

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年6月23日提出
【計算期間】	第9期(自 平成27年4月1日至 平成28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】

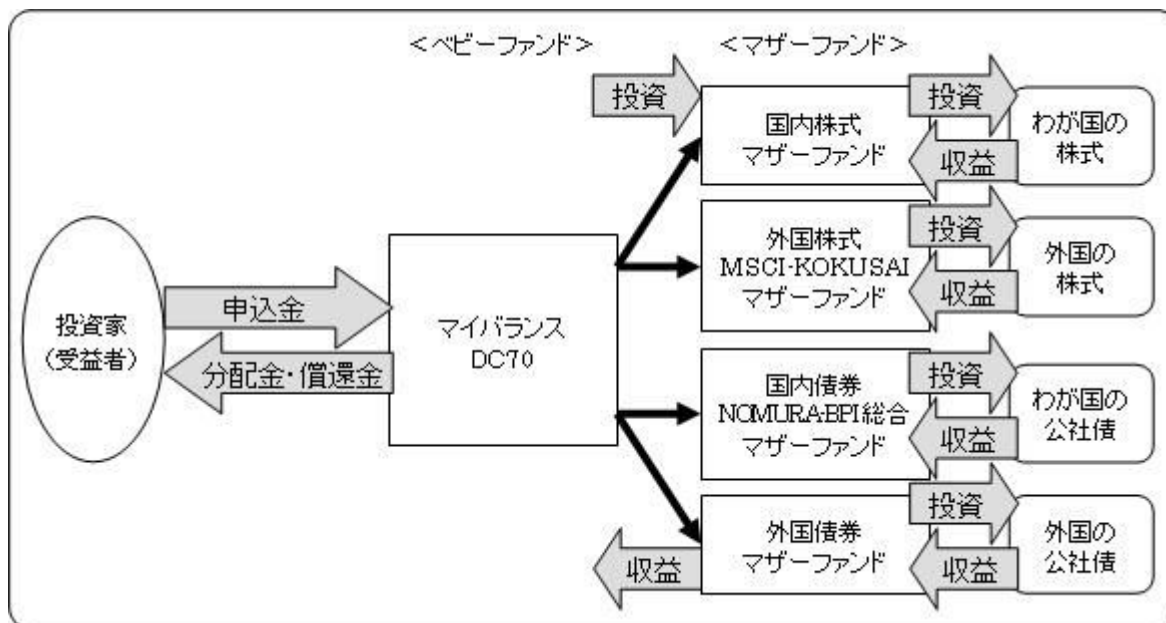
ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

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

《属性区分表》

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

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

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〕

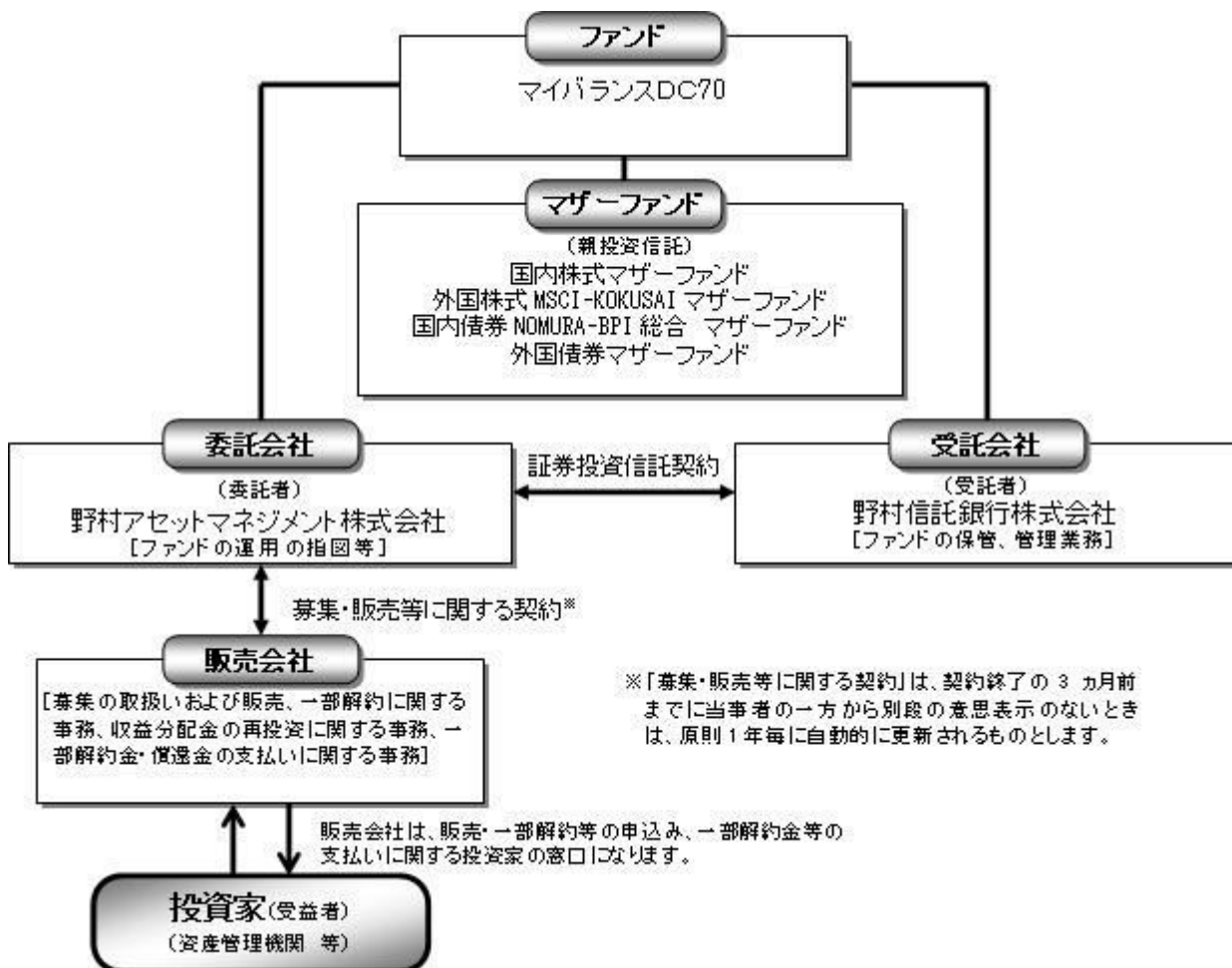
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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28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%

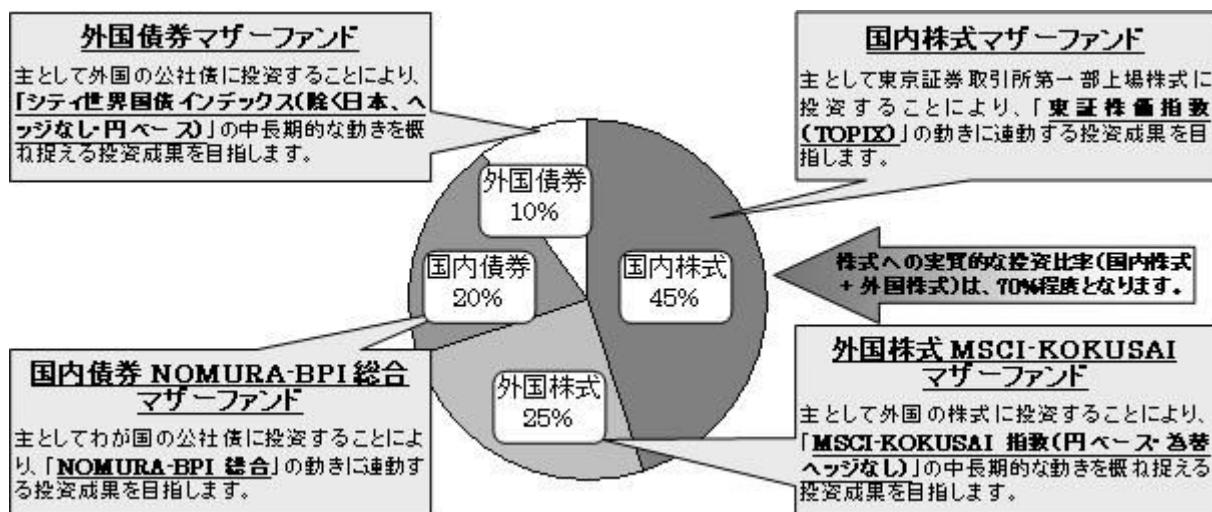
2【投資方針】

(1)【投資方針】

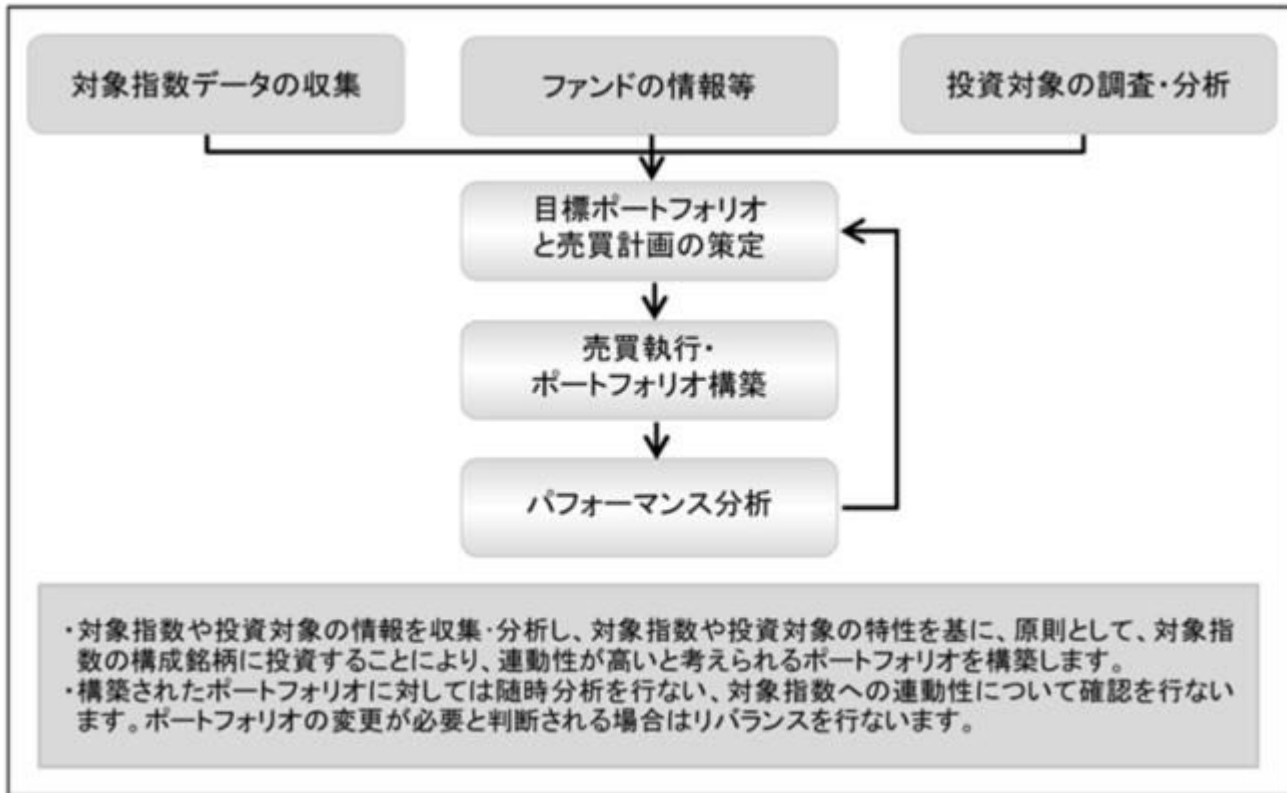
[1] 内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

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。



投資プロセス



* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

各マザーファンドが対象とするインデックスについて

国内株式マザーファンド：東証株価指数(TOPIX)

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

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

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

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

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

MSCI-KOKUSAI指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された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、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行わない円ベースの指数)です。

シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

[2] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とします。

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

マザーファンドの主要投資対象

[1] 国内株式マザーファンド

わが国の株式を主要投資対象とします。

[2] 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

外国の株式を主要投資対象とします。

[3] 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

わが国の公社債を主要投資対象とします。

[4] 外国債券マザーファンド

外国の公社債を主要投資対象とします。

なお、デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定します。

投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ 有価証券

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

ハ 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ 金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

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

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

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

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

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

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

- 1 株券または新株引受権証券
- 2 国債証券
- 3 地方債証券
- 4 特別の法律により法人の発行する債券(金融商品取引法第2条第1項第3号で定めるものをいいます。)
- 5 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7 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、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 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。

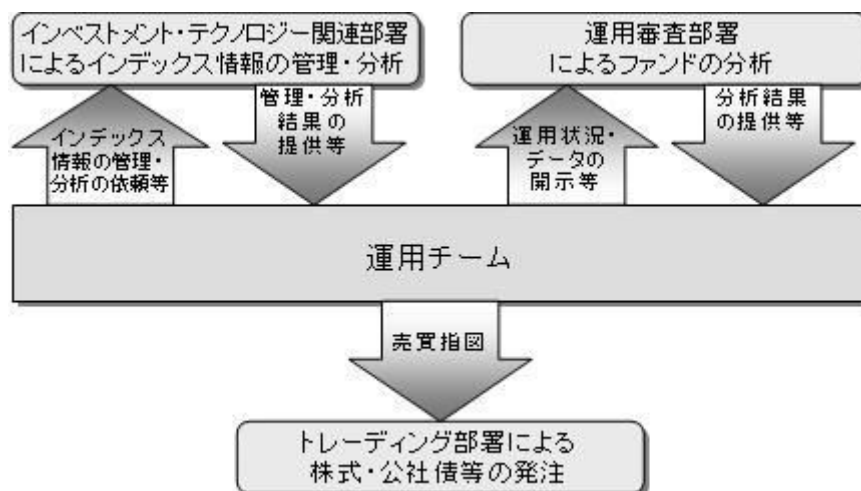
- 1 預金
- 2 指定金銭信託(上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。)
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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】

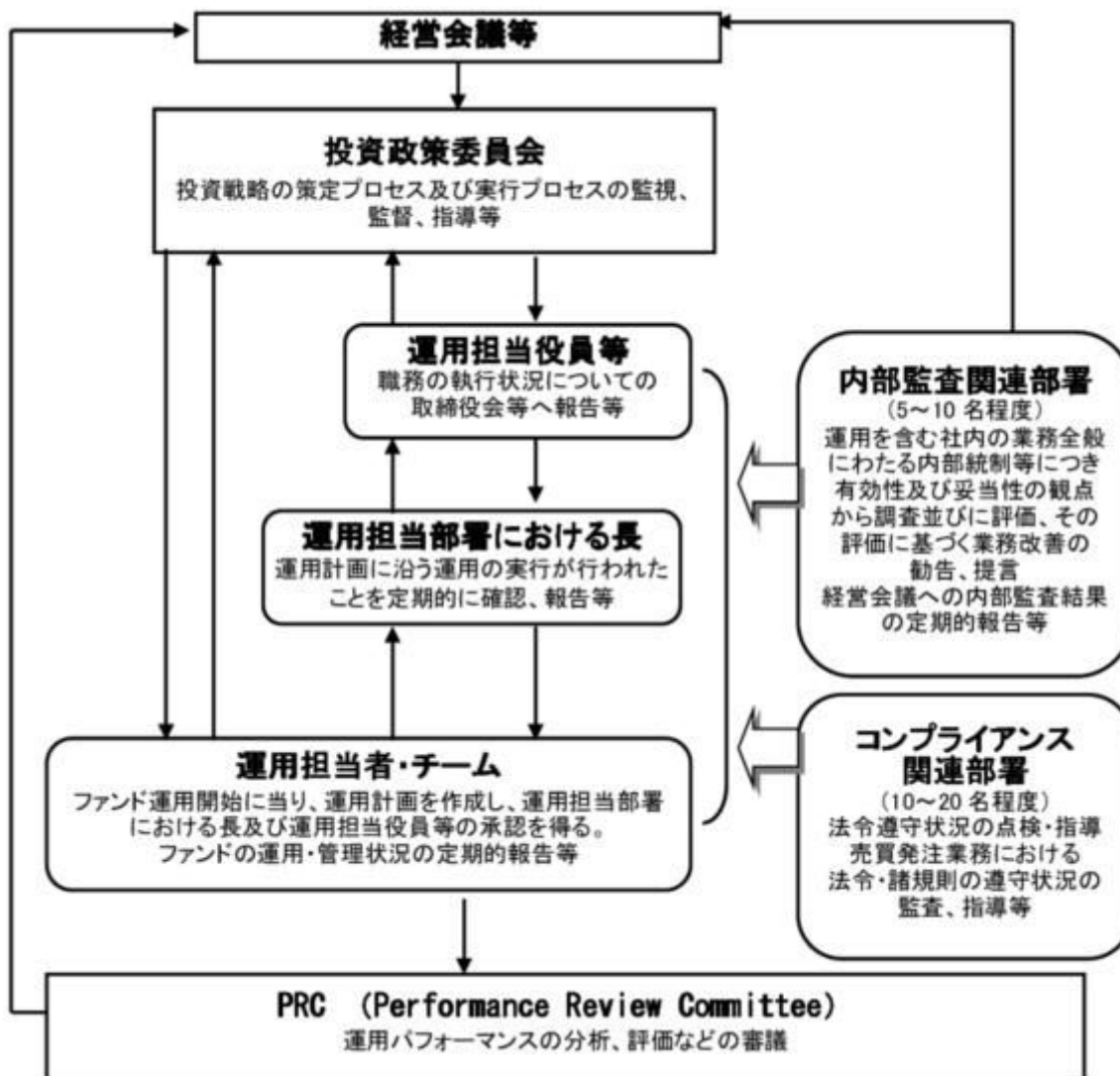
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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いません。

利子・配当収入とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

売買益とは、売買損益に評価損益を加減した利益金額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

* 委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

ファンドの決算日

原則として**毎年3月31日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

分配金のお支払い

分配金は無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

株式への実質投資割合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、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。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。

(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第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等を加えた額を限度とします。

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

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

- ()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ()スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ()スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額と各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ()上記()において各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額に各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンドの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ()スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ()委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- 外貨建資産への投資割合(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せん。)の行使により取得可能な株券
- 6 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第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。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

同一の法人の発行する株式(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。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(国内債券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。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(外国債券マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の中長期的な動き

を概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

[為替変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用が

できない場合があります。

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

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

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

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

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

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

外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドについて

「MSCI」の著作権等について

本ファンドは、MSCI Inc.(MSCI)、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であると問わず、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

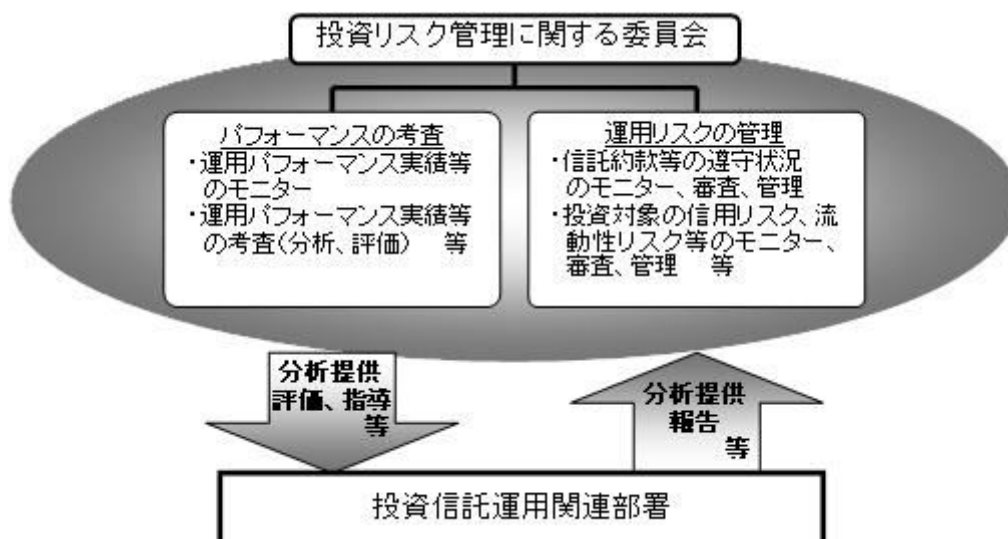
パフォーマンスの考査

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



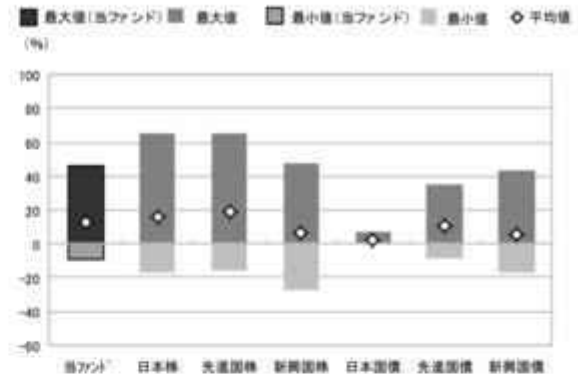
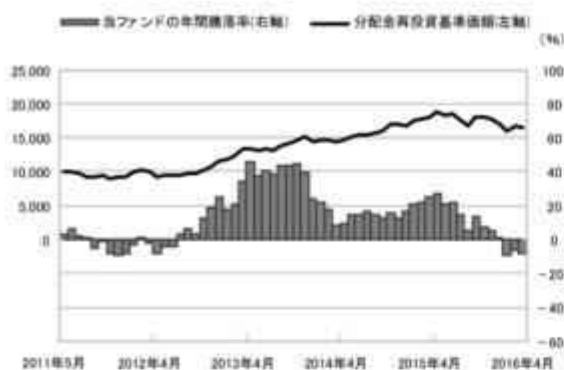
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

リスクの定量的比較

(2011年5月末～2016年4月末:月次)

〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉

〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	45.7	65.0	65.7	47.4	6.7	34.9	43.7
最小値(%)	△ 9.3	△ 17.0	△ 15.6	△ 27.4	0.4	△ 8.8	△ 17.4
平均値(%)	13.2	16.1	19.5	6.8	2.5	10.3	6.0

- 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2011年5月末を10,000として指数化しております。
- 年間騰落率は、2011年5月から2016年4月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2011年5月から2016年4月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

＜代表的な資産クラスの指数＞

- 日本株: 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
- 先進国株: MSCI-KOKUSA指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株: MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債: NOMURA-BPI国債
- 先進国債: シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
- 新興国債: JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSA指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSA指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価値を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものではありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、ブレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)、「指数スポンサー」は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ、NYSE、SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSP J.P. Morgan Securities PLC.; またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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28年 6月23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28年 6月23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。

支払先の役務の内容

＜委託会社＞	＜販売会社＞	＜受託会社＞
ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等	口座内でのファンドの管理および事務手続き、購入後の情報提供、各種書類の送付等	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等

(4)【その他の手数料等】

信託財産において一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息は信託財産から支払われます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は信託報酬支払いのときに信託財産から支払われます。

