

【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26年6月25日提出
【計算期間】	第7期(自 平成25年4月2日至 平成26年3月31日)
【ファンド名】	マイバランスDC70
【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兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

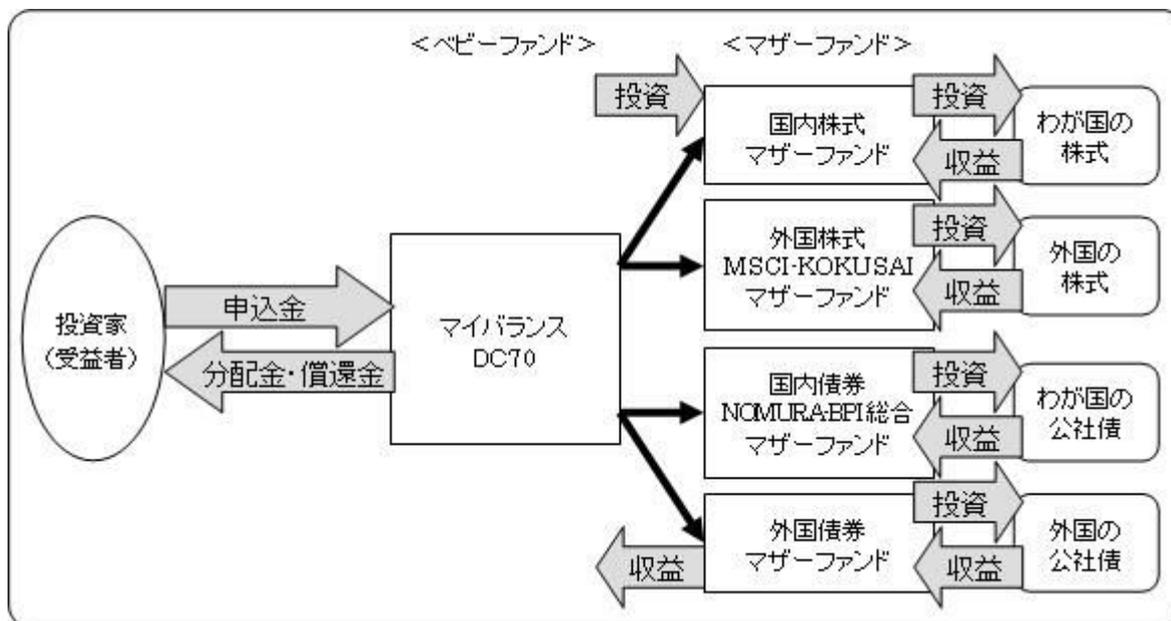
ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

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



マザーファンドの運用の方針等については、「第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）各マザーファンドの概要」をご参照ください。

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

信託金の限度額

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

できます。

<商品分類>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。

なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に**網掛け表示**しております。

(マイバランスDC70)

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州			T O P I X
	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (合成指数)
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券) 資産配分 固定型))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

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

す。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（平成22年7月1日現在）

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

ヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

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

〔特殊型〕

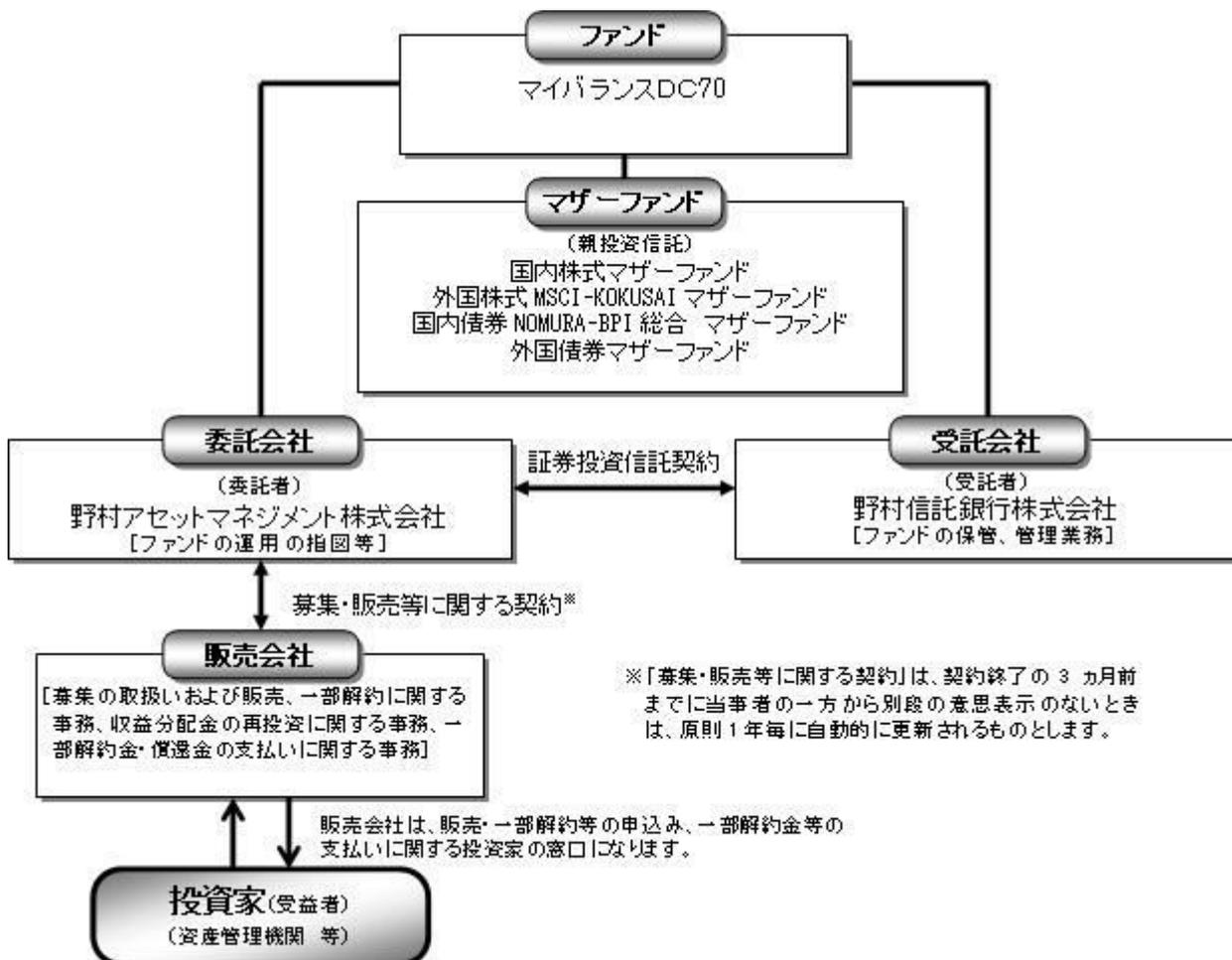
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

(2)【ファンドの沿革】

平成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(平成26年5月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立

平成9年(1997年)10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

平成12年(2000年)11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

・大株主の状況

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

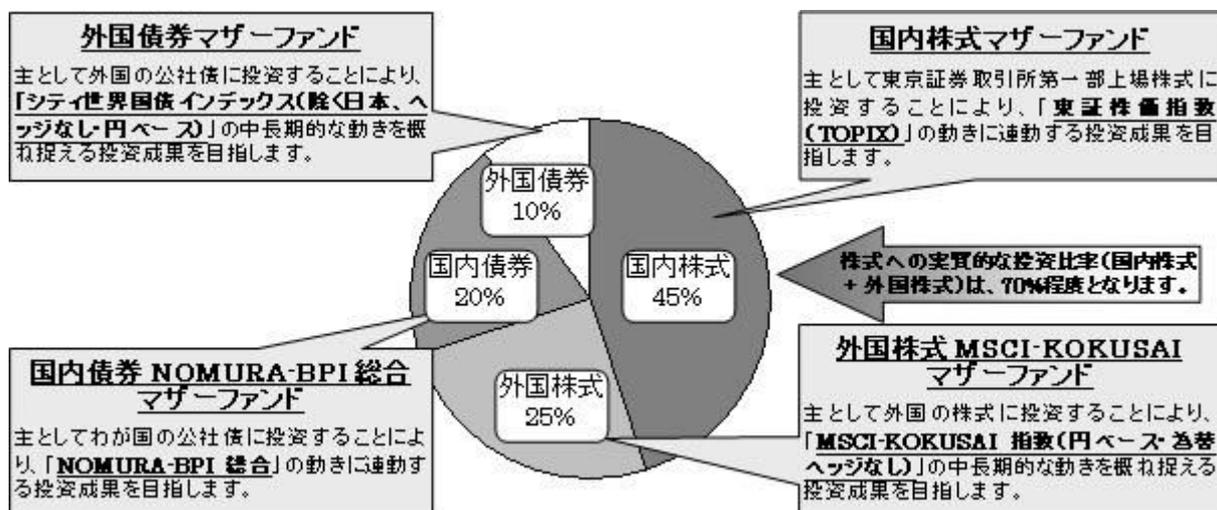
2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

運用にあたっては、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券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、野村證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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

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

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

シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・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・マーケッツ・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ます。)に係る権利

ハ 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ 金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

有価証券の指図範囲(約款第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。

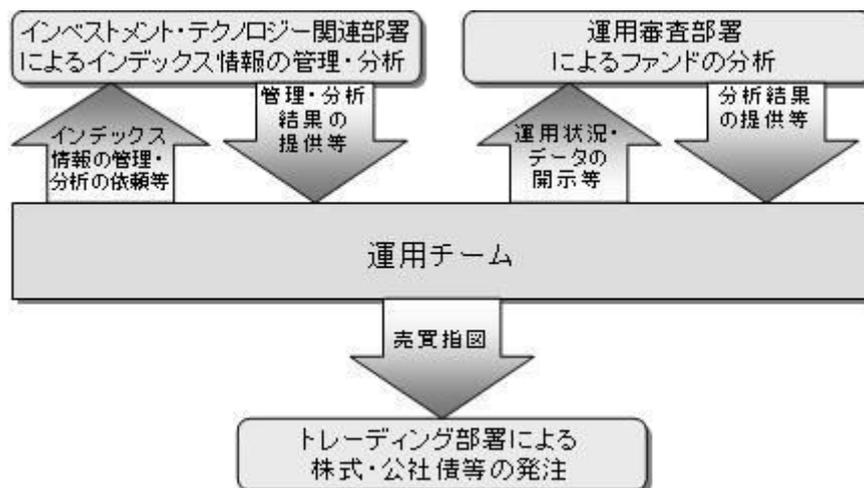
金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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】

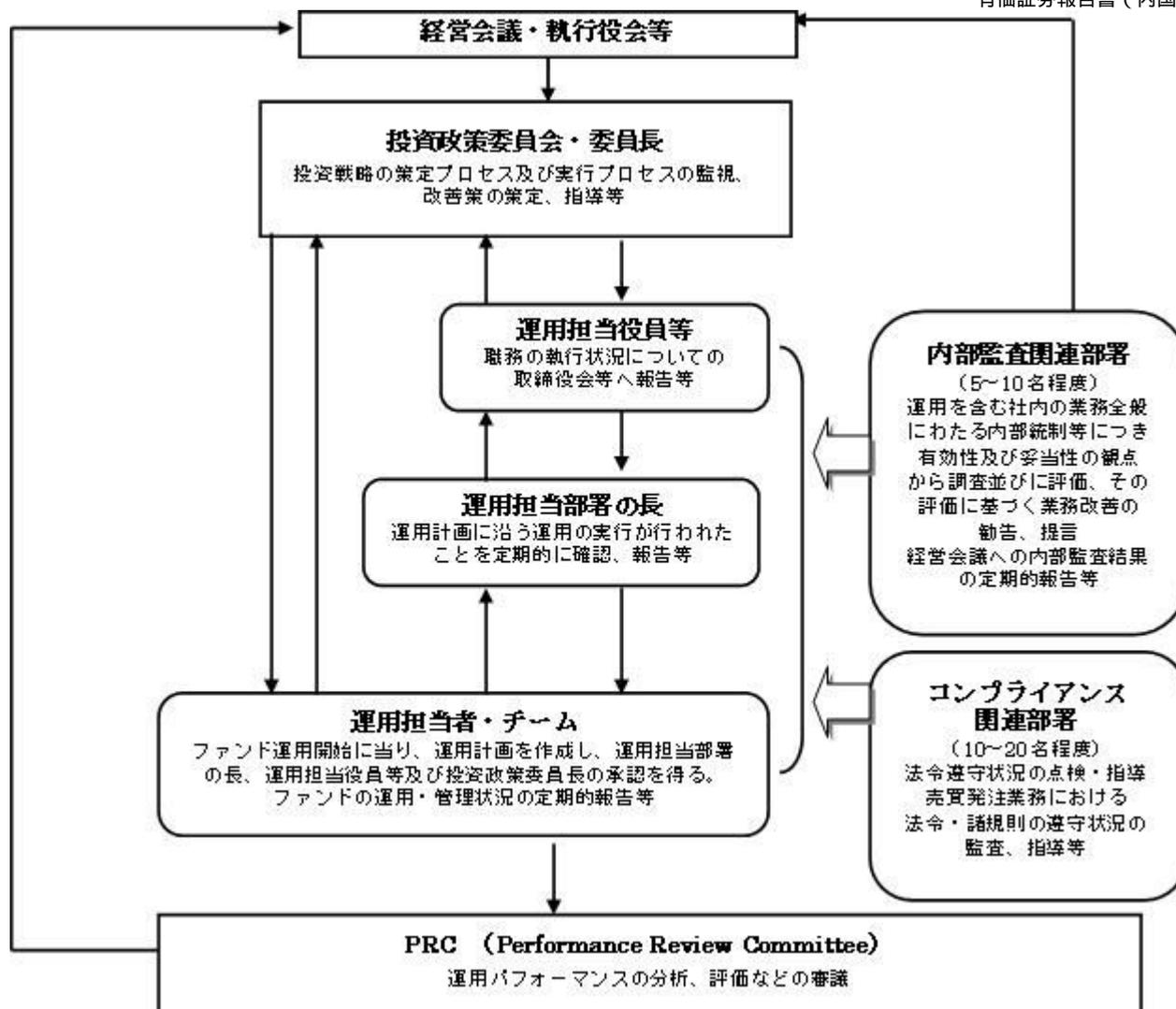
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。

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

います。

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には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の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、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額と各マザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する各マザーファンドの時価総額に各マザーファンドの信託財産純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ()委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。
- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(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で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金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。

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。
- 外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)
- 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以内とします。
- 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
とします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、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()の数を越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、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

[為替変動リスク]

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

響を受けます。

[債券価格変動リスク]

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

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

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

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

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

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

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて

「MSCI」の著作権等について

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

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

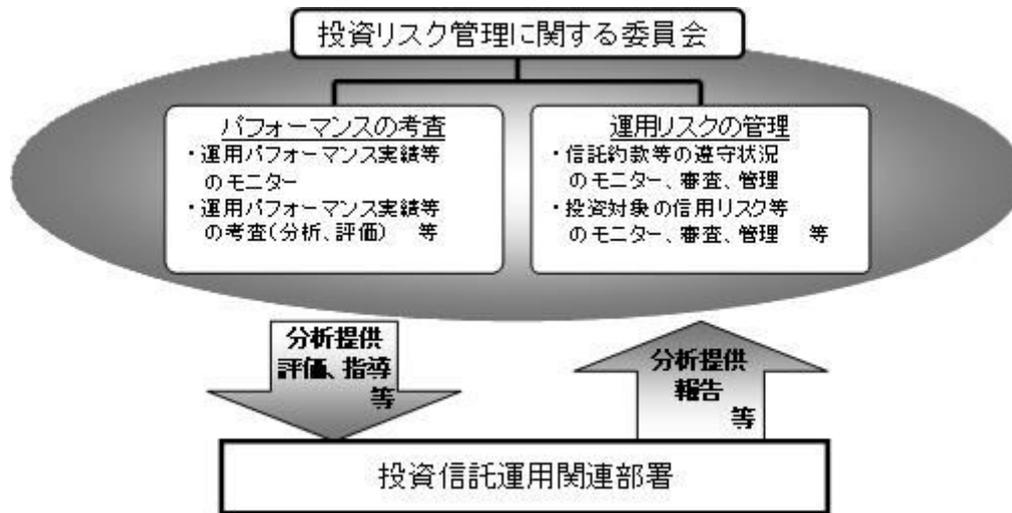
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

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39.96(税抜年10,000分の37)以内(平成26年6月25日現在年10,000分の25.92(税抜年10,000分の24))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11	年10,000分の10	年10,000分の3

* 上記配分は、平成26年6月25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る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産から支払われます。

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。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

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

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(国税(所得税及び復興特別所得税)15.315%)の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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。

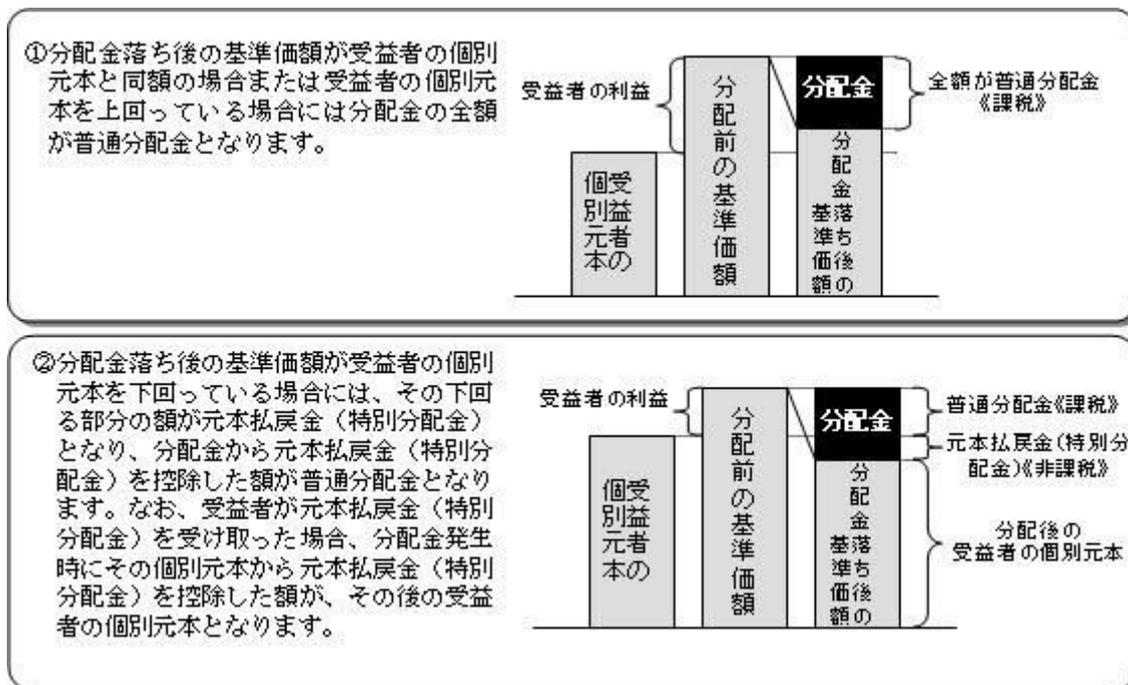
換金(解約)時および償還時の課税について

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。

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26年 4月30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】

マイバランスDC70

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	4,557,633,883	99.96
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,818,488	0.03
合計(純資産総額)		4,559,452,371	100.00

(参考)国内株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	168,648,674,320	97.73
現金・預金・その他資産(負債控除後)		3,903,005,391	2.26
合計(純資産総額)		172,551,679,711	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,894,035,000	2.25

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	154,040,454,784	56.84
	カナダ	12,100,754,504	4.46
	ドイツ	11,192,218,062	4.13
	イタリア	3,200,705,141	1.18
	フランス	12,074,546,526	4.45
	オランダ	3,293,509,758	1.21
	スペイン	4,330,236,945	1.59
	ベルギー	1,486,752,035	0.54
	オーストリア	334,733,751	0.12
	ルクセンブルグ	37,695,328	0.01
	フィンランド	1,054,629,936	0.38
	アイルランド	393,247,141	0.14
	ポルトガル	231,650,926	0.08
	イギリス	25,516,974,081	9.41
	スイス	10,977,129,255	4.05
	スウェーデン	3,869,082,319	1.42
	ノルウェー	1,007,875,086	0.37
	デンマーク	1,604,505,548	0.59
	オーストラリア	8,837,047,032	3.26
	ニュージーランド	156,964,624	0.05
香港	3,285,737,072	1.21	
シンガポール	1,634,480,253	0.60	
イスラエル	603,120,956	0.22	
小計		261,264,051,063	96.41
投資信託受益証券	アメリカ	32,026,633	0.01
投資証券	アメリカ	4,170,134,192	1.53
	カナダ	54,214,726	0.02
	フランス	356,759,934	0.13
	オランダ	25,962,232	0.00
	イギリス	378,391,230	0.13
	オーストラリア	684,304,210	0.25

	香港	103,700,709	0.03
	シンガポール	95,903,498	0.03
	小計	5,869,370,731	2.16
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,799,373,253	1.40
	合計（純資産総額）	270,964,821,680	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,314,326,219	0.85
	買建	カナダ	171,467,252	0.06
	買建	ドイツ	558,278,420	0.20
	買建	イギリス	382,685,066	0.14
	買建	スイス	166,169,254	0.06

（参考）国内債券NOMURA - B P I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	231,474,311,820	78.52
地方債証券	日本	18,954,212,004	6.42
特殊債券	日本	25,674,342,243	8.70
社債券	日本	16,193,345,000	5.49
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,489,989,095	0.84
	合計（純資産総額）	294,786,200,162	100.00

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	110,606,351,231	37.52
	カナダ	6,655,417,206	2.25
	メキシコ	3,057,824,002	1.03
	ドイツ	24,518,071,243	8.31
	イタリア	31,206,123,602	10.58
	フランス	30,763,182,272	10.43
	オランダ	8,447,300,862	2.86
	スペイン	16,988,192,846	5.76
	ベルギー	8,032,511,624	2.72
	オーストリア	5,063,567,753	1.71
	フィンランド	1,997,671,510	0.67

	アイルランド	2,585,086,012	0.87
	イギリス	22,851,620,915	7.75
	スイス	932,662,094	0.31
	スウェーデン	1,600,411,796	0.54
	ノルウェー	984,907,559	0.33
	デンマーク	2,326,750,604	0.78
	ポーランド	2,068,283,346	0.70
	オーストラリア	4,876,189,360	1.65
	シンガポール	995,441,490	0.33
	マレーシア	1,486,266,358	0.50
	南アフリカ	1,411,940,880	0.47
	小計	289,455,774,565	98.19
現金・預金・その他資産(負債控除後)		5,314,652,942	1.80
合計(純資産総額)		294,770,427,507	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

マイバランスDC70

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	1,955,682,598	1.0773	2,106,871,636	1.0417	2,037,234,562	44.68
2	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	642,114,654	1.7746	1,139,496,665	1.7991	1,155,228,474	25.33
3	日本	親投資信託受益証券	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	748,125,852	1.2109	905,908,563	1.2127	907,252,220	19.89
4	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	220,864,625	2.0639	455,842,819	2.0733	457,918,627	10.04

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.96
合計	99.96

(参考) 国内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	1,417,100	6,060.31	8,588,065,301	5,516.00	7,816,723,600	4.53

2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,612,700	663.45	5,050,645,815	542.00	4,126,083,400	2.39
3	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	493,500	5,770.58	2,847,781,230	7,590.00	3,745,665,000	2.17
4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	916,300	4,015.59	3,679,485,117	3,380.00	3,097,094,000	1.79
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	760,000	4,654.19	3,537,184,400	4,033.00	3,065,080,000	1.77
6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,041,000	214.63	2,798,989,830	200.00	2,608,200,000	1.51
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	394,900	5,111.03	2,018,345,747	5,661.00	2,235,528,900	1.29
8	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	632,300	3,631.37	2,296,115,251	3,356.00	2,121,998,800	1.22
9	日本	株式	ファナック	電気機器	113,600	15,948.29	1,811,725,744	18,400.00	2,090,240,000	1.21
10	日本	株式	キヤノン	電気機器	590,300	3,503.71	2,068,240,013	3,215.00	1,897,814,500	1.09
11	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	399,500	4,950.97	1,977,912,515	4,588.00	1,832,906,000	1.06
12	日本	株式	日立製作所	電気機器	2,451,000	655.33	1,606,213,830	727.00	1,781,877,000	1.03
13	日本	株式	KDDI	情報・通信業	311,900	4,797.76	1,496,421,344	5,442.00	1,697,359,800	0.98
14	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	420,400	3,825.80	1,608,366,320	4,031.00	1,694,632,400	0.98
15	日本	株式	三菱地所	不動産業	703,000	2,923.26	2,055,051,780	2,314.00	1,626,742,000	0.94
16	日本	株式	三菱商事	卸売業	784,100	1,922.65	1,507,549,865	1,828.00	1,433,334,800	0.83
17	日本	株式	三井不動産	不動産業	474,000	3,406.46	1,614,662,040	3,021.00	1,431,954,000	0.82
18	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,228,000	1,134.99	1,393,767,720	1,137.00	1,396,236,000	0.80
19	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	187,300	8,264.23	1,547,890,279	7,453.00	1,395,946,900	0.80
20	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	828,000	1,591.22	1,317,530,160	1,622.00	1,343,016,000	0.77
21	日本	株式	三井物産	卸売業	925,300	1,413.65	1,308,050,345	1,449.00	1,340,759,700	0.77
22	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,163,300	788.42	917,168,986	1,119.00	1,301,732,700	0.75
23	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,429,200	1,045.96	1,494,886,032	877.00	1,253,408,400	0.72
24	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	334,200	3,584.49	1,197,936,558	3,660.00	1,223,172,000	0.70
25	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,054,500	835.22	1,715,959,490	588.00	1,208,046,000	0.70
26	日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	4,507,000	264.65	1,192,777,550	268.00	1,207,876,000	0.70
27	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,018,000	1,054.01	1,072,982,180	1,163.00	1,183,934,000	0.68
28	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	389,300	3,276.15	1,275,405,195	3,011.00	1,172,182,300	0.67
29	日本	株式	デンソー	輸送用機器	251,600	4,583.61	1,153,236,276	4,652.00	1,170,443,200	0.67
30	日本	株式	信越化学工業	化学	191,300	6,586.56	1,260,008,928	5,998.00	1,147,417,400	0.66

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.54
		建設業	2.59
		食料品	4.08
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.27

化学	5.38
医薬品	4.39
石油・石炭製品	0.63
ゴム製品	0.93
ガラス・土石製品	1.00
鉄鋼	1.54
非鉄金属	1.02
金属製品	0.67
機械	5.06
電気機器	12.34
輸送用機器	11.31
精密機器	1.35
その他製品	1.37
電気・ガス業	2.00
陸運業	3.81
海運業	0.33
空運業	0.52
倉庫・運輸関連業	0.22
情報・通信業	7.11
卸売業	4.54
小売業	4.19
銀行業	9.02
証券、商品先物取引業	1.46
保険業	2.15
その他金融業	1.24
不動産業	3.19
サービス業	2.52
合 計	97.73

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	78,560	55,087.20	4,327,650,793	60,778.98	4,774,796,771	1.76
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	381,400	10,024.99	3,823,533,856	10,409.78	3,970,291,808	1.46

3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	692,300	4,135.18	2,862,787,191	4,156.73	2,877,704,941	1.06
4	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	246,200	9,998.31	2,461,585,990	10,366.68	2,552,278,659	0.94
5	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コングロ マリット	882,900	2,655.54	2,344,582,269	2,745.84	2,424,305,314	0.89
6	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	商業銀行	436,700	5,057.64	2,208,674,401	5,076.11	2,216,740,163	0.81
7	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	281,400	7,705.22	2,168,250,456	7,832.96	2,204,197,336	0.81
8	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	167,800	12,159.28	2,040,328,023	12,925.78	2,168,946,169	0.80
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	237,200	8,184.17	1,941,285,977	8,459.16	2,006,514,744	0.74
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	商業銀行	328,000	6,160.70	2,020,711,043	5,756.42	1,888,106,088	0.69
11	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	565,400	3,271.20	1,849,540,324	3,258.89	1,842,578,441	0.68
12	スイス	株式	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	医薬品	61,300	30,855.74	1,891,456,923	29,636.37	1,816,709,849	0.67
13	アメリカ	株式	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	情報技術 サービス	89,990	19,542.07	1,758,591,285	20,020.23	1,801,621,137	0.66
14	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	200,700	8,413.61	1,688,613,233	8,808.46	1,767,858,022	0.65
15	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	360,700	4,865.76	1,755,081,869	4,799.06	1,731,024,441	0.63
16	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	商業銀行	1,635,000	1,055.01	1,724,947,400	1,055.18	1,725,229,715	0.63
17	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	459,500	3,598.53	1,653,525,776	3,634.44	1,670,028,029	0.61
18	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	254,800	5,744.10	1,463,598,667	6,025.25	1,535,236,044	0.56
19	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	商業銀行	930,400	1,742.31	1,621,052,482	1,563.77	1,454,937,563	0.53
20	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	346,600	3,996.65	1,385,242,183	4,162.88	1,442,856,877	0.53
21	イギリス	株式	BP PLC	石油・ガ ス・消耗 燃料	1,626,000	835.72	1,358,885,273	867.83	1,411,106,897	0.52
22	フランス	株式	TOTAL SA	石油・ガ ス・消耗 燃料	186,500	6,807.77	1,269,649,515	7,298.19	1,361,112,920	0.50
23	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	インター ネットソ フトウェ ア	24,150	57,557.92	1,390,023,862	55,032.82	1,329,042,634	0.49
24	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	石油・ガ ス・消耗 燃料	336,600	3,786.65	1,274,587,434	3,936.87	1,325,152,462	0.48

25	アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア	317,900	4,060.27	1,290,762,281	4,115.68	1,308,376,929	0.48
26	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	インターネットソフトウェア	24,150	57,380.66	1,385,743,123	54,147.29	1,307,657,223	0.48
27	アメリカ	株式	CITIGROUP	商業銀行	264,400	4,848.32	1,281,896,469	4,941.69	1,306,584,845	0.48
28	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	96,900	12,675.41	1,228,247,548	13,184.35	1,277,564,377	0.47
29	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	139,700	8,313.46	1,161,390,669	8,741.34	1,221,166,022	0.45
30	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品	423,800	2,793.80	1,184,012,695	2,875.81	1,218,772,029	0.44

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー設備・サービス	1.49
		石油・ガス・消耗燃料	9.09
		化学	2.91
		建設資材	0.34
		容器・包装	0.20
		金属・鉱業	2.09
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	2.10
		建設関連製品	0.20
		建設・土木	0.43
		電気設備	0.89
		コングロマリット	1.96
		機械	1.68
		商社・流通業	0.27
		商業・専門サービス	0.43
		航空貨物・物流サービス	0.57
		旅客航空輸送業	0.13
		海運業	0.09
		陸運・鉄道	0.92
		運送インフラ	0.16
自動車部品	0.60		

自動車	1.20
家庭用耐久財	0.26
レジャー用品	0.09
繊維・アパレル・贅沢品	1.18
ホテル・レストラン・レジャー	1.65
メディア	2.84
販売	0.08
インターネット販売カタログ販売	0.73
複合小売り	0.52
専門小売り	1.52
食品・生活必需品小売り	2.17
飲料	2.19
食品	2.58
タバコ	1.37
家庭用品	1.51
パーソナル用品	0.26
ヘルスケア機器・用品	1.40
ヘルスケアプロバイダ・サービス	1.42
バイオテクノロジー	1.52
医薬品	7.13
商業銀行	9.66
各種金融サービス	1.31
保険	4.20
不動産管理・開発	0.57
インターネットソフトウェア	1.81
情報技術サービス	2.16
ソフトウェア	2.52
通信機器	1.14
コンピュータ・周辺機器	2.47
電子装置・機器・部品	0.35
半導体・半導体製造装置	1.49
各種電気通信サービス	2.78
無線通信サービス	0.50
電力	1.63
ガス	0.15

		総合公益事業	1.35
		水道	0.08
		貯蓄・抵当・不動産金融	0.06
		消費者金融	0.54
		資本市場	2.07
		各種消費者サービス	0.02
		独立系発電事業・エネルギー販売	0.11
		ヘルスケア・テクノロジー	0.05
		ライフサイエンスツールサービス	0.33
		専門サービス	0.48
投資信託受益証券			0.01
投資証券			2.16
合 計			98.59

(参考) 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(10年)第306回	3,000,000,000	106.72	3,201,780,000	106.79	3,203,700,000	1.4	2020/3/20	1.08
2	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第116回	3,200,000,000	100.07	3,202,240,000	100.09	3,202,912,000	0.2	2018/12/20	1.08
3	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第328回	3,000,000,000	100.34	3,010,230,000	100.55	3,016,530,000	0.6	2023/3/20	1.02
4	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第325回	2,900,000,000	102.31	2,967,048,000	102.49	2,972,413,000	0.8	2022/9/20	1.00
5	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第102回	2,900,000,000	100.54	2,915,718,000	100.52	2,915,225,000	0.3	2016/12/20	0.98
6	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第332回	2,900,000,000	99.81	2,894,664,000	100.04	2,901,305,000	0.6	2023/12/20	0.98
7	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第105回	2,800,000,000	100.27	2,807,616,000	100.28	2,807,868,000	0.2	2017/6/20	0.95
8	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第329回	2,700,000,000	101.96	2,753,163,000	102.17	2,758,698,000	0.8	2023/6/20	0.93
9	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第285回	2,620,000,000	104.72	2,743,873,600	104.59	2,740,467,600	1.7	2017/3/20	0.92
10	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第312回	2,450,000,000	105.78	2,591,781,500	105.82	2,592,614,500	1.2	2020/12/20	0.87
11	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第305回	2,400,000,000	106.03	2,544,912,000	106.04	2,544,984,000	1.3	2019/12/20	0.86

12	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第113回	2,300,000,000	100.56	2,312,995,000	100.61	2,314,168,000	0.3	2018/6/20	0.78
13	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第107回	2,300,000,000	100.24	2,305,520,000	100.25	2,305,819,000	0.2	2017/12/20	0.78
14	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第284回	2,200,000,000	104.35	2,295,700,000	104.21	2,292,818,000	1.7	2016/12/20	0.77
15	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第106回	2,200,000,000	100.25	2,205,698,000	100.26	2,205,918,000	0.2	2017/9/20	0.74
16	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第333回	2,200,000,000	99.70	2,193,450,000	99.86	2,196,920,000	0.6	2024/3/20	0.74
17	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第309回	2,000,000,000	105.07	2,101,480,000	105.10	2,102,060,000	1.1	2020/6/20	0.71
18	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第289回	2,000,000,000	105.06	2,101,360,000	104.99	2,099,900,000	1.5	2017/12/20	0.71
19	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第296回	1,900,000,000	105.89	2,012,062,000	105.81	2,010,447,000	1.5	2018/9/20	0.68
20	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第89回	2,000,000,000	100.39	2,007,880,000	100.36	2,007,360,000	0.4	2015/6/20	0.68
21	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第320回	1,900,000,000	104.14	1,978,679,000	104.29	1,981,529,000	1	2021/12/20	0.67
22	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第288回	1,850,000,000	105.47	1,951,287,500	105.36	1,949,234,000	1.7	2017/9/20	0.66
23	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第324回	1,900,000,000	102.44	1,946,512,000	102.58	1,949,115,000	0.8	2022/6/20	0.66
24	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第330回	1,900,000,000	101.83	1,934,903,000	102.04	1,938,931,000	0.8	2023/9/20	0.65
25	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第91回	1,900,000,000	100.46	1,908,911,000	100.44	1,908,417,000	0.4	2015/9/20	0.64
26	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第327回	1,800,000,000	102.20	1,839,726,000	102.39	1,843,164,000	0.8	2022/12/20	0.62
27	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第313回	1,700,000,000	106.45	1,809,786,000	106.52	1,810,959,000	1.3	2021/3/20	0.61
28	日本	国債証券	国庫債券 利付(10年)第310回	1,700,000,000	104.47	1,776,058,000	104.51	1,776,789,000	1	2020/9/20	0.60
29	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第96回	1,700,000,000	100.81	1,713,821,000	100.77	1,713,243,000	0.5	2016/3/20	0.58
30	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第93回	1,700,000,000	100.72	1,712,240,000	100.67	1,711,509,000	0.5	2015/12/20	0.58

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.52
地方債証券	6.42
特殊債券	8.70
社債券	5.49

合 計	99.15
-----	-------

(参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	12,500,000	14,830.25	1,853,782,025	14,698.72	1,837,340,185	3.75	2015/8/1	0.62
2	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000	20,360.95	1,628,876,080	21,185.87	1,694,870,224	9	2023/11/1	0.57
3	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000	14,947.90	1,644,269,044	15,061.29	1,656,742,164	3.75	2016/8/1	0.56
4	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,700,000	17,337.05	1,508,323,942	17,113.68	1,488,890,821	4.25	2023/10/25	0.50
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	11,568.47	1,503,901,761	10,946.40	1,423,032,255	3.125	2019/5/15	0.48
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	11,507.44	1,495,967,544	10,832.56	1,408,234,036	3.125	2021/5/15	0.47
7	イギリス	国債証券	UK TREASURY	6,800,000	21,898.00	1,489,064,640	20,653.05	1,404,407,992	4.5	2042/12/7	0.47
8	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,700,000	16,424.83	1,428,960,314	15,802.59	1,374,825,556	5	2016/10/25	0.46
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	11,238.87	1,461,053,529	10,546.38	1,371,029,928	2.625	2020/11/15	0.46
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,500.68	1,365,089,671	10,413.31	1,353,730,457	1.25	2015/9/30	0.45
11	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000	15,472.05	1,392,484,943	14,973.83	1,347,645,494	3.5	2016/1/4	0.45
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	11,847.51	1,421,702,389	11,203.72	1,344,447,526	3.625	2020/2/15	0.45
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,248.57	1,332,314,694	10,273.42	1,335,545,256	0.25	2015/7/15	0.45
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	11,769.68	1,412,362,457	11,071.45	1,328,574,948	3.375	2019/11/15	0.45
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,100,000	18,679.91	1,326,273,937	18,376.59	1,304,737,961	4.5	2041/4/25	0.44
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	11,184.89	1,342,186,822	10,802.50	1,296,300,943	4.25	2015/8/15	0.43
17	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000	19,718.06	1,281,674,028	19,711.78	1,281,265,817	6	2025/10/25	0.43
18	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000	16,536.09	1,322,887,768	15,967.01	1,277,360,880	4.25	2017/7/4	0.43
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,752.40	1,290,288,654	10,572.43	1,268,692,409	2.125	2015/12/31	0.43
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	10,607.24	1,272,869,488	10,469.02	1,256,283,043	1.875	2015/6/30	0.42
21	イギリス	国債証券	UNITED KINGDOM (GOVERNMENT)	6,100,000	21,359.27	1,302,916,019	20,540.82	1,252,990,215	4.25	2055/12/07	0.42
22	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000	16,917.31	1,268,798,366	16,523.34	1,239,250,537	4.25	2019/4/25	0.42
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,700,000	16,457.43	1,267,222,218	16,003.86	1,232,297,482	4.25	2017/10/25	0.41
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	11,989.97	1,318,897,635	11,177.27	1,229,500,191	3.625	2021/2/15	0.41
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,700,000	15,716.13	1,210,142,102	15,952.83	1,228,368,449	5.25	2017/8/1	0.41
26	ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM GOVT	6,500,000	19,398.53	1,260,904,866	18,869.37	1,226,509,600	5	2035/3/28	0.41

27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,200,000	19,722.98	1,222,824,998	19,462.31	1,206,663,803	5.5	2029/4/25	0.40
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,000,000	11,063.04	1,216,934,489	10,689.07	1,175,798,314	4.125	2015/5/15	0.39
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000	16,002.44	1,200,183,450	15,563.05	1,167,228,900	3.75	2017/4/25	0.39
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,500,000	11,444.62	1,201,685,283	11,024.56	1,157,579,016	4.5	2016/2/15	0.39

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.19
合計	98.19

【投資不動産物件】

マイバランスDC70

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

マイバランスDC70

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2014年06月限)	買建	337	日本円	3,982,206,225	3,894,035,000	2.25

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2014 年06月限)	買建	241	米ドル	22,414,312.5	2,299,932,604	22,554,587.5	2,314,326,219	0.85
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2014年06 月限)	買建	11	カナダド ル	1,797,600	168,435,120	1,829,960	171,467,252	0.06
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指数 先物(2014年06月 限)	買建	125	ユーロ	3,882,390	550,289,957	3,938,750	558,278,420	0.20
	イギリス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2014年06月限)	買建	33	英ポンド	2,166,695	374,123,227	2,216,280	382,685,066	0.14
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取 引所	SMI株価指数先物 (2014年06月限)	買建	17	スイスフ ラン	1,410,920	163,850,139	1,430,890	166,169,254	0.06

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

マイバランスDC70

平成26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。

		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計算期間	(2008年 3月31日)	4	4	0.8346	0.8346
第2計算期間	(2009年 3月31日)	411	411	0.6004	0.6004
第3計算期間	(2010年 3月31日)	1,118	1,118	0.7484	0.7484
第4計算期間	(2011年 3月31日)	1,622	1,622	0.7231	0.7231
第5計算期間	(2012年 4月 2日)	2,431	2,431	0.7374	0.7374
第6計算期間	(2013年 4月 1日)	3,339	3,339	0.8701	0.8701

第7計算期間	(2014年 3月31日)	4,574	4,576	1.0370	1.0375
	2013年 4月末日	3,669		0.9515	
	5月末日	3,788		0.9542	
	6月末日	3,684		0.9349	
	7月末日	3,817		0.9465	
	8月末日	3,825		0.9345	
	9月末日	4,033		0.9825	
	10月末日	4,086		0.9983	
	11月末日	4,313		1.0394	
	12月末日	4,499		1.0697	
	2014年 1月末日	4,400		1.0259	
	2月末日	4,522		1.0327	
	3月末日	4,574		1.0370	
	4月末日	4,559		1.0253	

【分配の推移】

マイバランスDC70

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2007年 9月27日～2008年 3月31日	0.0000円
第2計算期間	2008年 4月 1日～2009年 3月31日	0.0000円
第3計算期間	2009年 4月 1日～2010年 3月31日	0.0000円
第4計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	0.0000円
第5計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	0.0000円
第6計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	0.0000円
第7計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	0.0005円

【収益率の推移】

マイバランスDC70

	計算期間	収益率
第1計算期間	2007年 9月27日～2008年 3月31日	16.5%
第2計算期間	2008年 4月 1日～2009年 3月31日	28.1%
第3計算期間	2009年 4月 1日～2010年 3月31日	24.7%
第4計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	3.4%
第5計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	2.0%
第6計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	18.0%
第7計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	19.2%

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(分配額の額。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】

