4,753,000	貸付株式数	2,000
	中部飼料	12,400	540.00	6,696,000		
	日本配合飼料	43,000	114.00	4,902,000	貸付株式数	19,000
	東洋精糖	21,000	100.00	2,100,000		
	日本甜菜製糖	78,000	179.00	13,962,000		
	三井製糖	50,000	275.00	13,750,000		
	森永製菓	137,000	189.00	25,893,000		
	中村屋	33,000	397.00	13,101,000		
	江崎グリコ	51,000	976.00	49,776,000	貸付株式数	1,000
	名糖産業	6,200	1,044.00	6,472,800	貸付株式数	2,700
	不二家	80,000	187.00	14,960,000	貸付株式数	18,000 (7,000)
	山崎製パン	103,000	1,163.00	119,789,000	貸付株式数	20,000
	第一屋製パン	19,000	93.00	1,767,000	貸付株式数	8,000 (3,000)
	モロゾフ	21,000	276.00	5,796,000	貸付株式数	9,000 (3,000)
	カルビー	7,600	4,135.00	31,426,000	貸付株式数	200
	森永乳業	119,000	318.00	37,842,000		
	ヤクルト本社	75,300	2,810.00	211,593,000	貸付株式数	33,000 (5,800)
	明治ホールディングス	41,600	3,600.00	149,760,000		
	雪印メグミルク	30,300	1,530.00	46,359,000	貸付株式数	5,700

[次へ](#)

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	プリマハム	79,000	155.00	12,245,000		
	日本ハム	107,000	1,044.00	111,708,000		
	伊藤ハム	77,000	313.00	24,101,000		
	林兼産業	45,000	80.00	3,600,000	貸付株式数	20,000 (20,000)
	丸大食品	67,000	314.00	21,038,000		
	米久	12,300	741.00	9,114,300		
	S Foods	9,000	667.00	6,003,000		
	サッポロホールディングス	230,000	303.00	69,690,000		
	アサヒグループホールディングス	263,600	1,812.00	477,643,200		
	キリンホールディングス	564,000	1,063.00	599,532,000		
	宝ホールディングス	119,000	553.00	65,807,000	貸付株式数	14,000 (14,000)
	オエノンホールディングス	36,000	200.00	7,200,000		
	養命酒製造	11,000	785.00	8,635,000		
	三国コカ・コーラボトリング	14,600	710.00	10,366,000		
	コカ・コーラウエスト	47,600	1,434.00	68,258,400		
	コカ・コーラ セントラル ジャパン	15,800	1,063.00	16,795,400		
	ダイドードリンコ	6,500	3,305.00	21,482,500		
	伊藤園	39,100	1,479.00	57,828,900	貸付株式数	4,900
	キーコーヒー	12,200	1,457.00	17,775,400	貸付株式数	5,600 (4,600)
	ユニカフェ	3,200	381.00	1,219,200		
	ジャパンフーズ	1,800	883.00	1,589,400		
	日清オイリオグループ	54,000	345.00	18,630,000		
	不二製油	34,100	1,171.00	39,931,100		
	J - オイルミルズ	52,000	233.00	12,116,000	貸付株式数	5,000
	キッコーマン	115,000	944.00	108,560,000		
	味の素	370,000	1,033.00	382,210,000		
	キューピー	71,500	1,215.00	86,872,500	貸付株式数	900
	ハウス食品	49,900	1,414.00	70,558,600		
	カゴメ	54,300	1,600.00	86,880,000	貸付株式数	23,100 (23,100)
	焼津水産化学工業	6,600	813.00	5,365,800		
	アリアケジャパン	12,800	1,580.00	20,224,000	貸付株式数	500
	ニチレイ	157,000	383.00	60,131,000		
	東洋水産	60,000	2,136.00	128,160,000		
	日清食品ホールディングス	54,900	3,070.00	168,543,000		
	永谷園	13,000	900.00	11,700,000	貸付株式数	5,000
	フジッコ	15,000	1,012.00	15,180,000		
	ロック・フィールド	7,300	1,613.00	11,774,900		
	日本たばこ産業	3,115	470,500.00	1,465,607,500	貸付株式数	68
	わらべや日洋	7,800	1,327.00	10,350,600	貸付株式数	3,400
	なとり	6,400	863.00	5,523,200	貸付株式数	2,900 (2,900)
	ミヨシ油脂	44,000	113.00	4,972,000		
	片倉工業	16,500	755.00	12,457,500		
	グンゼ	98,000	237.00	23,226,000	貸付株式数	2,000
	東洋紡績	555,000	117.00	64,935,000		
	ユニチカ	290,000	53.00	15,370,000		
	富士紡ホールディングス	55,000	183.00	10,065,000	貸付株式数	25,000

	日清紡ホールディングス	84,000	777.00	65,268,000		
	倉敷紡績	135,000	158.00	21,330,000		
	シキボウ	85,000	106.00	9,010,000		
	日本毛織	45,000	615.00	27,675,000		
	大東紡織	20,000	72.00	1,440,000	貸付株式数	8,000
	トーア紡コーポレーション	59,000	63.00	3,717,000		
	ダイドーリミテッド	16,100	693.00	11,157,300		
	帝国繊維	14,000	649.00	9,086,000		
	帝人	537,000	282.00	151,434,000		
	東レ	953,000	612.00	583,236,000		
	サカイオーベックス	37,000	148.00	5,476,000		
	住江織物	33,000	180.00	5,940,000	貸付株式数	2,000
	日本フェルト	7,300	410.00	2,993,000		
	イチカワ	9,000	169.00	1,521,000		
	日本バイリーン	16,000	380.00	6,080,000	貸付株式数	1,000
	日東製網	15,000	159.00	2,385,000	貸付株式数	1,000
	芦森工業	31,000	112.00	3,472,000	貸付株式数	1,000
	アツギ	103,000	106.00	10,918,000		
	ダイニック	25,000	167.00	4,175,000		
	セーレン	32,700	549.00	17,952,300		
	東海染工	18,000	113.00	2,034,000	貸付株式数	7,000

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	小松精練	20,000	422.00	8,440,000		
	ワコールホールディングス	78,000	974.00	75,972,000		
	ホギメディカル	8,300	3,600.00	29,880,000		
	レナウン	28,400	145.00	4,118,000	貸付株式数	8,300
	クラウディア	1,500	1,177.00	1,765,500		
	T S Iホールディングス	58,600	513.00	30,061,800		
	三陽商会	64,000	226.00	14,464,000	貸付株式数	29,000 (25,000)
	ナイガイ	37,000	57.00	2,109,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
	オンワードホールディングス	81,000	671.00	54,351,000		
	ルック	22,000	256.00	5,632,000	貸付株式数	9,000
	ゴールドウイン	30,000	505.00	15,150,000	貸付株式数	13,000
	デサント	33,000	518.00	17,094,000		
	ヤマトインターナショナル	7,900	396.00	3,128,400	貸付株式数	3,500 (3,500)
	特種東海製紙	83,000	188.00	15,604,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
	王子製紙	580,000	392.00	227,360,000		
	三菱製紙	187,000	80.00	14,960,000		
	北越紀州製紙	81,500	542.00	44,173,000		
	中越パルプ工業	50,000	179.00	8,950,000		
	巴川製紙所	22,000	176.00	3,872,000	貸付株式数	1,000
	大王製紙	55,000	483.00	26,565,000		
	日本製紙グループ本社	63,400	1,687.00	106,955,800	貸付株式数	29,400 (28,400)
	レンゴー	106,000	575.00	60,950,000	貸付株式数	23,000
	トーモク	41,000	233.00	9,553,000		
	ザ・パックス	7,700	1,394.00	10,733,800		
	クラレ	208,700	1,167.00	243,552,900		
	旭化成	765,000	504.00	385,560,000		
	共和レザー	7,600	320.00	2,432,000		
	コープケミカル	20,000	111.00	2,220,000		
	昭和電工	816,000	190.00	155,040,000		
	住友化学	902,000	355.00	320,210,000		
	日本化成	25,000	141.00	3,525,000	貸付株式数	11,000
	住友精化	24,000	381.00	9,144,000		
	日産化学工業	99,900	765.00	76,423,500		
	ラサ工業	53,000	126.00	6,678,000	貸付株式数	21,000
	クレハ	85,000	393.00	33,405,000		
	テイカ	22,000	293.00	6,446,000		
	石原産業	220,000	85.00	18,700,000	貸付株式数	13,000
	片倉チッカリン	9,000	225.00	2,025,000		
	日本曹達	78,000	373.00	29,094,000		
	東ソー	351,000	225.00	78,975,000		
	トクヤマ	204,000	258.00	52,632,000	貸付株式数	88,000
	セントラル硝子	126,000	359.00	45,234,000		
	東亜合成	164,000	381.00	62,484,000		
	ダイソー	52,000	270.00	14,040,000		
	関東電化工業	29,000	306.00	8,874,000	貸付株式数	6,000
	電気化学工業	276,000	329.00	90,804,000	貸付株式数	20,000
	信越化学工業	235,600	4,805.00	1,132,058,000		

	日本カーバイド工業	41,000	125.00	5,125,000	貸付株式数	7,000 (3,000)
	堺化学工業	41,000	313.00	12,833,000		
	エア・ウォーター	107,000	1,045.00	111,815,000		
	大陽日酸	173,000	568.00	98,264,000		
	日本化学工業	52,000	140.00	7,280,000		
	日本パーカライジング	31,000	1,263.00	39,153,000		
	高压ガス工業	19,000	500.00	9,500,000		
	チタン工業	14,000	350.00	4,900,000	貸付株式数	6,000
	四国化成工業	19,000	476.00	9,044,000		
	戸田工業	17,000	580.00	9,860,000	貸付株式数	5,000
	ステラ ケミファ	6,200	1,966.00	12,189,200	貸付株式数	2,100
	保土谷化学工業	26,000	268.00	6,968,000	貸付株式数	12,000 (7,000)
	日本触媒	95,000	958.00	91,010,000		
	大日精化工業	47,000	380.00	17,860,000		
	カネカ	164,000	491.00	80,524,000		
	三菱瓦斯化学	226,000	543.00	122,718,000		
	三井化学	557,000	244.00	135,908,000		
	J S R	119,600	1,671.00	199,851,600		
	東京応化工業	23,600	1,856.00	43,801,600	貸付株式数	3,900
	大阪有機化学工業	8,000	449.00	3,592,000	貸付株式数	100

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	三菱ケミカルホールディングス	821,000	437.00	358,777,000		
	日本合成化学工業	27,000	513.00	13,851,000		
	ダイセル	171,000	531.00	90,801,000		
	住友ベークライト	113,000	430.00	48,590,000		
	積水化学工業	273,000	711.00	194,103,000		
	日本ゼオン	123,000	769.00	94,587,000		
	アイカ工業	34,200	1,174.00	40,150,800		
	宇部興産	550,000	223.00	122,650,000		
	積水樹脂	18,000	831.00	14,958,000		
	タキロン	31,000	292.00	9,052,000		
	旭有機材工業	46,000	219.00	10,074,000		
	日立化成工業	56,800	1,471.00	83,552,800		
	ニチバン	13,000	267.00	3,471,000		
	リケンテクノス	21,000	267.00	5,607,000		
	大倉工業	31,000	262.00	8,122,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
	積水化成品工業	34,000	298.00	10,132,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
	群栄化学工業	35,000	212.00	7,420,000		
	タイガースポリマー	6,500	357.00	2,320,500		
	日本カーリット	10,400	417.00	4,336,800		
	日本化薬	92,000	829.00	76,268,000		
	日本精化	10,900	558.00	6,082,200		
	A D E K A	56,500	771.00	43,561,500		
	日油	104,000	401.00	41,704,000		
	ハリマ化成	11,200	573.00	6,417,600		
	花王	348,300	2,155.00	750,586,500		
	第一工業製薬	24,000	253.00	6,072,000		
	三洋化成工業	41,000	542.00	22,222,000		
	大日本塗料	75,000	95.00	7,125,000		
	日本ペイント	124,000	625.00	77,500,000		
	関西ペイント	149,000	833.00	124,117,000		
	トウペ	11,000	99.00	1,089,000	貸付株式数	3,000
	中国塗料	40,000	505.00	20,200,000		
	日本特殊塗料	10,100	345.00	3,484,500		
	藤倉化成	16,600	430.00	7,138,000		
	太陽ホールディングス	10,700	2,191.00	23,443,700	貸付株式数	1,200 (700)
	D I C	501,000	168.00	84,168,000		
	サカタインクス	24,000	409.00	9,816,000		
	東洋インキS Cホールディングス	118,000	336.00	39,648,000		
	富士フイルムホールディングス	280,500	1,917.00	537,718,500		
	資生堂	218,100	1,416.00	308,829,600		
	ライオン	151,000	472.00	71,272,000		
	高砂香料工業	43,000	381.00	16,383,000		
	マンダム	13,200	2,059.00	27,178,800		
	ミルボン	7,000	2,373.00	16,611,000	貸付株式数	2,900
	ファンケル	33,000	1,087.00	35,871,000		
	コーセー	21,200	1,877.00	39,792,400		

ドクターシーラボ	79	378,000.00	29,862,000	貸付株式数	35 (1)
ポーラ・オルビスホールディングス	13,400	2,424.00	32,481,600		
エステー	8,100	1,009.00	8,172,900	貸付株式数	2,900 (2,900)
コニシ	9,500	1,111.00	10,554,500		
長谷川香料	16,600	1,184.00	19,654,400		
星光PMC	5,400	332.00	1,792,800	貸付株式数	700
小林製薬	18,200	4,100.00	74,620,000		
荒川化学工業	10,200	718.00	7,323,600		
メック	9,400	315.00	2,961,000		
日本高純度化学	37	211,500.00	7,825,500		
荏原ユージライト	1,800	2,434.00	4,381,200	貸付株式数	700
アース製薬	9,400	2,944.00	27,673,600		
イハラケミカル工業	22,000	329.00	7,238,000		
北興化学工業	13,000	245.00	3,185,000		
大成ラミック	3,700	2,505.00	9,268,500	貸付株式数	1,600
クマイ化学工業	30,000	317.00	9,510,000	貸付株式数	13,000
日本農薬	30,000	371.00	11,130,000		
アキレス	107,000	117.00	12,519,000		
有沢製作所	21,800	323.00	7,041,400		
日東電工	108,300	3,405.00	368,761,500		
レック	3,900	1,320.00	5,148,000	貸付株式数	200

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	きもと	10,700	521.00	5,574,700		
	藤森工業	9,400	1,337.00	12,567,800		
	前澤化成工業	9,200	983.00	9,043,600		
	J S P	8,600	1,191.00	10,242,600		
	エフピコ	5,800	5,260.00	30,508,000		
	天馬	10,400	933.00	9,703,200	貸付株式数	4,600 (4,600)
	信越ポリマー	25,700	422.00	10,845,400	貸付株式数	5,300
	東リ	34,000	178.00	6,052,000		
	ニフコ	29,300	2,235.00	65,485,500		
	日本バルカー工業	51,000	231.00	11,781,000		
	ユニ・チャーム	72,500	4,370.00	316,825,000	貸付株式数	3,900
	協和発酵キリン	180,000	912.00	164,160,000		
	武田薬品工業	492,000	3,595.00	1,768,740,000	貸付株式数	6,600
	アステラス製薬	291,500	3,390.00	988,185,000	貸付株式数	6,400
	大日本住友製薬	93,000	870.00	80,910,000	貸付株式数	700
	塩野義製薬	205,100	1,133.00	232,378,300		
	田辺三菱製薬	131,200	1,146.00	150,355,200		
	わかもと製薬	15,000	246.00	3,690,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
	あすか製薬	15,000	500.00	7,500,000		
	日本新薬	27,000	1,015.00	27,405,000		
	中外製薬	152,600	1,522.00	232,257,200		
	科研製薬	52,000	1,038.00	53,976,000		
	エーザイ	161,700	3,240.00	523,908,000	貸付株式数	6,700
	ロート製薬	55,000	1,026.00	56,430,000		
	小野薬品工業	64,200	4,600.00	295,320,000		
	久光製薬	40,800	3,945.00	160,956,000		
	有機合成薬品工業	9,000	248.00	2,232,000		
	持田製薬	46,000	961.00	44,206,000		
	参天製薬	44,100	3,600.00	158,760,000	貸付株式数	1,800
	扶桑薬品工業	44,000	226.00	9,944,000		
	日本ケミファ	20,000	446.00	8,920,000		
	ツムラ	35,800	2,367.00	84,738,600		
	日医工	22,200	1,811.00	40,204,200		
	キッセイ薬品工業	24,400	1,613.00	39,357,200		
	生化学工業	25,100	910.00	22,841,000	貸付株式数	100
	栄研化学	10,200	1,102.00	11,240,400		
	日水製薬	5,300	755.00	4,001,500	貸付株式数	2,300 (2,300)
	鳥居薬品	9,000	1,538.00	13,842,000		
	東和薬品	6,700	3,990.00	26,733,000		
	沢井製薬	8,600	8,800.00	75,680,000	貸付株式数	3,700
	ゼリア新薬工業	19,000	1,465.00	27,835,000	貸付株式数	8,000
	第一三共	441,700	1,491.00	658,574,700		
	キョーリン製薬ホールディングス	32,000	1,569.00	50,208,000		
	大幸薬品	6,100	827.00	5,044,700	貸付株式数	200
	ダイト	3,700	1,241.00	4,591,700		
	大塚ホールディングス	260,700	2,446.00	637,672,200		
	大正製薬ホールディングス	31,600	6,720.00	212,352,000		

	日本コークス工業	106,000	124.00	13,144,000		
	昭和シェル石油	117,400	522.00	61,282,800		
	コスモ石油	363,000	226.00	82,038,000		
	ニチレキ	17,000	449.00	7,633,000		
	東燃ゼネラル石油	198,000	764.00	151,272,000		
	ユシロ化学工業	7,100	913.00	6,482,300		
	ビーピー・カストロール	5,400	342.00	1,846,800		
	AOCホールディングス	30,400	503.00	15,291,200		
	MORESCO	2,700	903.00	2,438,100	貸付株式数	1,200
	出光興産	15,600	8,180.00	127,608,000		
	JXホールディングス	1,457,500	515.00	750,612,500	貸付株式数	63,600
	横浜ゴム	160,000	605.00	96,800,000		
	東洋ゴム工業	99,000	235.00	23,265,000		
	ブリヂストン	411,600	2,032.00	836,371,200		
	住友ゴム工業	102,400	1,133.00	116,019,200		
	藤倉ゴム工業	8,200	306.00	2,509,200		
	オカモト	47,000	317.00	14,899,000		
	フコク	5,500	933.00	5,131,500	貸付株式数	300
	ニッタ	13,000	1,524.00	19,812,000		
	東海ゴム工業	24,300	1,057.00	25,685,100		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	三ツ星ベルト	35,000	459.00	16,065,000		
	バンドー化学	47,000	306.00	14,382,000		
	日東紡績	96,000	322.00	30,912,000	貸付株式数	30,000 (18,000)
	旭硝子	647,000	694.00	449,018,000		
	日本板硝子	563,000	126.00	70,938,000	貸付株式数	258,000
	石塚硝子	17,000	153.00	2,601,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
	日本山村硝子	52,000	202.00	10,504,000		
	日本電気硝子	252,000	715.00	180,180,000		
	オハラ	5,000	929.00	4,645,000		
	住友大阪セメント	266,000	241.00	64,106,000		
	太平洋セメント	771,000	187.00	144,177,000		
	デイ・シイ	12,100	329.00	3,980,900	貸付株式数	5,000
	日本ヒューム	13,000	369.00	4,797,000	貸付株式数	4,000
	日本コンクリート工業	20,000	270.00	5,400,000		
	東海カーボン	114,000	440.00	50,160,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
	日本カーボン	60,000	233.00	13,980,000		
	東洋炭素	6,500	3,090.00	20,085,000	貸付株式数	2,000
	ノリタケカンパニーリミテド	68,000	251.00	17,068,000		
	TOTO	203,000	615.00	124,845,000		
	日本碍子	171,000	1,077.00	184,167,000		
	日本特殊陶業	113,000	1,184.00	133,792,000		
	ダントーホールディングス	19,000	100.00	1,900,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
	MARUWA	3,900	3,590.00	14,001,000	貸付株式数	1,700
	品川リフラクトリーズ	33,000	222.00	7,326,000		
	黒崎播磨	28,000	264.00	7,392,000		
	東京窯業	16,000	217.00	3,472,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
	ニッカトー	4,600	497.00	2,286,200		
	フジインコーポレーテッド	12,000	1,003.00	12,036,000	貸付株式数	4,500 (4,500)
	エーアンドエーマテリアル	27,000	95.00	2,565,000	貸付株式数	12,000
	ニチアス	58,000	458.00	26,564,000		
	ニチハ	14,500	1,011.00	14,659,500		
	新日本製鐵	3,446,000	223.00	768,458,000	貸付株式数	205,000
	住友金属工業	2,433,000	164.00	399,012,000		
	神戸製鋼所	1,819,000	133.00	241,927,000		
	日新製鋼	465,000	135.00	62,775,000		
	中山製鋼所	67,000	76.00	5,092,000		
	合同製鐵	73,000	210.00	15,330,000		
	ジェイ エフ イー ホールディングス	311,000	1,786.00	555,446,000	貸付株式数	4,700
	東京製鐵	66,400	718.00	47,675,200		
	共英製鋼	14,000	1,645.00	23,030,000	貸付株式数	6,100
	大和工業	30,000	2,401.00	72,030,000		
	東京鐵鋼	26,000	312.00	8,112,000	貸付株式数	3,000
	大阪製鐵	8,200	1,631.00	13,374,200		
	淀川製鋼所	93,000	353.00	32,829,000		
	東洋鋼鈑	31,000	336.00	10,416,000		
	住友鋼管	7,600	857.00	6,513,200	貸付株式数	3,400 (3,400)
	丸一鋼管	40,300	1,899.00	76,529,700		

	モリ工業	20,000	298.00	5,960,000		
	大同特殊鋼	220,000	573.00	126,060,000		
	日本高周波鋼業	51,000	101.00	5,151,000		
	日本金属工業	101,000	75.00	7,575,000		
	日本冶金工業	96,500	142.00	13,703,000	貸付株式数	16,500 (16,500)
	山陽特殊製鋼	65,000	448.00	29,120,000		
	愛知製鋼	70,000	425.00	29,750,000		
	日立金属	86,000	1,042.00	89,612,000	貸付株式数	10,000
	日本金属	31,000	147.00	4,557,000	貸付株式数	14,000 (9,000)
	大太平洋金属	91,000	448.00	40,768,000		
	日本電工	47,000	411.00	19,317,000	貸付株式数	21,000
	栗本鐵工所	63,000	215.00	13,545,000		
	旭テック	108,000	32.00	3,456,000	貸付株式数	48,000 (15,000)
	日本鑄鉄管	14,000	202.00	2,828,000		
	三菱製鋼	79,000	287.00	22,673,000		
	日亜鋼業	20,000	207.00	4,140,000		
	日本精線	9,000	425.00	3,825,000		
	シンニッタン	11,300	542.00	6,124,600		
	新家工業	28,000	136.00	3,808,000		
	日本軽金属	297,000	131.00	38,907,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	大紀アルミニウム工業所	20,000	268.00	5,360,000		
	三井金属鉱業	357,000	232.00	82,824,000		
	東邦亜鉛	74,000	373.00	27,602,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
	三菱マテリアル	819,000	264.00	216,216,000		
	住友金属鉱山	340,000	1,166.00	396,440,000		
	DOWAホールディングス	157,000	553.00	86,821,000	貸付株式数	2,000
	古河機械金属	220,000	80.00	17,600,000		
	大阪チタニウムテクノロジーズ	12,900	3,155.00	40,699,500	貸付株式数	5,900
	東邦チタニウム	21,300	1,311.00	27,924,300	貸付株式数	9,700
	住友軽金属工業	317,000	83.00	26,311,000		
	古河スカイ	53,000	267.00	14,151,000	貸付株式数	19,000
	古河電気工業	413,000	215.00	88,795,000	貸付株式数	81,000
	住友電気工業	463,700	1,135.00	526,299,500		
	フジクラ	197,000	276.00	54,372,000		
	昭和電線ホールディングス	168,000	79.00	13,272,000		
	東京特殊電線	17,000	97.00	1,649,000	貸付株式数	7,000
	タツタ電線	25,000	502.00	12,550,000	貸付株式数	11,000 (2,000)
	日立電線	102,000	214.00	21,828,000		
	沖電線	14,000	165.00	2,310,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
	カナレ電気	1,600	1,407.00	2,251,200		
	平河ヒューテック	2,500	785.00	1,962,500		
	リョービ	73,000	318.00	23,214,000		
	アサヒホールディングス	18,400	1,761.00	32,402,400		
	稲葉製作所	6,300	1,012.00	6,375,600		
	宮地エンジニアリンググループ	40,000	165.00	6,600,000	貸付株式数	18,000
	三協・立山ホールディングス	177,000	146.00	25,842,000		
	トーカロ	7,400	1,653.00	12,232,200		
	アルファC O	4,400	1,139.00	5,011,600	貸付株式数	1,400
	SUMCO	80,300	986.00	79,175,800	貸付株式数	35,100
	川田テクノロジーズ	2,900	1,250.00	3,625,000		
	東洋製罐	92,800	1,190.00	110,432,000		
	ホッカンホールディングス	31,000	237.00	7,347,000		
	コロナ	6,000	1,241.00	7,446,000	貸付株式数	2,400 (2,200)
	横河ブリッジホールディングス	27,000	574.00	15,498,000		
	日本橋梁	4,600	318.00	1,462,800	貸付株式数	2,100 (900)
	駒井ハルテック	25,000	262.00	6,550,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
	高田機工	11,000	224.00	2,464,000		
	三和ホールディングス	131,000	325.00	42,575,000		
	文化シャッター	34,000	301.00	10,234,000		
	東洋シャッター	3,700	433.00	1,602,100	貸付株式数	1,400 (1,100)
	住生活グループ	170,700	1,713.00	292,409,100		
	日本ファイルコン	9,500	405.00	3,847,500		
	ノーリツ	25,700	1,541.00	39,603,700		
	長府製作所	12,600	1,926.00	24,267,600		
	リンナイ	21,100	6,030.00	127,233,000		
	ダイニチ工業	6,700	779.00	5,219,300		
	日東精工	17,000	266.00	4,522,000		

	三洋工業	16,000	192.00	3,072,000		
	岡部	25,800	492.00	12,693,600		
	中国工業	20,000	109.00	2,180,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
	東プレ	25,200	866.00	21,823,200		
	高周波熱錬	17,400	751.00	13,067,400		
	東京製鋼	82,000	170.00	13,940,000	貸付株式数	38,000
	パイオラックス	5,600	2,183.00	12,224,800		
	日本発條	95,000	903.00	85,785,000		
	中央発條	17,000	337.00	5,729,000		
	アドバネクス	26,000	93.00	2,418,000	貸付株式数	1,000
	三益半導体工業	11,100	787.00	8,735,700		
	アタカ大機	8,000	297.00	2,376,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
	日本製鋼所	202,000	559.00	112,918,000		
	日立ツール	7,500	852.00	6,390,000		
	三浦工業	19,500	2,141.00	41,749,500		
	タクマ	44,000	413.00	18,172,000		
	ツガミ	35,000	920.00	32,200,000	貸付株式数	15,000
	オークマ	79,000	695.00	54,905,000		
	東芝機械	71,000	435.00	30,885,000		
	アマダ	185,000	582.00	107,670,000		

[次へ](#)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	アイダエンジニアリング	33,900	474.00	16,068,600	貸付株式数	2,500
	牧野フライス製作所	65,000	705.00	45,825,000	貸付株式数	28,000
	オーエスジー	57,800	1,286.00	74,330,800	貸付株式数	11,200 (2,300)
	ダイジェット工業	15,000	194.00	2,910,000		
	旭ダイヤモンド工業	32,300	966.00	31,201,800		
	森精機製作所	69,200	856.00	59,235,200	貸付株式数	26,400 (13,400)
	ディスコ	13,200	4,595.00	60,654,000	貸付株式数	5,700
	日東工器	7,600	1,844.00	14,014,400	貸付株式数	3,400 (3,400)
	豊和工業	68,000	91.00	6,188,000		
	大阪機工	51,000	118.00	6,018,000	貸付株式数	22,000 (22,000)
	東洋機械金属	9,700	237.00	2,298,900	貸付株式数	4,400
	津田駒工業	32,000	193.00	6,176,000	貸付株式数	12,000
	エンシュウ	32,000	91.00	2,912,000	貸付株式数	9,000
	島精機製作所	17,100	1,555.00	26,590,500	貸付株式数	4,800 (4,800)
	日阪製作所	17,000	906.00	15,402,000		
	やまびこ	5,200	1,381.00	7,181,200		
	ペガサスミシン製造	12,000	223.00	2,676,000	貸付株式数	5,300 (2,700)
	ナプテスコ	54,500	1,725.00	94,012,500		
	三井海洋開発	10,800	1,717.00	18,543,600	貸付株式数	4,700 (4,700)
	レオン自動機	12,000	206.00	2,472,000		
	S M C	39,200	13,470.00	528,024,000		
	新川	10,100	461.00	4,656,100	貸付株式数	600
	ホソカワミクロン	20,000	485.00	9,700,000		
	ユニオンツール	7,200	1,539.00	11,080,800	貸付株式数	2,900
	オイレス工業	14,500	1,624.00	23,548,000		
	サトーホールディングス	13,700	1,187.00	16,261,900	貸付株式数	1,300
	日本エアーテック	3,800	389.00	1,478,200		
	日精樹脂工業	10,400	453.00	4,711,200		
	ワイエイシイ	5,300	676.00	3,582,800	貸付株式数	1,500 (1,500)
	小松製作所	612,500	2,387.00	1,462,037,500	貸付株式数	274,600
	住友重機械工業	335,000	471.00	157,785,000		
	日立建機	67,000	1,880.00	125,960,000	貸付株式数	27,900 (200)
	日工	18,000	318.00	5,724,000		
	巴工業	4,900	1,711.00	8,383,900		
	井関農機	134,000	212.00	28,408,000	貸付株式数	62,000 (62,000)
	T O W A	11,700	453.00	5,300,100		
	丸山製作所	29,000	178.00	5,162,000	貸付株式数	2,000
	北川鉄工所	60,000	169.00	10,140,000		
	クボタ	601,000	806.00	484,406,000	貸付株式数	161,000
	荏原実業	3,100	1,272.00	3,943,200	貸付株式数	1,400 (1,400)
	三菱化工機	40,000	171.00	6,840,000		
	月島機械	20,000	724.00	14,480,000		
	帝国電機製作所	4,400	1,623.00	7,141,200	貸付株式数	1,800 (1,800)
	東京機械製作所	42,000	60.00	2,520,000		
	新東工業	28,600	923.00	26,397,800		
	澁谷工業	8,200	919.00	7,535,800	貸付株式数	3,300
	アイチ コーポレーション	21,700	389.00	8,441,300		

	小森コーポレーション	37,200	694.00	25,816,800		
	鶴見製作所	10,000	680.00	6,800,000		
	住友精密工業	19,000	487.00	9,253,000	貸付株式数	8,000
	酒井重工業	25,000	268.00	6,700,000	貸付株式数	11,000 (8,000)
	荏原製作所	214,000	293.00	62,702,000		
	石井鐵工所	19,000	171.00	3,249,000	貸付株式数	8,000 (3,000)
	西島製作所	15,100	1,117.00	16,866,700	貸付株式数	6,700
	ダイキン工業	159,800	2,319.00	370,576,200		
	オルガノ	25,000	556.00	13,900,000		
	トーヨーカネツ	70,000	181.00	12,670,000	貸付株式数	12,000 (8,000)
	栗田工業	72,400	2,018.00	146,103,200		
	椿本チエイン	67,000	524.00	35,108,000		
	大同工業	26,000	153.00	3,978,000		
	日本コンベヤ	40,000	83.00	3,320,000		
	木村化工機	12,000	371.00	4,452,000	貸付株式数	2,900 (2,900)
	アネスト岩田	20,000	390.00	7,800,000		
	ダイフク	57,500	473.00	27,197,500		
	加藤製作所	30,000	389.00	11,670,000	貸付株式数	5,000
	油研工業	23,000	181.00	4,163,000		
	タダノ	61,000	581.00	35,441,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	フジテック	37,000	535.00	19,795,000		
	シーケーディ	35,100	650.00	22,815,000		
	キトー	53	70,700.00	3,747,100		
	平和	27,200	1,615.00	43,928,000		
	理想科学工業	9,000	1,354.00	12,186,000		
	SANKYO	38,000	4,025.00	152,950,000		
	日本金銭機械	11,600	819.00	9,500,400	貸付株式数	2,900
	マースエンジニアリング	7,100	1,809.00	12,843,900	貸付株式数	3,100 (3,100)
	福島工業	3,400	1,165.00	3,961,000		
	オーイズミ	4,400	315.00	1,386,000	貸付株式数	1,900
	ダイコク電機	5,800	1,167.00	6,768,600		
	アマノ	38,000	746.00	28,348,000		
	JUKI	76,000	181.00	13,756,000	貸付株式数	33,000
	サンデン	66,000	278.00	18,348,000		
	蛇の目ミシン工業	122,000	68.00	8,296,000	貸付株式数	1,000
	マックス	20,000	1,047.00	20,940,000		
	グローリー	37,400	1,819.00	68,030,600		
	大和冷機工業	18,000	424.00	7,632,000		
	セガサミーホールディングス	134,800	1,758.00	236,978,400		
	日本ピストンリング	46,000	204.00	9,384,000		
	リケン	46,000	373.00	17,158,000		
	T P R	13,900	1,377.00	19,140,300		
	ホシザキ電機	25,300	1,973.00	49,916,900		
	大豊工業	8,800	1,017.00	8,949,600		
	日本精工	279,000	644.00	179,676,000		
	NTN	290,000	353.00	102,370,000		
	ジェイテクト	119,900	1,002.00	120,139,800		
	不二越	126,000	481.00	60,606,000	貸付株式数	10,000
	日本トムソン	40,000	532.00	21,280,000		
	T H K	83,400	1,683.00	140,362,200		
	ユーシン精機	6,200	1,681.00	10,422,200	貸付株式数	100
	前澤給装工業	4,700	1,182.00	5,555,400	貸付株式数	100
	イーグル工業	15,000	852.00	12,780,000		
	前澤工業	9,200	229.00	2,106,800	貸付株式数	4,300 (4,300)
	日本ピラー工業	13,000	714.00	9,282,000		
	キッツ	51,600	346.00	17,853,600	貸付株式数	300
	日立工機	33,500	754.00	25,259,000		
	マキタ	81,800	3,415.00	279,347,000		
	日立造船	496,000	108.00	53,568,000		
	三菱重工業	2,102,000	399.00	838,698,000		
	I H I	857,000	207.00	177,399,000		
	イビデン	82,200	2,037.00	167,441,400		
	コニカミノルタホールディングス	331,000	725.00	239,975,000		
	ブラザー工業	162,100	1,140.00	184,794,000		
	ミネベア	187,000	361.00	67,507,000	貸付株式数	13,000 (13,000)
	日立製作所	2,816,000	550.00	1,548,800,000	貸付株式数	880,000
	東芝	2,640,000	363.00	958,320,000	貸付株式数	150,000

三菱電機	1,254,000	731.00	916,674,000		
富士電機	378,000	219.00	82,782,000		
東洋電機製造	25,000	329.00	8,225,000	貸付株式数	9,000
安川電機	147,000	788.00	115,836,000	貸付株式数	30,000
シンフォニアテクノロジー	75,000	180.00	13,500,000		
明電舎	124,000	293.00	36,332,000	貸付株式数	21,000 (21,000)
オリジン電気	18,000	366.00	6,588,000		
デンヨー	11,800	1,008.00	11,894,400		
東芝テック	79,000	322.00	25,438,000		
芝浦メカトロニクス	22,000	248.00	5,456,000		
マブチモーター	17,100	3,730.00	63,783,000		
日本電産	67,800	7,590.00	514,602,000		
高岳製作所	50,000	255.00	12,750,000	貸付株式数	21,000
ダイヘン	74,000	299.00	22,126,000		
ヤーマン	1,000	1,442.00	1,442,000	貸付株式数	400
JVCケンウッド	75,800	379.00	28,728,200	貸付株式数	33,200 (6,000)
第一精工	2,900	2,185.00	6,336,500	貸付株式数	1,300
日新電機	25,000	499.00	12,475,000		
大崎電気工業	18,000	832.00	14,976,000	貸付株式数	3,000
オムロン	139,700	1,772.00	247,548,400		