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

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

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは下記の通りです。

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

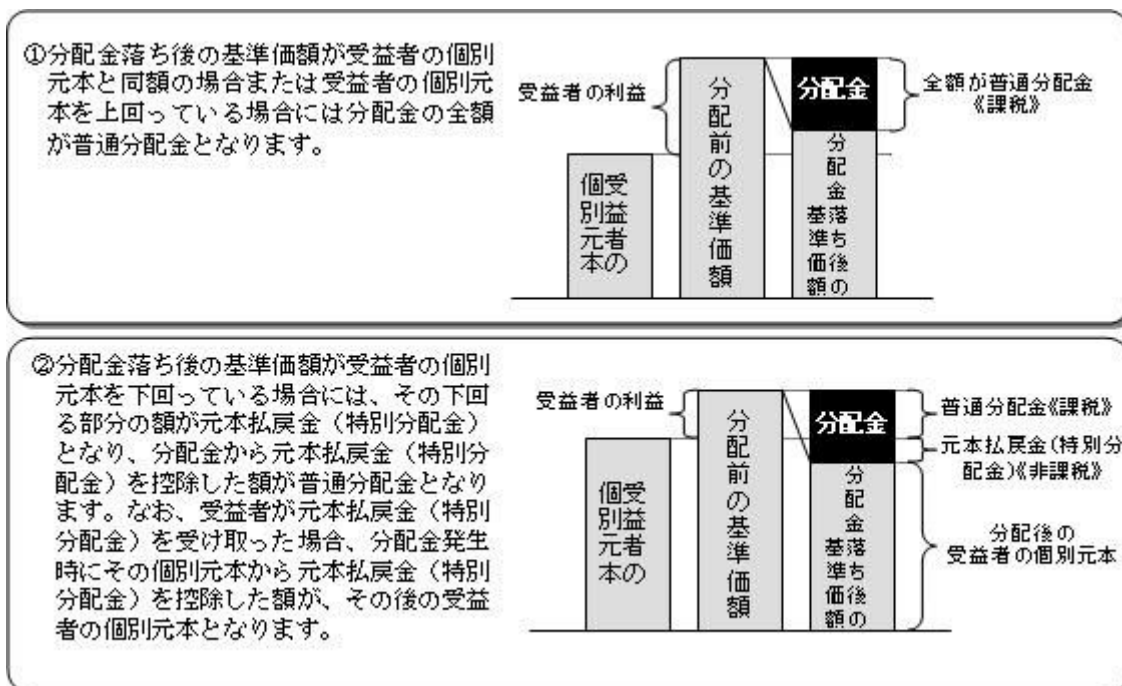
換金(解約)時および償還時の課税について

換金(解約)時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(平成28年4月末現在)が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は平成28年4月28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	7,700,457,787	99.95
現金・預金・その他資産(負債控除後)		3,159,874	0.04
合計(純資産総額)		7,703,617,661	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	277,316,982,210	98.12
現金・預金・その他資産(負債控除後)		5,307,274,767	1.87
合計(純資産総額)		282,624,256,977	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,160,085,000	1.82

(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	197,820,372,467	61.38
	カナダ	12,175,762,675	3.77
	ドイツ	11,746,935,530	3.64
	イタリア	2,797,642,473	0.86
	フランス	12,367,467,073	3.83
	オランダ	3,842,527,403	1.19
	スペイン	4,267,050,007	1.32
	ベルギー	1,872,244,077	0.58

	オーストリア	238,920,078	0.07
	ルクセンブルグ	35,046,523	0.01
	フィンランド	1,237,429,111	0.38
	アイルランド	636,560,466	0.19
	ポルトガル	212,309,245	0.06
	イギリス	24,803,322,886	7.69
	スイス	11,728,062,161	3.63
	スウェーデン	3,762,798,978	1.16
	ノルウェー	766,885,249	0.23
	デンマーク	2,522,784,964	0.78
	オーストラリア	8,254,662,081	2.56
	ニュージーランド	223,912,422	0.06
	香港	3,878,647,783	1.20
	シンガポール	1,563,114,752	0.48
	イスラエル	797,837,537	0.24
	小計	307,552,295,941	95.43
投資信託受益証券	アメリカ	25,138,237	0.00
投資証券	アメリカ	6,360,108,630	1.97
	カナダ	80,172,948	0.02
	フランス	501,635,572	0.15
	イギリス	408,659,526	0.12
	オーストラリア	879,723,236	0.27
	香港	174,350,640	0.05
	シンガポール	139,856,101	0.04
	小計	8,544,506,653	2.65
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,138,644,974	1.90
合計（純資産総額）		322,260,585,805	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,107,330,637	1.27
	買建	カナダ	240,002,677	0.07
	買建	ドイツ	795,094,102	0.24
	買建	イギリス	509,806,519	0.15
	買建	スイス	235,712,620	0.07

（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	523,298,197,220	78.49
地方債証券	日本	51,758,791,135	7.76
特殊債券	日本	58,715,629,876	8.80
社債券	日本	29,829,984,810	4.47
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,063,509,725	0.45
合計（純資産総額）		666,666,112,766	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	265,474,023,033	42.10
	カナダ	12,919,373,803	2.04
	メキシコ	6,204,831,529	0.98
	ドイツ	34,278,048,285	5.43
	イタリア	71,766,480,804	11.38
	フランス	56,525,169,927	8.96
	オランダ	13,900,486,821	2.20
	スペイン	45,387,099,255	7.19
	ベルギー	15,491,674,116	2.45
	オーストリア	8,884,407,747	1.40
	フィンランド	3,199,421,082	0.50
	アイルランド	6,266,059,954	0.99
	イギリス	49,145,850,390	7.79
	スイス	1,737,734,220	0.27
	スウェーデン	3,121,967,854	0.49
	ノルウェー	1,926,479,362	0.30
	デンマーク	4,166,252,711	0.66
	ポーランド	3,750,986,313	0.59
	オーストラリア	11,478,730,318	1.82
	シンガポール	2,427,557,888	0.38
マレーシア	2,920,737,790	0.46	
南アフリカ	2,837,385,717	0.44	
	小計	623,810,758,919	98.92
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,767,108,461	1.07
合計（純資産総額）		630,577,867,380	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	2,734,481,733	1.2553	3,432,675,494	1.2489	3,415,094,236	44.33
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	968,074,418	2.0145	1,950,185,916	2.0054	1,941,376,437	25.20
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	1,185,215,549	1.3143	1,557,743,880	1.3256	1,571,121,731	20.39
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	354,395,352	2.2506	797,629,371	2.1808	772,865,383	10.03

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	99.95
合計	99.95

(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	1,737,800	7,962.56	13,837,336,768	5,654.00	9,825,521,200	3.47
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	11,064,400	830.54	9,189,426,776	520.10	5,754,594,440	2.03
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,065,900	4,235.51	4,514,630,109	4,864.00	5,184,537,600	1.83
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	781,300	7,048.22	5,506,774,286	5,988.00	4,678,424,400	1.65
5	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,400,900	2,888.94	4,047,116,046	3,169.00	4,439,452,100	1.57
6	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	925,500	4,320.55	3,998,669,025	4,530.00	4,192,515,000	1.48
7	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,104,200	5,118.44	5,651,781,448	3,413.00	3,768,634,600	1.33
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,257,400	4,052.49	5,095,600,926	2,992.50	3,762,769,500	1.33
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,546,300	230.43	4,504,053,909	167.80	3,279,869,140	1.16
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	582,800	6,077.64	3,542,048,592	5,262.00	3,066,693,600	1.08
11	日本	株式	ソニー	電気機器	985,900	3,529.43	3,479,665,037	2,778.00	2,738,830,200	0.96
12	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,030,400	2,250.04	2,318,441,216	2,597.00	2,675,948,800	0.94
13	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	576,900	5,160.87	2,977,305,903	4,543.00	2,620,856,700	0.92
14	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	255,400	10,943.63	2,795,003,102	9,824.00	2,509,049,600	0.88
15	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,638,600	1,782.77	2,921,246,922	1,497.00	2,452,984,200	0.86
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	125,100	21,208.10	2,653,133,310	19,435.00	2,431,318,500	0.86
17	日本	株式	花王	化学	393,600	5,678.43	2,235,030,048	6,116.00	2,407,257,600	0.85
18	日本	株式	ファナック	電気機器	143,000	23,978.48	3,428,922,640	16,505.00	2,360,215,000	0.83
19	日本	株式	キヤノン	電気機器	752,200	4,092.86	3,078,649,292	3,112.00	2,340,846,400	0.82
20	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,025,000	2,676.36	2,743,269,000	2,121.00	2,174,025,000	0.76
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	146,600	17,569.06	2,575,624,196	14,795.00	2,168,947,000	0.76

22	日本	株式	キーエンス	電気機器	31,700	62,476.92	1,980,518,364	67,160.00	2,128,972,000	0.75
23	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	558,700	4,867.67	2,719,567,229	3,689.00	2,061,044,300	0.72
24	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	493,900	4,731.08	2,336,680,412	4,116.00	2,032,892,400	0.71
25	日本	株式	三井不動産	不動産業	731,000	3,416.13	2,497,191,030	2,725.00	1,991,975,000	0.70
26	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,950,000	1,224.81	2,388,379,500	1,000.00	1,950,000,000	0.68
27	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,034,700	2,516.02	2,603,325,894	1,863.00	1,927,646,100	0.68
28	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,565,000	773.27	2,756,707,550	515.60	1,838,114,000	0.65
29	日本	株式	ダイキン工業	機械	203,500	7,983.04	1,624,548,640	8,884.00	1,807,894,000	0.63
30	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,490,000	1,489.48	2,219,325,200	1,198.00	1,785,020,000	0.63

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.30
		建設業	3.08
		食料品	4.91
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.08
		医薬品	5.71
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.96
		ガラス・土石製品	0.91
		鉄鋼	1.24
		非鉄金属	0.84
		金属製品	0.64
		機械	4.64
		電気機器	11.48
		輸送用機器	9.17
		精密機器	1.59
		その他製品	1.53
		電気・ガス業	1.99
		陸運業	4.52
		海運業	0.22
		空運業	0.65
		倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	8.23		
卸売業	4.16		
小売業	4.76		
銀行業	7.34		
証券、商品先物取引業	1.03		
保険業	2.22		

	その他金融業	1.35
	不動産業	2.79
	サービス業	3.82
合 計		98.12

(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	538,200	12,024.21	6,471,429,822	10,735.74	5,777,977,959	1.79
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウ ェア	732,700	6,041.73	4,426,781,066	5,590.66	4,096,280,245	1.27
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗燃 料	402,000	9,276.07	3,728,980,140	9,708.48	3,902,810,970	1.21
4	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	267,200	11,960.55	3,195,860,296	12,376.50	3,307,002,804	1.02
5	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コングロ マリット	911,500	3,493.34	3,184,181,689	3,394.56	3,094,148,276	0.96
6	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インター ネットソフ トウェア・ サービス	219,300	12,588.32	2,760,619,673	11,950.67	2,620,783,576	0.81
7	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	468,700	5,339.33	2,502,547,486	5,589.56	2,619,830,287	0.81
8	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・カタロ グ販売	38,490	65,706.22	2,529,032,696	66,571.05	2,562,320,003	0.79
9	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通 信サービス	594,300	4,320.85	2,567,885,612	4,249.52	2,525,489,736	0.78
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	308,000	8,157.02	2,512,363,700	8,190.89	2,522,795,660	0.78
11	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	355,600	6,553.17	2,330,308,141	7,036.07	2,502,027,381	0.77
12	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インター ネットソフ トウェア・ サービス	30,040	82,370.66	2,474,414,852	77,465.94	2,327,076,838	0.72
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	262,800	9,074.13	2,384,681,364	8,767.92	2,304,211,347	0.71
14	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通 信サービス	393,100	5,930.89	2,331,432,859	5,672.97	2,230,047,455	0.69
15	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インター ネットソフ トウェア・ サービス	28,140	84,325.31	2,372,914,364	79,180.23	2,228,131,813	0.69
16	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	596,500	3,300.18	1,968,558,861	3,621.75	2,160,373,875	0.67
17	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗燃 料	181,900	10,453.68	1,901,525,756	11,397.53	2,073,212,071	0.64
18	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	399,200	5,112.15	2,040,772,276	4,903.63	1,957,529,096	0.60
19	スイス	株式	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	医薬品	67,880	26,746.01	1,815,519,159	28,055.65	1,904,417,522	0.59
20	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	114,600	15,634.98	1,791,769,281	16,199.10	1,856,416,860	0.57
21	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	219,900	7,908.64	1,739,111,036	8,427.98	1,853,313,902	0.57
22	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	122,500	14,642.84	1,793,748,512	14,898.56	1,825,073,906	0.56
23	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	メディア	151,300	10,855.37	1,642,417,859	11,554.48	1,748,192,824	0.54
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	269,100	5,840.89	1,571,784,845	6,180.02	1,663,044,055	0.51
25	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,003,000	1,479.43	1,483,868,290	1,648.44	1,653,390,335	0.51