マイバランスDC70

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2007年 9月27日～2008年 3月31日	5,432,439		5,432,439
第2計算期間	2008年 4月 1日～2009年 3月31日	734,800,159	55,102,359	685,130,239
第3計算期間	2009年 4月 1日～2010年 3月31日	922,938,802	113,702,503	1,494,366,538
第4計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	954,798,757	205,009,319	2,244,155,976
第5計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	1,282,954,759	229,425,374	3,297,685,361
第6計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	975,482,362	435,268,097	3,837,899,626
第7計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	1,446,924,627	873,511,133	4,411,313,120

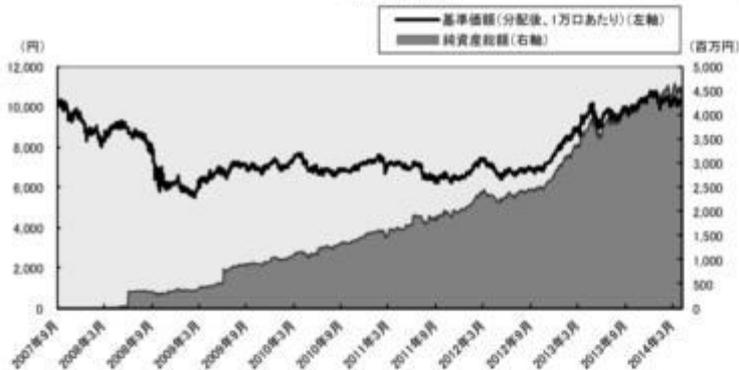
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

運用実績 (2014年4月30日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次・設定来)



分配の推移

(1万円あたり、課税前)

2014年3月	5円
2013年4月	0円
2012年4月	0円
2011年3月	0円
2010年3月	0円
設定来累計	5円

主要な資産の状況

銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内株式マザーファンド	44.7
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	25.3
3	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	19.9
4	外国債券マザーファンド	10.0

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2.0
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.1
3	ソフトバンク	情報・通信業	1.0
4	本田技研工業	輸送用機器	0.8
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.8

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.4
2	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.4
3	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3
4	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.2
5	GENERAL ELEC CO	コングロメリット	0.2

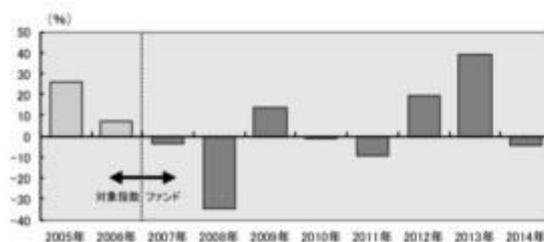
・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付(10年)第306回	国債証券	0.2
2	国庫債券 利付(5年)第116回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付(10年)第328回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付(10年)第325回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付(5年)第102回	国債証券	0.2

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.1
2	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.1
3	BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	0.1
4	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	国債証券	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.0

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。
- ・2005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。
- ・2014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。

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

2【換金（解約）手続等】

受益者は、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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

一部解約の実行の請求の受付については、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。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

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

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

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

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

金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

また、一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該証券の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとし、

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

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

* 一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用するアキュムレーションまたはアモチゼーションによる評価をいいます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。

- 1 外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日とします。
- 2 残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)による評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

無期限とします(平成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、公告を行ないません。

()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、公告を行ないません。

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

()上記()の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記()の信託約款の変更をしません。

()委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

()委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記()から()までの規定にしたがいます。

(e) 公告

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

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

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

(f) 反対者の買取請求権

ファンドの信託契約の解約または信託約款の変更を行なう場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、前述

の「(b)信託期間の終了」()または「(d)信託約款の変更」()に規定する公告または書面に付記します。

(g) 関係法人との契約の更新に関する手続

委託者と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から別段の意思表示のないときは、原則1年毎に自動的に更新されるものとします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

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】

(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7期計算期間(平成25年4月2日から平成26年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【マイバランスDC70】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (平成25年 4月 1日現在)	第7期 (平成26年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,420,940	10,787,650
親投資信託受益証券	3,337,806,435	4,572,741,846
未収入金	-	1,926,694
未収利息	16	12
流動資産合計	3,345,227,391	4,585,456,202
資産合計	3,345,227,391	4,585,456,202
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	2,205,656
未払解約金	2,449,548	3,174,487
未払受託者報酬	444,727	676,641
未払委託者報酬	3,113,017	4,736,422
その他未払費用	44,408	67,605
流動負債合計	6,051,700	10,860,811
負債合計	6,051,700	10,860,811
純資産の部		
元本等		
元本	3,837,899,626	4,411,313,120
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	498,723,935	163,282,271
(分配準備積立金)	591,647,271	1,050,557,048
元本等合計	3,339,175,691	4,574,595,391
純資産合計	3,339,175,691	4,574,595,391
負債純資産合計	3,345,227,391	4,585,456,202

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	平成24年 4月 3日 至 平成25年 4月 1日	自	平成25年 4月 2日 至 平成26年 3月31日
営業収益				
受取利息		3,248		6,157
有価証券売買等損益		511,507,967		672,804,796
営業収益合計		511,511,215		672,810,953
営業費用				
受託者報酬		811,420		1,269,455
委託者報酬		5,679,786		8,886,086
その他費用		81,013		126,824
営業費用合計		6,572,219		10,282,365
営業利益又は営業損失（ ）		504,938,996		662,528,588
経常利益又は経常損失（ ）		504,938,996		662,528,588
当期純利益又は当期純損失（ ）		504,938,996		662,528,588
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		11,860,410		86,593,127
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		866,070,048		498,723,935
剰余金増加額又は欠損金減少額		116,152,606		100,684,403
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		116,152,606		100,684,403
剰余金減少額又は欠損金増加額		241,885,079		12,408,002
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		241,885,079		12,408,002
分配金		-		2,205,656
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		498,723,935		163,282,271

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成25年 4月 2日から平成26年 3月31日までとなっております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

第6期 平成25年 4月 1日現在	第7期 平成26年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,837,899,626口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 4,411,313,120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 498,723,935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 0.8701円 (10,000口当たり純資産額) (8,701円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0370円 (10,000口当たり純資産額) (10,370円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第6期 自 平成24年 4月 3日 至 平成25年 4月 1日	第7期 自 平成25年 4月 2日 至 平成26年 3月31日																																																
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>60,224,501円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>432,854,085円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>140,482,629円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>98,568,685円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>732,129,900円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,837,899,626口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>1,907円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	60,224,501円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	432,854,085円	収益調整金額	C	140,482,629円	分配準備積立金額	D	98,568,685円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	732,129,900円	当ファンドの期末残存口数	F	3,837,899,626口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,907円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>61,005,481円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>514,929,980円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>366,488,625円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>476,827,243円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,419,251,329円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>4,411,313,120口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>3,217円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	61,005,481円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	514,929,980円	収益調整金額	C	366,488,625円	分配準備積立金額	D	476,827,243円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,419,251,329円	当ファンドの期末残存口数	F	4,411,313,120口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,217円
項目																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	60,224,501円																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	432,854,085円																																															
収益調整金額	C	140,482,629円																																															
分配準備積立金額	D	98,568,685円																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	732,129,900円																																															
当ファンドの期末残存口数	F	3,837,899,626口																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,907円																																															
項目																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	61,005,481円																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	514,929,980円																																															
収益調整金額	C	366,488,625円																																															
分配準備積立金額	D	476,827,243円																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,419,251,329円																																															
当ファンドの期末残存口数	F	4,411,313,120口																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,217円																																															

10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	2,205,656円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第6期 自 平成24年 4月 3日 至 平成25年 4月 1日	第7期 自 平成25年 4月 2日 至 平成26年 3月31日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第6期 平成25年 4月 1日現在	第7期 平成26年 3月31日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期 自 平成24年 4月 3日 至 平成25年 4月 1日	第7期 自 平成25年 4月 2日 至 平成26年 3月31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6期 自 平成24年 4月 3日 至 平成25年 4月 1日	第7期 自 平成25年 4月 2日 至 平成26年 3月31日
期首元本額 3,297,685,361円	期首元本額 3,837,899,626円
期中追加設定元本額 975,482,362円	期中追加設定元本額 1,446,924,627円
期中一部解約元本額 435,268,097円	期中一部解約元本額 873,511,133円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第6期 自 平成24年 4月 3日 至 平成25年 4月 1日	第7期 自 平成25年 4月 2日 至 平成26年 3月31日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	505,659,336	624,319,196
合計	505,659,336	624,319,196

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成26年 3月31日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成26年 3月31日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド		2,072,128,208	
		外国債券マザーファンド		455,647,522	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド		1,144,002,634	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド		900,963,482	
	小計	銘柄数: 4 組入時価比率: 100.0%		4,572,741,846	100.0%
合計				4,572,741,846	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「国内債券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。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成26年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,433,411,589
株式	174,758,180,170
派生商品評価勘定	32,865,648
未収入金	158,351,676

(平成26年 3月31日現在)

未収配当金	1,675,869,279
未収利息	4,079
その他未収収益	2,378,057
差入委託証拠金	147,430,000
流動資産合計	185,208,490,498
資産合計	185,208,490,498
負債の部	
流動負債	
未払金	1,858,899,002
未払解約金	291,400,428
未払利息	208,309
有価証券貸借取引受入金	5,038,922,331
流動負債合計	7,189,430,070
負債合計	7,189,430,070
純資産の部	
元本等	
元本	165,134,965,026
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,884,095,402
元本等合計	178,019,060,428
純資産合計	178,019,060,428
負債純資産合計	185,208,490,498

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 3月31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	1.0780円
(10,000口当たり純資産額)	(10,780円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	4,874,834,421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25年 4月 2日 至 平成26年 3月31日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成26年 3月31日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成26年 3月31日現在	
期首	平成25年 4月 2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	188,481,466,279円
同期中における追加設定元本額	33,957,348,761円
同期中における一部解約元本額	57,303,850,014円
期末元本額	165,134,965,026円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	227,897,261円
バランスセレクト50	569,479,169円
バランスセレクト70	613,121,188円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,773,119,080円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	7,824,960,311円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	13,112,439,724円
野村資産設計ファンド2015	228,787,735円
野村資産設計ファンド2020	172,437,684円
野村資産設計ファンド2025	185,387,754円
野村資産設計ファンド2030	167,874,730円
野村資産設計ファンド2035	129,645,998円
野村資産設計ファンド2040	503,136,298円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	5,712,108,995円
のむらップ・ファンド（保守型）	1,090,732,713円
のむらップ・ファンド（普通型）	1,797,642,805円
のむらップ・ファンド（積極型）	937,569,189円
野村資産設計ファンド2045	20,436,199円
野村インデックスファンド・TOPIX	488,651,822円
マイ・ロード	2,772,934,776円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	32,943,282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）	4,855,090,383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）	1,369,094,025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）	9,242,558,421円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,468,180,226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）	20,616,101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）	59,560,876円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	37,459,007円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	10,928,186,114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）	781,436,823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）	5,120,946,348円
野村日本株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,733,029,068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）	3,179,699,849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）	901,759,163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）	76,557,343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）	561,149,886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）	8,848,263,719円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,303,673,417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）	1,043,807,007円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	9,070,524円

バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	38,917,758円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	37,069,310円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	90,563,908円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	3,849,349,074円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	11,553,558,227円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,186,442,430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)	30,396,746,399円
マイバランスDC30	1,865,679,262円
マイバランスDC50	2,243,088,961円
マイバランスDC70	1,922,196,854円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	6,049,907,830円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式(平成26年3月31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	45,000	262.00	11,790,000	貸付株式数	19,000 (19,000)
	日本水産	140,900	217.00	30,575,300		
	マルハニチロホールディングス	218,000	167.00	36,406,000		
	サカタのタネ	16,900	1,420.00	23,998,000		
	ホクト	12,700	2,147.00	27,266,900	貸付株式数	1,300 (1,000)
	住石ホールディングス	31,800	116.00	3,688,800	貸付株式数	700
	日鉄鉱業	29,000	404.00	11,716,000		
	三井松島産業	75,000	159.00	11,925,000		
	国際石油開発帝石	557,500	1,339.00	746,492,500		
	日本海洋掘削	2,900	4,415.00	12,803,500	貸付株式数	1,200
	石油資源開発	16,300	3,435.00	55,990,500		
	K&Oエナジーグループ	5,800	1,419.00	8,230,200		
	ショーボンドホールディングス	10,200	4,560.00	46,512,000	貸付株式数	3,700 (700)
	ミライト・ホールディングス	32,600	904.00	29,470,400		
	タマホーム	5,700	852.00	4,856,400	貸付株式数	2,500
	ダイセキ環境ソリューション	1,000	1,586.00	1,586,000	貸付株式数	200
	安藤・間	76,500	387.00	29,605,500		
	東急建設	40,700	437.00	17,785,900		
	コムシスホールディングス	55,700	1,618.00	90,122,600		
	ミサワホーム	12,300	1,327.00	16,322,100		
	高松コンストラクショングループ	8,600	1,835.00	15,781,000	貸付株式数	3,700
	東建コーポレーション	4,280	4,690.00	20,073,200	貸付株式数	610
	ヤマウラ	5,400	293.00	1,582,200	貸付株式数	2,000 (2,000)
	大成建設	580,000	461.00	267,380,000	貸付株式数	240,000 (240,000)
	大林組	344,000	582.00	200,208,000		
	清水建設	351,000	535.00	187,785,000		
	飛鳥建設	70,400	153.00	10,771,200	貸付株式数	18,700
	長谷工コーポレーション	152,900	646.00	98,773,400		
	松井建設	13,000	441.00	5,733,000		
	銭高組	12,000	288.00	3,456,000	貸付株式数	5,000 (1,000)

鹿島建設	504,000	362.00	182,448,000		
不動テトラ	81,000	189.00	15,309,000	貸付株式数	35,200 (35,200)
大末建設	44,000	116.00	5,104,000	貸付株式数	20,000 (20,000)
鉄建建設	70,000	279.00	19,530,000	貸付株式数	30,000
日鉄住金テックスエンジ	19,000	358.00	6,802,000		
西松建設	150,000	334.00	50,100,000		
三井住友建設	308,100	108.00	33,274,800		
大豊建設	35,000	377.00	13,195,000	貸付株式数	15,000
前田建設工業	71,000	650.00	46,150,000		
佐田建設	39,000	122.00	4,758,000	貸付株式数	17,000
ナカノフドー建設	8,800	241.00	2,120,800		
奥村組	102,000	460.00	46,920,000		
大和小田急建設	6,000	297.00	1,782,000	貸付株式数	2,500 (2,500)
東鉄工業	13,800	1,913.00	26,399,400		
イチケン	13,000	170.00	2,210,000		
浅沼組	34,000	143.00	4,862,000	貸付株式数	16,000 (16,000)
戸田建設	133,000	339.00	45,087,000		
熊谷組	123,000	255.00	31,365,000	貸付株式数	53,000
青木あすなろ建設	6,900	588.00	4,057,200		
北野建設	24,000	258.00	6,192,000		
植木組	14,000	209.00	2,926,000		
三井ホーム	15,000	483.00	7,245,000		
矢作建設工業	15,600	1,013.00	15,802,800		
ピーエス三菱	9,000	462.00	4,158,000	貸付株式数	3,900
大東建託	43,500	9,551.00	415,468,500		
新日本建設	13,600	313.00	4,256,800	貸付株式数	100
N I P P O	27,000	1,425.00	38,475,000		
東亜道路工業	22,000	409.00	8,998,000		
前田道路	36,000	1,439.00	51,804,000		
日本道路	31,000	471.00	14,601,000		
東亜建設工業	100,000	211.00	21,100,000		
若築建設	62,000	140.00	8,680,000	貸付株式数	17,000
東洋建設	35,600	363.00	12,922,800	貸付株式数	15,500
五洋建設	136,500	351.00	47,911,500	貸付株式数	7,000
大林道路	13,000	531.00	6,903,000		
世紀東急工業	59,000	123.00	7,257,000	貸付株式数	25,000
福田組	17,000	475.00	8,075,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
住友林業	78,900	1,037.00	81,819,300		
日本基礎技術	12,700	342.00	4,343,400	貸付株式数	5,900 (4,400)
日成ビルド工業	29,000	246.00	7,134,000	貸付株式数	9,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	52,000	114.00	5,928,000	貸付株式数	22,000
巴コーポレーション	14,200	454.00	6,446,800	貸付株式数	100
パナホーム	43,000	709.00	30,487,000		
大和ハウス工業	315,000	1,751.00	551,565,000	貸付株式数	33,000
ライト工業	23,900	863.00	20,625,700		
積水ハウス	305,500	1,281.00	391,345,500	貸付株式数	5,800 (5,800)
日特建設	14,000	380.00	5,320,000	貸付株式数	3,700
北陸電気工事	5,000	442.00	2,210,000		
ユアテック	18,000	397.00	7,146,000		

西部電気工業	10,000	472.00	4,720,000		
四電工	10,000	362.00	3,620,000		
中電工	16,600	1,784.00	29,614,400		
関電工	52,000	523.00	27,196,000		
きんでん	76,000	999.00	75,924,000		
東京エネシス	12,000	501.00	6,012,000		
トーエネック	16,000	567.00	9,072,000		
住友電設	7,900	1,283.00	10,135,700		
日本電設工業	19,000	1,389.00	26,391,000		
協和エクシオ	44,900	1,326.00	59,537,400		
新日本空調	9,600	650.00	6,240,000		
N D S	17,000	285.00	4,845,000		
九電工	21,000	826.00	17,346,000		
三機工業	24,000	654.00	15,696,000		
日揮	115,000	3,590.00	412,850,000		
中外炉工業	34,000	233.00	7,922,000	貸付株式数	11,000 (11,000)
ヤマト	10,000	349.00	3,490,000		
太平電業	17,000	639.00	10,863,000		
高砂熱学工業	32,700	1,057.00	34,563,900		
三晃金属工業	13,000	267.00	3,471,000	貸付株式数	1,000
朝日工業社	13,000	378.00	4,914,000		
明星工業	17,000	458.00	7,786,000		
大気社	15,200	2,238.00	34,017,600		
ダイダン	15,000	545.00	8,175,000		
日比谷総合設備	14,000	1,489.00	20,846,000	貸付株式数	100
東芝プラントシステム	18,600	1,538.00	28,606,800		
東洋エンジニアリング	61,000	474.00	28,914,000	貸付株式数	26,000
千代田化工建設	91,000	1,331.00	121,121,000		
新興ブランテック	23,500	799.00	18,776,500		
日本製粉	70,000	565.00	39,550,000		
日清製粉グループ本社	114,300	1,134.00	129,616,200	貸付株式数	20,900 (20,900)
日東富士製粉	9,000	319.00	2,871,000	貸付株式数	2,000
昭和産業	47,000	337.00	15,839,000		
鳥越製粉	9,100	715.00	6,506,500		
協同飼料	40,000	113.00	4,520,000	貸付株式数	16,000
中部飼料	11,000	663.00	7,293,000		
日本配合飼料	35,000	124.00	4,340,000	貸付株式数	14,000
東洋精糖	17,000	100.00	1,700,000		
日本甜菜製糖	58,000	200.00	11,600,000		
三井製糖	45,000	394.00	17,730,000		
塩水港精糖	6,700	273.00	1,829,100		
森永製菓	112,000	226.00	25,312,000		
中村屋	27,000	406.00	10,962,000		
江崎グリコ	40,000	1,367.00	54,680,000		
名糖産業	5,100	1,068.00	5,446,800		
不二家	66,000	194.00	12,804,000	貸付株式数	28,000 (16,000)
山崎製パン	84,000	1,222.00	102,648,000	貸付株式数	16,000 (3,000)
第一屋製パン	15,000	126.00	1,890,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
モロゾフ	17,000	321.00	5,457,000	貸付株式数	8,000 (8,000)

亀田製菓	6,400	3,060.00	19,584,000	貸付株式数	2,600	
カルビー	42,400	2,429.00	102,989,600			
森永乳業	97,000	332.00	32,204,000			
六甲バター	5,100	871.00	4,442,100	貸付株式数	2,200	(700)
ヤクルト本社	67,100	5,180.00	347,578,000			
明治ホールディングス	34,000	6,510.00	221,340,000			
雪印メグミルク	24,700	1,346.00	33,246,200	貸付株式数	10,900	(900)
プリマハム	57,000	215.00	12,255,000			
日本ハム	80,000	1,537.00	122,960,000			
伊藤ハム	63,000	470.00	29,610,000	貸付株式数	27,000	(27,000)
林兼産業	37,000	76.00	2,812,000	貸付株式数	16,000	(16,000)
丸大食品	55,000	306.00	16,830,000			
米久	3,700	804.00	2,974,800	貸付株式数	1,200	(1,200)
S Foods	7,000	1,094.00	7,658,000	貸付株式数	3,000	(3,000)
サッポロホールディングス	188,000	406.00	76,328,000			
アサヒグループホールディングス	230,500	2,889.00	665,914,500			
キリンホールディングス	491,000	1,430.00	702,130,000			
宝ホールディングス	90,000	787.00	70,830,000			
オエノンホールディングス	27,000	252.00	6,804,000			
養命酒製造	9,000	985.00	8,865,000			
コカ・コーラウエスト	35,300	1,801.00	63,575,300			
コカ・コーライーストジャパン	23,700	2,590.00	61,383,000			
サントリー食品インターナショナル	58,900	3,555.00	209,389,500			
ダイドードリンコ	5,300	4,305.00	22,816,500	貸付株式数	100	
伊藤園	31,200	2,310.00	72,072,000	貸付株式数	13,500	(1,600)
キーコーヒー	10,800	1,587.00	17,139,600	貸付株式数	4,700	(4,700)
ユニカフェ	3,100	641.00	1,987,100	貸付株式数	1,300	
ジャパンフーズ	1,500	1,254.00	1,881,000			
日清オイリオグループ	50,000	336.00	16,800,000	貸付株式数	22,000	
不二製油	27,800	1,322.00	36,751,600			
かどや製油	1,100	2,680.00	2,948,000	貸付株式数	400	
J-オイルミルズ	48,000	275.00	13,200,000			
キッコーマン	94,000	1,947.00	183,018,000			
味の素	273,000	1,475.00	402,675,000			
キュービー	58,300	1,421.00	82,844,300			
ハウス食品グループ本社	40,300	1,714.00	69,074,200			
カゴメ	44,300	1,749.00	77,480,700	貸付株式数	19,300	
焼津水産化学工業	5,000	946.00	4,730,000	貸付株式数	1,900	(1,900)
アリアケジャパン	10,400	2,394.00	24,897,600			
ニチレイ	122,000	436.00	53,192,000			
東洋水産	56,000	3,445.00	192,920,000			
イートアンド	700	1,589.00	1,112,300	貸付株式数	300	(100)
日清食品ホールディングス	44,800	4,655.00	208,544,000	貸付株式数	1,000	
永谷園	11,000	987.00	10,857,000			
フジッコ	11,000	1,243.00	13,673,000			
ロック・フィールド	6,000	1,957.00	11,742,000	貸付株式数	2,500	(200)
日本たばこ産業	635,400	3,240.00	2,058,696,000			
ケンコーマヨネーズ	3,700	913.00	3,378,100			
わらべや日洋	6,700	1,950.00	13,065,000			

なとり	5,300	1,114.00	5,904,200	貸付株式数	2,200
ミヨシ油脂	39,000	149.00	5,811,000	貸付株式数	6,000
片倉工業	12,300	1,311.00	16,125,300	貸付株式数	600
グンゼ	87,000	274.00	23,838,000		
東洋紡	453,000	162.00	73,386,000		
ユニチカ	294,000	57.00	16,758,000	貸付株式数	68,000
富士紡ホールディングス	56,000	271.00	15,176,000	貸付株式数	7,000
日清紡ホールディングス	68,000	882.00	59,976,000		
倉敷紡績	110,000	186.00	20,460,000		
シキボウ	62,000	118.00	7,316,000	貸付株式数	3,000
日本毛織	34,000	800.00	27,200,000		
大東紡織	16,000	73.00	1,168,000	貸付株式数	7,000
トーア紡コーポレーション	45,000	71.00	3,195,000	貸付株式数	19,000
ダイドーリミテッド	12,000	641.00	7,692,000	貸付株式数	4,600
帝国繊維	11,200	1,576.00	17,651,200		
帝人	438,000	256.00	112,128,000	貸付株式数	87,000
東レ	777,000	682.00	529,914,000		
サカイオーベックス	28,000	196.00	5,488,000	貸付株式数	12,000
住江織物	29,000	320.00	9,280,000		
日本フェルト	6,000	454.00	2,724,000		
イチカワ	7,000	274.00	1,918,000		
日本バイリーン	11,000	584.00	6,424,000		
日東製網	12,000	159.00	1,908,000	貸付株式数	5,000 (1,000)
芦森工業	23,000	127.00	2,921,000		
アツギ	90,000	117.00	10,530,000		
ダイニック	20,000	176.00	3,520,000		
セーレン	28,700	849.00	24,366,300		
東海染工	15,000	117.00	1,755,000	貸付株式数	3,000 (1,000)
小松精練	18,000	531.00	9,558,000		
ワコールホールディングス	64,000	1,053.00	67,392,000		
ホギメディカル	6,700	5,280.00	35,376,000		
レナウン	25,700	124.00	3,186,800	貸付株式数	4,600
クラウディア	1,200	1,151.00	1,381,200	貸付株式数	300
T S Iホールディングス	51,500	683.00	35,174,500	貸付株式数	6,400 (6,400)
三陽商会	56,000	301.00	16,856,000		
ナイガイ	39,000	85.00	3,315,000	貸付株式数	17,000
オンワードホールディングス	71,000	715.00	50,765,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
ルック	19,000	273.00	5,187,000	貸付株式数	8,000
キムラタン	358,000	11.00	3,938,000	貸付株式数	155,000 (91,000)
ゴールドウイン	25,000	518.00	12,950,000		
デサント	24,000	812.00	19,488,000		
キング	5,300	435.00	2,305,500	貸付株式数	2,300 (2,300)
ヤマトインターナショナル	6,400	428.00	2,739,200		
特種東海製紙	62,000	230.00	14,260,000	貸付株式数	12,000 (8,000)
王子ホールディングス	473,000	462.00	218,526,000		
日本製紙	55,400	1,945.00	107,753,000	貸付株式数	16,500
三菱製紙	152,000	92.00	13,984,000	貸付株式数	5,000
北越紀州製紙	73,000	518.00	37,814,000	貸付株式数	21,500 (19,000)
中越パルプ工業	41,000	213.00	8,733,000		

巴川製紙所	17,000	198.00	3,366,000	貸付株式数	6,000	(6,000)
大王製紙	37,000	1,239.00	45,843,000	貸付株式数	16,000	(16,000)
レンゴー	86,000	554.00	47,644,000			
トーモク	34,000	293.00	9,962,000			
ザ・バック	7,600	1,970.00	14,972,000			
クラレ	170,300	1,180.00	200,954,000	貸付株式数	2,700	
旭化成	668,000	702.00	468,936,000			
共和レザー	7,000	483.00	3,381,000			
コープケミカル	16,000	122.00	1,952,000	貸付株式数	6,000	(5,000)
昭和電工	713,000	146.00	104,098,000	貸付株式数	248,000	
住友化学	789,000	381.00	300,609,000			
日本化成	20,000	133.00	2,660,000	貸付株式数	6,000	
住友精化	22,000	693.00	15,246,000	貸付株式数	8,000	
日産化学工業	73,400	1,549.00	113,696,600			
ラサ工業	40,000	142.00	5,680,000	貸付株式数	13,000	
クレハ	75,000	488.00	36,600,000	貸付株式数	20,000	
多木化学	7,000	629.00	4,403,000	貸付株式数	3,000	(3,000)
テイカ	18,000	291.00	5,238,000			
石原産業	192,000	95.00	18,240,000			
片倉チッカリン	7,000	261.00	1,827,000			
日本曹達	69,000	561.00	38,709,000			
東ソー	286,000	398.00	113,828,000			
トクヤマ	167,000	338.00	56,446,000			
セントラル硝子	102,000	335.00	34,170,000			
東亜合成	126,000	442.00	55,692,000			
ダイソー	43,000	365.00	15,695,000			
関東電化工業	26,000	264.00	6,864,000	貸付株式数	1,000	
電気化学工業	214,000	354.00	75,756,000			
信越化学工業	192,200	5,898.00	1,133,595,600			
日本カーバイド工業	31,000	230.00	7,130,000	貸付株式数	14,000	
堺化学工業	43,000	320.00	13,760,000			
エア・ウォーター	88,000	1,428.00	125,664,000			
大陽日酸	138,000	812.00	112,056,000	貸付株式数	5,000	
日本化学工業	40,000	144.00	5,760,000	貸付株式数	7,000	
日本パーカライジング	25,300	2,388.00	60,416,400			
高压ガス工業	16,000	570.00	9,120,000			
チタン工業	13,000	236.00	3,068,000	貸付株式数	2,000	
四国化成工業	15,000	744.00	11,160,000			
戸田工業	19,000	259.00	4,921,000	貸付株式数	8,000	
ステラ ケミファ	5,500	1,473.00	8,101,500			
保土谷化学工業	32,000	207.00	6,624,000	貸付株式数	4,000	
日本触媒	91,000	1,219.00	110,929,000			
大日精化工業	41,000	479.00	19,639,000			
カネカ	133,000	626.00	83,258,000			
三菱瓦斯化学	169,000	582.00	98,358,000			
三井化学	487,000	253.00	123,211,000	貸付株式数	213,000	
J S R	98,300	1,913.00	188,047,900	貸付株式数	42,200	
東京応化工業	20,700	2,281.00	47,216,700			
大阪有機化学工業	7,100	470.00	3,337,000			

三菱ケミカルホールディングス	670,000	429.00	287,430,000	貸付株式数	500
日本合成化学工業	22,000	741.00	16,302,000		
ダイセル	139,000	846.00	117,594,000		
住友ベークライト	84,000	397.00	33,348,000		
積水化学工業	220,000	1,073.00	236,060,000		
日本ゼオン	85,000	934.00	79,390,000		
アイカ工業	30,100	2,299.00	69,199,900		
宇部興産	540,000	190.00	102,600,000		
積水樹脂	15,000	1,400.00	21,000,000		
タキロン	25,000	425.00	10,625,000		
旭有機材工業	38,000	233.00	8,854,000		
日立化成	46,300	1,405.00	65,051,500		
ニチバン	11,000	347.00	3,817,000		
リケンテクノス	17,000	586.00	9,962,000		
大倉工業	26,000	323.00	8,398,000		
積水化成成品工業	30,000	276.00	8,280,000		
群栄化学工業	29,000	387.00	11,223,000	貸付株式数	13,000
タイガースポリマー	5,300	424.00	2,247,200		
ミライアル	2,700	1,453.00	3,923,100	貸付株式数	1,100
日本化薬	75,000	1,163.00	87,225,000		
カーリットホールディングス	8,500	473.00	4,020,500		
日本精化	8,900	665.00	5,918,500	貸付株式数	3,900 (3,900)
A D E K A	46,100	1,190.00	54,859,000		
日油	89,000	747.00	66,483,000		
新日本理化	12,700	237.00	3,009,900	貸付株式数	5,600
ハリマ化成グループ	9,100	458.00	4,167,800		
花王	278,700	3,657.00	1,019,205,900	貸付株式数	1,500 (1,500)
第一工業製薬	19,000	322.00	6,118,000	貸付株式数	1,000
三洋化成工業	34,000	661.00	22,474,000		
大日本塗料	61,000	165.00	10,065,000		
日本ペイント	93,000	1,564.00	145,452,000		
関西ペイント	130,000	1,475.00	191,750,000		
神東塗料	6,000	212.00	1,272,000		
中国塗料	31,000	733.00	22,723,000	貸付株式数	1,000
日本特殊塗料	8,300	612.00	5,079,600		
藤倉化成	13,500	639.00	8,626,500	貸付株式数	1,700
太陽ホールディングス	8,700	3,055.00	26,578,500	貸付株式数	200
D I C	380,000	271.00	102,980,000		
サカタインクス	21,900	975.00	21,352,500		
東洋インキSCホールディングス	96,000	417.00	40,032,000		
T & K T O K A	3,900	2,268.00	8,845,200		
富士フィルムホールディングス	245,200	2,771.00	679,449,200		
資生堂	190,600	1,816.00	346,129,600		
ライオン	124,000	611.00	75,764,000		
高砂香料工業	38,000	596.00	22,648,000		
マンダム	10,700	3,730.00	39,911,000		
ミルボン	6,800	3,435.00	23,358,000		
ファンケル	24,800	1,226.00	30,404,800	貸付株式数	1,100 (600)
コーセー	17,300	3,390.00	58,647,000		

ドクターシーラボ	7,300	3,200.00	23,360,000	貸付株式数	3,100
シーボン	900	2,284.00	2,055,600	貸付株式数	300
ポーラ・オルビスホールディングス	10,900	4,105.00	44,744,500		
ノエビアホールディングス	7,100	1,948.00	13,830,800	貸付株式数	700
アジュバンコスメジャパン	1,300	937.00	1,218,100	貸付株式数	500 (500)
エステー	6,600	999.00	6,593,400		
コニシ	7,800	1,827.00	14,250,600		
長谷川香料	13,600	1,691.00	22,997,600		
星光PMC	4,400	1,446.00	6,362,400	貸付株式数	1,900 (100)
小林製薬	17,600	5,950.00	104,720,000		
荒川化学工業	9,000	918.00	8,262,000		
メック	8,300	802.00	6,656,600	貸付株式数	3,500 (3,400)
日本高純度化学	3,000	2,288.00	6,864,000		
JCU	1,600	6,560.00	10,496,000	貸付株式数	700
新田ゼラチン	6,400	1,047.00	6,700,800	貸付株式数	2,800 (2,000)
アース製薬	7,700	3,755.00	28,913,500		
イハラケミカル工業	16,500	833.00	13,744,500	貸付株式数	7,000 (7,000)
北興化学工業	10,000	329.00	3,290,000		
大成ラミック	2,800	2,645.00	7,406,000	貸付株式数	1,200 (1,100)
クミアイ化学工業	22,000	655.00	14,410,000		
日本農薬	24,000	1,555.00	37,320,000		
アキレス	85,000	143.00	12,155,000		
有沢製作所	17,800	553.00	9,843,400		
日東電工	88,300	4,942.00	436,378,600		
レック	3,300	1,122.00	3,702,600	貸付株式数	1,400
きもと	15,700	356.00	5,589,200	貸付株式数	3,400
藤森工業	9,200	2,682.00	24,674,400		
前澤化成工業	7,500	1,093.00	8,197,500	貸付株式数	200
JSP	7,000	1,593.00	11,151,000	貸付株式数	3,000
エフビコ	10,600	3,285.00	34,821,000	貸付株式数	2,200
天馬	8,500	1,427.00	12,129,500		
信越ポリマー	21,000	386.00	8,106,000		
東リ	28,000	205.00	5,740,000		
ニフコ	23,900	2,916.00	69,692,400		
日本バルカー工業	45,000	286.00	12,870,000		
ユニ・チャーム	65,700	5,513.00	362,204,100		
協和発酵キリン	128,000	1,100.00	140,800,000		
武田薬品工業	401,400	4,892.00	1,963,648,800		
アステラス製薬	1,234,000	1,224.00	1,510,416,000		
大日本住友製薬	75,800	1,640.00	124,312,000	貸付株式数	32,000
塩野義製薬	167,300	1,913.00	320,044,900		
田辺三菱製薬	89,200	1,443.00	128,715,600		
わかもと製薬	12,000	277.00	3,324,000		
あすか製薬	12,600	1,037.00	13,066,200		
日本新薬	25,000	1,957.00	48,925,000		
バイオフェルミン製薬	1,700	2,780.00	4,726,000		
中外製薬	106,700	2,635.00	281,154,500		
科研製薬	39,000	1,632.00	63,648,000		
エーザイ	131,900	4,018.00	529,974,200	貸付株式数	50,400 (300)

ロート製薬	45,000	1,822.00	81,990,000		
小野薬品工業	48,700	8,940.00	435,378,000	貸付株式数	3,000
久光製薬	33,300	4,665.00	155,344,500	貸付株式数	2,700
有機合成薬品工業	7,000	258.00	1,806,000		
持田製薬	7,900	7,390.00	58,381,000		
参天製薬	39,300	4,580.00	179,994,000		
扶桑薬品工業	36,000	364.00	13,104,000		
日本ケミファ	15,000	523.00	7,845,000		
ツムラ	31,500	2,480.00	78,120,000		
日医工	25,100	1,590.00	39,909,000		
キッセイ薬品工業	19,900	2,561.00	50,963,900		
生化学工業	22,300	1,377.00	30,707,100		
栄研化学	8,300	1,793.00	14,881,900		
白水製薬	4,300	1,075.00	4,622,500	貸付株式数	2,000 (2,000)
鳥居薬品	7,300	3,350.00	24,455,000		
JCRファーマ	6,200	2,370.00	14,694,000	貸付株式数	2,600 (2,500)
東和薬品	5,500	4,455.00	24,502,500	貸付株式数	2,300 (1,900)
富士製薬工業	3,000	2,023.00	6,069,000		
沢井製薬	17,000	6,330.00	107,610,000		
ゼリア新薬工業	16,900	2,096.00	35,422,400	貸付株式数	1,700 (1,700)
第一三共	337,900	1,738.00	587,270,200		
キョーリン製薬ホールディングス	28,600	1,971.00	56,370,600		
大幸薬品	5,100	1,689.00	8,613,900		
ダイト	3,500	1,502.00	5,257,000		
大塚ホールディングス	212,700	3,087.00	656,604,900		
大正製薬ホールディングス	25,800	8,310.00	214,398,000		
日本コークス工業	86,500	124.00	10,726,000		
昭和シェル石油	95,800	922.00	88,327,600		
コスモ石油	296,000	187.00	55,352,000		
ニチレキ	13,000	1,028.00	13,364,000	貸付株式数	5,000
東燃ゼネラル石油	162,000	911.00	147,582,000	貸付株式数	16,000
コシロ化学工業	5,800	1,013.00	5,875,400		
ビービー・カストロール	4,400	546.00	2,402,400		
富士石油	27,300	269.00	7,343,700	貸付株式数	11,900 (11,900)
MORESCO	2,500	1,540.00	3,850,000	貸付株式数	1,100
出光興産	50,800	2,119.00	107,645,200		
JXホールディングス	1,189,200	497.00	591,032,400		
横浜ゴム	120,000	970.00	116,400,000		
東洋ゴム工業	89,000	731.00	65,059,000		
ブリヂストン	335,800	3,660.00	1,229,028,000		
住友ゴム工業	83,600	1,314.00	109,850,400		
藤倉ゴム工業	6,700	903.00	6,050,100	貸付株式数	2,900 (100)
オカモト	37,000	348.00	12,876,000		
フコク	4,500	990.00	4,455,000		
ニッタ	10,600	1,924.00	20,394,400		
東海ゴム工業	19,800	1,057.00	20,928,600	貸付株式数	7,700
三ツ星ベルト	27,000	584.00	15,768,000		
バンドー化学	39,000	424.00	16,536,000		
日東紡績	79,000	482.00	38,078,000		

旭硝子	528,000	598.00	315,744,000		
日本板硝子	517,000	147.00	75,999,000	貸付株式数	217,000
石塚硝子	14,000	219.00	3,066,000		
日本山村硝子	42,000	182.00	7,644,000		
日本電気硝子	221,000	531.00	117,351,000		
オハラ	4,000	635.00	2,540,000	貸付株式数	1,700
住友大阪セメント	199,000	427.00	84,973,000		
太平洋セメント	629,000	372.00	233,988,000		
デイ・シイ	11,000	590.00	6,490,000	貸付株式数	600
日本ヒューム	10,000	837.00	8,370,000		
日本コンクリート工業	20,000	381.00	7,620,000		
三谷セキサン	5,400	1,620.00	8,748,000	貸付株式数	1,600 (1,600)
ジャパンパイル	9,700	838.00	8,128,600		
東海カーボン	100,000	350.00	35,000,000		
日本カーボン	56,000	196.00	10,976,000	貸付株式数	24,000 (8,000)
東洋炭素	6,600	2,287.00	15,094,200	貸付株式数	1,900
ノリタケカンパニーリミテド	60,000	261.00	15,660,000		
TOTO	157,000	1,431.00	224,667,000		
日本碍子	135,000	2,150.00	290,250,000		
日本特殊陶業	92,000	2,320.00	213,440,000	貸付株式数	9,000 (9,000)
ダントーホールディングス	14,000	112.00	1,568,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
MARUWA	2,800	4,020.00	11,256,000		
品川リフラクトリーズ	27,000	209.00	5,643,000		
黒崎播磨	23,000	226.00	5,198,000		
ヨータイ	6,000	306.00	1,836,000	貸付株式数	1,000
イソライト工業	3,900	183.00	713,700	貸付株式数	1,500 (1,400)
東京窯業	13,000	220.00	2,860,000		
ニッカトー	3,800	413.00	1,569,400		
フジインコーポレーテッド	9,800	1,287.00	12,612,600		
エアンドエーマテリアル	22,000	119.00	2,618,000	貸付株式数	9,000
ニチアス	52,000	662.00	34,424,000		
ニチハ	13,000	1,187.00	15,431,000		
新日鐵住金	4,529,000	282.00	1,277,178,000		
神戸製鋼所	1,709,000	137.00	234,133,000	貸付株式数	4,000 (4,000)
中山製鋼所	60,000	84.00	5,040,000	貸付株式数	4,000
合同製鐵	54,000	145.00	7,830,000		
ジェイ エフ イー ホールディングス	273,300	1,943.00	531,021,900		
日新製鋼ホールディングス	45,400	883.00	40,088,200		
東京製鐵	59,100	554.00	32,741,400		
共英製鋼	10,000	1,830.00	18,300,000		
大和工業	22,200	3,235.00	71,817,000		
東京鐵鋼	22,000	421.00	9,262,000		
大阪製鐵	5,400	1,809.00	9,768,600		
淀川製鋼所	76,000	427.00	32,452,000		
東洋鋼鈑	26,000	506.00	13,156,000		
丸一鋼管	35,800	2,669.00	95,550,200		
モリ工業	16,000	363.00	5,808,000		
大同特殊鋼	179,000	516.00	92,364,000	貸付株式数	15,000
日本高周波鋼業	42,000	97.00	4,074,000	貸付株式数	19,000 (19,000)