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	日東工業	18,800	1,059.00	19,909,200		
	I D E C	16,400	813.00	13,333,200		
	ジーエス・ユアサ コーポレーション	242,000	456.00	110,352,000	貸付株式数	101,000 (96,000)
	サクサホールディングス	32,000	185.00	5,920,000	貸付株式数	14,000
	メルコホールディングス	6,900	2,077.00	14,331,300	貸付株式数	2,900
	テクノメディカ	9	345,000.00	3,105,000		
	日本電気	1,724,000	173.00	298,252,000		
	富士通	1,209,000	436.00	527,124,000		
	沖電気工業	484,000	124.00	60,016,000		
	岩崎通信機	55,000	77.00	4,235,000		
	電気興業	38,000	409.00	15,542,000		
	サンケン電気	64,000	392.00	25,088,000	貸付株式数	29,000 (23,000)
	ナカヨ通信機	12,000	364.00	4,368,000		
	アイホン	7,200	1,554.00	11,188,800	貸付株式数	3,200 (3,200)
	ルネサスエレクトロニクス	32,500	563.00	18,297,500	貸付株式数	15,000 (8,300)
	セイコーエプソン	85,600	1,162.00	99,467,200	貸付株式数	35,800
	ワコム	247	179,200.00	44,262,400	貸付株式数	46 (46)
	アルバック	25,000	897.00	22,425,000	貸付株式数	10,900
	アクセル	5,800	1,934.00	11,217,200	貸付株式数	1,800 (1,800)
	ピクセラ	5,200	197.00	1,024,400	貸付株式数	2,400
	ナナオ	10,600	1,729.00	18,327,400		
	日本信号	29,200	509.00	14,862,800		
	京三製作所	27,000	354.00	9,558,000		
	能美防災	17,000	561.00	9,537,000		
	ホーチキ	11,000	417.00	4,587,000		
	日本無線	27,000	204.00	5,508,000	貸付株式数	10,000
	パナソニック	1,432,700	768.00	1,100,313,600		
	シャープ	605,000	599.00	362,395,000	貸付株式数	271,000 (5,000)
	アンリツ	60,000	1,101.00	66,060,000	貸付株式数	27,000 (16,000)
	富士通ゼネラル	30,000	626.00	18,780,000	貸付株式数	12,000 (11,000)
	日立国際電気	29,000	764.00	22,156,000		
	ソニー	782,400	1,717.00	1,343,380,800	貸付株式数	11,900
	T D K	65,600	4,800.00	314,880,000		
	帝国通信工業	30,000	148.00	4,440,000		
	ミツミ電機	44,300	705.00	31,231,500		
	タムラ製作所	42,000	226.00	9,492,000	貸付株式数	4,000
	アルプス電気	99,000	730.00	72,270,000		
	池上通信機	40,000	59.00	2,360,000		
	パイオニア	177,800	424.00	75,387,200	貸付株式数	70,100
	日本電波工業	9,700	1,217.00	11,804,900		
	日本トリム	1,450	2,109.00	3,058,050		
	ローランド ディー・ジー	5,500	1,001.00	5,505,500		
	フォスター電機	11,900	1,216.00	14,470,400	貸付株式数	5,300
	クラリオン	77,000	224.00	17,248,000		
	S M K	40,000	291.00	11,640,000	貸付株式数	18,000
	ヨコオ	9,700	522.00	5,063,400		

東光	57,000	276.00	15,732,000	貸付株式数	8,000
ティアック	68,000	34.00	2,312,000	貸付株式数	27,000
ホシデン	34,000	616.00	20,944,000		
ヒロセ電機	21,800	8,660.00	188,788,000		
日本航空電子工業	29,000	723.00	20,967,000		
TOA	14,000	676.00	9,464,000		
ユニデン	37,000	328.00	12,136,000		
アルパイン	24,500	1,110.00	27,195,000		
スミダコーポレーション	7,800	538.00	4,196,400		
アイコム	6,900	2,016.00	13,910,400	貸付株式数	1,800
リオン	2,800	751.00	2,102,800		
船井電機	11,300	1,819.00	20,554,700		
横河電機	136,000	833.00	113,288,000		
新電元工業	44,000	393.00	17,292,000		
アズビル	32,200	1,812.00	58,346,400		
日本光電工業	24,900	2,250.00	56,025,000		
チノー	22,000	226.00	4,972,000		
共和電業	13,000	268.00	3,484,000		
日本電子材料	5,000	397.00	1,985,000		
堀場製作所	23,200	2,832.00	65,702,400	貸付株式数	800
アドバンテスト	93,200	1,306.00	121,719,200	貸付株式数	36,000 (8,900)

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	小野測器	14,000	322.00	4,508,000		
	エスペック	13,000	778.00	10,114,000		
	パナソニック電工SUNX	11,000	426.00	4,686,000	貸付株式数	2,500
	キーエンス	30,750	19,230.00	591,322,500		
	日置電機	6,000	1,602.00	9,612,000		
	シスメックス	44,100	3,300.00	145,530,000		
	メガチップス	10,300	1,633.00	16,819,900	貸付株式数	4,500
	OBARA GROUP	8,900	1,106.00	9,843,400		
	日本電産コパル電子	12,900	479.00	6,179,100		
	ミヤチテクノス	5,600	708.00	3,964,800	貸付株式数	2,600
	東京電波	3,700	425.00	1,572,500	貸付株式数	1,600
	澤藤電機	7,000	254.00	1,778,000	貸付株式数	3,000
	コーセル	18,200	1,136.00	20,675,200		
	日立メディコ	9,000	1,084.00	9,756,000		
	新日本無線	8,000	220.00	1,760,000	貸付株式数	3,000
	オプテックス	8,600	1,102.00	9,477,200		
	千代田インテグレ	6,100	1,032.00	6,295,200		
	東光電気	8,000	364.00	2,912,000		
	スタンレー電気	84,100	1,319.00	110,927,900		
	岩崎電気	46,000	172.00	7,912,000	貸付株式数	12,000
	ウシオ電機	76,100	1,149.00	87,438,900		
	岡谷電機産業	6,700	352.00	2,358,400	貸付株式数	2,900 (2,900)
	ヘリオス テクノ ホールディング	10,700	143.00	1,530,100	貸付株式数	200 (200)
	日本セラミック	8,200	1,393.00	11,422,600		
	日本デジタル研究所	10,600	865.00	9,169,000		
	古河電池	9,000	482.00	4,338,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
	双信電機	6,100	367.00	2,238,700	貸付株式数	700
	山一電機	12,700	180.00	2,286,000		
	図研	8,200	662.00	5,428,400		
	日本電子	46,000	238.00	10,948,000		
	カシオ計算機	119,500	597.00	71,341,500	貸付株式数	54,200 (30,400)
	ファナック	130,600	14,970.00	1,955,082,000	貸付株式数	400
	日本シイエムケイ	27,000	444.00	11,988,000		
	エンプラス	6,300	2,051.00	12,921,300		
	ローム	61,800	4,110.00	253,998,000		
	浜松ホトニクス	48,900	3,105.00	151,834,500		
	三井ハイテック	16,500	489.00	8,068,500		
	新光電気工業	42,100	809.00	34,058,900	貸付株式数	17,300
	京セラ	104,300	7,620.00	794,766,000		
	太陽誘電	56,300	892.00	50,219,600	貸付株式数	24,900 (3,300)
	村田製作所	131,600	4,900.00	644,840,000		
	ユーシン	17,400	705.00	12,267,000		
	双葉電子工業	21,400	1,194.00	25,551,600		
	北陸電気工業	50,000	122.00	6,100,000	貸付株式数	2,000
	ニチコン	39,500	982.00	38,789,000		
	日本ケミコン	72,000	322.00	23,184,000		

	K O A	15,800	868.00	13,714,400		
	市光工業	30,000	165.00	4,950,000	貸付株式数	1,000
	小糸製作所	63,000	1,339.00	84,357,000		
	ミツバ	23,000	801.00	18,423,000	貸付株式数	1,000
	スター精密	20,100	811.00	16,301,100	貸付株式数	2,300
	大日本スクリーン製造	119,000	752.00	89,488,000	貸付株式数	28,000
	キャノン電子	11,500	2,088.00	24,012,000		
	キャノン	779,000	3,990.00	3,108,210,000		
	リコー	377,000	836.00	315,172,000	貸付株式数	91,000
	日本電産サンキョー	30,000	502.00	15,060,000		
	MUTOHホールディングス	13,000	291.00	3,783,000	貸付株式数	2,000 (2,000)
	東京エレクトロン	105,500	4,795.00	505,872,500	貸付株式数	900
	トヨタ紡織	43,800	993.00	43,493,400	貸付株式数	19,600
	鬼怒川ゴム工業	29,000	637.00	18,473,000		
	ユニプレス	20,100	2,570.00	51,657,000	貸付株式数	7,800
	豊田自動織機	114,200	2,531.00	289,040,200		
	モリタホールディングス	20,000	544.00	10,880,000	貸付株式数	9,000 (9,000)
	三櫻工業	15,900	700.00	11,130,000		
	デンソー	309,800	2,756.00	853,808,800		
	東海理化電機製作所	29,400	1,449.00	42,600,600		
	三井造船	485,000	141.00	68,385,000	貸付株式数	217,000

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	佐世保重工業	82,000	133.00	10,906,000	貸付株式数	36,000
	川崎重工業	911,000	252.00	229,572,000	貸付株式数	398,000
	日本車輛製造	46,000	335.00	15,410,000	貸付株式数	16,000 (16,000)
	日本輸送機	16,000	256.00	4,096,000	貸付株式数	1,000
	近畿車輛	19,000	311.00	5,909,000		
	日産自動車	1,595,500	898.00	1,432,759,000	貸付株式数	41,600
	いすゞ自動車	793,000	488.00	386,984,000	貸付株式数	31,000
	トヨタ自動車	1,626,100	3,565.00	5,797,046,500		
	日野自動車	179,000	604.00	108,116,000		
	三菱自動車工業	2,803,000	94.00	263,482,000	貸付株式数	1,252,000
	エフテック	4,300	1,798.00	7,731,400	貸付株式数	100
	武蔵精密工業	12,100	1,982.00	23,982,200		
	日産車体	37,000	865.00	32,005,000		
	新明和工業	56,000	415.00	23,240,000	貸付株式数	1,000
	極東開発工業	21,600	812.00	17,539,200		
	日信工業	22,900	1,358.00	31,098,200		
	トピー工業	94,000	259.00	24,346,000		
	ティラド	45,000	345.00	15,525,000	貸付株式数	19,000
	曙ブレーキ工業	63,500	466.00	29,591,000	貸付株式数	27,800
	タチエス	16,400	1,663.00	27,273,200		
	NOK	60,700	1,836.00	111,445,200		
	フタバ産業	35,500	476.00	16,898,000		
	カヤバ工業	87,000	491.00	42,717,000	貸付株式数	39,000 (3,000)
	シロキ工業	28,000	278.00	7,784,000		
	大同メタル工業	19,000	1,025.00	19,475,000		
	プレス工業	58,000	556.00	32,248,000		
	カルソニックカンセイ	74,000	516.00	38,184,000		
	太平洋工業	26,000	520.00	13,520,000		
	ケーヒン	25,900	1,532.00	39,678,800	貸付株式数	11,300
	河西工業	15,000	467.00	7,005,000		
	アイシン精機	103,300	2,933.00	302,978,900		
	富士機工	14,000	310.00	4,340,000		
	マツダ	1,682,000	146.00	245,572,000	貸付株式数	147,000
	ダイハツ工業	116,000	1,533.00	177,828,000		
	今仙電機製作所	9,200	1,160.00	10,672,000		
	本田技研工業	1,058,000	3,210.00	3,396,180,000		
	スズキ	262,200	2,024.00	530,692,800		
	富士重工業	396,000	681.00	269,676,000		
	ヤマハ発動機	204,300	1,114.00	227,590,200	貸付株式数	40,000 (40,000)
	ショーワ	26,600	677.00	18,008,200		
	T B K	13,000	559.00	7,267,000		
	エクセディ	17,000	2,405.00	40,885,000		
	豊田合成	35,400	1,625.00	57,525,000		
	愛三工業	13,000	880.00	11,440,000	貸付株式数	100
	ヨロズ	7,500	1,797.00	13,477,500		
	エフ・シー・シー	20,500	1,862.00	38,171,000		
	シマノ	46,900	4,970.00	233,093,000	貸付株式数	1,500

	タカタ	22,700	2,236.00	50,757,200		
	テイ・エス テック	26,500	1,622.00	42,983,000		
	日本電産トーソク	6,000	937.00	5,622,000	貸付株式数	2,600 (2,600)
	テルモ	88,700	3,850.00	341,495,000		
	クリエートメディック	3,800	837.00	3,180,600		
	日機装	41,000	867.00	35,547,000		
	島津製作所	150,000	741.00	111,150,000		
	JMS	19,000	267.00	5,073,000		
	クボテック	27	22,100.00	596,700	貸付株式数	5
	モリテックス	2,700	311.00	839,700		
	長野計器	8,800	782.00	6,881,600	貸付株式数	4,000 (4,000)
	バイ・テクノロジー	17	287,900.00	4,894,300	貸付株式数	7
	東京計器	43,000	193.00	8,299,000		
	愛知時計電機	14,000	308.00	4,312,000	貸付株式数	5,000 (5,000)
	東京精密	22,500	1,715.00	38,587,500		
	ニコン	218,500	2,539.00	554,771,500	貸付株式数	3,900
	トプコン	28,900	542.00	15,663,800	貸付株式数	4,300
	オリンパス	147,900	1,303.00	192,713,700		
	理研計器	10,100	601.00	6,070,100		
	タムロン	10,700	2,642.00	28,269,400	貸付株式数	1,100

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	HOYA	304,900	1,838.00	560,406,200		
	ノーリツ鋼機	11,300	437.00	4,938,100		
	エー・アンド・デイ	12,200	304.00	3,708,800		
	日本電産コパル	9,800	1,074.00	10,525,200		
	シチズンホールディングス	150,100	512.00	76,851,200		
	リズム時計工業	57,000	143.00	8,151,000		
	大研医器	1,500	940.00	1,410,000	貸付株式数	200
	セイコーホールディングス	73,000	200.00	14,600,000	貸付株式数	9,000
	ニプロ	60,900	612.00	37,270,800	貸付株式数	7,300 (7,300)
	パラマウントベッドホールディングス	10,700	2,462.00	26,343,400	貸付株式数	900
	SHO-BI	2,000	531.00	1,062,000		
	永大産業	16,000	380.00	6,080,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
	SRIスポーツ	7,900	1,013.00	8,002,700		
	バンダイナムコホールディングス	129,700	1,200.00	155,640,000		
	共立印刷	14,600	245.00	3,577,000	貸付株式数	6,500 (1,900)
	フランスベッドホールディングス	84,000	168.00	14,112,000	貸付株式数	37,000
	パイロットコーポレーション	109	159,600.00	17,396,400		
	トッパン・フォームズ	26,900	731.00	19,663,900		
	フジシールインターナショナル	14,100	1,532.00	21,601,200		
	タカラトミー	41,200	597.00	24,596,400		
	廣済堂	10,700	312.00	3,338,400	貸付株式数	4,200 (2,000)
	アーク	42,400	88.00	3,731,200	貸付株式数	5,900
	タカノ	4,900	455.00	2,229,500	貸付株式数	2,200 (2,200)
	プロネクサス	13,800	450.00	6,210,000	貸付株式数	4,100
	ホクシン	8,800	180.00	1,584,000		
	ウッドワン	21,000	351.00	7,371,000		
	大建工業	51,000	287.00	14,637,000		
	凸版印刷	381,000	633.00	241,173,000		
	大日本印刷	382,000	831.00	317,442,000		
	図書印刷	20,000	153.00	3,060,000		
	共同印刷	42,000	226.00	9,492,000		
	日本写真印刷	21,000	1,040.00	21,840,000	貸付株式数	9,400 (1,100)
	光村印刷	12,000	277.00	3,324,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
	宝印刷	7,100	635.00	4,508,500	貸付株式数	100
	アシックス	116,800	920.00	107,456,000		
	ツツミ	6,300	2,181.00	13,740,300	貸付株式数	900
	ローランド	12,900	820.00	10,578,000		
	小松ウオール工業	4,700	855.00	4,018,500	貸付株式数	2,100 (2,100)
	ヤマハ	92,200	855.00	78,831,000		
	河合楽器製作所	47,000	189.00	8,883,000		
	クリナップ	14,600	646.00	9,431,600		
	ピジョン	11,100	3,105.00	34,465,500		
	兼松日産農林	19,000	175.00	3,325,000	貸付株式数	8,000
	キングジム	10,400	666.00	6,926,400		
	リンテック	23,800	1,664.00	39,603,200		
	TASAKI	25,000	51.00	1,275,000		

	イトーキ	26,400	369.00	9,741,600	貸付株式数	11,800 (10,100)
	任天堂	71,700	12,600.00	903,420,000		
	三菱鉛筆	10,300	1,432.00	14,749,600		
	タカラスタンダード	58,000	614.00	35,612,000		
	コクヨ	65,200	601.00	39,185,200	貸付株式数	1,100
	ナカバヤシ	26,000	199.00	5,174,000		
	グローブライド	61,000	102.00	6,222,000		
	岡村製作所	44,000	553.00	24,332,000		
	美津濃	62,000	453.00	28,086,000		
	アデランス	15,700	903.00	14,177,100	貸付株式数	7,300 (7,300)
	東京電力	1,001,200	205.00	205,246,000	貸付株式数	460,900
	中部電力	413,200	1,479.00	611,122,800		
	関西電力	511,700	1,267.00	648,323,900		
	中国電力	173,400	1,539.00	266,862,600		
	北陸電力	122,800	1,491.00	183,094,800		
	東北電力	313,300	935.00	292,935,500		
	四国電力	115,500	2,311.00	266,920,500		
	九州電力	277,000	1,167.00	323,259,000		
	北海道電力	117,400	1,203.00	141,232,200		
	沖縄電力	7,500	3,420.00	25,650,000		
	電源開発	77,800	2,229.00	173,416,200		

[次へ](#)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	東京瓦斯	1,513,000	395.00	597,635,000		
	大阪瓦斯	1,217,000	336.00	408,912,000		
	東邦瓦斯	319,000	496.00	158,224,000		
	北海道瓦斯	22,000	263.00	5,786,000		
	西部瓦斯	141,000	225.00	31,725,000		
	静岡瓦斯	32,500	592.00	19,240,000		
	東武鉄道	712,000	425.00	302,600,000		
	相鉄ホールディングス	201,000	254.00	51,054,000		
	東京急行電鉄	738,000	385.00	284,130,000		
	京浜急行電鉄	322,000	707.00	227,654,000	貸付株式数	148,000
	小田急電鉄	402,000	762.00	306,324,000	貸付株式数	42,000 (40,000)
	京王電鉄	350,000	581.00	203,350,000	貸付株式数	64,000 (64,000)
	京成電鉄	201,000	625.00	125,625,000	貸付株式数	2,000
	富士急行	34,000	499.00	16,966,000	貸付株式数	14,000
	新京成電鉄	16,000	348.00	5,568,000	貸付株式数	4,000
	東日本旅客鉄道	218,100	5,220.00	1,138,482,000		
	西日本旅客鉄道	109,000	3,280.00	357,520,000		
	東海旅客鉄道	1,088	670,000.00	728,960,000		
	西日本鉄道	162,000	381.00	61,722,000		
	ハマキョウレックス	3,600	2,836.00	10,209,600		
	サカイ引越センター	2,300	1,752.00	4,029,600	貸付株式数	100
	近畿日本鉄道	1,133,000	307.00	347,831,000	貸付株式数	521,000 (171,000)
	阪急阪神ホールディングス	842,000	359.00	302,278,000		
	南海電気鉄道	261,000	343.00	89,523,000	貸付株式数	96,000
	京阪電気鉄道	281,000	385.00	108,185,000		
	名糖運輸	5,100	615.00	3,136,500	貸付株式数	2,200 (2,200)
	名古屋鉄道	438,000	222.00	97,236,000	貸付株式数	33,000
	日本通運	496,000	319.00	158,224,000		
	ヤマトホールディングス	255,100	1,258.00	320,915,800		
	山九	152,000	314.00	47,728,000		
	丸運	6,800	212.00	1,441,600		
	丸全昭和運輸	42,000	267.00	11,214,000		
	センコー	50,000	325.00	16,250,000		
	トナミホールディングス	26,000	189.00	4,914,000		
	日本梱包運輸倉庫	37,600	992.00	37,299,200		
	日本石油輸送	14,000	205.00	2,870,000		
	福山通運	76,000	442.00	33,592,000	貸付株式数	33,000 (10,000)
	セイノーホールディングス	97,000	587.00	56,939,000		
	神奈川中央交通	15,000	449.00	6,735,000	貸付株式数	6,000
	日立物流	26,100	1,488.00	38,836,800		
	日本郵船	993,000	268.00	266,124,000		
	商船三井	658,000	369.00	242,802,000		
	川崎汽船	387,000	193.00	74,691,000	貸付株式数	173,000 (8,000)
	N S ユナイテッド海運	54,000	140.00	7,560,000	貸付株式数	18,000
	乾汽船	13,800	333.00	4,595,400		
	明治海運	11,200	357.00	3,998,400	貸付株式数	4,900 (500)
	飯野海運	60,600	373.00	22,603,800	貸付株式数	10,500

共栄タンカー	10,000	225.00	2,250,000	貸付株式数	4,000
第一中央汽船	82,000	125.00	10,250,000	貸付株式数	27,000
全日本空輸	1,671,000	243.00	406,053,000	貸付株式数	770,000 (79,000)
パスコ	12,000	324.00	3,888,000	貸付株式数	5,000
日新	47,000	215.00	10,105,000		
三菱倉庫	89,000	964.00	85,796,000		
三井倉庫	58,000	348.00	20,184,000		
住友倉庫	92,000	419.00	38,548,000		
澁澤倉庫	30,000	249.00	7,470,000	貸付株式数	13,000 (13,000)
東陽倉庫	20,000	187.00	3,740,000		
日本トランスシティ	26,000	281.00	7,306,000		
ケイヒン	23,000	118.00	2,714,000		
安田倉庫	9,800	529.00	5,184,200		
東洋埠頭	36,000	151.00	5,436,000		
宇徳	8,500	281.00	2,388,500	貸付株式数	3,900 (3,900)
上組	139,000	676.00	93,964,000		
サンリツ	3,300	554.00	1,828,200		
キムラユニティー	2,800	748.00	2,094,400	貸付株式数	1,300 (1,300)
キューソー流通システム	3,900	875.00	3,412,500		
郵船ロジスティクス	9,900	1,289.00	12,761,100	貸付株式数	100

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	近鉄エクスプレス	11,200	2,940.00	32,928,000		
	東海運	7,900	260.00	2,054,000	貸付株式数	3,500 (3,500)
	エーアイティー	1,000	1,236.00	1,236,000	貸付株式数	100
	NEC ネットエスアイ	11,600	1,164.00	13,502,400		
	システナ	132	61,900.00	8,170,800		
	新日鉄ソリューションズ	8,300	1,541.00	12,790,300		
	コア	4,600	695.00	3,197,000	貸付株式数	2,100 (2,100)
	ソフトクリエイト	1,300	1,159.00	1,506,700	貸付株式数	500
	デジタルハーツ	10	164,900.00	1,649,000		
	ITホールディングス	37,600	947.00	35,607,200		
	プライムワークス	20	75,000.00	1,500,000	貸付株式数	9 (9)
	グリーン	63,500	2,067.00	131,254,500	貸付株式数	28,400
	コーエーテクモホールディングス	24,500	664.00	16,268,000		
	三菱総合研究所	4,800	1,856.00	8,908,800	貸付株式数	2,100 (2,100)
	ボルテージ	1,500	1,205.00	1,807,500	貸付株式数	600 (600)
	ネクソン	63,000	1,438.00	90,594,000		
	ドワンゴ	62	119,300.00	7,396,600	貸付株式数	5
	ベリサーブ	7	140,900.00	986,300		
	マクロミル	12,000	784.00	9,408,000	貸付株式数	5,500
	ティーガイア	80	136,200.00	10,896,000		
	GMO ペイメントゲートウェイ	27	339,000.00	9,153,000	貸付株式数	12
	ザッパラス	68	107,600.00	7,316,800		
	インターネットイニシアティブ	72	291,600.00	20,995,200		
	ソネットエンタテインメント	70	313,000.00	21,910,000		
	SRAホールディングス	6,500	961.00	6,246,500		
	JBSホールディングス	7,700	307.00	2,363,900	貸付株式数	3,400 (1,000)
	朝日ネット	10,000	368.00	3,680,000		
	パナソニック電工インフォメーションシステムズ	2,900	2,197.00	6,371,300	貸付株式数	1,000
	フェイス	419	10,130.00	4,244,470		
	野村総合研究所	70,100	2,057.00	144,195,700		
	サイバネットシステム	101	21,600.00	2,181,600		
	インテージ	3,600	1,655.00	5,958,000		
	シンプレクス・ホールディングス	207	27,930.00	5,781,510		
	クレスコ	2,800	631.00	1,766,800		
	フジ・メディア・ホールディングス	1,289	142,700.00	183,940,300		
	オービック	3,880	16,720.00	64,873,600		
	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	2,400	758.00	1,819,200		
	ヤフー	9,062	26,640.00	241,411,680		
	トレンドマイクロ	54,600	2,533.00	138,301,800	貸付株式数	12,300
	日本オラクル	24,700	3,120.00	77,064,000		
	アルファシステムズ	4,080	1,166.00	4,757,280	貸付株式数	1,800 (1,800)
	フューチャーアーキテクト	148	36,000.00	5,328,000		
	シーエーシー	8,400	745.00	6,258,000		
	ソフトバンク・テクノロジー	2,900	1,095.00	3,175,500	貸付株式数	1,300
	トーセ	3,000	539.00	1,617,000		
	オービックビジネスコンサルタント	3,150	3,915.00	12,332,250		

伊藤忠テクノソリューションズ	14,600	3,620.00	52,852,000		
アイティフォー	13,800	304.00	4,195,200		
東計電算	2,200	1,064.00	2,340,800	貸付株式数	1,000 (1,000)
エクスネット	11	124,800.00	1,372,800		
大塚商会	9,900	6,570.00	65,043,000		
サイボウズ	226	27,540.00	6,224,040	貸付株式数	101
ソフトブレン	181	8,560.00	1,549,360		
アグレックス	3,300	740.00	2,442,000	貸付株式数	1,200
電通国際情報サービス	7,600	651.00	4,947,600		
ウェザーニューズ	3,200	2,426.00	7,763,200	貸付株式数	1,500 (1,400)
C I J	12,300	372.00	4,575,600		
WOWOW	38	179,000.00	6,802,000		
日本コロムビア	123,000	31.00	3,813,000	貸付株式数	1,000
ネットワンシステムズ	55,900	1,022.00	57,129,800		
アルゴグラフィックス	4,500	1,127.00	5,071,500		
エイベックス・グループ・ホールディングス	23,400	991.00	23,189,400		
日本ユニシス	29,900	568.00	16,983,200		
兼松エレクトロニクス	7,800	907.00	7,074,600		
東京放送ホールディングス	74,200	1,230.00	91,266,000	貸付株式数	1,300
日本テレビ放送網	10,860	13,210.00	143,460,600	貸付株式数	4,710
テレビ朝日	313	132,700.00	41,535,100		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	スカパーJ S A Tホールディングス	939	36,300.00	34,085,700		
	テレビ東京ホールディングス	7,800	1,087.00	8,478,600	貸付株式数	2,100 (2,100)
	アイ・ティー・シーネットワーク	10,500	523.00	5,491,500		
	イー・アクセス	944	18,480.00	17,445,120	貸付株式数	423
	N E Cモバイリング	4,500	2,800.00	12,600,000		
	日本電信電話	570,000	3,720.00	2,120,400,000		
	K D D I	1,921	538,000.00	1,033,498,000		
	光通信	11,400	2,453.00	27,964,200		
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	10,198	136,200.00	1,388,967,600		
	G M Oインターネット	36,700	425.00	15,597,500		
	学研ホールディングス	37,000	171.00	6,327,000		
	ゼンリン	17,800	825.00	14,685,000		
	昭文社	6,700	606.00	4,060,200	貸付株式数	3,100 (3,100)
	角川グループホールディングス	11,700	2,607.00	30,501,900	貸付株式数	5,000
	インプレスホールディングス	10,200	139.00	1,417,800	貸付株式数	4,500
	アイネット	5,300	485.00	2,570,500		
	松竹	81,000	774.00	62,694,000	貸付株式数	32,000 (32,000)
	東宝	88,300	1,524.00	134,569,200		
	東映	52,000	417.00	21,684,000		
	葵プロモーション	5,500	535.00	2,942,500		
	エヌ・ティ・ティ・データ	765	287,400.00	219,861,000		
	D T S	12,800	1,097.00	14,041,600		
	スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,400	1,718.00	69,407,200	貸付株式数	1,900
	シーイーシー	7,300	420.00	3,066,000		
	カプコン	23,700	1,933.00	45,812,100		
	ジャステック	7,800	500.00	3,900,000		
	S C S K	25,200	1,261.00	31,777,200	貸付株式数	900
	日本システムウエア	4,100	315.00	1,291,500		
	アイネス	15,000	653.00	9,795,000		
	T K C	10,400	1,787.00	18,584,800		
	富士ソフト	16,200	1,562.00	25,304,400		
	N S D	23,900	744.00	17,781,600		
	コナミ	55,900	2,382.00	133,153,800		
	福井コンピュータ	1,700	424.00	720,800		
	J B C Cホールディングス	9,700	547.00	5,305,900		
	ソフトバンク	560,700	2,452.00	1,374,836,400		
	ハウスイ	10,000	118.00	1,180,000	貸付株式数	2,000
	インターニックス	5,000	376.00	1,880,000		
	高千穂交易	5,100	880.00	4,488,000	貸付株式数	2,300 (2,300)
	伊藤忠食品	3,000	3,010.00	9,030,000	貸付株式数	900
	エレマテック	8,200	1,207.00	9,897,400	貸付株式数	300
	J A L U X	3,500	859.00	3,006,500	貸付株式数	1,600 (1,600)
	トーメンデバイス	1,900	2,030.00	3,857,000	貸付株式数	100 (100)
	東京エレクトロン デバイス	25	148,500.00	3,712,500		
	双日	828,400	147.00	121,774,800		
	アルフレッサ ホールディングス	32,400	3,855.00	124,902,000		

横浜冷凍	28,600	633.00	18,103,800		
神栄	15,000	140.00	2,100,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
山下医科器械	1,000	1,062.00	1,062,000		
ラサ商事	5,300	492.00	2,607,600	貸付株式数	700
アルコニックス	3,200	1,953.00	6,249,600		
あい ホールディングス	19,800	430.00	8,514,000		
ダイワボウホールディングス	120,000	183.00	21,960,000	貸付株式数	18,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,200	689.00	15,984,800	貸付株式数	10,400 (10,400)
八洲電機	8,100	380.00	3,078,000	貸付株式数	2,000
U K Cホールディングス	7,300	1,222.00	8,920,600		
T O K A Iホールディングス	60,400	400.00	24,160,000		
ミタチ産業	2,900	429.00	1,244,100		
シップヘルスケアホールディングス	16,100	1,685.00	27,128,500		
富士興産	44,000	75.00	3,300,000	貸付株式数	13,000
協栄産業	15,000	154.00	2,310,000		
小野建	10,800	709.00	7,657,200		
佐鳥電機	9,100	500.00	4,550,000		
エコートレーディング	3,100	731.00	2,266,100	貸付株式数	1,400 (1,400)
伯東	7,500	824.00	6,180,000		
コンドーテック	8,700	642.00	5,585,400		
中山福	7,100	604.00	4,288,400		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	ナガイレーベン	16,400	1,215.00	19,926,000	貸付株式数	1,100
	三菱食品	11,300	2,078.00	23,481,400		
	松田産業	9,000	1,357.00	12,213,000		
	メディカルホールディングス	133,300	1,068.00	142,364,400		
	アドヴァン	7,300	772.00	5,635,600		
	S P K	2,900	1,435.00	4,161,500		
	アズワン	8,100	1,794.00	14,531,400		
	スズデン	4,000	505.00	2,020,000	貸付株式数	1,800 (1,800)
	尾家産業	4,000	835.00	3,340,000		
	シモジマ	7,600	1,068.00	8,116,800	貸付株式数	3,300 (1,600)
	ドウシシャ	5,800	2,376.00	13,780,800		
	高速	7,400	702.00	5,194,800		
	黒田電気	15,300	899.00	13,754,700		
	丸文	9,800	413.00	4,047,400		
	ハピネット	6,600	932.00	6,151,200	貸付株式数	2,900 (2,900)
	トーメンエレクトロニクス	5,700	1,102.00	6,281,400		
	エクセル	5,700	810.00	4,617,000		
	マルカキカイ	4,000	840.00	3,360,000	貸付株式数	300 (300)
	ガリバーインターナショナル	3,750	3,295.00	12,356,250	貸付株式数	500 (500)
	日本エム・ディ・エム	10,300	272.00	2,801,600		
	進和	7,300	962.00	7,022,600		
	エスケイジャパン	2,900	255.00	739,500	貸付株式数	1,200 (1,200)
	ダイトエレクトロン	5,600	445.00	2,492,000		
	シークス	7,800	1,271.00	9,913,800	貸付株式数	3,500 (3,500)
	田中商事	3,800	448.00	1,702,400	貸付株式数	1,700
	オーハシテクニカ	6,900	594.00	4,098,600		
	マクニカ	6,300	1,946.00	12,259,800		
	白銅	4,000	763.00	3,052,000		
	伊藤忠商事	987,400	915.00	903,471,000	貸付株式数	36,100
	丸紅	1,083,000	607.00	657,381,000		
	高島	21,000	244.00	5,124,000	貸付株式数	9,000 (6,000)
	F & A アクアホールディングス	9,400	784.00	7,369,600	貸付株式数	4,300 (4,300)
	長瀬産業	70,100	1,015.00	71,151,500		
	蝶理	74,000	101.00	7,474,000		
	豊田通商	137,900	1,697.00	234,016,300		
	三共生興	21,000	282.00	5,922,000		
	兼松	263,000	109.00	28,667,000		
	ツカモトコーポレーション	22,000	163.00	3,586,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
	三井物産	1,068,300	1,357.00	1,449,683,100	貸付株式数	76,300
	日本紙パルプ商事	64,000	289.00	18,496,000	貸付株式数	20,000 (20,000)
	日立ハイテクノロジーズ	37,500	1,991.00	74,662,500		
	カメイ	16,000	1,225.00	19,600,000		
	東都水産	20,000	156.00	3,120,000	貸付株式数	9,000 (1,000)
	スターゼン	41,000	248.00	10,168,000		
	山善	47,500	686.00	32,585,000	貸付株式数	6,300
	椿本興業	13,000	268.00	3,484,000		
	住友商事	730,400	1,209.00	883,053,600		

内田洋行	28,000	263.00	7,364,000	貸付株式数	12,000 (12,000)
三菱商事	901,400	1,938.00	1,746,913,200	貸付株式数	29,000
第一実業	26,000	409.00	10,634,000		
キャノンマーケティングジャパン	41,200	1,049.00	43,218,800		
西華産業	46,000	247.00	11,362,000		
佐藤商事	11,000	612.00	6,732,000		
菱洋エレクトロ	13,900	901.00	12,523,900		
東京産業	12,500	308.00	3,850,000		
ユアサ商事	126,000	142.00	17,892,000		
神鋼商事	31,000	196.00	6,076,000		
阪和興業	124,000	369.00	45,756,000		
カナデン	12,000	540.00	6,480,000		
菱電商事	18,000	485.00	8,730,000		
フルサト工業	7,300	875.00	6,387,500		
岩谷産業	137,000	277.00	37,949,000		
すてきナイスグループ	54,000	247.00	13,338,000		
昭光通商	44,000	138.00	6,072,000		
二チモウ	18,000	214.00	3,852,000	貸付株式数	2,000
極東貿易	14,000	194.00	2,716,000	貸付株式数	6,000
イワキ	19,000	197.00	3,743,000		