26	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	187,500	8,426.60	1,579,988,437	8,643.91	1,620,733,125	0.50
27	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	239,200	6,672.80	1,596,133,760	6,727.67	1,609,259,860	0.49
28	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	149,700	10,831.22	1,621,434,757	10,675.38	1,598,104,760	0.49
29	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	456,100	3,589.92	1,637,363,652	3,484.56	1,589,308,956	0.49
30	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	140,800	11,270.22	1,586,848,032	11,263.64	1,585,920,864	0.49

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	0.75
		石油・ガス・消耗燃料	6.46
		化学	2.61
		建設資材	0.33
		容器・包装	0.30
		金属・鉱業	1.31
		紙製品・林産品	0.07
		航空宇宙・防衛	2.06
		建設関連製品	0.25
		建設・土木	0.33
		電気設備	0.77
		コングロマリット	2.13
		機械	1.33
		商社・流通業	0.30
		商業サービス・用品	0.44
		航空貨物・物流サービス	0.59
		旅客航空輸送業	0.15
		海運業	0.07
		陸運・鉄道	0.84
		運送インフラ	0.22
		自動車部品	0.56
		自動車	1.03
		家庭用耐久財	0.46
		レジャー用品	0.09
		繊維・アパレル・贅沢品	1.22
		ホテル・レストラン・レジャー	1.80
メディア	2.97		
販売	0.09		
インターネット販売・カタログ販売	1.25		
複合小売り	0.52		
専門小売り	1.98		
食品・生活必需品小売り	2.12		

飲料	2.44
食品	2.27
タバコ	1.58
家庭用品	1.52
パーソナル用品	0.70
ヘルスケア機器・用品	1.70
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.94
バイオテクノロジー	2.45
医薬品	6.58
銀行	8.48
各種金融サービス	1.45
保険	4.15
不動産管理・開発	0.63
インターネットソフトウェア・サービス	2.60
情報技術サービス	2.61
ソフトウェア	3.07
通信機器	0.83
コンピュータ・周辺機器	2.28
電子装置・機器・部品	0.38
半導体・半導体製造装置	1.99
各種電気通信サービス	2.85
無線通信サービス	0.40
電力	1.75
ガス	0.20
総合公益事業	1.27
水道	0.09
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02
消費者金融	0.54
資本市場	1.89
各種消費者サービス	0.01
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.07
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.44
専門サービス	0.47
投資信託受益証券	0.00
投資証券	2.65
合 計	98.09

(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 (5年)第12 5回	8,200,000,000	101.32	8,308,896,000	101.34	8,310,372,000	0.1	2020/9/20	1.24
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	8,100,000,000	101.27	8,203,194,000	101.28	8,204,409,000	0.1	2020/6/20	1.23
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	8,100,000,000	101.17	8,195,013,000	101.17	8,195,175,000	0.2	2018/12/20	1.22
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	7,800,000,000	101.15	7,890,402,000	101.18	7,892,586,000	0.1	2019/12/20	1.18
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	101.21	7,388,841,000	101.22	7,389,717,000	0.1	2020/3/20	1.10
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	7,300,000,000	101.05	7,376,796,000	101.07	7,378,475,000	0.2	2018/9/20	1.10
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 3回	7,000,000,000	101.16	7,081,620,000	101.17	7,082,180,000	0.3	2018/6/20	1.06
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	6,400,000,000	105.89	6,777,152,000	105.94	6,780,672,000	0.6	2023/12/20	1.01
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	6,000,000,000	104.57	6,274,560,000	104.78	6,286,860,000	0.4	2025/9/20	0.94
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	5,900,000,000	104.55	6,168,509,000	104.74	6,180,132,000	0.4	2025/6/20	0.92
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	5,900,000,000	103.56	6,110,453,000	103.83	6,126,324,000	0.3	2025/12/20	0.91
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	5,900,000,000	101.28	5,975,579,000	101.27	5,975,048,000	0.2	2019/3/20	0.89
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	5,500,000,000	105.99	5,829,890,000	106.05	5,833,190,000	0.6	2024/3/20	0.87
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,500,000,000	105.49	5,802,280,000	105.50	5,802,500,000	0.6	2023/3/20	0.87
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	107.08	5,675,293,000	107.11	5,676,830,000	0.8	2023/6/20	0.85
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 6回	5,600,000,000	100.57	5,632,424,000	100.62	5,635,112,000	0.2	2017/9/20	0.84
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	101.44	5,579,585,000	101.46	5,580,410,000	0.2	2019/9/20	0.83
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	5,500,000,000	101.38	5,575,960,000	101.42	5,578,320,000	0.1	2020/12/20	0.83
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	106.60	5,277,145,500	106.53	5,273,433,000	1.2	2020/12/20	0.79
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,900,000,000	106.47	5,217,373,000	106.42	5,214,727,000	0.8	2022/9/20	0.78
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 30回	4,800,000,000	107.29	5,149,968,000	107.32	5,151,600,000	0.8	2023/9/20	0.77
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	4,900,000,000	104.56	5,123,783,000	104.75	5,133,044,000	0.4	2025/3/20	0.76
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 8回	5,000,000,000	101.37	5,068,700,000	101.36	5,068,400,000	0.2	2019/6/20	0.76

24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	4,700,000,000	105.34	4,951,215,000	105.46	4,956,996,000	0.5	2024/9/20	0.74
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (40年)第1 回	2,960,000,000	153.41	4,540,995,200	161.08	4,768,204,800	2.4	2048/3/20	0.71
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 9回	4,700,000,000	101.06	4,750,146,000	101.05	4,749,538,000	0.1	2019/6/20	0.71
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 5回	4,500,000,000	100.47	4,521,285,000	100.50	4,522,770,000	0.2	2017/6/20	0.67
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	4,100,000,000	106.10	4,350,182,000	106.21	4,354,651,000	0.6	2024/6/20	0.65
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	4,100,000,000	105.64	4,331,609,000	105.55	4,327,673,000	1.3	2019/12/20	0.64
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第36 0回	4,200,000,000	100.55	4,223,268,000	100.60	4,225,368,000	0.1	2018/1/15	0.63

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.49
地方債証券	7.76
特殊債券	8.80
社債券	4.47
合計	99.54

(参考)外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	42,000,000	14,921.46	6,267,016,181	15,099.62	6,341,843,672	6	2026/2/15	1.00
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,800,000	12,008.81	6,220,563,981	11,993.61	6,212,693,703	3.625	2020/2/15	0.98
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	11,873.51	5,853,644,257	11,841.85	5,838,033,377	3.375	2019/11/15	0.92
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,100,000	11,539.52	5,781,304,180	11,614.63	5,818,932,721	2.625	2020/11/15	0.92
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,600,000	11,778.11	5,841,946,083	11,563.61	5,735,555,510	4.25	2017/11/15	0.90
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,600,000	11,993.85	5,589,135,186	11,967.89	5,577,038,597	3.5	2020/5/15	0.88
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,200,000	12,153.78	5,371,971,109	12,144.52	5,367,879,360	3.625	2021/2/15	0.85
8	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	23,900,000	20,805.48	4,972,511,700	20,831.05	4,978,623,245	6.5	2027/7/4	0.78
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,000,000	11,664.09	4,782,279,139	11,501.02	4,715,421,218	3.5	2018/2/15	0.74
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,500,000	16,130.10	4,597,081,343	16,165.38	4,607,135,808	4.25	2023/10/25	0.73
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	40,600,000	10,852.69	4,406,195,739	11,055.59	4,488,572,425	1.75	2023/5/15	0.71
12	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	23,100,000	19,322.71	4,463,546,407	19,394.06	4,480,027,929	5.5	2029/4/25	0.71
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,000,000	11,974.59	4,430,599,330	11,889.86	4,399,251,277	3.625	2019/8/15	0.69
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,400,000	11,790.06	4,291,584,226	11,922.45	4,339,772,127	3.125	2021/5/15	0.68

15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,000,000	11,558.00	4,276,461,797	11,599.20	4,291,705,156	2.625	2020/8/15	0.68
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,000,000	11,150.19	3,679,564,876	11,677.22	3,853,485,138	3	2044/11/15	0.61
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	11,215.06	3,869,197,221	11,152.91	3,847,755,546	1.875	2017/9/30	0.61
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	11,204.82	3,776,026,947	11,302.53	3,808,954,163	2	2022/2/15	0.60
19	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000	18,801.41	3,722,680,519	18,804.18	3,723,227,640	6	2025/10/25	0.59
20	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	19,800,000	18,296.71	3,622,750,391	18,568.25	3,676,514,767	3.25	2044/1/22	0.58
21	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	25,900,000	14,272.43	3,696,561,823	14,091.34	3,649,657,992	4.25	2019/9/1	0.57
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	26,900,000	13,634.66	3,667,724,652	13,393.29	3,602,795,742	4.5	2018/2/1	0.57
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	30,600,000	11,917.98	3,646,903,470	11,760.82	3,598,812,897	3.75	2018/11/15	0.57
24	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	28,700,000	12,505.10	3,588,963,808	12,514.02	3,591,525,645	0.5	2017/10/31	0.56
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	31,200,000	11,171.36	3,485,466,064	11,496.31	3,586,849,500	2.375	2024/8/15	0.56
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	31,000,000	11,508.68	3,567,692,322	11,407.56	3,536,346,282	2.875	2018/3/31	0.56
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	30,400,000	11,332.28	3,445,013,434	11,611.20	3,529,806,770	2.5	2024/5/15	0.55
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,600,000	20,916.49	3,472,138,962	20,974.04	3,481,691,610	5.75	2032/10/25	0.55
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	29,800,000	11,885.22	3,541,796,680	11,547.32	3,441,103,950	4.75	2017/8/15	0.54
30	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,900,000	16,135.81	3,372,385,291	16,199.97	3,385,795,486	1.25	2018/7/22	0.53

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.92
合計	98.92

【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 - KOKUSA Iマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 国内債券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(2016年06月限)	買建	389	日本円	5,225,949,044	5,160,085,000	1.82

(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(2016 年06月限)	買建	358	米ドル	36,827,212.5	4,041,786,570	37,424,425	4,107,330,637	1.27
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2016年06 月限)	買建	17	カナダド ル	2,685,060	234,110,380	2,752,640	240,002,677	0.07
	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(2016年06月 限)	買建	209	ユーロ	6,195,920	769,037,596	6,405,850	795,094,102	0.24
	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(2016年06月限)	買建	51	英ポンド	3,137,920	500,435,482	3,196,680	509,806,519	0.15
	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 (2016年06月限)	買建	26	スイスフ ラン	2,014,540	227,441,566	2,087,800	235,712,620	0.07

(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28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
第8計算期間	(2015年 3月31日)	6,732	6,735	1.2599	1.2604
第9計算期間	(2016年 3月31日)	7,669	7,673	1.1776	1.1781
	2015年 4月末日	6,876		1.2819	
	5月末日	7,257		1.3266	
	6月末日	7,203		1.2962	
	7月末日	7,484		1.3183	
	8月末日	7,088		1.2474	
	9月末日	6,867		1.1842	
	10月末日	7,467		1.2715	
	11月末日	7,609		1.2830	
	12月末日	7,724		1.2637	
	2016年 1月末日	7,408		1.1984	
	2月末日	7,033		1.1334	
	3月末日	7,669		1.1776	
	4月末日	7,703		1.1718	

【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
第8計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	0.0005円
第9計算期間	2015年 4月 1日～2016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%
第8計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	21.5%
第9計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	6.5%

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

（４）【設定及び解約の実績】

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
第8計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	1,874,209,965	941,707,489	5,343,815,596
第9計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	2,335,022,495	1,165,689,519	6,513,148,572

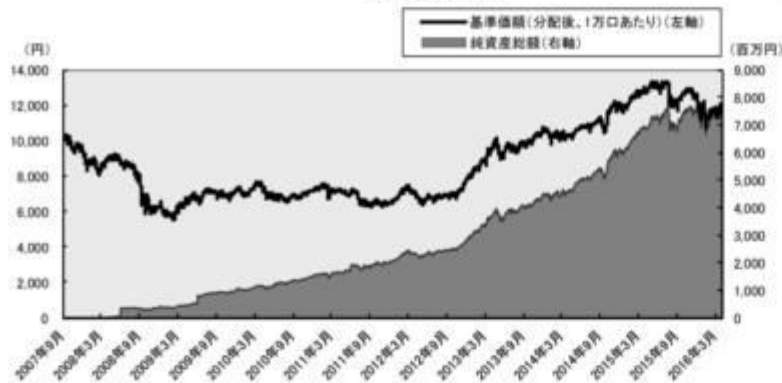
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