日本冶金工業	83,500	331.00	27,638,500	貸付株式数	36,500	(1,000)
山陽特殊製鋼	58,000	433.00	25,114,000	貸付株式数	9,000	(9,000)
愛知製鋼	57,000	406.00	23,142,000			
日立金属	95,000	1,469.00	139,555,000			
日本金属	28,000	130.00	3,640,000	貸付株式数	10,000	(8,000)
大平洋金属	75,000	385.00	28,875,000			
日本電工	46,000	275.00	12,650,000			
栗本鐵工所	55,000	228.00	12,540,000			
虹技	11,000	204.00	2,244,000			
日本鑄鉄管	12,000	231.00	2,772,000			
三菱製鋼	65,000	221.00	14,365,000			
日亜鋼業	15,000	291.00	4,365,000			
日本精線	8,000	411.00	3,288,000	貸付株式数	3,000	
シンニッタン	10,100	391.00	3,949,100			
新家工業	23,000	160.00	3,680,000			
大紀アルミニウム工業所	17,000	245.00	4,165,000			
日本軽金属ホールディングス	242,500	135.00	32,737,500			
三井金属鉱業	273,000	238.00	64,974,000			
東邦亜鉛	60,000	313.00	18,780,000			
三菱マテリアル	668,000	293.00	195,724,000			
住友金属鉱山	277,000	1,296.00	358,992,000			
DOWAホールディングス	118,000	862.00	101,716,000			
古河機械金属	180,000	186.00	33,480,000			
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	1,788.00	20,919,600	貸付株式数	5,100	
東邦チタニウム	18,100	618.00	11,185,800	貸付株式数	8,100	
UACJ	136,000	426.00	57,936,000			
古河電気工業	337,000	257.00	86,609,000			
住友電気工業	403,600	1,536.00	619,929,600			
フジクラ	172,000	472.00	81,184,000			
昭和電線ホールディングス	137,000	104.00	14,248,000	貸付株式数	57,000	
東京特殊電線	15,000	147.00	2,205,000	貸付株式数	7,000	
タツタ電線	15,600	534.00	8,330,400			
沖電線	11,000	175.00	1,925,000	貸付株式数	4,000	
カナレ電気	1,500	1,492.00	2,238,000	貸付株式数	500	
平河ヒューテック	2,300	795.00	1,828,500			
リョービ	65,000	315.00	20,475,000			
アサヒホールディングス	16,100	1,675.00	26,967,500			
稲葉製作所	4,600	1,296.00	5,961,600			
宮地エンジニアリンググループ	35,000	229.00	8,015,000	貸付株式数	14,000	
トーカロ	6,500	1,634.00	10,621,000			
アルファコ	3,600	995.00	3,582,000			
SUMCO	65,500	797.00	52,203,500	貸付株式数	28,500	
川田テクノロジーズ	2,200	2,990.00	6,578,000	貸付株式数	900	
東洋製罐グループホールディングス	76,100	1,676.00	127,543,600			
ホッカンホールディングス	26,000	286.00	7,436,000			
コロナ	5,600	1,066.00	5,969,600			
横河ブリッジホールディングス	20,000	1,138.00	22,760,000			
日本橋梁	23,400	148.00	3,463,200	貸付株式数	10,300	
駒井ハルテック	21,000	311.00	6,531,000			

高田機工	9,000	207.00	1,863,000	貸付株式数	2,000 (2,000)
三和ホールディングス	90,000	669.00	60,210,000		
文化シヤッター	25,000	633.00	15,825,000		
三協立山	13,000	2,020.00	26,260,000		
東洋シヤッター	2,800	615.00	1,722,000		
L I X I Lグループ	149,200	2,846.00	424,623,200		
日本ファイルコン	7,000	447.00	3,129,000		
ノーリツ	21,000	1,924.00	40,404,000		
長府製作所	11,400	2,650.00	30,210,000	貸付株式数	100
リンナイ	16,600	9,070.00	150,562,000		
ダイニチ工業	5,400	762.00	4,114,800	貸付株式数	1,700
日東精工	15,000	303.00	4,545,000		
三洋工業	13,000	179.00	2,327,000		
岡部	21,100	1,485.00	31,333,500		
中国工業	1,600	752.00	1,203,200	貸付株式数	700
東ブレ	20,600	1,104.00	22,742,400		
高周波熱錬	15,600	658.00	10,264,800		
東京製綱	72,000	160.00	11,520,000	貸付株式数	28,000
サンコール	7,000	629.00	4,403,000		
モリテック スチール	5,400	309.00	1,668,600		
パイオラックス	5,000	3,775.00	18,875,000		
日本発條	85,300	957.00	81,632,100		
中央発條	14,000	301.00	4,214,000		
アドバネクス	21,000	143.00	3,003,000	貸付株式数	8,000
三益半導体工業	9,000	919.00	8,271,000		
日本ドライケミカル	800	2,248.00	1,798,400	貸付株式数	200
アタカ大機	7,000	305.00	2,135,000		
日本製鋼所	153,000	463.00	70,839,000		
三浦工業	15,900	2,841.00	45,171,900		
タクマ	33,000	738.00	24,354,000		
ツガミ	33,000	617.00	20,361,000	貸付株式数	14,000
オークマ	70,000	834.00	58,380,000		
東芝機械	58,000	488.00	28,304,000		
アマダ	164,000	726.00	119,064,000		
アイダエンジニアリング	25,100	982.00	24,648,200		
滝澤鉄工所	27,000	155.00	4,185,000		
富士機械製造	32,600	907.00	29,568,200		
牧野フライス製作所	53,000	727.00	38,531,000		
オーエスジー	44,000	1,790.00	78,760,000		
ダイジェット工業	12,000	151.00	1,812,000	貸付株式数	3,000
旭ダイヤモンド工業	27,500	1,313.00	36,107,500		
D M G森精機	63,400	1,305.00	82,737,000	貸付株式数	8,200 (7,700)
ディスコ	11,900	6,420.00	76,398,000	貸付株式数	4,900
日東工器	6,200	1,900.00	11,780,000	貸付株式数	2,700
豊和工業	6,000	768.00	4,608,000		
大阪機工	41,000	135.00	5,535,000	貸付株式数	11,000
東洋機械金属	7,900	573.00	4,526,700		
津田駒工業	26,000	159.00	4,134,000	貸付株式数	11,000
エンシュウ	26,000	133.00	3,458,000	貸付株式数	8,000 (3,000)

島精機製作所	14,000	1,588.00	22,232,000	貸付株式数	6,000
日阪製作所	14,000	999.00	13,986,000		
やまびこ	4,200	4,210.00	17,682,000		
ベガサスミシン製造	9,800	393.00	3,851,400	貸付株式数	3,800 (3,800)
ナプテスコ	48,900	2,374.00	116,088,600		
三井海洋開発	8,800	2,612.00	22,985,600	貸付株式数	3,800
レオン自動機	10,000	579.00	5,790,000		
S M C	30,600	27,225.00	833,085,000	貸付株式数	1,300
新川	8,900	590.00	5,251,000	貸付株式数	4,100 (4,100)
ホソカワミクロン	18,000	582.00	10,476,000		
ユニオンツール	4,600	2,360.00	10,856,000		
オイレス工業	10,100	2,207.00	22,290,700		
日精工ー・エス・ビー機械	2,900	1,855.00	5,379,500	貸付株式数	1,200
サトーホールディングス	11,200	2,391.00	26,779,200	貸付株式数	4,800 (4,700)
日本エアータック	3,200	474.00	1,516,800	貸付株式数	100
日精樹脂工業	7,800	616.00	4,804,800		
ワイエイシイ	4,300	579.00	2,489,700		
小松製作所	499,700	2,138.00	1,068,358,600	貸付株式数	141,300
住友重機械工業	293,000	419.00	122,767,000		
日立建機	54,700	1,988.00	108,743,600	貸付株式数	1,000
日工	16,000	481.00	7,696,000		
巴工業	3,700	1,709.00	6,323,300	貸付株式数	1,700 (1,000)
井関農機	110,000	273.00	30,030,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
T O W A	8,700	543.00	4,724,100	貸付株式数	1,200
丸山製作所	22,000	231.00	5,082,000	貸付株式数	10,000
北川鉄工所	49,000	175.00	8,575,000		
クボタ	559,000	1,367.00	764,153,000		
荏原実業	2,800	1,397.00	3,911,600	貸付株式数	1,200 (1,200)
三菱化工機	35,000	163.00	5,705,000	貸付株式数	15,000
月島機械	17,000	1,155.00	19,635,000		
帝国電機製作所	3,600	3,380.00	12,168,000	貸付株式数	1,200
東京機械製作所	37,000	93.00	3,441,000	貸付株式数	15,000
新東工業	25,200	789.00	19,882,800		
澁谷工業	6,700	2,750.00	18,425,000	貸付株式数	2,900
アイチ コーポレーション	15,100	458.00	6,915,800		
小森コーポレーション	26,000	1,288.00	33,488,000		
鶴見製作所	8,000	1,332.00	10,656,000		
住友精密工業	17,000	370.00	6,290,000	貸付株式数	2,000
酒井重工業	20,000	356.00	7,120,000	貸付株式数	2,000 (2,000)
荏原製作所	236,000	647.00	152,692,000		
石井鐵工所	16,000	277.00	4,432,000	貸付株式数	7,000
西島製作所	11,400	1,273.00	14,512,200	貸付株式数	400
ダイキン工業	139,700	5,782.00	807,745,400		
オルガノ	17,000	480.00	8,160,000	貸付株式数	5,000
トーヨーカネツ	57,000	263.00	14,991,000		
栗田工業	64,400	2,239.00	144,191,600		
椿本チエイン	55,000	738.00	40,590,000		
大同工業	21,000	287.00	6,027,000		
日本コンベヤ	33,000	141.00	4,653,000	貸付株式数	14,000

木村化工機	9,800	474.00	4,645,200	貸付株式数	4,200	
アネスト岩田	17,000	650.00	11,050,000			
ダイフク	43,500	1,276.00	55,506,000			
サムコ	1,300	1,455.00	1,891,500	貸付株式数	500	
加藤製作所	24,000	557.00	13,368,000			
油研工業	20,000	225.00	4,500,000			
タダノ	45,000	1,342.00	60,390,000	貸付株式数	4,000	
フジテック	29,800	1,397.00	41,630,600			
C K D	28,700	984.00	28,240,800			
キトー	6,000	2,112.00	12,672,000			
平和	22,200	1,770.00	39,294,000			
理想科学工業	7,900	2,553.00	20,168,700			
S A N K Y O	31,000	4,345.00	134,695,000			
日本金銭機械	9,400	1,825.00	17,155,000	貸付株式数	4,000	(900)
マースエンジニアリング	5,800	1,943.00	11,269,400	貸付株式数	100	
福島工業	5,600	1,648.00	9,228,800			
オーイズミ	3,600	893.00	3,214,800	貸付株式数	1,500	
ダイコク電機	4,200	2,228.00	9,357,600			
アマノ	29,200	1,066.00	31,127,200			
J U K I	66,000	208.00	13,728,000	貸付株式数	4,000	
サンデン	58,000	460.00	26,680,000	貸付株式数	16,000	(10,000)
蛇の目ミシン工業	99,000	83.00	8,217,000	貸付株式数	23,000	
マックス	16,000	1,145.00	18,320,000	貸付株式数	1,000	
グローリー	30,500	2,829.00	86,284,500			
新晃工業	7,100	973.00	6,908,300			
大和冷機工業	16,000	707.00	11,312,000			
セガサミーホールディングス	110,000	2,312.00	254,320,000			
日本ピストンリング	40,000	177.00	7,080,000	貸付株式数	4,000	
リケン	41,000	417.00	17,097,000			
T P R	11,400	1,574.00	17,943,600			
ホシザキ電機	22,400	3,900.00	87,360,000			
大豊工業	7,300	978.00	7,139,400			
日本精工	228,000	1,062.00	242,136,000			
N T N	237,000	351.00	83,187,000			
ジェイテクト	108,700	1,534.00	166,745,800	貸付株式数	1,200	(1,200)
不二越	95,000	680.00	64,600,000			
日本トムソン	33,000	505.00	16,665,000	貸付株式数	1,000	
T H K	63,800	2,317.00	147,824,600			
ユースン精機	4,500	3,000.00	13,500,000	貸付株式数	1,900	(900)
前澤給装工業	3,900	1,272.00	4,960,800	貸付株式数	1,600	(1,600)
イーグル工業	12,600	1,591.00	20,046,600			
前澤工業	7,500	334.00	2,505,000			
日本ビラー工業	11,100	801.00	8,891,100			
キッツ	45,900	505.00	23,179,500			
日立工機	27,400	809.00	22,166,600	貸付株式数	8,300	
マキタ	66,700	5,670.00	378,189,000			
日立造船	76,400	492.00	37,588,800	貸付株式数	8,000	
三菱重工業	1,822,000	597.00	1,087,734,000			
I H I	721,000	434.00	312,914,000			

イビデン	62,300	2,034.00	126,718,200	貸付株式数	4,900
コニカミノルタ	270,500	963.00	260,491,500		
ブラザー工業	132,300	1,443.00	190,908,900		
ミネベア	139,000	918.00	127,602,000		
日立製作所	2,462,000	762.00	1,876,044,000		
東芝	2,019,000	437.00	882,303,000		
三菱電機	1,023,000	1,162.00	1,188,726,000		
富士電機	285,000	461.00	131,385,000		
東洋電機製造	22,000	350.00	7,700,000	貸付株式数	3,000
安川電機	112,200	1,427.00	160,109,400	貸付株式数	11,000
シンフォニアテクノロジー	62,000	162.00	10,044,000		
明電舎	94,000	457.00	42,958,000		
オリジン電気	15,000	303.00	4,545,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
山洋電気	15,000	667.00	10,005,000		
デンヨー	10,100	1,735.00	17,523,500		
東芝テック	64,000	587.00	37,568,000		
芝浦メカトロニクス	18,000	235.00	4,230,000	貸付株式数	8,000 (7,000)
マブチモーター	14,400	6,760.00	97,344,000		
日本電産	110,600	6,279.00	694,457,400	貸付株式数	300
東光高岳ホールディングス	5,700	1,984.00	11,308,800	貸付株式数	1,900
ダイヘン	60,000	411.00	24,660,000		
ヤーマン	1,300	1,565.00	2,034,500	貸付株式数	500 (400)
JVCケンウッド	70,700	249.00	17,604,300	貸付株式数	29,800
第一精工	4,300	1,233.00	5,301,900	貸付株式数	500 (500)
日新電機	21,000	532.00	11,172,000		
大崎電気工業	16,000	597.00	9,552,000	貸付株式数	7,000 (4,000)
オムロン	115,400	4,260.00	491,604,000		
日東工業	15,000	2,166.00	32,490,000		
I D E C	13,400	967.00	12,957,800	貸付株式数	400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	197,000	547.00	107,759,000	貸付株式数	88,000
サクサホールディングス	26,000	159.00	4,134,000		
メルコホールディングス	4,900	1,516.00	7,428,400	貸付株式数	2,000
テクノメディカ	2,300	2,199.00	5,057,700		
日本電気	1,407,000	317.00	446,019,000		
富士通	986,000	624.00	615,264,000		
沖電気工業	395,000	221.00	87,295,000		
岩崎通信機	48,000	91.00	4,368,000		
電気興業	29,000	627.00	18,183,000		
サンケン電気	56,000	730.00	40,880,000		
ナカヨ通信機	10,000	328.00	3,280,000		
アイホン	5,900	1,725.00	10,177,500	貸付株式数	2,700 (2,700)
ルネサスエレクトロニクス	53,000	787.00	41,711,000	貸付株式数	23,100
セイコーエプソン	69,800	3,210.00	224,058,000		
ワコム	80,600	725.00	58,435,000	貸付株式数	35,100
アルバック	18,800	2,109.00	39,649,200		
アクセル	5,100	1,690.00	8,619,000	貸付株式数	600
E I Z O	9,400	2,698.00	25,361,200		
日本信号	28,200	901.00	25,408,200		
京三製作所	24,000	349.00	8,376,000		

能美防災	14,000	1,304.00	18,256,000		
ホーチキ	7,000	557.00	3,899,000		
エレコム	3,700	2,165.00	8,010,500	貸付株式数	1,600
日本無線	26,000	395.00	10,270,000	貸付株式数	11,000
パナソニック	1,169,000	1,173.00	1,371,237,000		
シャープ	738,000	314.00	231,732,000	貸付株式数	322,000
アンリツ	59,500	1,185.00	70,507,500	貸付株式数	5,800
富士通ゼネラル	24,000	996.00	23,904,000		
日立国際電気	20,000	1,239.00	24,780,000		
ソニー	561,000	1,972.00	1,106,292,000		
T D K	61,800	4,310.00	266,358,000		
帝国通信工業	24,000	177.00	4,248,000		
ミツミ電機	38,900	747.00	29,058,300		
タムラ製作所	39,000	261.00	10,179,000		
アルプス電気	75,000	1,231.00	92,325,000	貸付株式数	900 (900)
池上通信機	32,000	110.00	3,520,000	貸付株式数	14,000 (2,000)
パイオニア	141,900	221.00	31,359,900	貸付株式数	55,800
日本電波工業	9,200	806.00	7,415,200	貸付株式数	3,400 (900)
日本トリム	2,200	6,090.00	13,398,000		
ローランド ディー . ジー .	4,500	4,085.00	18,382,500		
フォスター電機	10,500	1,256.00	13,188,000		
クラリオン	63,000	162.00	10,206,000	貸付株式数	27,000
S M K	30,000	389.00	11,670,000		
ヨコオ	8,600	561.00	4,824,600		
東光	24,000	323.00	7,752,000	貸付株式数	1,000
ティアック	55,000	72.00	3,960,000	貸付株式数	24,000
ホシデン	30,000	506.00	15,180,000		
ヒロセ電機	17,800	14,180.00	252,404,000		
日本航空電子工業	26,000	1,542.00	40,092,000		
T O A	11,000	1,047.00	11,517,000		
古野電気	9,900	710.00	7,029,000	貸付株式数	4,300 (4,200)
ユニデン	32,000	258.00	8,256,000		
アルパイン	22,200	1,353.00	30,036,600		
スミダコーポレーション	8,400	572.00	4,804,800		
アイコム	5,700	2,364.00	13,474,800		
リオン	2,900	1,470.00	4,263,000	貸付株式数	1,200 (1,100)
船井電機	10,300	1,022.00	10,526,600	貸付株式数	4,400 (4,100)
横河電機	110,900	1,667.00	184,870,300		
新電元工業	33,000	456.00	15,048,000	貸付株式数	4,000
アズビル	31,000	2,548.00	78,988,000		
東亜ディーケーケー	3,800	525.00	1,995,000		
日本光電工業	21,800	4,115.00	89,707,000		
チノー	18,000	220.00	3,960,000		
共和電業	12,000	459.00	5,508,000		
日本電子材料	4,400	446.00	1,962,400	貸付株式数	1,800
堀場製作所	18,900	3,890.00	73,521,000		
アドバンテスト	69,700	1,117.00	77,854,900	貸付株式数	30,300 (8,100)
小野測器	11,000	464.00	5,104,000		
エスベック	10,600	800.00	8,480,000		

パナソニック デバイスSUNX	9,000	445.00	4,005,000		
キーエンス	23,200	42,570.00	987,624,000		
日置電機	5,300	1,539.00	8,156,700	貸付株式数	300
シスメックス	85,700	3,290.00	281,953,000		
メガチップス	9,200	1,210.00	11,132,000	貸付株式数	4,000
O B A R A G R O U P	6,600	3,865.00	25,509,000		
日本電産コバル電子	10,600	671.00	7,112,600		
澤藤電機	6,000	217.00	1,302,000	貸付株式数	2,000
コーセル	14,900	1,207.00	17,984,300		
新日本無線	7,000	311.00	2,177,000	貸付株式数	3,000 (2,000)
オプテックス	6,500	1,782.00	11,583,000		
千代田インテグレ	4,500	1,880.00	8,460,000		
レーザーテック	7,900	1,162.00	9,179,800	貸付株式数	2,900 (2,900)
スタンレー電気	73,700	2,291.00	168,846,700		
岩崎電気	37,000	253.00	9,361,000		
ウシオ電機	62,100	1,332.00	82,717,200		
岡谷電機産業	5,500	386.00	2,123,000	貸付株式数	2,300 (2,300)
ヘリオス テクノ ホールディング	8,700	324.00	2,818,800	貸付株式数	3,700
日本セラミック	5,900	1,767.00	10,425,300	貸付株式数	2,500
遠藤照明	4,200	1,927.00	8,093,400	貸付株式数	1,200
日本デジタル研究所	7,600	1,488.00	11,308,800		
古河電池	7,000	715.00	5,005,000	貸付株式数	3,000 (3,000)
双信電機	5,000	376.00	1,880,000		
山一電機	11,100	416.00	4,617,600	貸付株式数	4,800
図研	6,700	821.00	5,500,700	貸付株式数	2,900
日本電子	39,000	392.00	15,288,000	貸付株式数	9,000
カシオ計算機	106,400	1,221.00	129,914,400	貸付株式数	4,900
ファナック	114,100	18,205.00	2,077,190,500		
日本シイエムケイ	24,000	263.00	6,312,000	貸付株式数	5,800 (300)
エンプラス	3,900	5,800.00	22,620,000		
大真空	14,000	414.00	5,796,000	貸付株式数	5,000
ローム	54,000	4,605.00	248,670,000		
浜松ホトニクス	39,900	4,650.00	185,535,000		
三井ハイテック	13,500	691.00	9,328,500		
新光電気工業	34,400	745.00	25,628,000		
京セラ	180,000	4,653.00	837,540,000		
太陽誘電	49,800	1,273.00	63,395,400	貸付株式数	21,700 (100)
村田製作所	107,300	9,735.00	1,044,565,500		
ユーシン	14,200	623.00	8,846,600	貸付株式数	6,600
双葉電子工業	19,000	1,780.00	33,820,000		
北陸電気工業	41,000	140.00	5,740,000		
ニチコン	32,200	817.00	26,307,400		
日本ケミコン	71,000	322.00	22,862,000	貸付株式数	10,000
K O A	12,900	1,150.00	14,835,000		
市光工業	24,000	140.00	3,360,000	貸付株式数	4,000
小糸製作所	56,000	1,747.00	97,832,000		
ミツバ	18,800	1,694.00	31,847,200		
スター精密	19,400	1,244.00	24,133,600	貸付株式数	8,300 (8,300)
大日本スクリーン製造	97,000	477.00	46,269,000		

キャノン電子	9,400	1,800.00	16,920,000		
キャノン	593,200	3,191.00	1,892,901,200		
リコー	307,700	1,190.00	366,163,000		
MUTOHホールディングス	14,000	475.00	6,650,000	貸付株式数	6,000
東京エレクトロン	91,800	6,325.00	580,635,000		
トヨタ紡織	35,800	1,043.00	37,339,400	貸付株式数	15,600
鬼怒川ゴム工業	19,000	428.00	8,132,000	貸付株式数	4,000
ユニプレス	16,600	1,855.00	30,793,000	貸付株式数	5,900 (1,100)
豊田自動織機	93,200	4,960.00	462,272,000		
モリタホールディングス	18,000	881.00	15,858,000		
三櫻工業	13,000	646.00	8,398,000		
デンソー	252,800	4,948.00	1,250,854,400		
東海理化電機製作所	26,900	1,734.00	46,644,600		
三井造船	396,000	218.00	86,328,000		
佐世保重工業	72,000	148.00	10,656,000	貸付株式数	24,000 (24,000)
川崎重工業	797,000	380.00	302,860,000		
名村造船所	15,000	964.00	14,460,000		
サノヤスホールディングス	9,300	234.00	2,176,200	貸付株式数	3,900 (200)
日本車輛製造	37,000	428.00	15,836,000	貸付株式数	9,000 (8,000)
ニチユ三菱フォークリフト	12,000	725.00	8,700,000	貸付株式数	2,000
近畿車輛	18,000	388.00	6,984,000		
日産自動車	1,436,200	920.00	1,321,304,000	貸付株式数	99,900
いすゞ自動車	593,000	593.00	351,649,000		
トヨタ自動車	1,424,000	5,826.00	8,296,224,000		
日野自動車	127,800	1,531.00	195,661,800		
三菱自動車工業	320,500	1,080.00	346,140,000		
エフテック	4,300	1,249.00	5,370,700	貸付株式数	1,800 (100)
レシップホールディングス	3,400	864.00	2,937,600		
G M B	1,000	1,258.00	1,258,000		
武蔵精密工業	10,900	2,125.00	23,162,500	貸付株式数	2,600 (1,800)
日産車体	50,000	1,729.00	86,450,000		
新明和工業	41,000	942.00	38,622,000		
極東開発工業	17,700	1,489.00	26,355,300		
日信工業	20,800	1,925.00	40,040,000		
トビー工業	84,000	182.00	15,288,000		
ティラド	40,000	293.00	11,720,000		
曙ブレーキ工業	47,500	462.00	21,945,000	貸付株式数	20,700 (500)
タチエス	15,100	1,700.00	25,670,000	貸付株式数	500 (500)
N O K	49,500	1,685.00	83,407,500		
フタバ産業	31,200	450.00	14,040,000		
カヤバ工業	96,000	436.00	41,856,000	貸付株式数	1,000
シロキ工業	23,000	208.00	4,784,000		
大同メタル工業	14,000	1,084.00	15,176,000		
プレス工業	40,000	374.00	14,960,000	貸付株式数	17,000
カルソニックカンセイ	69,000	479.00	33,051,000		
太平洋工業	20,800	692.00	14,393,600		
ケーヒン	23,500	1,504.00	35,344,000	貸付株式数	4,800
河西工業	14,000	661.00	9,254,000		
アイシン精機	93,600	3,725.00	348,660,000		

富士機工	12,000	336.00	4,032,000		
マツダ	1,525,000	458.00	698,450,000	貸付株式数	19,000 (19,000)
ダイハツ工業	108,600	1,823.00	197,977,800		
今仙電機製作所	7,600	1,287.00	9,781,200	貸付株式数	3,300 (3,100)
本田技研工業	920,800	3,634.00	3,346,187,200		
スズキ	213,900	2,694.00	576,246,600		
富士重工業	348,200	2,792.00	972,174,400		
ヤマハ発動機	155,600	1,645.00	255,962,000		
ショーワ	24,200	1,134.00	27,442,800		
T B K	11,000	521.00	5,731,000		
エクセディ	12,400	2,888.00	35,811,200		
豊田合成	33,000	1,979.00	65,307,000		
愛三工業	12,400	792.00	9,820,800		
ヨロズ	7,500	1,695.00	12,712,500		
エフ・シー・シー	16,700	1,837.00	30,677,900		
シマノ	44,200	10,370.00	458,354,000	貸付株式数	2,700
タカタ	18,500	2,594.00	47,989,000		
テイ・エス テック	21,600	3,130.00	67,608,000		
テルモ	156,800	2,253.00	353,270,400	貸付株式数	700
クリエートメディック	3,400	948.00	3,223,200		
日機装	33,200	1,146.00	38,047,200		
島津製作所	132,000	917.00	121,044,000		
J M S	19,000	307.00	5,833,000		
クボテック	2,600	258.00	670,800	貸付株式数	1,100 (800)
ショットモリテックス	2,200	275.00	605,000		
長野計器	6,500	689.00	4,478,500	貸付株式数	1,600 (1,600)
ブイ・テクノロジー	2,100	3,335.00	7,003,500	貸付株式数	9 (2)
東京計器	35,000	301.00	10,535,000	貸付株式数	13,000
愛知時計電機	13,000	295.00	3,835,000		
東京精密	18,400	1,817.00	33,432,800		
マニー	3,100	4,280.00	13,268,000	貸付株式数	600 (400)
ニコン	191,000	1,662.00	317,442,000	貸付株式数	13,400 (200)
トプコン	27,500	1,692.00	46,530,000	貸付株式数	4,300
オリンパス	152,400	3,290.00	501,396,000		
理研計器	9,000	934.00	8,406,000		
タムロン	7,900	2,445.00	19,315,500	貸付株式数	3,400 (1,400)
H O Y A	248,800	3,213.00	799,394,400		
ノーリツ鋼機	9,200	726.00	6,679,200		
エー・アンド・デイ	9,300	428.00	3,980,400	貸付株式数	2,800
シチズンホールディングス	125,900	777.00	97,824,300		
リズム時計工業	46,000	137.00	6,302,000		
大研医器	3,500	1,713.00	5,995,500	貸付株式数	1,400
松風	5,000	876.00	4,380,000	貸付株式数	2,300
セイコーホールディングス	66,000	411.00	27,126,000		
ニプロ	54,500	927.00	50,521,500	貸付株式数	24,500
パラマウントベッドホールディングス	9,800	3,225.00	31,605,000		
S H O - B I	3,000	411.00	1,233,000	貸付株式数	800
前田工織	7,400	1,696.00	12,550,400	貸付株式数	1,500
永大産業	13,000	620.00	8,060,000		

アートネイチャー	3,300	2,938.00	9,695,400	貸付株式数	700
ダンロップスポーツ	5,500	1,252.00	6,886,000		
パンダイナムコホールディングス	112,800	2,443.00	275,570,400		
共立印刷	18,500	271.00	5,013,500		
フランスベッドホールディングス	64,000	193.00	12,352,000	貸付株式数	10,000 (10,000)
パイロットコーポレーション	8,900	4,250.00	37,825,000		
トッパン・フォームズ	18,300	961.00	17,586,300		
フジシールインターナショナル	12,400	3,515.00	43,586,000		
タカラトミー	33,700	478.00	16,108,600	貸付株式数	10,900
廣済堂	9,500	513.00	4,873,500	貸付株式数	2,400 (2,400)
アーク	30,300	287.00	8,696,100	貸付株式数	12,700
タカノ	4,500	551.00	2,479,500	貸付株式数	2,000 (2,000)
プロネクサス	10,400	762.00	7,924,800		
ホクシン	7,200	149.00	1,072,800	貸付株式数	3,200 (3,200)
ウッドワン	17,000	324.00	5,508,000		
大建工業	42,000	281.00	11,802,000		
凸版印刷	289,000	739.00	213,571,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
大日本印刷	312,000	989.00	308,568,000	貸付株式数	140,000 (140,000)
図書印刷	16,000	447.00	7,152,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
共同印刷	32,000	292.00	9,344,000		
日本写真印刷	17,200	1,359.00	23,374,800	貸付株式数	7,400 (300)
光村印刷	10,000	262.00	2,620,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
宝印刷	5,800	814.00	4,721,200		
アシックス	101,600	2,029.00	206,146,400	貸付株式数	16,700 (16,700)
ツツミ	5,100	2,480.00	12,648,000		
ローランド	9,800	1,429.00	14,004,200		
小松ウオール工業	3,500	1,983.00	6,940,500		
ヤマハ	75,200	1,329.00	99,940,800		
河合楽器製作所	35,000	188.00	6,580,000	貸付株式数	2,000
クリナップ	10,400	1,036.00	10,774,400		
ビジョン	16,700	4,660.00	77,822,000		
兼松日産農林	16,000	155.00	2,480,000	貸付株式数	7,000
キングジム	8,500	715.00	6,077,500	貸付株式数	300
リンテック	24,300	1,968.00	47,822,400		
T A S A K I	2,000	685.00	1,370,000	貸付株式数	900
イトーキ	21,500	649.00	13,953,500		
任天堂	63,000	12,260.00	772,380,000		
三菱鉛筆	8,400	2,959.00	24,855,600		
タカラスタANDARD	42,000	791.00	33,222,000		
コクヨ	53,200	755.00	40,166,000	貸付株式数	9,300 (9,300)
ナカバヤシ	22,000	207.00	4,554,000		
グローブライド	53,000	134.00	7,102,000		
岡村製作所	39,000	904.00	35,256,000		
美津濃	51,000	581.00	29,631,000		
アデランス	12,800	1,181.00	15,116,800	貸付株式数	3,300
東京電力	867,900	416.00	361,046,400		
中部電力	337,100	1,215.00	409,576,500		
関西電力	417,500	1,059.00	442,132,500		
中国電力	141,500	1,439.00	203,618,500		

北陸電力	100,200	1,339.00	134,167,800		
東北電力	255,600	1,064.00	271,958,400		
四国電力	92,100	1,400.00	128,940,000		
九州電力	226,000	1,262.00	285,212,000	貸付株式数	53,300 (53,300)
北海道電力	95,800	872.00	83,537,600		
沖縄電力	6,700	3,495.00	23,416,500		
電源開発	63,500	2,915.00	185,102,500		
東京瓦斯	1,200,000	524.00	628,800,000		
大阪瓦斯	1,059,000	391.00	414,069,000		
東邦瓦斯	260,000	562.00	146,120,000	貸付株式数	11,000
北海道瓦斯	20,000	283.00	5,660,000	貸付株式数	8,000
西部瓦斯	115,000	261.00	30,015,000	貸付株式数	2,000
静岡瓦斯	26,600	630.00	16,758,000		
SBSホールディングス	2,200	1,729.00	3,803,800		
東武鉄道	581,000	499.00	289,919,000		
相鉄ホールディングス	175,000	378.00	66,150,000		
東京急行電鉄	602,000	631.00	379,862,000		
京浜急行電鉄	263,000	870.00	228,810,000		
小田急電鉄	328,000	889.00	291,592,000		
京王電鉄	286,000	719.00	205,634,000		
京成電鉄	153,000	895.00	136,935,000	貸付株式数	2,000 (2,000)
富士急行	28,000	1,061.00	29,708,000	貸付株式数	12,000 (1,000)
新京成電鉄	13,000	377.00	4,901,000		
東日本旅客鉄道	188,200	7,606.00	1,431,449,200		
西日本旅客鉄道	92,300	4,214.00	388,952,200		
東海旅客鉄道	91,600	12,060.00	1,104,696,000		
鴻池運輸	5,400	1,592.00	8,596,800		
西日本鉄道	132,000	390.00	51,480,000	貸付株式数	44,000 (44,000)
ハマキョウレックス	2,900	2,775.00	8,047,500		
サカイ引越センター	1,700	3,410.00	5,797,000	貸付株式数	700
近畿日本鉄道	1,030,000	367.00	378,010,000	貸付株式数	92,000 (92,000)
阪急阪神ホールディングス	687,000	562.00	386,094,000		
南海電気鉄道	213,000	400.00	85,200,000		
京阪電気鉄道	216,000	412.00	88,992,000		
神戸電鉄	25,000	340.00	8,500,000	貸付株式数	11,000 (4,000)
名糖運輸	4,200	658.00	2,763,600	貸付株式数	1,800
名古屋鉄道	357,000	310.00	110,670,000	貸付株式数	156,000
山陽電気鉄道	37,000	485.00	17,945,000	貸付株式数	11,000 (11,000)
日本通運	405,000	505.00	204,525,000		
ヤマトホールディングス	187,800	2,224.00	417,667,200	貸付株式数	30,800
山九	124,000	387.00	47,988,000		
丸運	6,400	241.00	1,542,400		
丸全昭和運輸	34,000	348.00	11,832,000	貸付株式数	14,000 (13,000)
センコー	41,000	448.00	18,368,000	貸付株式数	9,000 (4,000)
トナミホールディングス	21,000	193.00	4,053,000		
日本梱包運輸倉庫	31,200	1,819.00	56,752,800		
日本石油輸送	12,000	234.00	2,808,000		
福山通運	62,000	620.00	38,440,000	貸付株式数	14,000
セイノーホールディングス	73,000	983.00	71,759,000		

神奈川中央交通	12,000	518.00	6,216,000	貸付株式数	5,000	(5,000)
日立物流	21,300	1,676.00	35,698,800			
日本郵船	864,000	300.00	259,200,000			
商船三井	575,000	402.00	231,150,000			
川崎汽船	448,000	223.00	99,904,000			
N S ユナイテッド海運	44,000	245.00	10,780,000	貸付株式数	14,000	
乾汽船	12,200	340.00	4,148,000	貸付株式数	5,500	(100)
明治海運	9,100	414.00	3,767,400	貸付株式数	1,300	
飯野海運	42,300	517.00	21,869,100			
共栄タンカー	9,000	218.00	1,962,000	貸付株式数	3,000	
第一中央汽船	75,000	93.00	6,975,000	貸付株式数	33,000	
日本航空	86,400	5,080.00	438,912,000			
A N A ホールディングス	2,011,000	223.00	448,453,000	貸付株式数	517,000	(38,000)
スカイマーク	21,800	291.00	6,343,800	貸付株式数	9,300	
バスコ	9,000	434.00	3,906,000	貸付株式数	4,000	
トランコム	3,000	4,005.00	12,015,000	貸付株式数	400	
日新	39,000	294.00	11,466,000			
三菱倉庫	67,000	1,436.00	96,212,000			
三井倉庫	51,000	412.00	21,012,000			
住友倉庫	68,000	503.00	34,204,000			
澁澤倉庫	24,000	386.00	9,264,000			
東陽倉庫	17,000	267.00	4,539,000			
日本トランスシティ	21,000	318.00	6,678,000			
ケイヒン	19,000	160.00	3,040,000			
中央倉庫	5,900	915.00	5,398,500	貸付株式数	500	
安田倉庫	8,000	1,099.00	8,792,000	貸付株式数	200	
東洋埠頭	30,000	246.00	7,380,000	貸付株式数	1,000	
宇徳	8,300	359.00	2,979,700			
上組	122,000	1,003.00	122,366,000			
サンリツ	2,500	546.00	1,365,000			
キムラユニティー	2,300	937.00	2,155,100	貸付株式数	1,000	
キューソー流通システム	3,200	1,012.00	3,238,400	貸付株式数	1,400	(1,400)
郵船ロジスティクス	9,400	1,302.00	12,238,800			
近鉄エクスプレス	9,100	4,585.00	41,723,500			
東海運	5,500	265.00	1,457,500			
エーアイティー	3,800	762.00	2,895,600	貸付株式数	1,500	(400)
N E C ネットズエスアイ	11,100	2,098.00	23,287,800			
システナ	9,800	743.00	7,281,400			
デジタルアーツ	2,700	946.00	2,554,200	貸付株式数	200	
新日鉄住金ソリューションズ	8,400	2,340.00	19,656,000			
コア	3,800	757.00	2,876,600	貸付株式数	1,600	(1,600)
ソフトクリエイティブホールディングス	3,300	839.00	2,768,700	貸付株式数	1,400	(1,400)
I T ホールディングス	36,300	1,694.00	61,492,200			
ネオス	2,100	983.00	2,064,300	貸付株式数	900	(800)
電算システム	2,400	1,194.00	2,865,600	貸付株式数	1,000	(500)
グリー	60,800	1,140.00	69,312,000	貸付株式数	26,100	(1,000)
コーエーテクモホールディングス	20,000	1,398.00	27,960,000	貸付株式数	3,300	
三菱総合研究所	3,900	2,082.00	8,119,800			
ボルテージ	1,800	1,487.00	2,676,600	貸付株式数	400	

電算	700	2,050.00	1,435,000	貸付株式数	300
ヒト・コミュニケーションズ	1,100	1,810.00	1,991,000	貸付株式数	100
ブレインパッド	800	1,688.00	1,350,400	貸付株式数	300
K L a b	7,000	587.00	4,109,000	貸付株式数	3,100
ポルトウウィン・ピットクルーホール ディ	6,000	1,329.00	7,974,000	貸付株式数	2,600 (2,500)
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	1,448.00	2,172,000	貸付株式数	600 (600)
ネクソン	83,800	870.00	72,906,000		
アイスタイル	3,300	591.00	1,950,300	貸付株式数	1,400
エムアップ	1,800	701.00	1,261,800	貸付株式数	700 (700)
エイチーム	900	4,940.00	4,446,000	貸付株式数	300
e n i s h	1,400	2,063.00	2,888,200	貸付株式数	600
モバイルクリエイト	800	3,350.00	2,680,000	貸付株式数	300
ブロードリーフ	10,000	1,612.00	16,120,000	貸付株式数	4,200 (4,200)
ハーツユナイテッドグループ	2,300	2,985.00	6,865,500		
ダウンゴ	9,100	3,450.00	31,395,000	貸付株式数	4,200
ベリサーブ	600	1,648.00	988,800		
マクロミル	2,000	782.00	1,564,000		
ティーガイア	10,000	931.00	9,310,000	貸付株式数	1,000
豆蔵ホールディングス	5,900	400.00	2,360,000		
テクマトリックス	3,200	584.00	1,868,800	貸付株式数	1,200
GMOペイメントゲートウェイ	3,800	4,390.00	16,682,000	貸付株式数	800 (800)
ザッパラス	5,600	758.00	4,244,800	貸付株式数	2,600
インターネットイニシアティブ	14,800	2,491.00	36,866,800	貸付株式数	6,400
ビットアイル	7,600	615.00	4,674,000	貸付株式数	3,300
S R Aホールディングス	4,800	1,384.00	6,643,200		
システムインテグレータ	800	830.00	664,000		
朝日ネット	9,300	489.00	4,547,700		
コムチュア	900	1,818.00	1,636,200	貸付株式数	300
パナソニック インフォメーションシス テム	2,000	2,813.00	5,626,000		
フェイス	3,000	1,054.00	3,162,000	貸付株式数	100
野村総合研究所	57,200	3,260.00	186,472,000		
サイバネットシステム	8,200	360.00	2,952,000	貸付株式数	200
インテージホールディングス	5,500	1,371.00	7,540,500		
ソースネクスト	5,000	747.00	3,735,000	貸付株式数	2,200 (1,200)
ティー・ワイ・オー	7,200	161.00	1,159,200	貸付株式数	1,800
クレスコ	2,300	1,003.00	2,306,900		
フジ・メディア・ホールディングス	97,600	1,895.00	184,952,000		
オービック	34,800	3,260.00	113,448,000		
ジャストシステム	13,800	795.00	10,971,000		
TDCソフトウェアエンジニアリング	2,200	836.00	1,839,200		
ヤフー	731,000	506.00	369,886,000		
トレンドマイクロ	44,600	3,195.00	142,497,000		
日本オラクル	16,200	4,675.00	75,735,000		
アルファシステムズ	3,300	1,547.00	5,105,100	貸付株式数	1,500 (1,500)
フューチャーアーキテクト	12,100	618.00	7,477,800		
シーエーシー	6,200	1,037.00	6,429,400	貸付株式数	900
ソフトバンク・テクノロジー	2,400	1,525.00	3,660,000	貸付株式数	1,000