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	三愛石油	30,000	419.00	12,570,000		
	稲畑産業	33,000	566.00	18,678,000		
	G S Iクレオス	30,000	127.00	3,810,000		
	明和産業	9,800	412.00	4,037,600		
	J F E 商事	83,000	420.00	34,860,000		
	東邦ホールディングス	39,600	1,469.00	58,172,400		
	サンゲツ	21,900	2,174.00	47,610,600		
	ミツウロコグループホールディングス	19,900	519.00	10,328,100	貸付株式数	4,000 (4,000)
	シナネン	27,000	356.00	9,612,000		
	伊藤忠エネクス	27,300	470.00	12,831,000		
	サンリオ	31,200	3,200.00	99,840,000	貸付株式数	13,600 (100)
	サンワテクノス	6,000	826.00	4,956,000		
	リョーサン	20,200	1,584.00	31,996,800		
	新光商事	13,500	706.00	9,531,000		
	トーホー	26,000	307.00	7,982,000		
	三信電気	17,700	690.00	12,213,000		
	東陽テクニカ	17,900	903.00	16,163,700		
	モスフードサービス	16,200	1,552.00	25,142,400		
	加賀電子	13,400	843.00	11,296,200		
	ソーダニッカ	13,000	353.00	4,589,000	貸付株式数	5,000 (5,000)
	立花エレテック	7,500	760.00	5,700,000		
	P a l t a c	13,000	1,131.00	14,703,000		
	太平洋興発	42,000	84.00	3,528,000	貸付株式数	11,000
	ヤマタネ	62,000	123.00	7,626,000		
	丸紅建材リース	12,000	191.00	2,292,000	貸付株式数	5,000 (5,000)
	日鐵商事	28,000	257.00	7,196,000		
	トラスコ中山	15,400	1,678.00	25,841,200	貸付株式数	2,700
	オートバックスセブン	14,700	3,950.00	58,065,000	貸付株式数	2,700
	加藤産業	17,800	1,552.00	27,625,600		
	イノテック	7,400	577.00	4,269,800		
	イエローハット	11,700	1,365.00	15,970,500	貸付株式数	2,800
	富士エレクトロニクス	6,400	1,229.00	7,865,600	貸付株式数	2,900 (2,900)
	J Kホールディングス	10,400	395.00	4,108,000		
	日伝	5,100	2,201.00	11,225,100	貸付株式数	600 (200)
	北沢産業	10,000	174.00	1,740,000		
	杉本商事	6,700	791.00	5,299,700	貸付株式数	900
	因幡電機産業	14,600	2,490.00	36,354,000		
	住金物産	58,000	222.00	12,876,000		
	ミスミグループ本社	45,800	2,001.00	91,645,800	貸付株式数	1,400
	江守商事	2,500	994.00	2,485,000		
	アルテック	6,000	275.00	1,650,000	貸付株式数	2,200
	タキヒヨー	19,000	445.00	8,455,000	貸付株式数	7,000
	スズケン	47,600	2,534.00	120,618,400		
	ジェコス	8,500	388.00	3,298,000		
	ローソン	39,100	5,170.00	202,147,000	貸付株式数	15,500
	サンエー	4,200	3,165.00	13,293,000		

	キリン堂	5,300	538.00	2,851,400	貸付株式数	2,200	
	ダイユーエイト	1,900	758.00	1,440,200	貸付株式数	800	(800)
	カワチ薬品	8,600	1,904.00	16,374,400			
	エービーシー・マート	17,600	3,085.00	54,296,000	貸付株式数	3,300	
	ハードオフコーポレーション	6,000	660.00	3,960,000	貸付株式数	2,600	(2,600)
	アスクル	8,500	1,468.00	12,478,000	貸付株式数	3,800	
	ゲオホールディングス	191	96,200.00	18,374,200	貸付株式数	86	
	ポイント	10,450	3,020.00	31,559,000	貸付株式数	1,600	
	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	8,000	231.00	1,848,000	貸付株式数	3,000	
	くらコーポレーション	6,400	1,360.00	8,704,000	貸付株式数	2,900	
	キャンドゥ	65	97,000.00	6,305,000	貸付株式数	30	(11)
	パル	3,600	3,060.00	11,016,000			
	エディオン	49,400	569.00	28,108,600			
	サーラコーポレーション	10,500	534.00	5,607,000			
	あみやき亭	19	200,500.00	3,809,500	貸付株式数	8	
	ひらまつ	52	78,100.00	4,061,200			
	ゲンキー	900	2,512.00	2,260,800			
	ハニーズ	10,860	1,551.00	16,843,860	貸付株式数	4,960	(880)
	アルペン	9,500	1,621.00	15,399,500			
	ビックカメラ	470	42,750.00	20,092,500	貸付株式数	210	
	D C Mホールディングス	64,100	630.00	40,383,000			

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	MonotaRO	7,000	1,277.00	8,939,000	貸付株式数	3,300 (3,300)
	J・フロントリテイリング	292,000	456.00	133,152,000		
	ドトール・日レスホールディングス	19,700	1,072.00	21,118,400		
	マツモトキヨシホールディングス	22,900	1,788.00	40,945,200		
	スタートトゥデイ	22,500	1,470.00	33,075,000		
	物語コーポレーション	1,600	1,444.00	2,310,400	貸付株式数	600
	ココカラファイン	12,900	2,572.00	33,178,800	貸付株式数	500
	三越伊勢丹ホールディングス	245,900	967.00	237,785,300		
	クリエイトSDホールディングス	5,200	2,176.00	11,315,200	貸付株式数	100 (100)
	丸善CHホールディングス	3,600	216.00	777,600	貸付株式数	1,600
	ブックオフコーポレーション	6,800	779.00	5,297,200	貸付株式数	1,500 (1,500)
	あさひ	7,200	1,505.00	10,836,000		
	サークルKサンクス	26,800	1,764.00	47,275,200		
	日本調剤	1,560	2,708.00	4,224,480		
	コスモス薬品	5,500	4,210.00	23,155,000		
	セブン&アイ・ホールディングス	517,700	2,445.00	1,265,776,500		
	ツルハホールディングス	10,200	4,860.00	49,572,000		
	サンマルクホールディングス	3,500	3,260.00	11,410,000	貸付株式数	1,500 (1,500)
	フェリシモ	3,500	1,141.00	3,993,500		
	トリドール	10,700	1,034.00	11,063,800	貸付株式数	1,300
	クスリのアオキ	1,800	2,226.00	4,006,800		
	メディカルシステムネットワーク	4,200	1,088.00	4,569,600	貸付株式数	1,800
	総合メディカル	3,000	3,130.00	9,390,000	貸付株式数	1,300 (1,100)
	はるやま商事	5,100	480.00	2,448,000		
	カッパ・クリエイト	9,100	1,791.00	16,298,100	貸付株式数	3,650
	ライトオン	9,200	752.00	6,918,400		
	ジーンズメイト	3,900	237.00	924,300	貸付株式数	500
	良品計画	13,100	4,300.00	56,330,000	貸付株式数	5,800
	三城ホールディングス	15,300	573.00	8,766,900	貸付株式数	6,600
	コナカ	14,600	773.00	11,285,800		
	ハウスオブローゼ	1,400	1,251.00	1,751,400	貸付株式数	600 (100)
	G-7ホールディングス	3,600	422.00	1,519,200		
	イオン北海道	7,800	357.00	2,784,600	貸付株式数	3,600 (3,600)
	コジマ	16,700	467.00	7,798,900	貸付株式数	100
	コーナン商事	13,500	1,318.00	17,793,000	貸付株式数	6,000
	エコス	4,200	498.00	2,091,600		
	ワタミ	14,600	1,760.00	25,696,000	貸付株式数	6,800 (6,700)
	マルシェ	3,000	715.00	2,145,000	貸付株式数	1,300
	ドン・キホーテ	33,000	3,000.00	99,000,000		
	メガネトップ	17,700	932.00	16,496,400		
	西松屋チェーン	27,100	672.00	18,211,200		
	ゼンショーホールディングス	47,200	1,003.00	47,341,600	貸付株式数	21,100
	幸楽苑	7,600	1,237.00	9,401,200	貸付株式数	3,300 (100)
	ハークスレイ	3,000	513.00	1,539,000	貸付株式数	1,300 (1,300)
	サイゼリヤ	18,300	1,317.00	24,101,100		
	ポプラ	3,100	493.00	1,528,300	貸付株式数	100 (100)

	ユナイテッドアローズ	13,300	1,745.00	23,208,500	貸付株式数	5,900	(5,900)
	ハイデイ日高	6,500	1,304.00	8,476,000	貸付株式数	2,400	(2,400)
	京都きもの友禅	8,200	981.00	8,044,200	貸付株式数	2,900	
	コロワイド	41,000	594.00	24,354,000	貸付株式数	19,000	(500)
	壱番屋	5,000	2,460.00	12,300,000			
	トップカルチャー	4,400	417.00	1,834,800			
	スギホールディングス	22,200	2,507.00	55,655,400	貸付株式数	9,600	
	スクロール	16,000	336.00	5,376,000	貸付株式数	100	
	ファミリーマート	38,000	3,495.00	132,810,000			
	木曽路	14,100	1,583.00	22,320,300	貸付株式数	6,400	(6,400)
	千趣会	22,300	588.00	13,112,400	貸付株式数	10,200	(10,200)
	タカキュー	9,500	184.00	1,748,000	貸付株式数	4,000	(4,000)
	ケーヨー	23,200	522.00	12,110,400	貸付株式数	9,800	
	上新電機	27,000	808.00	21,816,000	貸付株式数	11,000	
	日本瓦斯	11,800	1,342.00	15,835,600	貸付株式数	1,200	
	ベスト電器	38,500	204.00	7,854,000	貸付株式数	7,500	
	マルエツ	25,000	308.00	7,700,000	貸付株式数	3,000	
	ロイヤルホールディングス	20,700	934.00	19,333,800	貸付株式数	200	(200)
	東天紅	9,000	154.00	1,386,000	貸付株式数	3,000	(3,000)
	いなげや	13,800	925.00	12,765,000	貸付株式数	700	
	島忠	28,000	1,914.00	53,592,000			

[次へ](#)

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	チヨダ	16,200	1,643.00	26,616,600	貸付株式数	7,600 (7,600)
	ライフコーポレーション	7,800	1,360.00	10,608,000	貸付株式数	3,500 (3,500)
	カスミ	25,300	548.00	13,864,400		
	リンガーハット	11,200	1,067.00	11,950,400	貸付株式数	5,000
	さが美	10,000	132.00	1,320,000	貸付株式数	4,000 (4,000)
	MrMax	12,300	338.00	4,157,400		
	テンアライド	9,300	264.00	2,455,200	貸付株式数	4,300
	AOKIホールディングス	10,900	1,492.00	16,262,800		
	オークワ	18,000	1,159.00	20,862,000		
	コメリ	16,900	2,318.00	39,174,200		
	青山商事	34,100	1,692.00	57,697,200		
	しまむら	14,400	9,310.00	134,064,000		
	CFSコーポレーション	8,100	371.00	3,005,100		
	高島屋	167,000	680.00	113,560,000		
	松屋	24,900	785.00	19,546,500	貸付株式数	10,800 (1,500)
	エイチ・ツー・オー リテイリング	64,000	717.00	45,888,000	貸付株式数	10,000
	丸栄	20,000	119.00	2,380,000	貸付株式数	8,000
	ニッセンホールディングス	24,700	435.00	10,744,500	貸付株式数	7,400
	パルコ	22,500	793.00	17,842,500	貸付株式数	10,000 (2,500)
	丸井グループ	161,300	683.00	110,167,900		
	原信ナルスホールディングス	6,800	1,320.00	8,976,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
	井筒屋	67,000	57.00	3,819,000	貸付株式数	31,000 (31,000)
	ダイエー	76,400	270.00	20,628,000		
	イズミヤ	43,000	449.00	19,307,000	貸付株式数	2,000
	イオン	436,300	1,087.00	474,258,100	貸付株式数	177,800 (172,800)
	ユニー	92,800	883.00	81,942,400		
	イズミ	37,100	1,560.00	57,876,000		
	東武ストア	16,000	278.00	4,448,000		
	平和堂	22,800	1,091.00	24,874,800	貸付株式数	10,600 (10,600)
	フジ	13,700	1,817.00	24,892,900		

ヤオコー	5,500	2,774.00	15,257,000		
ゼビオ	14,900	2,175.00	32,407,500		
ケースホールディングス	30,900	2,673.00	82,595,700		
O l y m p i c	8,200	773.00	6,338,600	貸付株式数	3,700 (3,700)
日産東京販売ホールディングス	18,000	241.00	4,338,000	貸付株式数	8,000 (3,000)
アインファーマシーズ	6,800	4,530.00	30,804,000		
元気寿司	3,800	1,000.00	3,800,000		
ヤマダ電機	60,210	5,090.00	306,468,900		
アークランドサカモト	8,100	1,444.00	11,696,400		
ニトリホールディングス	24,500	7,540.00	184,730,000		
グルメ杵屋	9,000	464.00	4,176,000	貸付株式数	3,000 (2,000)
愛眼	9,800	355.00	3,479,000	貸付株式数	3,900 (3,900)
吉野家ホールディングス	335	105,300.00	35,275,500		
松屋フーズ	5,900	1,620.00	9,558,000	貸付株式数	2,600
サガミチェーン	15,000	605.00	9,075,000	貸付株式数	4,000 (4,000)
プレナス	13,800	1,485.00	20,493,000		
ミニストップ	9,100	1,588.00	14,450,800	貸付株式数	4,200 (4,200)
アークス	17,000	1,510.00	25,670,000		
バロー	24,600	1,380.00	33,948,000	貸付株式数	8,800
ベルク	6,100	1,238.00	7,551,800		
大庄	5,800	996.00	5,776,800		
ファーストリテイリング	28,900	19,030.00	549,967,000	貸付株式数	100
サンドラッグ	23,500	2,546.00	59,831,000		
ヤマザワ	3,200	1,385.00	4,432,000		
やまや	2,100	1,867.00	3,920,700	貸付株式数	900 (900)
ベルーナ	15,450	679.00	10,490,550		
新生銀行	964,000	108.00	104,112,000	貸付株式数	113,000
あおぞら銀行	386,000	238.00	91,868,000		
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,369,500	426.00	3,991,407,000		
りそなホールディングス	1,077,200	385.00	414,722,000		
三井住友トラスト・ホールディングス	2,426,000	266.00	645,316,000	貸付株式数	145,000
三井住友フィナンシャルグループ	939,798	2,770.00	2,603,240,460	貸付株式数	46,000
第四銀行	161,000	288.00	46,368,000		

	北越銀行	127,000	175.00	22,225,000		
	西日本シティ銀行	434,000	226.00	98,084,000		
	札幌北洋ホールディングス	186,600	305.00	56,913,000		
	千葉銀行	488,000	529.00	258,152,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	横浜銀行	795,000	413.00	328,335,000		
	常陽銀行	473,000	374.00	176,902,000		
	群馬銀行	280,000	435.00	121,800,000		
	武蔵野銀行	19,900	2,794.00	55,600,600		
	千葉興業銀行	23,700	478.00	11,328,600		
	筑波銀行	51,400	283.00	14,546,200		
	東京都民銀行	23,400	976.00	22,838,400		
	七十七銀行	194,000	357.00	69,258,000		
	青森銀行	92,000	254.00	23,368,000		
	秋田銀行	85,000	272.00	23,120,000		
	山形銀行	75,000	393.00	29,475,000		
	岩手銀行	8,400	3,710.00	31,164,000		
	東邦銀行	104,000	280.00	29,120,000		
	東北銀行	67,000	151.00	10,117,000		
	みちのく銀行	62,000	161.00	9,982,000		
	ふくおかフィナンシャルグループ	502,000	365.00	183,230,000		
	静岡銀行	373,000	842.00	314,066,000		
	十六銀行	155,000	280.00	43,400,000		
	スルガ銀行	121,000	837.00	101,277,000		
	八十二銀行	228,000	476.00	108,528,000		
	山梨中央銀行	76,000	366.00	27,816,000		
	大垣共立銀行	165,000	292.00	48,180,000		
	福井銀行	107,000	260.00	27,820,000		
	北國銀行	148,000	304.00	44,992,000		
	清水銀行	4,200	3,135.00	13,167,000		
	滋賀銀行	116,000	483.00	56,028,000		
	南都銀行	115,000	385.00	44,275,000		
	百五銀行	112,000	373.00	41,776,000		
	京都銀行	221,000	738.00	163,098,000		
	三重銀行	51,000	196.00	9,996,000		
	ほくほくフィナンシャルグループ	867,000	156.00	135,252,000		

広島銀行	365,000	372.00	135,780,000	貸付株式数	160,000
山陰合同銀行	74,000	644.00	47,656,000		
中国銀行	101,000	1,100.00	111,100,000		
鳥取銀行	39,000	175.00	6,825,000		
伊予銀行	132,000	720.00	95,040,000		
百十四銀行	136,000	376.00	51,136,000		
四国銀行	89,000	310.00	27,590,000		
阿波銀行	109,000	497.00	54,173,000	貸付株式数	2,000
鹿児島銀行	80,000	518.00	41,440,000		
大分銀行	80,000	258.00	20,640,000		
宮崎銀行	82,000	228.00	18,696,000		
肥後銀行	96,000	485.00	46,560,000		
佐賀銀行	75,000	234.00	17,550,000		
十八銀行	79,000	258.00	20,382,000		
沖縄銀行	9,400	3,620.00	34,028,000		
琉球銀行	26,000	1,119.00	29,094,000		
八千代銀行	6,300	1,991.00	12,543,300		
セブン銀行	347,800	180.00	62,604,000		
みずほフィナンシャルグループ	15,904,700	136.00	2,163,039,200	貸付株式数	664,000
紀陽ホールディングス	493,000	123.00	60,639,000		
山口フィナンシャルグループ	124,000	726.00	90,024,000		
長野銀行	40,000	160.00	6,400,000		
名古屋銀行	112,000	289.00	32,368,000		
愛知銀行	4,500	5,060.00	22,770,000		
第三銀行	70,000	173.00	12,110,000		
中京銀行	51,000	212.00	10,812,000		
東日本銀行	59,000	188.00	11,092,000		
大光銀行	44,000	255.00	11,220,000	貸付株式数	1,000
愛媛銀行	78,000	232.00	18,096,000		
トマト銀行	48,000	158.00	7,584,000		
みなと銀行	112,000	153.00	17,136,000		
京葉銀行	102,000	387.00	39,474,000		
関西アーバン銀行	172,000	127.00	21,844,000		

	栃木銀行	62,000	302.00	18,724,000		
	北日本銀行	3,900	2,278.00	8,884,200		
	東和銀行	124,000	94.00	11,656,000		

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	福島銀行	143,000	67.00	9,581,000	貸付株式数	66,000 (66,000)
	大東銀行	79,000	72.00	5,688,000	貸付株式数	31,000
	トモニホールディングス	95,200	396.00	37,699,200		
	フィデアホールディングス	71,200	222.00	15,806,400		
	池田泉州ホールディングス	510,700	115.00	58,730,500	貸付株式数	183,400 (183,400)
	S B Iホールディングス	13,113	8,060.00	105,690,780		
	日本アジア投資	89,000	80.00	7,120,000	貸付株式数	39,000
	ジャフコ	15,000	2,113.00	31,695,000		
	大和証券グループ本社	1,226,000	334.00	409,484,000		
	野村ホールディングス	2,679,200	375.00	1,004,700,000		
	岡三証券グループ	105,000	348.00	36,540,000		
	丸三証券	41,700	375.00	15,637,500		
	東洋証券	46,000	236.00	10,856,000	貸付株式数	20,000 (20,000)
	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	142,000	312.00	44,304,000		
	光世証券	30,000	110.00	3,300,000		
	水戸証券	36,000	230.00	8,280,000	貸付株式数	16,000
	いちよし証券	27,700	575.00	15,927,500		
	松井証券	73,400	533.00	39,122,200	貸付株式数	31,900 (1,800)
	だいこう証券ビジネス	7,000	322.00	2,254,000		
	マネックスグループ	996	18,800.00	18,724,800	貸付株式数	103
	カブドットコム証券	50,500	312.00	15,756,000	貸付株式数	16,800
	極東証券	16,600	702.00	11,653,200		
	岩井コスモホールディングス	11,700	439.00	5,136,300		
	小林洋行	3,100	193.00	598,300	貸付株式数	1,400
	N K S Jホールディングス	258,800	1,841.00	476,450,800		
	M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	369,900	1,721.00	636,597,900		
	ソニーフィナンシャルホールディングス	118,600	1,495.00	177,307,000		
	第一生命保険	6,619	117,900.00	780,380,100		
	東京海上ホールディングス	469,900	2,275.00	1,069,022,500		
	T & Dホールディングス	451,100	985.00	444,333,500		

クレディセゾン	101,100	1,737.00	175,610,700		
フィデック	68	11,750.00	799,000		
芙蓉総合リース	11,800	2,911.00	34,349,800	貸付株式数	2,900
興銀リース	17,200	2,166.00	37,255,200	貸付株式数	7,500
東京センチュリーリース	33,200	1,671.00	55,477,200		
日本証券金融	51,100	479.00	24,476,900		
大阪証券金融	14,400	186.00	2,678,400	貸付株式数	6,400 (6,400)
ポケットカード	12,400	372.00	4,612,800	貸付株式数	5,300
リコーリース	8,500	1,935.00	16,447,500		
イオンクレジットサービス	55,000	1,333.00	73,315,000	貸付株式数	19,500 (2,500)
アコム	24,860	1,935.00	48,104,100	貸付株式数	11,560 (11,560)
ジャックス	75,000	309.00	23,175,000		
オリエントコーポレーション	179,000	110.00	19,690,000		
日立キャピタル	24,300	1,239.00	30,107,700		
オリックス	64,400	8,120.00	522,928,000	貸付株式数	17,420
三菱UFJリース	31,390	3,670.00	115,201,300		
アサックス	17	100,000.00	1,700,000	貸付株式数	7
NECキャピタルソリューション	4,200	1,378.00	5,787,600	貸付株式数	1,800 (1,800)
日本駐車場開発	1,341	4,325.00	5,799,825		
昭栄	22,500	332.00	7,470,000	貸付株式数	10,100 (1,200)
東京建物不動産販売	4,800	287.00	1,377,600		
野村不動産ホールディングス	59,300	1,459.00	86,518,700		
常和ホールディングス	2,200	1,466.00	3,225,200	貸付株式数	900
ヒューリック	40,100	979.00	39,257,900	貸付株式数	17,900
パーク24	64,400	1,099.00	70,775,600		
三井不動産	549,000	1,595.00	875,655,000		
三菱地所	866,000	1,495.00	1,294,670,000		
平和不動産	117,000	227.00	26,559,000		
東京建物	236,000	334.00	78,824,000		
ダイビル	36,400	605.00	22,022,000		
サンケイビル	2,700	734.00	1,981,800		
東急不動産	249,000	411.00	102,339,000		
京阪神ビルディング	14,700	390.00	5,733,000	貸付株式数	200

	住友不動産	297,000	2,002.00	594,594,000	貸付株式数	6,000
	東宝不動産	13,000	512.00	6,656,000		
	大京	191,000	226.00	43,166,000		

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	テーオーシー	48,000	467.00	22,416,000		
	東京楽天地	20,000	306.00	6,120,000		
	レオパレス21	95,600	291.00	27,819,600	貸付株式数	32,500 (2,400)
	フジ住宅	15,800	478.00	7,552,400		
	空港施設	12,800	385.00	4,928,000		
	明和地所	6,100	435.00	2,653,500		
	住友不動産販売	4,450	3,920.00	17,444,000	貸付株式数	1,990 (1,990)
	ゴールドクレスト	11,150	1,501.00	16,736,150		
	東栄住宅	8,400	863.00	7,249,200		
	リロ・ホールディング	4,000	2,415.00	9,660,000		
	日本エスリード	4,800	844.00	4,051,200	貸付株式数	2,100 (2,100)
	東急リバブル	11,200	851.00	9,531,200		
	飯田産業	11,700	714.00	8,353,800		
	日神不動産	7,300	613.00	4,474,900	貸付株式数	2,100 (2,100)
	アーネストワン	20,500	929.00	19,044,500		
	タカラレーベン	14,300	773.00	11,053,900	貸付株式数	1,500
	サンヨーハウジング名古屋	57	75,900.00	4,326,300	貸付株式数	24
	イオンモール	56,400	1,920.00	108,288,000	貸付株式数	800
	フージャースコーポレーション	190	70,500.00	13,395,000	貸付株式数	87
	タクトホーム	66	78,500.00	5,181,000		
	トーセイ	120	32,350.00	3,882,000		
	エヌ・ティ・ティ都市開発	769	68,900.00	52,984,100		
	サンフロンティア不動産	101	17,110.00	1,728,110	貸付株式数	5
	ランドビジネス	83	17,290.00	1,435,070	貸付株式数	3
	グランディハウス	2,700	644.00	1,738,800	貸付株式数	1,200
	日本空港ビルデング	39,500	1,058.00	41,791,000		
	日本工営	44,000	285.00	12,540,000		
	ネクスト	5,100	386.00	1,968,600	貸付株式数	1,500
	日本M&Aセンター	5,200	2,238.00	11,637,600	貸付株式数	400 (400)
	ノバレーゼ	25	55,900.00	1,397,500		

アコーディア・ゴルフ	533	62,600.00	33,365,800		
パソナグループ	130	72,800.00	9,464,000		
リンクアンドモチベーション	26	56,400.00	1,466,400	貸付株式数	11 (11)
エス・エム・エス	18	106,500.00	1,917,000		
テンプホールディングス	17,900	774.00	13,854,600	貸付株式数	7,900 (5,500)
クックパッド	1,900	1,990.00	3,781,000	貸付株式数	800
学情	4,200	369.00	1,549,800	貸付株式数	1,800 (1,800)
スタジオアリス	6,000	1,400.00	8,400,000		
シミックホールディングス	4,300	1,413.00	6,075,900		
NECフィールディング	10,600	1,082.00	11,469,200		
総合警備保障	47,700	957.00	45,648,900		
カカクコム	20,400	2,182.00	44,512,800	貸付株式数	200
ルネサンス	5,800	438.00	2,540,400	貸付株式数	2,500
新日本科学	8,000	258.00	2,064,000	貸付株式数	3,700
エムスリー	103	304,500.00	31,363,500		
ベストプライダル	29	86,500.00	2,508,500		
ディー・エヌ・エー	58,700	2,371.00	139,177,700		
博報堂DYホールディングス	16,640	5,190.00	86,361,600		
ぐるなび	9,100	876.00	7,971,600		
一休	93	37,000.00	3,441,000	貸付株式数	16
ジャパンベストレスキューシステム	19	73,400.00	1,394,600		
ジェイコムホールディングス	2,300	738.00	1,697,400	貸付株式数	100 (100)
PGMホールディングス	184	57,300.00	10,543,200	貸付株式数	82
イーピーエス	70	186,700.00	13,069,000		
アミューズ	3,600	1,117.00	4,021,200		
ドリームインキュベータ	41	90,300.00	3,702,300		
TAC	7,200	184.00	1,324,800	貸付株式数	3,300
ケネディクス	1,427	16,270.00	23,217,290		
電通	119,200	2,641.00	314,807,200		
テイクアンドギヴ・ニーズ	559	8,030.00	4,488,770	貸付株式数	28
ぴあ	3,800	855.00	3,249,000	貸付株式数	1,700 (1,400)
イオンファンタジー	4,200	1,254.00	5,266,800		
ネクシィーズ	522	2,002.00	1,045,044	貸付株式数	236 (9)

	みらかホールディングス	34,200	3,310.00	113,202,000		
	アルプス技研	5,700	625.00	3,562,500		
	ダイオーズ	2,400	502.00	1,204,800		
	日本空調サービス	3,200	749.00	2,396,800		

通貨	銘柄	株式 数	評価額(円)		備考	
			単価	金額		
日本円	オリエンタルランド	35,400	8,780.00	310,812,000		
	ダスキン	39,400	1,617.00	63,709,800		
	明光ネットワークジャパン	11,900	790.00	9,401,000		
	ファルコSDホールディングス	7,100	924.00	6,560,400		
	秀英予備校	2,400	342.00	820,800		
	田谷	2,000	690.00	1,380,000	貸付株式数	800
	ラウンドワン	40,900	549.00	22,454,100		
	リゾートトラスト	20,100	1,333.00	26,793,300		
	ビー・エム・エル	8,600	2,114.00	18,180,400		
	ワタベウェディング	3,900	774.00	3,018,600		
	もしもしホットライン	21,700	816.00	17,707,200		
	東急コミュニティー	3,400	2,616.00	8,894,400		
	リソー教育	1,329	5,200.00	6,910,800		
	ウェアハウス	2,100	260.00	546,000	貸付株式数	900
	ユー・エス・エス	17,080	8,530.00	145,692,400		
	東京個別指導学院	6,300	162.00	1,020,600	貸付株式数	2,700
	テー・オー・ダブリュー	4,300	553.00	2,377,900	貸付株式数	1,800
	セントラルスポーツ	4,000	1,051.00	4,204,000		
	フルキャストホールディングス	108	18,740.00	2,023,920	貸付株式数	19
	リゾートソリューション	11,000	163.00	1,793,000	貸付株式数	4,000
	エイチ・アイ・エス	13,300	2,517.00	33,476,100		
	共立メンテナンス	6,500	1,721.00	11,186,500	貸付株式数	100
	イチネンホールディングス	13,700	428.00	5,863,600	貸付株式数	6,300 (6,300)
	建設技術研究所	7,200	554.00	3,988,800		
	燦ホールディングス	2,800	1,626.00	4,552,800	貸付株式数	800
	スバル興業	9,000	260.00	2,340,000		
	東京テアトル	50,000	118.00	5,900,000	貸付株式数	8,000
	よみうりランド	26,000	266.00	6,916,000	貸付株式数	11,000
	東京都競馬	101,000	127.00	12,827,000		
	常磐興産	40,000	97.00	3,880,000	貸付株式数	18,000

	カナモト	17,000	975.00	16,575,000		
	東京ドーム	105,000	281.00	29,505,000	貸付株式数	48,000 (48,000)
	トランス・コスモス	17,100	1,252.00	21,409,200		
	乃村工藝社	26,000	303.00	7,878,000		
	藤田観光	33,000	317.00	10,461,000		
	日本管財	4,800	1,477.00	7,089,600	貸付株式数	700
	トーカイ	5,300	1,770.00	9,381,000	貸付株式数	100
	白洋舎	14,000	214.00	2,996,000	貸付株式数	5,000
	セコム	127,200	3,980.00	506,256,000		
	セントラル警備保障	5,800	794.00	4,605,200		
	丹青社	13,000	298.00	3,874,000		
	メイテック	20,500	1,681.00	34,460,500	貸付株式数	500
	アサツー ディ・ケイ	21,600	2,381.00	51,429,600		
	応用地質	13,700	983.00	13,467,100	貸付株式数	800
	船井総合研究所	13,400	556.00	7,450,400		
	進学会	6,200	338.00	2,095,600		
	ベネッセホールディングス	40,600	4,025.00	163,415,000		
	イオンディライト	14,800	1,728.00	25,574,400		
	ナック	3,300	1,667.00	5,501,100		
	二チイ学館	25,600	1,097.00	28,083,200		
	ダイセキ	21,100	1,522.00	32,114,200		
計	銘柄数：1,654			146,502,278,629		
	組入時価比率：96.7%			100%		
合計				146,502,278,629		

- (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。
- 2 貸付株式の( )内は、委託者の利害関係人である野村證券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成24年4月2日現在)  
該当事項はございません。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成24年4月2日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建	4,827,560,000		4,896,320,000	68,399,640
合計	4,827,560,000		4,896,320,000	68,399,640

(注)時価の算定方法

先物取引

先物取引の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

[次へ](#)

2 「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」の状況  
以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## (1)貸借対照表

科目	対象年月日	平成24年4月2日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		2,206,003,806
コール・ローン		163,266,729
株式		214,098,024,313
投資信託受益証券		38,188,800
投資証券		4,335,907,329
派生商品評価勘定		32,719,088
未収入金		1,471,867,965
未収配当金		448,627,472
未収利息		408
差入委託証拠金		706,990,892
流動資産合計		223,501,596,802
資産合計		
223,501,596,802		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		31,174,100
未払解約金		138,107,276
その他未払費用		2,404,800
流動負債合計		171,686,176
負債合計		
171,686,176		
純資産の部		
元本等		
元本		209,658,976,274
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		13,670,934,352
元本等合計		223,329,910,626
純資産合計		
223,329,910,626		
負債純資産合計		
223,501,596,802		

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式、投資信託受益証券及び投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p>
2 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3 費用・収益の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>(1) 株式及び投資証券 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 受取配当金は、投資信託受益証券の収益分配金を、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (追加情報)

自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

平成24年4月2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 (10,000口当たり純資産額)	1.0652 円 10,652 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23年4月1日 至 平成24年4月2日	
1	<p><b>金融商品に対する取組方針</b> 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2	<p><b>金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</b> 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、(3)附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p>
3	<p><b>金融商品に係るリスク管理体制</b> 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;"><b>市場リスクの管理</b> 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;"><b>信用リスクの管理</b> 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;"><b>流動性リスクの管理</b> 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成24年4月2日現在	
1	<p><b>貸借対照表計上額、時価及び差額</b> 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ぬ。</p>
2	<p><b>時価の算定方法</b></p> <p style="padding-left: 20px;">株式、投資信託受益証券及び投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p style="padding-left: 20px;">派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(3)附属明細表に記載しております。</p> <p style="padding-left: 20px;">コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (その他の注記)

平成24年4月2日現在

1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成23年4月1日
期首元本額	214,049,082,506 円
期首より平成24年4月2日までの期中追加設定元本額	52,265,345,243 円
期首より平成24年4月2日までの期中一部解約元本額	56,655,451,475 円
期末元本額	209,658,976,274 円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	125,435,950 円
バランスセレクト50	392,889,571 円
バランスセレクト70	272,586,127 円
野村外国株式インデックスファンド	620,033,458 円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	6,396,419,738 円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	35,308,283,306 円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	14,247,080,859 円
野村資産設計ファンド2015	224,722,753 円
野村資産設計ファンド2020	115,242,122 円
野村資産設計ファンド2025	126,425,311 円
野村資産設計ファンド2030	112,191,011 円
野村資産設計ファンド2035	86,495,321 円
野村資産設計ファンド2040	355,298,652 円
野村外国株インデックス(野村投資一任口座向け)	620,399,102 円
のむらップ・ファンド(保守型)	430,066,901 円
のむらップ・ファンド(普通型)	1,780,963,102 円
のむらップ・ファンド(積極型)	2,606,917,286 円
野村資産設計ファンド2045	7,946,724 円
野村インデックスファンド・外国株式	377,716,017 円
マイ・ロード	103,453,105 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)	7,874,423,430 円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	1,402,319,717 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)	29,539,872,278 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)	13,539,056,669 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)	17,852,895 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)	77,761,826 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)	75,335,838 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)	289,440,712 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)	3,347,233,248 円
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,016,195,082 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)	835,316,807 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)	50,674,892 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)	539,301,999 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)	9,431,839,082 円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,247,614,619 円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,905,492 円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	20,340,614 円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	17,863,246 円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I(確定拠出年金向け)	54,648,471,840 円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,439,140,069 円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,423,661,999 円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,230,504,730 円
マイバランスDC30	551,533,940 円
マイバランスDC50	891,796,225 円
マイバランスDC70	570,422,418 円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I	6,267,530,191 円

\*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

(3) 附属明細表  
第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(平成24年4月2日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES	49,900	41.94	2,092,806.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	28,900	52.83	1,526,787.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	8,600	66.75	574,050.00	
	FMC TECHNOLOGIES INC	27,500	50.42	1,386,550.00	
	HALLIBURTON CO	106,600	33.19	3,538,054.00	
	HELMERICH & PAYNE	12,600	53.95	679,770.00	
	NABORS INDUSTRIES INC	33,200	17.49	580,668.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	49,500	79.47	3,933,765.00	
	NOBLE CORP	31,000	37.47	1,161,570.00	
	ROWAN COMPANIES INC	14,900	32.93	490,657.00	
	SCHLUMBERGER LTD	155,200	69.93	10,853,136.00	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	18,900	26.36	498,204.00	
	WEATHERFORD INTL LTD	87,500	15.09	1,320,375.00	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	24,500	15.21	372,645.00	
	ANADARKO PETE	58,200	78.34	4,559,388.00	
	APACHE CORPORATION	44,200	100.44	4,439,448.00	
	ARCH COAL INC	25,500	10.71	273,105.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	24,300	31.17	757,431.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	77,000	23.17	1,784,090.00	
	CHEVRON CORP	230,600	107.24	24,729,544.00	
	CIMAREX ENERGY CO	9,600	75.47	724,512.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	20,700	30.03	621,621.00	
	CONCHO RESOURCES INC	11,700	102.08	1,194,336.00	
	CONOCOPHILLIPS	145,900	76.01	11,089,859.00	
	CONSOL ENERGY INC	25,900	34.10	883,190.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,500	85.82	472,010.00	
	DENBURY RESOURCES INC	47,500	18.23	865,925.00	
	DEVON ENERGY CORP	44,700	71.12	3,179,064.00	
	EL PASO CORPORATION	88,500	29.55	2,615,175.00	
	ENERGEN CORP	8,100	49.15	398,115.00	
	EOG RESOURCES INC	31,100	111.10	3,455,210.00	
	EQT CORP	17,100	48.21	824,391.00	
	EXXON MOBIL CORP	555,300	86.73	48,161,169.00	
	HESS CORP	35,700	58.95	2,104,515.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	24,900	32.15	800,535.00	
	KINDER MORGAN INC	13,400	38.65	517,910.00	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,300	74.63	768,689.00	
	MARATHON OIL CORP	81,900	31.70	2,596,230.00	