運用実績 (2016年4月28日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次:設定来)



分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2016年3月	5 円
2015年3月	5 円
2014年3月	5 円
2013年4月	0 円
2012年4月	0 円
設定来累計	15 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	44.3
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	25.2
3	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	20.4
4	外国債券マザーファンド	10.0

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1.5
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.9
3	日本電信電話	情報・通信業	0.8
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.7
5	KDDI	情報・通信業	0.7

・「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	0.5
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3
3	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.3
4	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.3
5	GENERAL ELEC CO	コングロマリット	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

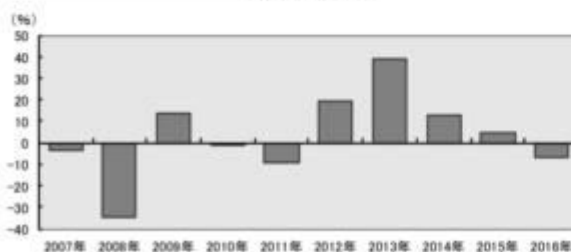
順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付(5年)第125回	国債証券	0.3
2	国庫債券 利付(5年)第124回	国債証券	0.3
3	国庫債券 利付(5年)第116回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付(5年)第122回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付(5年)第123回	国債証券	0.2

・「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	US TREASURY BOND	国債証券	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2007年は設定日(2007年9月27日)から年末までの収益率。
- ・2016年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

販売の単位は、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

<申込手数料>

なし

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

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します。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

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

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

無期限とします(平成19年9月27日設定)。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年4月1日から翌年3月31日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間は、下記「(5) その他 (a) ファンドの繰上償還条項 等」による解約の日までとします。

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、やむを得ない事情が発生したとき等は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b) 信託期間の終了

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

() 上記()の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を

述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- () 上記()の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。
- () 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- () 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交付運用報告書を作成し、知られたる受益者に対して交付します。

(d) 信託約款の変更

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

(e) 公告

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

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

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告

は、日本経済新聞に掲載します。

(f) 反対者の買取請求権

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

(g) 関係法人との契約の更新に関する手續

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

自動けいぞく投資契約に基づいて、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9期計算期間(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人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8期 (平成27年 3月31日現在)	第9期 (平成28年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	-	10,911,680
コール・ローン	26,046,380	10,336,037
親投資信託受益証券	6,729,759,185	7,666,491,928
未収利息	12	-
流動資産合計	6,755,805,577	7,687,739,645
資産合計	6,755,805,577	7,687,739,645
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,671,907	3,256,574
未払解約金	12,821,865	5,124,233
未払受託者報酬	966,149	1,186,526
未払委託者報酬	6,762,981	8,305,630
その他未払費用	96,555	118,594
流動負債合計	23,319,457	17,991,557
負債合計	23,319,457	17,991,557
純資産の部		
元本等		
元本	5,343,815,596	6,513,148,572
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,388,670,524	1,156,599,516
(分配準備積立金)	1,870,496,097	1,639,934,434
元本等合計	6,732,486,120	7,669,748,088
純資産合計	6,732,486,120	7,669,748,088
負債純資産合計	6,755,805,577	7,687,739,645

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日	自	平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日
営業収益				
受取利息		7,545		8,606
有価証券売買等損益		1,110,750,974		494,820,888
営業収益合計		1,110,758,519		494,812,282
営業費用				
受託者報酬		1,766,405		2,338,169
委託者報酬		12,364,717		16,367,102
その他費用		176,516		233,701
営業費用合計		14,307,638		18,938,972
営業利益又は営業損失（ ）		1,096,450,881		513,751,254
経常利益又は経常損失（ ）		1,096,450,881		513,751,254
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,096,450,881		513,751,254
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（ ）		88,764,725		15,407,250
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		163,282,271		1,388,670,524
剰余金増加額又は欠損金減少額		264,603,459		575,970,450
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		264,603,459		575,970,450
剰余金減少額又は欠損金増加額		44,229,455		306,440,880
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		44,229,455		306,440,880
分配金		2,671,907		3,256,574
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,388,670,524		1,156,599,516

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成27年 4月 1日から平成28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8期 平成27年 3月31日現在	第9期 平成28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 5,343,815,596口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,513,148,572口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2599円 (10,000口当たり純資産額) (12,599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 1.1776円 (10,000口当たり純資産額) (11,776円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日	第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28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>101,004,556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>906,681,600円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>854,063,467円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>865,481,848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>2,727,231,471円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>5,343,815,596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>5,103円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>2,671,907円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	101,004,556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	906,681,600円	収益調整金額	C	854,063,467円	分配準備積立金額	D	865,481,848円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,727,231,471円	当ファンドの期末残存口数	F	5,343,815,596口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,103円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,671,907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>118,014,381円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,800,537,699円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,525,176,627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>3,443,728,707円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>6,513,148,572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>5,287円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>3,256,574円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	118,014,381円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,800,537,699円	分配準備積立金額	D	1,525,176,627円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,443,728,707円	当ファンドの期末残存口数	F	6,513,148,572口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,287円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,256,574円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	101,004,556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	906,681,600円																																																											
収益調整金額	C	854,063,467円																																																											
分配準備積立金額	D	865,481,848円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,727,231,471円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	5,343,815,596口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,103円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,671,907円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	118,014,381円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	1,800,537,699円																																																											
分配準備積立金額	D	1,525,176,627円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,443,728,707円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	6,513,148,572口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,287円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,256,574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8期 自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日	第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第8期 平成27年 3月31日現在	第9期 平成28年 3月31日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第8期 自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日	第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28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8期 自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日	第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日
期首元本額 4,411,313,120円	期首元本額 5,343,815,596円
期中追加設定元本額 1,874,209,965円	期中追加設定元本額 2,335,022,495円
期中一部解約元本額 941,707,489円	期中一部解約元本額 1,165,689,519円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第8期 自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日	第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28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	1,072,680,172	501,135,396
合計	1,072,680,172	501,135,396

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 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28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		3,397,854,987	
		外国債券マザーファンド		775,257,894	
		外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド		1,953,889,754	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド		1,539,489,293	
	小計	銘柄数:4 組入時価比率:100.0%		7,666,491,928 100.0%	
合計			7,666,491,928		

(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-KOKUSA I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28年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	11,563,349,960
コール・ローン	10,953,328,118
株式	278,413,493,530
派生商品評価勘定	1,695,140

(平成28年 3月31日現在)

未収入金	773,208,364
未収配当金	2,776,086,246
未収利息	132
その他未収収益	7,003,706
差入委託証拠金	159,139,020
流動資産合計	304,647,304,216
資産合計	304,647,304,216
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,497,260
未払金	2,074,605,900
未払解約金	206,406,864
有価証券貸借取引受入金	18,523,259,275
流動負債合計	20,825,769,299
負債合計	20,825,769,299
純資産の部	
元本等	
元本	226,101,018,220
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	57,720,516,697
元本等合計	283,821,534,917
純資産合計	283,821,534,917
負債純資産合計	304,647,304,216

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 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	1.2553円
(10,000口当たり純資産額)	(12,553円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	17,290,140,690円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 4月 1日 至 平成28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28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> 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28年 3月31日現在	
期首	平成27年 4月 1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	179,624,319,005円
同期中における追加設定元本額	77,502,700,660円
同期中における一部解約元本額	31,026,001,445円
期末元本額	226,101,018,220円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	197,196,096円
バランスセレクト50	459,995,225円
バランスセレクト70	514,589,379円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,536,321,979円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	5,482,014,430円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	9,309,866,105円
野村資産設計ファンド2015	103,594,285円
野村資産設計ファンド2020	108,161,785円
野村資産設計ファンド2025	134,626,046円
野村資産設計ファンド2030	129,464,241円
野村資産設計ファンド2035	92,775,276円
野村資産設計ファンド2040	312,112,478円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	79,319,930,755円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,357,548,224円
のむラップ・ファンド（普通型）	3,417,644,181円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,111,305,602円
野村資産設計ファンド2045	29,196,794円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,560,482,585円
マイ・ロード	2,522,552,429円
ネクストコア	28,959,499円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	322,749,310円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,193,975,531円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	535,576,892円
野村資産設計ファンド2050	15,547,756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）	977,800,128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）	721,474,375円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	5,176,324,635円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,264,807,662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）	14,925,519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）	49,356,872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）	20,090,428円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,679,406,646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）	518,950,909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）	3,395,829,290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）	1,340,779,613円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,327,589,367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）	501,429,145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)	80,937,646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)	421,305,850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)	6,526,055,312円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	997,918,531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)	546,931,344円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	491,414,957円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	33,193,814円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	11,017,635円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	38,867,559円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	39,086,188円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	95,131,560円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,318,031,671円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,805,159,344円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,963,048,365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)	32,160,577,278円
マイバランスDC30	2,299,123,809円
マイバランスDC50	2,995,159,466円
マイバランスDC70	2,706,807,128円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,649,508,503円
野村DC運用戦略ファンド	45,415,062円
野村DC運用戦略ファンドM	314,962円
野村DC運用戦略ファンドA	549,957円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	88,579,142円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	617,804円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,313,861円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 3月31日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	66,000	258.00	17,028,000	貸付有価証券 31,000株(19,000株)
		日本水産	180,500	547.00	98,733,500	貸付有価証券 3,800株
		マルハニチロ	32,000	2,099.00	67,168,000	貸付有価証券 100株
		サカタのタネ	23,100	2,859.00	66,042,900	貸付有価証券 1,100株

ホクト	15,900	2,226.00	35,393,400	
ホクリヨウ	1,600	978.00	1,564,800	
住石ホールディングス	46,000	97.00	4,462,000	貸付有価証券 14,600株（12,600株）
日鉄鉱業	44,000	420.00	18,480,000	
三井松島産業	102,000	117.00	11,934,000	貸付有価証券 3,000株
国際石油開発帝石	825,300	853.50	704,393,550	
日本海洋掘削	4,700	2,354.00	11,063,800	貸付有価証券 2,200株（300株）
石油資源開発	24,800	2,522.00	62,545,600	貸付有価証券 3,400株
K & Oエナジーグループ	10,500	1,390.00	14,595,000	
ショーボンドホールディングス	16,400	4,280.00	70,192,000	貸付有価証券 7,100株
ミライト・ホールディングス	48,200	896.00	43,187,200	
タマホーム	11,700	444.00	5,194,800	貸付有価証券 5,400株（1,500株）
サンヨーホームズ	3,300	509.00	1,679,700	貸付有価証券 1,500株
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,074.00	3,866,400	貸付有価証券 1,600株（100株）
安藤・間	104,500	548.00	57,266,000	
東急建設	51,000	920.00	46,920,000	貸付有価証券 23,200株
コムシスホールディングス	67,300	1,738.00	116,967,400	貸付有価証券 4,500株（300株）
ミサワホーム	18,500	745.00	13,782,500	貸付有価証券 8,600株
高松コンストラクショングループ	11,800	2,426.00	28,626,800	
東建コーポレーション	6,400	9,200.00	58,880,000	貸付有価証券 900株
ヤマウラ	7,300	477.00	3,482,100	
大成建設	814,000	744.00	605,616,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
大林組	469,900	1,110.00	521,589,000	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
清水建設	479,000	954.00	456,966,000	貸付有価証券 33,000株