トーセ	2,500	718.00	1,795,000		
オービックビジネスコンサルタント	5,100	3,485.00	17,773,500	貸付株式数	2,200
伊藤忠テクノソリューションズ	11,400	4,355.00	49,647,000	貸付株式数	1,800 (1,800)
アイティフォー	11,200	463.00	5,185,600		
東計電算	1,800	1,396.00	2,512,800		
エクスネット	900	1,376.00	1,238,400		
大塚商会	9,100	13,480.00	122,668,000		
サイボウズ	15,100	357.00	5,390,700	貸付株式数	6,600 (6,600)
ソフトブレイン	13,800	133.00	1,835,400	貸付株式数	6,400 (6,400)
アグレックス	2,300	1,040.00	2,392,000	貸付株式数	1,000
電通国際情報サービス	6,200	1,258.00	7,799,600		
E Mシステムズ	1,400	2,303.00	3,224,200	貸付株式数	500
ウェザーニューズ	3,000	2,750.00	8,250,000		
C I J	9,300	424.00	3,943,200	貸付株式数	3,800 (3,800)
日本エンタープライズ	6,300	295.00	1,858,500		
WOWOW	3,100	3,680.00	11,408,000		
日本コロムビア	5,000	714.00	3,570,000	貸付株式数	2,200 (2,100)
ネットワンシステムズ	39,600	701.00	27,759,600	貸付株式数	17,600
アルゴグラフィックス	3,800	1,690.00	6,422,000		
マーベラスAQL	15,300	840.00	12,852,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
エイベックス・グループ・ホールディングス	18,600	1,813.00	33,721,800		
日本ユニシス	24,400	1,009.00	24,619,600		
兼松エレクトロニクス	6,400	1,452.00	9,292,800		
東京放送ホールディングス	54,500	1,193.00	65,018,500	貸付株式数	6,000
日本テレビホールディングス	100,600	1,686.00	169,611,600		
テレビ朝日	25,600	1,870.00	47,872,000		
スカパーJ S A Tホールディングス	76,600	552.00	42,283,200		
テレビ東京ホールディングス	8,200	1,748.00	14,333,600	貸付株式数	2,100
コネクシオ	8,900	816.00	7,262,400	貸付株式数	1,500
日本電信電話	396,800	5,619.00	2,229,619,200		
K D D I	313,500	5,976.00	1,873,476,000	貸付株式数	1,500 (1,500)
光通信	9,100	8,710.00	79,261,000		
N T T ドコモ	832,100	1,628.00	1,354,658,800		
G M O インターネット	33,700	1,029.00	34,677,300		
学研ホールディングス	34,000	287.00	9,758,000		
ゼンリン	13,300	1,042.00	13,858,600	貸付株式数	6,100 (6,100)
昭文社	6,000	692.00	4,152,000	貸付株式数	2,600 (2,600)
K A D O K A W A	10,100	3,305.00	33,380,500	貸付株式数	4,300 (100)
インプレスホールディングス	7,100	139.00	986,900	貸付株式数	3,100
アイネット	4,200	729.00	3,061,800	貸付株式数	1,900 (1,900)
松竹	66,000	882.00	58,212,000	貸付株式数	6,000
東宝	72,100	2,069.00	149,174,900		
東映	42,000	620.00	26,040,000	貸付株式数	19,000 (19,000)
A O I P r o .	4,700	650.00	3,055,000		
エヌ・ティ・ティ・データ	71,300	4,015.00	286,269,500		
D T S	9,600	1,806.00	17,337,600		
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36,700	2,125.00	77,987,500	貸付株式数	16,000 (500)

シーイーシー	6,000	629.00	3,774,000		
カプコン	25,800	1,958.00	50,516,400	貸付株式数	500
ジャステック	6,400	729.00	4,665,600		
S C S K	24,000	2,781.00	66,744,000		
日本システムウエア	3,800	461.00	1,751,800		
アイネス	13,700	711.00	9,740,700	貸付株式数	900
T K C	8,500	2,050.00	17,425,000		
富士ソフト	12,800	2,197.00	28,121,600		
N S D	21,400	1,293.00	27,670,200		
コナミ	45,600	2,385.00	108,756,000	貸付株式数	1,800
福井コンピュータホールディングス	1,400	865.00	1,211,000		
J B C Cホールディングス	8,400	752.00	6,316,800	貸付株式数	1,900
ミロク情報サービス	6,500	415.00	2,697,500		
ソフトバンク	495,900	7,800.00	3,868,020,000		
ハウスイ	8,000	130.00	1,040,000	貸付株式数	3,000
高千穂交易	4,200	1,072.00	4,502,400	貸付株式数	1,800 (1,800)
伊藤忠食品	2,500	3,525.00	8,812,500		
エレマテック	4,700	1,786.00	8,394,200		
J A L U X	2,800	1,048.00	2,934,400	貸付株式数	1,300 (1,300)
あらた	23,000	340.00	7,820,000		
トーメンデバイス	1,500	1,748.00	2,622,000		
東京エレクトロン デバイス	2,000	1,352.00	2,704,000	貸付株式数	500
双日	675,900	176.00	118,958,400		
アルフレッサ ホールディングス	29,900	6,730.00	201,227,000		
横浜冷凍	25,000	859.00	21,475,000	貸付株式数	10,700
神栄	14,000	212.00	2,968,000		
山下医科器械	800	1,732.00	1,385,600		
ラサ商事	4,300	469.00	2,016,700		
アルコニックス	3,000	2,165.00	6,495,000		
神戸物産	1,000	3,000.00	3,000,000	貸付株式数	400
あい ホールディングス	16,200	1,820.00	29,484,000		
ダイワボウホールディングス	92,000	180.00	16,560,000		
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,000	779.00	14,801,000		
八洲電機	7,800	445.00	3,471,000		
U K Cホールディングス	6,500	1,781.00	11,576,500		
T O K A Iホールディングス	49,300	351.00	17,304,300		
三洋貿易	3,500	943.00	3,300,500	貸付株式数	800
ミタチ産業	2,300	540.00	1,242,000		
シップヘルスケアホールディングス	14,500	3,960.00	57,420,000		
スターティア	800	1,848.00	1,478,400		
富士興産	3,600	651.00	2,343,600		
協栄産業	12,000	179.00	2,148,000		
小野建	8,800	1,235.00	10,868,000		
佐島電機	8,000	656.00	5,248,000		
エコトレーディング	2,500	693.00	1,732,500	貸付株式数	1,000
伯東	6,100	967.00	5,898,700		
コンドーテック	8,200	718.00	5,887,600		
中山福	5,800	863.00	5,005,400		

ナガイレーベン	13,400	2,201.00	29,493,400		
三菱食品	11,100	2,339.00	25,962,900	貸付株式数	1,100
松田産業	7,300	1,245.00	9,088,500	貸付株式数	3,200
メディバルホールディングス	101,000	1,578.00	159,378,000		
アドヴァン	5,100	1,203.00	6,135,300		
S P K	2,300	1,874.00	4,310,200		
アズワン	6,600	2,816.00	18,585,600		
スズデン	3,600	648.00	2,332,800	貸付株式数	1,500 (1,500)
尾家産業	3,200	836.00	2,675,200		
シモジマ	6,900	1,067.00	7,362,300	貸付株式数	700
ドウシシャ	10,700	1,590.00	17,013,000	貸付株式数	700
高速	6,000	904.00	5,424,000		
黒田電気	14,600	1,671.00	24,396,600	貸付株式数	6,300 (1,200)
丸文	8,900	537.00	4,779,300		
ハビネット	6,100	862.00	5,258,200	貸付株式数	2,700 (2,700)
トーマンエレクトロニクス	5,100	1,645.00	8,389,500		
エクセル	4,600	1,132.00	5,207,200		
マルカキカイ	3,300	1,282.00	4,230,600		
ガリバーインターナショナル	34,000	801.00	27,234,000		
日本エム・ディ・エム	8,400	302.00	2,536,800		
進和	6,000	1,256.00	7,536,000		
エスケイジャパン	2,400	288.00	691,200	貸付株式数	1,100 (1,100)
ダイトエレクトロン	4,600	415.00	1,909,000		
シークス	6,400	1,690.00	10,816,000	貸付株式数	200
田中商事	3,100	573.00	1,776,300		
オーハシテクニカ	5,200	847.00	4,404,400	貸付株式数	2,300 (2,300)
マクニカ	5,200	3,055.00	15,886,000		
白銅	3,300	940.00	3,102,000		
伊藤忠商事	805,600	1,206.00	971,553,600		
丸紅	883,000	693.00	611,919,000		
高島	19,000	243.00	4,617,000	貸付株式数	4,000
長瀬産業	57,200	1,275.00	72,930,000		
蝶理	6,400	1,124.00	7,193,600		
豊田通商	112,500	2,620.00	294,750,000		
三共生興	17,200	375.00	6,450,000		
兼松	215,000	160.00	34,400,000		
ツカモトコーポレーション	18,000	137.00	2,466,000	貸付株式数	6,000
三井物産	929,800	1,459.00	1,356,578,200		
日本紙パルプ商事	52,000	350.00	18,200,000		
日立ハイテクノロジーズ	30,600	2,404.00	73,562,400		
カメイ	13,100	771.00	10,100,100		
東都水産	18,000	220.00	3,960,000		
OUGホールディングス	15,000	207.00	3,105,000		
スターゼン	36,000	276.00	9,936,000	貸付株式数	15,000
山善	38,800	681.00	26,422,800		
椿本興業	11,000	285.00	3,135,000		
住友商事	596,000	1,313.00	782,548,000		
内田洋行	23,000	291.00	6,693,000		
三菱商事	788,000	1,916.00	1,509,808,000		

第一実業	23,000	459.00	10,557,000		
キヤノンマーケティングジャパン	28,800	1,417.00	40,809,600		
西華産業	35,000	252.00	8,820,000		
佐藤商事	9,000	688.00	6,192,000		
菱洋エレクトロ	11,900	1,324.00	15,755,600		
東京産業	10,000	402.00	4,020,000		
ユアサ商事	103,000	211.00	21,733,000		
神鋼商事	25,000	211.00	5,275,000		
小林産業	6,700	314.00	2,103,800		
阪和興業	101,000	400.00	40,400,000		
カナデン	10,000	706.00	7,060,000		
菱電商事	15,000	703.00	10,545,000		
フルサト工業	5,600	1,088.00	6,092,800	貸付株式数	200
岩谷産業	112,000	674.00	75,488,000		
すてきなイスグループ	43,000	228.00	9,804,000		
昭光通商	32,000	143.00	4,576,000		
ニチモウ	16,000	188.00	3,008,000		
極東貿易	12,000	216.00	2,592,000		
イワキ	15,000	198.00	2,970,000		
三愛石油	24,000	632.00	15,168,000		
稲畑産業	24,800	1,052.00	26,089,600		
G S I クレオス	27,000	145.00	3,915,000	貸付株式数	8,000 (7,000)
明和産業	9,300	353.00	3,282,900		
ワキタ	15,000	1,205.00	18,075,000		
東邦ホールディングス	32,300	2,184.00	70,543,200		
サンゲツ	17,900	2,709.00	48,491,100		
ミツウロコグループホールディングス	16,200	602.00	9,752,400		
シナネン	22,000	395.00	8,690,000	貸付株式数	4,000
伊藤忠エネクス	22,300	593.00	13,223,900		
サンリオ	25,500	3,480.00	88,740,000	貸付株式数	11,300
サンワテクノス	5,400	869.00	4,692,600		
リョーサン	15,000	2,179.00	32,685,000		
新光商事	11,100	941.00	10,445,100		
トーホー	21,000	353.00	7,413,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
三信電気	12,100	691.00	8,361,100		
東陽テクニカ	13,900	1,062.00	14,761,800		
モスフードサービス	13,200	2,078.00	27,429,600	貸付株式数	5,700
加賀電子	9,100	1,425.00	12,967,500		
ソーダニッカ	10,000	443.00	4,430,000	貸付株式数	4,000 (4,000)
立花エレテック	6,200	1,393.00	8,636,600	貸付株式数	600 (600)
P a l t a c	14,100	1,177.00	16,595,700		
太平洋興発	37,000	99.00	3,663,000	貸付株式数	15,000 (12,000)
ヤマタネ	50,000	161.00	8,050,000		
丸紅建材リース	9,000	213.00	1,917,000		
日鉄住金物産	66,000	331.00	21,846,000	貸付株式数	28,000 (28,000)
トラスコ中山	11,500	2,382.00	27,393,000	貸付株式数	500
オートバックスセブン	35,400	1,590.00	56,286,000		
加藤産業	14,500	2,195.00	31,827,500		
イノテック	9,300	440.00	4,092,000		

イエローハット	8,700	2,062.00	17,939,400		
富士エレクトロニクス	5,200	1,265.00	6,578,000		
J Kホールディングス	9,100	556.00	5,059,600	貸付株式数	1,300 (1,200)
日伝	4,600	2,448.00	11,260,800	貸付株式数	2,100 (2,100)
北沢産業	8,500	180.00	1,530,000		
杉本商事	5,400	1,018.00	5,497,200	貸付株式数	2,300
因幡電機産業	13,900	3,320.00	46,148,000		
バイテック	3,400	771.00	2,621,400	貸付株式数	100
ミスミグループ本社	40,400	2,860.00	115,544,000	貸付株式数	4,300 (4,300)
江守商事	3,200	1,609.00	5,148,800	貸付株式数	200
アルテック	4,900	244.00	1,195,600	貸付株式数	2,300 (100)
タキヒヨー	17,000	414.00	7,038,000		
スズケン	41,800	3,995.00	166,991,000		
ジェコス	6,900	869.00	5,996,100		
ローソン	41,400	7,300.00	302,220,000		
サンエー	7,600	3,045.00	23,142,000		
キリン堂	3,600	634.00	2,282,400		
ダイユーエイト	2,000	638.00	1,276,000		
カワチ薬品	7,000	1,962.00	13,734,000		
エービーシー・マート	14,400	4,480.00	64,512,000		
ハードオフコーポレーション	4,900	819.00	4,013,100		
アスクル	10,400	3,250.00	33,800,000	貸付株式数	4,500
ゲオホールディングス	17,300	910.00	15,743,000	貸付株式数	1,200
アダストリアホールディングス	7,800	2,574.00	20,077,200	貸付株式数	100
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	13,000	184.00	2,392,000	貸付株式数	5,000
くらコーポレーション	5,900	2,068.00	12,201,200	貸付株式数	2,500 (100)
キャンドゥ	4,800	1,648.00	7,910,400	貸付株式数	2,100 (1,600)
バル	5,900	1,983.00	11,699,700		
エディオン	46,300	575.00	26,622,500	貸付株式数	20,100
サーラコーポレーション	8,700	519.00	4,515,300		
あみやき亭	1,700	2,996.00	5,093,200	貸付株式数	700 (700)
ひらまつ	10,400	672.00	6,988,800	貸付株式数	4,500
ゲンキー	1,000	2,370.00	2,370,000	貸付株式数	400 (400)
大黒天物産	2,400	2,840.00	6,816,000	貸付株式数	200
ハニーズ	7,980	999.00	7,972,020	貸付株式数	3,600 (1,400)
アルペン	9,000	1,864.00	16,776,000	貸付株式数	500
クオール	7,400	655.00	4,847,000	貸付株式数	3,200
ジェイアイエヌ	5,100	3,085.00	15,733,500	貸付株式数	2,400
ビックカメラ	38,300	622.00	23,822,600	貸付株式数	12,500 (1,400)
D C Mホールディングス	48,900	690.00	33,741,000		
MonotaRO	15,600	2,622.00	40,903,200	貸付株式数	6,800 (6,700)
J . フロント リテイリング	239,000	710.00	169,690,000		
ドトール・日レスホールディングス	17,700	1,817.00	32,160,900	貸付株式数	6,600
マツモトキヨシホールディングス	20,800	3,285.00	68,328,000	貸付株式数	9,000 (9,000)
ブロンコビリー	1,600	2,008.00	3,212,800	貸付株式数	600 (500)
スタートトゥデイ	31,400	2,643.00	82,990,200	貸付株式数	13,600
物語コーポレーション	1,900	3,240.00	6,156,000	貸付株式数	300 (300)
ココカラファイン	10,500	2,984.00	31,332,000		
三越伊勢丹ホールディングス	200,700	1,274.00	255,691,800		

ウエルシアホールディングス	3,800	5,810.00	22,078,000	貸付株式数	400
クリエイトSDホールディングス	4,200	3,490.00	14,658,000	貸付株式数	200
丸善CHIIホールディングス	8,800	345.00	3,036,000	貸付株式数	3,900 (2,500)
エー・ピーカンパニー	900	1,659.00	1,493,100	貸付株式数	300
ブックオフコーポレーション	5,600	711.00	3,981,600	貸付株式数	2,400 (1,600)
あさひ	5,800	1,397.00	8,102,600		
日本調剤	1,270	2,665.00	3,384,550	貸付株式数	580 (80)
コスモス薬品	5,700	12,060.00	68,742,000	貸付株式数	500 (500)
トーエル	5,400	619.00	3,342,600		
一六堂	1,600	451.00	721,600		
セブン&アイ・ホールディングス	422,400	3,944.00	1,665,945,600		
クリエイト・レストランツ・ホールディング	1,300	2,885.00	3,750,500	貸付株式数	500
ツルハホールディングス	9,900	10,150.00	100,485,000		
サンマルクホールディングス	3,300	5,080.00	16,764,000	貸付株式数	1,400
フェリシモ	2,900	997.00	2,891,300	貸付株式数	1,300 (1,300)
トリドール	8,700	981.00	8,534,700		
クスリのアオキ	1,700	6,660.00	11,322,000	貸付株式数	700
メディカルシステムネットワーク	8,300	467.00	3,876,100	貸付株式数	3,600 (1,100)
総合メディカル	2,400	4,140.00	9,936,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
はるやま商事	4,200	772.00	3,242,400		
カッパ・クリエイトホールディングス	14,800	985.00	14,578,000	貸付株式数	6,400
ライトオン	7,500	691.00	5,182,500		
ジーンズメイト	3,200	207.00	662,400	貸付株式数	1,400
良品計画	10,700	9,940.00	106,358,000		
三城ホールディングス	12,500	499.00	6,237,500		
コナカ	12,900	717.00	9,249,300		
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,356.00	1,491,600	貸付株式数	400
G-7ホールディングス	3,000	755.00	2,265,000		
イオン北海道	6,300	584.00	3,679,200		
コジマ	14,900	300.00	4,470,000	貸付株式数	5,900
ヒマラヤ	2,300	1,000.00	2,300,000	貸付株式数	1,000
コーナン商事	13,200	1,045.00	13,794,000	貸付株式数	5,900
エコス	3,400	665.00	2,261,000		
ワタミ	11,900	1,507.00	17,933,300	貸付株式数	5,400 (5,400)
マルシェ	2,400	819.00	1,965,600	貸付株式数	1,100
ドンキホーテホールディングス	34,800	5,330.00	185,484,000		
西松屋チェーン	19,900	749.00	14,905,100	貸付株式数	8,500 (8,400)
ゼンショーホールディングス	46,300	1,011.00	46,809,300	貸付株式数	19,900 (100)
幸楽苑	6,200	1,306.00	8,097,200	貸付株式数	2,600
ハークスレイ	2,800	774.00	2,167,200		
サイゼリヤ	14,900	1,281.00	19,086,900	貸付株式数	1,100
ポプラ	2,500	534.00	1,335,000		
ユナイテッドアローズ	13,200	3,820.00	50,424,000	貸付株式数	5,700
ハイデイ日高	6,400	2,088.00	13,363,200		
京都きもの友禅	6,700	1,013.00	6,787,100	貸付株式数	200
コロワイド	33,500	1,051.00	35,208,500	貸付株式数	15,500
壺番屋	4,100	4,255.00	17,445,500	貸付株式数	1,000
トップカルチャー	3,600	471.00	1,695,600	貸付株式数	1,600 (1,600)

PLANT	1,900	965.00	1,833,500		
スギホールディングス	18,100	4,585.00	82,988,500	貸付株式数	600 (600)
スクロール	13,100	275.00	3,602,500	貸付株式数	6,000 (6,000)
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,773.00	13,652,100	貸付株式数	500
ファミリーマート	34,100	4,535.00	154,643,500		
木曽路	12,300	1,890.00	23,247,000	貸付株式数	5,400 (4,500)
サトレストランシシステムズ	9,400	772.00	7,256,800	貸付株式数	4,000
千趣会	18,200	842.00	15,324,400		
タカキュー	7,800	230.00	1,794,000	貸付株式数	3,100 (3,000)
ケーヨー	17,000	468.00	7,956,000	貸付株式数	7,800
上新電機	22,000	825.00	18,150,000	貸付株式数	9,000 (9,000)
日本瓦斯	15,000	1,574.00	23,610,000		
ベスト電器	32,500	135.00	4,387,500	貸付株式数	14,100 (14,100)
マルエツ	20,000	368.00	7,360,000		
ロイヤルホールディングス	16,900	1,485.00	25,096,500	貸付株式数	1,400
東天紅	7,000	184.00	1,288,000		
いなげや	11,200	1,027.00	11,502,400		
島忠	22,900	2,250.00	51,525,000		
チヨダ	11,900	2,237.00	26,620,300		
ライフコーポレーション	7,600	1,570.00	11,932,000	貸付株式数	2,900 (2,900)
カスミ	20,700	698.00	14,448,600		
リンガーハット	9,800	1,478.00	14,484,400	貸付株式数	4,200 (300)
さが美	8,000	101.00	808,000		
M r M a x	10,100	339.00	3,423,900		
テンアライド	7,600	303.00	2,302,800	貸付株式数	3,400
A O K Iホールディングス	17,400	1,466.00	25,508,400		
オークワ	16,000	920.00	14,720,000		
コメリ	15,600	2,807.00	43,789,200		
青山商事	25,400	2,710.00	68,834,000		
しまむら	11,700	8,930.00	104,481,000	貸付株式数	3,500 (3,500)
C F Sコーポレーション	6,600	460.00	3,036,000		
はせがわ	3,500	687.00	2,404,500	貸付株式数	200 (200)
高島屋	137,000	968.00	132,616,000	貸付株式数	39,000
松屋	20,300	857.00	17,397,100	貸付株式数	9,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	59,000	823.00	48,557,000	貸付株式数	9,000
近鉄百貨店	39,000	373.00	14,547,000	貸付株式数	16,000
丸栄	17,000	162.00	2,754,000	貸付株式数	7,000
ニッセンホールディングス	20,200	420.00	8,484,000	貸付株式数	8,600 (5,900)
パルコ	9,700	879.00	8,526,300	貸付株式数	4,200
丸井グループ	131,600	885.00	116,466,000		
アクシアル リテイリング	5,600	1,594.00	8,926,400	貸付株式数	300
井筒屋	55,000	74.00	4,070,000	貸付株式数	22,000
ダイエー	62,300	340.00	21,182,000	貸付株式数	2,100
イズミヤ	38,000	518.00	19,684,000		
イオン	403,300	1,163.00	469,037,900	貸付株式数	5,200
ユニーグループ・ホールディングス	96,700	614.00	59,373,800	貸付株式数	4,300 (4,200)
イズミ	22,500	3,050.00	68,625,000		
東武ストア	13,000	263.00	3,419,000	貸付株式数	1,000
平和堂	20,500	1,451.00	29,745,500		

フジ	11,200	1,898.00	21,257,600	貸付株式数	5,100	(5,100)
ヤオコー	5,100	4,905.00	25,015,500	貸付株式数	100	
ゼビオ	12,200	1,795.00	21,899,000			
ケーズホールディングス	21,300	2,869.00	61,109,700			
Olympicグループ	5,900	846.00	4,991,400	貸付株式数	2,600	(2,600)
日産東京販売ホールディングス	15,000	365.00	5,475,000			
アインファーマシース	5,600	4,775.00	26,740,000			
元氣寿司	3,100	1,529.00	4,739,900	貸付株式数	1,300	
ヤマダ電機	399,200	344.00	137,324,800	貸付株式数	58,500	
アークランドサカモト	6,600	1,965.00	12,969,000			
ニトリホールディングス	40,000	4,475.00	179,000,000			
グルメ杵屋	7,000	724.00	5,068,000	貸付株式数	3,000	(2,000)
愛眼	8,000	275.00	2,200,000	貸付株式数	3,500	(3,500)
ケーユーホールディングス	2,100	1,194.00	2,507,400			
吉野家ホールディングス	27,400	1,316.00	36,058,400	貸付株式数	400	(200)
松屋フーズ	4,800	1,792.00	8,601,600	貸付株式数	2,200	
サガミチェーン	13,000	928.00	12,064,000	貸付株式数	3,000	(3,000)
関西スーパーマーケット	7,500	820.00	6,150,000	貸付株式数	1,100	
王将フードサービス	5,000	3,470.00	17,350,000			
ブレナス	11,300	2,399.00	27,108,700			
ミニストップ	7,500	1,669.00	12,517,500	貸付株式数	300	
アークス	17,200	2,014.00	34,640,800			
パロー	21,700	1,297.00	28,144,900			
藤久	800	1,631.00	1,304,800			
ベルク	5,000	1,958.00	9,790,000			
大庄	4,700	1,244.00	5,846,800	貸付株式数	900	
ファーストリテイリング	23,600	37,435.00	883,466,000	貸付株式数	700	
サンドラッグ	21,300	4,715.00	100,429,500			
東京デリカ	5,100	1,575.00	8,032,500	貸付株式数	1,400	
ヤマザワ	2,400	1,519.00	3,645,600			
やまや	2,100	2,031.00	4,265,100			
ペルーナ	25,200	512.00	12,902,400			
島根銀行	2,100	1,321.00	2,774,100	貸付株式数	700	
じもとホールディングス	72,500	217.00	15,732,500	貸付株式数	27,200	(27,200)
足利ホールディングス	39,700	459.00	18,222,300	貸付株式数	9,200	(9,200)
新生銀行	874,000	203.00	177,422,000	貸付株式数	54,000	(54,000)
あおぞら銀行	524,000	294.00	154,056,000			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,649,600	567.00	4,337,323,200			
りそなホールディングス	959,900	499.00	478,990,100			
三井住友トラスト・ホールディングス	1,984,000	466.00	924,544,000			
三井住友フィナンシャルグループ	763,700	4,409.00	3,367,153,300			
第四銀行	128,000	379.00	48,512,000			
北越銀行	110,000	216.00	23,760,000			
西日本シティ銀行	354,000	232.00	82,128,000			
千葉銀行	389,000	636.00	247,404,000			
横浜銀行	657,000	515.00	338,355,000			
常陽銀行	376,000	515.00	193,640,000			
群馬銀行	226,000	562.00	127,012,000			
武蔵野銀行	16,100	3,420.00	55,062,000			

千葉興業銀行	20,900	716.00	14,964,400		
筑波銀行	42,000	398.00	16,716,000	貸付株式数	6,600 (6,600)
東京都民銀行	17,800	1,069.00	19,028,200	貸付株式数	1,800
七十七銀行	158,000	464.00	73,312,000		
青森銀行	74,000	285.00	21,090,000	貸付株式数	32,000
秋田銀行	69,000	298.00	20,562,000		
山形銀行	61,000	439.00	26,779,000	貸付株式数	1,000
岩手銀行	6,600	4,985.00	32,901,000	貸付株式数	100
東邦銀行	90,000	336.00	30,240,000		
東北銀行	51,000	155.00	7,905,000		
みちのく銀行	54,000	213.00	11,502,000	貸付株式数	23,000
ふくおかフィナンシャルグループ	410,000	424.00	173,840,000		
静岡銀行	296,000	1,007.00	298,072,000		
十六銀行	127,000	360.00	45,720,000		
スルガ銀行	98,000	1,818.00	178,164,000	貸付株式数	7,000 (7,000)
八十二銀行	186,000	587.00	109,182,000		
山梨中央銀行	64,000	466.00	29,824,000		
大垣共立銀行	126,000	282.00	35,532,000		
福井銀行	86,000	254.00	21,844,000		
北國銀行	113,000	361.00	40,793,000		
清水銀行	3,400	2,680.00	9,112,000		
滋賀銀行	95,000	560.00	53,200,000		
南都銀行	99,000	389.00	38,511,000		
百五銀行	91,000	424.00	38,584,000		
京都銀行	193,000	852.00	164,436,000		
紀陽銀行	39,600	1,322.00	52,351,200		
三重銀行	42,000	231.00	9,702,000		
ほくほくフィナンシャルグループ	687,000	198.00	136,026,000		
広島銀行	298,000	431.00	128,438,000		
山陰合同銀行	62,000	698.00	43,276,000		
中国銀行	75,200	1,376.00	103,475,200		
鳥取銀行	32,000	186.00	5,952,000		
伊予銀行	108,000	986.00	106,488,000		
百十四銀行	111,000	354.00	39,294,000		
四国銀行	73,000	212.00	15,476,000		
阿波銀行	83,000	549.00	45,567,000		
鹿児島銀行	70,000	655.00	45,850,000		
大分銀行	63,000	401.00	25,263,000		
宮崎銀行	67,000	314.00	21,038,000		
肥後銀行	83,000	550.00	45,650,000		
佐賀銀行	61,000	224.00	13,664,000		
十八銀行	63,000	226.00	14,238,000		
沖縄銀行	7,500	4,355.00	32,662,500	貸付株式数	3,400 (3,400)
琉球銀行	19,600	1,373.00	26,910,800		
八千代銀行	4,800	2,822.00	13,545,600		
セブン銀行	378,400	405.00	153,252,000		
みずほフィナンシャルグループ	13,095,000	204.00	2,671,380,000		
高知銀行	39,000	157.00	6,123,000	貸付株式数	5,000
山口フィナンシャルグループ	101,000	930.00	93,930,000		

長野銀行	33,000	185.00	6,105,000	貸付株式数	14,000
名古屋銀行	91,000	403.00	36,673,000		
北洋銀行	152,100	419.00	63,729,900		
愛知銀行	3,700	5,320.00	19,684,000		
第三銀行	57,000	181.00	10,317,000	貸付株式数	8,000 (7,000)
中京銀行	41,000	181.00	7,421,000		
東日本銀行	44,000	254.00	11,176,000	貸付株式数	18,000 (18,000)
大光銀行	36,000	218.00	7,848,000		
愛媛銀行	59,000	221.00	13,039,000	貸付株式数	8,000 (8,000)
トマト銀行	39,000	180.00	7,020,000		
みなと銀行	91,000	180.00	16,380,000		
京葉銀行	83,000	440.00	36,520,000		
関西アーバン銀行	141,000	123.00	17,343,000		
栃木銀行	51,000	438.00	22,338,000	貸付株式数	6,000 (6,000)
北日本銀行	3,100	2,747.00	8,515,700		
東和銀行	122,000	101.00	12,322,000	貸付株式数	52,000 (52,000)
福島銀行	124,000	86.00	10,664,000		
大東銀行	65,000	113.00	7,345,000		
トモニホールディングス	77,500	429.00	33,247,500		
フィデアホールディングス	58,100	195.00	11,329,500		
池田泉州ホールディングス	75,800	471.00	35,701,800		
F P G	6,600	1,095.00	7,227,000	貸付株式数	2,900
S B Iホールディングス	121,300	1,244.00	150,897,200		
日本アジア投資	69,000	101.00	6,969,000	貸付株式数	29,000
ジャフコ	13,800	4,630.00	63,894,000	貸付株式数	3,000 (1,600)
大和証券グループ本社	1,000,000	898.00	898,000,000		
野村ホールディングス	2,064,500	662.00	1,366,699,000		
岡三証券グループ	79,000	869.00	68,651,000		
丸三証券	30,000	847.00	25,410,000		
東洋証券	41,000	353.00	14,473,000	貸付株式数	4,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	107,000	866.00	92,662,000		
光世証券	24,000	245.00	5,880,000	貸付株式数	11,000 (10,000)
水戸証券	29,000	447.00	12,963,000	貸付株式数	12,000
いちよし証券	19,800	1,379.00	27,304,200		
松井証券	51,300	1,048.00	53,762,400	貸付株式数	2,700
だいこう証券ビジネス	4,900	705.00	3,454,500		
マネックスグループ	109,700	401.00	43,989,700		
カブドットコム証券	39,200	489.00	19,168,800		
極東証券	12,500	1,726.00	21,575,000	貸付株式数	5,400 (1,200)
岩井コスモホールディングス	9,500	1,123.00	10,668,500		
マネーパートナーズグループ	7,700	242.00	1,863,400	貸付株式数	2,800
小林洋行	2,900	258.00	748,200		
N K S Jホールディングス	224,300	2,652.00	594,843,600		
M S & A D インシュアランスグループ ホール	301,800	2,364.00	713,455,200		
ソニーフィナンシャルホールディングス	96,700	1,690.00	163,423,000		
第一生命保険	508,300	1,500.00	762,450,000		
東京海上ホールディングス	391,200	3,098.00	1,211,937,600		

T & Dホールディングス	346,400	1,227.00	425,032,800		
全国保証	24,100	2,723.00	65,624,300		
クレディセゾン	82,500	2,053.00	169,372,500		
アクリーティブ	6,900	194.00	1,338,600	貸付株式数	2,900 (2,400)
芙蓉総合リース	10,600	3,705.00	39,273,000		
興銀リース	17,600	2,603.00	45,812,800	貸付株式数	7,600 (7,600)
東京センチュリーリース	23,700	2,889.00	68,469,300		
日本証券金融	44,300	598.00	26,491,400		
ポケットカード	10,100	567.00	5,726,700		
リコーリース	6,900	2,456.00	16,946,400	貸付株式数	3,000
イオンフィナンシャルサービス	58,800	2,327.00	136,827,600	貸付株式数	3,100 (3,100)
アコム	202,900	330.00	66,957,000	貸付株式数	88,300 (400)
ジャックス	61,000	434.00	26,474,000		
オリエントコーポレーション	225,600	208.00	46,924,800	貸付株式数	101,800
日立キャピタル	19,800	2,208.00	43,718,400		
アプラスフィナンシャル	36,300	120.00	4,356,000	貸付株式数	15,800
オリックス	626,600	1,453.00	910,449,800		
三菱UFJリース	256,100	506.00	129,586,600		
日本取引所グループ	148,300	2,518.00	373,419,400		
イー・ギャランティ	2,900	2,268.00	6,577,200	貸付株式数	1,300
アサックス	1,700	1,233.00	2,096,100	貸付株式数	400
NECキャピタルソリューション	3,400	2,151.00	7,313,400	貸付株式数	1,400 (200)
日本駐車場開発	109,600	109.00	11,946,400	貸付株式数	7,400
ヒューリック	170,400	1,414.00	240,945,600	貸付株式数	70,100 (22,400)
東京建物不動産販売	5,200	412.00	2,142,400	貸付株式数	2,400 (2,400)
三栄建築設計	3,000	813.00	2,439,000		
野村不動産ホールディングス	66,700	1,970.00	131,399,000		
プレサンスコーポレーション	1,800	2,676.00	4,816,800	貸付株式数	700
常和ホールディングス	3,500	3,405.00	11,917,500	貸付株式数	1,500
フージャースホールディングス	15,000	602.00	9,030,000	貸付株式数	6,500 (100)
オープンハウス	4,000	1,757.00	7,028,000	貸付株式数	400
東急不動産ホールディングス	223,900	770.00	172,403,000		
飯田グループホールディングス	44,200	1,429.00	63,161,800		
パーク24	53,000	1,962.00	103,986,000	貸付株式数	15,500 (15,500)
バラカ	2,500	741.00	1,852,500		
三井不動産	476,000	3,149.00	1,498,924,000		
三菱地所	707,000	2,446.00	1,729,322,000		
平和不動産	20,400	1,648.00	33,619,200		
東京建物	206,000	885.00	182,310,000		
ダイビル	29,700	1,100.00	32,670,000		
京阪神ビルディング	16,700	526.00	8,784,200	貸付株式数	200
住友不動産	242,000	4,042.00	978,164,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
大京	170,000	207.00	35,190,000	貸付株式数	39,000
テーオーシー	34,800	742.00	25,821,600	貸付株式数	1,000
東京楽天地	17,000	492.00	8,364,000		
レオパレス21	116,100	495.00	57,469,500		
フジ住宅	12,900	674.00	8,694,600		
空港施設	12,200	762.00	9,296,400		
明和地所	5,000	421.00	2,105,000	貸付株式数	2,100 (900)

住友不動産販売	7,300	3,255.00	23,761,500	貸付株式数	100
ゴールドクレスト	8,000	2,179.00	17,432,000		
日本エスリード	3,900	1,073.00	4,184,700	貸付株式数	1,700 (1,700)
日神不動産	13,400	384.00	5,145,600		
タカラレーベン	33,500	319.00	10,686,500	貸付株式数	14,600
サンヨーハウジング名古屋	5,200	988.00	5,137,600		
イオンモール	65,200	2,636.00	171,867,200	貸付株式数	10,300
ファースト住建	2,800	1,475.00	4,130,000		
トーセイ	13,800	694.00	9,577,200	貸付株式数	6,100
穴吹興産	7,000	326.00	2,282,000		
エヌ・ティ・ティ都市開発	62,700	972.00	60,944,400		
サンフロンティア不動産	9,500	1,424.00	13,528,000	貸付株式数	1,400
エフ・ジェー・ネクスト	4,000	563.00	2,252,000		
ランドビジネス	6,800	405.00	2,754,000	貸付株式数	2,900
グランディハウス	5,900	328.00	1,935,200		
日本空港ビルデング	34,900	2,681.00	93,566,900	貸付株式数	1,200
日本工営	36,000	515.00	18,540,000		
ネクスト	9,000	800.00	7,200,000	貸付株式数	3,900 (1,700)
日本M&Aセンター	16,500	2,764.00	45,606,000		
ノバレーゼ	2,700	990.00	2,673,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
アコーディア・ゴルフ	43,500	1,160.00	50,460,000		
タケエイ	7,400	970.00	7,178,000	貸付株式数	2,200
トラスト・テック	1,400	1,618.00	2,265,200		
パソナグループ	7,900	609.00	4,811,100	貸付株式数	1,400
CDS	1,600	954.00	1,526,400		
リンクアンドモチベーション	13,700	226.00	3,096,200	貸付株式数	17
GCAサヴィアン	6,400	889.00	5,689,600	貸付株式数	2,100
エス・エム・エス	6,000	2,014.00	12,084,000	貸付株式数	2,300
テンプホールディングス	23,400	2,738.00	64,069,200	貸付株式数	400
リニカル	2,100	906.00	1,902,600	貸付株式数	800
クックパッド	5,300	2,459.00	13,032,700	貸付株式数	2,300
エスクリ	3,700	894.00	3,307,800	貸付株式数	500
アイ・ケイ・ケイ	2,400	867.00	2,080,800	貸付株式数	800 (800)
学情	3,500	876.00	3,066,000	貸付株式数	1,600
スタジオアリス	4,400	1,301.00	5,724,400	貸付株式数	600
シミックホールディングス	4,100	1,726.00	7,076,600	貸付株式数	100
NECフィールドディング	1,700	1,567.00	2,663,900		
総合警備保障	38,900	2,164.00	84,179,600		
カカココム	64,800	1,679.00	108,799,200		
ルネサンス	4,800	819.00	3,931,200	貸付株式数	2,200
ディップ	1,800	1,835.00	3,303,000	貸付株式数	600 (600)
オプト	4,300	787.00	3,384,100	貸付株式数	1,800
新日本科学	8,800	1,049.00	9,231,200	貸付株式数	3,800 (700)
ツクイ	11,500	1,006.00	11,569,000		
総合臨床ホールディングス	3,100	542.00	1,680,200	貸付株式数	100
キャリアデザインセンター	2,200	1,200.00	2,640,000		
エムスリー	71,900	1,694.00	121,798,600		
ベストプライダル	6,200	600.00	3,720,000	貸付株式数	1,000 (400)
アウトソーシング	3,400	1,466.00	4,984,400	貸付株式数	1,400

ディー・エヌ・エー	57,500	1,864.00	107,180,000	貸付株式数	25,900	(1,000)
博報堂DYホールディングス	148,100	720.00	106,632,000			
ぐるなび	14,900	1,450.00	21,605,000			
一休	7,600	1,173.00	8,914,800	貸付株式数	33	(32)
ジャパンベストレスキューシステム	6,600	424.00	2,798,400	貸付株式数	30	
ジェイコムホールディングス	2,200	761.00	1,674,200	貸付株式数	800	(100)
P G Mホールディングス	15,100	995.00	15,024,500	貸付株式数	6,600	
W D Bホールディングス	1,000	1,299.00	1,299,000	貸付株式数	200	
バリューコマース	6,600	1,027.00	6,778,200	貸付株式数	2,800	(200)
J Pホールディングス	17,900	465.00	8,323,500	貸付株式数	7,800	(200)
イーピーエス	11,500	1,125.00	12,937,500	貸付株式数	3	
プレステージ・インターナショナル	7,200	1,047.00	7,538,400			
アミューズ	3,000	1,881.00	5,643,000			
ドリームインキュベータ	2,800	1,580.00	4,424,000	貸付株式数	12	
T A C	6,500	312.00	2,028,000			
ケネディクス	126,000	334.00	42,084,000	貸付株式数	50,800	
電通	100,800	3,915.00	394,632,000			
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,971.00	9,066,600			
びあ	3,100	1,862.00	5,772,200	貸付株式数	1,300	
イオンファンタジー	3,500	1,315.00	4,602,500	貸付株式数	1,400	
ネクシィーズ	3,800	1,085.00	4,123,000	貸付株式数	1,600	
みらかホールディングス	28,100	4,520.00	127,012,000			
アルプス技研	4,300	1,005.00	4,321,500	貸付株式数	1,800	
ダイオーズ	1,900	845.00	1,605,500			
日本空調サービス	5,200	699.00	3,634,800			
オリエンタルランド	28,900	15,700.00	453,730,000	貸付株式数	1,800	
ダスキン	28,900	1,979.00	57,193,100	貸付株式数	100	
明光ネットワークジャパン	10,600	1,106.00	11,723,600			
ファルコSDホールディングス	5,500	1,219.00	6,704,500			
秀英予備校	1,700	326.00	554,200			
田谷	1,600	740.00	1,184,000			
ラウンドワン	30,300	884.00	26,785,200	貸付株式数	600	
リゾートトラスト	36,100	1,597.00	57,651,700	貸付株式数	7,200	
ピー・エム・エル	7,000	3,875.00	27,125,000			
ワタベウェディング	3,500	680.00	2,380,000			
もしもしホットライン	19,900	948.00	18,865,200			
リソー教育	12,000	255.00	3,060,000	貸付株式数	5,500	(1,600)
早稲田アカデミー	1,600	837.00	1,339,200			
ユー・エス・エス	129,400	1,449.00	187,500,600			
東京個別指導学院	5,200	458.00	2,381,600	貸付株式数	1,300	
楽天	347,300	1,377.00	478,232,100			
テー・オー・ダブリュー	3,500	707.00	2,474,500	貸付株式数	1,400	
セントラルスポーツ	3,300	1,573.00	5,190,900	貸付株式数	1,500	
フルキャストホールディングス	9,800	288.00	2,822,400	貸付株式数	4,400	(3,900)
リゾートソリューション	9,000	235.00	2,115,000	貸付株式数	3,000	(1,000)
リブセンス	5,300	1,241.00	6,577,300	貸付株式数	2,300	(2,200)
ジャパンマテリアル	900	2,195.00	1,975,500			
E R Iホールディングス	1,900	1,098.00	2,086,200			
リロ・ホールディング	4,000	5,630.00	22,520,000			