MARATHON PETROLEUM CORP	41,300	43.36	1,790,768.00
MURPHY OIL CORP	20,800	56.27	1,170,416.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	14,800	34.68	513,264.00
NOBLE ENERGY INC	20,600	97.78	2,014,268.00
OCCIDENTAL PETE CORP	94,500	95.23	8,999,235.00
PEABODY ENERGY CO	31,200	28.96	903,552.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,500	111.59	1,394,875.00
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	17,000	42.65	725,050.00
QEP RESOURCES INC	21,600	30.50	658,800.00
RANGE RESOURCES CORP	19,100	58.14	1,110,474.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	41,400	30.60	1,266,840.00
SPECTRA ENERGY CORP	76,000	31.55	2,397,800.00
SUNOCO INC	11,900	38.15	453,985.00
ULTRA PETROLEUM CORP	16,700	22.63	377,921.00
VALERO ENERGY CORP	64,700	25.77	1,667,319.00
WHITING PETROLEUM CORP	14,300	54.30	776,490.00
WILLIAMS COS	68,700	30.81	2,116,647.00
AIR PRODUCTS	24,300	91.80	2,230,740.00
AIRGAS INC	8,800	88.97	782,936.00
CELANESE CORP-SERIES A	18,500	46.18	854,330.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,550	182.65	1,379,007.50
DOW CHEM CO	136,200	34.64	4,717,968.00
DU PONT E I DE NEMOURS	106,600	52.90	5,639,140.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	15,400	51.69	796,026.00
ECOLAB INC	34,600	61.72	2,135,512.00
FMC CORP	8,400	105.86	889,224.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	9,400	58.60	550,840.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34,100	43.65	1,488,465.00
MONSANTO CO	61,700	79.76	4,921,192.00
MOSAIC CO/THE	35,700	55.29	1,973,853.00
PPG INDUSTRIES	18,300	95.80	1,753,140.00
PRAXAIR INC	34,700	114.64	3,978,008.00
SHERWIN-WILLIAMS	10,100	108.67	1,097,567.00
SIGMA-ALDRICH	14,300	73.06	1,044,758.00

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,200	85.63	445,276.00	
	VULCAN MATERIALS CO	14,900	42.73	636,677.00	
	BALL CORP	18,600	42.88	797,568.00	
	CROWN HOLDINGS INC	17,600	36.83	648,208.00	
	OWENS-ILLINOIS INC	19,400	23.34	452,796.00	
	ROCK-TENN COMPANY CL-A	8,100	67.56	547,236.00	
	SEALED AIR CORP	20,900	19.31	403,579.00	
	ALCOA INC	126,700	10.02	1,269,534.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	11,900	41.17	489,923.00	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	16,400	69.26	1,135,864.00	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER & GOLD	110,800	38.04	4,214,832.00	
	NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	57,300	51.27	2,937,771.00	
	NUCOR CORP	37,300	42.95	1,602,035.00	
	UNITED STATES STEEL CORP	17,000	29.37	499,290.00	
	WALTER ENERGY INC	7,300	59.21	432,233.00	
	IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	48,900	35.10	1,716,390.00	
	MEADWESTVACO CORP	19,100	31.59	603,369.00	
	BOEING CO	81,500	74.37	6,061,155.00	
	GENERAL DYNAMICS	35,200	73.38	2,582,976.00	
	GOODRICH BF	14,600	125.44	1,831,424.00	
	HONEYWELL INTERNATIONAL	84,700	61.05	5,170,935.00	
	L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	11,200	70.77	792,624.00	
	LOCKHEED MARTIN	32,000	89.86	2,875,520.00	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	28,700	61.08	1,752,996.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	16,680	172.90	2,883,972.00	
	RAYTHEON COMPANY	39,900	52.78	2,105,922.00	
	ROCKWELL COLLINS INC	17,200	57.56	990,032.00	
	TEXTRON INC	32,700	27.83	910,041.00	
	UNITED TECHNOLOGIES	100,100	82.94	8,302,294.00	
	MASCO CORP	41,900	13.37	560,203.00	
	FLUOR CORP	19,500	60.04	1,170,780.00	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,700	44.37	652,239.00	
	KBR INC	16,500	35.55	586,575.00	
	QUANTA SERVICES INC	23,600	20.90	493,240.00	
	URS CORP	9,000	42.52	382,680.00	
	AMETEK INC	19,000	48.51	921,690.00	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	18,100	63.95	1,157,495.00	
	EMERSON ELEC	85,900	52.18	4,482,262.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	16,800	79.70	1,338,960.00	
	ROPER INDUSTRIES	11,200	99.16	1,110,592.00	
3M CORP	76,900	89.21	6,860,249.00		
DANAHER CORP	67,600	56.00	3,785,600.00		
GENERAL ELEC CO	1,222,400	20.07	24,533,568.00		
TYCO INTERNATIONAL LTD	53,400	56.18	3,000,012.00		

AGCO CORP	11,000	47.21	519,310.00
CATERPILLAR INC DEL	75,200	106.52	8,010,304.00
CUMMINS INC	21,200	120.04	2,544,848.00
DEERE & COMPANY	47,600	80.90	3,850,840.00
DOVER CORP	21,900	62.94	1,378,386.00
EATON CORP	36,300	49.83	1,808,829.00
FLOWSERVE CORP	6,800	115.51	785,468.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	50,300	57.12	2,873,136.00
INGERSOLL-RAND PLC	36,000	41.35	1,488,600.00
JOY GLOBAL INC	12,500	73.50	918,750.00
PACCAR	37,100	46.83	1,737,393.00
PALL CORP	13,800	59.63	822,894.00
PARKER HANNIFIN CORP	17,500	84.55	1,479,625.00
PENTAIR INC	11,300	47.61	537,993.00
SPX CORP	5,800	77.53	449,674.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,500	76.96	1,423,760.00
XYLEM INC	20,000	27.75	555,000.00
FASTENAL CO	33,100	54.10	1,790,710.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,750	214.81	1,449,967.50
AVERY DENNISON CORP	11,400	30.13	343,482.00
CINTAS CORP	13,900	39.12	543,768.00
IRON MOUNTAIN INC	15,500	28.80	446,400.00
PITNEY BOWES INC.	25,100	17.58	441,258.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	33,700	30.56	1,029,872.00
STERICYCLE INC	9,200	83.64	769,488.00
WASTE MANAGEMENT INC	50,600	34.96	1,768,976.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	19,600	65.49	1,283,604.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	24,300	46.51	1,130,193.00
FEDEX CORPORATION	34,900	91.96	3,209,404.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	83,500	80.72	6,740,120.00
DELTA AIR LINES INC	23,778	9.91	235,639.98
SOUTHWEST AIRLINES	19,900	8.24	163,976.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,100	21.50	195,650.00

[次へ](#)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	CSX CORP	122,200	21.52	2,629,744.00	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	32,400	15.04	487,296.00	
	HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	11,000	54.37	598,070.00	
	KANSAS CITY SOUTHERN	12,800	71.69	917,632.00	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	41,500	65.83	2,731,945.00	
	UNION PAC CORP	55,700	107.48	5,986,636.00	
	AUTOLIV INC	10,400	67.05	697,320.00	
	BORGWARNER INC	13,100	84.34	1,104,854.00	
	GOODYEAR TIRE & RUBR	29,200	11.22	327,624.00	
	JOHNSON CONTROLS INC	78,000	32.48	2,533,440.00	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	12,000	46.45	557,400.00	
	FORD MOTOR COMPANY	408,500	12.49	5,102,165.00	
	GENERAL MOTORS CO	91,200	25.65	2,339,280.00	
	HARLEY-DAVIDSON INC	27,400	49.08	1,344,792.00	
	DR HORTON INC	31,300	15.17	474,821.00	
	GARMIN LTD	13,400	46.95	629,130.00	
	LEGGETT & PLATT INC	17,100	23.01	393,471.00	
	MOHAWK INDUSTRIES	6,600	66.51	438,966.00	
	NEWELL RUBBERMAID INC	34,100	17.81	607,321.00	
	TOLL BROTHERS INC	17,300	23.99	415,027.00	
	WHIRLPOOL CORP	9,300	76.86	714,798.00	
	HASBRO INC	14,300	36.72	525,096.00	
	MATTEL INC	39,000	33.66	1,312,740.00	
	COACH INC	34,300	77.28	2,650,704.00	
	FOSSIL INC	6,100	131.98	805,078.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	11,800	74.68	881,224.00	
	NIKE INC-B	41,200	108.44	4,467,728.00	
	RALPH LAUREN CORPORATION	7,230	174.33	1,260,405.90	
	V F CORP	10,500	145.98	1,532,790.00	
	CARNIVAL CORP	51,600	32.08	1,655,328.00	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,610	418.00	1,508,980.00	
	DARDEN RESTAURANTS INC	15,000	51.16	767,400.00	
	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY	33,200	16.79	557,428.00	
	LAS VEGAS SANDS CORP	42,600	57.57	2,452,482.00	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	30,800	37.85	1,165,780.00	
	MCDONALD'S CORP	118,300	98.10	11,605,230.00	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,900	13.62	570,678.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,500	29.43	485,595.00	
	STARBUCKS CORP	85,900	55.89	4,800,951.00	
	STARWOOD HOTELS & RESORTS	22,900	56.41	1,291,789.00	
	WYNN RESORTS LTD	9,300	124.88	1,161,384.00	
	YUM BRANDS INC	53,400	71.18	3,801,012.00	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	25,100	14.68	368,468.00	

CBS CORP-CL B	70,500	33.91	2,390,655.00
COMCAST CORP SPECIAL CL-A	75,000	29.51	2,213,250.00
COMCAST CORP-CL A	243,300	30.01	7,301,433.00
DIRECTV	82,300	49.34	4,060,682.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	16,300	50.60	824,780.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	13,100	46.88	614,128.00
DISH NETWORK CORP-A	23,600	32.93	777,148.00
DISNEY (WALT) CO	197,200	43.78	8,633,416.00
INTERPUBRIC GROUP	56,600	11.41	645,806.00
LIBERTY GLOBAL INC	15,500	50.08	776,240.00
LIBERTY GLOBAL INC -SERIES C	12,800	47.89	612,992.00
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	12,900	88.15	1,137,135.00
MCGRAW-HILL COMPANIES	33,500	48.47	1,623,745.00
NEWS CORP-CLASS B	52,000	19.98	1,038,960.00
NEWS CORP-INC CL A	201,000	19.69	3,957,690.00
OMNICOM GROUP	32,500	50.65	1,646,125.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	10,900	48.69	530,721.00
SIRIUS XM RADIO INC	442,800	2.31	1,022,868.00
TIME WARNER CABLE-A	36,900	81.50	3,007,350.00
TIME WARNER INC	116,900	37.75	4,412,975.00
VIACOM INC-CLASS B	58,300	47.46	2,766,918.00
VIRGIN MEDIA INC	32,500	24.98	811,850.00
WASHINGTON POST-CL B	560	373.57	209,199.20
GENUINE PARTS CO	17,700	62.75	1,110,675.00
AMAZON.COM INC	42,320	202.51	8,570,223.20
EXPEDIA INC	11,700	33.44	391,248.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP	66,200	19.09	1,263,758.00
NETFLIX INC	6,200	115.04	713,248.00
PRICELINE.COM INC	5,770	717.50	4,139,975.00
DOLLAR GENERAL CORP	19,200	46.20	887,040.00
DOLLAR TREE INC	13,700	94.49	1,294,513.00
FAMILY DOLLAR STORES	11,200	63.28	708,736.00
J.C.PENNEY COMPANY INC	18,800	35.43	666,084.00
KOHL'S CORP	27,800	50.03	1,390,834.00

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	MACYS INC	48,400	39.73	1,922,932.00	
	NORDSTROM INC	19,300	55.72	1,075,396.00	
	SEARS HOLDINGS CORP	5,400	66.25	357,750.00	
	TARGET CORP	74,500	58.27	4,341,115.00	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	10,400	49.61	515,944.00	
	ADVANCE AUTO PARTS	8,400	88.57	743,988.00	
	AUTOZONE	2,740	371.80	1,018,732.00	
	BED BATH & BEYOND	28,000	65.77	1,841,560.00	
	BEST BUY COMPANY INC	34,700	23.68	821,696.00	
	CARMAX INC	26,600	34.65	921,690.00	
	GAMESTOP CORP-CLASS A	15,000	21.84	327,600.00	
	GAP INC	36,200	26.14	946,268.00	
	HOME DEPOT	178,200	50.31	8,965,242.00	
	LIMITED BRANDS	29,200	48.00	1,401,600.00	
	LOWES COS INC	145,300	31.38	4,559,514.00	
	OREILLY AUTOMOTIVE INC,	14,800	91.35	1,351,980.00	
	PETSMART	13,400	57.22	766,748.00	
	ROSS STORES INC	26,700	58.10	1,551,270.00	
	STAPLES INC	80,500	16.18	1,302,490.00	
	TIFFANY & CO	14,100	69.13	974,733.00	
	TJX COS INC	87,900	39.71	3,490,509.00	
	URBAN OUTFITTERS INC	14,800	29.11	430,828.00	
	COSTCO WHOLESALE CORPORATION	50,300	90.80	4,567,240.00	
	CVS CAREMARK CORP	150,300	44.80	6,733,440.00	
	KROGER CO	66,800	24.23	1,618,564.00	
	SAFEWAY INC	41,300	20.21	834,673.00	
	SYSCO CORP	69,100	29.86	2,063,326.00	
	WAL-MART STORES INC	219,300	61.20	13,421,160.00	
	WALGREEN	102,400	33.49	3,429,376.00	
	WHOLE FOODS MARKET INC	17,900	83.20	1,489,280.00	
	BEAM INC	16,400	58.57	960,548.00	
	BROWN-FORMAN CORP-CL B	10,000	83.39	833,900.00	
	COCA COLA CO	236,600	74.01	17,510,766.00	
	COCA COLA ENTERPRISES	35,700	28.60	1,021,020.00	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	19,800	23.59	467,082.00	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	25,300	40.21	1,017,313.00	
	MOLSON COORS BREWING CO-B	17,800	45.25	805,450.00	
	MONSTER BEVERAGE CORP	16,700	62.09	1,036,903.00	
	PEPSICO INC	180,800	66.35	11,996,080.00	
	ARCHER DANIELS MIDLAND	77,700	31.66	2,459,982.00	
BUNGE LIMITED	16,700	68.44	1,142,948.00		
CAMPBELL SOUP CO	21,600	33.85	731,160.00		
CONAGRA INC	49,400	26.26	1,297,244.00		
GENERAL MILLS	74,400	39.45	2,935,080.00		
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	15,200	46.84	711,968.00		
HEINZ HJ CO.	37,400	53.55	2,002,770.00		

HERSHEY CO/THE	18,600	61.33	1,140,738.00
HORMEL FOODS CORP	16,700	29.52	492,984.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	13,000	81.36	1,057,680.00
KELLOGG CO	29,800	53.63	1,598,174.00
KRAFT FOODS INC-A	195,200	38.01	7,419,552.00
MCCORMICK & CO INC.	14,200	54.43	772,906.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	23,400	82.48	1,930,032.00
RALCORP HOLDINGS INC	6,500	74.09	481,585.00
SARA LEE CO	64,800	21.53	1,395,144.00
TYSON FOODS INC-CL A	36,800	19.15	704,720.00
ALTRIA GROUP INC	237,500	30.87	7,331,625.00
LORILLARD INC	15,700	129.48	2,032,836.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	201,000	88.61	17,810,610.00
REYNOLDS AMERICAN INC	40,500	41.44	1,678,320.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	16,300	49.19	801,797.00
CLOROX CO	14,900	68.75	1,024,375.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	55,800	97.78	5,456,124.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	7,800	74.18	578,604.00
KIMBERLY-CLARK CORP	45,900	73.89	3,391,551.00
PROCTER & GAMBLE CO	318,500	67.21	21,406,385.00
AVON PRODUCTS INC	50,900	19.36	985,424.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27,000	61.94	1,672,380.00
HERBALIFE LTD	13,800	68.82	949,716.00
BARD (C R)	9,700	98.72	957,584.00
BAXTER INTERNATIONAL INC.	65,400	59.78	3,909,612.00
BECTON,DICKINSON	25,300	77.65	1,964,545.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	168,500	5.98	1,007,630.00
CAREFUSION CORP	25,400	25.93	658,622.00
COVIDIEN PLC	56,200	54.68	3,073,016.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	17,400	40.13	698,262.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13,600	72.73	989,128.00

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	HOLOGIC INC	30,100	21.55	648,655.00	
	INTUITIVE SURGICAL INC	4,570	541.75	2,475,797.50	
	MEDTRONIC INC	122,600	39.19	4,804,694.00	
	ST JUDE MEDICAL INC	36,900	44.31	1,635,039.00	
	STRYKER CORP	33,900	55.48	1,880,772.00	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,800	68.96	882,688.00	
	ZIMMER HOLDINGS INC	20,600	64.28	1,324,168.00	
	AETNA INC	42,000	50.16	2,106,720.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	29,700	39.68	1,178,496.00	
	CARDINAL HEALTH INC	40,100	43.11	1,728,711.00	
	CIGNA CORP	32,500	49.25	1,600,625.00	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	17,000	35.57	604,690.00	
	DAVITA INC	10,500	90.17	946,785.00	
	EXPRESS SCRIPTS INC-COMMON	53,300	54.18	2,887,794.00	
	HCA HOLDINGS INC	20,200	24.74	499,748.00	
	HENRY SCHEIN INC	10,600	75.68	802,208.00	
	HUMANA INC	19,400	92.48	1,794,112.00	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,200	91.54	1,025,248.00	
	MCKESSON CORP	28,500	87.77	2,501,445.00	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	44,500	70.30	3,128,350.00	
	OMNICARE INC	13,100	35.57	465,967.00	
	PATTERSON COS INC	11,100	33.40	370,740.00	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	18,200	61.15	1,112,930.00	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	123,100	58.94	7,255,514.00	
	WELLPOINT INC	40,500	73.80	2,988,900.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,500	92.86	1,996,490.00	
	AMGEN INC	92,200	67.99	6,268,678.00	
	BIOGEN IDEC INC	26,700	125.97	3,363,399.00	
	CELGENE CORP	51,800	77.52	4,015,536.00	
	GILEAD SCIENCES INC	87,700	48.85	4,284,145.00	
	VERTEX PHARMACEUTICALS	25,100	41.01	1,029,351.00	
	ABBOTT LABS	180,100	61.29	11,038,329.00	
	ALLERGAN INC	35,500	95.43	3,387,765.00	
	BRISTOL MYERS SQUIBB	195,600	33.75	6,601,500.00	
	ELI LILLY & CO.	120,100	40.27	4,836,427.00	
	FOREST LABS INC.	30,600	34.69	1,061,514.00	
	HOSPIRA INC	18,700	37.39	699,193.00	
	JOHNSON & JOHNSON	316,100	65.96	20,849,956.00	
	MERCK & CO INC	352,600	38.40	13,539,840.00	
	MYLAN INC	49,000	23.45	1,149,050.00	
PERRIGO CO.	9,900	103.31	1,022,769.00		
PFIZER INC	889,800	22.66	20,162,868.00		
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	16,900	16.81	284,089.00		
WATSON PHARMACEUTICALS INC	14,500	67.06	972,370.00		
BB&T CORPORATION	81,500	31.39	2,558,285.00		

CIT GROUP INC	22,700	41.24	936,148.00
COMERICA INC	24,300	32.36	786,348.00
FIFTH THIRD BANCORP	106,100	14.05	1,490,705.00
KEYCORP	112,500	8.50	956,250.00
M & T BANK CORP	12,800	86.88	1,112,064.00
PNC FINANCIAL	60,600	64.49	3,908,094.00
REGIONS FINANCIAL CORP	148,000	6.59	975,320.00
SUNTRUST BKS INC.	61,600	24.17	1,488,872.00
US BANCORP	220,400	31.68	6,982,272.00
WELLS FARGO CO	579,900	34.14	19,797,786.00
BANK OF AMERICA CORP	1,172,100	9.57	11,216,997.00
CITIGROUP	338,200	36.55	12,361,210.00
CME GROUP INC	7,410	289.33	2,143,935.30
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,500	137.42	1,168,070.00
JPMORGAN CHASE & CO	439,900	45.98	20,226,602.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	24,000	26.10	626,400.00
MOODYS CORP	22,500	42.10	947,250.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	14,600	25.90	378,140.00
NYSE EURONEXT	30,500	30.01	915,305.00
ACE LTD	39,000	73.20	2,854,800.00
AFLAC INC	53,500	45.99	2,460,465.00
ALLEGHANY CORP	1,500	329.10	493,650.00
ALLSTATE CORP	57,800	32.92	1,902,776.00
AMERICAN INTL GROUP	63,200	30.83	1,948,456.00
AON CORP	34,200	49.06	1,677,852.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,700	37.24	584,668.00
ASSURANT INC	10,100	40.50	409,050.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	14,200	33.17	471,014.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	105,500	81.15	8,561,325.00
CHUBB CORP	32,300	69.11	2,232,253.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	18,000	34.51	621,180.00
EVEREST RE GROUP LTD	6,000	92.52	555,120.00

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	23,900	18.03	430,917.00	
	GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	55,900	8.32	465,088.00	
	HARTFORD FINANCIAL SERVICES	48,700	21.08	1,026,596.00	
	LINCOLN NATIONAL CORP	34,400	26.36	906,784.00	
	LOEWS CORP	37,500	39.87	1,495,125.00	
	MARSH & MCLENNAN COS	61,600	32.79	2,019,864.00	
	METLIFE INC	121,900	37.35	4,552,965.00	
	PARTNERRE LTD	7,800	67.89	529,542.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	34,900	29.51	1,029,899.00	
	PROGRESSIVE CO	67,600	23.18	1,566,968.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,800	63.39	3,473,772.00	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,000	75.73	454,380.00	
	TORCHMARK CORP	12,000	49.85	598,200.00	
	TRAVELERS COS INC/THE	48,100	59.20	2,847,520.00	
	UNUM GROUP	35,200	24.48	861,696.00	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	19,300	34.98	675,114.00	
	WR BERKLEY CORP	14,600	36.12	527,352.00	
	XL GROUP PLC	36,500	21.69	791,685.00	
	CBRE GROUP INC	34,200	19.96	682,632.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	20,400	36.70	748,680.00	
	EBAY INC	134,000	36.89	4,943,260.00	
	GOOGLE INC-CL A	29,630	641.24	18,999,941.20	
	VERISIGN INC	18,000	38.34	690,120.00	
	YAHOO! INC	134,900	15.22	2,053,178.00	
	ACCENTURE PLC-CL A	74,400	64.50	4,798,800.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,000	125.96	755,760.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESS	56,200	55.19	3,101,678.00	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	35,500	76.95	2,731,725.00	
	COMPUTER SCIENCE	18,100	29.94	541,914.00	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	27,000	33.12	894,240.00	
	FISERV INC	16,100	69.39	1,117,179.00	
	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	136,480	208.65	28,476,552.00	
	MASTERCARD INC-CLASS A	12,600	420.54	5,298,804.00	
	PAYCHEX INC	37,500	30.99	1,162,125.00	
	SAIC INC	31,900	13.20	421,080.00	
	TERADATA CORP	19,100	68.15	1,301,665.00	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	20,700	23.07	477,549.00	
	VISA INC-CLASS A SHARES	60,600	118.00	7,150,800.00	
	WESTERN UNION CO	71,300	17.60	1,254,880.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	58,500	12.82	749,970.00	
	ADOBE SYSTEMS INC.	56,100	34.31	1,924,791.00	
	AUTODESK INC.	25,600	42.32	1,083,392.00	

BMC SOFTWARE	19,100	40.16	767,056.00
CA INC	45,100	27.56	1,242,956.00
CITRIX SYSTEMS INC	21,300	78.91	1,680,783.00
ELECTRONIC ARTS	39,800	16.48	655,904.00
INTUIT INC	32,300	60.13	1,942,199.00
MICROSOFT CORP	876,700	32.25	28,273,575.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	28,800	25.58	736,704.00
ORACLE CORPORATION	466,900	29.16	13,614,804.00
RED HAT INC	22,900	59.89	1,371,481.00
SALESFORCE.COM INC	15,000	154.51	2,317,650.00
SYMANTEC CORP	87,300	18.70	1,632,510.00
SYNOPSYS INC	16,900	30.66	518,154.00
VMWARE INC - CLASS A	9,700	112.37	1,089,989.00
CISCO SYSTEMS	621,900	21.15	13,153,185.00
F5 NETWORKS INC	9,000	134.96	1,214,640.00
HARRIS CORP	13,000	45.08	586,040.00
JUNIPER NETWORKS INC	62,700	22.88	1,434,576.00
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS	32,500	39.24	1,275,300.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	32,000	50.83	1,626,560.00
QUALCOMM INC	194,500	68.02	13,229,890.00
APPLE INC	107,680	599.47	64,550,929.60
DELL INC	187,200	16.60	3,107,520.00
EMC CORP	235,600	29.88	7,039,728.00
HEWLETT PACKARD CO	229,200	23.83	5,461,836.00
NETAPP INC	42,900	44.77	1,920,633.00
SAN DISK CORPORATION	28,500	49.59	1,413,315.00
SEAGATE TECHNOLOGY	49,200	26.95	1,325,940.00
WESTERN DIGITAL	27,300	41.39	1,129,947.00
AMPHENOL CORP-CL A	19,000	59.77	1,135,630.00
ARROW ELECTRS INC	13,100	41.97	549,807.00
AVNET	17,800	36.39	647,742.00
CORNING INC	180,300	14.08	2,538,624.00
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	5,800	38.06	220,748.00
FLEXTRONICS INTL LTD	79,100	7.23	571,893.00
FLIR SYSTEMS INC	17,300	25.31	437,863.00

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	TE CONNECTIVITY LTD	48,800	36.75	1,793,400.00	
	XEROX CORP	162,600	8.08	1,313,808.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	65,800	8.02	527,716.00	
	ALTERA CORP.	38,100	39.82	1,517,142.00	
	ANALOG DEVICES INC	35,200	40.40	1,422,080.00	
	APPLIED MATERIALS	153,500	12.44	1,909,540.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	26,500	38.97	1,032,705.00	
	BROADCOM CORP-CL A	56,100	39.30	2,204,730.00	
	CREE INC	12,100	31.63	382,723.00	
	FIRST SOLAR INC	6,700	25.05	167,835.00	
	INTEL CORP	589,300	28.11	16,565,223.00	
	KLA TENCOR CORP	18,800	54.42	1,023,096.00	
	LAM RESEARCH	14,600	44.62	651,452.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	26,900	33.70	906,530.00	
	LSI CORP	63,100	8.68	547,708.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	61,500	15.73	967,395.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32,900	28.59	940,611.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY	21,800	37.20	810,960.00	
	MICRON TECHNOLOGY	106,300	8.10	861,030.00	
	NVIDIA CORP	71,600	15.39	1,101,924.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	133,500	33.61	4,486,935.00	
	XILINX INC	29,900	36.43	1,089,257.00	
	AT & T INC	686,000	31.23	21,423,780.00	
	CENTURYLINK INC	70,900	38.65	2,740,285.00	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CO	111,200	4.17	463,704.00	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	17,100	25.73	439,983.00	
	VERIZON COMMUNICATIONS	327,500	38.23	12,520,325.00	
	WINDSTREAM CORP	66,000	11.71	772,860.00	
	CROWN CASTLE INTL CORP	33,300	53.34	1,776,222.00	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	30,300	9.02	273,306.00	
	NII HOLDINGS INC	22,000	18.31	402,820.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	13,200	50.81	670,692.00	
	SPRINT NEXTEL CORP	346,300	2.85	986,955.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	56,300	38.58	2,172,054.00	
	DUKE ENERGY CORP	156,000	21.01	3,277,560.00	
	EDISON INTERNATIONAL	35,900	42.51	1,526,109.00	
	ENTERGY CORP	20,300	67.20	1,364,160.00	
	EXELON CORPORATION	98,000	39.21	3,842,580.00	
	FIRSTENERGY CORP	48,800	45.59	2,224,792.00	
	NEXTERA ENERGY INC	46,400	61.08	2,834,112.00	
NORTHEAST UTILITIES	20,700	37.12	768,384.00		
PEPCO HOLDINGS INC	26,500	18.89	500,585.00		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	12,500	47.90	598,750.00		
PPL CORPORATION	67,300	28.26	1,901,898.00		
PROGRESS ENERGY INC	34,300	53.11	1,821,673.00		

SOUTHERN CO.	100,700	44.93	4,524,451.00
ONEOK INC	11,200	81.66	914,592.00
ALLIANT ENERGY CORP	13,700	43.32	593,484.00
AMEREN CORPORATION	28,500	32.58	928,530.00
CENTERPOINT ENERGY INC	45,800	19.72	903,176.00
CONSOLIDATED EDISON INC	34,100	58.42	1,992,122.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	66,700	51.21	3,415,707.00
DTE ENERGY COMPANY	20,100	55.03	1,106,103.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	8,600	52.99	455,714.00
MDU RESOURCES GROUP INC	23,100	22.39	517,209.00
NISOURCE INC	32,500	24.35	791,375.00
NSTAR	12,200	48.63	593,286.00
PG&E CORP	46,900	43.41	2,035,929.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	58,900	30.61	1,802,929.00
SCANA CORP	14,100	45.61	643,101.00
SEMPRA ENERGY	26,300	59.96	1,576,948.00
WISCONSIN ENERGY CORP	26,100	35.18	918,198.00
XCEL ENERGY INC	55,600	26.47	1,471,732.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,700	34.03	704,421.00
HUDSON CITY BANCORP INC	53,400	7.31	390,354.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	51,300	13.91	713,583.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL IN	40,300	13.24	533,572.00
AMERICAN EXPRESS CO	120,700	57.86	6,983,702.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	58,000	55.74	3,232,920.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	63,600	33.34	2,120,424.00
SLM CORPORATION	57,800	15.76	910,928.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	26,100	57.13	1,491,093.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	141,300	24.13	3,409,569.00
BLACKROCK INC	12,120	204.90	2,483,388.00
EATON VANCE CORP	13,500	28.58	385,830.00
FRANKLIN RESOURCES INC	18,000	124.03	2,232,540.00
GOLDMAN SACHS GROUP	54,000	124.37	6,715,980.00

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考	
			単価	金額		
米ドル	INVESCO LTD	52,200	26.67	1,392,174.00		
	LEGG MASON INC	14,600	27.93	407,778.00		
	MORGAN STANLEY	167,400	19.64	3,287,736.00		
	NORTHERN TRUST CORP	24,600	47.45	1,167,270.00		
	SCHWAB(CHARLES)CORP	124,900	14.37	1,794,813.00		
	SEI INVESTMENTS COMPANY	18,300	20.69	378,627.00		
	STATE STREET CORP	57,200	45.50	2,602,600.00		
	T ROWE PRICE GROUP INC	29,100	65.30	1,900,230.00		
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	26,200	19.74	517,188.00		
	APOLLO GROUP-A	13,100	38.64	506,184.00		
	H & R BLOCK INC	34,300	16.47	564,921.00		
	AES CORP	78,700	13.07	1,028,609.00		
	CALPINE CORP	36,800	17.21	633,328.00		
	NRG ENERGY INC	28,200	15.67	441,894.00		
	CERNER CORP	17,000	76.16	1,294,720.00		
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	41,100	44.51	1,829,361.00		
	COVANCE INC	7,500	47.63	357,225.00		
	ILLUMINA INC	13,600	52.61	715,496.00		
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	20,800	48.82	1,015,456.00		
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43,400	56.38	2,446,892.00		
	WATERS CORP	10,800	92.66	1,000,728.00		
	DUN & BRADSTREET CORP	5,700	84.73	482,961.00		
	EQUIFAX INC	14,900	44.26	659,474.00		
	IHS INC-CLASS A	4,800	93.65	449,520.00		
	MANPOWER GROUP	9,500	47.37	450,015.00		
	NIELSEN HOLDINGS NV	11,100	30.14	334,554.00		
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	16,500	30.30	499,950.00		
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	15,700	46.97	737,429.00		
	計	銘柄数：562			1,494,062,200.88	
					(124,305,975,113)	
		組入時価比率：55.7%			58.0%	
	カナダドル	PRECISION DRILLING CORP	24,900	10.02	249,498.00	
		ARC RESOURCES LTD	34,300	22.90	785,470.00	
ATHABASCA OIL SANDS CORP		36,600	11.09	405,894.00		
BAYTEX ENERGY CORP		14,100	51.79	730,239.00		
BONAVISTA ENERGY CORP		17,000	20.20	343,400.00		
CAMECO CORP		44,500	21.41	952,745.00		
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		126,100	33.06	4,168,866.00		
CANADIAN OIL SANDS LTD		56,900	21.04	1,197,176.00		
CENOVUS ENERGY INC		86,600	35.90	3,108,940.00		
CRESCENT POINT ENERGY CORP		33,000	42.94	1,417,020.00		
ENBRIDGE INC		86,200	38.74	3,339,388.00		
ENCANA CORP		85,600	19.59	1,676,904.00		
ENERPLUS CORP		23,500	22.34	524,990.00		

HUSKY ENERGY INC	39,200	25.38	994,896.00
IMPERIAL OIL	34,500	45.32	1,563,540.00
MEG ENERGY CORP	14,400	38.46	553,824.00
NEXEN INC	62,600	18.29	1,144,954.00
NIKO RESOURCES LTD	5,500	35.09	192,995.00
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	30,300	29.14	882,942.00
PEMBINA PIPELINE CORP	19,100	28.18	538,238.00
PENGROWTH ENERGY CORP	43,200	9.35	403,920.00
PENN WEST PETROLEUM LTD	53,700	19.49	1,046,613.00
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	23,300	10.00	233,000.00
SUNCOR ENERGY INC	182,900	32.59	5,960,711.00
TALISMAN ENERGY	119,900	12.54	1,503,546.00
TOURMALINE OIL CORP	15,500	22.05	341,775.00
TRANSCANADA CORP	80,900	42.83	3,464,947.00
VERMILION ENERGY INC	10,400	46.01	478,504.00
AGRIUM INC	18,200	86.09	1,566,838.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	98,700	45.54	4,494,798.00
AGNICO EAGLE MINES	19,500	33.24	648,180.00
BARRICK GOLD	116,100	43.35	5,032,935.00
CENTERRA GOLD INC	18,900	15.51	293,139.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	76,700	13.70	1,050,790.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,700	19.02	1,078,434.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,000	42.89	643,350.00
GOLDCORP INC	93,300	44.96	4,194,768.00
IAMGOLD CORP	44,000	13.28	584,320.00
INMET MINING CORPORATION	6,000	56.40	338,400.00
IVANHOE MINES LTD	32,500	15.69	509,925.00
KINROSS GOLD CORP	131,300	9.75	1,280,175.00
NEW GOLD INC	48,300	9.85	475,755.00
OSISKO MINING CORP	38,100	11.58	441,198.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	10,800	22.01	237,708.00

[次へ](#)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
カナダドル	SILVER WHEATON CORP	41,600	33.08	1,376,128.00	
	TECK RESOURCES LTD	67,100	35.61	2,389,431.00	
	YAMANA GOLD INC	87,800	15.56	1,366,168.00	
	SINO-FOREST CORP	28,000	2.40	67,340.00	
	BOMBARDIER B SHEARS	164,400	4.14	680,616.00	
	CAE INC	32,500	10.23	332,475.00	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	17,500	39.93	698,775.00	
	FINNING INTERNATIONAL INC	20,000	27.47	549,400.00	
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,100	23.76	287,496.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	51,900	79.27	4,114,113.00	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	19,700	75.71	1,491,487.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	24,200	47.56	1,150,952.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	14,400	27.45	395,280.00	
	TIM HORTONS INC	18,700	53.36	997,832.00	
	SHAW COMMUNICATIONS-B	43,900	21.11	926,729.00	
	THOMSON REUTERS CORP	42,800	28.84	1,234,352.00	
	CANADIAN TIRE CORP LTD A	9,200	64.46	593,032.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	14,300	32.75	468,325.00	
	EMPIRE CO LTD A	3,800	57.60	218,880.00	
	LOBLAW COMPANIES	13,100	34.02	445,662.00	
	METRO INC	12,100	53.19	643,599.00	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	25,000	43.80	1,095,000.00	
	WESTON(GEORGE)LTD	5,900	63.33	373,647.00	
	SAPUTO INC	16,400	43.21	708,644.00	
	VITERRA INC	41,700	15.91	663,447.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	33,200	53.49	1,775,868.00	
	BANK OF MONTREAL	73,600	59.30	4,364,480.00	
	BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	126,700	55.88	7,079,996.00	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	46,100	76.24	3,514,664.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	18,300	79.37	1,452,471.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	166,300	57.81	9,613,803.00	
	TORONTO DOMINION BANK	104,300	84.66	8,830,038.00	
	ONEX CORP	10,900	36.71	400,139.00	
TMX GROUP INC	9,100	44.80	407,680.00		
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,250	402.59	905,827.50		
GREAT-WEST LIFECO INC	32,200	24.54	790,188.00		
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,600	30.58	293,568.00		
INTACT FINANCIAL CORP	15,300	60.03	918,459.00		
MANULIFE FINANCIAL CORP	207,400	13.51	2,801,974.00		
POWER CORPORATION OF CANADA	40,200	26.44	1,062,888.00		
POWER FINANCIAL CORP	29,500	29.34	865,530.00		