飛島建設	125,800	186.00	23,398,800	貸付有価証券 58,800株（1,300株）
長谷工コーポレーション	182,800	1,048.00	191,574,400	
松井建設	17,300	750.00	12,975,000	
銭高組	22,000	473.00	10,406,000	
鹿島建設	734,000	706.00	518,204,000	
不動テトラ	110,600	126.00	13,935,600	貸付有価証券 47,200株
大末建設	6,000	795.00	4,770,000	
鉄建建設	95,000	271.00	25,745,000	貸付有価証券 44,000株（1,000株）
西松建設	181,000	483.00	87,423,000	貸付有価証券 28,000株
三井住友建設	600,300	101.00	60,630,300	貸付有価証券 98,900株
大豊建設	61,000	490.00	29,890,000	貸付有価証券 14,000株
前田建設工業	96,000	839.00	80,544,000	貸付有価証券 14,000株
佐田建設	10,800	430.00	4,644,000	貸付有価証券 100株
ナカノフドー建設	12,000	551.00	6,612,000	
奥村組	149,000	595.00	88,655,000	
東鉄工業	18,800	3,460.00	65,048,000	
イチケン	17,000	322.00	5,474,000	貸付有価証券 3,000株
浅沼組	50,000	301.00	15,050,000	貸付有価証券 13,000株
戸田建設	182,000	544.00	99,008,000	
熊谷組	229,000	286.00	65,494,000	
青木あすなる建設	10,300	727.00	7,488,100	
北野建設	33,000	273.00	9,009,000	
植木組	19,000	231.00	4,389,000	
三井ホーム	20,000	526.00	10,520,000	
矢作建設工業	21,300	790.00	16,827,000	貸付有価証券 6,800株（700株）
ピーエス三菱	18,600	402.00	7,477,200	貸付有価証券 6,000株（1,100株）
日本ハウスホールディングス	31,900	406.00	12,951,400	貸付有価証券 14,900株

大東建託	58,500	15,980.00	934,830,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
新日本建設	18,600	531.00	9,876,600	
N I P P O	36,000	1,893.00	68,148,000	
東亜道路工業	29,000	375.00	10,875,000	
前田道路	49,000	1,856.00	90,944,000	
日本道路	47,000	523.00	24,581,000	貸付有価証券 4,000株
東亜建設工業	137,000	266.00	36,442,000	
若築建設	90,000	127.00	11,430,000	貸付有価証券 42,000株(2,000株)
東洋建設	49,200	491.00	24,157,200	貸付有価証券 9,000株
五洋建設	173,800	471.00	81,859,800	
大林道路	18,300	744.00	13,615,200	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
世紀東急工業	24,600	471.00	11,586,600	
福田組	25,000	1,127.00	28,175,000	
住友林業	107,800	1,293.00	139,385,400	
日本基礎技術	17,400	413.00	7,186,200	
日成ビルド工業	43,000	385.00	16,555,000	貸付有価証券 20,000株
ヤマダ・エスバイエル ホーム	80,000	85.00	6,800,000	貸付有価証券 26,000株
巴コーポレーション	19,500	357.00	6,961,500	貸付有価証券 100株
パナホーム	59,000	845.00	49,855,000	
大和ハウス工業	462,800	3,166.00	1,465,224,800	
ライト工業	30,100	1,040.00	31,304,000	
積水ハウス	523,800	1,899.50	994,958,100	
日特建設	17,200	405.00	6,966,000	
北陸電気工事	5,700	886.00	5,050,200	
ユアテック	25,000	940.00	23,500,000	貸付有価証券 6,000株
西部電気工業	13,000	409.00	5,317,000	
四電工	12,000	384.00	4,608,000	
中電工	22,600	2,249.00	50,827,400	
関電工	62,000	803.00	49,786,000	貸付有価証券 5,000株

きんでん	94,700	1,380.00	130,686,000	
東京エネシス	18,000	910.00	16,380,000	
トーエネック	22,000	694.00	15,268,000	
住友電設	12,400	1,457.00	18,066,800	
日本電設工業	25,500	2,262.00	57,681,000	
協和エクシオ	61,400	1,250.00	76,750,000	
新日本空調	13,200	994.00	13,120,800	貸付有価証券 800株
N D S	25,000	310.00	7,750,000	
九電工	29,000	2,679.00	77,691,000	貸付有価証券 13,000株(11,000株)
三機工業	34,700	901.00	31,264,700	貸付有価証券 1,900株
日揮	157,000	1,685.00	264,545,000	貸付有価証券 1,000株
中外炉工業	47,000	197.00	9,259,000	貸付有価証券 13,000株
ヤマト	14,000	460.00	6,440,000	
太平電業	23,000	938.00	21,574,000	貸付有価証券 5,000株
高砂熱学工業	46,700	1,414.00	66,033,800	貸付有価証券 14,900株
三晃金属工業	15,000	313.00	4,695,000	
朝日工業社	18,000	433.00	7,794,000	
明星工業	28,400	470.00	13,348,000	
大気社	19,200	2,714.00	52,108,800	貸付有価証券 8,700株(8,000株)
ダイダン	21,000	744.00	15,624,000	
日比谷総合設備	18,800	1,576.00	29,628,800	
東芝プラントシステム	25,400	1,379.00	35,026,600	貸付有価証券 11,800株(4,400株)
OSJBホールディングス	31,900	259.00	8,262,100	貸付有価証券 14,900株
東洋エンジニアリング	84,000	293.00	24,612,000	貸付有価証券 27,000株
千代田化工建設	113,000	825.00	93,225,000	貸付有価証券 15,000株
新興プランテック	32,200	857.00	27,595,400	貸付有価証券 1,700株
日本製粉	103,000	925.00	95,275,000	

日清製粉グループ本社	171,800	1,789.00	307,350,200	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
日東富士製粉	12,000	361.00	4,332,000	貸付有価証券 1,000株
昭和産業	64,000	466.00	29,824,000	
鳥越製粉	12,400	660.00	8,184,000	
中部飼料	14,500	838.00	12,151,000	
フィード・ワン	94,300	121.00	11,410,300	
東洋精糖	24,000	102.00	2,448,000	
日本甜菜製糖	80,000	191.00	15,280,000	
三井製糖	62,000	502.00	31,124,000	
塩水港精糖	16,700	247.00	4,124,900	貸付有価証券 900株
日新製糖	6,600	1,376.00	9,081,600	
森永製菓	141,000	573.00	80,793,000	
中村屋	36,000	460.00	16,560,000	
江崎グリコ	36,200	5,770.00	208,874,000	
名糖産業	6,900	1,302.00	8,983,800	
不二家	90,000	192.00	17,280,000	貸付有価証券 4,000株
山崎製パン	115,000	2,371.00	272,665,000	
第一屋製パン	24,000	106.00	2,544,000	
モロゾフ	24,000	422.00	10,128,000	
亀田製菓	8,700	4,480.00	38,976,000	
寿スピリッツ	11,100	2,527.00	28,049,700	貸付有価証券 1,700株
カルビー	58,100	4,470.00	259,707,000	
森永乳業	141,000	603.00	85,023,000	
六甲バター	7,000	1,755.00	12,285,000	貸付有価証券 3,200株
ヤクルト本社	84,000	4,985.00	418,740,000	貸付有価証券 17,300株（15,500株）
明治ホールディングス	92,800	9,050.00	839,840,000	
雪印メグミルク	36,900	2,829.00	104,390,100	貸付有価証券 2,100株（1,900株）
プリマハム	99,000	285.00	28,215,000	貸付有価証券 4,000株
日本ハム	115,000	2,480.00	285,200,000	
伊藤ハム	75,000	737.00	55,275,000	

林兼産業	50,000	101.00	5,050,000	貸付有価証券 4,000株
丸大食品	81,000	437.00	35,397,000	
米久	5,000	2,709.00	13,545,000	
S Foods	9,800	2,434.00	23,853,200	貸付有価証券 4,600株（3,300株）
サッポロホールディングス	239,000	560.00	133,840,000	貸付有価証券 16,000株
アサヒグループホールディングス	293,900	3,507.00	1,030,707,300	貸付有価証券 50,100株
キリンホールディングス	634,900	1,578.00	1,001,872,200	貸付有価証券 110,600株
宝ホールディングス	113,400	927.00	105,121,800	
オエノンホールディングス	43,000	207.00	8,901,000	
養命酒製造	4,800	1,977.00	9,489,600	
コカ・コーラウエスト	53,100	2,786.00	147,936,600	
コカ・コーライースト ジャパン	55,400	1,868.00	103,487,200	
サントリー食品インター ナショナル	107,300	5,070.00	544,011,000	
ダイトードリンコ	7,900	5,250.00	41,475,000	貸付有価証券 100株（100株）
伊藤園	46,500	3,555.00	165,307,500	貸付有価証券 14,400株（1,600株）
キーコーヒー	13,800	1,866.00	25,750,800	貸付有価証券 1,000株
ユニカフェ	4,200	921.00	3,868,200	貸付有価証券 1,900株
ジャパンフーズ	2,000	1,160.00	2,320,000	貸付有価証券 900株
日清オイリオグループ	83,000	459.00	38,097,000	
不二製油グループ本社	41,800	2,029.00	84,812,200	
かどや製油	1,500	2,827.00	4,240,500	貸付有価証券 300株
J - オイルミルズ	65,000	344.00	22,360,000	
キッコーマン	119,000	3,700.00	440,300,000	
味の素	329,000	2,539.50	835,495,500	
キューピー	79,700	2,552.00	203,394,400	貸付有価証券 9,700株
ハウス食品グループ本社	53,500	2,104.00	112,564,000	貸付有価証券

				5,100株(2,500株)
カゴメ	56,200	2,200.00	123,640,000	貸付有価証券 26,300株(14,300株)
焼津水産化学工業	7,400	1,017.00	7,525,800	貸付有価証券 2,000株
アリアケジャパン	12,800	6,600.00	84,480,000	
ピエトロ	1,500	1,919.00	2,878,500	貸付有価証券 600株(400株)
エバラ食品工業	3,800	2,014.00	7,653,200	
ニチレイ	167,000	916.00	152,972,000	
東洋水産	77,000	4,040.00	311,080,000	貸付有価証券 2,100株
イトアンド	1,700	2,268.00	3,855,600	貸付有価証券 700株
日清食品ホールディングス	66,300	5,290.00	350,727,000	
永谷園ホールディングス	15,000	1,116.00	16,740,000	
一正蒲鉾	5,400	997.00	5,383,800	貸付有価証券 1,400株
フジッコ	15,200	2,352.00	35,750,400	
ロック・フィールド	8,100	3,425.00	27,742,500	
日本たばこ産業	926,200	4,690.00	4,343,878,000	貸付有価証券 263,500株
ケンコーマヨネーズ	5,100	2,431.00	12,398,100	
わらべや日洋	8,400	2,479.00	20,823,600	
なとり	7,800	1,629.00	12,706,200	貸付有価証券 3,600株
北の達人コーポレーション	2,200	505.00	1,111,000	貸付有価証券 900株
ユーグレナ	53,000	1,631.00	86,443,000	貸付有価証券 24,400株
ミヨシ油脂	54,000	126.00	6,804,000	貸付有価証券 1,000株
理研ビタミン	4,600	4,015.00	18,469,000	
片倉工業	18,300	1,183.00	21,648,900	貸付有価証券 800株
ゲンゼ	118,000	318.00	37,524,000	
東洋紡	580,000	169.00	98,020,000	貸付有価証券 40,000株
ユニチカ	426,000	54.00	23,004,000	貸付有価証券 143,000株

富士紡ホールディングス	71,000	224.00	15,904,000	
倉敷紡績	150,000	195.00	29,250,000	
シキボウ	89,000	111.00	9,879,000	
日本毛織	45,100	760.00	34,276,000	貸付有価証券 21,000株
大東紡織	21,000	60.00	1,260,000	
トーア紡コーポレーション	6,200	512.00	3,174,400	貸付有価証券 1,600株
ダイドーリミテッド	16,400	480.00	7,872,000	貸付有価証券 7,600株
帝国繊維	15,300	1,537.00	23,516,100	貸付有価証券 1,400株
帝人	599,000	392.00	234,808,000	貸付有価証券 56,000株(56,000株)
東レ	1,062,000	959.20	1,018,670,400	貸付有価証券 15,000株
サカイオーベックス	39,000	175.00	6,825,000	
住江織物	37,000	327.00	12,099,000	
日本フェルト	7,800	447.00	3,486,600	貸付有価証券 2,500株
イチカワ	10,000	270.00	2,700,000	
日東製網	16,000	154.00	2,464,000	貸付有価証券 2,000株
芦森工業	32,000	164.00	5,248,000	貸付有価証券 14,000株
アツギ	113,000	114.00	12,882,000	
ダイニック	28,000	155.00	4,340,000	
セーレン	36,500	1,265.00	46,172,500	
東海染工	20,000	136.00	2,720,000	
小松精練	22,500	649.00	14,602,500	貸付有価証券 8,800株
ワコールホールディングス	87,000	1,343.00	116,841,000	
ホギメディカル	9,200	6,040.00	55,568,000	貸付有価証券 4,000株(2,400株)
レナウン	39,600	114.00	4,514,400	貸付有価証券 17,600株(7,000株)
クラウディア	3,800	569.00	2,162,200	貸付有価証券 1,400株
T S Iホールディングス	65,300	750.00	48,975,000	