	エイチ・アイ・エス	8,700	5,880.00	51,156,000		
	共立メンテナンス	5,300	3,480.00	18,444,000	貸付株式数	2,200
	イチネンホールディングス	11,200	782.00	8,758,400		
	建設技術研究所	6,300	1,215.00	7,654,500		
	スペース	5,200	1,010.00	5,252,000		
	燦ホールディングス	2,100	1,359.00	2,853,900		
	スバル興業	8,000	345.00	2,760,000		
	東京テアトル	41,000	146.00	5,986,000	貸付株式数	17,000
	よみうりランド	21,000	474.00	9,954,000	貸付株式数	9,000
	東京都競馬	82,000	308.00	25,256,000	貸付株式数	35,000 (30,000)
	常磐興産	36,000	142.00	5,112,000	貸付株式数	1,000
	カナモト	13,600	3,020.00	41,072,000		
	東京ドーム	79,000	530.00	41,870,000		
	西尾レントオール	5,800	3,830.00	22,214,000		
	トランス・コスモス	14,000	2,132.00	29,848,000		
	乃村工藝社	20,900	805.00	16,824,500		
	藤田観光	27,000	332.00	8,964,000	貸付株式数	11,000 (3,000)
	日本管財	4,600	2,073.00	9,535,800	貸付株式数	100
	トーカイ	4,700	2,942.00	13,827,400		
	白洋舎	11,000	236.00	2,596,000	貸付株式数	1,000 (1,000)
	セコム	111,200	5,946.00	661,195,200	貸付株式数	600 (600)
	セントラル警備保障	4,700	1,053.00	4,949,100		
	丹青社	13,300	464.00	6,171,200		
	メイテック	14,700	2,930.00	43,071,000		
	アサツー ディ・ケイ	18,700	2,133.00	39,887,100		
	応用地質	10,200	1,406.00	14,341,200		
	船井総合研究所	10,900	811.00	8,839,900	貸付株式数	3,200 (3,200)
	進学会	4,500	393.00	1,768,500		
	ベネッセホールディングス	35,800	3,945.00	141,231,000	貸付株式数	8,000 (4,400)
	イオンディライト	10,300	1,943.00	20,012,900	貸付株式数	800 (800)
	ナック	5,400	1,615.00	8,721,000		
	ニチイ学館	23,200	959.00	22,248,800	貸付株式数	2,700
	ダイセキ	15,800	1,780.00	28,124,000	貸付株式数	800
	ステップ	3,200	733.00	2,345,600		
計	銘柄数：1,771			174,758,180,170		
	組入時価比率：98.2%			100.0%		
合計				174,758,180,170		

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

(注2)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26年3月31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26年3月31日現在			評価損益(円)
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 株価指数先物取引 買建	3,022,605,000	-	3,055,620,000	32,865,648
合計	3,022,605,000	-	3,055,620,000	32,865,648

(注)時価の算定方法

国内先物取引について
先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成26年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,356,486,140
コール・ローン	974,205,240
株式	260,918,197,919
投資信託受益証券	30,942,383
投資証券	5,618,241,721
派生商品評価勘定	49,755,042
未収入金	41,193,146
未収配当金	502,333,837
未収利息	1,157
差入委託証拠金	790,860,107
流動資産合計	270,282,216,692
資産合計	270,282,216,692
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	739,200
未払解約金	164,568,436
その他未払費用	2,721,700
流動負債合計	168,029,336
負債合計	168,029,336
純資産の部	
元本等	
元本	152,198,514,460
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	117,915,672,896
元本等合計	270,114,187,356
純資産合計	270,114,187,356
負債純資産合計	270,282,216,692

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 3月31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	1,7747円
(10,000口当たり純資産額)	(17,747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25年 4月 2日 至 平成26年 3月31日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成26年 3月31日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2.時価の算定方法	
株式	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
投資信託受益証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成26年 3月31日現在	
期首	平成25年 4月 2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	183,169,796,484円
同期中における追加設定元本額	17,277,534,422円
同期中における一部解約元本額	48,248,816,446円
期末元本額	152,198,514,460円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	68,527,607円
バランスセレクト50	229,958,522円

バランスセレクト70	207,358,474円
野村外国株式インデックスファンド	605,674,071円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,290,407,898円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	14,520,914,880円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	8,110,994,108円
野村資産設計ファンド2015	87,223,182円
野村資産設計ファンド2020	65,877,337円
野村資産設計ファンド2025	70,957,498円
野村資産設計ファンド2030	64,494,713円
野村資産設計ファンド2035	49,602,368円
野村資産設計ファンド2040	192,759,489円
野村外国株インデックス（野村投資一任口座向け）	1,401,450,743円
のむらップ・ファンド（保守型）	447,699,028円
のむらップ・ファンド（普通型）	1,713,422,485円
のむらップ・ファンド（積極型）	2,274,570,019円
野村資産設計ファンド2045	7,847,593円
野村インデックスファンド・外国株式	828,530,088円
マイ・ロード	1,100,669,528円
ネクストコア	48,136,231円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	11,494,191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）	3,003,225,217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）	846,883,868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）	17,224,449,074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）	7,666,175,435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）	12,745,464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）	45,004,976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）	50,948,135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）	193,242,749円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	2,110,611,998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）	669,998,738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）	418,352,544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）	31,570,841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）	347,111,862円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	6,255,191,166円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	799,260,507円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,800,176円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	15,641,447円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	12,341,293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）	54,700,542,167円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,160,716,432円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	4,645,403,962円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	5,423,293,627円
マイバランスDC30	563,182,729円
マイバランスDC50	903,737,791円
マイバランスDC70	644,617,476円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I	9,004,847,422円
野村DC運用戦略ファンド	47,999,078円
野村DC運用戦略ファンドM	48,233円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成26年 3月31日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES	39,500	65.27	2,578,165.00	
		CAMERON INTERNATIONAL CORP	21,700	61.46	1,333,682.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	4,180	199.60	834,328.00	
		DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,500	47.92	311,480.00	
		ENSCO PLC-CL A	21,200	52.89	1,121,268.00	
		FMC TECHNOLOGIES INC	20,800	52.41	1,090,128.00	
		HALLIBURTON CO	75,800	59.46	4,507,068.00	
		HELMERICH & PAYNE	9,700	107.70	1,044,690.00	
		NABORS INDUSTRIES INC	25,000	24.78	619,500.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	37,600	77.67	2,920,392.00	
		NOBLE CORP PLC	23,300	32.47	756,551.00	
		OCEANEERING INTL INC	9,400	71.94	676,236.00	
		ROWAN COMPANIES INC	11,100	33.38	370,518.00	
		SCHLUMBERGER LTD	115,900	97.57	11,308,363.00	
		SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	13,200	30.23	399,036.00	
		WEATHERFORD INTL LTD	66,400	17.36	1,152,704.00	
		ANADARKO PETE	44,300	84.94	3,762,842.00	
		APACHE CORPORATION	35,000	83.02	2,905,700.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	36,700	33.84	1,241,928.00	
		CHENIERE ENERGY INC	17,600	54.87	965,712.00	
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	46,300	25.67	1,188,521.00	
		CHEVRON CORP	169,500	118.50	20,085,750.00	
		CIMAREX ENERGY CO	7,900	119.75	946,025.00	
		COBALT INTERNATIONAL ENERGY	27,200	18.49	502,928.00	
CONCHO RESOURCES INC	9,400	124.35	1,168,890.00			
CONOCOPHILLIPS	102,300	70.35	7,196,805.00			

CONSOL ENERGY INC	19,800	39.75	787,050.00	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,000	125.67	502,680.00	
DENBURY RESOURCES INC	31,300	16.67	521,771.00	
DEVON ENERGY CORP	34,300	65.79	2,256,597.00	
ENERGEN CORP	6,800	81.07	551,276.00	
EOG RESOURCES INC	23,950	197.16	4,721,982.00	
EQT CORP	13,300	98.53	1,310,449.00	
EXXON MOBIL CORP	385,200	97.70	37,634,040.00	
HESS CORP	26,500	83.22	2,205,330.00	
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	47.45	787,670.00	
KINDER MORGAN INC	59,400	32.14	1,909,116.00	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	9,943	71.06	706,549.58	
MARATHON OIL CORP	60,700	35.22	2,137,854.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	26,300	87.67	2,305,721.00	
MURPHY OIL CORP	15,900	62.75	997,725.00	
NOBLE ENERGY INC	31,700	71.14	2,255,138.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	70,800	95.55	6,764,940.00	
ONEOK INC	18,300	58.49	1,070,367.00	
PEABODY ENERGY CO	24,500	16.12	394,940.00	
PHILLIPS 66	49,900	76.65	3,824,835.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,410	188.85	2,343,628.50	
QEP RESOURCES INC	17,000	29.71	505,070.00	
RANGE RESOURCES CORP	14,300	85.23	1,218,789.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	31,200	45.81	1,429,272.00	
SPECTRA ENERGY CORP	59,500	36.82	2,190,790.00	
TESORO CORP	11,800	50.50	595,900.00	
VALERO ENERGY CORP	47,900	52.86	2,531,994.00	
WHITING PETROLEUM CORP	10,300	70.06	721,618.00	
WILLIAMS COS	60,800	40.92	2,487,936.00	
AIR PRODUCTS	18,600	117.30	2,181,780.00	
AIRGAS INC	5,900	105.90	624,810.00	
ALBEMARLE CORP	7,000	65.10	455,700.00	
ASHLAND INC	6,300	98.09	617,967.00	
CELANESE CORP-SERIES A	13,900	53.94	749,766.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,080	257.79	1,309,573.20	

DOW CHEM CO	106,500	48.20	5,133,300.00
DU PONT E I DE NEMOURS	81,300	66.62	5,416,206.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	13,600	85.60	1,164,160.00
ECOLAB INC	24,200	106.23	2,570,766.00
FMC CORP	11,800	76.45	902,110.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	7,500	94.14	706,050.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	41,200	88.38	3,641,256.00
MONSANTO CO	46,200	112.32	5,189,184.00
MOSAIC CO/THE	25,800	49.17	1,268,586.00
PPG INDUSTRIES	12,730	190.81	2,429,011.30
PRAXAIR INC	26,000	129.34	3,362,840.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,470	194.69	1,454,334.30
SIGMA-ALDRICH	10,700	92.37	988,359.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,000	126.95	507,800.00
VULCAN MATERIALS CO	11,800	66.39	783,402.00
AVERY DENNISON CORP	8,300	49.98	414,834.00
BALL CORP	11,900	53.97	642,243.00
CROWN HOLDINGS INC	12,700	43.87	557,149.00
MEADWESTVACO CORP	15,300	37.24	569,772.00
OWENS-ILLINOIS INC	14,000	32.90	460,600.00
ROCK-TENN COMPANY CL-A	6,600	102.74	678,084.00
SEALED AIR CORP	16,000	31.53	504,480.00
ALCOA INC	92,000	12.48	1,148,160.00
FREEMONT-MCMORAN COPPER & GOLD	91,300	32.86	3,000,118.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	45,400	23.92	1,085,968.00
NUCOR CORP	28,000	50.06	1,401,680.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	37,600	45.80	1,722,080.00
B/E AEROSPACE INC	9,000	85.64	770,760.00
BOEING CO	62,780	124.46	7,813,598.80
GENERAL DYNAMICS	26,500	107.70	2,854,050.00
HONEYWELL INTERNATIONAL	65,500	90.89	5,953,295.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	8,200	117.41	962,762.00
LOCKHEED MARTIN	23,860	160.54	3,830,484.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	18,400	121.81	2,241,304.00

PRECISION CASTPARTS CORP	12,710	247.58	3,146,741.80
RAYTHEON COMPANY	27,900	98.65	2,752,335.00
ROCKWELL COLLINS INC	11,200	79.01	884,912.00
TEXTRON INC	25,000	38.53	963,250.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,350	183.86	799,791.00
UNITED TECHNOLOGIES	76,700	114.81	8,805,927.00
MASCO CORP	31,000	22.04	683,240.00
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	8,400	85.06	714,504.00
FLUOR CORP	14,700	76.41	1,123,227.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,000	63.12	757,440.00
KBR INC	12,300	26.61	327,303.00
QUANTA SERVICES INC	18,600	36.86	685,596.00
AMETEK INC	21,300	51.33	1,093,329.00
EATON CORP PLC	42,500	74.23	3,154,775.00
EMERSON ELEC	61,700	66.76	4,119,092.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,600	124.25	1,565,550.00
ROPER INDUSTRIES	8,670	132.78	1,151,202.60
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,100	42.53	514,613.00
3M CORP	56,240	134.20	7,547,408.00
DANAHER CORP	52,500	73.87	3,878,175.00
GENERAL ELEC CO	891,600	25.88	23,074,608.00
AGCO CORP	8,600	54.07	465,002.00
CATERPILLAR INC DEL	55,900	99.39	5,555,901.00
CUMMINS INC	16,040	146.00	2,341,840.00
DEERE & COMPANY	32,700	88.75	2,902,125.00
DOVER CORP	15,100	80.99	1,222,949.00
FLOWSERVE CORP	12,300	76.13	936,399.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	36,900	80.76	2,980,044.00
INGERSOLL-RAND PLC	26,000	56.54	1,470,040.00
JOY GLOBAL INC	9,100	57.96	527,436.00
PACCAR	31,700	66.56	2,109,952.00
PALL CORP	9,700	88.54	858,838.00
PARKER HANNIFIN CORP	13,200	119.24	1,573,968.00
PENTAIR LTD	17,400	77.66	1,351,284.00
SPX CORP	3,800	96.78	367,764.00

STANLEY BLACK & DECKER INC	12,700	80.69	1,024,763.00
XYLEM INC	17,400	36.00	626,400.00
FASTENAL CO	24,900	48.98	1,219,602.00
GRAINGER(W.W.) INC	5,330	249.45	1,329,568.50
ADT CORP/THE	17,500	29.68	519,400.00
CINTAS CORP	9,500	58.99	560,405.00
IRON MOUNTAIN INC	12,300	27.09	333,207.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	25,500	33.66	858,330.00
STERICYCLE INC	7,500	111.99	839,925.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	40,400	41.81	1,689,124.00
WASTE MANAGEMENT INC	39,600	41.15	1,629,540.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,700	50.89	697,193.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	18,700	39.21	733,227.00
FEDEX CORPORATION	26,460	132.01	3,492,984.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	62,900	97.34	6,122,686.00
DELTA AIR LINES INC	20,200	33.53	677,306.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	23.16	354,348.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	8,600	42.96	369,456.00
CSX CORP	90,800	28.58	2,595,064.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	38,700	25.88	1,001,556.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,000	69.97	559,760.00
KANSAS CITY SOUTHERN	9,800	99.61	976,178.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	27,800	96.35	2,678,530.00
UNION PAC CORP	40,490	184.75	7,480,527.50
AUTOLIV INC	8,700	98.80	859,560.00
BORGWARNER INC	20,800	60.02	1,248,416.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	26,300	66.74	1,755,262.00
JOHNSON CONTROLS INC	60,200	46.55	2,802,310.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	10,800	79.71	860,868.00
FORD MOTOR COMPANY	323,000	15.45	4,990,350.00
GENERAL MOTORS CO	107,000	34.73	3,716,110.00
HARLEY-DAVIDSON INC	19,300	66.17	1,277,081.00
TESLA MOTORS INC	7,640	212.37	1,622,506.80
DR HORTON INC	25,400	21.67	550,418.00

GARMIN LTD	10,200	55.57	566,814.00
LEGETT & PLATT INC	12,300	32.23	396,429.00
LENNAR CORP-A	15,200	39.58	601,616.00
MOHAWK INDUSTRIES	5,410	134.73	728,889.30
NEWELL RUBBERMAID INC	26,000	29.18	758,680.00
PULTEGROUP INC	29,500	19.01	560,795.00
TOLL BROTHERS INC	13,500	35.72	482,220.00
WHIRLPOOL CORP	6,870	146.75	1,008,172.50
HASBRO INC	10,700	55.18	590,426.00
MATTEL INC	30,000	39.95	1,198,500.00
POLARIS INDUSTRIES INC	5,620	138.07	775,953.40
COACH INC	24,600	49.67	1,221,882.00
FOSSIL GROUP INC	4,700	116.94	549,618.00
LULULEMON ATHLETICA INC	8,900	51.89	461,821.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,800	92.75	1,558,200.00
NIKE INC-B	62,500	73.54	4,596,250.00
PVH CORP	7,160	123.81	886,479.60
RALPH LAUREN CORPORATION	5,230	158.24	827,595.20
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,200	115.22	829,584.00
V F CORP	31,240	61.37	1,917,198.80
CARNIVAL CORP	34,800	37.24	1,295,952.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,790	567.17	1,582,404.30
DARDEN RESTAURANTS INC	11,300	50.62	572,006.00
INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY	23,900	13.72	327,908.00
LAS VEGAS SANDS CORP	35,800	78.25	2,801,350.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	21,300	55.44	1,180,872.00
MCDONALD'S CORP	87,500	97.24	8,508,500.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,600	24.88	835,968.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,200	53.54	706,728.00
STARBUCKS CORP	66,100	73.70	4,871,570.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	17,200	78.45	1,349,340.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,600	72.67	842,972.00
WYNN RESORTS LTD	7,270	217.51	1,581,297.70
YUM BRANDS INC	39,200	74.20	2,908,640.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	16,700	16.72	279,224.00

CBS CORP-CL B	49,100	62.03	3,045,673.00
CHARTER COMMUNICATION-A	5,500	122.41	673,255.00
COMCAST CORP SPECIAL CL-A	40,900	48.37	1,978,333.00
COMCAST CORP-CL A	188,000	49.56	9,317,280.00
DIRECTV	43,700	75.72	3,308,964.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	13,300	82.34	1,095,122.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	7,700	76.50	589,050.00
DISH NETWORK CORP-A	18,800	61.80	1,161,840.00
DISNEY (WALT) CO	147,000	78.99	11,611,530.00
INTERPUBRIC GROUP	38,700	17.04	659,448.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	48,200	40.44	1,949,208.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	18,600	41.29	767,994.00
LIBERTY MEDIA CORP	8,170	129.47	1,057,769.90
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	33,600	17.03	572,208.00
OMNICOM GROUP	22,800	72.31	1,648,668.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,700	75.73	583,121.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	275,000	3.15	867,625.00
TIME WARNER CABLE-A	25,160	135.87	3,418,489.20
TIME WARNER INC	79,400	64.65	5,133,210.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	130,100	31.61	4,112,461.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	37,900	30.72	1,164,288.00
VIACOM INC-CLASS B	34,500	84.69	2,921,805.00
GENUINE PARTS CO	13,700	85.23	1,167,651.00
LKQ CORP	26,300	25.89	680,907.00
AMAZON.COM INC	32,240	338.29	10,906,469.60
EXPEDIA INC	9,900	72.21	714,879.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP	42,700	28.62	1,222,074.00
NETFLIX INC	4,780	358.87	1,715,398.60
PRICELINE.COM INC	4,520	1,192.01	5,387,885.20
TRIPADVISOR INC	10,300	90.05	927,515.00
DOLLAR GENERAL CORP	27,600	55.40	1,529,040.00
DOLLAR TREE INC	17,900	52.15	933,485.00
FAMILY DOLLAR STORES	9,000	57.76	519,840.00
KOHL'S CORP	19,200	57.00	1,094,400.00

MACYS INC	33,300	58.92	1,962,036.00
NORDSTROM INC	13,500	61.83	834,705.00
SEARS HOLDINGS CORP	3,800	46.61	177,118.00
TARGET CORP	52,800	59.98	3,166,944.00
ADVANCE AUTO PARTS	6,600	124.65	822,690.00
AUTOZONE	3,100	527.44	1,635,064.00
BED BATH & BEYOND	19,400	68.43	1,327,542.00
BEST BUY COMPANY INC	24,900	26.07	649,143.00
CARMAX INC	19,800	45.67	904,266.00
DICK S SPORTING GOODS INC	9,100	55.60	505,960.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	11,000	40.62	446,820.00
GAP INC	21,200	40.17	851,604.00
HOME DEPOT	123,900	78.72	9,753,408.00
L BRANDS, INC	21,900	56.55	1,238,445.00
LOWES COS INC	92,100	48.92	4,505,532.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,600	147.96	1,420,416.00
PETSMART	8,700	68.49	595,863.00
ROSS STORES INC	19,400	72.10	1,398,740.00
STAPLES INC	60,200	11.37	684,474.00
TIFFANY & CO	11,200	85.05	952,560.00
TJX COS INC	62,700	60.10	3,768,270.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12,800	70.77	905,856.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,700	97.89	557,973.00
URBAN OUTFITTERS INC	10,700	36.36	389,052.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	38,300	111.66	4,276,578.00
CVS CAREMARK CORP	104,700	74.26	7,775,022.00
KROGER CO	44,100	43.95	1,938,195.00
SAFEWAY INC	20,400	37.30	760,920.00
SYSCO CORP	50,600	35.98	1,820,588.00
WAL-MART STORES INC	143,300	76.01	10,892,233.00
WALGREEN	80,400	65.36	5,254,944.00
WHOLE FOODS MARKET INC	30,900	51.15	1,580,535.00
BEAM INC	13,200	83.28	1,099,296.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	10,700	88.96	951,872.00
COCA COLA CO	350,000	38.95	13,632,500.00

COCA COLA ENTERPRISES	21,800	46.85	1,021,330.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,800	83.21	1,231,508.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,500	53.95	944,125.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	13,500	58.08	784,080.00
MONSTER BEVERAGE CORP	12,200	69.49	847,778.00
PEPSICO INC	135,000	82.95	11,198,250.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	58,800	43.21	2,540,748.00
BUNGE LIMITED	12,800	78.98	1,010,944.00
CAMPBELL SOUP CO	18,300	44.56	815,448.00
CONAGRA INC	37,700	30.69	1,157,013.00
GENERAL MILLS	55,400	51.30	2,842,020.00
HERSHEY CO/THE	13,500	103.24	1,393,740.00
HORMEL FOODS CORP	13,200	48.40	638,880.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,300	96.48	897,264.00
KELLOGG CO	22,300	62.13	1,385,499.00
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	11,300	108.15	1,222,095.00
KRAFT FOODS GROUP INC	52,400	55.70	2,918,680.00
MCCORMICK & CO INC.	11,100	71.32	791,652.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	18,300	83.00	1,518,900.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	146,200	34.40	5,029,280.00
TYSON FOODS INC-CL A	24,300	43.15	1,048,545.00
ALTRIA GROUP INC	175,700	37.12	6,521,984.00
LORILLARD INC	33,400	53.35	1,781,890.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	141,000	81.02	11,423,820.00
REYNOLDS AMERICAN INC	28,700	53.02	1,521,674.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,700	68.11	864,997.00
CLOROX CO	11,600	88.09	1,021,844.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	81,200	64.10	5,204,920.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,500	99.27	545,985.00
KIMBERLY-CLARK CORP	33,400	109.82	3,667,988.00
PROCTER & GAMBLE CO	239,500	79.76	19,102,520.00
AVON PRODUCTS INC	40,000	14.36	574,400.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,000	66.73	1,401,330.00
HERBALIFE LTD	8,000	55.65	445,200.00
ABBOTT LABORATORIES	135,800	38.31	5,202,498.00

BARD (C R)	6,900	145.50	1,003,950.00
BAXTER INTERNATIONAL INC.	47,500	72.85	3,460,375.00
BECTON,DICKINSON	17,400	115.54	2,010,396.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	121,400	13.20	1,602,480.00
CAREFUSION CORP	18,700	39.47	738,089.00
COVIDIEN PLC	40,400	72.50	2,929,000.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	12,400	45.49	564,076.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,600	71.16	683,136.00
HOLOGIC INC	24,100	21.01	506,341.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,300	434.99	1,435,467.00
MEDTRONIC INC	87,600	60.41	5,291,916.00
RESMED INC	12,200	43.89	535,458.00
ST JUDE MEDICAL INC	26,000	64.78	1,684,280.00
STRYKER CORP	26,900	80.54	2,166,526.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,700	82.49	800,153.00
ZIMMER HOLDINGS INC	14,700	93.71	1,377,537.00
AETNA INC	32,100	74.10	2,378,610.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	20,600	64.82	1,335,292.00
CARDINAL HEALTH INC	30,400	69.68	2,118,272.00
CIGNA CORP	24,100	79.41	1,913,781.00
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	16,100	68.45	1,102,045.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	70,700	75.52	5,339,264.00
HCA HOLDINGS INC	27,200	51.14	1,391,008.00
HENRY SCHEIN INC	7,500	117.76	883,200.00
HUMANA INC	13,600	113.08	1,537,888.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,900	98.04	774,516.00
MCKESSON CORP	20,500	175.42	3,596,110.00
OMNICARE INC	9,700	58.76	569,972.00
PATTERSON COS INC	7,500	41.03	307,725.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,300	57.80	768,740.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	88,500	81.62	7,223,370.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,900	79.70	629,630.00
WELLPOINT INC	26,400	99.39	2,623,896.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,500	149.42	2,614,850.00

AMGEN INC	66,300	120.55	7,992,465.00
BIOGEN IDEC INC	20,770	294.12	6,108,872.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,500	66.26	828,250.00
CELGENE CORP	36,200	139.29	5,042,298.00
GILEAD SCIENCES INC	135,000	68.55	9,254,250.00
PHARMACYCLICS INC	5,400	100.49	542,646.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,980	300.09	2,094,628.20
VERTEX PHARMACEUTICALS	21,000	67.80	1,423,800.00
ABBVIE INC	139,900	50.98	7,132,102.00
ACTAVIS PLC	15,460	203.77	3,150,284.20
ALLERGAN INC	26,000	121.05	3,147,300.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	144,800	51.82	7,503,536.00
ELI LILLY & CO.	89,000	57.61	5,127,290.00
FOREST LABS INC.	21,500	91.54	1,968,110.00
HOSPIRA INC	14,800	42.59	630,332.00
JOHNSON & JOHNSON	248,700	97.44	24,233,328.00
MERCK & CO INC	257,300	55.98	14,403,654.00
MYLAN INC	33,800	48.83	1,650,454.00
PERRIGO CO PLC	12,070	153.16	1,848,641.20
PFIZER INC	571,000	31.88	18,203,480.00
ZOETIS INC	45,100	29.01	1,308,351.00
BANK OF AMERICA CORP	939,500	16.98	15,952,710.00
BB&T CORPORATION	62,200	39.83	2,477,426.00
CIT GROUP INC	16,400	48.84	800,976.00
CITIGROUP	267,100	47.25	12,620,475.00
COMERICA INC	15,900	51.09	812,331.00
FIFTH THIRD BANCORP	76,000	22.72	1,726,720.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,100	53.75	435,375.00
JPMORGAN CHASE & CO	331,200	60.04	19,885,248.00
KEYCORP	83,000	14.14	1,173,620.00
M & T BANK CORP	10,200	120.44	1,228,488.00
PNC FINANCIAL	47,200	85.73	4,046,456.00
REGIONS FINANCIAL CORP	124,000	10.95	1,357,800.00
SUNTRUST BKS INC.	48,100	39.03	1,877,343.00
US BANCORP	160,500	42.30	6,789,150.00

WELLS FARGO CO	441,000	49.29	21,736,890.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	97,800	123.53	12,081,234.00
CME GROUP INC	28,300	73.83	2,089,389.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	10,100	196.17	1,981,317.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	27,200	27.28	742,016.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	23,200	75.01	1,740,232.00
MOODYS CORP	17,700	77.57	1,372,989.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	10,100	36.72	370,872.00
ACE LTD	29,900	97.89	2,926,911.00
AFLAC INC	41,800	62.66	2,619,188.00
ALLEGHANY CORP	1,410	400.19	564,267.90
ALLSTATE CORP	39,700	55.80	2,215,260.00
AMERICAN INTL GROUP	122,900	49.88	6,130,252.00
AON PLC	25,800	82.62	2,131,596.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,400	56.93	649,002.00
ASSURANT INC	6,900	63.82	440,358.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,400	45.44	427,136.00
CHUBB CORP	21,900	88.14	1,930,266.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,700	48.25	661,025.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,250	149.67	636,097.50
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	21,100	31.14	657,054.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	37,900	34.88	1,321,952.00
LINCOLN NATIONAL CORP	23,500	49.91	1,172,885.00
LOEWS CORP	29,100	43.42	1,263,522.00
MARSH & MCLENNAN COS	48,600	48.59	2,361,474.00
METLIFE INC	83,600	52.56	4,394,016.00
PARTNERRE LTD	4,200	101.49	426,258.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,200	45.81	1,200,222.00
PROGRESSIVE CO	50,100	23.98	1,201,398.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40,400	83.59	3,377,036.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,000	97.02	388,080.00
TORCHMARK CORP	8,400	77.35	649,740.00
TRAVELERS COS INC/THE	31,800	83.99	2,670,882.00
UNUM GROUP	22,800	34.44	785,232.00
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	15,100	42.73	645,223.00

WR BERKLEY CORP	9,800	40.95	401,310.00
XL GROUP PLC	25,900	30.62	793,058.00
CBRE GROUP INC	23,800	26.85	639,030.00
REALOGY HOLDINGS CORP	13,000	43.93	571,090.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,400	58.24	896,896.00
EBAY INC	102,300	55.19	5,645,937.00
EQUINIX INC	4,500	184.02	828,090.00
FACEBOOK INC-A	162,400	60.01	9,745,624.00
GOOGLE INC-CL A	24,420	1,120.15	27,354,063.00
LINKEDIN CORP - A	8,820	190.59	1,681,003.80
RACKSPACE HOSTING INC	11,000	31.26	343,860.00
VERISIGN INC	12,600	53.49	673,974.00
YAHOO! INC	84,300	35.90	3,026,370.00
ACCENTURE PLC-CL A	55,800	78.81	4,397,598.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,320	274.23	1,184,673.60
AUTOMATIC DATA PROCESS	42,100	76.95	3,239,595.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	53,800	49.69	2,673,322.00
COMPUTER SCIENCE	12,900	60.29	777,741.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	25,400	52.89	1,343,406.00
FISERV INC	22,800	55.89	1,274,292.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,100	113.36	691,496.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	90,870	190.45	17,306,191.50
LEIDOS HOLDINGS INC	6,600	34.64	228,624.00
MASTERCARD INC-CLASS A	91,600	73.22	6,706,952.00
PAYCHEX INC	29,000	42.56	1,234,240.00
TERADATA CORP	13,900	48.10	668,590.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	15,300	30.42	465,426.00
VANTIV INC - CL A	10,400	30.15	313,560.00
VISA INC-CLASS A SHARES	44,520	212.09	9,442,246.80
WESTERN UNION CO	50,500	16.21	818,605.00
XEROX CORP	105,000	11.06	1,161,300.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,700	20.45	811,865.00
ADOBE SYSTEMS INC.	42,500	64.88	2,757,400.00
ANSYS INC	7,800	76.13	593,814.00
AUTODESK INC.	19,600	48.34	947,464.00

CA INC	27,500	30.84	848,100.00
CITRIX SYSTEMS INC	16,600	57.47	954,002.00
ELECTRONIC ARTS	27,700	28.53	790,281.00
INTUIT INC	23,500	77.77	1,827,595.00
MICROSOFT CORP	699,000	40.30	28,169,700.00
NETSUITE INC	2,800	92.44	258,832.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	20,900	17.17	358,853.00
ORACLE CORPORATION	321,000	39.57	12,701,970.00
RED HAT INC	16,900	52.23	882,687.00
SALESFORCE.COM INC	50,800	55.75	2,832,100.00
SERVICENOW INC	10,700	57.91	619,637.00
SYMANTEC CORP	61,900	19.79	1,225,001.00
SYNOPSYS INC	13,100	38.18	500,158.00
VMWARE INC - CLASS A	7,400	106.29	786,546.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,800	90.76	707,928.00
CISCO SYSTEMS	470,600	22.33	10,508,498.00
F5 NETWORKS INC	7,300	105.14	767,522.00
HARRIS CORP	9,200	71.88	661,296.00
JUNIPER NETWORKS INC	44,100	25.62	1,129,842.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	21,300	64.30	1,369,590.00
QUALCOMM INC	148,700	79.28	11,788,936.00
APPLE INC	79,330	536.86	42,589,103.80
EMC CORP	180,600	27.48	4,962,888.00
HEWLETT PACKARD CO	168,700	32.04	5,405,148.00
NETAPP INC	30,200	36.18	1,092,636.00
SAN DISK CORPORATION	19,600	80.61	1,579,956.00
SEAGATE TECHNOLOGY	28,200	54.92	1,548,744.00
WESTERN DIGITAL CORP	18,700	89.41	1,671,967.00
AMPHENOL CORP-CL A	13,800	91.62	1,264,356.00
ARROW ELECTRS INC	8,300	57.36	476,088.00
AVNET	11,800	45.60	538,080.00
CORNING INC	130,100	20.61	2,681,361.00
FLEXTRONICS INTL LTD	51,000	9.09	463,590.00
FLIR SYSTEMS INC	12,600	35.25	444,150.00
TE CONNECTIVITY LTD	37,000	59.51	2,201,870.00

TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,200	38.15	885,080.00	
ALTERA CORP.	27,800	35.45	985,510.00	
ANALOG DEVICES INC	27,000	52.84	1,426,680.00	
APPLIED MATERIALS	106,900	20.18	2,157,242.00	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	21,400	64.11	1,371,954.00	
BROADCOM CORP-CL A	47,500	31.03	1,473,925.00	
CREE INC	10,700	55.02	588,714.00	
INTEL CORP	437,500	25.62	11,208,750.00	
KLA TENCOR CORP	15,200	68.75	1,045,000.00	
LAM RESEARCH	14,000	54.49	762,860.00	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	20,000	47.85	957,000.00	
LSI CORP	46,300	11.07	512,541.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	35,800	15.43	552,394.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	26,000	32.29	839,540.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	18,000	46.92	844,560.00	
MICRON TECHNOLOGY	92,300	21.91	2,022,293.00	
NVIDIA CORP	48,800	17.90	873,520.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	96,000	46.64	4,477,440.00	
XILINX INC	22,900	53.84	1,232,936.00	
AT & T INC	464,000	35.07	16,272,480.00	
CENTURYLINK INC	52,900	32.68	1,728,772.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	95,800	5.62	538,396.00	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	13,700	38.51	527,587.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	364,200	47.42	17,270,364.00	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	51,000	8.22	419,220.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	11,300	92.25	1,042,425.00	
SPRINT CORP	84,000	9.29	780,360.00	
T-MOBILE US INC	20,500	32.60	668,300.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,600	50.00	2,130,000.00	
DUKE ENERGY CORP	61,900	70.44	4,360,236.00	
EDISON INTERNATIONAL	26,900	55.29	1,487,301.00	
ENERGY CORP	16,100	66.65	1,073,065.00	
EXELON CORPORATION	75,700	33.29	2,520,053.00	
FIRSTENERGY CORP	37,700	34.08	1,284,816.00	
NEXTERA ENERGY INC	37,700	94.72	3,570,944.00	

NORTHEAST UTILITIES	28,000	44.95	1,258,600.00
OGE ENERGY CORP	18,600	36.39	676,854.00
PEPCO HOLDINGS INC	22,700	20.24	459,448.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	10,000	54.03	540,300.00
PPL CORPORATION	55,200	32.98	1,820,496.00
SOUTHERN CO.	77,500	43.37	3,361,175.00
XCEL ENERGY INC	44,800	30.08	1,347,584.00
ALLIANT ENERGY CORP	9,500	55.91	531,145.00
AMEREN CORPORATION	22,400	40.80	913,920.00
CENTERPOINT ENERGY INC	37,400	23.54	880,396.00
CMS ENERGY CORP	23,700	28.83	683,271.00
CONSOLIDATED EDISON INC	26,500	53.17	1,409,005.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	51,400	71.09	3,654,026.00
DTE ENERGY COMPANY	15,100	73.19	1,105,169.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,500	58.99	442,425.00
MDU RESOURCES GROUP INC	15,100	33.87	511,437.00
NISOURCE INC	27,300	35.35	965,055.00
PG&E CORP	39,200	41.89	1,642,088.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	44,800	37.37	1,674,176.00
SCANA CORP	11,300	50.62	572,006.00
SEMPRA ENERGY	20,800	95.75	1,991,600.00
WISCONSIN ENERGY CORP	19,600	45.94	900,424.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,400	45.13	695,002.00
HUDSON CITY BANCORP INC	46,000	9.80	450,800.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	40,300	15.90	640,770.00
OCWEN FINANCIAL CORP	10,000	38.84	388,400.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL IN	29,800	14.64	436,272.00
AMERICAN EXPRESS CO	84,800	90.46	7,671,008.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	50,500	76.09	3,842,545.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	41,600	57.51	2,392,416.00
SLM CORPORATION	39,800	24.60	979,080.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,530	190.98	865,139.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,900	108.81	1,838,889.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	101,300	35.10	3,555,630.00
BLACKROCK INC	11,840	310.89	3,680,937.60

EATON VANCE CORP	10,000	37.78	377,800.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,000	53.67	1,985,790.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	38,150	162.30	6,191,745.00	
INVESCO LTD	39,400	36.44	1,435,736.00	
LEGG MASON INC	10,000	48.35	483,500.00	
MORGAN STANLEY	128,300	30.91	3,965,753.00	
NORTHERN TRUST CORP	19,800	64.91	1,285,218.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,700	54.50	637,650.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	103,100	27.19	2,803,289.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,900	33.65	434,085.00	
STATE STREET CORP	39,200	68.99	2,704,408.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,100	81.67	1,886,577.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	19,900	33.40	664,660.00	
H & R BLOCK INC	23,400	30.36	710,424.00	
AES CORP	62,900	14.29	898,841.00	
CALPINE CORP	29,800	20.80	619,840.00	
NRG ENERGY INC	27,500	31.55	867,625.00	
CERNER CORP	26,900	56.15	1,510,435.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,500	54.69	1,613,355.00	
ILLUMINA INC	11,300	142.02	1,604,826.00	
METTLER-TOLEDO INTL	2,610	232.08	605,728.80	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,300	118.50	3,827,550.00	
WATERS CORP	7,300	107.68	786,064.00	
DUN & BRADSTREET CORP	3,700	99.37	367,669.00	
EQUIFAX INC	11,100	68.19	756,909.00	
IHS INC-CLASS A	5,900	119.73	706,407.00	
MANPOWERGROUP INC	7,000	76.82	537,740.00	
NIELSEN HOLDINGS NV	23,400	44.26	1,035,684.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	12,300	41.20	506,760.00	
TOWERS WATSON & CO-CL A	5,700	110.14	627,798.00	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	13,000	59.87	778,310.00	
小計 銘柄数：578			1,502,514,334.88	
			(154,638,775,345)	
組入時価比率：57.2%			59.3%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	10,700	44.95	480,965.00

ARC RESOURCES LTD	28,500	30.30	863,550.00
ATHABASCA OIL CORP	31,000	7.89	244,590.00
BAYTEX ENERGY CORP	10,900	45.38	494,642.00
CAMECO CORP	34,600	25.43	879,878.00
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	95,100	42.09	4,002,759.00
CANADIAN OIL SANDS LTD	42,000	23.02	966,840.00
CENOVUS ENERGY INC	66,200	31.52	2,086,624.00
CRESCENT POINT ENERGY CORP	35,300	40.22	1,419,766.00
ENBRIDGE INC	70,500	50.03	3,527,115.00
ENCANA CORP	67,100	23.70	1,590,270.00
ENERPLUS CORP	18,700	21.99	411,213.00
HUSKY ENERGY INC	30,100	32.60	981,260.00
IMPERIAL OIL	26,300	51.43	1,352,609.00
INTER PIPELINE LTD	26,000	28.92	751,920.00
KEYERA CORP	7,200	69.24	498,528.00
MEG ENERGY CORP	12,400	37.30	462,520.00
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	26,300	19.16	503,908.00
PEMBINA PIPELINE CORP	26,900	41.83	1,125,227.00
PENGROWTH ENERGY CORP	47,500	6.77	321,575.00
PENN WEST PETROLEUM LTD	40,000	9.23	369,200.00
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,900	37.40	482,460.00
SUNCOR ENERGY INC	130,600	38.19	4,987,614.00
TALISMAN ENERGY	91,000	11.06	1,006,460.00
TOURMALINE OIL CORP	14,000	51.91	726,740.00
TRANSCANADA CORP	62,600	49.92	3,124,992.00
VERMILION ENERGY INC	8,200	69.11	566,702.00
AGRIUM INC	13,100	106.41	1,393,971.00
METHANEX CORP	8,200	70.43	577,526.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	76,700	39.31	3,015,077.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	16,100	34.29	552,069.00
BARRICK GOLD	101,500	20.24	2,054,360.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	66,800	6.39	426,852.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	50,500	20.56	1,038,280.00
FRANCO-NEVADA CORP	13,600	51.68	702,848.00
GOLDCORP INC	70,900	27.79	1,970,311.00

KINROSS GOLD CORP	104,600	4.67	488,482.00
NEW GOLD INC	43,100	5.62	242,222.00
SILVER WHEATON CORP	32,800	25.57	838,696.00
TECK RESOURCES LTD	49,200	23.84	1,172,928.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80,800	3.80	307,040.00
YAMANA GOLD INC	68,000	9.92	674,560.00
BOMBARDIER B SHEARS	132,000	4.06	535,920.00
CAE INC	21,200	14.47	306,764.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,800	47.73	610,944.00
FINNING INTERNATIONAL INC	14,900	30.77	458,473.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	73,800	61.43	4,533,534.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	15,610	163.66	2,554,732.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	19,400	105.49	2,046,506.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,700	54.52	583,364.00
TIM HORTONS INC	13,300	60.44	803,852.00
SHAW COMMUNICATIONS-B	33,000	26.25	866,250.00
THOMSON REUTERS CORP	33,600	37.61	1,263,696.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	6,900	103.82	716,358.00
DOLLARAMA INC	6,200	83.91	520,242.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	12,200	89.00	1,085,800.00
EMPIRE CO LTD A	4,600	67.70	311,420.00
LOBLAW COMPANIES	10,000	47.03	470,300.00
METRO INC	7,800	64.79	505,362.00
SHOPPERS DRUG MART CORP	17,700	61.10	1,081,470.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,200	81.45	342,090.00
SAPUTO INC	10,800	55.25	596,700.00
CATAMARAN CORP	17,700	49.07	868,539.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	27,810	141.11	3,924,269.10
BANK OF MONTREAL	56,400	73.53	4,147,092.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	106,200	63.60	6,754,320.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	35,000	94.83	3,319,050.00
NATIONAL BANK OF CANADA	29,200	44.02	1,285,384.00
ROYAL BANK OF CANADA	126,700	72.44	9,178,148.00
TORONTO DOMINION BANK	162,100	51.47	8,343,287.00