	SUN LIFE FINANCIAL INC	67,100	23.67	1,588,257.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	64,000	31.47	2,014,080.00	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	29,100	17.35	504,885.00	
	OPEN TEXT CORP	6,900	60.99	420,831.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	25,500	22.23	566,865.00	
	RESEARCH IN MOTION	53,200	14.63	778,316.00	
	BCE INC	29,600	39.94	1,182,224.00	
	BELL ALIANT INC	9,500	27.30	259,350.00	
	TELUS CORP	5,500	57.88	318,340.00	
	TELUS CORPORATION-NON VOTE	19,000	56.75	1,078,250.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	46,100	39.60	1,825,560.00	
	FORTIS INC	22,500	32.27	726,075.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,500	65.06	683,130.00	
	CI FINANCIAL CORP	18,100	22.74	411,594.00	
	IGM FINANCIAL INC	14,000	46.45	650,300.00	
	TRANSALTA CORP	23,200	18.70	433,840.00	
計	銘柄数：101			142,863,928.50	
				(11,923,423,472)	
	組入時価比率：5.3%			5.6%	
英ポンド	AMEC PLC	38,500	11.08	426,580.00	
	PETROFAC LTD	29,100	17.40	506,340.00	
	BG GROUP PLC	395,000	14.48	5,719,600.00	
	BP PLC	2,194,500	4.62	10,150,659.75	
	ESSAR ENERGY PLC	35,700	1.55	55,442.10	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	421,300	21.83	9,199,085.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	307,800	21.99	6,770,061.00	
	TULLOW OIL PLC	105,700	15.27	1,614,039.00	
	JOHNSON MATTHEY	24,200	23.59	570,878.00	
	REXAM PLC	102,200	4.28	437,518.20	
	ANGLO AMERICAN PLC	153,800	23.37	3,594,306.00	
	ANTOFAGASTA PLC	46,700	11.52	537,984.00	
	BHP BILLITON PLC	245,600	19.07	4,684,820.00	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	30,900	5.92	183,082.50	
	FRESNILLO PLC	21,100	15.98	337,178.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
英ポンド	GLENCORE INTERNATIONAL	162,500	3.89	632,775.00	
	KAZAKHMYS PLC	26,400	9.08	239,712.00	
	LONMIN PLC	18,300	10.22	187,026.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	11,000	53.70	590,700.00	
	RIO TINTO PLC-REG	158,500	34.46	5,461,910.00	
	VEDANTA RESOURCES PLC	13,400	12.28	164,552.00	
	XSTRATA PLC	244,500	10.68	2,611,260.00	
	BAE SYSTEMS PLC	375,600	2.99	1,126,424.40	
	COBHAM PLC	131,200	2.29	300,579.20	
	MEGGITT PLC	88,700	4.03	358,259.30	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	216,500	8.12	1,757,980.00	
	BALFOUR BEATTY PLC	76,500	2.85	218,407.50	
	SMITHS GROUP PLC	46,600	10.52	490,232.00	
	INVENSYS PLC	98,700	1.99	196,413.00	
	WEIR GROUP PLC	24,200	17.64	426,888.00	
	BUNZLE	37,100	10.04	372,484.00	
	WOLSELEY PLC	33,400	23.84	796,256.00	
	AGGREKO PLC	31,500	22.50	708,750.00	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	44,500	7.96	354,442.50	
	G4S PLC	167,100	2.72	455,347.50	
	SERCO GROUP PLC	54,900	5.42	297,832.50	
	GKN PLC	175,000	2.06	360,675.00	
	BURBERRY GROUP PLC	52,000	14.97	778,440.00	
	CARNIVAL PLC	20,300	19.98	405,594.00	
	COMPASS GROUP PLC	221,500	6.55	1,451,932.50	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	33,600	14.53	488,208.00	
	TUI TRAVEL PLC	50,000	1.96	98,150.00	
	WHITBREAD PLC	20,200	18.44	372,488.00	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	129,500	6.76	875,420.00	
	ITV PLC	421,000	0.88	371,953.50	
	PEARSON	94,500	11.65	1,100,925.00	
	REED ELSEVIER PLC	140,700	5.55	780,885.00	
	WPP PLC	148,900	8.54	1,272,350.50	
	MARKS & SPENCER PLC	185,000	3.79	701,150.00	
	NEXT PLC	20,700	29.83	617,481.00	
	KINGFISHER PLC	268,700	3.06	824,102.90	
	MORRISON SUPERMARKETS	249,100	2.98	742,318.00	
	SAINSBURY	144,600	3.11	450,139.80	
	TESCO PLC	924,400	3.30	3,050,520.00	
	DIAGEO PLC	290,500	15.02	4,364,762.50	
	SABMILLER PLC	109,900	25.09	2,757,940.50	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	41,300	12.20	503,860.00		
TATE & LYLE ORD.	53,500	7.05	377,175.00		
UNILEVER PLC	148,000	20.64	3,054,720.00		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	227,800	31.50	7,176,839.00		

	IMPERIAL TABACCO GROUP	117,000	25.35	2,965,950.00	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	72,300	35.33	2,554,359.00	
	SMITH & NEPHEW PLC	105,700	6.33	669,609.50	
	ASTRAZENECA PLC	150,400	27.79	4,179,616.00	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	583,900	13.96	8,154,163.50	
	SHIRE PLC	65,700	20.20	1,327,140.00	
	BARCLAYS PLC	1,336,300	2.35	3,143,645.75	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,068,100	5.54	11,473,818.80	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,823,000	0.33	1,620,769.15	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,097,000	0.27	579,610.80	
	STANDARD CHARTERED PLC	276,900	15.60	4,319,640.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	17,800	10.34	184,052.00	
	ADMIRAL GROUP PLC	22,100	11.87	262,327.00	
	AVIVA PLC	343,000	3.31	1,137,045.00	
	LEGAL & GENERAL	672,900	1.30	879,480.30	
	OLD MUTUAL PLC	638,700	1.58	1,012,978.20	
	PRUDENTIAL PLC	295,200	7.47	2,206,620.00	
	RESOLUTION LTD	155,500	2.61	406,321.50	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	399,700	1.04	418,086.20	
	STANDARD LIFE PLC	271,500	2.29	623,635.50	
	SAGE GROUP PLC (THE)	153,000	2.99	457,776.00	
	ARM HOLDINGS PLC	153,900	5.92	911,088.00	
	BT GROUP PLC	899,600	2.26	2,036,694.40	
	INMARSAT PLC	48,300	4.60	222,324.90	
	VODAFONE GROUP PLC	5,817,800	1.72	10,018,251.60	
	SSE PLC	109,400	13.29	1,453,926.00	
	CENTRICA PLC	598,400	3.16	1,893,337.60	
	NATIONAL GRID PLC	410,000	6.30	2,585,050.00	
	SEVERN TRENT PLC	27,300	15.44	421,512.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	78,800	6.01	473,982.00	
	3I GROUP PLC	118,200	2.14	252,948.00	
	ICAP PLC	67,900	3.92	266,711.20	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
英ポンド	INVESTEC PLC	64,200	3.82	245,436.60	
	MAN GROUP PLC	204,700	1.34	275,935.60	
	SCHRODERS PLC	12,800	15.80	202,240.00	
	INTERNATIONAL POWER	180,500	4.05	731,025.00	
	CAPITA PLC	73,300	7.32	536,922.50	
	EXPERIAN PLC	116,800	9.74	1,138,216.00	
	INTERTEK GROUP PLC	18,700	25.11	469,557.00	
	計	銘柄数：99			168,225,637.75
				(22,384,103,359)	
	組入時価比率：10.0%			10.5%	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	40,370	49.25	1,988,222.50	
	GIVAUDAN-REG	1,000	870.00	870,000.00	
	SIKA AG-BR	250	1,954.00	488,500.00	
	SYNGENTA AG	11,040	312.10	3,445,584.00	
	HOLCIM LTD-REG	28,240	58.90	1,663,336.00	
	GEBERIT AG-REG	4,630	188.90	874,607.00	
	ABB LTD	252,790	18.52	4,681,670.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,410	107.90	260,039.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,530	108.60	600,558.00	
	SULZER AG-REG	2,880	128.30	369,504.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6,180	122.10	754,578.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	60,910	56.60	3,447,506.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,570	415.50	1,483,335.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,000	72.55	362,750.00	
	ARYZTA AG	10,420	44.60	464,732.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	180	904.50	162,810.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	97	2,900.00	281,300.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	13	33,595.00	436,735.00	
	NESTLE SA-REG	382,070	56.80	21,701,576.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,810	100.30	582,743.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	860	153.60	132,096.00	
	SYNTHES INC	7,560	156.60	1,183,896.00	
	ACTELION LTD	13,440	33.00	443,520.00	
	NOVARTIS-REG	270,030	49.96	13,490,698.80	
	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	81,280	157.10	12,769,088.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	3,430	64.90	222,607.00	
	BALOISE HOLDING AG	5,530	72.70	402,031.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,410	107.40	366,234.00	
	SWISS RE LTD	39,610	57.65	2,283,516.50	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	17,210	242.60	4,175,146.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,760	364.90	1,007,124.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	132,260	25.73	3,403,049.80	
GAM HOLDING AG	21,540	13.15	283,251.00		

	JULIUS BAER GROUP LTD	24,830	36.44	904,805.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,410	176.10	248,301.00	
	UBS AG-REG	422,890	12.65	5,349,558.50	
	LONZA AG-REG	5,350	46.66	249,631.00	
	ADECCO SA-REG	15,540	47.30	735,042.00	
	SGS SA-REG	621	1,756.00	1,090,476.00	
計	銘柄数：39			93,660,158.10	
				(8,634,529,975)	
	組入時価比率：3.9%			4.0%	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	25,500	141.80	3,615,900.00	
	BOLIDEN AB	30,000	103.90	3,117,000.00	
	SSAB AB-A SHARES	19,400	62.55	1,213,470.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,100	181.70	1,290,070.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	66,500	114.60	7,620,900.00	
	ASSA ABLOY AB-B	37,200	207.80	7,730,160.00	
	SKANSKA AB-B SHS	44,800	114.70	5,138,560.00	
	ALFA LAVAL AB	40,200	136.10	5,471,220.00	
	ATLAS COPCO AB-A	78,300	160.10	12,535,830.00	
	ATLAS COPCO AB-B	45,600	142.60	6,502,560.00	
	SANDVIK AB	115,400	95.50	11,020,700.00	
	SCANIA AB-B	37,900	137.60	5,215,040.00	
	SKF AB-B SHARES	46,400	161.50	7,493,600.00	
	VOLVO AB-B	162,200	96.40	15,636,080.00	
	SECURITAS AB-B SHS	36,600	63.80	2,335,080.00	
	ELECTROLUX AB-B	27,800	139.90	3,889,220.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	49,500	39.91	1,975,545.00	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	5,500	364.40	2,004,200.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	117,800	239.40	28,201,320.00	
	SWEDISH MATCH AB	25,100	263.40	6,611,340.00	
	GETINGE AB-B SHS	23,000	188.40	4,333,200.00	
	NORDEA BANK AB	304,300	60.15	18,303,645.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
スウェーデン クローナ	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	165,300	47.00	7,769,100.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	56,800	210.90	11,979,120.00	
	SWEDBANK AB	94,100	102.80	9,673,480.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	15,600	98.30	1,533,480.00	
	INVESTOR AB-B SHS	52,600	146.70	7,716,420.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	23,700	153.90	3,647,430.00	
	ERICSSON LM-B	346,500	68.55	23,752,575.00	
	HEXAGON AB-B SHS	30,300	128.40	3,890,520.00	
	TELE 2 AB-B SHS	36,600	135.00	4,941,000.00	
	TELIA AB	252,100	46.14	11,631,894.00	
	MILICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	8,700	750.00	6,525,000.00	
	RATOS AB-B SHS	20,900	91.85	1,919,665.00	
	計	銘柄数：34			256,234,324.00
				(3,228,552,482)	
	組入時価比率：1.4%			1.5%	
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	17,600	96.35	1,695,760.00	
	SEADRILL LTD	38,700	213.40	8,258,580.00	
	SUBSEA 7 SA	32,900	150.80	4,961,320.00	
	STATOIL ASA	128,400	154.60	19,850,640.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	21,400	271.60	5,812,240.00	
	NORSK HYDRO	109,700	31.01	3,401,797.00	
	ORKLA ASA	91,700	45.06	4,132,002.00	
	DNB ASA	113,300	73.20	8,293,560.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24,900	67.25	1,674,525.00	
	TELENOR ASA	82,500	105.60	8,712,000.00	
	計	銘柄数：10			66,792,424.00
				(978,509,011)	
	組入時価比率：0.4%			0.5%	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	27,100	162.50	4,403,750.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,700	56.60	1,511,220.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	64	41,040.00	2,626,560.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	155	43,080.00	6,677,400.00	
	DSV A/S	21,000	126.50	2,656,500.00	
	CARLSBERG B	12,100	461.00	5,578,100.00	
	COLOPLAST-B	2,500	966.00	2,415,000.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,830	520.00	1,471,600.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	49,400	772.50	38,161,500.00	
	DANSKE BANK AS	75,500	94.50	7,134,750.00	
	TRYG A/S	3,260	314.60	1,025,596.00	
	TDC A/S	54,900	40.58	2,227,842.00	
	計	銘柄数：12			75,889,818.00
				(1,132,276,084)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	

ユ-ロ	CIE GENERALE GEOPHYSIQUE	17,030	22.19	377,895.70	
	FUGRO NV CVA	7,800	53.42	416,676.00	
	SAIPEM	30,400	38.73	1,177,392.00	
	SBM OFFSHORE NV	20,100	15.32	308,032.50	
	TECHNIP SA	11,400	88.33	1,006,962.00	
	TENARIS SA	53,400	14.30	763,620.00	
	ENI SPA	279,400	17.59	4,914,646.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	26,500	12.34	327,010.00	
	NESTE OIL OYJ	14,100	9.23	130,213.50	
	OMV AG	19,100	26.65	509,015.00	
	REPSOL YPF SA	92,800	18.81	1,745,568.00	
	TOTAL SA	245,500	38.24	9,387,920.00	
	AIR LIQUIDE	32,700	99.96	3,268,692.00	
	AKZO NOBEL	27,600	44.27	1,221,852.00	
	ARKEMA	6,600	69.87	461,142.00	
	BASF SE	106,200	65.59	6,965,658.00	
	K+S AG	19,800	39.22	776,655.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	18,200	43.38	789,607.00	
	LANXESS	9,700	61.98	601,206.00	
	LINDE AG	19,910	134.55	2,678,890.50	
	SOLVAY SA	6,900	88.77	612,513.00	
	UMICORE	13,800	41.30	570,009.00	
	WACKER CHEMIE AG	1,890	66.11	124,947.90	
	CIMPOR CIMENTOS DE PORTUGAL	24,400	5.00	122,000.00	
	CRH PLC	84,500	15.30	1,292,850.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	16,560	45.38	751,575.60	
	IMERYS	3,970	45.59	180,992.30	
	LAFARGE SA	23,790	35.78	851,325.15	
	ACERINOX SA	10,000	9.63	96,370.00	
	ARCELORMITTAL	100,200	14.33	1,435,866.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	SALZGITTER AG	4,630	41.09	190,269.85	
	THYSSENKRUPP AG	44,600	18.66	832,459.00	
	VOESTALPINE AG	12,300	25.21	310,144.50	
	STORA ENSO OYJ-R	65,200	5.57	363,164.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	61,700	10.21	629,957.00	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	48,400	30.70	1,486,122.00	
	FINMECCANICA SPA	49,300	4.06	200,158.00	
	SAFRAN SA	18,800	27.55	518,034.00	
	THALES (EX THOMSON-CSF)	11,530	28.06	323,531.80	
	COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	46,900	33.48	1,570,446.50	
	ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	16,760	19.19	321,624.40	
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,400	28.16	236,586.00	
	BOUYGUES	21,800	22.93	499,874.00	
	EIFFAGE	4,940	29.01	143,309.40	
	FERROVIAL SA	44,240	8.61	381,260.32	
	FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA	7,190	16.75	120,432.50	
	HOCHTIEF AG	5,140	45.49	233,818.60	
	VINCI	51,900	39.10	2,029,290.00	
	ALSTOM	24,350	29.26	712,481.00	
	BEKAERT NV	4,300	24.15	103,866.50	
	LEGRAND SA	26,420	27.59	728,927.80	
	PRYSMIAN SPA	23,000	13.18	303,140.00	
	SCHNEIDER SA	57,100	48.99	2,797,329.00	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	116,500	15.20	1,770,800.00	
	SIEMENS AG	95,100	75.59	7,188,609.00	
	WENDEL	3,970	64.05	254,278.50	
	FIAT INDUSTRIAL	89,100	8.00	712,800.00	
	GEA GROUP AG	20,570	25.86	531,940.20	
	KONE OYJ	18,000	41.77	751,860.00	
	MAN SE	7,460	99.83	744,731.80	
	METSO OYJ	14,900	32.05	477,545.00	
	VALLOUREC	13,360	47.50	634,600.00	
	WARTSILA OYJ	20,300	28.28	574,084.00	
	ZARDOYA OTIS S.A	18,960	9.71	184,101.60	
	BRENNTAG AG	5,200	91.82	477,464.00	
	BIC	3,580	75.24	269,359.20	
	EDENRED	18,570	22.56	418,939.20	
	DEUTSCHE POST AG-REG	98,500	14.43	1,421,847.50	
	TNT EXPRESS NV - W/I	41,800	9.26	387,068.00	
	DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	25,000	10.49	262,375.00	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	108,000	2.15	233,172.00	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	44,900	12.76	573,148.50	
	ADP	4,230	61.54	260,314.20	
	ATLANTIA SPA	38,100	12.45	474,345.00	

FRAPORT AG	3,800	46.95	178,410.00
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	62,200	6.51	405,046.40
VOPAK	8,100	43.19	349,879.50
CONTINENTAL AG	9,300	70.77	658,161.00
MICHELIN B	20,900	55.83	1,166,847.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	12,900	36.54	471,366.00
PIRELLI&CO	26,200	8.92	233,704.00
BAYER MOTOREN WERK	38,600	67.43	2,602,798.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	6,550	44.53	291,704.25
DAIMLER AG	104,600	45.21	4,728,966.00
FIAT SPA-ORD	88,400	4.40	389,667.20
PEUGEOT CITROEN	19,430	12.07	234,617.25
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	17,900	44.25	792,075.00
RENAULT	21,800	39.52	861,645.00
VOLKSWAGEN AG	3,310	120.90	400,179.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	16,730	131.85	2,205,850.50
ADIDAS AG	24,400	58.54	1,428,376.00
CHRISTIAN DIOR SA	6,440	115.05	740,922.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,800	27.15	374,670.00
LVMH	29,270	128.85	3,771,439.50
ACCOR SA	16,700	26.77	447,059.00
AUTOGRILL SPA	15,600	7.91	123,474.00
OPAP SA	25,700	7.27	186,839.00
SODEXO	10,900	61.56	671,004.00
AXEL SPRINGER AG	4,800	37.87	181,776.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14,800	27.72	410,256.00
JC DECAUX INTERNATIONAL	6,900	22.91	158,079.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	10,100	46.31	467,731.00
LAGARDERE S.C.A	13,580	23.13	314,105.40
MEDIASET SPA-ORD	83,500	2.06	172,678.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	8,620	19.27	166,107.40
PUBLICIS GROUPE	16,950	41.33	700,628.25
REED ELSEVIER NV	78,700	9.57	753,631.20

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	SANOMA OYJ	9,000	9.60	86,400.00	
	SES FDR	35,900	18.60	667,919.50	
	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	14,350	9.18	131,747.35	
	WOLTERS KLUWER	34,700	14.20	492,740.00	
	PPR	8,830	129.00	1,139,070.00	
	INDITEX	25,000	71.82	1,795,500.00	
	CARREFOUR SUPERMARCHE	65,800	17.97	1,182,755.00	
	CASINO GUICHARD	6,540	73.90	483,306.00	
	COLRUYT SA	8,700	30.14	262,218.00	
	DELHAIZE GROUP	11,500	39.45	453,675.00	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	65,510	3.71	243,500.67	
	JERONIMO MARTINS	24,500	15.27	374,237.50	
	KESKO OYJ	8,200	24.33	199,506.00	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	135,400	10.39	1,406,806.00	
	METRO AG	14,800	28.99	429,052.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	93,300	54.78	5,110,974.00	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	20,800	14.35	298,480.00	
	HEINEKEN HOLDING NV	13,200	35.10	463,320.00	
	HEINEKEN NV	30,100	41.67	1,254,417.50	
	PERNOD-RICARD	23,200	78.40	1,818,880.00	
	DANONE	67,300	52.30	3,519,790.00	
	KERRY GROUP PLC-A	17,400	34.70	603,780.00	
	SUEDZUCKER AG	8,530	23.87	203,653.75	
	UNILEVER NV-CVA	189,300	25.51	4,829,989.50	
	HENKEL AG & CO KGAA	15,490	46.80	724,932.00	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	20,500	54.94	1,126,270.00	
	BEIERSDORF AG	11,970	48.92	585,632.25	
	LOREAL-ORD	27,800	92.49	2,571,222.00	
	ESSILOR INTERNATIONAL	23,400	66.83	1,563,822.00	
	CELESIO AG	10,830	13.57	146,963.10	
	FRESENIUS MEDICAL CARE	24,300	53.14	1,291,302.00	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	13,400	76.89	1,030,326.00	
	GRIFOLS SA	16,510	16.00	264,160.00	
	BAYER AG	96,100	52.74	5,068,314.00	
	ELAN CORPORATION PLC	63,600	10.97	698,010.00	
	MERCK KGAA	7,710	82.98	639,775.80	
	ORION OYJ	11,900	14.82	176,358.00	
	SANOFI	131,700	58.23	7,668,891.00	
	U.C.B. SA	11,800	32.35	381,730.00	
	BANCA CARIGE SPA	90,300	0.98	88,855.20	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	534,900	0.31	169,081.89	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	536,600	5.96	3,201,892.20	
	BANCO DE SABADELL SA	243,900	2.04	498,043.80	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	59,100	1.37	80,967.00	

	BANCO POPOLARE SPA	200,000	1.42	284,400.00	
	BANCO SANTANDER SA	991,600	5.77	5,721,532.00	
	BANKIA SA	94,400	2.71	256,390.40	
	BANKINTER S.A.	23,090	3.93	90,812.97	
	BCO POPULAR ESPANOL	123,360	2.69	331,838.40	
	BCO POPULAR ESPANOL-RIGHTS	123,360	0.03	4,308.96	
	BNP PARIBAS	112,200	35.57	3,991,515.00	
	CAIXABANK	86,820	2.91	253,427.58	
	COMMERZBANK AG	424,830	1.89	805,902.51	
	CREDIT AGRICOLE SA	115,600	4.66	538,696.00	
	ERSTE GROUP BANK AG	22,700	17.29	392,483.00	
	INTESA SANPAOLO	1,154,000	1.34	1,550,976.00	
	INTESA SANPAOLO-RNC	105,400	1.15	121,947.80	
	IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810			
	KBC GROUPE NV	18,100	18.81	340,461.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	121,800	1.92	233,856.00	
	NATIXIS	102,100	2.88	294,558.50	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	4,900	26.50	129,850.00	
	SOCIETE GENERALE	76,700	21.96	1,684,715.50	
	UNICREDIT SPA	467,500	3.75	1,755,930.00	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	97,200	3.17	308,901.60	
	DEUTSCHE BOERSE AG	22,200	50.48	1,120,656.00	
	EURAZEO	3,140	38.15	119,791.00	
	EXOR SPA	6,500	18.93	123,045.00	
	GROUPE BRUXELLES LAM	9,600	58.04	557,184.00	
	ING GROEP NV	441,000	6.24	2,754,927.00	
	POHJOLA BANK PLC	14,200	8.30	117,931.00	
	AEGON NV	206,300	4.16	859,033.20	
	AGEAS	249,100	1.64	410,516.80	
	ALLIANZ SE	52,800	89.47	4,724,016.00	
	ASSICURAZIONI GENERALI	136,300	11.64	1,586,532.00	
	AXA	201,600	12.43	2,505,888.00	
	CNP ASSURANCES	16,400	11.70	191,880.00	

[次△](#)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	DELTA LLOYD NV	12,600	13.18	166,068.00	
	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	6,820	44.54	303,762.80	
	MAPFRE SA	85,780	2.41	207,072.92	
	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	20,760	113.05	2,346,918.00	
	SAMPO OYJ-A	48,100	21.67	1,042,327.00	
	SCOR SE	19,700	20.26	399,122.00	
	VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN	4,300	33.07	142,201.00	
	IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000			
	IMMOFINANZ AG	116,500	2.72	317,346.00	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	13,340	14.13	188,494.20	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	36,100	14.15	510,815.00	
	ATOS	5,300	43.24	229,198.50	
	CAP GEMINI SA	17,990	33.56	603,744.40	
	INDRA SISTEMAS SA	12,950	9.18	118,984.60	
	DASSAULT SYSTEMES SA	6,800	68.99	469,132.00	
	SAP AG	107,000	52.36	5,602,520.00	
	ALCATEL-LUCENT	267,000	1.70	455,235.00	
	NOKIA OYJ	429,300	4.08	1,752,402.60	
	NEOPOST SA	4,120	48.22	198,666.40	
	ASML HOLDING NV	49,500	37.48	1,855,260.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	123,400	7.66	945,984.40	
	STMICROELECTRONICS NV	73,790	6.12	452,111.33	
	BELGACOM SA	16,800	24.10	404,964.00	
	DEUTSCHE TELEKOM-REG	323,400	9.02	2,919,331.80	
	ELISA CORPORATION	17,800	17.97	319,866.00	
	FRANCE TELECOM SA	217,400	11.10	2,414,227.00	
	HELLENIC TELECOM	30,100	3.19	96,019.00	
	ILIAD SA	2,040	103.30	210,732.00	
	KONINKLIJKE KPN NV	170,100	8.24	1,402,984.80	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	85,100	4.07	347,122.90	
	TELECOM ITALIA SPA	1,087,000	0.89	969,060.50	
	TELECOM ITALIA-RNC	692,000	0.73	510,004.00	
	TELEFONICA SA	477,800	12.28	5,869,773.00	
	TELEKOM AUSTRIA AG	38,300	8.73	334,435.60	
	VIVENDI SA	144,100	13.76	1,982,816.00	
	MOBISTAR SA	3,800	37.35	141,930.00	
	ACCIONA S.A.	3,100	52.36	162,316.00	
	E.ON AG	207,600	17.96	3,728,496.00	
	ELECTRICITE DE FRANCE	27,900	17.11	477,369.00	
	ENEL SPA	771,100	2.71	2,091,223.20	
	ENERGIAS DE PORTUGAL	232,600	2.18	507,300.60	
	FORTUM OYJ	51,100	18.20	930,020.00	

	IBERDROLA SA	444,900	4.25	1,893,939.30	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	12,200	36.69	447,618.00	
	TERNA SPA	133,300	3.01	401,766.20	
	VERBUND AG	8,400	22.81	191,604.00	
	ENAGAS	19,500	14.43	281,385.00	
	GAS NATURAL SDG	40,000	11.98	479,200.00	
	SNAM SPA	189,400	3.60	682,976.40	
	A2A SPA	129,900	0.60	78,134.85	
	GDF SUEZ	142,500	19.37	2,760,225.00	
	RWE AG	56,900	35.80	2,037,304.50	
	RWE AG-NON VTG PFD	4,540	32.96	149,661.10	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	33,030	11.50	379,845.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,170	12.43	549,253.95	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	107,200	37.30	3,999,096.00	
	MEDIOBANCA SPA-ORD	60,400	4.40	266,001.60	
	EDP RENOVAVEIS SA	26,300	3.72	97,993.80	
	ENEL GREEN POWER SPA	192,500	1.42	274,312.50	
	QIAGEN NV	26,200	11.67	305,885.00	
	BUREAU VERITAS SA	6,400	66.00	422,400.00	
	RANDSTAD HOLDING NV	14,400	28.29	407,376.00	
計	銘柄数：246			254,371,907.85	
				(28,248,000,366)	
	組入時価比率：12.6%			13.2%	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	246,000	77.60	19,089,600.00	
	NWS HOLDINGS LTD	169,500	11.88	2,013,660.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	138,000	14.38	1,984,440.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	23,800	55.25	1,314,950.00	
	MTR CORP	167,500	27.80	4,656,500.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	82,500	27.25	2,248,125.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	153,000	21.45	3,281,850.00	
	SANDS CHINA LTD	282,000	30.35	8,558,700.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	158,333	16.98	2,688,494.34	
	SJM HOLDINGS LIMITED	198,000	15.80	3,128,400.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考	
			単価	金額		
香港ドル	WYNN MACAU LTD	186,800	22.70	4,240,360.00		
	LI & FUNG LTD	667,600	17.82	11,896,632.00		
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	80,000	19.70	1,576,000.00		
	BANK OF EAST ASIA	184,660	29.20	5,392,072.00		
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	439,500	21.45	9,427,275.00		
	HANG SENG BANK	90,900	103.20	9,380,880.00		
	WING HANG BANK LTD	19,000	77.15	1,465,850.00		
	FIRST PACIFIC CO	226,000	8.61	1,945,860.00		
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	117,400	130.50	15,320,700.00		
	AIA GROUP LTD	970,000	28.45	27,596,500.00		
	CHEUNG KONG	162,000	100.30	16,248,600.00		
	HANG LUNG GROUP LTD	106,000	50.25	5,326,500.00		
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	278,000	28.45	7,909,100.00		
	HENDERSON LAND	107,151	42.85	4,591,420.35		
	HOPEWELL HOLDINGS	59,500	21.30	1,267,350.00		
	HYSAN DEVELOPMENT	69,000	31.10	2,145,900.00		
	KERRY PROPERTIES	86,500	34.95	3,023,175.00		
	NEW WORLD DEVELOPMENT	436,500	9.33	4,072,545.00		
	SINO LAND CO.LTD	332,000	12.40	4,116,800.00		
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	165,000	96.50	15,922,500.00		
	SWIRE PACIFIC-A	85,500	87.05	7,442,775.00		
	WHARF(HOLDING)	174,000	42.20	7,342,800.00		
	WHEELOK & COMPANY LTD	102,000	23.40	2,386,800.00		
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	251,000	5.53	1,388,030.00		
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	113.30	2,481,270.00		
	HKT TRUST AND HKT LTD	12,195	6.04	73,657.80		
	PCCW LTD	398,000	2.78	1,106,440.00		
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	55,000	47.25	2,598,750.00		
	CLP HLDGS	221,500	67.00	14,840,500.00		
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	165,000	57.00	9,405,000.00		
	HONG KONG & CHINA GAS	549,012	19.90	10,925,338.80		
	計	銘柄数：41			261,822,100.29	
					(2,806,732,915)	
		組入時価比率：1.3%			1.3%	
	シンガポールドル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	181,000	3.25	588,250.00	
		FRASER & NEAVE	106,500	6.70	713,550.00	
		KEPPEL CORP.	167,700	10.99	1,843,023.00	
		SEMBICORP INDUSTRIES	111,040	5.28	586,291.20	
		COSCO CORP SINGAPORE LTD	104,000	1.16	121,160.00	
		SEMBICORP MARINE	103,600	5.28	547,008.00	
		YANGZIJIANG SHIPBUILDING	237,000	1.33	315,210.00	
NOBLE GROUP LTD		425,481	1.38	587,163.78		
SINGAPORE AIRLINES LTD	65,040	10.77	700,480.80			

	NEPTUNE ORIENT LINES	89,750	1.41	126,996.25	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	252,000	1.56	393,120.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	691,600	1.70	1,179,178.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	177,000	3.92	693,840.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	12,000	48.29	579,480.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	167,600	2.36	395,536.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	756,320	0.78	593,711.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	227,000	4.90	1,112,300.00	
	DBS GROUP HLDGS	208,000	14.18	2,949,440.00	
	OCBC-ORD	297,000	8.92	2,649,240.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	144,000	18.35	2,642,400.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	96,000	6.94	666,240.00	
	CAPITALAND LIMITED	304,000	3.12	948,480.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	151,000	1.63	246,885.00	
	CITY DEVELOPMENT	55,000	11.35	624,250.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	230,000	2.20	506,000.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	91,000	3.47	315,770.00	
	UOL GROUP LIMITED	49,700	4.74	235,578.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	931,000	3.15	2,932,650.00	
	STARHUB LTD	63,000	3.10	195,300.00	
計	銘柄数：29			25,988,531.23	
				(1,725,118,703)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	23,500	28.63	672,805.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	15,200	13.89	211,128.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	124,000	13.35	1,655,400.00	
	SANTOS LTD.	107,700	14.24	1,533,648.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	75,300	34.81	2,621,193.00	
	INCITEC PIVOT LTD	187,500	3.15	590,625.00	
	ORICA LTD	41,500	27.97	1,160,755.00	
	BORAL LTD	83,600	4.03	336,908.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
豪ドル	JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	49,300	7.68	378,624.00	
	AMCOR	139,100	7.44	1,034,904.00	
	ALUMINA LTD	297,400	1.23	367,289.00	
	BHP BILLITON LIMITED	371,500	34.61	12,857,615.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	146,400	5.81	850,584.00	
	ILUKA RESOURCES LTD	50,400	17.79	896,616.00	
	LYNAS CORPORATION LIMITED	203,900	1.09	223,270.50	
	NEWCREST MINING	88,500	29.68	2,626,680.00	
	OZ MINERALS LTD	36,500	9.76	356,240.00	
	RIO TINTO LTD	50,100	65.40	3,276,540.00	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	18,300	14.69	268,827.00	
	LEIGHTON HOLDINGS	16,900	21.32	360,308.00	
	BRAMBLES LTD	171,400	7.10	1,216,940.00	
	TOLL HLDGS	79,900	5.87	469,013.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	127,100	1.78	226,873.50	
	ASCIANO LTD	111,600	4.90	546,840.00	
	QR NATIONAL LTD	198,200	3.73	739,286.00	
	SYDNEY AIRPORT	42,300	2.87	121,401.00	
	TRANSURBAN GROUP	154,100	5.60	862,960.00	
	CROWN LTD	44,100	8.69	383,229.00	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	77,800	4.39	341,542.00	
	TABCORP HOLDINGS	80,900	2.72	220,048.00	
	TATTS GROUP LTD	151,800	2.48	376,464.00	
	FAIRFAX MEDIA LTD	285,900	0.72	207,277.50	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	58,200	2.01	116,982.00	
	METCASH LTD	96,100	4.30	413,230.00	
	WESFARMERS LIMITED	115,700	30.02	3,473,314.00	
	WOOLWORTHS LIMITED	142,700	25.98	3,707,346.00	
	COCA-COLA AMATIL LTD	66,000	12.47	823,020.00	
	COCHLEAR LTD	7,200	61.90	445,680.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,000	19.55	273,700.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	43,200	12.52	540,864.00	
	CSL LIMITED	61,200	35.89	2,196,468.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	306,400	23.26	7,126,864.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	45,200	7.75	350,300.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	182,200	50.10	9,128,220.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	256,200	24.60	6,302,520.00	
	WESTPAC BANKING CORP	352,500	21.89	7,716,225.00	
	ASX LTD	20,800	33.20	690,560.00	
	AMP LIMITED	325,100	4.32	1,404,432.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	233,600	3.40	794,240.00		
QBE INSURANCE	127,500	14.17	1,806,675.00		