三陽商会	82,000	256.00	20,992,000	貸付有価証券 36,000株
ナイガイ	54,000	50.00	2,700,000	貸付有価証券 13,000株
オンワードホールディングス	95,000	769.00	73,055,000	貸付有価証券 29,000株
ルック	27,000	152.00	4,104,000	貸付有価証券 5,000株
キムラタン	617,000	7.00	4,319,000	貸付有価証券 289,000株
ゴールドウイン	6,200	4,555.00	28,241,000	貸付有価証券 2,600株(900株)
デサント	33,400	1,658.00	55,377,200	
キング	7,300	383.00	2,795,900	
ヤマトインターナショナル	9,000	386.00	3,474,000	貸付有価証券 2,800株
特種東海製紙	85,000	364.00	30,940,000	
王子ホールディングス	601,000	452.00	271,652,000	貸付有価証券 26,000株
日本製紙	75,700	2,003.00	151,627,100	貸付有価証券 10,100株
三菱製紙	223,000	80.00	17,840,000	
北越紀州製紙	90,900	671.00	60,993,900	貸付有価証券 16,800株
中越パルプ工業	58,000	196.00	11,368,000	貸付有価証券 24,000株(18,000株)
巴川製紙所	23,000	195.00	4,485,000	貸付有価証券 1,000株
大王製紙	64,800	949.00	61,495,200	貸付有価証券 30,300株(8,000株)
レンゴー	129,000	568.00	73,272,000	貸付有価証券 5,000株
トーモク	46,000	277.00	12,742,000	
ザ・パック	10,400	2,704.00	28,121,600	
クラレ	231,100	1,376.00	317,993,600	貸付有価証券 67,200株
旭化成	913,000	760.90	694,701,700	
共和レザー	9,600	893.00	8,572,800	
昭和電工	975,000	116.00	113,100,000	貸付有価証券 455,000株
住友化学	1,078,000	509.00	548,702,000	

日本化成	27,000	113.00	3,051,000	
住友精化	30,000	556.00	16,680,000	貸付有価証券 13,000株
日産化学工業	88,000	2,900.00	255,200,000	
ラサ工業	55,000	110.00	6,050,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
クレハ	110,000	358.00	39,380,000	貸付有価証券 43,000株(23,000株)
多木化学	9,000	660.00	5,940,000	
テイカ	25,000	529.00	13,225,000	
石原産業	263,000	77.00	20,251,000	貸付有価証券 31,000株
片倉コープアグリ	18,000	231.00	4,158,000	
日東エフシー	8,600	886.00	7,619,600	貸付有価証券 200株
日本曹達	95,000	567.00	53,865,000	貸付有価証券 9,000株
東ソー	395,000	473.00	186,835,000	
トクヤマ	243,000	174.00	42,282,000	貸付有価証券 113,000株
セントラル硝子	159,000	611.00	97,149,000	
東亜合成	91,700	937.00	85,922,900	
大阪ソーダ	63,000	411.00	25,893,000	貸付有価証券 26,000株
関東電化工業	35,000	800.00	28,000,000	貸付有価証券 16,000株
デンカ	303,000	463.00	140,289,000	
信越化学工業	262,600	5,824.00	1,529,382,400	貸付有価証券 100株
日本カーバイド工業	50,000	128.00	6,400,000	
堺化学工業	59,000	309.00	18,231,000	
エア・ウォーター	121,000	1,666.00	201,586,000	
大陽日酸	112,800	1,068.00	120,470,400	貸付有価証券 36,500株(7,200株)
日本化学工業	54,000	208.00	11,232,000	
日本パーライジング	74,800	1,018.00	76,146,400	
高圧ガス工業	22,000	640.00	14,080,000	
チタン工業	17,000	185.00	3,145,000	
四国化成工業	21,000	976.00	20,496,000	

戸田工業	29,000	318.00	9,222,000	貸付有価証券 13,000株
ステラ ケミファ	7,500	2,402.00	18,015,000	貸付有価証券 1,100株
保土谷化学工業	44,000	187.00	8,228,000	貸付有価証券 20,000株
日本触媒	21,300	5,730.00	122,049,000	貸付有価証券 1,700株
大日精化工業	57,000	450.00	25,650,000	
カネカ	198,000	964.00	190,872,000	
三菱瓦斯化学	252,000	606.00	152,712,000	
三井化学	621,000	375.00	232,875,000	
J S R	137,400	1,618.00	222,313,200	
東京応化工業	29,400	2,816.00	82,790,400	貸付有価証券 5,600株
大阪有機化学工業	10,500	606.00	6,363,000	
三菱ケミカルホールディ ングス	980,900	587.50	576,278,750	
日本合成化学工業	34,000	713.00	24,242,000	
ダイセル	206,000	1,538.00	316,828,000	
住友ベークライト	137,000	441.00	60,417,000	
積水化学工業	332,500	1,386.00	460,845,000	
日本ゼオン	126,000	728.00	91,728,000	貸付有価証券 12,000株
アイカ工業	44,000	2,364.00	104,016,000	
宇部興産	784,000	199.00	156,016,000	
積水樹脂	22,600	1,508.00	34,080,800	
タキロン	34,000	558.00	18,972,000	
旭有機材工業	47,000	205.00	9,635,000	
日立化成	72,400	2,025.00	146,610,000	
ニチバン	14,000	659.00	9,226,000	
リケンテクノス	23,700	388.00	9,195,600	貸付有価証券 7,300株（500株）
大倉工業	35,000	292.00	10,220,000	
積水化成品工業	38,000	341.00	12,958,000	
群栄化学工業	39,000	299.00	11,661,000	
タイガースポリマー	7,200	602.00	4,334,400	
ミライアル	5,300	834.00	4,420,200	貸付有価証券 300株

ダイキアクシス	2,700	875.00	2,362,500	
ダイキョーニシカワ	18,900	1,615.00	30,523,500	貸付有価証券 8,800株
日本化薬	95,000	1,138.00	108,110,000	貸付有価証券 4,000株
カーリットホールディングス	13,600	496.00	6,745,600	貸付有価証券 6,300株
日本精化	12,100	769.00	9,304,900	
扶桑化学工業	9,300	1,660.00	15,438,000	貸付有価証券 4,300株
A D E K A	72,000	1,643.00	118,296,000	
日油	112,000	798.00	89,376,000	
新日本理化	23,100	138.00	3,187,800	貸付有価証券 8,400株
ハリマ化成グループ	12,500	538.00	6,725,000	貸付有価証券 200株
花王	393,900	6,003.00	2,364,581,700	貸付有価証券 75,800株
第一工業製薬	32,000	328.00	10,496,000	貸付有価証券 12,000株
ニイタカ	2,100	1,415.00	2,971,500	
三洋化成工業	46,000	793.00	36,478,000	
大日本塗料	84,000	195.00	16,380,000	貸付有価証券 8,000株
日本ペイントホールディングス	113,000	2,497.00	282,161,000	貸付有価証券 21,400株
関西ペイント	165,700	1,808.00	299,585,600	貸付有価証券 6,600株
神東塗料	11,000	173.00	1,903,000	
中国塗料	42,000	742.00	31,164,000	貸付有価証券 2,000株
日本特殊塗料	10,300	904.00	9,311,200	
藤倉化成	19,900	509.00	10,129,100	
太陽ホールディングス	10,700	3,810.00	40,767,000	
D I C	578,000	269.00	155,482,000	
サカティンクス	29,900	1,226.00	36,657,400	
東洋インキ S C ホールディングス	145,000	451.00	65,395,000	
T & K T O K A	10,600	952.00	10,091,200	貸付有価証券 4,800株

富士フィルムホールディングス	335,100	4,451.00	1,491,530,100	
資生堂	277,900	2,512.00	698,084,800	貸付有価証券 41,200株
ライオン	169,000	1,269.00	214,461,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
高砂香料工業	9,600	2,514.00	24,134,400	
マンダム	13,600	5,010.00	68,136,000	
ミルボン	8,600	4,550.00	39,130,000	
ファンケル	34,000	1,535.00	52,190,000	貸付有価証券 10,800株(1,500株)
コーセー	23,700	10,950.00	259,515,000	
コタ	5,050	1,183.00	5,974,150	
シーズ・ホールディングス	18,400	2,305.00	42,412,000	貸付有価証券 2,300株
シーボン	1,700	2,368.00	4,025,600	貸付有価証券 700株
ポーラ・オルビスホールディングス	14,900	9,330.00	139,017,000	
ノエビアホールディングス	9,200	3,235.00	29,762,000	貸付有価証券 4,300株
アジュバンコスメジャパン	2,700	914.00	2,467,800	貸付有価証券 1,200株
エステー	10,000	1,114.00	11,140,000	
アグロ カネショウ	5,700	1,048.00	5,973,600	貸付有価証券 300株
コニシ	23,000	1,404.00	32,292,000	
長谷川香料	18,500	1,705.00	31,542,500	
星光PMC	8,000	1,268.00	10,144,000	貸付有価証券 3,700株(200株)
小林製薬	22,200	9,880.00	219,336,000	貸付有価証券 100株
荒川化学工業	12,500	971.00	12,137,500	
メック	11,300	867.00	9,797,100	貸付有価証券 3,800株
日本高純度化学	4,100	2,036.00	8,347,600	貸付有価証券 1,900株
JCU	4,300	3,700.00	15,910,000	貸付有価証券 2,000株
新田ゼラチン	9,600	735.00	7,056,000	貸付有価証券 2,300株(2,000株)

O A T アグリオ	1,300	1,441.00	1,873,300	貸付有価証券 400株
デクセリアルズ	32,800	1,112.00	36,473,600	貸付有価証券 14,200株(100株)
アース製薬	10,500	4,550.00	47,775,000	貸付有価証券 4,900株(2,900株)
イハラケミカル工業	22,500	1,454.00	32,715,000	
北興化学工業	16,000	305.00	4,880,000	
大成ラミック	4,100	2,936.00	12,037,600	貸付有価証券 300株
クミアイ化学工業	30,200	1,010.00	30,502,000	貸付有価証券 13,900株(10,600株)
日本農薬	33,400	571.00	19,071,400	貸付有価証券 15,600株(500株)
アキレス	120,000	144.00	17,280,000	
有沢製作所	21,600	575.00	12,420,000	
日東電工	113,200	6,257.00	708,292,400	貸付有価証券 400株
レック	4,600	1,279.00	5,883,400	貸付有価証券 2,100株
きもと	23,800	171.00	4,069,800	貸付有価証券 900株
藤森工業	12,500	2,646.00	33,075,000	貸付有価証券 100株
前澤化成工業	10,200	1,032.00	10,526,400	
J S P	9,500	2,242.00	21,299,000	
エフピコ	13,000	4,815.00	62,595,000	
天馬	11,300	1,843.00	20,825,900	貸付有価証券 400株
信越ポリマー	28,700	603.00	17,306,100	
東リ	38,000	287.00	10,906,000	
ニフコ	28,000	5,410.00	151,480,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
日本バルカー工業	57,000	295.00	16,815,000	
ユニ・チャーム	296,500	2,449.00	726,128,500	貸付有価証券 56,700株(6,400株)
協和発酵キリン	175,200	1,796.00	314,659,200	貸付有価証券 45,400株
武田薬品工業	583,200	5,136.00	2,995,315,200	
アステラス製薬	1,639,800	1,496.50	2,453,960,700	