	ONEX CORP	8,000	61.34	490,720.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,780	477.73	850,359.40	
	GREAT-WEST LIFECO INC	27,100	30.35	822,485.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,300	44.87	372,421.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,100	68.00	822,800.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	165,000	21.02	3,468,300.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	30,400	30.01	912,304.00	
	POWER FINANCIAL CORP	22,500	34.07	766,575.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	53,000	38.23	2,026,190.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	49,200	44.82	2,205,144.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	7,700	17.53	134,981.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	18,900	33.97	642,033.00	
	OPEN TEXT CORP	10,200	51.48	525,096.00	
	BLACKBERRY LTD	43,900	9.31	408,709.00	
	BCE INC	22,700	47.45	1,077,115.00	
	BELL ALIANT INC	7,000	27.03	189,210.00	
	TELUS CORP	19,300	40.35	778,755.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	32,000	45.85	1,467,200.00	
	FORTIS INC	18,900	31.51	595,539.00	
	ATCO LTD CL1	6,800	52.28	355,504.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,600	40.28	426,968.00	
	CI FINANCIAL CORP	13,700	34.46	472,102.00	
	IGM FINANCIAL INC	8,500	51.94	441,490.00	
	TRANSALTA CORP	24,300	12.76	310,068.00	
	小計 銘柄数：94			128,261,084.10	
				(11,950,085,205)	
				4.6%	
	組入時価比率：4.4%				
ユーロ	CGG	14,900	11.20	166,880.00	
	FUGRO NV CVA	6,600	43.91	289,806.00	
	SAIPEM	23,900	17.19	410,841.00	
	TECHNIP SA	8,800	75.00	660,000.00	
	TENARIS SA	41,700	15.92	663,864.00	
	ENI SPA	223,400	18.18	4,061,412.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	31,100	12.40	385,640.00	
	NESTE OIL OYJ	10,700	14.58	156,006.00	

OMV AG	12,500	32.44	405,500.00
REPSOL SA	76,718	18.60	1,427,338.39
TOTAL SA	188,300	48.03	9,044,049.00
VOPAK	6,100	40.94	249,764.50
AIR LIQUIDE	27,470	99.05	2,720,903.50
AKZO NOBEL	20,900	59.11	1,235,399.00
ARKEMA	5,500	81.56	448,580.00
BASF SE	80,800	80.41	6,497,128.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	3,200	72.61	232,352.00
K+S AG	16,300	23.82	388,266.00
KONINKLIJKE DSM NV	13,700	49.65	680,205.00
LANXESS	7,100	54.10	384,110.00
LINDE AG	16,470	145.30	2,393,091.00
SOLVAY SA	5,100	113.90	580,890.00
UMICORE	9,900	36.69	363,231.00
CRH PLC	67,400	20.28	1,366,872.00
HEIDELBERGCEMENT AG	12,300	61.09	751,407.00
IMERYS	3,000	63.67	191,010.00
LAFARGE SA	17,000	56.51	960,670.00
ARCELORMITTAL	87,100	11.56	1,007,311.50
THYSSENKRUPP AG	41,300	19.38	800,394.00
VOESTALPINE AG	9,600	31.42	301,632.00
STORA ENSO OYJ-R	49,400	7.76	383,591.00
UPM-KYMMENE OYJ	47,200	12.31	581,032.00
AIRBUS GROUP NV	51,400	52.60	2,703,640.00
FINMECCANICA SPA	33,000	7.11	234,795.00
SAFRAN SA	24,200	50.19	1,214,598.00
THALES (EX THOMSON-CSF)	8,300	48.04	398,773.50
ZODIAC AEROSPACE	15,400	25.44	391,776.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	37,100	43.65	1,619,415.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,514	28.54	385,689.56
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	7,100	39.73	282,118.50
BOUYGUES	17,500	30.28	529,900.00
FERROVIAL SA	36,500	15.67	572,137.50
HOCHTIEF AG	2,900	65.35	189,515.00

OCI	8,000	32.98	263,880.00
VINCI	42,100	54.29	2,285,609.00
ALSTOM	18,700	19.39	362,686.50
LEGRAND SA	23,200	45.03	1,044,696.00
OSRAM LICHT AG	7,750	45.92	355,880.00
PRYSMIAN SPA	17,400	18.08	314,592.00
SCHNEIDER ELECTRIC SA	48,200	64.45	3,106,490.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	82,000	25.86	2,120,520.00
SIEMENS AG	69,800	98.97	6,908,106.00
ANDRITZ AG	6,500	44.40	288,600.00
CNH INDUSTRIAL NV	80,100	8.22	658,822.50
GEA GROUP AG	16,800	33.56	563,892.00
KONE OYJ	27,600	30.24	834,624.00
MAN SE	3,200	92.37	295,584.00
METSO OYJ	11,900	23.34	277,746.00
VALLOUREC	9,300	39.29	365,397.00
WARTSILA OYJ	15,600	39.70	619,320.00
ZARDOYA OTIS S.A	15,600	12.46	194,376.00
BRENNTAG AG	4,430	135.05	598,271.50
REXEL SA	18,700	18.80	351,653.50
BIC	2,500	95.10	237,750.00
EDENRED	19,100	22.77	435,002.50
DEUTSCHE POST AG-REG	79,100	27.54	2,178,809.50
TNT EXPRESS NV	36,000	7.11	256,176.00
DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	19,200	19.05	365,856.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	80,000	5.06	405,200.00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	34,900	16.61	579,863.50
ADP	2,400	90.73	217,752.00
ATLANTIA SPA	34,200	18.78	642,276.00
FRAPORT AG	2,900	54.20	157,180.00
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	48,000	9.14	439,008.00
CONTINENTAL AG	9,860	172.90	1,704,794.00
MICHELIN B	16,600	91.37	1,516,742.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,200	29.75	303,450.00

PIRELLI&CO	21,100	11.58	244,338.00
VALEO	6,600	101.50	669,900.00
BAYER MOTOREN WERK	29,700	92.23	2,739,231.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,700	68.30	321,010.00
DAIMLER AG	84,700	68.83	5,829,901.00
FIAT SPA-ORD	74,000	8.24	609,760.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	13,500	74.56	1,006,560.00
RENAULT	16,900	70.78	1,196,182.00
VOLKSWAGEN AG	2,710	184.45	499,859.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	12,730	188.65	2,401,514.50
ADIDAS AG	18,600	78.54	1,460,844.00
CHRISTIAN DIOR SA	4,780	138.20	660,596.00
HUGO BOSS AG	2,800	96.41	269,948.00
KERING	6,700	147.90	990,930.00
LUXOTTICA GROUP SPA	14,800	42.52	629,296.00
LVMH	22,560	133.75	3,017,400.00
ACCOR SA	13,500	37.00	499,500.00
SODEXO	8,600	76.03	653,858.00
AXEL SPRINGER SE	3,500	46.84	163,957.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,000	24.53	318,955.00
JC DECAUX INTERNATIONAL	5,300	30.90	163,796.50
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,100	98.50	206,850.00
LAGARDERE S.C.A	9,700	29.08	282,124.50
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	18,700	32.96	616,352.00
PUBLICIS GROUPE	15,900	65.57	1,042,563.00
REED ELSEVIER NV	63,000	15.61	983,745.00
RTL GROUP	3,300	83.53	275,649.00
SES FDR	26,100	27.27	711,747.00
SKY DEUTSCHLAND AG	37,000	6.35	235,209.00
TELENET GROUP HOLDING NV	4,300	45.01	193,543.00
WOLTERS KLUWER	25,900	20.44	529,396.00
INDITEX	19,200	110.00	2,112,000.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	54,300	28.22	1,532,346.00
CASINO GUICHARD	5,200	85.90	446,680.00
COLRUYT SA	6,700	40.00	268,000.00

DELHAIZE GROUP	8,700	51.64	449,268.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	56,900	6.57	373,833.00
JERONIMO MARTINS	23,400	12.40	290,160.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	83,169	14.32	1,191,395.92
METRO AG	11,400	29.47	335,958.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	71,000	77.39	5,494,690.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,200	47.11	433,412.00
HEINEKEN NV	20,400	50.24	1,024,896.00
PERNOD-RICARD	18,700	84.96	1,588,752.00
REMY COINTREAU	2,300	59.50	136,850.00
DANONE	49,700	52.15	2,591,855.00
KERRY GROUP PLC-A	13,700	56.41	772,817.00
SUEDZUCKER AG	8,300	20.58	170,855.50
UNILEVER NV-CVA	143,100	29.95	4,286,560.50
HENKEL AG & CO KGAA	11,700	72.66	850,122.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,900	78.45	1,247,355.00
BEIERSDORF AG	8,700	71.34	620,658.00
LOREAL-ORD	21,180	119.95	2,540,541.00
ESSILOR INTERNATIONAL	18,100	74.05	1,340,305.00
CELESIO AG	3,300	24.90	82,186.50
FRESENIUS MEDICAL CARE	19,500	50.86	991,770.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	10,850	113.70	1,233,645.00
GRIFOLS SA	13,200	39.86	526,218.00
BAYER AG	72,770	99.30	7,226,061.00
MERCK KGAA	5,670	122.90	696,843.00
ORION OYJ	7,800	22.35	174,330.00
SANOFI	105,200	75.80	7,974,160.00
U.C.B. SA	10,100	58.00	585,800.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	646,000	0.25	163,244.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	508,000	8.89	4,517,136.00
BANCO DE SABADELL SA	298,659	2.24	670,489.45
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	145,000	1.35	196,040.00
BANCO SANTANDER SA	1,020,000	6.83	6,966,600.00
BANK OF IRELAND	2,050,000	0.29	608,850.00
BANKIA SA	362,000	1.53	555,308.00

BCO POPULAR ESPANOL	142,000	5.37	762,824.00
BNP PARIBAS	87,500	56.10	4,908,750.00
CAIXABANK	153,652	4.51	693,431.47
COMMERZBANK AG	87,400	13.15	1,149,310.00
CREDIT AGRICOLE SA	87,900	11.39	1,001,620.50
ERSTE GROUP BANK AG	23,628	23.91	564,945.48
INTESA SANPAOLO	1,037,000	2.40	2,490,874.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROUPE NV	22,700	43.89	996,416.50
NATIXIS	77,000	5.34	411,488.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,100	23.45	260,295.00
SOCIETE GENERALE	63,000	44.55	2,806,965.00
UNICREDIT SPA	380,000	6.53	2,483,300.00
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	75,000	6.65	499,125.00
DEUTSCHE BOERSE AG	16,900	57.99	980,031.00
EURAZEO	2,500	64.90	162,250.00
EXOR SPA	8,600	32.69	281,134.00
GROUPE BRUXELLES LAM	7,200	72.60	522,720.00
ING GROEP NV	337,000	9.99	3,368,989.00
WENDEL	2,800	115.60	323,680.00
AEGON NV	159,000	6.59	1,048,128.00
AGEAS	19,400	32.18	624,292.00
ALLIANZ SE	40,130	123.00	4,935,990.00
ASSICURAZIONI GENERALI	102,500	16.22	1,662,550.00
AXA	157,400	19.10	3,007,127.00
CNP ASSURANCES	16,400	15.38	252,232.00
DELTA LLOYD NV	15,900	19.76	314,263.50
HANNOVER RUECK SE	5,300	65.19	345,507.00
MAPFRE SA	91,000	3.09	281,918.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	15,700	159.05	2,497,085.00
SAMPO OYJ-A	38,900	37.21	1,447,469.00
SCOR SE	14,200	25.49	361,958.00
UNIPOLSAI SPA	80,000	2.81	224,800.00
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN	3,100	35.28	109,383.50

DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	28,000	15.54	435,120.00
IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00
IMMOFINANZ AG	82,000	3.38	277,406.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,800	33.36	326,977.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	33,600	29.49	991,032.00
ATOS	6,000	65.67	394,020.00
CAP GEMINI SA	12,500	55.18	689,750.00
DASSAULT SYSTEMES SA	5,800	85.66	496,828.00
GEMALTO	6,800	84.40	573,920.00
SAP AG	81,000	58.70	4,754,700.00
ALCATEL-LUCENT	246,000	2.88	709,218.00
NOKIA OYJ	337,000	5.37	1,809,690.00
ASML HOLDING NV	31,700	67.15	2,128,655.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	96,000	8.57	823,584.00
STMICROELECTRONICS NV	57,700	6.73	388,321.00
BELGACOM SA	13,800	22.84	315,192.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	253,700	11.75	2,980,975.00
ELISA CORPORATION	12,500	20.88	261,000.00
ILIAD SA	2,430	208.10	505,683.00
KONINKLIJKE KPN NV	286,000	2.56	733,590.00
ORANGE	166,300	10.71	1,781,073.00
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	53,000	3.15	166,950.00
TELECOM ITALIA SPA	920,000	0.85	783,380.00
TELECOM ITALIA-RNC	554,000	0.68	376,997.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	23,800	5.80	138,111.40
TELEFONICA SA	366,400	11.47	4,202,608.00
TELEKOM AUSTRIA AG	22,000	7.18	158,092.00
VIVENDI SA	108,200	20.31	2,198,083.00
ZIGGO NV	13,600	32.27	438,940.00
ELECTRICITE DE FRANCE	22,000	28.46	626,120.00
ENEL SPA	587,000	4.11	2,414,918.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	171,000	3.34	572,679.00
FORTUM OYJ	40,200	16.36	657,672.00
IBERDROLA SA	432,000	5.09	2,201,040.00

	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,600	58.90	565,440.00	
	TERNA SPA	138,000	3.93	542,616.00	
	ENAGAS	16,000	22.25	356,000.00	
	GAS NATURAL SDG	30,500	20.44	623,572.50	
	SNAM SPA	175,000	4.24	742,350.00	
	E.ON SE	159,600	14.21	2,267,916.00	
	GDF SUEZ	116,600	19.96	2,327,336.00	
	RWE AG	42,700	29.84	1,274,168.00	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	24,300	14.87	361,462.50	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,000	14.54	479,820.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	89,900	32.30	2,904,219.50	
	MEDIOBANCA SPA-ORD	44,000	7.98	351,120.00	
	ENEL GREEN POWER SPA	160,000	2.03	324,800.00	
	QIAGEN NV	20,100	15.27	306,927.00	
	BUREAU VERITAS SA	20,800	22.26	463,112.00	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,000	42.71	469,810.00	
	小計銘柄数：231			265,108,491.87	
				(37,552,617,873)	
	組入時価比率：13.9%			14.4%	
英ポンド	AMEC PLC	26,800	11.06	296,408.00	
	PETROFAC LTD	22,700	14.16	321,432.00	
	BG GROUP PLC	299,400	11.11	3,327,831.00	
	BP PLC	1,642,000	4.84	7,949,743.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,000	21.93	7,479,835.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	218,100	23.39	5,102,449.50	
	TULLOW OIL PLC	78,200	7.60	594,320.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,500	25.39	291,985.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	17,700	32.50	575,250.00	
	REXAM PLC	67,000	4.90	328,367.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	122,500	15.09	1,848,525.00	
	ANTOFAGASTA PLC	34,900	8.41	293,683.50	
	BHP BILLITON PLC	185,500	18.52	3,435,460.00	
	FRESNILLO PLC	14,200	8.50	120,700.00	
	GLENCORE XSTRATA PLC	931,000	3.13	2,916,357.50	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,400	45.34	335,516.00	

RIO TINTO PLC-REG	111,700	32.79	3,663,201.50
BAE SYSTEMS PLC	287,000	4.07	1,169,238.00
COBHAM PLC	99,000	3.01	298,386.00
MEGGITT PLC	70,600	4.77	337,185.60
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	168,700	10.77	1,816,899.00
SMITHS GROUP PLC	33,900	12.71	430,869.00
IMI PLC	24,937	14.53	362,334.61
MELROSE INDUSTRIES PLC	93,076	2.95	274,574.20
WEIR GROUP PLC	18,200	25.53	464,646.00
BUNZLE	30,000	16.00	480,000.00
TRAVIS PERKINS PLC	20,900	18.76	392,084.00
WOLSELEY PLC	23,612	34.47	813,905.64
AGGREKO PLC	24,200	15.04	363,968.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	32,000	12.92	413,440.00
G4S PLC	136,800	2.37	325,447.20
SERCO GROUP PLC	46,300	4.20	194,737.80
ROYAL MAIL PLC	55,000	5.64	310,200.00
EASYJET PLC	14,200	17.11	242,962.00
GKN PLC	148,000	3.94	583,416.00
PERSIMMON PLC	28,300	13.64	386,012.00
BURBERRY GROUP PLC	39,200	14.09	552,328.00
CARNIVAL PLC	16,800	22.90	384,720.00
COMPASS GROUP PLC	161,200	9.20	1,483,846.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	24,100	19.32	465,612.00
TUI TRAVEL PLC	38,000	4.37	166,174.00
WHITBREAD PLC	15,800	42.23	667,234.00
WILLIAM HILL PLC	81,000	3.42	277,587.00
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	89,200	9.17	818,410.00
ITV PLC	323,000	1.89	611,762.00
PEARSON	72,000	10.39	748,080.00
REED ELSEVIER PLC	105,100	9.14	960,614.00
WPP PLC	120,100	12.15	1,459,215.00
ASOS PLC	4,600	50.24	231,104.00
MARKS & SPENCER PLC	141,000	4.53	639,717.00

NEXT PLC	13,900	67.00	931,300.00
KINGFISHER PLC	211,000	4.18	882,191.00
MORRISON SUPERMARKETS	195,000	2.14	419,055.00
SAINSBURY	111,800	3.17	354,517.80
TESCO PLC	712,000	2.97	2,120,336.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	18,800	15.05	282,940.00
DIAGEO PLC	220,600	18.68	4,121,911.00
SABMILLER PLC	86,200	30.25	2,607,550.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,400	28.30	888,620.00
TATE & LYLE ORD.	42,500	6.67	283,687.50
UNILEVER PLC	114,900	25.57	2,937,993.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	166,200	33.40	5,551,080.00
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	85,300	24.32	2,074,496.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,900	49.30	2,854,470.00
SMITH & NEPHEW PLC	81,100	9.21	747,336.50
ASTRAZENECA PLC	110,400	39.37	4,347,000.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	428,000	16.18	6,925,040.00
SHIRE PLC	51,400	30.21	1,552,794.00
BARCLAYS PLC	1,344,000	2.31	3,105,984.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,652,000	6.11	10,093,720.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,389,000	0.74	3,262,782.60
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	190,000	3.07	583,680.00
STANDARD CHARTERED PLC	213,800	12.59	2,692,811.00
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	15,800	19.79	312,682.00
ADMIRAL GROUP PLC	17,500	14.34	250,950.00
AVIVA PLC	262,000	4.70	1,231,924.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	95,000	2.41	229,425.00
LEGAL & GENERAL	529,000	2.05	1,084,450.00
OLD MUTUAL PLC	436,000	2.00	874,180.00
PRUDENTIAL PLC	224,700	12.80	2,877,283.50
RESOLUTION LTD	126,000	2.96	373,338.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	330,000	0.89	295,515.00
RSA INSURANCE GROUP PLC - RTS	123,750	0.33	41,765.62
STANDARD LIFE PLC	205,000	3.80	779,615.00
SAGE GROUP PLC (THE)	95,000	4.20	399,000.00

	ARM HOLDINGS PLC	123,600	9.77	1,208,190.00	
	BT GROUP PLC	697,000	3.74	2,607,477.00	
	INMARSAT PLC	41,100	7.29	299,619.00	
	VODAFONE GROUP PLC	2,326,000	2.19	5,096,266.00	
	SSE PLC	86,400	15.11	1,305,504.00	
	CENTRICA PLC	445,000	3.28	1,462,270.00	
	NATIONAL GRID PLC	327,300	8.30	2,716,590.00	
	SEVERN TRENT PLC	20,300	18.29	371,287.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	61,000	7.96	485,865.00	
	3I GROUP PLC	89,000	3.94	350,927.00	
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	83,000	3.95	328,099.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,100	14.60	278,860.00	
	ICAP PLC	46,000	3.77	173,420.00	
	INVESTEC PLC	55,200	4.81	265,898.40	
	SCHRODERS PLC	9,000	25.78	232,020.00	
	CAPITA PLC	58,100	11.02	640,262.00	
	EXPERIAN PLC	89,800	10.93	981,514.00	
	INTERTEK GROUP PLC	13,700	30.65	419,905.00	
小計	銘柄数：103			145,603,168.97	
				(24,943,278,876)	
	組入時価比率：9.2%			9.6%	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	31,500	36.39	1,146,285.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	790	333.25	263,267.50	
	GIVAUDAN-REG	798	1,359.00	1,084,482.00	
	SIKA AG-BR	196	3,526.00	691,096.00	
	SYNGENTA AG	8,260	337.00	2,783,620.00	
	HOLCIM LTD-REG	20,000	72.15	1,443,000.00	
	GEBERIT AG-REG	3,340	288.70	964,258.00	
	ABB LTD	193,000	22.68	4,377,240.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	129.50	249,935.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,970	129.50	514,115.00	
	SULZER AG-REG	2,000	119.40	238,800.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,010	122.70	614,727.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	45,800	83.90	3,842,620.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,760	550.00	1,518,000.00	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	3,600	101.60	365,760.00	
	ARYZTA AG	7,910	77.25	611,047.50	
	BARRY CALLEBAUT AG	190	1,173.00	222,870.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	76	4,332.00	329,232.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	9	51,445.00	463,005.00	
	NESTLE SA-REG	284,200	66.35	18,856,670.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,560	129.30	589,608.00	
	ACTELION LTD	8,900	85.45	760,505.00	
	NOVARTIS-REG	202,600	72.45	14,678,370.00	
	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	61,900	265.70	16,446,830.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	2,440	76.00	185,440.00	
	BALOISE HOLDING AG	4,090	111.50	456,035.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,930	214.80	629,364.00	
	SWISS RE LTD	31,600	81.35	2,570,660.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,220	269.10	3,557,502.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,500	74.80	336,600.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,020	540.50	1,091,810.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	135,700	28.21	3,828,097.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	19,800	39.20	776,160.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,560	246.10	383,916.00	
	UBS AG-REG	320,800	17.99	5,771,192.00	
	LONZA AG-REG	4,600	90.45	416,070.00	
	ADECCO SA-REG	12,000	73.15	877,800.00	
	SGS SA-REG	485	2,179.00	1,056,815.00	
小計	銘柄数：38			94,992,804.00	
				(11,032,464,256)	
	組入時価比率：4.1%			4.2%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	20,100	132.90	2,671,290.00	
	BOLIDEN AB	22,400	96.90	2,170,560.00	
	ASSA ABLOY AB-B	29,600	340.60	10,081,760.00	
	SKANSKA AB-B SHS	32,900	150.00	4,935,000.00	
	ALFA LAVAL AB	27,000	173.70	4,689,900.00	
	ATLAS COPCO AB-A	59,100	183.30	10,833,030.00	
	ATLAS COPCO AB-B	34,800	173.30	6,030,840.00	

	SANDVIK AB	92,700	90.30	8,370,810.00
	SCANIA AB-B	29,000	190.70	5,530,300.00
	SKF AB-B SHARES	35,900	167.60	6,016,840.00
	VOLVO AB-B	132,600	101.60	13,472,160.00
	SECURITAS AB-B SHS	29,800	74.30	2,214,140.00
	ELECTROLUX AB-B	20,800	138.70	2,884,960.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	40,400	44.49	1,797,396.00
	HENNES&MAURITZ AB-B	83,200	273.00	22,713,600.00
	SWEDISH MATCH AB	17,400	211.40	3,678,360.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	53,100	188.70	10,019,970.00
	ELEKTA AB-B SHS	31,700	84.60	2,681,820.00
	GETINGE AB-B SHS	17,100	180.30	3,083,130.00
	NORDEA BANK AB	266,200	89.05	23,705,110.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	133,700	87.05	11,638,585.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	43,500	318.60	13,859,100.00
	SWEDBANK AB	79,000	170.30	13,453,700.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,700	125.00	1,462,500.00
	INVESTOR AB-B SHS	40,500	229.90	9,310,950.00
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	20,300	230.80	4,685,240.00
	ERICSSON LM-B	266,500	85.40	22,759,100.00
	HEXAGON AB-B SHS	21,600	216.90	4,685,040.00
	TELIA AB	211,000	48.42	10,216,620.00
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR- SDR	6,100	655.50	3,998,550.00
	TELE 2 AB-B SHS	28,400	80.35	2,281,940.00
小計	銘柄数：31			245,932,301.00
				(3,895,567,647)
	組入時価比率：1.4%			1.5%
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	14,400	93.50	1,346,400.00
	SEADRILL LTD	33,500	207.60	6,954,600.00
	SUBSEA 7 SA	24,900	109.50	2,726,550.00
	STATOIL ASA	98,700	169.50	16,729,650.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,700	261.20	4,100,840.00
	NORSK HYDRO	116,000	29.65	3,439,400.00
	ORKLA ASA	68,800	51.15	3,519,120.00

	DNB ASA	84,700	103.90	8,800,330.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,200	123.20	2,119,040.00	
	TELENOR ASA	60,900	132.90	8,093,610.00	
小計	銘柄数：10			57,829,540.00	
				(991,198,315)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
デンマーク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	19,700	236.20	4,653,140.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	48	61,400.00	2,947,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	120	64,000.00	7,680,000.00	
	DSV A/S	16,200	172.90	2,800,980.00	
	CARLSBERG B	9,300	535.00	4,975,500.00	
	COLOPLAST-B	10,100	436.00	4,403,600.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,100	464.10	974,610.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	175,100	246.20	43,109,620.00	
	DANSKE BANK AS	59,500	148.00	8,806,000.00	
	TRYG A/S	2,300	533.00	1,225,900.00	
	TDC A/S	68,800	49.40	3,398,720.00	
小計	銘柄数：11			84,975,270.00	
				(1,611,980,871)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	18,000	14.93	268,740.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,400	21.81	270,444.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	96,900	14.30	1,385,670.00	
	SANTOS LTD.	84,600	13.32	1,126,872.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	58,600	38.65	2,264,890.00	
	INCITEC PIVOT LTD	143,000	2.93	418,990.00	
	ORICA LTD	32,600	21.56	702,856.00	
	BORAL LTD	67,000	5.61	375,870.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,900	14.23	525,087.00	
	AMCOR	107,000	10.35	1,107,450.00	
	ALUMINA LTD	237,000	1.20	284,400.00	
	BHP BILLITON LIMITED	282,600	36.14	10,213,164.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,000	5.34	758,280.00	
	ILUKA RESOURCES LTD	37,800	9.71	367,038.00	
	NEWCREST MINING	64,000	9.80	627,200.00	

RIO TINTO LTD	38,500	63.24	2,434,740.00
LEIGHTON HOLDINGS	14,300	21.10	301,730.00
BRAMBLES LTD	140,000	9.32	1,304,800.00
TOLL HLDGS	55,000	5.09	279,950.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	78,000	1.08	84,630.00
ASCIANO LTD	85,000	5.20	442,000.00
AURIZON HOLDINGS LTD	173,000	5.12	885,760.00
SYDNEY AIRPORT	97,900	4.22	413,138.00
TRANSURBAN GROUP	123,000	7.25	891,750.00
CROWN RESORTS LTD	35,100	16.51	579,501.00
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	78,000	2.46	191,880.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	52.02	270,504.00
TABCORP HOLDINGS	62,000	3.42	212,040.00
TATTS GROUP LTD	133,000	2.90	385,700.00
REA GROUP LTD	4,100	47.96	196,636.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,000	3.27	124,260.00
METCASH LTD	78,000	2.67	208,260.00
WESFARMERS LIMITED	100,200	41.39	4,147,278.00
WOOLWORTHS LIMITED	110,900	35.60	3,948,040.00
COCA-COLA AMATIL LTD	52,400	11.07	580,068.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	54,000	3.59	193,860.00
COCHLEAR LTD	5,300	57.24	303,372.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,400	47.84	593,216.00
SONIC HEALTHCARE LTD	33,900	17.25	584,775.00
CSL LIMITED	42,800	69.85	2,989,580.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	241,200	32.82	7,916,184.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	27,000	12.85	346,950.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,300	11.12	437,016.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	141,800	77.14	10,938,452.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	210,000	35.32	7,417,200.00
WESTPAC BANKING CORP	273,500	34.43	9,416,605.00
ASX LTD	17,700	35.91	635,607.00
AMP LIMITED	259,000	4.96	1,284,640.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	210,000	5.57	1,169,700.00
QBE INSURANCE	105,100	12.65	1,329,515.00

	SUNCORP GROUP LTD	113,800	12.65	1,439,570.00	
	COMPUTERSHARE LTD	41,000	12.10	496,100.00	
	TELSTRA CORP LTD	390,000	5.03	1,961,700.00	
	SP AUSNET	163,400	1.30	213,237.00	
	APA GROUP	75,500	6.45	486,975.00	
	AGL ENERGY LTD	47,200	15.07	711,304.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,200	57.65	1,510,430.00	
	ALS LTD	35,236	7.31	257,575.16	
	SEEK LTD	28,800	17.26	497,088.00	
小計	銘柄数：59			91,710,267.16	
				(8,729,900,330)	
	組入時価比率：3.2%			3.3%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,000	9.63	597,060.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,900	3.87	378,873.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	30,000	8.59	257,700.00	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	148,000	2.44	361,860.00	
	CONTACT ENERGY LTD	31,800	5.33	169,494.00	
小計	銘柄数：5			1,764,987.00	
				(157,472,140)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS LTD	42,500	26.45	1,124,125.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	186,000	103.20	19,195,200.00	
	NWS HOLDINGS LTD	135,500	13.00	1,761,500.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	14.52	1,553,640.00	
	MTR CORP	132,500	28.35	3,756,375.00	
	LI & FUNG LTD	535,600	11.68	6,255,808.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	62,000	24.85	1,540,700.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	188,000	65.95	12,398,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	78,000	27.25	2,125,500.00	
	SANDS CHINA LTD	216,000	57.40	12,398,400.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	130,333	12.40	1,616,129.20	
	SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	21.30	3,535,800.00	
	WYNN MACAU LTD	132,400	31.65	4,190,460.00	
	BANK OF EAST ASIA	110,860	30.50	3,381,230.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	337,500	21.70	7,323,750.00	

	HANG SENG BANK	67,300	122.70	8,257,710.00	
	FIRST PACIFIC CO	226,000	7.84	1,771,840.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	98,000	118.70	11,632,600.00	
	AIA GROUP LTD	1,057,400	36.95	39,070,930.00	
	CHEUNG KONG	124,000	127.50	15,810,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	192,000	22.00	4,224,000.00	
	HENDERSON LAND	96,866	44.00	4,262,104.00	
	HYSAN DEVELOPMENT	54,000	33.30	1,798,200.00	
	KERRY PROPERTIES	57,000	24.60	1,402,200.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	312,500	7.52	2,350,000.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT RTS	104,166	1.32	137,499.12	
	SINO LAND CO.LTD	256,000	11.14	2,851,840.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	93.65	13,017,350.00	
	SWIRE PACIFIC-A	61,500	90.00	5,535,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	100,800	21.65	2,182,320.00	
	WHARF(HOLDING)	134,000	50.20	6,726,800.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	77,000	30.05	2,313,850.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	72.30	1,583,370.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	220,000	8.01	1,762,200.00	
	PCCW LTD	386,000	3.89	1,501,540.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	56,000	50.00	2,800,000.00	
	CLP HLDGS	157,500	58.65	9,237,375.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	127,000	67.55	8,578,850.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	502,194	16.76	8,416,771.44	
小計	銘柄数：39			239,381,566.76	
				(3,176,593,390)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
シンガポールドル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	141,000	3.82	538,620.00	
	KEPPEL CORP.	130,700	10.84	1,416,788.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	83,040	5.44	451,737.60	
	SEMBCORP MARINE	72,600	4.03	292,578.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	1.07	175,225.00	
	NOBLE GROUP LTD	412,481	1.21	499,102.01	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	50,040	10.47	523,918.80	

	COMFORTDELGRO CORP LTD	167,000	1.95	326,485.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	524,600	1.33	697,718.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	146,000	4.18	610,280.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	9,000	44.70	402,300.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	113,000	2.22	250,860.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	615,320	0.58	356,885.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	160,000	3.46	553,600.00	
	DBS GROUP HLDGS	152,000	16.08	2,444,160.00	
	OCBC-ORD	229,000	9.51	2,177,790.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	111,000	21.35	2,369,850.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	74,000	6.94	513,560.00	
	CAPITALAND LIMITED	232,000	2.82	654,240.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	118,000	1.76	208,270.00	
	CITY DEVELOPMENT	37,000	10.02	370,740.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	264,000	2.62	691,680.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	54,000	3.35	180,900.00	
	UOL GROUP LIMITED	38,700	6.22	240,714.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	704,000	3.65	2,569,600.00	
	STARHUB LTD	61,000	4.16	253,760.00	
	小計 銘柄数：26			19,771,362.01	
				(1,619,274,548)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
新シケル	DELEK GROUP LTD	300	1,338.00	401,400.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	43,100	30.55	1,316,705.00	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	210	2,000.00	420,000.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	76,200	172.90	13,174,980.00	
	BANK HAPOALIM BM	93,000	20.03	1,862,790.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,000	13.63	1,567,450.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,000	47.38	426,420.00	
	NICE SYSTEMS LTD	5,300	153.20	811,960.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	165,000	6.36	1,050,885.00	
	小計 銘柄数：9			21,032,590.00	
				(618,989,123)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	

合計			260,918,197,919	
			(260,918,197,919)	

(注1)外貨建有利証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有利証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(平成26年 3月31日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額/口数	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST		300,645.00	
	小計	銘柄数: 1		300,645.00	
		組入時価比率: 0.0%		(30,942,383)	0.5%
	合計			30,942,383	(30,942,383)
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	33,900	720,375.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	65,590	914,324.60	
		AMERICAN TOWER CORP	34,500	2,833,485.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	85,000	929,050.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,100	1,444,443.00	
		BOSTON PROPERTIES	13,400	1,526,126.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,600	505,324.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	28,800	2,148,768.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,800	577,800.00	
		DUKE REALTY CORP	28,600	476,190.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,900	1,715,961.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,800	658,474.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	47,100	1,030,548.00	
		HCP INC	40,100	1,530,617.00	
		HEALTH CARE REIT INC	25,600	1,513,728.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	67,800	1,351,932.00	
		KIMCO REALTY CORP	34,800	760,032.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	12,500	456,875.00	
		MACERICH CO /THE	12,200	752,618.00	
		PLUM CREEK TIMBER CO	16,200	674,568.00	

	PROLOGIS INC	43,900	1,779,706.00	
	PUBLIC STORAGE	13,000	2,184,390.00	
	RAYONIER INC	11,800	533,596.00	
	REALTY INCOME CORP	16,900	688,675.00	
	REGENCY CENTERS CORP	8,700	441,699.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	27,220	4,460,269.20	
	SL GREEN REALTY CORP	8,200	815,654.00	
	UDR INC	23,600	606,048.00	
	VENTAS INC	25,800	1,557,288.00	
	VORNADO REALTY TRUST	15,200	1,491,120.00	
	WEYERHAEUSER CO	52,100	1,520,278.00	
小計	銘柄数：31	857,710	38,599,961.80	
			(3,972,708,068)	
	組入時価比率：1.5%		70.4%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	10,500	239,085.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	12,400	327,732.00	
小計	銘柄数：2	22,900	566,817.00	
			(52,810,339)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	
ユーロ	CORIO NV	6,700	222,607.50	
	FONCIERE DES REGIONS	2,500	167,500.00	
	GECINA SA	2,200	209,902.00	
	ICADE	3,000	214,410.00	
	KLEPIERRE	8,900	290,407.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	8,760	1,674,912.00	
小計	銘柄数：6	32,060	2,779,738.50	
			(393,749,958)	
	組入時価比率：0.1%		7.0%	
英ポンド	BRITISH LAND	86,500	570,035.00	
	HAMMERSON PLC	65,900	366,733.50	
	INTU PROPERTIES PLC	58,000	180,438.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	68,000	703,120.00	
	SEGRO PLC	70,800	234,277.20	
小計	銘柄数：5	349,200	2,054,603.70	
			(351,974,159)	

	組入時価比率：0.1%		6.2%
豪ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	199,200	374,496.00
	DEXUS PROPERTY GROUP	398,000	419,890.00
	FEDERATION CENTRES	132,200	308,026.00
	GOODMAN GROUP	158,000	745,760.00
	GPT GROUP	148,000	537,240.00
	LEND LEASE GROUP	48,000	569,760.00
	MIRVAC GROUP	344,000	574,480.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	197,000	728,900.00
	WESTFIELD GROUP	171,400	1,761,992.00
	WESTFIELD RETAIL TRUST	276,000	819,720.00
小計	銘柄数：10	2,071,800	6,840,264.00 (651,124,730)
	組入時価比率：0.2%		11.6%
香港ドル	LINK REIT	206,000	7,755,900.00
小計	銘柄数：1	206,000	7,755,900.00 (102,920,793)
	組入時価比率：0.0%		1.8%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	187,000	420,750.00
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	199,000	297,505.00
	CAPITAMALL TRUST	219,900	416,710.50
小計	銘柄数：3	605,900	1,134,965.50 (92,953,674)
	組入時価比率：0.0%		1.6%
合計			5,618,241,721 (5,618,241,721)
合計			5,649,184,104 (5,649,184,104)

(注1)外貨建保有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建保有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成26年 3月31日現在	
	契約額等(円)	

		うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
株価指数先物取引				
買建	3,112,389,474	-	3,156,350,226	43,960,752
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	869,220,710	-	875,015,000	5,794,290
米ドル	511,191,500	-	514,550,000	3,358,500
カナダドル	64,474,410	-	65,212,000	737,590
ユーロ	169,145,160	-	169,968,000	822,840
英ポンド	50,830,740	-	51,390,000	559,260
スイスフラン	57,749,400	-	58,065,000	315,600
スウェーデンクローナ	15,829,500	-	15,830,000	500
売建	87,582,800	-	88,322,000	739,200
米ドル	30,645,000	-	30,873,000	228,000
ユーロ	28,082,000	-	28,328,000	246,000
英ポンド	28,855,800	-	29,121,000	265,200
合計	-	-	-	49,015,842

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

貸借対照表

(単位：円)

(平成26年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,004,941,304
国債証券	228,251,802,200
地方債証券	18,831,051,942
特殊債券	24,742,489,382
社債券	16,196,297,000
未収入金	1,404,111,000
未収利息	513,788,304
前払費用	16,926,047
流動資産合計	294,961,407,179
資産合計	294,961,407,179
負債の部	
流動負債	
未払金	4,017,549,753
未払解約金	152,759,924
流動負債合計	4,170,309,677
負債合計	4,170,309,677
純資産の部	
元本等	
元本	240,151,184,071
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	50,639,913,431
元本等合計	290,791,097,502
純資産合計	290,791,097,502
負債純資産合計	294,961,407,179

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、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	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 3月31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	1.2109円
(10,000口当たり純資産額)	(12,109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25年 4月 2日 至 平成26年 3月31日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。
市場リスクの管理	市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。
信用リスクの管理	信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。
流動性リスクの管理	流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成26年 3月31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、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）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成26年 3月31日現在	
期首	平成25年 4月 2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	216,358,243,115円
同期中における追加設定元本額	76,813,958,455円
同期中における一部解約元本額	53,021,017,499円
期末元本額	240,151,184,071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	341,667,648円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	19,039,553,030円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	28,007,845,900円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,352,378,546円
野村資産設計ファンド2015	920,706,223円
野村資産設計ファンド2020	372,113,475円
野村資産設計ファンド2025	244,768,503円
野村資産設計ファンド2030	146,974,534円
野村資産設計ファンド2035	77,340,218円
野村資産設計ファンド2040	203,324,439円
野村日本債券インデックスファンド	2,164,790,293円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	14,719,539,897円
のむらップ・ファンド(保守型)	3,886,030,541円
のむらップ・ファンド(普通型)	1,175,932,163円
のむらップ・ファンド(積極型)	327,924,811円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	17,096,231,005円
野村資産設計ファンド2045	6,276,474円
野村円債投資インデックスファンド	1,567,260,636円
野村インデックスファンド・国内債券	269,056,567円
マイ・ロード	20,583,070,934円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	19,652,292円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	5,213,340,337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)	490,039,051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)	20,676,155,490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)	3,312,880,268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)	67,601,172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)	47,346,191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)	13,399,631円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	9,778,802,402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)	559,062,556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)	3,053,061,985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)	1,613,830,430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)	182,681,846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)	502,130,709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)	1,131,091,099円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,315,159,987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)	1,297,373,572円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	9,213,183,346円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	13,409,159,026円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,256,489,585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)	33,639,871,972円
マイバランスDC30	4,469,088,438円
マイバランスDC50	2,607,830,251円
マイバランスDC70	744,044,498円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	5,035,122,100円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成26年 3月31日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成26年 3月31日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第328回	1,000,000,000	1,000,220,000	
		国庫債券 利付(2年)第330回	300,000,000	300,462,000	
		国庫債券 利付(2年)第331回	400,000,000	400,108,000	
		国庫債券 利付(2年)第333回	1,000,000,000	1,000,300,000	
		国庫債券 利付(2年)第334回	1,100,000,000	1,100,352,000	
		国庫債券 利付(2年)第336回	1,000,000,000	1,000,350,000	
		国庫債券 利付(2年)第337回	1,000,000,000	1,000,370,000	
		国庫債券 利付(2年)第338回	500,000,000	500,145,000	
		国庫債券 利付(5年)第89回	2,000,000,000	2,007,880,000	
		国庫債券 利付(5年)第90回	1,700,000,000	1,704,641,000	
		国庫債券 利付(5年)第91回	1,900,000,000	1,908,911,000	
		国庫債券 利付(5年)第92回	700,000,000	702,254,000	
		国庫債券 利付(5年)第93回	1,700,000,000	1,712,240,000	
		国庫債券 利付(5年)第94回	1,500,000,000	1,513,380,000	
		国庫債券 利付(5年)第95回	1,000,000,000	1,010,090,000	
		国庫債券 利付(5年)第96回	1,700,000,000	1,713,821,000	
		国庫債券 利付(5年)第97回	1,700,000,000	1,711,645,000	
		国庫債券 利付(5年)第98回	900,000,000	904,176,000	
		国庫債券 利付(5年)第99回	1,600,000,000	1,612,016,000	
		国庫債券 利付(5年)第100回	1,000,000,000	1,005,040,000	
国庫債券 利付(5年)第101回	1,600,000,000	1,613,008,000			
国庫債券 利付(5年)第102回	2,900,000,000	2,915,718,000			
国庫債券 利付(5年)第103回	1,500,000,000	1,508,640,000			
国庫債券 利付(5年)第104回	1,000,000,000	1,002,800,000			