	SUNCORP GROUP LTD	151,100	8.40	1,269,240.00	
	COMPUTERSHARE LTD	53,900	9.00	485,100.00	
	TELSTRA CORP LTD	506,800	3.29	1,667,372.00	
	SP AUSNET	162,028	1.07	174,180.10	
	APA GROUP	58,800	5.10	299,880.00	
	AGL ENERGY LTD	56,400	14.75	831,900.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	40,100	29.08	1,166,108.00	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	7,700	67.23	517,671.00	
計	銘柄数：58			91,713,924.60	
				(7,954,348,680)	
	組入時価比率：3.6%			3.7%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	80,800	6.74	544,592.00	
	AUCKLAND INT'L AIRPORT LTD	97,900	2.46	240,834.00	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	75,800	3.94	298,652.00	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	224,500	2.42	544,412.50	
	CONTACT ENERGY LTD	44,395	4.73	209,988.35	
計	銘柄数：5			1,838,478.85	
				(125,512,951)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
新シェケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	53,900	42.70	2,301,530.00	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	300	2,503.00	750,900.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,700	141.90	383,130.00	
	DELEK GROUP LTD	500	721.90	360,950.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	108,500	168.80	18,314,800.00	
	BANK HAPOALIM BM	119,000	13.77	1,638,630.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	130,200	11.73	1,527,246.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	104,300	4.98	520,144.10	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	14,200	34.10	484,220.00	
	NICE SYSTEMS LTD	6,900	145.20	1,001,880.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	207,200	6.05	1,253,560.00	
	CELLCOM ISRAEL LTD	5,500	45.30	249,150.00	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	9,900	27.65	273,735.00	
計	銘柄数：13			29,059,875.10	
				(650,941,202)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
合計				214,098,024,313	
				(214,098,024,313)	

- (注) 1 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。  
2 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。  
3 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## (2) 株式以外の有価証券

(平成24年4月2日現在)

種類	銘柄	券面総額 / 口数	評価額	備考
投資信託受益証券	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	600,000	459,000.00	
米ドル計	銘柄数：1	600,000	459,000.00	
			(38,188,800)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	
投資信託受益証券計			38,188,800	
			(38,188,800)	
投資証券	AMERICAN TOWER CORP	45,800	2,886,316.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	112,900	1,786,078.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,100	1,568,985.00	
	BOSTON PROPERTIES	17,300	1,816,327.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,700	865,449.00	
	DUKE REALTY CORP	28,300	405,822.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	34,600	2,166,652.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,100	687,209.00	

	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	51,200	869,888.00	
	HCP INC	47,400	1,870,404.00	
	HEALTH CARE REIT INC	24,200	1,330,032.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	84,200	1,382,564.00	
	KIMCO REALTY CORP	48,000	924,480.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	13,100	467,932.00	
	MACERICH CO /THE	15,500	895,125.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	19,000	789,640.00	
	PROLOGIS INC	54,200	1,952,284.00	
	PUBLIC STORAGE	16,700	2,307,439.00	
	RAYONIER INC	14,400	634,896.00	
	REGENCY CENTERS CORP	9,900	440,352.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	33,900	4,938,552.00	
	VENTAS INC	33,300	1,901,430.00	
	VORNADO REALTY TRUST	19,600	1,650,320.00	
	WEYERHAEUSER CO	61,800	1,354,656.00	
米ドル計	銘柄数：24	815,200	35,892,832.00	
			(2,986,283,622)	
	組入時価比率：1.3%		68.3%	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	8,300	196,378.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,400	389,232.00	
カナダドル計	銘柄数：2	22,700	585,610.00	
			(48,875,010)	
	組入時価比率：0.0%		1.1%	
	BRITISH LAND	100,600	482,779.40	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	67,500	223,695.00	
	HAMMERSON PLC	83,700	347,857.20	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	88,500	639,412.50	
	SEGRO PLC	86,700	203,571.60	
英ポンド計	銘柄数：5	427,000	1,897,315.70	
			(252,456,827)	
	組入時価比率：0.1%		5.8%	

種類	銘柄	券面総額 / 口数	評価額	備考
投資証券	CORIO NV	6,500	257,075.00	
	FONCIERE DES REGIONS	3,390	204,179.70	
	GECINA SA	2,790	218,568.60	
	ICADE	2,830	189,298.70	
	KLEPIERRE	12,790	332,540.00	
	UNIBAIL RODAMCO SE	10,720	1,607,464.00	
ユーロ計	銘柄数：6	39,020	2,809,126.00	
			(311,953,442)	
	組入時価比率：0.1%		7.1%	
	LINK REIT	255,500	7,383,950.00	
香港ドル計	銘柄数：1	255,500	7,383,950.00	
			(79,155,944)	
	組入時価比率：0.0%		1.8%	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	217,000	438,340.00	
	CAPITAMALL TRUST	236,900	427,604.50	
シンガポールドル計	銘柄数：2	453,900	865,944.50	
			(57,481,395)	
	組入時価比率：0.0%		1.3%	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	230,600	412,774.00	
	DEXUS PROPERTY GROUP	536,000	466,320.00	
	GOODMAN GROUP	816,000	563,040.00	
	GPT GROUP	207,100	646,152.00	
	LEND LEASE GROUP	61,600	460,152.00	
	MIRVAC GROUP	388,100	454,077.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	260,600	766,164.00	
	WESTFIELD GROUP	256,200	2,262,246.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	342,500	883,650.00	
豪ドル計	銘柄数：9	3,098,700	6,914,575.00	
			(599,701,089)	
	組入時価比率：0.3%		13.7%	
投資証券計			4,335,907,329	
			(4,335,907,329)	
合計			4,374,096,129	
			(4,374,096,129)	

- (注) 1 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。  
2 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。  
3 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成24年4月2日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超		
市場取引			

先物取引 株価指数先物取引 買建	4,633,146,711		4,634,691,699	1,544,988
合計	4,633,146,711		4,634,691,699	1,544,988

(注)時価の算定方法

先物取引

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

[次へ](#)

## 3 「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## (1)貸借対照表

科目	対象年月日	平成24年4月2日現在 金額(円)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン		5,361,372,936
国債証券		175,880,057,140
地方債証券		16,695,200,350
特殊債券		21,215,026,702
社債券		17,094,358,000
未収入金		618,966,000
未収利息		473,339,430
前払費用		27,875,389
流動資産合計		237,366,195,947
<b>資産合計</b>		
237,366,195,947		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払金		3,851,785,000
未払解約金		165,767,506
流動負債合計		4,017,552,506
<b>負債合計</b>		
4,017,552,506		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本		201,321,560,598
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		32,027,082,843
元本等合計		233,348,643,441
<b>純資産合計</b>		
233,348,643,441		
<b>負債純資産合計</b>		
237,366,195,947		

## (2)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	(1) 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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	(1) 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。

## (追加情報)

自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

平成24年4月2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	1,1591 円
(10,000口当たり純資産額)	11,591 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23年4月1日 至 平成24年4月2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、(3)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24年4月2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、地方債証券、特殊債券及び社債券 (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)

平成24年4月2日現在

1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成23年4月1日
期首元本額	211,191,332,986 円
期首より平成24年4月2日までの期中追加設定元本額	37,814,323,134 円
期首より平成24年4月2日までの期中一部解約元本額	47,684,095,522 円
期末元本額	201,321,560,598 円
期末元本額の内訳*	
野村国内債券インデックスファンド	320,126,422 円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	22,976,013,130 円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	42,214,459,024 円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,645,932,181 円
野村資産設計ファンド2015	1,053,631,936 円
野村資産設計ファンド2020	306,172,554 円
野村資産設計ファンド2025	211,394,061 円
野村資産設計ファンド2030	131,289,960 円
野村資産設計ファンド2035	64,983,525 円
野村資産設計ファンド2040	196,655,785 円
野村日本債券インデックスファンド	4,745,412,311 円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	1,116,744,708 円
のむらップ・ファンド(保守型)	2,242,090,146 円
のむらップ・ファンド(普通型)	680,357,147 円
のむらップ・ファンド(積極型)	244,375,651 円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	3,216,962,012 円
野村資産設計ファンド2045	3,317,434 円
野村円債投資インデックスファンド	1,166,713,707 円
野村インデックスファンド・国内債券	91,594,782 円
マイ・ロード	1,384,835,036 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)	8,513,847,134 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)	506,293,814 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)	21,855,288,453 円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,610,204,219 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)	58,958,504 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)	51,009,029 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)	12,360,955 円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	10,005,731,478 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)	521,369,551 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)	3,018,185,223 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)	2,007,300,993 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)	182,468,365 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)	486,334,595 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)	1,063,945,912 円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,251,942,999 円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,090,048,847 円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	7,147,045,573 円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	9,848,599,354 円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,579,521,540 円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け)	29,821,839,714 円
マイバランスDC30	2,791,179,922 円
マイバランスDC50	1,644,745,764 円
マイバランスDC70	420,201,629 円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	3,820,075,519 円

\* 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

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成24年4月2日現在)

該当事項はございません。

## (2) 株式以外の有価証券

(平成24年4月2日現在)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	国庫債券 利付(2年)第309回	1,000,000,000	999,920,000	
	国庫債券 利付(2年)第311回	1,500,000,000	1,502,400,000	
	国庫債券 利付(2年)第312回	2,500,000,000	2,499,550,000	
	国庫債券 利付(2年)第313回	2,000,000,000	1,999,620,000	
	国庫債券 利付(2年)第314回	500,000,000	499,900,000	
	国庫債券 利付(5年)第72回	950,000,000	965,988,500	
	国庫債券 利付(5年)第74回	900,000,000	909,711,000	
	国庫債券 利付(5年)第75回	600,000,000	608,700,000	
	国庫債券 利付(5年)第76回	600,000,000	609,576,000	
	国庫債券 利付(5年)第77回	900,000,000	911,736,000	
	国庫債券 利付(5年)第78回	400,000,000	405,424,000	
	国庫債券 利付(5年)第79回	700,000,000	707,105,000	
	国庫債券 利付(5年)第80回	800,000,000	809,488,000	
	国庫債券 利付(5年)第81回	1,900,000,000	1,925,574,000	
	国庫債券 利付(5年)第82回	1,500,000,000	1,523,130,000	
	国庫債券 利付(5年)第83回	700,000,000	711,865,000	
	国庫債券 利付(5年)第84回	1,300,000,000	1,316,315,000	
	国庫債券 利付(5年)第85回	1,000,000,000	1,013,730,000	
	国庫債券 利付(5年)第86回	1,800,000,000	1,820,286,000	
	国庫債券 利付(5年)第88回	1,900,000,000	1,918,715,000	
	国庫債券 利付(5年)第89回	2,000,000,000	2,014,020,000	
	国庫債券 利付(5年)第90回	2,700,000,000	2,710,314,000	
	国庫債券 利付(5年)第91回	900,000,000	906,183,000	
	国庫債券 利付(5年)第93回	1,000,000,000	1,010,110,000	
	国庫債券 利付(5年)第94回	1,000,000,000	1,013,790,000	
	国庫債券 利付(5年)第95回	1,400,000,000	1,419,194,000	
	国庫債券 利付(5年)第96回	1,700,000,000	1,716,643,000	
	国庫債券 利付(5年)第97回	1,700,000,000	1,708,840,000	
	国庫債券 利付(5年)第98回	800,000,000	800,832,000	
	国庫債券 利付(5年)第99回	1,600,000,000	1,607,040,000	
	国庫債券 利付(5年)第101回	2,000,000,000	2,007,420,000	
	国庫債券 利付(5年)第102回	3,400,000,000	3,396,838,000	
	国庫債券 利付(5年)第103回	1,000,000,000	998,050,000	
	国庫債券 利付(40年)第1回	460,000,000	499,527,800	
	国庫債券 利付(40年)第2回	200,000,000	206,090,000	
	国庫債券 利付(40年)第3回	270,000,000	277,165,800	
	国庫債券 利付(40年)第4回	310,000,000	316,640,200	
	国庫債券 利付(10年)第250回	820,000,000	823,952,400	
	国庫債券 利付(10年)第252回	700,000,000	707,602,000	
	国庫債券 利付(10年)第254回	790,000,000	804,915,200	
	国庫債券 利付(10年)第255回	560,000,000	571,384,800	
	国庫債券 利付(10年)第256回	500,000,000	511,090,000	
	国庫債券 利付(10年)第257回	320,000,000	326,524,800	
	国庫債券 利付(10年)第258回	1,330,000,000	1,360,882,600	
	国庫債券 利付(10年)第259回	1,120,000,000	1,150,385,600	

国庫債券 利付(10年)第260回	1,050,000,000	1,084,104,000	
国庫債券 利付(10年)第261回	1,000,000,000	1,036,880,000	
国庫債券 利付(10年)第262回	880,000,000	914,390,400	
国庫債券 利付(10年)第263回	900,000,000	932,211,000	
国庫債券 利付(10年)第264回	710,000,000	733,671,400	
国庫債券 利付(10年)第265回	1,280,000,000	1,326,451,200	
国庫債券 利付(10年)第266回	520,000,000	537,466,800	
国庫債券 利付(10年)第267回	550,000,000	566,989,500	
国庫債券 利付(10年)第269回	630,000,000	651,029,400	
国庫債券 利付(10年)第270回	670,000,000	693,932,400	
国庫債券 利付(10年)第271回	850,000,000	877,650,500	
国庫債券 利付(10年)第272回	320,000,000	333,193,600	
国庫債券 利付(10年)第273回	690,000,000	720,822,300	
国庫債券 利付(10年)第275回	320,000,000	333,891,200	
国庫債券 利付(10年)第276回	100,000,000	105,077,000	
国庫債券 利付(10年)第277回	750,000,000	789,660,000	
国庫債券 利付(10年)第278回	550,000,000	583,396,000	
国庫債券 利付(10年)第279回	920,000,000	983,066,000	
国庫債券 利付(10年)第280回	350,000,000	373,737,000	
国庫債券 利付(10年)第281回	500,000,000	535,990,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	国庫債券 利付(10年)第282回	1,500,000,000	1,592,415,000	
	国庫債券 利付(10年)第283回	1,400,000,000	1,492,428,000	
	国庫債券 利付(10年)第284回	1,900,000,000	2,022,113,000	
	国庫債券 利付(10年)第285回	720,000,000	768,096,000	
	国庫債券 利付(10年)第286回	200,000,000	214,778,000	
	国庫債券 利付(10年)第287回	1,550,000,000	1,672,884,000	
	国庫債券 利付(10年)第288回	850,000,000	909,772,000	
	国庫債券 利付(10年)第289回	1,200,000,000	1,272,612,000	
	国庫債券 利付(10年)第290回	1,250,000,000	1,318,500,000	
	国庫債券 利付(10年)第291回	1,200,000,000	1,258,800,000	
	国庫債券 利付(10年)第292回	400,000,000	429,000,000	
	国庫債券 利付(10年)第293回	450,000,000	485,662,500	
	国庫債券 利付(10年)第295回	2,000,000,000	2,121,700,000	
	国庫債券 利付(10年)第296回	1,100,000,000	1,167,012,000	
	国庫債券 利付(10年)第297回	700,000,000	737,779,000	
	国庫債券 利付(10年)第298回	1,300,000,000	1,361,763,000	
	国庫債券 利付(10年)第299回	1,800,000,000	1,884,132,000	
	国庫債券 利付(10年)第300回	1,400,000,000	1,484,630,000	
	国庫債券 利付(10年)第301回	1,200,000,000	1,272,420,000	
	国庫債券 利付(10年)第302回	1,200,000,000	1,263,708,000	
	国庫債券 利付(10年)第303回	500,000,000	526,120,000	
	国庫債券 利付(10年)第304回	700,000,000	731,332,000	
	国庫債券 利付(10年)第305回	2,600,000,000	2,713,100,000	
	国庫債券 利付(10年)第306回	2,000,000,000	2,099,180,000	
	国庫債券 利付(10年)第308回	500,000,000	520,255,000	
	国庫債券 利付(10年)第309回	2,000,000,000	2,049,360,000	
	国庫債券 利付(10年)第310回	800,000,000	811,392,000	
	国庫債券 利付(10年)第311回	2,450,000,000	2,445,149,000	
	国庫債券 利付(10年)第312回	2,450,000,000	2,519,531,000	
	国庫債券 利付(10年)第313回	1,900,000,000	1,966,234,000	
	国庫債券 利付(10年)第314回	1,300,000,000	1,323,192,000	
	国庫債券 利付(10年)第315回	700,000,000	716,940,000	
	国庫債券 利付(10年)第316回	800,000,000	812,224,000	
	国庫債券 利付(10年)第317回	500,000,000	506,510,000	
	国庫債券 利付(10年)第318回	800,000,000	803,120,000	
	国庫債券 利付(10年)第319回	1,950,000,000	1,970,728,500	
	国庫債券 利付(10年)第320回	1,900,000,000	1,902,508,000	
	国庫債券 利付(10年)第321回	1,000,000,000	999,090,000	
	国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	117,096,000	
	国庫債券 利付(30年)第2回	100,000,000	110,737,000	
	国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	174,630,400	
	国庫債券 利付(30年)第4回	120,000,000	142,386,000	
	国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	160,939,500	
	国庫債券 利付(30年)第6回	130,000,000	143,497,900	
	国庫債券 利付(30年)第7回	155,000,000	168,438,500	
	国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	100,075,000	
	国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	60,529,300	
	国庫債券 利付(30年)第10回	150,000,000	131,619,000	
	国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	156,940,800	

国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	230,931,800	
国庫債券 利付(30年)第13回	190,000,000	195,929,900	
国庫債券 利付(30年)第14回	180,000,000	198,558,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	150,000,000	168,126,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	215,000,000	240,802,150	
国庫債券 利付(30年)第17回	200,000,000	220,588,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	280,000,000	303,231,600	
国庫債券 利付(30年)第19回	200,000,000	216,724,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	290,000,000	325,092,900	
国庫債券 利付(30年)第21回	270,000,000	292,188,600	
国庫債券 利付(30年)第22回	100,000,000	112,092,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	340,000,000	381,092,400	
国庫債券 利付(30年)第24回	300,000,000	336,234,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	490,000,000	529,636,100	
国庫債券 利付(30年)第26回	450,000,000	495,216,000	
国庫債券 利付(30年)第27回	750,000,000	840,922,500	
国庫債券 利付(30年)第28回	600,000,000	673,110,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	700,000,000	771,127,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	600,000,000	647,976,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	500,000,000	529,455,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	870,000,000	939,539,100	
国庫債券 利付(30年)第33回	1,140,000,000	1,155,720,600	
国庫債券 利付(30年)第34回	800,000,000	845,616,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	国庫債券 利付(30年)第35回	1,200,000,000	1,213,488,000	
	国庫債券 利付(30年)第36回	200,000,000	201,890,000	
	国庫債券 利付(20年)第23回	200,000,000	215,732,000	
	国庫債券 利付(20年)第24回	550,000,000	599,274,500	
	国庫債券 利付(20年)第25回	13,000,000	14,012,440	
	国庫債券 利付(20年)第26回	100,000,000	110,700,000	
	国庫債券 利付(20年)第27回	60,000,000	67,156,800	
	国庫債券 利付(20年)第28回	29,000,000	33,139,460	
	国庫債券 利付(20年)第29回	310,000,000	352,705,600	
	国庫債券 利付(20年)第30回	10,000,000	11,205,600	
	国庫債券 利付(20年)第31回	110,000,000	124,086,600	
	国庫債券 利付(20年)第32回	41,000,000	46,572,310	
	国庫債券 利付(20年)第33回	1,410,000,000	1,628,282,100	
	国庫債券 利付(20年)第34回	190,000,000	219,583,000	
	国庫債券 利付(20年)第35回	228,000,000	261,274,320	
	国庫債券 利付(20年)第36回	380,000,000	433,371,000	
	国庫債券 利付(20年)第37回	320,000,000	366,656,000	
	国庫債券 利付(20年)第38回	170,000,000	192,298,900	
	国庫債券 利付(20年)第39回	511,000,000	575,058,960	
	国庫債券 利付(20年)第40回	525,000,000	583,406,250	
	国庫債券 利付(20年)第41回	255,000,000	270,322,950	
	国庫債券 利付(20年)第42回	283,000,000	321,437,060	
	国庫債券 利付(20年)第43回	400,000,000	464,532,000	
	国庫債券 利付(20年)第44回	150,000,000	170,155,500	
	国庫債券 利付(20年)第45回	242,000,000	272,796,920	
	国庫債券 利付(20年)第46回	90,000,000	100,018,800	
	国庫債券 利付(20年)第47回	130,000,000	144,597,700	
	国庫債券 利付(20年)第48回	200,000,000	227,506,000	
	国庫債券 利付(20年)第49回	200,000,000	220,910,000	
	国庫債券 利付(20年)第50回	183,000,000	198,752,640	
	国庫債券 利付(20年)第51回	310,000,000	339,291,900	
	国庫債券 利付(20年)第52回	100,000,000	110,320,000	
	国庫債券 利付(20年)第53回	250,000,000	275,802,500	
	国庫債券 利付(20年)第54回	250,000,000	278,150,000	
	国庫債券 利付(20年)第55回	231,000,000	252,836,430	
	国庫債券 利付(20年)第56回	120,000,000	131,296,800	
	国庫債券 利付(20年)第57回	210,000,000	227,715,600	
	国庫債券 利付(20年)第58回	180,000,000	195,156,000	
	国庫債券 利付(20年)第59回	230,000,000	244,508,400	
	国庫債券 利付(20年)第60回	380,000,000	392,426,000	
	国庫債券 利付(20年)第61回	300,000,000	296,919,000	
	国庫債券 利付(20年)第62回	340,000,000	328,185,000	
	国庫債券 利付(20年)第63回	400,000,000	428,152,000	
	国庫債券 利付(20年)第64回	300,000,000	323,928,000	
	国庫債券 利付(20年)第65回	255,000,000	275,020,050	
	国庫債券 利付(20年)第66回	300,000,000	320,289,000	
	国庫債券 利付(20年)第67回	310,000,000	333,733,600	
	国庫債券 利付(20年)第68回	290,000,000	321,836,200	
	国庫債券 利付(20年)第69回	560,000,000	615,266,400	

国庫債券 利付(20年)第70回	340,000,000	384,672,600	
国庫債券 利付(20年)第71回	500,000,000	554,420,000	
国庫債券 利付(20年)第72回	570,000,000	624,588,900	
国庫債券 利付(20年)第73回	350,000,000	378,994,000	
国庫債券 利付(20年)第74回	320,000,000	350,214,400	
国庫債券 利付(20年)第75回	500,000,000	546,470,000	
国庫債券 利付(20年)第76回	430,000,000	459,627,000	
国庫債券 利付(20年)第77回	320,000,000	345,987,200	
国庫債券 利付(20年)第78回	310,000,000	330,965,300	
国庫債券 利付(20年)第79回	360,000,000	388,843,200	
国庫債券 利付(20年)第80回	320,000,000	349,446,400	
国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	388,198,800	
国庫債券 利付(20年)第82回	320,000,000	348,726,400	
国庫債券 利付(20年)第83回	370,000,000	402,800,500	
国庫債券 利付(20年)第84回	390,000,000	419,811,600	
国庫債券 利付(20年)第85回	500,000,000	543,715,000	
国庫債券 利付(20年)第86回	450,000,000	500,791,500	
国庫債券 利付(20年)第87回	490,000,000	538,911,800	
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	516,393,700	
国庫債券 利付(20年)第90回	510,000,000	559,735,200	
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	277,557,500	
国庫債券 利付(20年)第92回	750,000,000	812,055,000	
国庫債券 利付(20年)第93回	200,000,000	213,388,000	

[次△](#)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	216,110,000	
	国庫債券 利付(20年)第95回	500,000,000	552,955,000	
	国庫債券 利付(20年)第96回	450,000,000	485,536,500	
	国庫債券 利付(20年)第97回	450,000,000	490,761,000	
	国庫債券 利付(20年)第98回	500,000,000	538,325,000	
	国庫債券 利付(20年)第99回	800,000,000	860,472,000	
	国庫債券 利付(20年)第100回	520,000,000	565,770,400	
	国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	278,967,500	
	国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	557,215,000	
	国庫債券 利付(20年)第104回	100,000,000	107,194,000	
	国庫債券 利付(20年)第105回	300,000,000	321,006,000	
	国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	433,812,000	
	国庫債券 利付(20年)第107回	600,000,000	641,244,000	
	国庫債券 利付(20年)第108回	700,000,000	727,685,000	
	国庫債券 利付(20年)第109回	700,000,000	726,551,000	
	国庫債券 利付(20年)第110回	700,000,000	747,180,000	
	国庫債券 利付(20年)第111回	500,000,000	540,475,000	
	国庫債券 利付(20年)第112回	700,000,000	746,214,000	
	国庫債券 利付(20年)第113回	700,000,000	745,220,000	
	国庫債券 利付(20年)第114回	600,000,000	637,872,000	
	国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	539,165,000	
	国庫債券 利付(20年)第116回	500,000,000	538,465,000	
	国庫債券 利付(20年)第117回	300,000,000	318,477,000	
	国庫債券 利付(20年)第118回	200,000,000	209,068,000	
	国庫債券 利付(20年)第119回	300,000,000	304,170,000	
	国庫債券 利付(20年)第120回	300,000,000	294,801,000	
	国庫債券 利付(20年)第121回	1,000,000,000	1,028,100,000	
	国庫債券 利付(20年)第122回	800,000,000	809,528,000	
	国庫債券 利付(20年)第123回	700,000,000	741,321,000	
	国庫債券 利付(20年)第124回	600,000,000	625,548,000	
	国庫債券 利付(20年)第125回	600,000,000	644,394,000	
	国庫債券 利付(20年)第126回	300,000,000	312,453,000	
	国庫債券 利付(20年)第127回	500,000,000	512,865,000	
	国庫債券 利付(20年)第128回	300,000,000	307,350,000	
	国庫債券 利付(20年)第129回	500,000,000	503,955,000	
	国庫債券 利付(20年)第130回	500,000,000	503,260,000	
	国庫債券 利付(20年)第132回	900,000,000	890,136,000	
	国庫債券 利付(20年)第133回	1,000,000,000	1,005,850,000	
	国庫債券 利付(20年)第134回	400,000,000	401,768,000	
国債証券計	銘柄数：248	168,721,000,000	175,880,057,140	
	組入時価比率：75.4%		76.2%	
地方債証券	東京都 公募第601回	121,400,000	123,976,108	
	東京都 公募第609回	100,000,000	102,642,000	
	東京都 公募第611回	400,000,000	414,564,000	
	東京都 公募第618回	100,000,000	103,333,000	
	東京都 公募第622回	300,000,000	309,951,000	
	東京都 公募第644回	60,000,000	64,042,200	
	東京都 公募第660回	100,000,000	106,224,000	

東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	108,721,000	
東京都 公募第10回	200,000,000	209,160,000	
東京都 公募第1回	300,000,000	310,713,000	
東京都 公募第7回	100,000,000	108,667,000	
北海道 公募平成16年度第6回	100,000,000	103,355,000	
北海道 公募平成18年度第6回	100,000,000	107,238,000	
北海道 公募平成19年度第4回	100,000,000	107,583,000	
北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	105,629,000	
北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	104,751,000	
神奈川県 公募第127回	100,000,000	103,703,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	110,886,000	
神奈川県 公募第7回	200,000,000	216,822,000	
神奈川県 公募第30回	100,000,000	101,392,000	
大阪府 公募第262回	100,000,000	102,110,000	
大阪府 公募第285回	150,000,000	156,352,500	
大阪府 公募第291回	100,000,000	106,669,000	
大阪府 公募第303回	300,000,000	322,137,000	
大阪府 公募第337回	200,000,000	208,282,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	102,062,000	
大阪府 公募第41回	200,000,000	202,900,000	
京都府 公募平成15年度第2回	100,000,000	102,110,000	
京都府 公募平成16年度第3回	100,000,000	103,194,000	
京都府 公募平成18年度第1回	160,000,000	169,801,600	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債証券	兵庫県 公募平成16年度第13回	100,000,000	102,932,000	
	兵庫県 公募平成21年度第13回	100,000,000	104,970,000	
	兵庫県 公募第2回	100,000,000	109,208,000	
	兵庫県 公募第9回	100,000,000	106,164,000	
	静岡県 公募平成16年度第1回	110,000,000	113,429,800	
	静岡県 公募平成19年度第4回	200,000,000	215,842,000	
	静岡県 公募平成21年度第7回	100,000,000	105,644,000	
	静岡県 公募(20年)第11回	100,000,000	100,358,000	
	愛知県 公募平成19年度第3回	111,000,000	119,451,540	
	愛知県 公募平成20年度第8回	100,000,000	104,493,000	
	愛知県 公募平成21年度第3回	114,000,000	121,615,200	
	愛知県 公募平成21年度第17回	100,000,000	104,535,000	
	愛知県 公募平成22年度第3回	100,000,000	103,999,000	
	広島県 公募平成16年度第1回	200,000,000	206,138,000	
	広島県 公募平成22年度第6回	200,000,000	205,284,000	
	埼玉県 公募平成19年度第7回	200,000,000	213,070,000	
	埼玉県 公募平成21年度第5回	100,000,000	104,750,000	
	埼玉県 公募平成22年度第2回	200,000,000	208,164,000	
	福岡県 公募平成18年度第1回	200,000,000	215,166,000	
	福岡県 公募平成19年度第6回	100,000,000	106,780,000	
	福岡県 公募平成20年度第3回	100,000,000	106,221,000	
	千葉県 公募平成20年度第6回	100,000,000	106,557,000	
	千葉県 公募平成21年度第11回	180,000,000	188,352,000	
	千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	105,894,000	
	新潟県 公募平成17年度第1回	100,000,000	103,375,000	
	新潟県 公募平成21年度第2回	150,000,000	158,409,000	
	共同発行市場地方債 公募第3回	100,000,000	100,411,000	
	共同発行市場地方債 公募第13回	300,700,000	308,821,907	
	共同発行市場地方債 公募第17回	100,000,000	103,816,000	
	共同発行市場地方債 公募第20回	100,000,000	103,374,000	
	共同発行市場地方債 公募第22回	100,000,000	103,282,000	
	共同発行市場地方債 公募第26回	300,000,000	309,891,000	
	共同発行市場地方債 公募第27回	100,000,000	103,364,000	
	共同発行市場地方債 公募第28回	129,500,000	133,940,555	
	共同発行市場地方債 公募第31回	200,000,000	208,658,000	
	共同発行市場地方債 公募第32回	100,000,000	104,773,000	
	共同発行市場地方債 公募第34回	100,000,000	104,169,000	
	共同発行市場地方債 公募第35回	100,000,000	104,992,000	
	共同発行市場地方債 公募第56回	400,000,000	427,376,000	
	共同発行市場地方債 公募第62回	100,000,000	107,139,000	
	共同発行市場地方債 公募第64回	100,000,000	107,407,000	
	共同発行市場地方債 公募第82回	300,000,000	313,920,000	
	共同発行市場地方債 公募第84回	500,000,000	521,155,000	
	共同発行市場地方債 公募第85回	300,000,000	313,944,000	
	共同発行市場地方債 公募第88回	100,000,000	102,405,000	
	共同発行市場地方債 公募第93回	100,000,000	102,704,000	
	熊本県 公募平成18年度第2回	173,000,000	183,994,150	
	静岡市 公募平成17年度第1回	100,000,000	104,716,000	
	大阪市 公募平成17年度第4回	100,000,000	103,577,000	

大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	105,289,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	102,482,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	109,768,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	105,950,000	
名古屋市 公募第460回	100,000,000	106,887,000	
名古屋市 公募第464回	100,000,000	106,356,000	
名古屋市 公募第12回ゆ号	200,000,000	204,800,000	
名古屋市 公募第12回ひ号	100,000,000	103,421,000	
京都市 公募平成19年度第4回	190,000,000	201,795,200	
神戸市 公募平成17年度13回	100,000,000	104,884,000	
神戸市 公募平成21年度第7回	100,000,000	106,725,000	
横浜市 公募平成15年度第3回	50,000,000	50,511,500	
横浜市 公募公債平成17年度1回	300,000,000	309,450,000	
横浜市 公募公債平成17年度2回	205,000,000	212,142,200	
横浜市 公募平成21年度第4回	200,000,000	208,706,000	
横浜市 公募平成22年度第5回	100,000,000	102,856,000	
札幌市 公募平成19年度第3回	100,000,000	106,990,000	
札幌市 公募平成22年度第4回	100,000,000	101,418,000	
川崎市 公募第82回	100,000,000	105,483,000	
北九州市 公募平成18年度第2回	170,000,000	180,985,400	
福岡市 公募平成15年度第6回	175,000,000	178,666,250	
福岡市 公募平成20年度第3回	100,000,000	105,704,000	
広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	103,899,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債証券	さいたま市 公募第3回	100,000,000	104,418,000	
	鹿児島県 公募平成18年度第1回	178,200,000	190,353,240	
	山梨県 公募平成19年度第1回	200,000,000	214,992,000	
	岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	104,197,000	
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	105,775,000	
	東京都住宅供給公社債券 第4回	300,000,000	318,789,000	
	東京都住宅供給公社債券 第5回	200,000,000	213,906,000	
地方債証券計	銘柄数：109	15,927,800,000	16,695,200,350	
	組入時価比率：7.2%		7.2%	
特殊債券	日本政策投資銀行債券 政府保証第18回	100,000,000	107,776,000	
	日本政策投資銀行社債 政府保証第5回	100,000,000	105,043,000	
	日本政策投資銀行債券 財投機関債第9回	100,000,000	101,953,000	
	日本政策投資銀行債券 財投機関債第29回	200,000,000	212,982,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第317回	500,000,000	502,205,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第319回	101,000,000	102,056,460	
	道路債券 政府保証第322回	100,000,000	102,232,000	
	道路債券 政府保証第332回	100,000,000	103,261,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第336回	500,000,000	516,850,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第338回	200,000,000	207,678,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第344回	200,000,000	212,112,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第345回	101,000,000	104,230,990	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証第346回	300,000,000	311,790,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第3回	100,000,000	104,689,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第4回	100,000,000	106,472,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第6回	200,000,000	209,450,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第8回	200,000,000	220,408,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第23回	200,000,000	217,142,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第33回	200,000,000	211,698,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券財投機関債第38回	100,000,000	107,452,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継政府保証債第1回	115,000,000	120,246,300	

	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3回	200,000,000	209,318,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5回	100,000,000	105,097,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回	100,000,000	108,288,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9回	100,000,000	108,265,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第14回	180,000,000	191,923,200	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第42回	100,000,000	107,407,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第58回	136,000,000	145,578,480	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第60回	139,000,000	149,666,860	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第67回	200,000,000	212,904,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	210,684,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第98回	300,000,000	311,751,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第100回	400,000,000	418,476,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	210,186,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	203,746,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	101,817,000	
	日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	112,331,000	
	公営企業債券 政府保証第836回	115,000,000	117,498,950	
	公営企業債券 政府保証第839回	404,000,000	415,538,240	
	公営企業債券 政府保証第846回	134,000,000	138,373,760	
	公営企業債券 政府保証第847回	200,000,000	206,734,000	
	公営企業債券 政府保証第852回	200,000,000	206,884,000	
	公営企業債券 政府保証第855回	100,000,000	103,623,000	
	公営企業債券 政府保証第856回	355,000,000	370,659,050	
	公営企業債券 政府保証第857回	200,000,000	209,750,000	
	公営企業債券 政府保証第858回	200,000,000	209,164,000	
	公営企業債券 政府保証第864回	135,000,000	143,912,700	
	公営企業債券 政府保証第886回	103,000,000	110,904,220	
	公営企業債券 政府保証15年第1回	300,000,000	318,156,000	
	地方公共団体金融機構債券 第1回	100,000,000	106,345,000	
	地方公共団体金融機構債券 政府保証第 5回	200,000,000	206,722,000	
	地方公共団体金融機構債券 20年第4 回	100,000,000	104,509,000	
	地方公共団体金融機構債券 20年第6 回	300,000,000	318,642,000	
	地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	104,720,000	
	地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	101,964,000	

	公営企業債券 20年第2回財投機関債	100,000,000	102,471,000	
	公営企業債券 第7回財投機関債	100,000,000	101,626,000	
	公営企業債券 第11回財投機関債	100,000,000	103,274,000	
	公営企業債券 第14回財投機関債	200,000,000	206,994,000	
	公営企業債券 第24回財投機関債	100,000,000	107,058,000	
	首都高速道路債券 政府保証第189回	100,000,000	102,138,000	
	首都高速道路債券 政府保証第193回	100,000,000	103,237,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊債券	首都高速道路債券 政府保証第198回	101,000,000	104,468,340	
	阪神高速道路債券 政府保証第146回	101,000,000	104,406,730	
	中小企業債券 政府保証第186回	100,000,000	103,614,000	
	国際協力銀行債券 第21回財投機関債	100,000,000	104,280,000	
	国際協力銀行債券 第27回財投機関債	200,000,000	212,750,000	
	都市再生債券 財投機関債第21回	200,000,000	212,494,000	
	本州四国連絡橋債券 政府保証第23回	100,000,000	102,423,000	
	本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	108,563,000	
	東京交通債券 第342回	200,000,000	223,270,000	
	東京交通債券 第347回	157,000,000	168,550,490	
	関西国際空港債券 財投機関債第3回	200,000,000	208,124,000	
	住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回	200,000,000	214,634,000	
	住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	100,613,000	
	住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	102,114,000	
	国民生活債券 政府保証第17回	200,000,000	210,246,000	
	商工債券 利付第709回い号	100,000,000	102,111,000	
	農林債券 利付第696回い号	100,000,000	101,313,000	
	農林債券 利付第700回い号	100,000,000	101,697,000	
	農林債券 利付第704回い号	100,000,000	101,885,000	
	農林債券 利付第706回い号	100,000,000	102,139,000	
	農林債券 利付第708回い号	100,000,000	101,869,000	
	農林債券 利付第715回い号	400,000,000	404,228,000	
	農林債券 利付第719回い号	100,000,000	101,132,000	
	農林債券 利付第729回い号	100,000,000	101,363,000	
	しんきん中金債券 利付第227回	100,000,000	101,808,000	
	しんきん中金債券 利付第234回	300,000,000	305,739,000	
	しんきん中金債券 利付第240回	100,000,000	101,623,000	
	しんきん中金債券 利付第245回	100,000,000	101,194,000	
	しんきん中金債券 利付第246回	100,000,000	101,049,000	
	商工債券 利付(10年)第5回	500,000,000	534,180,000	
	国際協力機構債券 第6回財投機関債	100,000,000	103,366,000	
	東日本高速道路債券 政府保証第2回	120,000,000	125,458,800	
	中日本高速道路債券 政府保証第2回	100,000,000	104,552,000	
	中日本高速道路債券 政府保証第13回	138,000,000	147,087,300	
	中日本高速道路債券 財投機関債第3回	100,000,000	107,332,000	
	西日本高速道路債券 政府保証第1回	215,000,000	225,425,350	
	西日本高速道路債券 政府保証第2回	176,000,000	187,464,640	
	西日本高速道路債券 政府保証第3回	151,000,000	160,999,220	
	西日本高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	106,585,000	
	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第24回	100,000,000	100,861,000	
	緑資源債券 財投機関債第3回	200,000,000	206,638,000	
	緑資源債券 財投機関債第4回	100,000,000	104,117,000	
	貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	31,012,000	32,266,125	
	貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	121,437,000	124,999,961	
	貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	219,630,000	227,117,186	
	貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	103,785,000	105,769,369	

	貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	112,731,000	116,767,897	
	貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	120,128,000	127,807,783	
	貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	40,423,000	42,860,506	
	貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	121,152,000	125,243,303	
	貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	60,904,000	63,248,804	
	貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	124,365,000	127,967,854	
	貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	249,056,000	255,608,663	
	貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	228,805,000	240,364,228	
	貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	230,168,000	244,063,242	
	貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	130,804,000	136,539,755	
	貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	66,839,000	70,334,679	
	貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	75,098,000	79,604,630	
	貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	242,433,000	252,530,334	
	貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	203,997,000	211,669,327	
	貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	187,874,000	188,659,313	
	貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	140,386,000	146,331,347	
	貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	284,664,000	293,531,283	
	貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	152,488,000	162,309,752	
	貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	191,928,000	199,601,281	
特殊債券計	銘柄数：127	20,317,107,000	21,215,026,702	
	組入時価比率：9.1%		9.2%	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク 第12回円貨社債	100,000,000	99,271,000	
	GEキャピタルコーポレーション 第12回円貨社債	100,000,000	102,050,000	
	JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー 第7回円貨社債	100,000,000	102,122,000	
	エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第12回	100,000,000	95,160,000	
	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク 第7回円貨社債	100,000,000	100,997,000	
	シティグループ・インク 第11回円貨社債	100,000,000	99,888,000	
	シティグループ・インク 第22回円貨社債	100,000,000	101,782,000	
	バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション 第6回円貨社債	200,000,000	196,418,000	
	クレディ・スイス・グループAG保証第2回クレディ・スイス円貨	100,000,000	101,667,000	
	パークレイズ・バンク・ピーエルシー 第4回円貨社債	100,000,000	99,608,000	
	ナショナル・オーストラリア銀行 第6回円貨社債(2011)	100,000,000	100,336,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポレーション 第5回円貨社債	200,000,000	202,298,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行 第5回円貨社債	100,000,000	101,046,000	
	ラボバンク・ネーデルランド 第1回円貨社債(2008)	100,000,000	101,675,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク 第4回円貨社債	100,000,000	100,802,000	
	キリンホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,791,000	
	キリンホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,413,000	
	キッコーマン 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,674,000	
	ニチレイ 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,180,000	
	日本たばこ産業 第5回	100,000,000	101,839,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人 第1回特定投資法人債	100,000,000	102,395,000	
	セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,200,000	
	住友化学 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,562,000	
	三菱化学 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,952,000	
	三井化学 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,229,000	
	JXホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,000,000	

新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,928,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,783,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第16回（JFEス保証）	100,000,000	101,639,000	
豊田自動織機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,482,000	
日立製作所 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,042,000	
東芝 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,846,000	
日本電気 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,295,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,347,000	
パナソニック 第10回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,592,000	
シャープ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,191,000	
ソニー 第26回	100,000,000	107,185,000	
デンソー 第6回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,579,000	
三菱重工業 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,088,000	
日本生命2010基金特定目的会社 第1回特定社債	100,000,000	100,130,000	
日産自動車 第47回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,428,000	
伊藤忠商事 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,898,000	
丸紅 第72回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,170,000	
三井物産 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,398,000	
三井物産 第58回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,589,000	
住友商事 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,942,000	
三菱商事 第53回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,719,000	
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	107,987,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	105,655,000	
クレディセゾン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,900,000	
みずほコーポレート銀行 第2回劣後特約付	100,000,000	103,493,000	
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,908,000	
みずほコーポレート銀行 第13回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,806,000	
みずほコーポレート銀行 第14回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,074,000	

三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	113,514,000	
三菱東京UFJ銀行 第106回特定社 債間限定同順位特約付	200,000,000	202,934,000	
三菱東京UFJ銀行 第116回特定社 債間限定同順位特約付	200,000,000	201,072,000	
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,353,000	
東京三菱銀行 第4回無担保社債(劣後 特約付)	100,000,000	100,820,000	
三菱東京UFJ銀行 第11回(劣後特 約付)	100,000,000	106,847,000	
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	109,044,000	
UFJ銀行 第3回劣後特約付	100,000,000	101,104,000	
広島銀行 第10回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	102,010,000	
広島銀行 第12回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	102,759,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	102,211,000	
住友信託銀行 第5回劣後特約付	100,000,000	105,665,000	
みずほ信託銀行 第1回劣後特約付	100,000,000	104,007,000	
中央三井信託銀行 第3回無担保社債 (劣後特約付)	100,000,000	103,747,000	
セブン銀行 第3回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	102,361,000	
三井住友銀行 第48回社債間限定同順 位特約付	200,000,000	202,422,000	
三井住友銀行 第52回社債間限定同順 位特約付	200,000,000	201,416,000	
三井住友銀行 第8回劣後特約付	100,000,000	103,616,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	101,456,000	
	みずほ銀行 第6回劣後特約付	200,000,000	212,010,000	
	トヨタファイナンス 第27回社債間限定同等特約付	200,000,000	212,926,000	
	オリックス 第144回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,779,000	
	三菱UFJリース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,094,000	
	野村ホールディングス 第6回	100,000,000	103,629,000	
	野村ホールディングス 第15回	100,000,000	102,713,000	
	野村ホールディングス 第21回	100,000,000	101,411,000	
	第1回財政融資マスタートラスト特定目的会社 第1回特定社債	100,000,000	105,893,000	
	三井住友海上火災保険 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,754,000	
	三井不動産 第23回社債間限定同順位特約付	300,000,000	309,747,000	
	三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	111,506,000	
	三菱地所 第71回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,596,000	
	東京建物 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,820,000	
	住友不動産 第73回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,831,000	
	東京急行電鉄 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,624,000	
	京成電鉄 第42回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,668,000	
	東日本旅客鉄道 第2回	100,000,000	113,231,000	
	東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	113,587,000	
	東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,162,000	
	東日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,555,000	
	西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,418,000	
	東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,501,000	
	東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	210,502,000	
	日本郵船 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,254,000	
	日本電信電話 第51回	300,000,000	320,514,000	
	KDDI 第5回2号	100,000,000	113,243,000	
	KDDI 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,561,000	
	NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,962,000	
	東京電力 第426回	200,000,000	192,752,000	
	東京電力 第428回	300,000,000	279,858,000	

	東京電力 第459回	100,000,000	79,809,000	
	東京電力 第510回	100,000,000	92,253,000	
	東京電力 第511回	100,000,000	90,275,000	
	東京電力 第560回	100,000,000	62,099,000	
	東京電力 第565回	300,000,000	206,649,000	
	中部電力 第406回	200,000,000	219,720,000	
	中部電力 第464回	100,000,000	100,306,000	
	中部電力 第467回	100,000,000	102,650,000	
	中部電力 第482回	200,000,000	214,180,000	
	関西電力 第439回	100,000,000	102,552,000	
	関西電力 第441回	200,000,000	205,064,000	
	関西電力 第448回	200,000,000	213,640,000	
	中国電力 第330回	100,000,000	106,001,000	
	北陸電力 第245回	200,000,000	220,246,000	
	北陸電力 第248回	100,000,000	113,024,000	
	東北電力 第414回	100,000,000	100,473,000	
	東北電力 第431回	400,000,000	422,708,000	
	九州電力 第372回	100,000,000	100,318,000	
	九州電力 第374回	100,000,000	101,449,000	
	九州電力 第389回	200,000,000	210,362,000	
	九州電力 第395回	100,000,000	102,300,000	
	九州電力 第409回	100,000,000	102,193,000	
	北海道電力 第285回	100,000,000	103,806,000	
	電源開発 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,884,000	
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,960,000	
	大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,212,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,283,000	
	N T T デ - タ 第24回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,034,000	
社債券計	銘柄数：131	16,700,000,000	17,094,358,000	
	組入時価比率：7.3%		7.4%	
合計			230,884,642,192	

(注) 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  
該当事項はございません。

[次へ](#)

## 4 「外国債券マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## (1) 貸借対照表

科目	対象年月日	平成24年4月2日現在 金額(円)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金		2,082,481,820
コール・ローン		254,654,287
国債証券		289,572,127,330
派生商品評価勘定		2,537,050
未収入金		223,528,103
未収利息		3,545,195,088
前払費用		148,982,168
流動資産合計		295,829,505,846
<b>資産合計</b>		
295,829,505,846		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定		1,147,300
未払解約金		160,560,160
その他未払費用		2,607,300
流動負債合計		164,314,760
<b>負債合計</b>		
164,314,760		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本		191,939,049,543
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		103,726,141,543
元本等合計		295,665,191,086
<b>純資産合計</b>		
295,665,191,086		
<b>負債純資産合計</b>		
295,829,505,846		

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 外国為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3 費用・収益の計上基準	<p>(1) 有価証券売買等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (追加情報)

自 平成23年4月1日 至 平成24年4月2日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

平成24年4月2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	1,540円
(10,000口当たり純資産額)	15,404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23年4月1日 至 平成24年4月2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、(3)附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 また、当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行なうことを目的として、為替予約取引を利用しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成24年4月2日現在	
1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2 時価の算定方法 国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(3)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)

平成24年4月2日現在

1 元本の移動及び期末元本額の内訳	
期首	平成23年4月1日
期首元本額	227,779,692,512 円
期首より平成24年4月2日までの期中追加設定元本額	16,636,473,163 円
期首より平成24年4月2日までの期中一部解約元本額	52,477,116,132 円
期末元本額	191,939,049,543 円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	129,133,035 円
バランスセレクト50	136,146,444 円
バランスセレクト70	73,892,911 円
野村外国債券インデックスファンド	286,166,265 円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,934,714,884 円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	80,790,285,911 円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,784,707,617 円
野村資産設計ファンド2015	191,693,458 円
野村資産設計ファンド2020	77,442,303 円
野村資産設計ファンド2025	72,927,536 円
野村資産設計ファンド2030	58,237,342 円
野村資産設計ファンド2035	37,864,473 円
野村資産設計ファンド2040	122,160,819 円
野村外国債券インデックス(野村投資一任口座向け)	1,970,382,998 円
のむらップ・ファンド(保守型)	1,335,277,377 円
のむらップ・ファンド(普通型)	1,275,222,311 円
のむらップ・ファンド(積極型)	684,152,719 円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	135,268,523 円
野村資産設計ファンド2045	2,073,865 円
野村インデックスファンド・外国債券	78,105,763 円
マイ・ロード	274,233,742 円
野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	134,354,894 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)	26,003,603,443 円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	1,544,118,462 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)	23,420,872,116 円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,603,727,316 円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	12,290,906 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)	58,347,495 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)	9,432,939 円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	12,766,272,730 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)	895,659,343 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)	3,452,870,451 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)	574,816,486 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)	122,083,946 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)	370,737,438 円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	3,248,604,467 円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,717,198,590 円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,298,324,372 円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,940,816 円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	6,704,881 円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	4,851,125 円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	450,935,419 円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,470,550,778 円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	1,853,984,760 円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	1,723,946,928 円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	9,533,577,401 円
マイバランスDC30	576,093,485 円
マイバランスDC50	311,023,624 円
マイバランスDC70	159,445,438 円
野村DC外国債券インデックスファンド	1,147,471,356 円
野村DC運用戦略ファンド	14,117,842 円

\* 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

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成24年4月2日現在)

該当事項はございません。

## (2) 株式以外の有価証券

(平成24年4月2日現在)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US TREASURY BOND	9,400,000.00	11,846,202.42	
	US TREASURY BOND	10,000,000.00	12,963,281.00	
	US TREASURY BOND	12,000,000.00	16,594,687.20	
	US TREASURY BOND	7,500,000.00	10,537,500.00	
	US TREASURY BOND	3,700,000.00	5,486,261.58	
	US TREASURY BOND	4,000,000.00	5,813,124.80	
	US TREASURY BOND	10,000,000.00	15,377,343.00	
	US TREASURY BOND	10,000,000.00	15,191,796.00	
	US TREASURY BOND	3,200,000.00	4,699,499.84	
	US TREASURY BOND	3,000,000.00	4,399,452.90	
	US TREASURY BOND	4,500,000.00	6,237,421.65	
	US TREASURY BOND	4,050,000.00	6,225,609.37	
	US TREASURY BOND	2,900,000.00	4,287,241.97	
	US TREASURY BOND	3,000,000.00	4,141,171.80	
	US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,896,250.00	
	US TREASURY BOND	1,500,000.00	2,202,421.80	
	US TREASURY BOND	1,700,000.00	2,453,578.04	
	US TREASURY BOND	4,100,000.00	5,796,054.38	
	US TREASURY BOND	4,500,000.00	6,025,429.35	
	US TREASURY BOND	2,700,000.00	3,535,312.50	
	US TREASURY BOND	9,300,000.00	11,167,628.79	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,108,203.00	
	US TREASURY N/B	19,500,000.00	19,805,448.00	
	US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,279,140.40	
	US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,415,077.30	
	US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,207,030.00	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,093,359.00	
	US TREASURY N/B	18,550,000.00	19,550,685.31	
	US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,680,000.00	
	US TREASURY N/B	13,500,000.00	14,072,167.80	
	US TREASURY N/B	15,000,000.00	14,959,569.00	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,267,694.70	
	US TREASURY N/B	15,000,000.00	14,985,351.00	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,205,078.00	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,120,703.00	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,180,742.10	
	US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,718,554.50	
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,087,695.00	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,277,734.00	
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,089,648.00	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,309,765.00	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	15,506,287.82	

	US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,601,756.50	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,498,828.00	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,049,609.00	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,357,109.20	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,462,109.00	
	US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,955,468.00	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,340,976.30	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,173,280.80	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,522,187.20	
	US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,809,375.00	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	12,398,983.90	
	US TREASURY N/B	11,000,000.00	12,088,398.30	
	US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,745,389.40	
	US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,641,523.30	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,591,406.00	
	US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,985,780.80	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,482,421.00	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,285,742.10	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,369,531.00	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,447,968.00	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,214,062.00	
	US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,181,405.80	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,629,374.40	
	US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,217,265.40	
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,141,562.50	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	12,002,812.50	
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,354,687.50	
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,315,000.00	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,905,234.05	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,405,780.90	
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,216,562.50	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,396,249.60	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,794,687.20	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,206,561.60	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,700,781.00	
	US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,999,452.30	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,909,375.00	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,777,187.20	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,647,656.00	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,642,500.00	
	US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,357,890.30	
	US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,895,077.90	
	US TREASURY N/B	7,500,000.00	8,209,277.25	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,065,625.00	
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	7,017,187.20	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,831,250.00	
	US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,630,702.90	
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,253,124.80	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,875,000.00	
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,177,734.00	
	US TREASURY N/B	11,000,000.00	12,798,671.60	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,981,561.60	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,234,375.00	
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,246,327.90	
	US TREASURY N/B	9,000,000.00	10,328,905.80	
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,346,405.80	
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,954,843.60	
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,967,187.50	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,435,937.00	
	US TREASURY N/B	10,600,000.00	11,422,327.86	
	US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,319,295.90	
	US TREASURY N/B	11,700,000.00	13,276,757.52	
	US TREASURY N/B	15,000,000.00	16,748,437.50	
	US TREASURY N/B	20,000,000.00	22,681,250.00	
	US TREASURY N/B	19,000,000.00	21,375,741.00	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,655,311.60	
	US TREASURY N/B	12,500,000.00	13,146,972.50	
	US TREASURY N/B	20,500,000.00	23,209,843.75	
	US TREASURY N/B	22,000,000.00	23,949,921.60	
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,997,500.00	
	US TREASURY N/B	4,600,000.00	6,733,250.00	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,690,000.00	
	US TREASURY N/B	8,200,000.00	10,013,929.38	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,274,804.60	
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,785,937.00	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	14,700,000.00	
	US TREASURY N/B	14,000,000.00	16,824,609.20	

	US TREASURY N/B	9,000,000.00	11,243,671.20	
	US TREASURY N/B	14,000,000.00	16,822,968.40	
	US TREASURY N/B	14,000,000.00	15,485,311.80	
	US TREASURY N/B	11,300,000.00	13,306,632.53	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,920,625.00	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,415,312.50	
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,836,874.80	
	US TREASURY NOTE	7,000,000.00	7,157,773.00	
	US TREASURY NOTE	17,000,000.00	17,639,490.70	
	US TREASURY NOTE	7,000,000.00	7,271,250.00	
	US TREASURY NOTE	21,500,000.00	22,866,423.90	
	US TREASURY NOTE	8,000,000.00	8,222,187.20	
	US TREASURY NOTE	13,300,000.00	14,202,424.95	
	US TREASURY NOTE	7,000,000.00	7,118,944.70	
	US TREASURY NOTE	14,700,000.00	16,021,277.16	
	US TREASURY NOTE	7,500,000.00	8,777,343.75	
米ドル計	銘柄数：135	1,286,700,000.00	1,432,984,727.72	
			(119,224,329,346)	
	組入時価比率：40.3%		41.2%	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	4,400,592.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	7,296,173.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	4,585,590.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,518,095.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,015,150.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,570,000.00	4,937,930.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,300,000.00	6,538,833.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,905,734.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	4,167,460.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,693,550.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,830,318.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,206,280.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	3,240,170.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,669,696.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,626,750.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,779,406.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	3,172,745.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	2,658,443.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,574,766.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	2,386,300.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	4,629,824.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	5,409,864.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	12,372,096.00	
カナダドル計	銘柄数：23	90,470,000.00	104,615,765.70	
			(8,731,231,805)	
	組入時価比率：3.0%		3.0%	
	UK TREASURY	5,000,000.00	5,187,500.00	
	UK TREASURY	2,000,000.00	2,224,000.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	6,728,800.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	7,442,360.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	6,901,050.00	
	UK TREASURY	5,000,000.00	5,700,000.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,521,840.00	
	UK TREASURY	7,700,000.00	8,051,890.00	
	UK TREASURY	6,900,000.00	7,835,640.00	
	UK TREASURY	3,000,000.00	3,102,000.00	
	UK TREASURY	3,100,000.00	4,349,300.00	
	UK TREASURY	3,700,000.00	4,490,690.00	
	UK TREASURY	4,900,000.00	5,863,340.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	6,533,340.00	
	UK TREASURY	6,000,000.00	7,321,800.00	
	UK TREASURY	5,600,000.00	6,406,400.00	
	UK TREASURY	3,600,000.00	5,418,000.00	
	UK TREASURY	4,300,000.00	4,903,720.00	
	UK TREASURY	3,500,000.00	4,059,300.00	

	UK TREASURY	4,600,000.00	5,844,300.00	
	UK TREASURY	4,000,000.00	4,713,600.00	
	UK TREASURY	2,800,000.00	3,976,560.00	
	UK TREASURY	4,300,000.00	5,325,120.00	
	UK TREASURY	5,000,000.00	5,817,500.00	
	UK TREASURY	8,500,000.00	9,858,300.00	
	UK TREASURY	6,100,000.00	7,649,400.00	
	UK TREASURY	4,600,000.00	5,341,520.00	
	UK TREASURY	800,000.00	929,600.00	
	UK TREASURY	15,200,000.00	18,498,400.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,717,680.00	
	UNITED KINGDOM (GOVERNMENT)	6,300,000.00	7,540,470.00	
英ポンド計	銘柄数：31	155,400,000.00	182,253,420.00	
			(24,250,640,065)	
	組入時価比率：8.2%		8.4%	
	SWITZERLAND	2,000,000.00	2,181,400.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	5,900,000.00	7,090,030.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	1,000,000.00	1,423,500.00	
スイスフラン 計	銘柄数：3	8,900,000.00	10,694,930.00	
			(985,965,596)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,000,000.00	20,024,100.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,200,000.00	17,854,020.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,200,900.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,000,000.00	14,427,400.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	20,000,000.00	23,254,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	30,400,000.00	37,937,680.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	14,692,800.00	
スウェーデン クローナ計	銘柄数：7	123,900,000.00	143,390,900.00	
			(1,806,725,340)	
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	16,500,000.00	17,385,901.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	15,000,000.00	16,521,000.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,200,000.00	13,578,600.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	11,495,000.00	

[次へ](#)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,438,000.00	
ノルウェーク ローネ計	銘柄数：5	59,500,000.00	65,418,501.50	
			(958,381,046)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
	KINGDOM OF DENMARK	25,000,000.00	26,902,500.00	
	KINGDOM OF DENMARK	26,000,000.00	29,187,600.00	
	KINGDOM OF DENMARK	14,000,000.00	16,287,600.00	
	KINGDOM OF DENMARK	23,500,000.00	27,819,300.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,500,000.00	17,112,000.00	
	KINGDOM OF DENMARK	7,000,000.00	10,760,960.00	
	KINGDOM OF DENMARK	28,500,000.00	40,404,450.00	
デンマークク ローネ計	銘柄数：7	139,500,000.00	168,474,410.00	
			(2,513,638,197)	
	組入時価比率：0.9%		0.9%	
	BELGIUM KINGDOM	5,600,000.00	5,860,887.20	
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,883,870.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	3,982,020.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	6,000,000.00	6,283,200.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,500,000.00	3,681,650.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	4,200,000.00	4,481,820.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,500,000.00	4,140,150.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	5,500,000.00	5,851,450.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	4,500,000.00	4,694,400.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	4,000,000.00	4,294,400.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,000,000.00	3,441,300.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,000,000.00	3,212,400.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,000,000.00	3,201,900.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	4,365,000.00	5,267,245.50	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	7,500,000.00	8,743,462.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,005,000.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,000,000.00	7,242,200.00	

	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	304,605.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	1,983,600.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000,000.00	9,745,000.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,006,400.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,500,000.00	6,395,025.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	3,896,200.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000.00	4,450,500.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000.00	4,344,300.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000.00	4,195,800.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	5,203,010.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,800,000.00	5,895,352.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	8,604,760.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	3,338,600.00	
	BUNDES OblIGATION	3,000,000.00	3,102,750.00	
	BUNDES OblIGATION	6,000,000.00	6,337,200.00	
	BUNDES OblIGATION	6,000,000.00	6,373,800.00	
	BUNDES OblIGATION	5,000,000.00	5,428,000.00	
	BUNDES OblIGATION	1,500,000.00	1,534,800.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,500,000.00	12,013,475.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,000,000.00	11,781,550.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,000,000.00	13,076,400.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	7,111,000.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000.00	9,821,700.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,500,000.00	14,993,100.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,800,000.00	8,893,560.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	6,828,900.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,853,750.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,155,700.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	7,120,200.00	

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,600,000.00	7,666,230.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	7,460,700.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	7,926,100.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	6,678,000.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	5,886,100.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,652,500.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,455,060.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	4,557,000.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	7,041,000.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	6,111,200.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	10,041,500.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	8,937,207.50	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,500,000.00	10,784,800.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,100,000.00	6,885,510.00	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000.00	3,061,787.40	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,047,420.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	17,700,000.00	18,138,960.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000.00	11,187,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,009,900.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	10,759,350.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	11,827,750.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,200,000.00	5,138,640.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	14,000,000.00	14,112,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,000,800.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	14,500,000.00	14,449,250.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,497,800.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	7,533,360.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,541,800.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,013,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,500,000.00	6,415,500.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,000,000.00	5,988,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	6,852,300.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,000,000.00	5,943,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,000,000.00	5,840,400.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	6,657,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	4,624,500.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	4,856,390.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,000,000.00	5,925,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,493,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,000,000.00	5,788,800.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,300,000.00	13,342,620.00	

	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	6,417,400.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,700,000.00	8,316,770.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,250,000.00	7,007,850.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000,000.00	10,240,000.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	6,375,680.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	4,889,160.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,800,000.00	3,000,480.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	5,972,380.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,224,500.00	
	FINNISH GOVERNMENT	2,500,000.00	2,659,500.00	
	FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,666,275.00	
	FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,611,520.00	
	FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,519,050.00	
	FINNISH GOVERNMENT	2,500,000.00	2,740,750.00	
	FINNISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,425,500.00	
	FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,725,075.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,305,600.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,000,000.00	12,650,400.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,000,000.00	9,605,700.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,800,000.00	7,331,760.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,000,000.00	9,687,150.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,500,000.00	11,178,825.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,000,000.00	10,747,000.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,500,000.00	12,091,800.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,000,000.00	9,889,200.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	5,951,370.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000.00	7,229,625.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,800,000.00	6,527,900.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,086,320.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,687,800.00	

	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,200,000.00	4,573,800.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,548,800.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	7,860,000.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,000,000.00	9,728,550.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	4,882,595.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	9,091,200.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,946,000.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,813,100.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000.00	6,580,600.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,100,000.00	5,155,340.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	6,580,000.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	5,900,000.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,400,000.00	9,964,000.00	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,400,000.00	13,206,330.00	
	FRENCH TREASURY NOTE	5,000,000.00	5,166,700.00	
	FRENCH TREASURY NOTE	4,500,000.00	4,723,875.00	
	FRENCH TREASURY NOTE	5,500,000.00	5,742,792.00	
	FRENCH TREASURY NOTE	6,200,000.00	6,409,392.60	
	IRELAND(REP OF)	3,700,000.00	3,673,966.80	
	IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	3,000,000.00	2,671,560.00	
	IRISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,014,960.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	IRISH GOVERNMENT	2,120,000.00	2,093,584.80	
	IRISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,823,866.00	
	IRISH GOVERNMENT	1,000,000.00	956,540.00	
	IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,045,133.00	
	IRISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,777,944.00	
	IRISH GOVERNMENT	2,200,000.00	1,921,260.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	5,364,500.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,763,250.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,000,000.00	6,468,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,700,000.00	7,509,360.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,000,000.00	6,933,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,800,000.00	4,328,960.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,568,800.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	5,525,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,356,800.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,809,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,470,000.00	6,640,185.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,900,000.00	3,911,810.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,889,200.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	602,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,147,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,320,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,130,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,500,000.00	4,842,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,416,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,500,000.00	5,156,527.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,381,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,500,000.00	3,830,750.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,500,000.00	4,779,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,070,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,697,900.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000.00	2,293,058.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,700,000.00	4,139,930.00	
	SPANISH GOVERNMENT	9,200,000.00	9,454,380.00	
	SPANISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,269,325.00	
	SPANISH GOVERNMENT	10,500,000.00	10,978,275.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,000,000.00	5,266,500.00	

	SPANISH GOVERNMENT	6,300,000.00	6,336,855.00	
	SPANISH GOVERNMENT	3,960,000.00	3,844,764.00	
	SPANISH GOVERNMENT	6,200,000.00	4,791,980.00	
ユーロ計	銘柄数：178	993,065,000.00	1,073,615,266.40	
			(119,224,975,333)	
	組入時価比率：40.3%		41.2%	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,536,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,379,100.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,800,000.00	12,065,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,728,800.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,100,000.00	13,781,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,600,000.00	10,790,800.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,121,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,922,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,800,000.00	9,967,090.00	
ズロチ計	銘柄数：9	81,700,000.00	83,291,990.00	
			(2,230,559,492)	
	組入時価比率：0.8%		0.8%	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,700,000.00	2,905,818.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,000,000.00	2,165,924.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,746,516.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,700,000.00	3,206,709.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,500,000.00	3,960,155.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,175,530.40	
シンガポールドル計	銘柄数：6	15,200,000.00	17,160,654.00	
			(1,139,124,212)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,316,991.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	10,394,970.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,232,527.00	

	MALAYSIAN GOVERNMENT	14,500,000.00	15,051,551.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	8,835,758.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	10,934,924.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,078,500.00	

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	3,986,077.20	
リング計	銘柄数：8	55,100,000.00	56,831,299.40	
			(1,549,221,221)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,500,000.00	6,705,536.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,599,607.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	8,635,752.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,561,459.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,986,391.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,900,000.00	6,426,262.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,849,994.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	7,258,156.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,278,600.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,040,460.00	
豪ドル計	銘柄数：10	45,700,000.00	49,342,219.70	
			(4,279,450,714)	
	組入時価比率：1.4%		1.5%	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	34,000,000.00	35,768,782.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,000,000.00	38,377,850.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	44,506,160.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	48,708,078.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	19,000,000.00	19,474,069.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	19,643,160.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	61,000,000.00	64,698,796.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,000,000.00	62,940,892.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	5,000,000.00	5,272,255.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	65,000,000.00	72,592,260.00	
メキシコペソ 計	銘柄数：10	366,000,000.00	411,982,302.00	

			(2,677,884,963)	
	組入時価比率：0.9%		0.9%	
国債証券計			289,572,127,330	
			(289,572,127,330)	
合計			289,572,127,330	
			(289,572,127,330)	

- (注) 1 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。  
2 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。  
3 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成24年4月2日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
買建	176,671,950		179,209,000	2,537,050
米ドル	73,817,550		74,871,000	1,053,450
英ポンド	26,211,680		26,610,000	398,320
ユーロ	76,642,720		77,728,000	1,085,280
売建	121,488,700		122,636,000	1,147,300
米ドル	20,624,850		20,797,500	172,650
ユーロ	88,031,440		88,832,000	800,560
豪ドル	12,832,410		13,006,500	174,090
合計				1,389,750

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成24年4月27日現在

資産総額	4,627,808,396	円
負債総額	3,743,127	円
純資産総額( - )	4,624,065,269	円
発行済口数	5,676,545,116	口
1口当たり純資産額( / )	0.8146	円

&lt;ご参考&gt;

## 「国内株式マザーファンド」

資産総額	160,523,470,390	円
負債総額	18,357,650,716	円
純資産総額( - )	142,165,819,674	円
発行済口数	205,662,835,834	口
1口当たり純資産額( / )	0.6913	円

## 「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

資産総額	213,143,778,229	円
負債総額	344,838,944	円
純資産総額( - )	212,798,939,285	円
発行済口数	206,988,898,330	口
1口当たり純資産額( / )	1.0281	円

## 「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」

資産総額	235,020,292,173	円
負債総額	917,730,586	円
純資産総額( - )	234,102,561,587	円
発行済口数	200,635,331,095	口
1口当たり純資産額( / )	1.1668	円

## 「外国債券マザーファンド」

資産総額	286,848,548,454	円
負債総額	801,021,089	円
純資産総額( - )	286,047,527,365	円
発行済口数	190,185,387,128	口
1口当たり純資産額( / )	1.5040	円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3) 受益権の譲渡

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

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

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

### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (5) 受益権の再分割

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

### (6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

平成24年5月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### (a) 会社の意思決定機構

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

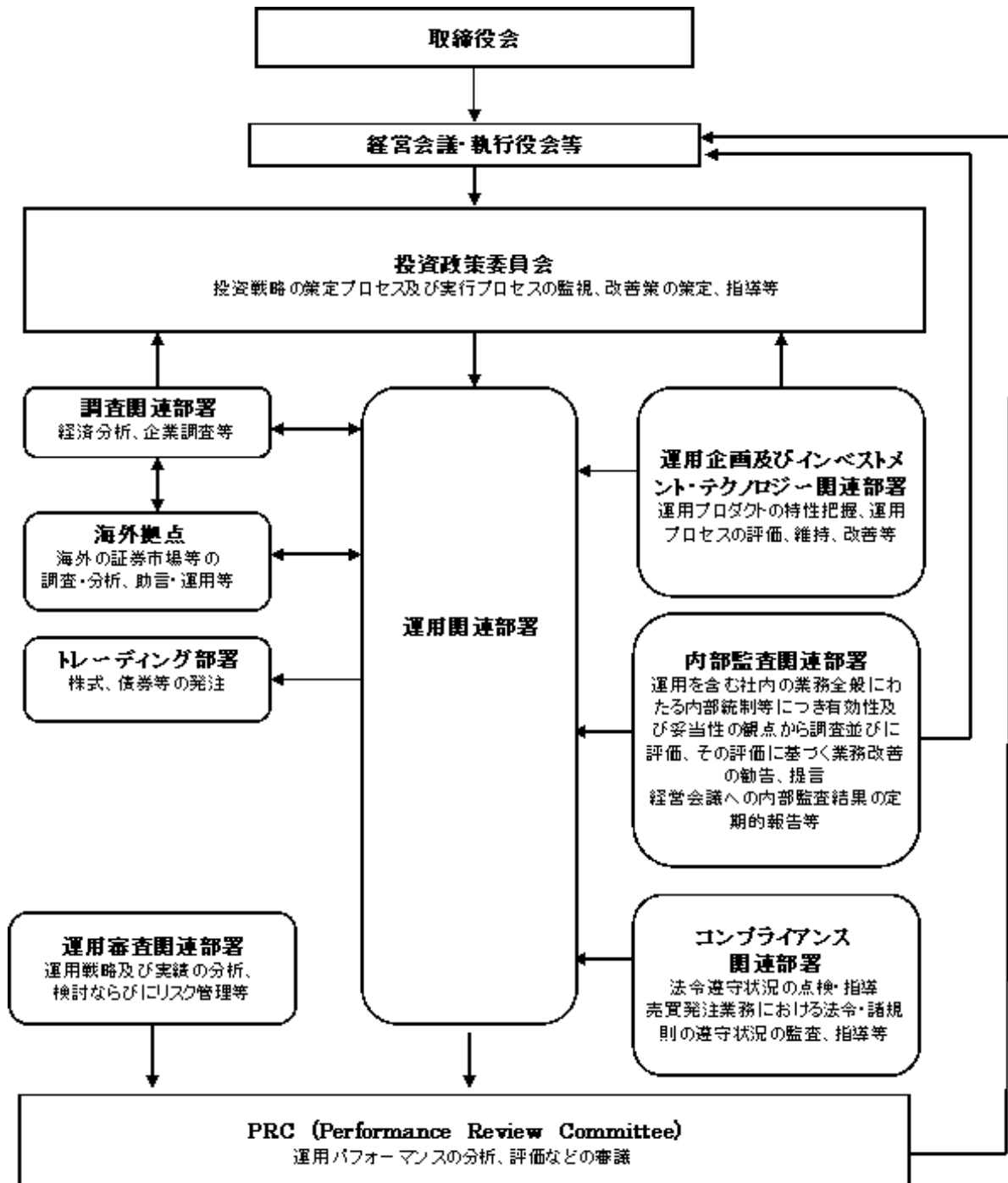
###### 代表執行役・執行役

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

###### 委員会

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

###### (b) 投資信託の運用体制



## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成24年4月27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	768	9,983,622
単位型株式投資信託	40	228,995
追加型公社債投資信託	18	4,740,909
単位型公社債投資信託	0	0
合計	826	14,953,526