国庫債券 利付(5年)第105回	2,800,000,000	2,807,616,000	
国庫債券 利付(5年)第106回	2,200,000,000	2,205,698,000	
国庫債券 利付(5年)第107回	2,300,000,000	2,305,520,000	
国庫債券 利付(5年)第108回	300,000,000	299,610,000	
国庫債券 利付(5年)第109回	1,100,000,000	1,097,822,000	
国庫債券 利付(5年)第110回	1,000,000,000	1,005,910,000	
国庫債券 利付(5年)第111回	1,000,000,000	1,009,850,000	
国庫債券 利付(5年)第112回	1,000,000,000	1,009,840,000	
国庫債券 利付(5年)第113回	2,300,000,000	2,312,995,000	
国庫債券 利付(5年)第114回	800,000,000	804,432,000	
国庫債券 利付(5年)第115回	1,500,000,000	1,501,650,000	
国庫債券 利付(5年)第116回	3,200,000,000	3,202,240,000	
国庫債券 利付(5年)第117回	1,000,000,000	1,000,240,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	260,000,000	304,431,400	
国庫債券 利付(40年)第2回	400,000,000	447,784,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	440,000,000	492,949,600	
国庫債券 利付(40年)第4回	610,000,000	683,108,500	
国庫債券 利付(40年)第5回	600,000,000	637,848,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	700,000,000	723,485,000	
国庫債券 利付(10年)第270回	670,000,000	679,969,600	
国庫債券 利付(10年)第271回	850,000,000	861,619,500	
国庫債券 利付(10年)第272回	320,000,000	326,195,200	
国庫債券 利付(10年)第273回	690,000,000	704,365,800	
国庫債券 利付(10年)第274回	600,000,000	614,610,000	
国庫債券 利付(10年)第275回	1,500,000,000	1,533,960,000	
国庫債券 利付(10年)第276回	100,000,000	102,607,000	
国庫債券 利付(10年)第277回	750,000,000	772,357,500	
国庫債券 利付(10年)第278回	550,000,000	568,551,500	
国庫債券 利付(10年)第279回	920,000,000	954,638,000	

国庫債券 利付(10年)第280回	1,350,000,000	1,404,202,500	
国庫債券 利付(10年)第281回	800,000,000	833,888,000	
国庫債券 利付(10年)第282回	1,300,000,000	1,351,545,000	
国庫債券 利付(10年)第283回	1,400,000,000	1,458,954,000	
国庫債券 利付(10年)第284回	2,200,000,000	2,295,700,000	
国庫債券 利付(10年)第285回	2,620,000,000	2,743,873,600	
国庫債券 利付(10年)第286回	400,000,000	421,664,000	
国庫債券 利付(10年)第287回	1,550,000,000	1,638,923,500	
国庫債券 利付(10年)第288回	1,850,000,000	1,951,287,500	
国庫債券 利付(10年)第289回	2,000,000,000	2,101,360,000	
国庫債券 利付(10年)第290回	1,250,000,000	1,311,575,000	
国庫債券 利付(10年)第291回	1,400,000,000	1,463,448,000	
国庫債券 利付(10年)第292回	1,600,000,000	1,697,728,000	
国庫債券 利付(10年)第293回	750,000,000	801,510,000	
国庫債券 利付(10年)第294回	500,000,000	532,245,000	
国庫債券 利付(10年)第295回	1,600,000,000	1,689,792,000	
国庫債券 利付(10年)第296回	1,900,000,000	2,012,062,000	
国庫債券 利付(10年)第297回	700,000,000	739,949,000	
国庫債券 利付(10年)第298回	1,500,000,000	1,578,585,000	
国庫債券 利付(10年)第299回	1,400,000,000	1,476,776,000	
国庫債券 利付(10年)第300回	1,000,000,000	1,064,680,000	
国庫債券 利付(10年)第301回	1,500,000,000	1,601,070,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第302回	700,000,000	743,554,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	1,600,000,000	1,702,464,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,058,640,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	2,400,000,000	2,544,912,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,201,780,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	600,000,000	637,782,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	2,000,000,000	2,101,480,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	1,700,000,000	1,776,058,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	950,000,000	980,447,500	
国庫債券 利付(10年)第312回	2,450,000,000	2,591,781,500	
国庫債券 利付(10年)第313回	1,700,000,000	1,809,786,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	900,000,000	945,882,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	1,500,000,000	1,585,830,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	800,000,000	840,160,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	500,000,000	524,810,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	1,400,000,000	1,459,318,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,150,000,000	1,206,649,000	
国庫債券 利付(10年)第320回	1,900,000,000	1,978,679,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	1,500,000,000	1,561,620,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	600,000,000	619,806,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	700,000,000	722,666,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第324回	1,900,000,000	1,946,512,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	2,900,000,000	2,967,048,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	1,600,000,000	1,621,312,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	1,800,000,000	1,839,726,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	3,000,000,000	3,010,230,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	2,700,000,000	2,753,163,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	1,900,000,000	1,934,903,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,100,000,000	1,100,000,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	2,900,000,000	2,894,664,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	1,200,000,000	1,195,500,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	124,196,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	100,000,000	118,381,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	186,816,000	
国庫債券 利付(30年)第4回	120,000,000	150,585,600	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	171,925,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	130,000,000	152,483,500	
国庫債券 利付(30年)第7回	155,000,000	178,527,450	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	106,701,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	64,951,250	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	236,455,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	166,763,200	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	243,372,800	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	315,180,700	
国庫債券 利付(30年)第14回	380,000,000	438,265,400	
国庫債券 利付(30年)第15回	450,000,000	526,333,500	
国庫債券 利付(30年)第16回	315,000,000	368,074,350	
国庫債券 利付(30年)第17回	400,000,000	460,172,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	380,000,000	430,198,000	

国庫債券	利付（30年）第19回	300,000,000	339,444,000
国庫債券	利付（30年）第20回	290,000,000	338,464,800
国庫債券	利付（30年）第21回	270,000,000	305,132,400
国庫債券	利付（30年）第22回	400,000,000	466,468,000
国庫債券	利付（30年）第23回	340,000,000	396,654,200
国庫債券	利付（30年）第24回	300,000,000	349,824,000
国庫債券	利付（30年）第25回	390,000,000	439,881,000
国庫債券	利付（30年）第26回	650,000,000	745,459,000
国庫債券	利付（30年）第27回	550,000,000	642,125,000
国庫債券	利付（30年）第28回	700,000,000	818,342,000
国庫債券	利付（30年）第29回	700,000,000	805,553,000
国庫債券	利付（30年）第30回	800,000,000	905,552,000
国庫債券	利付（30年）第31回	800,000,000	889,264,000
国庫債券	利付（30年）第32回	970,000,000	1,099,592,000
国庫債券	利付（30年）第33回	1,070,000,000	1,146,376,600
国庫債券	利付（30年）第34回	1,000,000,000	1,114,070,000
国庫債券	利付（30年）第35回	1,100,000,000	1,178,331,000
国庫債券	利付（30年）第36回	1,100,000,000	1,178,177,000
国庫債券	利付（30年）第37回	1,100,000,000	1,153,262,000
国庫債券	利付（30年）第38回	700,000,000	717,059,000
国庫債券	利付（30年）第39回	700,000,000	732,326,000
国庫債券	利付（30年）第40回	600,000,000	614,190,000
国庫債券	利付（30年）第41回	700,000,000	700,000,000
国庫債券	利付（30年）第42回	200,000,000	199,602,000
国庫債券	利付（20年）第29回	310,000,000	328,767,400
国庫債券	利付（20年）第30回	10,000,000	10,531,100
国庫債券	利付（20年）第31回	110,000,000	117,387,600
国庫債券	利付（20年）第32回	41,000,000	43,914,690
国庫債券	利付（20年）第33回	410,000,000	447,519,100
国庫債券	利付（20年）第34回	190,000,000	209,093,100
国庫債券	利付（20年）第35回	228,000,000	249,561,960
国庫債券	利付（20年）第36回	380,000,000	417,870,800
国庫債券	利付（20年）第37回	320,000,000	352,998,400
国庫債券	利付（20年）第38回	170,000,000	187,120,700
国庫債券	利付（20年）第39回	511,000,000	560,444,360

国庫債券 利付(20年)第40回	525,000,000	574,717,500	
国庫債券 利付(20年)第41回	255,000,000	271,493,400	
国庫債券 利付(20年)第42回	483,000,000	540,510,810	
国庫債券 利付(20年)第43回	400,000,000	458,544,000	
国庫債券 利付(20年)第44回	150,000,000	169,882,500	
国庫債券 利付(20年)第45回	242,000,000	272,656,560	
国庫債券 利付(20年)第46回	90,000,000	100,690,200	
国庫債券 利付(20年)第47回	130,000,000	145,771,600	
国庫債券 利付(20年)第48回	200,000,000	228,834,000	
国庫債券 利付(20年)第49回	200,000,000	223,888,000	
国庫債券 利付(20年)第50回	183,000,000	202,366,890	
国庫債券 利付(20年)第51回	310,000,000	345,284,200	
国庫債券 利付(20年)第52回	100,000,000	112,291,000	
国庫債券 利付(20年)第53回	250,000,000	281,290,000	
国庫債券 利付(20年)第54回	250,000,000	283,160,000	
国庫債券 利付(20年)第55回	231,000,000	258,438,180	
国庫債券 利付(20年)第56回	120,000,000	134,470,800	
国庫債券 利付(20年)第57回	210,000,000	233,570,400	
国庫債券 利付(20年)第58回	180,000,000	200,554,200	
国庫債券 利付(20年)第59回	230,000,000	252,843,600	
国庫債券 利付(20年)第60回	380,000,000	408,055,400	
国庫債券 利付(20年)第61回	300,000,000	311,532,000	
国庫債券 利付(20年)第62回	440,000,000	448,857,200	
国庫債券 利付(20年)第63回	300,000,000	332,748,000	
国庫債券 利付(20年)第64回	400,000,000	447,792,000	
国庫債券 利付(20年)第65回	455,000,000	509,782,000	
国庫債券 利付(20年)第66回	300,000,000	333,207,000	
国庫債券 利付(20年)第67回	310,000,000	347,727,000	
国庫債券 利付(20年)第68回	290,000,000	333,624,700	
国庫債券 利付(20年)第69回	560,000,000	638,976,800	
国庫債券 利付(20年)第70回	540,000,000	633,565,800	
国庫債券 利付(20年)第71回	200,000,000	230,804,000	
国庫債券 利付(20年)第72回	670,000,000	767,478,300	
国庫債券 利付(20年)第73回	350,000,000	397,939,500	
国庫債券 利付(20年)第74回	320,000,000	367,043,200	

国庫債券 利付(20年)第75回	200,000,000	229,680,000	
国庫債券 利付(20年)第76回	430,000,000	484,760,500	
国庫債券 利付(20年)第77回	320,000,000	364,025,600	
国庫債券 利付(20年)第78回	310,000,000	349,596,300	
国庫債券 利付(20年)第79回	360,000,000	409,734,000	
国庫債券 利付(20年)第80回	320,000,000	367,737,600	
国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	410,119,200	
国庫債券 利付(20年)第82回	420,000,000	482,676,600	
国庫債券 利付(20年)第83回	370,000,000	425,633,200	
国庫債券 利付(20年)第84回	590,000,000	671,968,700	
国庫債券 利付(20年)第85回	400,000,000	460,296,000	
国庫債券 利付(20年)第86回	450,000,000	528,025,500	
国庫債券 利付(20年)第87回	390,000,000	453,328,200	
国庫債券 利付(20年)第88回	300,000,000	352,233,000	
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	546,266,900	
国庫債券 利付(20年)第90回	510,000,000	592,966,800	
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	293,680,000	
国庫債券 利付(20年)第92回	650,000,000	748,403,500	
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	341,682,000	
国庫債券 利付(20年)第95回	500,000,000	587,885,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	450,000,000	523,732,500	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	345,318,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	800,000,000	920,024,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	720,000,000	837,151,200	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	297,255,000	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	594,525,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	300,000,000	352,713,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	459,628,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	600,000,000	689,082,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	464,780,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	344,325,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第108回	700,000,000	784,343,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	500,000,000	559,300,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	700,000,000	802,312,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	500,000,000	579,240,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	800,000,000	915,608,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	1,300,000,000	1,485,588,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	800,000,000	912,704,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	577,570,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	500,000,000	576,645,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	900,000,000	1,024,992,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	561,155,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	400,000,000	437,028,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	500,000,000	531,840,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	900,000,000	994,833,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	700,000,000	763,525,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	900,000,000	1,019,880,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	600,000,000	671,040,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	600,000,000	687,960,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	400,000,000	446,360,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	500,000,000	550,495,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	800,000,000	878,648,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第129回	500,000,000	541,645,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	900,000,000	972,360,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	300,000,000	319,353,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	500,000,000	530,710,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	900,000,000	969,687,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	400,000,000	429,752,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	400,000,000	423,300,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	500,000,000	521,085,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	400,000,000	422,008,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	400,000,000	409,068,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	400,000,000	415,532,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	1,300,000,000	1,367,249,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	900,000,000	943,542,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	500,000,000	532,425,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	800,000,000	823,360,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	500,000,000	506,350,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	1,400,000,000	1,459,178,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	1,400,000,000	1,454,236,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	1,600,000,000	1,630,544,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	500,000,000	499,615,000	
ポーランド共和国 第12回円貨債	100,000,000	101,922,000	

		券(2012)		
	小計	銘柄数:267 組入時価比率:78.5%	216,189,000,000	228,251,802,200 79.3%
	合計			228,251,802,200
地方債証券	日本円	東京都 公募第622回	300,000,000	304,236,000
		東京都 公募第644回	60,000,000	62,884,200
		東京都 公募第660回	100,000,000	105,823,000
		東京都 公募第671回	100,000,000	106,113,000
		東京都 公募第703回	100,000,000	103,643,000
		東京都 公募第708回	100,000,000	102,633,000
		東京都 公募第712回	100,000,000	101,491,000
		東京都 公募第716回	200,000,000	202,730,000
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	113,412,000
		東京都 公募第10回	200,000,000	219,346,000
		東京都 公募第1回	300,000,000	323,655,000
		東京都 公募第7回	100,000,000	114,855,000
		東京都 公募第23回	100,000,000	112,573,000
		北海道 公募平成18年度第6回	100,000,000	104,599,000
		北海道 公募平成19年度第4回	100,000,000	105,724,000
		北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	106,844,000
		北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	106,501,000
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	101,717,000
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	101,218,000
		神奈川県 公募第184回	100,000,000	104,020,000
		神奈川県 公募第188回	200,000,000	208,026,000
		神奈川県 公募第200回	100,000,000	101,332,000
		神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	115,203,000
		神奈川県 公募第7回	200,000,000	230,930,000
		大阪府 公募第285回	150,000,000	153,441,000
		大阪府 公募第291回	100,000,000	104,084,000
		大阪府 公募第303回	300,000,000	316,776,000
		大阪府 公募第337回	200,000,000	212,896,000
		大阪府 公募第346回	100,000,000	105,369,000
		大阪府 公募第356回	100,000,000	103,748,000
大阪府 公募第5回	100,000,000	112,618,000		
大阪府 公募第8回	100,000,000	106,183,000		

京都府	公募平成18年度第1回	160,000,000	166,784,000	
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,750,000	
兵庫県	公募平成21年度第13回	100,000,000	106,226,000	
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	109,306,000	
兵庫県	公募第2回	100,000,000	116,943,000	
兵庫県	公募第9回	100,000,000	114,507,000	
静岡県	公募平成19年度第4回	200,000,000	212,076,000	
静岡県	公募平成21年度第2回	100,000,000	107,289,000	
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	107,074,000	
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	108,392,000	
愛知県	公募平成19年度第3回	111,000,000	117,456,870	
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	112,767,000	
愛知県	公募平成21年度第3回	114,000,000	122,372,160	
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	106,485,000	
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	106,359,000	
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	105,084,000	
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	103,379,000	
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	105,537,000	
広島県	公募平成22年度第6回	200,000,000	211,418,000	
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	101,643,000	
埼玉県	公募平成19年度第7回	200,000,000	211,380,000	
埼玉県	公募平成21年度第5回	100,000,000	106,222,000	
埼玉県	公募平成22年度第2回	200,000,000	212,780,000	
埼玉県	公募平成24年度第4回	100,000,000	102,142,000	
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	149,724,200	
福岡県	公募平成18年度第1回	200,000,000	209,466,000	
福岡県	公募平成19年度第6回	100,000,000	105,371,000	
福岡県	公募平成20年度第3回	100,000,000	105,842,000	
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	103,904,000	
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	106,946,000	
千葉県	公募平成20年度第6回	100,000,000	106,448,000	
千葉県	公募平成21年度第11回	180,000,000	191,674,800	
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	103,902,000	
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,767,000	
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	101,841,000	

千葉県 公募（20年）第8回	100,000,000	113,805,000	
新潟県 公募平成21年度第2回	150,000,000	160,615,500	
群馬県 公募第8回	100,000,000	103,906,000	
共同発行市場地方債 公募第26回	300,000,000	304,044,000	
共同発行市場地方債 公募第27回	100,000,000	101,449,000	
共同発行市場地方債 公募第28回	129,500,000	131,496,890	
共同発行市場地方債 公募第31回	200,000,000	204,266,000	
共同発行市場地方債 公募第32回	100,000,000	102,424,000	
共同発行市場地方債 公募第34回	100,000,000	102,304,000	
共同発行市場地方債 公募第35回	100,000,000	102,799,000	
共同発行市場地方債 公募第56回	400,000,000	422,492,000	
共同発行市場地方債 公募第62回	100,000,000	106,384,000	
共同発行市場地方債 公募第64回	100,000,000	106,764,000	
共同発行市場地方債 公募第82回	300,000,000	319,458,000	
共同発行市場地方債 公募第84回	500,000,000	531,740,000	
共同発行市場地方債 公募第85回	100,000,000	106,755,000	
共同発行市場地方債 公募第88回	100,000,000	105,180,000	
共同発行市場地方債 公募第93回	300,000,000	317,148,000	
共同発行市場地方債 公募第94回	300,000,000	316,941,000	
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	155,955,000	
共同発行市場地方債 公募第113回	200,000,000	203,040,000	
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	101,669,000	
共同発行市場地方債 公募第116回	100,000,000	101,601,000	
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	202,874,000	
共同発行市場地方債 公募第120回	200,000,000	200,688,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	101,200,000	
熊本県 公募平成18年度第2回	173,000,000	180,331,740	
静岡市 公募平成17年度第1回	100,000,000	102,407,000	
大阪市 公募平成17年度第4回	100,000,000	101,727,000	
大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	107,002,000	
大阪市 公募（15年）第1回	100,000,000	109,740,000	

大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	118,145,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	114,646,000	
名古屋市 公募第460回	100,000,000	105,458,000	
名古屋市 公募第464回	100,000,000	106,205,000	
名古屋市 公募第469回	100,000,000	106,001,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	104,112,000	
名古屋市 公募第12回ひ号	100,000,000	101,526,000	
京都市 公募平成19年度第4回	190,000,000	200,505,100	
神戸市 公募平成17年度13回	100,000,000	102,742,000	
神戸市 公募平成21年度第7回	100,000,000	107,367,000	
横浜市 公募公債平成17年度2回	205,000,000	208,050,400	
横浜市 公募平成21年度第4回	200,000,000	211,766,000	
横浜市 公募平成22年度第5回	100,000,000	105,818,000	
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	203,574,000	
札幌市 公募平成19年度第3回	100,000,000	105,544,000	
札幌市 公募平成22年度第4回	100,000,000	104,404,000	
川崎市 公募第82回	100,000,000	106,772,000	
川崎市 公募第85回	100,000,000	100,825,000	
北九州市 公募平成18年度第2回	170,000,000	177,512,300	
福岡市 公募平成20年度第3回	100,000,000	105,483,000	
福岡市 公募平成24年度第5回	100,000,000	100,015,000	
広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	105,894,000	
千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	103,782,000	
さいたま市 公募第3回	100,000,000	102,354,000	
鹿児島県 公募平成18年度第1回	178,200,000	186,220,782	
福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	98,331,000	
山梨県 公募平成19年度第1回	200,000,000	212,034,000	
岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	106,329,000	
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	115,201,000	
福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	114,119,000	
東京都住宅供給公社債券 第4回	300,000,000	312,201,000	
東京都住宅供給公社債券 第5回	200,000,000	211,028,000	
小計	銘柄数: 130 組入時価比率: 6.5%	17,868,700,000	18,831,051,942 6.5%

合計			18,831,051,942	
特殊債券	日本円	韓国産業銀行 第45回円貨社債 (2014)	100,000,000	99,579,000
		日本政策投資銀行債券 政府保証第 18回	100,000,000	105,881,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債 第25回	100,000,000	100,752,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債 第26回	100,000,000	101,429,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 5回	100,000,000	105,883,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 9回	100,000,000	104,184,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 10回	100,000,000	101,141,000
		日本政策投資銀行債券 財投機関債 第29回	200,000,000	209,162,000
		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	215,888,000
		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	102,466,520
		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	305,448,000
		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	102,526,000
		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	112,147,000
		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	205,086,000
		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	234,110,000
		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	232,914,000
		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	230,300,000
		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	106,724,000
		日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第86回	200,000,000	204,918,000
		日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第102回	100,000,000	99,591,000

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	117,770,350	
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	205,096,000	
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	102,842,000	
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	110,232,000	
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	110,266,000	
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	187,137,000	
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	105,884,000	
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	144,546,240	
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	148,490,920	
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	212,724,000	
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	226,914,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	226,698,000	
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	317,811,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	229,370,000	
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	426,224,000	
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	226,100,000	
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	219,872,000	
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	107,634,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	300,000,000	316,242,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	102,218,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	103,407,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,708,000	

券 政府保証債第170回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第171回	100,000,000	102,112,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第173回	200,000,000	203,952,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第175回	200,000,000	203,364,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第180回	200,000,000	202,222,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第183回	100,000,000	104,238,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第190回	200,000,000	199,476,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第193回	200,000,000	204,310,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第197回	200,000,000	203,278,000	
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	119,917,000	
公営企業債券 政府保証第852回	200,000,000	202,962,000	
公営企業債券 政府保証第855回	100,000,000	101,736,000	
公営企業債券 政府保証第856回	355,000,000	362,671,550	
公営企業債券 政府保証第857回	200,000,000	204,950,000	
公営企業債券 政府保証第858回	200,000,000	204,836,000	
公営企業債券 政府保証第864回	135,000,000	140,337,900	
公営企業債券 政府保証第881回	200,000,000	210,162,000	
公営企業債券 政府保証第886回	103,000,000	109,988,550	
公営企業債券 30年第4回財投機 関債	100,000,000	121,952,000	
公営企業債券 政府保証15年第1 回	300,000,000	323,895,000	
地方公共団体金融機構債券 第1回	100,000,000	107,012,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保 証第5回	200,000,000	210,460,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第4回	100,000,000	112,260,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第6回	300,000,000	341,247,000	
地方公共団体金融機構債券 F24 回	100,000,000	108,695,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保	100,000,000	104,217,000	

証第16回			
地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	104,883,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	200,000,000	207,326,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	104,680,000	
地方公共団体金融機構債券 第37回	300,000,000	305,571,000	
地方公共団体金融機構債券 F144回	200,000,000	201,960,000	
地方公共団体金融機構債券 第44回	100,000,000	101,009,000	
地方公共団体金融機構債券 第52回	300,000,000	303,891,000	
公営企業債券 20年第2回財投機関債	100,000,000	106,648,000	
公営企業債券 第24回財投機関債	100,000,000	104,797,000	
首都高速道路債券 政府保証第198回	101,000,000	102,485,710	
阪神高速道路債券 政府保証第146回	101,000,000	102,398,850	
中小企業債券 政府保証第186回	100,000,000	101,719,000	
中小企業債券 第6回財投機関債	100,000,000	102,224,000	
国際協力銀行債券 第21回財投機関債	100,000,000	102,079,000	
国際協力銀行債券 第27回財投機関債	200,000,000	209,368,000	
都市再生債券 財投機関債第21回	300,000,000	319,299,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	114,616,000	
東京交通債券 第342回	200,000,000	228,674,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	176,056,660	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	102,423,000	
預金保険機構債券 政府保証第191回	100,000,000	99,916,000	
預金保険機構債券 政府保証第194回	300,000,000	299,325,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回	200,000,000	212,826,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第41回	100,000,000	106,542,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	111,436,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	108,551,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	109,609,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	109,430,000	
国民生活債券 政府保証第17回	200,000,000	205,814,000	
商工債券 利付第734回い号	100,000,000	100,879,000	
商工債券 利付第739回い号	100,000,000	100,873,000	
商工債券 利付第740回い号	100,000,000	100,759,000	
商工債券 利付第742回い号	100,000,000	100,639,000	
商工債券 利付第753回い号	100,000,000	100,097,000	
農林債券 利付第729回い号	100,000,000	101,068,000	
農林債券 利付第741回い号	150,000,000	151,258,500	
農林債券 利付第743回い号	100,000,000	100,686,000	
農林債券 利付第745回い号	100,000,000	100,386,000	
農林債券 利付第751回い号	200,000,000	200,364,000	
農林債券 利付第759回い号	100,000,000	100,479,000	
農林債券 利付第760回い号	100,000,000	100,465,000	
しんきん中金債券 利付第246回	100,000,000	100,569,000	
しんきん中金債券 利付第259回	100,000,000	100,859,000	
しんきん中金債券 利付第271回	200,000,000	201,030,000	
しんきん中金債券 利付第284回	100,000,000	100,685,000	
しんきん中金債券 利付第286回	100,000,000	100,444,000	
しんきん中金債券 利付第287回	100,000,000	100,203,000	
商工債券 利付(10年)第5回	500,000,000	529,250,000	
韓国ガス公社 第6回円貨債券(支配権変更プットオプション条項)	100,000,000	101,555,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	100,000,000	111,249,000	
東日本高速道路債券 政府保証第2回	120,000,000	122,862,000	
中日本高速道路債券 政府保証第2回	100,000,000	102,389,000	
中日本高速道路債券 政府保証第1回	138,000,000	144,717,840	

3回			
中日本高速道路債券 財投機関債第3回	100,000,000	105,769,000	
中日本高速道路社債 第32回	100,000,000	101,500,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	100,917,000	
中日本高速道路社債 第47回	100,000,000	100,009,000	
西日本高速道路債券 政府保証第1回	215,000,000	220,267,500	
西日本高速道路債券 政府保証第2回	176,000,000	183,536,320	
西日本高速道路債券 政府保証第3回	151,000,000	157,686,280	
西日本高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	104,868,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回	200,000,000	209,740,000	
緑資源債券 財投機関債第4回	100,000,000	102,053,000	
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	19,778,000	20,778,371	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	74,487,000	77,895,525	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	137,485,000	144,652,093	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	81,513,000	86,273,359	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	79,798,000	86,568,062	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	28,457,000	30,758,886	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	82,176,000	86,994,800	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	42,071,000	44,762,702	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	79,605,000	83,400,566	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	181,476,000	190,800,236	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	146,430,000	155,871,806	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	150,180,000	162,786,109	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機	85,646,000	91,200,999	

		構債券			
		貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	44,876,000	48,073,863	
		貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	54,767,000	59,147,264	
		貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	184,185,000	196,293,321	
		貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	168,608,000	174,549,745	
		貸付債権担保5種第17回住宅金融支援機構債券	100,236,000	105,644,734	
		貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	251,976,000	266,885,419	
		貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	175,998,000	183,094,239	
		貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	110,096,000	119,263,693	
		貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	253,752,000	270,372,756	
		貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	246,087,000	253,587,731	
		貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	274,341,000	282,184,409	
		貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	183,972,000	188,002,826	
		貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	87,073,000	91,359,603	
		貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	169,856,000	177,754,304	
		貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	98,923,000	99,465,098	
		貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	96,096,000	96,830,173	
	小計	銘柄数：159 組入時価比率：8.5%	23,562,944,000	24,742,489,382 8.6%	
	合計			24,742,489,382	
社債券	日本円	G E キャピタルコーポレーション 第12回円貨社債	100,000,000	101,477,000	
		J P モルガン・チェース・アンド・カンパニー 第9回円貨社債	100,000,000	102,711,000	
		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	106,207,000	

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	204,544,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第4回円貨社債(2013)	100,000,000	100,265,000	
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	101,716,000	
オーストラリア・コモンウェルス銀行 第5回円貨社債(2011)	200,000,000	202,706,000	
ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第9回円貨社債	100,000,000	102,634,000	
オーストラリア・ニューージーランド銀行 第7回円貨社債	100,000,000	102,746,000	
ラボバンク・ネダーランド 第16回円貨社債(2012)(コー	100,000,000	102,299,000	
ラボバンク・ネダーランド 第17回円貨社債(2012)(コー	100,000,000	100,440,000	
ラボバンク・ネダーランド 第18回円貨社債(2012)(コー	100,000,000	101,161,000	
ウォルマート・ストアーズ・インク 第4回円貨社債	100,000,000	100,911,000	
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,609,000	
サッポロホールディングス 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,979,000	
キッコーマン 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,320,000	
ニチレイ 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,671,000	
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	106,904,000	
日本製紙グループ本社 第8回日本製紙株式会社保証付	100,000,000	104,848,000	
住友化学 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,773,000	
三菱化学 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,387,000	
三井化学 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,002,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,476,000	
武田薬品工業 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,342,000	
JXホールディングス 第1回社債	100,000,000	100,852,000	

間限定同順位特約付			
新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,917,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,858,000	
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	101,784,000	
豊田自動織機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,137,000	
東芝 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,105,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,601,000	
日本電気 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,950,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,411,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,818,000	
パナソニック 第10回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,978,000	
ソニー 第26回	100,000,000	106,382,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,070,000	
川崎重工業 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,508,000	
日本生命2010基金特定目的会社 第1回特定社債	100,000,000	100,839,000	
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,904,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	102,529,000	
伊藤忠商事 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,502,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,475,000	
丸紅 第72回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,854,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,908,000	
三井物産 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,754,000	

三井物産 第58回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,670,000	
住友商事 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,873,000	
三菱商事 第53回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,798,000	
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	106,062,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	106,820,000	
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,845,000	
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	116,973,000	
みずほコーポレート銀行 第29回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,294,000	
みずほコーポレート銀行 第32回特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,895,000	
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	113,663,000	
三菱東京UFJ銀行 第93回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,287,000	
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	200,850,000	
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	104,025,000	
三菱東京UFJ銀行 第11回(劣後特約付)	100,000,000	105,263,000	
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,744,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	107,528,000	
住友信託銀行 第5回劣後特約付	100,000,000	104,113,000	
みずほ信託銀行 第1回劣後特約付	100,000,000	102,833,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,035,000	
三井住友銀行 第52回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,438,000	
三井住友銀行 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,235,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	107,034,000	
みずほ銀行 第6回劣後特約付	200,000,000	210,206,000	

日産フィナンシャルサービス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,767,000	
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	209,476,000	
オリックス 第144回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,274,000	
オリックス 第148回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,729,000	
オリックス 第164回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,431,000	
三井住友ファイナンス&リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,478,000	
三菱UFJリース 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,610,000	
野村ホールディングス 第6回	100,000,000	104,475,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	107,314,000	
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	104,947,000	
三井不動産 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,676,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	114,315,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,244,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	102,279,000	
住友不動産 第73回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,782,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,700,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	102,147,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,664,000	
京成電鉄 第42回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,290,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	114,173,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,720,000	
東日本旅客鉄道 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,848,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限	100,000,000	108,427,000	

定同順位特約付			
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,067,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,416,000	
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,453,000	
東海旅客鉄道 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,050,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	226,650,000	
日本電信電話 第51回	300,000,000	312,585,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	105,816,000	
KDDI 第5回2号	100,000,000	109,034,000	
NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,077,000	
東京電力 第428回	300,000,000	307,251,000	
東京電力 第459回	100,000,000	99,616,000	
東京電力 第560回	100,000,000	82,135,000	
東京電力 第565回	300,000,000	271,791,000	
中部電力 第406回	200,000,000	208,674,000	
中部電力 第482回	200,000,000	218,206,000	
関西電力 第448回	200,000,000	213,376,000	
関西電力 第469回	100,000,000	105,009,000	
中国電力 第314回	100,000,000	110,285,000	
中国電力 第330回	100,000,000	110,123,000	
中国電力 第378回	100,000,000	100,778,000	
北陸電力 第245回	200,000,000	208,744,000	
北陸電力 第248回	100,000,000	107,915,000	
東北電力 第431回	400,000,000	426,096,000	
四国電力 第281回	200,000,000	203,414,000	
九州電力 第389回	200,000,000	207,700,000	
九州電力 第409回	100,000,000	105,174,000	
北海道電力 第285回	100,000,000	103,003,000	
北海道電力 第296回	100,000,000	106,401,000	
電源開発 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,786,000	
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,408,000	

	位特約付			
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,935,000	
	大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,191,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,482,000	
	NTTデータ 第24回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,142,000	
小計	銘柄数：126 組入時価比率：5.6%	15,600,000,000	16,196,297,000 5.6%	
合計			16,196,297,000	
合計			288,021,640,524	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成26年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,903,917,280
コール・ローン	774,390,212
国債証券	291,023,916,962
派生商品評価勘定	3,600,920
未収利息	3,253,068,279
前払費用	154,112,127
流動資産合計	297,113,005,780
資産合計	297,113,005,780
負債の部	
流動負債	
未払金	258,978,480
未払解約金	310,852,401
その他未払費用	3,356,500
流動負債合計	573,187,381
負債合計	573,187,381
純資産の部	
元本等	
元本	143,676,953,033
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	152,862,865,366
元本等合計	296,539,818,399

(平成26年 3月31日現在)

純資産合計	296,539,818,399
負債純資産合計	297,113,005,780

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成26年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0639円
(10,000口当たり純資産額)	(20,639円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

<p>自 平成25年 4月 2日</p> <p>至 平成26年 3月31日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p>

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成26年 3月31日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成26年 3月31日現在	
期首	平成25年 4月 2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	161,684,302,214円
同期中における追加設定元本額	26,189,359,874円
同期中における一部解約元本額	44,196,709,055円
期末元本額	143,676,953,033円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	88,620,623円
バランスセレクト50	99,576,753円
バランスセレクト70	71,331,116円
野村外国債券インデックスファンド	288,110,427円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,893,174,369円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	41,773,882,458円

野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,000,037,655円
野村資産設計ファンド2015	97,639,859円
野村資産設計ファンド2020	64,973,896円
野村資産設計ファンド2025	56,524,535円
野村資産設計ファンド2030	45,747,680円
野村資産設計ファンド2035	30,760,917円
野村資産設計ファンド2040	97,043,106円
野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け）	10,936,250,243円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,809,606,333円
のむラップ・ファンド（普通型）	1,680,061,967円
のむラップ・ファンド（積極型）	699,149,116円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	1,697,867,859円
野村資産設計ファンド2045	2,995,604円
野村インデックスファンド・外国債券	211,297,904円
マイ・ロード	5,148,295,463円
ネクストコア	692,381,825円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	9,919,981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）	62,703,075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）	12,441,169,452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）	1,169,434,324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）	17,270,097,344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）	3,294,211,105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）	10,997,943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）	42,364,779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）	7,993,215円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	9,723,431,086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）	750,363,274円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	2,731,841,793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）	361,055,813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）	95,364,797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）	299,572,426円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	2,699,247,456円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,380,154,369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）	2,129,461,714円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,563,663円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	6,743,452円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	4,211,597円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	493,821,067円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,490,718,118円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	1,997,769,202円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	1,874,667,417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）	10,390,683,242円
マイバランスDC30	723,300,749円
マイバランスDC50	386,892,615円
マイバランスDC70	220,770,155円
野村DC外国債券インデックスファンド	1,408,476,469円
野村DC運用戦略ファンド	693,912,165円
野村DC運用戦略ファンドM	10,822,780円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成26年 3月31日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成26年 3月31日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	4,000,000.00	4,622,968.40	
		US TREASURY BOND	9,400,000.00	10,739,132.46	
		US TREASURY BOND	7,000,000.00	8,232,929.60	
		US TREASURY BOND	5,000,000.00	6,195,703.00	
		US TREASURY BOND	3,500,000.00	4,693,007.55	
		US TREASURY BOND	3,200,000.00	4,240,749.76	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,800,625.00	
		US TREASURY BOND	3,700,000.00	5,163,523.16	
		US TREASURY BOND	4,500,000.00	5,879,531.25	
		US TREASURY BOND	4,200,000.00	5,533,171.56	
		US TREASURY BOND	1,300,000.00	1,794,101.53	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,697,812.40	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,564,765.60	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,509,375.00	
		US TREASURY BOND	3,400,000.00	3,931,781.08	
		US TREASURY BOND	1,600,000.00	1,400,874.88	
		US TREASURY BOND	500,000.00	519,335.90	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,082,187.20	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,023,046.00	
		US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,259,100.60	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,023,828.00			
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,254,296.00			

US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,489,843.20	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,228,515.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,026,171.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,255,000.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,012,694.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,210,156.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,669,374.40	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,161,562.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,023,437.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,195,000.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,998,046.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,137,812.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,680,468.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,159,257.70	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,997,304.50	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,994,843.60	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,371,250.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,089,062.50	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	11,309,238.15	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,212,109.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,196,640.40	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,993,671.80	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,750,859.05	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,251,015.10	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,977,929.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,133,710.90	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,785,936.80	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,237,656.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,105,156.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,995,507.50	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,483,436.80	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,005,194.70	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,615,234.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,802,187.20	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,507,303.90	

US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,033,281.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,019,843.60	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,575,781.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,492,187.20	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,706,288.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,418,124.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,008,202.90	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,662,500.00	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,010,663.80	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,572,695.20	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,605,468.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,995,000.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,622,265.40	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,587,460.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,538,476.50	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,431,249.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,230,273.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,919,687.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,334,374.40	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,966,249.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,123,437.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,239,453.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,113,671.50	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,971,015.40	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,427,500.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,880,000.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,199,687.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,932,343.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,410,937.50	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,323,437.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,949,453.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,893,320.20	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,869,296.70	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,223,125.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,974,414.00	

US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,156,250.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,981,015.40	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,639,140.40	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,986,405.80	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,898,593.20	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,038,437.20	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,961,718.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,911,914.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,934,765.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,961,718.50	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,408,241.85	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	11,128,343.22	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,952,968.40	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,866,327.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,915,781.20	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	10,043,812.04	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,761,328.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,937,500.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,812,500.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	13,094,061.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,787,500.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,671,249.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,941,874.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,977,265.40	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,288,281.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,931,562.20	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,341,757.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,041,015.50	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,975,389.80	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,705,858.40	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,359,218.75	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	8,739,140.40	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,322,753.70	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,666,718.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,450,000.00	

	US TREASURY N/B	8,200,000.00	7,596,851.46	
	US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,377,874.56	
	US TREASURY N/B	9,200,000.00	8,531,562.04	
	US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,855,625.00	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,039,375.00	
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,227,000.00	
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,208,007.75	
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	4,122,343.75	
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,525,156.25	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,109,960.60	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,308,945.20	
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,947,343.60	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,423,242.10	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,265,624.80	
	US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,878,406.25	
	US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,997,624.56	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,590,859.20	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,116,444.70	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,043,984.05	
	US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,437,218.56	
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	2,997,968.75	
	US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,420,000.00	
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,292,703.02	
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,249,000.00	
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,522,500.00	
	US TREASURY NOTE	7,500,000.00	8,300,390.25	
	US TREASURY NOTE	7,000,000.00	7,413,984.20	
小計	銘柄数：154	1,034,400,000.00	1,084,875,998.64	
			(111,655,437,780)	
	組入時価比率：37.7%		38.4%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	2,800,000.00	2,817,836.00	
	CANADA GOVERNMENT	2,000,000.00	2,081,080.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,000,130.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,578,816.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,160,350.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,203,900.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,250,240.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,635,205.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	503,565.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,016,020.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,905,604.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	903,906.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,288,677.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,555,254.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,659,392.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	701,645.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,073,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,847,546.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,271,717.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,421,432.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,206,420.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	2,246,496.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,477,952.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	3,709,212.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	9,180,408.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	716,598.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,673,100.00	
小計	銘柄数：27	64,800,000.00	72,086,497.00	
			(6,716,298,925)	
	組入時価比率：2.3%		2.3%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,000,000.00	13,349,050.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,000,000.00	26,705,000.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	27,000,000.00	28,279,800.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	11,849,750.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	15,274,500.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	37,000,000.00	40,788,800.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,000,000.00	12,873,900.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	31,000,000.00	35,014,500.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,000,000.00	26,121,250.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	6,200,400.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	18,155,340.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,000,000.00	48,149,200.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	4,696,836.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	16,445,250.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	61,196,100.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,000,000.00	8,136,450.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	12,000,000.00	13,664,400.00
	銘柄数：17	345,000,000.00	386,900,526.00 (3,052,645,150)
組入時価比率：1.0%		1.0%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,037,000.00
	BELGIUM KINGDOM	4,300,000.00	4,945,503.10
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,219,210.00
	BELGIUM KINGDOM	3,900,000.00	4,564,170.00
	BELGIUM KINGDOM	2,300,000.00	2,740,680.00
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,041,400.00
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	2,067,030.00
	BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,818,450.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	1,500,000.00	1,614,600.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	4,000,000.00	4,210,000.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,800,000.00	4,074,360.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,800,000.00	3,095,120.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,000,000.00	3,510,300.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,500,000.00	2,825,375.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,700,000.00	3,097,710.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	4,200,000.00	5,635,140.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	6,500,000.00	8,596,295.50
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,149,760.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,200,000.00	5,428,800.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,267,708.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,150,750.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,800,000.00	4,009,950.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,545,660.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	5,055,790.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,112,920.00

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,086,095.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,356,800.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000.00	5,112,450.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,900,000.00	4,368,390.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,800,000.00	4,190,640.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,250,190.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000.00	5,350,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,637,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,958,940.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,302,400.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,800,000.00	6,591,410.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,455,545.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,715,050.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,717,860.00
BUNDES Obligation	2,000,000.00	2,049,160.00
BUNDES Obligation	5,000,000.00	5,261,900.00
BUNDES Obligation	4,000,000.00	4,109,920.00
BUNDES Obligation	2,500,000.00	2,511,700.00
BUNDES Obligation	2,000,000.00	1,985,860.00
BUNDES Obligation	2,100,000.00	2,145,150.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000.00	9,351,360.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000.00	9,533,250.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,433,900.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	6,590,580.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	9,040,240.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	6,829,500.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	6,043,180.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,760,900.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,318,290.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,500,000.00	5,140,935.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,663,650.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,062,375.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	7,159,140.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,254,400.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,160,400.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,200,000.00	2,236,960.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,729,430.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	3,223,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	3,562,180.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	5,743,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	4,613,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	4,313,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	4,641,300.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	4,663,680.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	5,556,456.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,300,000.00	5,512,686.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	4,725,742.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000.00	4,512,964.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000.00	2,814,396.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,200,000.00	2,239,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,047,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,200,000.00	5,344,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,500,000.00	13,003,375.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,067,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	4,235,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,028,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000.00	11,708,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,357,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,400,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,534,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,658,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,700,000.00	8,667,890.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,606,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,758,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,393,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,578,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,183,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,550,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,900,000.00	6,625,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	5,005,800.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	6,067,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,000,000.00	6,657,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,396,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	3,760,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	964,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,300,000.00	3,534,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,300,000.00	7,151,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,200,000.00	4,825,380.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	4,730,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000.00	5,437,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,541,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	4,514,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	11,828,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	992,610.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,283,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	7,289,090.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,100,000.00	7,960,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000.00	1,776,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	6,405,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,600,000.00	7,061,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,705,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	5,348,130.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,500,000.00	7,363,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,900,000.00	7,772,160.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,051,350.00	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	825,680.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,234,800.00	
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	611,910.00	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	944,400.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,703,850.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,800,000.00	2,065,680.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,183,680.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,893,680.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	424,720.00	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	509,350.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,000,000.00	7,246,540.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	7,829,625.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,000,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,000,000.00	7,436,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,700,000.00	9,750,090.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	8,276,250.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,700,000.00	8,721,020.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	5,679,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,500,000.00	2,533,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,800,000.00	6,713,790.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,009,150.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	8,749,875.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,500,000.00	4,922,050.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,890,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,800,000.00	7,737,720.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,476,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000.00	7,551,050.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,400,000.00	7,200,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	5,861,270.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	4,164,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	7,810,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,700,000.00	10,490,460.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000.00	8,996,650.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,800,000.00	7,639,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,200,000.00	8,445,020.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,900,000.00	7,033,705.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,300,000.00	5,576,240.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,800,000.00	5,666,640.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	9,573,750.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,390,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,400,000.00	1,675,730.00	
FRENCH TREASURY NOTE	3,500,000.00	3,581,725.00	
FRENCH TREASURY NOTE	5,200,000.00	5,402,280.00	
FRENCH TREASURY NOTE	1,000,000.00	1,051,700.00	
FRENCH TREASURY NOTE	4,000,000.00	4,161,800.00	