### 3 【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

なお、財務諸表等規則は、平成21年3月24日付内閣府令第5号により改正されておりますが、第51期事業年度(前事業年度)は改正前、第52期事業年度(当事業年度)は改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57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. 財務諸表及び中間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. 委託会社の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度及び当事業年度の財務諸表ならびに当中間会計期間の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査及び中間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22年 3月31日)	(平成23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		520	538
金銭の信託		38,530	39,575
有価証券		5,100	1,400
短期貸付金		126	166
前払金		0	0
前払費用		47	41
未収入金		79	171
未収委託者報酬		9,756	10,032
未収収益		2,645	3,761
繰延税金資産		1,513	1,736
その他		143	12
貸倒引当金		6	6
流動資産計		58,457	57,430
固定資産			
有形固定資産		1,729	1,823
建物	2	635	576
器具備品	2	1,094	1,246
無形固定資産		11,839	10,649
ソフトウェア		11,836	10,647
電話加入権		1	1
その他		1	0
投資その他の資産		28,988	32,430
投資有価証券		11,614	8,648
関係会社株式		16,099	22,609
従業員長期貸付金		366	235
長期差入保証金		66	64
長期前払費用		23	24
繰延税金資産		490	582
その他		327	265
貸倒引当金		0	0
固定資産計		42,557	44,903
資産合計		101,014	102,333

		前事業年度 (平成22年 3月31日)	当事業年度 (平成23年 3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)
<b>(負債の部)</b>			
<b>流動負債</b>			
関係会社短期借入金		11,000	8,000
預り金		95	87
未払金	1	6,217	7,645
未払収益分配金		4	4
未払償還金		61	79
未払手数料		4,226	4,517
その他未払金		1,925	3,043
未払費用	1	7,594	7,373
未払法人税等		849	800
前受収益		9	9
賞与引当金		2,538	2,900
流動負債計		28,305	26,818
<b>固定負債</b>			
退職給付引当金		4,576	4,064
時効後支払損引当金		475	481
その他		351	65
固定負債計		5,403	4,611
<b>負債合計</b>		<b>33,708</b>	<b>31,429</b>
<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	11,729
資本準備金		11,729	11,729
利益剰余金		35,164	39,369
利益準備金		685	685
その他利益剰余金		34,479	38,684
別途積立金		24,606	24,606
繰越利益剰余金		9,872	14,077
評価・換算差額等		3,231	2,624
その他有価証券評価差額金		3,056	2,694
繰延ヘッジ損益		175	69
<b>純資産合計</b>		<b>67,306</b>	<b>70,903</b>
<b>負債・純資産合計</b>		<b>101,014</b>	<b>102,333</b>

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)		当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			76,293		81,230
運用受託報酬			10,576		13,165
その他営業収益			57		143
営業収益計			86,927		94,539
営業費用					
支払手数料			35,199		39,741
広告宣伝費			1,155		1,155
公告費			0		-
受益証券発行費			10		6
調査費			20,998		20,709
調査費		1,394		1,310	
委託調査費		19,603		19,398	
委託計算費			883		917
営業雑経費			2,493		2,451
通信費		222		207	
印刷費		1,293		1,148	
協会費		71		73	
諸経費		905		1,022	
営業費用計			60,740		64,980
一般管理費					
給料			9,912		10,131
役員報酬	2	388		322	
給料・手当		6,740		6,822	
賞与		2,784		2,987	
交際費			153		141
旅費交通費			458		484
租税公課			206		231
不動産賃借料			1,464		1,452
退職給付費用			1,116		1,054
固定資産減価償却費			4,630		4,575
諸経費			6,529		6,106
一般管理費計			24,471		24,176
営業利益			1,715		5,382

		前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)		当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	3,698		4,771	
収益分配金		6		9	
受取利息		5		6	
金銭の信託運用益		2,385		1,222	
為替差益		45		62	
その他		283		319	
営業外収益計			6,424		6,391
営業外費用					
支払利息	1	98		75	
時効後支払損引当金繰入額		37		13	
その他		53		9	
営業外費用計			189		98
経常利益			7,950		11,676
特別利益					
投資有価証券売却益		72		419	
株式報酬受入益		226		173	
特別利益計			299		593
特別損失					
投資有価証券売却損		60		149	
投資有価証券等評価損		70		10	
固定資産除却損	3	16		412	
システム利用契約解約違約金		63		20	
特別損失計			210		591
税引前当期純利益			8,039		11,677
法人税、住民税及び事業税			2,662		3,759
法人税等調整額			492		108
当期純利益			5,869		7,810

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
<b>株主資本</b>		
<b>資本金</b>		
前期末残高	17,180	17,180
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	17,180	17,180
<b>資本剰余金</b>		
<b>資本準備金</b>		
前期末残高	11,729	11,729
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,729	11,729
<b>資本剰余金合計</b>		
前期末残高	11,729	11,729
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,729	11,729
<b>利益剰余金</b>		
<b>利益準備金</b>		
前期末残高	685	685
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	685	685
<b>その他利益剰余金</b>		
<b>別途積立金</b>		
前期末残高	24,606	24,606
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	24,606	24,606
<b>繰越利益剰余金</b>		
前期末残高	7,608	9,872
当期変動額		
別途積立金の取崩	-	-
剰余金の配当	3,605	3,605
当期純利益	5,869	7,810
当期変動額合計	2,264	4,204

当期末残高	9,872	14,077
利益剰余金合計		
前期末残高	32,900	35,164
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	3,605
当期純利益	5,869	7,810
当期変動額合計	2,264	4,204
当期末残高	35,164	39,369
株主資本合計		
前期末残高	61,810	64,074
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	3,605
当期純利益	5,869	7,810
当期変動額合計	2,264	4,204
当期末残高	64,074	68,279
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	2,084	3,056
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	971	361
当期変動額合計	971	361
当期末残高	3,056	2,694
繰延ヘッジ損益		
前期末残高	249	175
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	73	245
当期変動額合計	73	245
当期末残高	175	69
評価・換算差額等合計		
前期末残高	2,333	3,231
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	898	607
当期変動額合計	898	607
当期末残高	3,231	2,624
純資産合計		
前期末残高	64,143	67,306
当期変動額		
剰余金の配当	3,605	3,605
当期純利益	5,869	7,810
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	898	607
当期変動額合計	3,162	3,597
当期末残高	67,306	70,903



## [重要な会計方針]

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)								
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ...移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの... 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております) 時価のないもの... 移動平均法による原価法</p> <p>2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法</p> <p>4. 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、定額法によっております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0" data-bbox="319 1086 622 1209"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間に基づく定額法によっております。</p> <p>5. 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。 なお、破綻先に対する債権3百万円については、債権額から備忘価額を控除した額を取立不能見込額として債権額から直接減額しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p>	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>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 (同左)</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの (同左)</p> <p>時価のないもの (同左)</p> <p>2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法 (同左)</p> <p>3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 (同左)</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 (同左)</p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 (同左)</p> <p>5. 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 (同左)</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								

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務債務は、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>6. リース取引の処理方法 リース取引開始日が平成20年 4月 1日より前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p> <p>7. ヘッジ会計 (1)ヘッジ会計の方法 ヘッジ会計は、原則として、時価評価されているヘッジ手段に係る損益を、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで純資産の部において繰り延べる方法によっております。</p> <p>(2)ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段 - 為替予約、株価指数先物 ヘッジ対象 - 投資有価証券</p> <p>(3)ヘッジ方針 投資有価証券に係る為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4)ヘッジ有効性評価の方法 為替変動リスク及び価格変動リスクのヘッジにつきましては、そのリスク減殺効果を、対応するヘッジ手段ならびにヘッジ対象ごとに定期的に把握し、ヘッジの有効性を確かめております。</p> <p>8. 消費税等の会計処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>9. 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。</p>	<p>(3) 退職給付引当金 (同左)</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 (同左)</p> <p>6. リース取引の処理方法 (同左)</p> <p>7. ヘッジ会計 (1)ヘッジ会計の方法 ヘッジ会計は、原則として、時価評価されているヘッジ手段に係る損益を、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで純資産の部において繰り延べる方法によっております。 また、為替予約が付されている外貨建金銭債権については、振当処理を行っております。</p> <p>(2)ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段 - 為替予約 ヘッジ対象 - 投資有価証券、短期貸付金</p> <p>(3)ヘッジ方針 投資有価証券及び短期貸付金に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4)ヘッジ有効性評価の方法 為替変動リスクのヘッジにつきましては、そのリスク減殺効果を、対応するヘッジ手段ならびにヘッジ対象ごとに定期的に把握し、ヘッジの有効性を確かめております。</p> <p>8. 消費税等の会計処理方法 (同左)</p> <p>9. 連結納税制度の適用 (同左)</p>

## [会計方針の変更]

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
(退職給付の処理方法) 「退職給付に係る会計基準」の一部改正(その3)(企業会計基準第19号 平成20年 7月31日)に伴い、当事業年度から同会計基準を適用しております。なお、同会計基準の適用に伴う退職給付債務の変動はないため、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。	
	(資産除去債務に関する会計基準) 当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年 3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針(企業会計基準第21号 平成20年 3月31日)」を適用しております。 これによる損益への影響はありません。

## [追加情報]

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
(耐用年数の変更) 当社は、翌事業年度に導入予定のシステムにより置き換えられる現行のシステムの状況等を調査した結果、一部のシステム(ソフトウェア及び器具備品)について耐用年数が実態と乖離していることが判明したため、当該資産の耐用年数を実態に合わせて変更しております。 この結果、従来の方法と比較して、減価償却費が284百万円増加し、経常利益及び税引前当期純利益は284百万円減少しております。	
(賞与制度の改定) 従業員の賞与につきましては従来 6月及び12月の年 2回の支給であり、賞与引当金には計算期間が10月 1日から 3月末日までに対応する金額を計上していましたが、制度改定により年 1回の支給と変更となり、当事業年度末においては賞与引当金には計算期間が 4月 1日から 3月末日までに対応する金額を計上しております。	

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成22年3月31日)	当事業年度末 (平成23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 1,655百万円	未払金 2,442百万円
未払費用 1,017	未払費用 762
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 369百万円	建物 437百万円
器具備品 1,647	器具備品 1,874
合計 2,017	合計 2,311

## 損益計算書関係

前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23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 3,542百万円	受取配当金 4,633百万円
支払利息 98	支払利息 75
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 7百万円	ソフトウェア 412百万円
器具備品 5	
ソフトウェア 4	
合計 16	合計 412

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成21年4月1日 至 平成22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	前事業年度末株式数	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21年5月28日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	3,605百万円
1株当たり配当額	700円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21年6月1日

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

平成22年5月27日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	3,605百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	700円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年6月1日

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23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	前事業年度末株式数	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22年5月27日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	3,605百万円
1株当たり配当額	700円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年6月1日

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

該当事項はありません。

## リース取引関係

前事業年度 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	当事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)																																																																
<p>1. ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) 該当事項はありません。</p> <p>(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;"></th> <th style="text-align: right;">器具備品</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">603百万円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">415</td> </tr> <tr> <td>減損損失累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">188</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額及びリース資産減損勘定期末残高 未経過リース料期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">99百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年超</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right;">195</td> </tr> </tbody> </table> <p>リース資産減損勘定期末残高 - 百万円</p> <p>支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額及び減損損失</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">187百万円</td> </tr> <tr> <td>リース資産減損勘定の取崩額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">175</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">7</td> </tr> <tr> <td>減損損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </tbody> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については利息法によっております。</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>未経過リース料</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">5百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年超</td> <td style="text-align: right;">3</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right;">8</td> </tr> </tbody> </table>		器具備品	取得価額相当額	603百万円	減価償却累計額相当額	415	減損損失累計額相当額	-	期末残高相当額	188	1年以内	99百万円	1年超	96	合計	195	支払リース料	187百万円	リース資産減損勘定の取崩額	-	減価償却費相当額	175	支払利息相当額	7	減損損失	-	1年以内	5百万円	1年超	3	合計	8	<p>1. ファイナンス・リース取引</p> <p>(1)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) (同左)</p> <p>(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額、減損損失累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;"></th> <th style="text-align: right;">器具備品</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">417百万円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">325</td> </tr> <tr> <td>減損損失累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">91</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額及びリース資産減損勘定期末残高 未経過リース料期末残高相当額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">73百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年超</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> </tbody> </table> <p>リース資産減損勘定期末残高 - 百万円</p> <p>支払リース料、リース資産減損勘定の取崩額、減価償却費相当額、支払利息相当額及び減損損失</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">103百万円</td> </tr> <tr> <td>リース資産減損勘定の取崩額</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">3</td> </tr> <tr> <td>減損損失</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </tbody> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 (同左)</p> <p>利息相当額の算定方法 (同左)</p> <p>2. オペレーティング・リース取引</p> <p>未経過リース料</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">6百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年超</td> <td style="text-align: right;">4</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">合計</td> <td style="text-align: right;">10</td> </tr> </tbody> </table>		器具備品	取得価額相当額	417百万円	減価償却累計額相当額	325	減損損失累計額相当額	-	期末残高相当額	91	1年以内	73百万円	1年超	22	合計	96	支払リース料	103百万円	リース資産減損勘定の取崩額	-	減価償却費相当額	96	支払利息相当額	3	減損損失	-	1年以内	6百万円	1年超	4	合計	10
	器具備品																																																																
取得価額相当額	603百万円																																																																
減価償却累計額相当額	415																																																																
減損損失累計額相当額	-																																																																
期末残高相当額	188																																																																
1年以内	99百万円																																																																
1年超	96																																																																
合計	195																																																																
支払リース料	187百万円																																																																
リース資産減損勘定の取崩額	-																																																																
減価償却費相当額	175																																																																
支払利息相当額	7																																																																
減損損失	-																																																																
1年以内	5百万円																																																																
1年超	3																																																																
合計	8																																																																
	器具備品																																																																
取得価額相当額	417百万円																																																																
減価償却累計額相当額	325																																																																
減損損失累計額相当額	-																																																																
期末残高相当額	91																																																																
1年以内	73百万円																																																																
1年超	22																																																																
合計	96																																																																
支払リース料	103百万円																																																																
リース資産減損勘定の取崩額	-																																																																
減価償却費相当額	96																																																																
支払利息相当額	3																																																																
減損損失	-																																																																
1年以内	6百万円																																																																
1年超	4																																																																
合計	10																																																																

## 金融商品関係

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## （追加情報）

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

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

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

## （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部で行っております。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22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	520	520	-
(2)金銭の信託	38,530	38,530	-
(3)短期貸付金	126	126	-
(4)未収委託者報酬	9,756	9,756	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	15,890	15,890	-
(6)関係会社株式	3,064	92,414	89,350
資産計	67,888	157,238	89,350
(7)関係会社短期借入金	11,000	11,000	-
(8)未払金	6,217	6,217	-
(9)未払費用	7,594	7,594	-
(10)未払法人税等	849	849	-
負債計	25,662	25,662	-
(11)デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	86	86	-
デリバティブ取引計	86	86	-

(\*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## (1) 現金・預金、(3)短期貸付金、(4)未収委託者報酬

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

## (2) 金銭の信託

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

## (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、投資信託は基準価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

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

## (6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

## (7) 関係会社短期借入金、(8) 未払金、(9) 未払費用、(10) 未払法人税等

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

## (11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券824百万円、関係会社株式13,035百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について70百万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	519	-	-	-
金銭の信託	38,530	-	-	-
短期貸付金	126	-	-	-
未収委託者報酬	9,756	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	5,100	0	997	-
合計	54,032	0	997	-

当事業年度(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部で行っております。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23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	538	538	-
(2)金銭の信託	39,575	39,575	-
(3)短期貸付金	166	166	-
(4)未収委託者報酬	10,032	10,032	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	9,252	9,252	-
(6)関係会社株式	3,064	79,658	76,594
資産計	62,630	139,224	76,594
(7)関係会社短期借入金	8,000	8,000	-
(8)未払金	7,645	7,645	-
未払収益分配金	4	4	-
未払償還金	79	79	-
未払手数料	4,517	4,517	-
その他未払金	3,043	3,043	-
(9)未払費用	7,373	7,373	-
(10)未払法人税等	800	800	-
負債計	23,819	23,819	-
(11)デリバティブ取引(*)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	65	65	-
デリバティブ取引計	65	65	-

(\*) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

## (1) 現金・預金、(3) 短期貸付金、(4)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。ただし、短期貸付金は為替予約等の振当処理の対象とされており、円貨建債権とみて当該帳簿価額を以って時価としております。「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

## (2) 金銭の信託

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

## (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、投資信託は基準価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

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

## (6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

## (7) 関係会社短期借入金、(8) 未払金、(9) 未払費用、(10) 未払法人税等

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

## (11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券796百万円、関係会社株式19,545百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

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	537	-	-	-
金銭の信託	39,575	-	-	-
短期貸付金	166	-	-	-
未収委託者報酬	10,032	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	1,400	0	1	-
合計	51,713	0	1	-

## 有価証券関係

前事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成22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22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22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	92,414	89,350
合計	3,064	92,414	89,350

## 4. その他有価証券(平成22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	5,656	282	5,373
投資信託( 1 )	3,103	3,001	102
小計	8,759	3,283	5,475
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,031	2,326	295
譲渡性預金	5,100	5,100	-
小計	7,131	7,426	295
合計	15,890	10,710	5,179

- ( 1 ) 当事業年度末において、投資有価証券に係る為替変動リスク及び価格変動リスクをヘッジするための為替予約取引及び株価指数先物取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ利益は175百万円(税効果会計適用後)であり、貸借対照表に計上しております。

## 5. 事業年度中に売却したその他有価証券(自平成21年4月1日至平成22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	38	-	60
投資信託	626	72	0
合計	664	72	60

当事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成23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23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23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	79,658	76,594
合計	3,064	79,658	76,594

## 4．その他有価証券(平成23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	4,930	282	4,647
小計	4,930	282	4,647
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託( 1 )	2,922	3,003	80
譲渡性預金	1,400	1,400	-
小計	4,322	4,403	80
合計	9,252	4,685	4,566

- ( 1 ) 当事業年度末において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ損失は69百万円（税効果会計適用後）であり、貸借対照表に計上しております。

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自平成22年4月1日至平成23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	67	39	-
投資信託	1,824	380	149
合計	1,891	419	149

## デリバティブ取引関係

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

## 1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## （1）通貨関連

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価	当該時価の算定方法
原則的処理方法	為替予約取引	投資信託	3,082	-	17	先物為替相場によって いる
合 計			3,082	-	17	

## （2）株式関連

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価	当該時価の算定方法
原則的処理方法	株価指数先物取引	投資信託	967	-	68	取引所の価格によって いる
合 計			967	-	68	

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## 1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 通貨関連

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価	当該時価の算定方法

原則的処理方法	為替予約取引	投資信託	2,846	-	65	先物為替相場によっ ている
為替予約等の振当処理	為替予約取引	短期貸付金	166	-	(*1) -	-
合 計			3,013	-	(*1) 65	-

(\*1) 為替予約等の振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている短期貸付金と一体として処理されるため、その時価は当該短期貸付金の時価に含めて記載しております。

## 退職給付関係

前事業年度(自 平成21年 4月 1日 至 平成22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. 退職給付債務に関する事項(平成22年 3月31日)

イ. 退職給付債務	12,427百万円
ロ. 年金資産	6,488
ハ. 未積立退職給付債務(イ + ロ)	5,938
ニ. 会計基準変更時差異の未処理額	
ホ. 未認識数理計算上の差異	2,015
ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額)	653
ト. 貸借対照表計上額純額(ハ + ニ + ホ + ヘ)	4,576
チ. 前払年金費用	
リ. 退職給付引当金(ト - チ)	4,576

## 3. 退職給付費用に関する事項(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

イ. 勤務費用	524百万円
ロ. 利息費用	247
ハ. 期待運用収益	136
ニ. 会計基準変更時差異の費用処理額	
ホ. 数理計算上の差異の費用処理額	357
ヘ. 過去勤務債務の費用処理額	40
ト. 退職給付費用(イ + ロ + ハ + ニ + ホ + ヘ)	952
チ. その他(注)	163
計	1,116

(注) 確定拠出年金への掛金支払額であります。

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ. 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
ロ. 割引率	2.1%
ハ. 期待運用収益率	2.5%
ニ. 過去勤務債務の額の処理年数	16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、費用処理することとしております。)
ホ. 数理計算上の差異の処理年数	(1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、翌期から費用処理することとしております。)
ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数	該当はありません。

当事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項(平成23年 3月31日)

イ. 退職給付債務	12,965百万円
ロ. 年金資産	7,475
ハ. 未積立退職給付債務(イ + ロ)	5,489
ニ. 会計基準変更時差異の未処理額	
ホ. 未認識数理計算上の差異	2,037
ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額)	613
ト. 貸借対照表計上額純額(ハ + ニ + ホ + ヘ)	4,064
チ. 前払年金費用	
リ. 退職給付引当金(ト - チ)	4,064

3. 退職給付費用に関する事項(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

イ. 勤務費用	535百万円
ロ. 利息費用	260
ハ. 期待運用収益	162
ニ. 会計基準変更時差異の費用処理額	
ホ. 数理計算上の差異の費用処理額	254
ヘ. 過去勤務債務の費用処理額	40
ト. 退職給付費用(イ + ロ + ハ + ニ + ホ + ヘ)	848
チ. その他(注)	206
計	1,054

(注) 確定拠出年金への掛金支払額等であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ. 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
ロ. 割引率	2.1%
ハ. 期待運用収益率	2.5%
ニ. 過去勤務債務の額の処理年数	16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、費用処理することとしております。)
ホ. 数理計算上の差異の処理年数	(1) 退職一時金に係るもの 1年(発生時の翌期に費用処理することとしております。) (2) 退職年金に係るもの 16年(発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、翌期から費用処理することとしております。)
ヘ. 会計基準変更時差異の処理年数	該当はありません。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (平成22年3月31日)	当事業年度末 (平成23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
退職給付引当金 1,876	退職給付引当金 1,666
賞与引当金 1,040	賞与引当金 1,189
所有株式税務簿価通算差異 884	所有株式税務簿価通算差異 884
投資有価証券評価減 614	投資有価証券評価減 569
ゴルフ会員権評価減 510	ゴルフ会員権評価減 509
減価償却超過額 369	減価償却超過額 307
未払確定拠出年金掛金 217	未払事業税 206
子会社株式売却損 196	時効後支払損引当金 197
時効後支払損引当金 194	子会社株式売却損 196
その他 268	未払確定拠出年金掛金 107
繰延税金資産小計 6,173	繰延ヘッジ損失 48
評価性引当金 1,923	その他 184
繰延税金資産計 4,250	繰延税金資産小計 6,069
繰延税金負債	評価性引当金 1,878
繰延ヘッジ利益 122	繰延税金資産計 4,190
有価証券評価差額金 2,123	繰延税金負債
繰延税金負債計 2,245	有価証券評価差額金 1,872
繰延税金資産(純額) 2,004	繰延税金負債計 1,872
	繰延税金資産(純額) 2,318
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 41.0%	法定実効税率 41.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 1.4%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.8%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 9.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 13.2%
住民税等均等割 0.0%	住民税等均等割 0.0%
タックスハイブン税制 3.5%	タックスハイブン税制 5.8%
外国税額控除 2.4%	外国税額控除 0.6%
その他 0.3%	その他 0.7%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 27.0%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 33.1%

## セグメント情報等

前事業年度(自 平成21年4月1日 至 平成22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。

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23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。

## (追加情報)

当事業年度より「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。



## 関連当事者情報

前事業年度(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492	持株会社	(被所有) 直接 100.0%	資産の賃貸借等 役員の兼任	資金の借入(*1)	168,000	関係会社 短期 借入金	11,000
							資金の返済	169,000		
							借入金利息の支払	98	未払費用	3

## (イ) 関連会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金 (百万円)	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	情報サービス業	(所有) 直接 22.3%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*2)	6,866	未払費用	0

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金 (百万円)	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	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3)	26,417 (注)3	未払 手数料	3,469
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	投資顧問業		当社投資信託の運用委託 役員の兼任	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*4)	3,263	未払費用	940

## (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せん。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (\* 1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
  - (\* 2) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。
  - (\* 3) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。
  - (\* 4) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。
3. 平成21年11月23日付で野村証券(株)はジョインベスト証券(株)を吸収合併しており、当社とジョインベスト証券(株)の取引は野村証券(株)に引継がれております。野村証券(株)との取引金額には、合併前のジョインベスト証券(株)と当社の取引金額を含んでおります。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所及び野村土地建物(株)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	野村土地建物(株)
流動資産合計	128,800	5,765
固定資産合計	228,173	78,723
流動負債合計	76,471	8,010
固定負債合計	76,265	12,507
純資産合計	204,237	63,970
売上高	325,646	2,546
税引前当期純利益	40,539	4,841
当期純利益	26,416	4,445

当事業年度(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100.0%	資産の賃貸借等 役員の兼任	資金の借入(*1)	137,500	関係会社 短期 借入金	8,000
							資金の返済	140,500		
							借入金利息の支払	75	未払費用	3

## (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)
子会社	ノムラ・アセット・マネジメント・ストラテジック・インベストメンツ・Pte リミテッド	シンガポール共和国	68,275 (千米ドル)	持株会社	(所有) 直接 100.0%	役員の派遣	増資の引受(*2)	5,762	-	-
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有) 直接 21.6%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託(*3)	6,794	未払費用	61

## (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	野村證券株式会社	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(*4)	31,596	未払手数料	3,835
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託 役員の兼任	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*5)	2,657	未払費用	939

(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せん。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (\* 1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
  - (\* 2) 増資の引受けにつきましては、当社が平成22年12月23日及び12月28日に1株1米ドルで引受けしております。
  - (\* 3) 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。
  - (\* 4) 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。
  - (\* 5) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所及び野村土地建物(株)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	野村土地建物(株)
流動資産合計	167,970	7,506
固定資産合計	205,568	76,404
流動負債合計	79,436	7,926
固定負債合計	80,690	9,832
純資産合計	213,412	66,152
売上高	312,345	2,546
税引前当期純利益	36,149	3,289
当期純利益	21,100	2,944

## 1株当たり情報

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,067円44銭	1株当たり純資産額	13,765円90銭
1株当たり当期純利益	1,139円63銭	1株当たり当期純利益	1,516円39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	5,869百万円	損益計算書上の当期純利益	7,810百万円
普通株式に係る当期純利益	5,869百万円	普通株式に係る当期純利益	7,810百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

## 中間財務諸表

## 中間貸借対照表

		平成23年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		498
金銭の信託		39,466
有価証券		1,600
短期貸付金		168
未収委託者報酬		8,212
未収収益		4,942
繰延税金資産		853
その他		313
貸倒引当金		6
流動資産計		56,049
固定資産		
有形固定資産	1	1,687
無形固定資産		10,049
ソフトウェア		10,047
その他		1
投資その他の資産		22,390
投資有価証券		6,685
関係会社株式		14,424
繰延税金資産		886
その他		393
貸倒引当金		0
固定資産計		34,127
資産合計		90,176

		平成23年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
関係会社短期借入金		5,000
未払収益分配金		4
未払償還金		53
未払手数料		3,570
その他未払金	2	1,323
未払費用		7,194
未払法人税等		723
賞与引当金		1,463
その他		99
流動負債計		19,431
固定負債		
退職給付引当金		3,251
時効後支払損引当金		491
その他		5
固定負債計		3,747
負債合計		23,179
(純資産の部)		
株主資本		65,310
資本金		17,180
資本剰余金		11,729
資本準備金		11,729
利益剰余金		36,400
利益準備金		685
その他利益剰余金		35,715
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		11,108
評価・換算差額等		1,686
その他有価証券評価差額金		1,568
繰延ヘッジ損益		117
純資産合計		66,996
負債・純資産合計		90,176

## 中間損益計算書

		自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		41,975
運用受託報酬		9,087
その他営業収益		67
営業収益計		51,131
営業費用		
支払手数料		21,876
調査費		10,328
その他営業費用		2,150
営業費用計		34,356
一般管理費	1	11,623
営業利益		5,151
営業外収益	2	3,261
営業外費用	3	333
経常利益		8,079
特別利益	4	123
特別損失	5	69
税引前中間純利益		8,133
法人税、住民税及び事業税		1,605
法人税等調整額		1,229
中間純利益		5,298

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間

（単位：百万円）

	自 平成23年 4月 1日
	至 平成23年 9月30日
<b>株主資本</b>	
<b>資本金</b>	
当期首残高	17,180
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	17,180
<b>資本剰余金</b>	
<b>資本準備金</b>	
当期首残高	11,729
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,729
<b>資本剰余金合計</b>	
当期首残高	11,729
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,729
<b>利益剰余金</b>	
<b>利益準備金</b>	
当期首残高	685
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	685
<b>その他利益剰余金</b>	
<b>別途積立金</b>	
当期首残高	24,606
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	24,606
<b>繰越利益剰余金</b>	
当期首残高	14,077
当中間期変動額	
剰余金の配当	8,267
中間純利益	5,298
当中間期変動額合計	2,968
当中間期末残高	11,108
<b>利益剰余金合計</b>	
当期首残高	39,369
当中間期変動額	

剰余金の配当	8,267
中間純利益	5,298
当中間期変動額合計	2,968
当中間期末残高	36,400
株主資本合計	
当期首残高	68,279
当中間期変動額	
剰余金の配当	8,267
中間純利益	5,298
当中間期変動額合計	2,968
当中間期末残高	65,310
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	2,694
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	1,125
当中間期変動額合計	1,125
当中間期末残高	1,568
繰延ヘッジ損益	
当期首残高	69
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	187
当中間期変動額合計	187
当中間期末残高	117
評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,624
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	938
当中間期変動額合計	938
当中間期末残高	1,686
純資産合計	
当期首残高	70,903
当中間期変動額	
剰余金の配当	8,267
中間純利益	5,298
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	938
当中間期変動額合計	3,906
当中間期末残高	66,996

## [重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>子会社株式及び関連会社株式... 移動平均法による原価法          その他有価証券          時価のあるもの... 中間決算日の市場価格等に基づく時価法          (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております)          時価のないもの... 移動平均法による原価法</p>
2 デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	時価法
3 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
4 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産          定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法によっております。</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。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間に基づく定額法によっております。</p>
5 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金          一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金          賞与の支払に備えるため、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業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。          確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。          退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務債務は、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>
6 リース取引の処理方法	<p>リース取引開始日が平成20年4月1日より前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>

7 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 ヘッジ会計は、原則として、時価評価されているヘッジ手段に係る損益を、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで資産または負債として繰り延べる方法によっております。 また、為替予約が付されている外貨建金銭債権については、振当処理を行っております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段 - 為替予約 ヘッジ対象 - 投資有価証券、短期貸付金</p> <p>(3) ヘッジ方針 投資有価証券及び短期貸付金に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 為替変動リスクのヘッジにつきましては、そのリスク減殺効果を、対応するヘッジ手段ならびにヘッジ対象ごとに定期的に把握し、ヘッジの有効性を確かめております。</p>
8 消費税等の会計処理	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ます。
9 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

## [追加情報]

	自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日
会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用	当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

平成23年 9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	2,541百万円
2 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。	

## 中間損益計算書関係

自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	232百万円
無形固定資産	1,864百万円
長期前払費用	5百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	2,987百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	30百万円
金銭の信託運用損	276百万円
4 特別利益の内訳	
投資有価証券等売却益	34百万円
株式報酬受入益	88百万円
5 特別損失の内訳	
投資有価証券売却損	26百万円
投資有価証券等評価損	0百万円
固定資産除却損	42百万円

## 中間株主資本等変動計算書関係

自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日				
1 発行済株式に関する事項				
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少
	普通株式	5,150,693株	-	-
				当中間会計期間末
				5,150,693株
2 配当に関する事項				
	配当金支払額			
	平成23年 7月11日開催の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。			
	・普通株式の配当に関する事項			
	(1) 配当財産の種類	野村ホールディングス株式会社株式		
	(2) 配当財産の帳簿価額	8,267百万円		
	(3) 1株当たり配当額	1,605円12銭		
	(4) 基準日	平成23年 7月19日		
	(5) 効力発生日	平成23年 7月20日		

## リース取引関係

自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日	
1 ファイナンス・リース取引	
(1) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの)	
該当事項はありません。	
(2) 所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの)	
リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額	
有形固定資産(器具備品)	
取得価額相当額	361百万円
減価償却累計額相当額	310
中間期末残高相当額	50
未経過リース料中間期末残高相当額	
1年内	47百万円
1年超	6
合計	53
支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額	
支払リース料	43百万円
減価償却費相当額	40
支払利息相当額	1
減価償却費相当額の算定方法	
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	
利息相当額の算定方法	
リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については利息法によっております。	
2 オペレーティング・リース取引	
未経過リース料	
1年内	6百万円
1年超	5
合計	12

## 金融商品関係

当中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月30日における中間貸借対照表計上額、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)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	498	498	-
(2)金銭の信託	39,466	39,466	-
(3)短期貸付金	168	168	-
(4)未収委託者報酬	8,212	8,212	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,544	7,544	-
(6)関係会社株式	3,064	77,011	73,947
資産計	58,954	132,902	73,947
(7)関係会社短期借入金	5,000	5,000	-
(8)未払金	4,952	4,952	-
未払収益分配金	4	4	-
未払償還金	53	53	-
未払手数料	3,570	3,570	-
その他未払金	1,323	1,323	-
(9)未払費用	7,194	7,194	-
(10)未払法人税等	723	723	-
負債計	17,869	17,869	-
(11)デリバティブ取引（*）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	5	5	-
デリバティブ取引計	5	5	-

（\*）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(3)短期貸付金、(4)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。ただし、短期貸付金は為替予約等の振当処理の対象とされており、円貨建債権とみて当該帳簿価額を以って時価としております。「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

## (2) 金銭の信託

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

## (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、投資信託は基準価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、帳簿価額によっております。

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

## (6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

## (7) 関係会社短期借入金、(8) 未払金、(9) 未払費用、(10) 未払法人税等

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

## (11) デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照ください。

注2：非上場株式（中間貸借対照表計上額：投資有価証券740百万円、関係会社株式11,360百万円）は、市場価格がなく、かつキャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

## 有価証券関係

## 当中間会計期間末（平成23年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(平成23年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(平成23年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	77,011	73,947
合計	3,064	77,011	73,947

## 3．その他有価証券(平成23年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの			
株式	3,356	282	3,073
投資信託	-	-	-
小計	3,356	282	3,073
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託( 1 )	2,587	3,003	415
譲渡性預金	1,600	1,600	-
小計	4,187	4,603	415
合計	7,544	4,885	2,658

- ( 1 ) 当中間会計期間において、投資有価証券に係る為替変動リスクをヘッジするための為替予約取引についてヘッジ会計を適用しております。対応する繰延ヘッジ利益は117百万円（税効果会計適用後）であり、中間貸借対照表に計上しております。

## デリバティブ取引関係

当中間会計期間（自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日）

## 1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## （ 1 ）通貨関連

（単位：百万円）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価	当該時価の算定方法
原則的処理方法	為替予約取引	投資信託	2,575	-	5	先物為替相場によって
為替予約等の振当処理	為替予約取引	短期貸付金	168	-	(*1) -	-
合 計			2,743	-	(*1) 5	-

(\*1) 為替予約等の振当処理によるものは、ヘッジ対象とされている短期貸付金と一体として処理されるため、その時価は当該短期貸付金の時価に含めて記載しております。

## セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30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、中間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中間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中間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、中間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。

## 1 株当たり情報

自 平成23年 4 月 1 日 至 平成23年 9 月30日	
1 株当たり純資産額	13,007円36銭
1 株当たり中間純利益	1,028円70銭
(注) 1 . 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。	
2 . 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。	
中間純利益	5,298百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	5,298百万円
期中平均株式数	5,150千株

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### (1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
-------	-----------------------	----------

野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
------------	-----------	--

\* 平成24年4月末現在

## (2) 販売会社

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

\* 平成24年4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・連絡等を行いません。

### (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いません。

### 3 【資本関係】（持株比率5.0%以上を記載します。）

#### (1) 受託者

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

当計算期間において提出された、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は以下の通りです。

平成23年6月22日	有価証券届出書、有価証券報告書
平成23年12月21日	半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書

## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月21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 英 公 一指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志 保

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21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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。

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) 上記は、独立監査人の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。

## 独立監査人の監査報告書

平成23年6月17日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	英 公 一
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀 井 純 子
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊 藤 志 保

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22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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23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。

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) 上記は、独立監査人の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。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年11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  
業務執行社員 公認会計士 内田 満雄指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

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23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

#### 中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成23年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を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) 上記は、独立監査人の中間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。

## 独立監査人の監査報告書

平成 24年 5月 28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 内田 満 雄指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマイバランスDC50の平成23年4月1日から平成24年4月2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、マイバランスDC50の平成24年4月2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、独立監査人の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. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)