FRENCH TREASURY NOTE	2,000,000.00	2,036,200.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	1,500,000.00	1,707,600.00	
IRISH GOVERNMENT	2,800,000.00	3,030,020.00	
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	924,320.00	
IRISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,273,300.00	
IRISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,217,950.00	
IRISH GOVERNMENT	2,300,000.00	2,625,795.00	
IRISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,762,800.00	
IRISH GOVERNMENT	2,500,000.00	3,008,750.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,677,165.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	1,991,700.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,883,850.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,800,000.00	1,909,890.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	5,660,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	513,475.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	4,905,870.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,200,000.00	1,226,160.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,800,000.00	3,253,320.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,800,000.00	3,211,740.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,100,000.00	3,510,130.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	632,940.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	4,112,150.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,300,000.00	3,412,510.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,404,340.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,000,000.00	4,177,200.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,200,000.00	5,295,641.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,000,000.00	3,733,224.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,563,750.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,200,000.00	2,399,100.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,625,622.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,616,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	3,869,250.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,740,800.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,600,000.00	2,988,700.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,743,750.00	

小計	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,283,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,940,250.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	3,372,485.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,800,000.00	4,820,300.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	774,550.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	1,400,000.00	1,531,110.00	
	SPANISH GOVERNMENT	4,300,000.00	4,887,165.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,100,000.00	6,394,125.00	
	SPANISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,747,600.00	
	SPANISH GOVERNMENT	4,600,000.00	4,712,930.00	
	銘柄数：210	798,500,000.00	918,329,668.90	
		(130,081,397,599)		
	組入時価比率：43.9%	44.8%		
英ポンド	UK TREASURY	4,000,000.00	4,240,800.00	
	UK TREASURY	4,100,000.00	4,195,120.00	
	UK TREASURY	5,300,000.00	5,696,440.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	2,951,330.00	
	UK TREASURY	2,000,000.00	2,494,600.00	
	UK TREASURY	4,000,000.00	3,951,600.00	
	UK TREASURY	4,800,000.00	5,442,240.00	
	UK TREASURY	4,600,000.00	4,519,040.00	
	UK TREASURY	4,700,000.00	5,294,080.00	
	UK TREASURY	900,000.00	890,190.00	
	UK TREASURY	3,900,000.00	4,260,750.00	
	UK TREASURY	3,700,000.00	4,253,890.00	
	UK TREASURY	3,700,000.00	4,049,280.00	
	UK TREASURY	2,400,000.00	3,304,800.00	
	UK TREASURY	4,000,000.00	4,376,400.00	
	UK TREASURY	4,200,000.00	4,672,080.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	2,717,590.00	
	UK TREASURY	4,600,000.00	4,418,760.00	
	UK TREASURY	3,500,000.00	4,211,200.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,600,150.00	
	UK TREASURY	2,100,000.00	2,815,050.00	
UK TREASURY	3,200,000.00	3,819,200.00		

	UK TREASURY	4,000,000.00	4,512,000.00	
	UK TREASURY	1,900,000.00	2,212,930.00	
	UK TREASURY	4,300,000.00	4,850,400.00	
	UK TREASURY	3,300,000.00	4,021,710.00	
	UK TREASURY	3,400,000.00	3,850,840.00	
	UK TREASURY	1,850,000.00	2,097,530.00	
	UK TREASURY	7,600,000.00	9,010,560.00	
	UK TREASURY	3,200,000.00	3,672,960.00	
	UK TREASURY	2,600,000.00	3,011,060.00	
	UK TREASURY	2,400,000.00	2,530,800.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	2,800,000.00	2,661,120.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,100,000.00	7,162,620.00	
小計	銘柄数：34	121,250,000.00	134,769,120.00	
			(23,087,297,947)	
	組入時価比率：7.8%		7.9%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	5,900,000.00	6,695,910.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	1,000,000.00	1,356,800.00	
小計	銘柄数：2	6,900,000.00	8,052,710.00	
			(935,241,739)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	6,000,000.00	6,314,100.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,000,000.00	10,502,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,000,000.00	14,150,500.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	18,180,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	25,000,000.00	30,130,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,459,820.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	9,500,000.00	9,003,150.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	9,800,000.00	10,985,310.00	
小計	銘柄数：8	91,500,000.00	101,724,880.00	
			(1,611,322,099)	
	組入時価比率：0.5%		0.6%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,700,000.00	15,282,120.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	11,300,000.00	12,173,648.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	11,148,000.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,700,000.00	11,537,810.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	7,511,200.00	

小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.3%	54,700,000.00	57,652,778.20 (988,168,618) 0.3%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	4,000,000.00	4,253,600.00
	KINGDOM OF DENMARK	11,500,000.00	12,200,350.00
	KINGDOM OF DENMARK	12,000,000.00	13,562,400.00
	KINGDOM OF DENMARK	16,000,000.00	18,811,200.00
	KINGDOM OF DENMARK	20,500,000.00	23,085,050.00
	KINGDOM OF DENMARK	4,000,000.00	3,967,920.00
	KINGDOM OF DENMARK	8,000,000.00	12,330,960.00
	KINGDOM OF DENMARK	24,500,000.00	34,520,500.00
小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.8%	100,500,000.00	122,731,980.00 (2,328,225,660) 0.8%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	4,600,000.00	4,717,944.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,730,880.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,901,600.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,158,200.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,300,000.00	4,471,570.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	3,964,920.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,244,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,057,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,425,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,228,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,867,500.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,600,000.00	5,129,602.60
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,968,200.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,261,600.00
小計	銘柄数：14 組入時価比率：0.7%	56,200,000.00	59,126,016.60 (2,008,510,783) 0.7%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,422,430.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,237,740.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,539,230.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,735,660.00

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,553,550.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,487,220.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,494,700.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,880,190.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	4,720,380.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,064,040.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,791,680.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,045,850.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,380,150.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,400,395.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	865,800.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,276,145.00	
	銘柄数：16	46,300,000.00	48,895,160.00	(4,654,330,280)
	組入時価比率：1.6%			1.6%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,546,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,616,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,465,760.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,241,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,043,165.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	984,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	281,910.00	
	銘柄数：7	11,400,000.00	12,179,485.00	(997,499,821)
組入時価比率：0.3%			0.3%	
リンギ	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,675,960.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	7,863,240.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,450,660.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,163,800.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	995,600.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,000,000.00	9,254,700.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,131,160.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,714,320.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,008,400.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,630,000.00	

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,655,490.60		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	565,002.60		
	銘柄数：12	47,000,000.00	47,108,333.20	(1,486,267,912)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
	ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,400,000.00	13,681,056.96	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,000,000.00	15,129,337.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,000,000.00	16,391,100.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	20,000,000.00	18,529,150.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,872,409.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	33,000,000.00	38,460,741.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,000,000.00	6,760,800.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		31,500,000.00	23,623,185.60		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		6,500,000.00	4,904,006.90		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		5,000,000.00	4,869,678.00		
小計	銘柄数：10	153,400,000.00	146,221,465.96	(1,421,272,649)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
合計			291,023,916,962	(291,023,916,962)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成26年 3月31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	430,171,080	-	433,772,000	3,600,920
米ドル	163,277,440	-	164,656,000	1,378,560
ユーロ	266,893,640	-	269,116,000	2,222,360
合計	430,171,080	-	433,772,000	3,600,920

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

マイバランスDC70

平成26年 4月30日現在

資産総額	4,561,775,820円
負債総額	2,323,449円
純資産総額（ - ）	4,559,452,371円
発行済口数	4,446,755,548口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0253円

（参考）国内株式マザーファンド

平成26年 4月30日現在

資産総額	192,614,231,740円
負債総額	20,062,552,029円
純資産総額（ - ）	172,551,679,711円
発行済口数	165,641,185,312口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0417円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成26年 4月30日現在

資産総額	271,826,391,152円
負債総額	861,569,472円
純資産総額（ - ）	270,964,821,680円
発行済口数	150,612,514,380口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7991円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

平成26年 4月30日現在

資産総額	297,121,046,590円
負債総額	2,334,846,428円
純資産総額（ - ）	294,786,200,162円
発行済口数	243,086,788,394口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2127円

（参考）外国債券マザーファンド

平成26年 4月30日現在

資産総額	295,392,942,462円
負債総額	622,514,955円
純資産総額（ - ）	294,770,427,507円
発行済口数	142,172,090,233口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0733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26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。

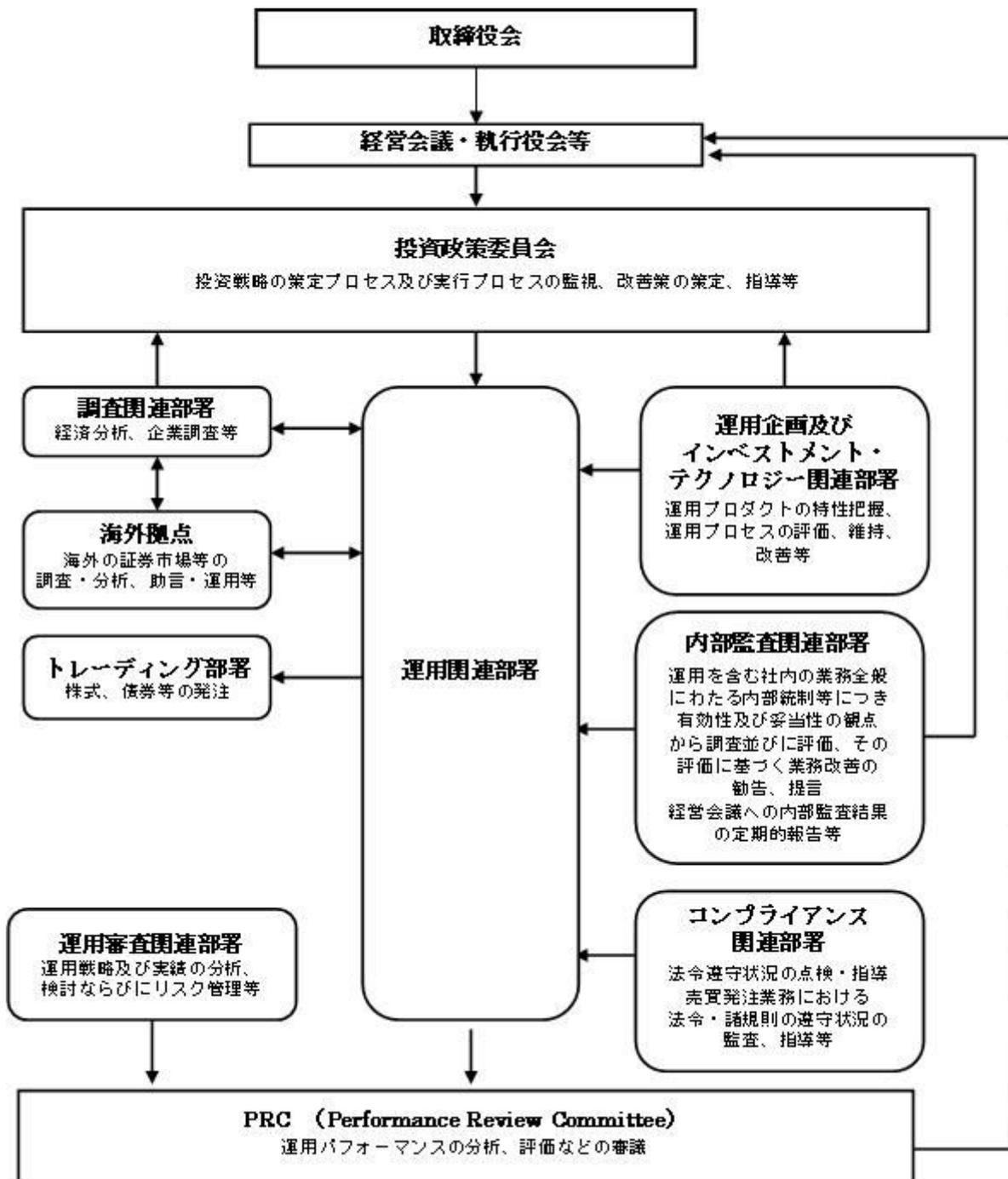
代表執行役・執行役

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26年4月30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	806	13,534,000

単位型株式投資信託	45	236,082
追加型公社債投資信託	18	6,186,017
単位型公社債投資信託	32	381,973
合計	901	20,338,072

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。

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. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成24年4月1日から平成25年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(平成25年4月1日から平成25年9月30日まで)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 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25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		240	333
金銭の信託		50,326	51,061
有価証券		1,800	4,500
短期貸付金		153	-
前払費用		37	29
未収入金		217	271
未収委託者報酬		8,149	8,651
未収収益		4,200	4,224
繰延税金資産		1,402	1,504
その他		14	12
貸倒引当金		6	6
流動資産計		66,535	70,582
固定資産			

有形固定資産			1,677		1,470
建物	2	516		485	
器具備品	2	1,161		985	
無形固定資産			9,754		8,458
ソフトウェア		9,753		8,457	
電話加入権		1		1	
その他		0		0	
投資その他の資産			21,505		21,443
投資有価証券		6,691		9,061	
関係会社株式		14,429		12,092	
従業員長期貸付金		29		29	
長期差入保証金		57		55	
長期前払費用		23		19	
その他		273		184	
貸倒引当金		0		0	
固定資産計			32,937		31,373
資産合計			99,472		101,956

区分	注記 番号	前事業年度 (平成24年 3月31日)		当事業年度 (平成25年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
短期借入金			-		3,000
関係会社短期借入金			8,500		2,000
預り金			93		102
未払金	1		6,276		6,481
未払収益分配金		4		3	
未払償還金		50		42	
未払手数料		3,610		3,764	
その他未払金		2,610		2,671	
未払費用	1		6,760		6,979
未払法人税等			856		763
前受収益			6		-
賞与引当金			2,816		3,109
流動負債計			25,310		22,436
固定負債					
退職給付引当金			2,437		813
時効後支払損引当金			489		495
繰延税金負債			7		1,640
固定負債計			2,934		2,948
負債合計			28,244		25,385
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			68,521		71,942
資本剰余金			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			39,611		43,032
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		38,926		42,347	

別途積立金		24,606		24,606
繰越利益剰余金		14,320		17,740
評価・換算差額等			2,705	4,628
その他有価証券評価差額金			2,693	4,659
繰延ヘッジ損益			12	30
純資産合計			71,227	76,570
負債・純資産合計			99,472	101,956

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)		当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			78,412		74,067
運用受託報酬			17,784		17,516
その他営業収益			129		163
営業収益計			96,325		91,747
営業費用					
支払手数料			40,671		37,925
広告宣伝費			952		768
公告費			0		0
受益証券発行費			5		5
調査費			19,308		16,591
調査費		1,108		1,138	
委託調査費		18,200		15,453	
委託計算費			931		903
営業雑経費			2,523		2,616
通信費		213		199	
印刷費		1,085		1,057	
協会費		76		76	
諸経費		1,147		1,282	
営業費用計			64,393		58,810
一般管理費					
給料			9,635		10,039
役員報酬	2	252		229	
給料・手当		6,602		6,696	
賞与		2,780		3,114	
交際費			140		122
旅費交通費			473		446
租税公課			224		289
不動産賃借料			1,309		1,242
退職給付費用			1,039		1,067
固定資産減価償却費			4,354		4,106
諸経費			6,204		6,273
一般管理費計			23,381		23,589
営業利益			8,550		9,347

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,116		3,002	
収益分配金		9		0	
受取利息		3		2	
金銭の信託運用益		377		1,016	
為替差益		55		43	
その他		360		331	
営業外収益計			4,924		4,396
営業外費用					
支払利息	1	54		56	
時効後支払損引当金繰入額		38		9	
その他		11		78	
営業外費用計			104		145
経常利益			13,370		13,598
特別利益					
投資有価証券等売却益		36		59	
株式報酬受入益		177		160	
固定資産売却益		-		10	
特別利益計			214		230
特別損失					
投資有価証券売却損		136		60	
投資有価証券等評価損		1		9	
関係会社株式評価損		-		2,916	
固定資産除却損	3	82		118	
特別損失計			221		3,105
税引前当期純利益			13,363		10,723
法人税、住民税及び事業税			3,625		3,765
法人税等調整額			1,228		446
当期純利益			8,509		6,510

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
	株主資本			
資本金				
当期首残高		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
資本剰余金				

資本準備金		
当期首残高	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
資本剰余金合計		
当期首残高	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
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	685	685
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	685	685
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	24,606	24,606
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	24,606	24,606
繰越利益剰余金		
当期首残高	14,077	14,320
当期変動額		
剰余金の配当	8,267	3,090
当期純利益	8,509	6,510
当期変動額合計	242	3,420
当期末残高	14,320	17,740
利益剰余金合計		
当期首残高	39,369	39,611
当期変動額		
剰余金の配当	8,267	3,090
当期純利益	8,509	6,510
当期変動額合計	242	3,420
当期末残高	39,611	43,032
株主資本合計		
当期首残高	68,279	68,521
当期変動額		
剰余金の配当	8,267	3,090
当期純利益	8,509	6,510
当期変動額合計	242	3,420
当期末残高	68,521	71,942
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	2,693
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	0	1,965
当期変動額合計	0	1,965

当期末残高	2,693	4,659
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	69	12
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	82	43
当期変動額合計	82	43
当期末残高	12	30
評価・換算差額等合計		
当期首残高	2,624	2,705
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	81	1,922
当期変動額合計	81	1,922
当期末残高	2,705	4,628
純資産合計		
当期首残高	70,903	71,227
当期変動額		
剰余金の配当	8,267	3,090
当期純利益	8,509	6,510
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	81	1,922
当期変動額合計	324	5,342
当期末残高	71,227	76,570

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2. 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	(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。 建物 38～50年 附属設備 8～15年 構築物 20年 器具備品 4～15年 (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。

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业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務債務は、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	<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 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方法	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p>
9．連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。</p>

[会計方針の変更等]

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による損益に与える影響は軽微であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (平成24年3月31日)	当事業年度末 (平成25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 2,320百万円	未払金 2,368百万円
未払費用 1,267	未払費用 1,584
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 477百万円	建物 518百万円
器具備品 2,303	器具備品 2,524
合計 2,780	合計 3,043

損益計算書関係

前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25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 3,776百万円	受取配当金 2,922百万円
支払利息 54	支払利息 44
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 19百万円	建物 5百万円
器具備品 9	器具備品 23
ソフトウェア 53	ソフトウェア 89
ア	ア
合計 82	合計 118

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成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

配当財産の種類 野村ホールディングス株式会社株式

配当財産の帳簿価額

8,267百万円

1株当たり配当額	1,605円12銭
基準日	平成23年7月19日
効力発生日	平成23年7月20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24年5月16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	3,090百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	600円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月1日

当事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成24年5月16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	3,090百万円
1株当たり配当額	600円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24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25年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項	
配当金の総額	3,966百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	770円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月21日

リース取引関係

前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31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。	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) (同左)

(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの)	(2)所有権移転外ファイナンス・リース取引(通常の賃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	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
器具備品	器具備品
取得価額相当額	取得価額相当額
184百万円	- 百万円
減価償却累計額相当額	減価償却累計額相当額
163	-
減損損失累計額相当額	減損損失累計額相当額
-	-
期末残高相当額	期末残高相当額
21	-
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	未経過リース料期末残高相当額
1年以内	- 百万円
22百万円	-
1年超	-
-	-
合計	合計
22	-
リース資産減損勘定期末残高	リース資産減損勘定期末残高
- 百万円	- 百万円
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	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
支払リース料	支払リース料
75百万円	22百万円
リース資産減損勘定の取崩額	リース資産減損勘定の取崩額
-	-
減価償却費相当額	減価償却費相当額
70	21
支払利息相当額	支払利息相当額
1	0
減損損失	減損損失
-	-
減価償却費相当額の算定方法	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。	(同左)
利息相当額の算定方法	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。	(同左)
2. オペレーティング・リース取引	2. オペレーティング・リース取引
未経過リース料	未経過リース料
1年以内	3百万円
15百万円	2
1年超	-
24	6
合計	合計
40	-

金融商品関係

前事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を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、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24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	240	240	-
(2)金銭の信託	50,326	50,326	-
(3)短期貸付金	153	153	-
(4)未収委託者報酬	8,149	8,149	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,725	7,725	-
(6)関係会社株式	3,064	89,073	86,009
資産計	69,658	155,667	86,009
(7)短期借入金	-	-	-
(8)関係会社短期借入金	8,500	8,500	-
(9)未払金	6,276	6,276	-
未払収益分配金	4	4	-
未払償還金	50	50	-
未払手数料	3,610	3,610	-
その他未払金	2,610	2,610	-
(10)未払費用	6,760	6,760	-
(11)未払法人税等	856	856	-
負債計	22,393	22,393	-
(12)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	10	10	-
デリバティブ取引計	10	10	-

(*) 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。

(8) 関係会社短期借入金、(9) 未払金、(10) 未払費用、(11) 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。

(12) 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：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券766百万円、関係会社株式11,365百万円）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0百万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	238	-	-	-

金銭の信託	50,326	-	-	-
短期貸付金	153	-	-	-
未収委託者報酬	8,149	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	1,800	1	-	-
合計	60,668	1	-	-

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を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及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成25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	333	333	-
(2)金銭の信託	51,061	51,061	-
(3)短期貸付金	-	-	-

(4)未収委託者報酬	8,651	8,651	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	12,678	12,678	-
(6)関係会社株式	3,064	104,822	101,758
資産計	75,789	177,548	101,758
(7)短期借入金	3,000	3,000	-
(8)関係会社短期借入金	2,000	2,000	-
(9)未払金	6,481	6,481	-
未払収益分配金	3	3	-
未払償還金	42	42	-
未払手数料	3,764	3,764	-
その他未払金	2,671	2,671	-
(10)未払費用	6,979	6,979	-
(11)未払法人税等	763	763	-
負債計	19,224	19,224	-
(12)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	3	3	-
デリバティブ取引計	3	3	-

（*）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、(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) 短期借入金、(8) 関係会社短期借入金、(9) 未払金、(10) 未払費用、(11) 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。

(12) 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：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券883百万円、関係会社株式9,028百万円）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2,916百万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	333	-	-	-
金銭の信託	51,061	-	-	-
未収委託者報酬	8,651	-	-	-
有価証券及び投資有価証券	4,500	-	-	-
合計	64,547	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成24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24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24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	89,073	86,009
合計	3,064	89,073	86,009

4．その他有価証券(平成24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	4,624	282	4,341
小計	4,624	282	4,341
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)	1,300	1,431	130
譲渡性預金	1,800	1,800	-
小計	3,100	3,231	130
合計	7,725	3,514	4,210

- (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利益は12百万円（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23年 4月 1日 至 平成24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	40	1	26
投資信託	1,343	-	110
合計	1,384	1	136

当事業年度（自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）

1. 売買目的有価証券(平成25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25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25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	104,822	101,758
合計	3,064	104,822	101,758

4. その他有価証券(平成25年 3月31日)

区分	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	7,534	282	7,251
小計	7,534	282	7,251

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)	644	645	0
譲渡性預金	4,500	4,500	-
小計	5,144	5,145	0
合計	12,678	5,427	7,250

- (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30百万円（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24年4月1日 至 平成25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	21	6	-
投資信託	708	-	60
合計	730	6	60

デリバティブ取引関係

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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	1,308	-	10	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	153	-	(*1) -	-
合計			1,462	-	(*1) 10	-

(*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。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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	647	-	3	先物為替相場によつて
合計			647	-	3	-

退職給付関係

前事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24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24年3月31日)	
イ. 退職給付債務	13,948百万円
ロ. 年金資産	9,508
ハ. 未積立退職給付債務(イ+ロ)	4,440
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	2,575
ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額)	572
ト. 貸借対照表計上額純額(ハ+ニ+ホ+ヘ)	2,437
チ. 前払年金費用	
リ. 退職給付引当金(ト-チ)	2,437
3. 退職給付費用に関する事項(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
イ. 勤務費用	543百万円
ロ. 利息費用	272
ハ. 期待運用収益	186
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	280
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)	869
チ. その他(注)	170
計	1,039
(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	1.8%
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24年4月1日 至 平成25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25年3月31日)

イ. 退職給付債務	15,209百万円
ロ. 年金資産	12,456
ハ. 未積立退職給付債務(イ+ロ)	2,752
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	2,471
ヘ. 未認識過去勤務債務(債務の増額)	532
ト. 貸借対照表計上額純額(ハ+ニ+ホ+ヘ)	813
チ. 前払年金費用	
リ. 退職給付引当金(ト-チ)	813

3. 退職給付費用に関する事項(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

イ. 勤務費用	608百万円
ロ. 利息費用	251
ハ. 期待運用収益	237
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	304
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)	885
チ. その他(注)	170
計	1,055

(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	1.5%
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24年3月31日)	当事業年度末 (平成25年3月31日)
------------------------	------------------------

<p>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</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>繰延税金資産</th> <th>百万円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>賞与引当金</td><td>1,070</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価減</td><td>-</td></tr> <tr><td>所有株式税務簿価通算差異</td><td>776</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価減</td><td>501</td></tr> <tr><td>ゴルフ会員権評価減</td><td>430</td></tr> <tr><td>退職給付引当金</td><td>877</td></tr> <tr><td>減価償却超過額</td><td>243</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td>166</td></tr> <tr><td>時効後支払損引当金</td><td>176</td></tr> <tr><td>子会社株式売却損</td><td>172</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td>80</td></tr> <tr><td>繰延ヘッジ損失</td><td>-</td></tr> <tr><td>その他</td><td>68</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td>4,564</td></tr> <tr><td>評価性引当金</td><td>1,650</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td>2,913</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>有価証券評価差額金</td><td>1,511</td></tr> <tr><td>繰延ヘッジ利益</td><td>7</td></tr> <tr><td>繰延税金負債計</td><td>1,518</td></tr> <tr><td>繰延税金資産(純額)</td><td>1,394</td></tr> </tbody> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,070	関係会社株式評価減	-	所有株式税務簿価通算差異	776	投資有価証券評価減	501	ゴルフ会員権評価減	430	退職給付引当金	877	減価償却超過額	243	未払事業税	166	時効後支払損引当金	176	子会社株式売却損	172	未払社会保険料	80	繰延ヘッジ損失	-	その他	68	繰延税金資産小計	4,564	評価性引当金	1,650	繰延税金資産計	2,913	繰延税金負債		有価証券評価差額金	1,511	繰延ヘッジ利益	7	繰延税金負債計	1,518	繰延税金資産(純額)	1,394	<p>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</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>繰延税金資産</th> <th>百万円</th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>賞与引当金</td><td>1,181</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価減</td><td>1,050</td></tr> <tr><td>所有株式税務簿価通算差異</td><td>776</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価減</td><td>501</td></tr> <tr><td>ゴルフ会員権評価減</td><td>408</td></tr> <tr><td>退職給付引当金</td><td>292</td></tr> <tr><td>減価償却超過額</td><td>208</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td>184</td></tr> <tr><td>時効後支払損引当金</td><td>178</td></tr> <tr><td>子会社株式売却損</td><td>172</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td>90</td></tr> <tr><td>繰延ヘッジ損失</td><td>18</td></tr> <tr><td>その他</td><td>124</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td>5,189</td></tr> <tr><td>評価性引当金</td><td>2,704</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td>2,485</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>有価証券評価差額金</td><td>2,620</td></tr> <tr><td>繰延ヘッジ利益</td><td>-</td></tr> <tr><td>繰延税金負債計</td><td>2,620</td></tr> <tr><td>繰延税金負債(純額)</td><td>135</td></tr> </tbody> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,181	関係会社株式評価減	1,050	所有株式税務簿価通算差異	776	投資有価証券評価減	501	ゴルフ会員権評価減	408	退職給付引当金	292	減価償却超過額	208	未払事業税	184	時効後支払損引当金	178	子会社株式売却損	172	未払社会保険料	90	繰延ヘッジ損失	18	その他	124	繰延税金資産小計	5,189	評価性引当金	2,704	繰延税金資産計	2,485	繰延税金負債		有価証券評価差額金	2,620	繰延ヘッジ利益	-	繰延税金負債計	2,620	繰延税金負債(純額)	135
繰延税金資産	百万円																																																																																								
賞与引当金	1,070																																																																																								
関係会社株式評価減	-																																																																																								
所有株式税務簿価通算差異	776																																																																																								
投資有価証券評価減	501																																																																																								
ゴルフ会員権評価減	430																																																																																								
退職給付引当金	877																																																																																								
減価償却超過額	243																																																																																								
未払事業税	166																																																																																								
時効後支払損引当金	176																																																																																								
子会社株式売却損	172																																																																																								
未払社会保険料	80																																																																																								
繰延ヘッジ損失	-																																																																																								
その他	68																																																																																								
繰延税金資産小計	4,564																																																																																								
評価性引当金	1,650																																																																																								
繰延税金資産計	2,913																																																																																								
繰延税金負債																																																																																									
有価証券評価差額金	1,511																																																																																								
繰延ヘッジ利益	7																																																																																								
繰延税金負債計	1,518																																																																																								
繰延税金資産(純額)	1,394																																																																																								
繰延税金資産	百万円																																																																																								
賞与引当金	1,181																																																																																								
関係会社株式評価減	1,050																																																																																								
所有株式税務簿価通算差異	776																																																																																								
投資有価証券評価減	501																																																																																								
ゴルフ会員権評価減	408																																																																																								
退職給付引当金	292																																																																																								
減価償却超過額	208																																																																																								
未払事業税	184																																																																																								
時効後支払損引当金	178																																																																																								
子会社株式売却損	172																																																																																								
未払社会保険料	90																																																																																								
繰延ヘッジ損失	18																																																																																								
その他	124																																																																																								
繰延税金資産小計	5,189																																																																																								
評価性引当金	2,704																																																																																								
繰延税金資産計	2,485																																																																																								
繰延税金負債																																																																																									
有価証券評価差額金	2,620																																																																																								
繰延ヘッジ利益	-																																																																																								
繰延税金負債計	2,620																																																																																								
繰延税金負債(純額)	135																																																																																								
<p>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</p> <table border="1"> <tbody> <tr><td>法定実効税率</td><td>41.0%</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>0.3%</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>11.3%</td></tr> <tr><td>住民税等均等割</td><td>0.0%</td></tr> <tr><td>タックスヘイブン税制</td><td>4.2%</td></tr> <tr><td>外国税額控除</td><td>0.0%</td></tr> <tr><td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td>2.4%</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価減</td><td>-%</td></tr> <tr><td>その他</td><td>0.3%</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>36.3%</td></tr> </tbody> </table>	法定実効税率	41.0%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	11.3%	住民税等均等割	0.0%	タックスヘイブン税制	4.2%	外国税額控除	0.0%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	2.4%	関係会社株式評価減	-%	その他	0.3%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.3%	<p>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</p> <table border="1"> <tbody> <tr><td>法定実効税率</td><td>38.0%</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>0.5%</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>10.1%</td></tr> <tr><td>住民税等均等割</td><td>0.0%</td></tr> <tr><td>タックスヘイブン税制</td><td>2.1%</td></tr> <tr><td>外国税額控除</td><td>0.0%</td></tr> <tr><td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td>-%</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価減</td><td>10.3%</td></tr> <tr><td>その他</td><td>1.6%</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>39.2%</td></tr> </tbody> </table>	法定実効税率	38.0%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.5%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	10.1%	住民税等均等割	0.0%	タックスヘイブン税制	2.1%	外国税額控除	0.0%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-%	関係会社株式評価減	10.3%	その他	1.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	39.2%																																												
法定実効税率	41.0%																																																																																								
(調整)																																																																																									
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3%																																																																																								
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	11.3%																																																																																								
住民税等均等割	0.0%																																																																																								
タックスヘイブン税制	4.2%																																																																																								
外国税額控除	0.0%																																																																																								
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	2.4%																																																																																								
関係会社株式評価減	-%																																																																																								
その他	0.3%																																																																																								
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.3%																																																																																								
法定実効税率	38.0%																																																																																								
(調整)																																																																																									
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.5%																																																																																								
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	10.1%																																																																																								
住民税等均等割	0.0%																																																																																								
タックスヘイブン税制	2.1%																																																																																								
外国税額控除	0.0%																																																																																								
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-%																																																																																								
関係会社株式評価減	10.3%																																																																																								
その他	1.6%																																																																																								
税効果会計適用後の法人税等の負担率	39.2%																																																																																								
<p>3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」(平成23年法律第114号)が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後開始する事業年度より、法人税率が30%から25.5%に引き下げられました。また、「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」(平成23年法律第117号)が同日に公布され、平成24年4月1日から平成27年3月31日までの期間(指定期間)内に開始する事業年度(3年間)は、各課税事業年度の基準法人税額の10%が復興特別法人税として課税されることになりました。これらの改正により、繰延税金資産および繰延税金負債を計算する法定実効税率は平成24年4月1日から平成27年3月31日までに解消すると見込まれる一時差異等については38%、平成27年4月1日以降に解消すると見込まれる一時差異等については36%となっております。</p> <p>この改正の影響により、繰延税金資産の純額が108百万円減少し、法人税等調整額は322百万円増加しております。</p>																																																																																									

セグメント情報等

前事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100.0%	資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任	資金の借入(*1)	90,500	関係会社 短期 借入金	8,500
							資金の返済	90,000		
							借入金利息の支払	54	未払費用	2
							金銭信託の移管(*2)	9,258	-	-
							株式交換(*3)	8,267	-	-

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有) 直接 21.6%	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等(*4)	5,887	未払費用	478

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の 子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*5)	33,134	未払手数料	2,987
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(*6)	2,126	未払費用	787

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
- (*2) 譲渡代金は、平成24年1月17日における時価評価金額としています。
- (*3) 当社が保有する野村土地建物株式会社株式と引き換えに野村ホールディングス株式会社株式を取得いたしました。交換は、第三者算定機関の算定による交換比率に基づいております。
- (*4) 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。
- (*5) 投資信託に係る事務代手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。
- (*6) 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)野村総合研究所であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(百万円)	
(株)野村総合研究所	
流動資産合計	166,580
固定資産合計	229,654
流動負債合計	72,440
固定負債合計	74,932
純資産合計	248,861
売上高	320,289
税引前当期純利益	62,962
当期純利益	41,340

当事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有)直接100.0%	資産の賃貸借及び購入等役員の兼任	資金の借入(*1)	59,500	短期借入金	2,000
							資金の返済	66,000		
							借入金利息の支払	44	未払費用	0

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接21.6%	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等(*2)	4,433	未払費用	706

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3)	30,983	未払手数料	3,105
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託役員の兼任	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*4)	1,941	未払費用	827
親会社の子会社	野村信託銀行株式会社	東京都千代田区	30,000 (百万円)	信託銀行業		資産の賃貸借及び購入等役員の兼任	資金の借入(*1)	3,000	短期借入金	3,000
							借入金利息の支払	12	未払費用	-

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス(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)野村総合研究所であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

	(百万円)
(株)野村総合研究所	
流動資産合計	173,316
固定資産合計	239,585
流動負債合計	119,842
固定負債合計	20,742
純資産合計	272,316
売上高	337,340
税引前当期純利益	34,113
当期純利益	21,544

1株当たり情報

前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,828円81銭	1株当たり純資産額	14,866円12銭
1株当たり当期純利益	1,652円20銭	1株当たり当期純利益	1,264円08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	8,509百万円	損益計算書上の当期純利益	6,510百万円
普通株式に係る当期純利益	8,509百万円	普通株式に係る当期純利益	6,510百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

中間財務諸表

中間貸借対照表

		平成25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		212
金銭の信託		40,345
有価証券		9,300
未収委託者報酬		9,996
未収収益		5,897
繰延税金資産		1,221
その他		523
貸倒引当金		7

流動資産計		67,488
固定資産		
有形固定資産	1	1,503
無形固定資産		8,073
ソフトウェア		8,072
その他		1
投資その他の資産		24,943
投資有価証券		12,512
関係会社株式		12,092
前払年金費用		13
その他		324
固定資産計		34,520
資産合計		102,009

		平成25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		
未払収益分配金		2
未払償還金		40
未払手数料		4,303
その他未払金	2	1,997
未払費用		6,705
未払法人税等		1,055
賞与引当金		1,989
その他		108
流動負債計		16,201
固定負債		
時効後支払損引当金		504
繰延税金負債		3,124
固定負債計		3,628
負債合計		19,830
(純資産の部)		
株主資本		75,436
資本金		17,180
資本剰余金		11,729
資本準備金		11,729
利益剰余金		46,526
利益準備金		685
その他利益剰余金		45,841
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		21,235
評価・換算差額等		6,741
その他有価証券評価差額金		6,809
繰延ヘッジ損益		67
純資産合計		82,178
負債・純資産合計		102,009

中間損益計算書

		自 平成25年4月1日 至 平成25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		43,970
運用受託報酬		11,575
その他営業収益		90
営業収益計		55,636
営業費用		
支払手数料		22,457
調査費		9,742
その他営業費用		2,266
営業費用計		34,466
一般管理費	1	12,258
営業利益		8,912
営業外収益	2	2,738
営業外費用	3	839
経常利益		10,811
特別利益	4	152
特別損失	5	5
税引前中間純利益		10,958
法人税、住民税及び事業税		2,918
法人税等調整額		579
中間純利益		7,460

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25年4月1日	至 平成25年9月30日
株主資本		
資本金		
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
資本剰余金		
資本準備金		
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

資本剰余金合計	
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
利益剰余金	
利益準備金	
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
その他利益剰余金	
別途積立金	
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
繰越利益剰余金	
当期首残高	17,740
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,966
中間純利益	7,460
当中間期変動額合計	3,494
当中間期末残高	21,235
利益剰余金合計	
当期首残高	43,032
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,966
中間純利益	7,460
当中間期変動額合計	3,494
当中間期末残高	46,526
株主資本合計	
当期首残高	71,942
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,966
中間純利益	7,460
当中間期変動額合計	3,494
当中間期末残高	75,436
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	4,659
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)	2,150
当中間期変動額合計	2,150
当中間期末残高	6,809
繰延ヘッジ損益	
当期首残高	30
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)	36
当中間期変動額合計	36
当中間期末残高	67
評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,628
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)	2,113
当中間期変動額合計	2,113
当中間期末残高	6,741
純資産合計	
当期首残高	76,570
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,966
中間純利益	7,460
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	2,113
当中間期変動額合計	5,607
当中間期末残高	82,178

[重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	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
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	(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。 (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。

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 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 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>
7 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。
8 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

平成25年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	3,217百万円
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25年4月1日	至 平成25年9月30日
1	減価償却実施額		
	有形固定資産	173	百万円
	無形固定資産	1,637	百万円
	長期前払費用	4	百万円
2	営業外収益のうち主要なもの		
	受取配当金	2,551	百万円
3	営業外費用のうち主要なもの		
	支払利息	11	百万円
	金銭の信託運用損	715	百万円
4	特別利益の内訳		
	株式報酬受入益	152	百万円
5	特別損失の内訳		
	投資有価証券評価損	2	百万円
	固定資産除却損	3	百万円

中間株主資本等変動計算書関係

					自 平成25年4月1日	至 平成25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	当中間会計期間末	
	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株	
2	配当に関する事項					
	配当金支払額					
	平成25年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。					
	・普通株式の配当に関する事項					
	(1) 配当金の総額			3,966	百万円	
	(2) 1株当たり配当額			770	円	
	(3) 基準日			平成25年3月31日		
	(4) 効力発生日			平成25年6月21日		

金融商品関係

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成25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	212	212	-
(2)金銭の信託	40,345	40,345	-
(3)未収委託者報酬	9,996	9,996	-
(4)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	20,832	20,832	-
(5)関係会社株式	3,064	147,949	144,885
資産計	74,450	219,336	144,885
(6)未払金	6,343	6,343	-
未払収益分配金	2	2	-
未払償還金	40	40	-
未払手数料	4,303	4,303	-
その他未払金	1,997	1,997	-
(7)未払費用	6,705	6,705	-
(8)未払法人税等	1,055	1,055	-
負債計	14,104	14,104	-
(9)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	6	6	-
デリバティブ取引計	6	6	-

（*）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) 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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、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。

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

(9) 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：非上場株式等（中間貸借対照表計上額：投資有価証券979百万円、関係会社株式9,028百万円）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25年9月30日）

1．満期保有目的の債券(平成25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25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	147,949	144,885
合計	3,064	147,949	144,885

3．その他有価証券(平成25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	10,828	282	10,545
投資信託(1)	702	644	58
小計	11,531	926	10,604
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	0	1	0
譲渡性預金	9,300	9,300	-
小計	9,300	9,301	0
合計	20,832	10,227	10,604

- (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損失は67百万円（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25年 4 月 1 日 至 平成25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	709	-	6	先物為替相場によっている

セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成25年 4 月 1 日 至 平成25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25年 4 月 1 日 至 平成25年 9 月30日
1 株当たり純資産額	15,954円87銭
1 株当たり中間純利益	1,448円44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 | 7,460百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式に係る中間純利益 | 7,460百万円 |
| 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 [*]	(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26年4月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北國銀行	26,673百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

* 平成26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・連絡等を行ないます。

(2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成25年 6月25日	有価証券届出書
平成25年 6月25日	有価証券報告書
平成25年12月18日	有価証券届出書の訂正届出書
平成25年12月18日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7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 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、「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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は、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。

独立監査人の監査報告書

平成26年5月27日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	岩 部 俊 夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森 重 俊 寛

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DC70の平成25年4月2日から平成26年3月31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DC70の平成26年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成25年11月22日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	岩部俊夫
--------------------	-------	------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛
--------------------	-------	------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯原尚
--------------------	-------	-----

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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に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25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25年4月1日から平成25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) 1. 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。
2. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。