大日本住友製薬	103,600	1,296.00	134,265,600	貸付有価証券 48,500株
塩野義製薬	213,400	5,297.00	1,130,379,800	
田辺三菱製薬	170,600	1,957.00	333,864,200	
わかもと製薬	17,000	259.00	4,403,000	貸付有価証券 7,000株
あすか製薬	18,600	1,392.00	25,891,200	貸付有価証券 4,500株
日本新薬	33,500	4,400.00	147,400,000	
バイオフェルミン製薬	2,400	3,760.00	9,024,000	貸付有価証券 200株
中外製薬	145,800	3,485.00	508,113,000	
科研製薬	25,200	6,810.00	171,612,000	
エーザイ	180,300	6,770.00	1,220,631,000	
ロート製薬	71,700	2,050.00	146,985,000	
小野薬品工業	332,600	4,765.00	1,584,839,000	貸付有価証券 600株（600株）
久光製薬	45,400	5,030.00	228,362,000	
有機合成薬品工業	10,000	247.00	2,470,000	
持田製薬	10,100	8,360.00	84,436,000	
参天製薬	269,700	1,693.00	456,602,100	
扶桑薬品工業	49,000	260.00	12,740,000	貸付有価証券 1,000株
日本ケミファ	20,000	479.00	9,580,000	
ツムラ	46,100	2,702.00	124,562,200	貸付有価証券 21,500株
日医工	34,200	2,596.00	88,783,200	
キッセイ薬品工業	25,900	2,594.00	67,184,600	
生化学工業	28,000	1,695.00	47,460,000	貸付有価証券 6,400株
栄研化学	12,300	2,356.00	28,978,800	
日水製薬	5,900	1,296.00	7,646,400	
鳥居薬品	10,000	2,588.00	25,880,000	貸付有価証券 300株
JCRファーマ	11,300	2,562.00	28,950,600	貸付有価証券 100株
東和薬品	6,700	4,615.00	30,920,500	貸付有価証券 2,300株（800株）
富士製薬工業	4,100	1,896.00	7,773,600	貸付有価証券

				1,400株
沢井製薬	24,900	7,050.00	175,545,000	
ゼリア新薬工業	30,000	1,461.00	43,830,000	貸付有価証券 3,900株
第一三共	492,500	2,502.50	1,232,481,250	
キョーリン製薬ホールディングス	39,000	2,144.00	83,616,000	
大幸薬品	7,200	1,443.00	10,389,600	貸付有価証券 3,300株
ダイト	6,100	3,015.00	18,391,500	
大塚ホールディングス	314,800	4,088.00	1,286,902,400	
大正製薬ホールディングス	35,200	8,920.00	313,984,000	貸付有価証券 1,700株(100株)
ペプチドリーム	18,000	6,850.00	123,300,000	貸付有価証券 8,400株
日本コークス工業	118,100	81.00	9,566,100	
昭和シェル石油	147,200	1,010.00	148,672,000	貸付有価証券 20,500株
ニチレキ	17,900	812.00	14,534,800	
東燃ゼネラル石油	221,000	1,018.00	224,978,000	
ユシロ化学工業	7,800	1,316.00	10,264,800	
ピーピー・カストロール	6,000	1,276.00	7,656,000	貸付有価証券 100株
富士石油	33,900	310.00	10,509,000	
MORESCO	4,600	1,332.00	6,127,200	貸付有価証券 2,100株
出光興産	76,400	2,009.00	153,487,600	貸付有価証券 33,100株(4,000株)
JXホールディングス	1,733,400	433.80	751,948,920	
コスモエネルギーホールディングス	44,200	1,193.00	52,730,600	
横浜ゴム	88,300	1,851.00	163,443,300	貸付有価証券 30,600株
東洋ゴム工業	66,300	1,680.00	111,384,000	
ブリヂストン	494,200	4,205.00	2,078,111,000	貸付有価証券 147,000株
住友ゴム工業	137,000	1,739.00	238,243,000	貸付有価証券 49,900株
藤倉ゴム工業	12,200	440.00	5,368,000	貸付有価証券 100株

オカモト	46,000	950.00	43,700,000	貸付有価証券 21,000株
フコク	5,400	891.00	4,811,400	貸付有価証券 2,400株
ニッタ	15,800	2,835.00	44,793,000	
住友理工	31,600	981.00	30,999,600	
三ツ星ベルト	36,000	906.00	32,616,000	
バンドー化学	53,000	509.00	26,977,000	
日東紡績	97,000	363.00	35,211,000	
旭硝子	773,000	616.00	476,168,000	貸付有価証券 73,000株
日本板硝子	706,000	80.00	56,480,000	貸付有価証券 330,000株
石塚硝子	20,000	204.00	4,080,000	
日本山村硝子	58,000	166.00	9,628,000	
日本電気硝子	302,000	576.00	173,952,000	貸付有価証券 9,000株（9,000株）
オハラ	5,500	525.00	2,887,500	貸付有価証券 2,500株（800株）
住友大阪セメント	290,000	442.00	128,180,000	
太平洋セメント	914,000	259.00	236,726,000	
デイ・シイ	13,500	348.00	4,698,000	貸付有価証券 100株
日本ヒューム	14,000	583.00	8,162,000	
日本コンクリート工業	30,100	265.00	7,976,500	貸付有価証券 9,400株
三谷セキサン	7,300	1,543.00	11,263,900	貸付有価証券 3,400株
アジアパイルホールディ ングス	18,000	408.00	7,344,000	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	127,000	267.00	33,909,000	
日本カーボン	72,000	240.00	17,280,000	貸付有価証券 33,000株（7,000株）
東洋炭素	8,100	1,402.00	11,356,200	貸付有価証券 1,700株（200株）
ノリタケカンパニーリミ テド	83,000	254.00	21,082,000	貸付有価証券 20,000株
TOTO	107,600	3,510.00	377,676,000	
日本碍子	185,000	2,079.00	384,615,000	
日本特殊陶業	126,200	2,154.00	271,834,800	

ダントーホールディングス	17,000	195.00	3,315,000	貸付有価証券 8,000株（4,000株）
MARUWA	5,400	2,745.00	14,823,000	貸付有価証券 100株
品川リフラクトリーズ	37,000	201.00	7,437,000	
黒崎播磨	32,000	251.00	8,032,000	
ヨータイ	8,000	290.00	2,320,000	貸付有価証券 1,000株
イソライト工業	7,200	199.00	1,432,800	
東京窯業	17,800	175.00	3,115,000	貸付有価証券 1,800株
ニッカトー	5,100	377.00	1,922,700	
フジミインコーポレーテッド	12,900	1,500.00	19,350,000	貸付有価証券 200株
エーアンドエーマテリアル	30,000	76.00	2,280,000	
ニチアス	75,000	673.00	50,475,000	貸付有価証券 23,000株
ニチハ	19,400	1,703.00	33,038,200	
新日鐵住金	660,100	2,162.00	1,427,136,200	貸付有価証券 22,800株（22,800株）
神戸製鋼所	2,689,000	99.00	266,211,000	貸付有価証券 58,000株
中山製鋼所	164,000	70.00	11,480,000	貸付有価証券 10,000株
合同製鐵	82,000	189.00	15,498,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	400,100	1,516.00	606,551,600	
日新製鋼	66,800	1,313.00	87,708,400	貸付有価証券 2,100株
東京製鐵	80,800	670.00	54,136,000	貸付有価証券 11,500株
共英製鋼	15,600	1,692.00	26,395,200	貸付有価証券 7,200株
大和工業	32,300	2,443.00	78,908,900	
東京鐵鋼	30,000	379.00	11,370,000	
大阪製鐵	9,200	1,842.00	16,946,400	
淀川製鋼所	21,800	2,389.00	52,080,200	
東洋鋼鈹	35,000	338.00	11,830,000	
丸一鋼管	49,000	3,085.00	151,165,000	

モリ工業	23,000	304.00	6,992,000	
大同特殊鋼	245,000	390.00	95,550,000	
日本高周波鋼業	57,000	76.00	4,332,000	貸付有価証券 8,000株
日本冶金工業	107,600	131.00	14,095,600	貸付有価証券 50,300株
山陽特殊製鋼	87,000	514.00	44,718,000	
愛知製鋼	86,000	441.00	37,926,000	
日立金属	167,600	1,161.00	194,583,600	
日本金属	38,000	101.00	3,838,000	貸付有価証券 17,000株
大平洋金属	102,000	329.00	33,558,000	貸付有価証券 47,000株（8,000株）
新日本電工	82,800	180.00	14,904,000	貸付有価証券 16,500株
栗本鐵工所	70,000	154.00	10,780,000	
虹技	20,000	160.00	3,200,000	
日本鑄鉄管	16,000	137.00	2,192,000	
三菱製鋼	102,000	182.00	18,564,000	
日亜鋼業	20,200	243.00	4,908,600	
日本精線	10,000	443.00	4,430,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	13,100	672.00	8,803,200	貸付有価証券 300株
新家工業	29,000	127.00	3,683,000	貸付有価証券 4,000株
大紀アルミニウム工業所	23,000	278.00	6,394,000	
日本軽金属ホールディングス	331,300	185.00	61,290,500	貸付有価証券 68,700株
三井金属鉱業	373,000	180.00	67,140,000	貸付有価証券 11,000株
東邦亜鉛	77,000	285.00	21,945,000	貸付有価証券 34,000株
三菱マテリアル	913,000	318.00	290,334,000	貸付有価証券 113,000株
住友金属鉱山	404,000	1,117.50	451,470,000	
DOWAホールディングス	188,000	627.00	117,876,000	
古河機械金属	228,000	166.00	37,848,000	貸付有価証券 42,000株

大阪チタニウムテクノロジーズ	14,400	1,529.00	22,017,600	貸付有価証券 6,700株
東邦チタニウム	24,800	811.00	20,112,800	貸付有価証券 11,500株
U A C J	205,000	228.00	46,740,000	貸付有価証券 95,000株（1,000株）
古河電気工業	460,000	243.00	111,780,000	
住友電気工業	586,000	1,369.00	802,234,000	
フジクラ	204,000	530.00	108,120,000	
昭和電線ホールディングス	174,000	63.00	10,962,000	貸付有価証券 43,000株
東京特殊電線	2,100	889.00	1,866,900	
タツタ電線	30,500	356.00	10,858,000	
沖電線	17,000	220.00	3,740,000	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
カナレ電気	2,300	1,949.00	4,482,700	貸付有価証券 400株
平河ヒューテック	6,900	908.00	6,265,200	
リョービ	89,000	444.00	39,516,000	
アーレスティ	16,900	732.00	12,370,800	
アサヒホールディングス	22,000	1,516.00	33,352,000	貸付有価証券 200株
稲葉製作所	7,800	1,310.00	10,218,000	貸付有価証券 200株
宮地エンジニアリンググループ	45,000	145.00	6,525,000	貸付有価証券 21,000株
トーカロ	10,300	2,024.00	20,847,200	
アルファC o	4,900	1,096.00	5,370,400	貸付有価証券 800株
S U M C O	114,600	708.00	81,136,800	貸付有価証券 51,200株
川田テクノロジーズ	2,800	3,595.00	10,066,000	貸付有価証券 1,200株
東洋製罐グループホールディングス	104,000	2,108.00	219,232,000	
ホッカンホールディングス	38,000	310.00	11,780,000	
コロナ	7,600	1,100.00	8,360,000	貸付有価証券 3,500株
横河ブリッジホールディングス	27,700	1,210.00	33,517,000	貸付有価証券 12,800株（200株）

駒井ハルテック	26,000	241.00	6,266,000	
高田機工	13,000	201.00	2,613,000	
三和ホールディングス	145,300	837.00	121,616,100	
文化シャッター	40,700	925.00	37,647,500	
三協立山	19,200	1,459.00	28,012,800	貸付有価証券 6,700株
アルインコ	8,200	1,006.00	8,249,200	貸付有価証券 1,200株
東洋シャッター	3,600	563.00	2,026,800	
L I X I Lグループ	203,900	2,295.00	467,950,500	
日本フィルコン	10,600	428.00	4,536,800	貸付有価証券 300株（300株）
ノーリツ	28,700	1,834.00	52,635,800	貸付有価証券 11,600株（3,900株）
長府製作所	15,600	2,608.00	40,684,800	貸付有価証券 2,500株
リンナイ	27,200	9,940.00	270,368,000	貸付有価証券 1,100株
ダイニチ工業	7,400	606.00	4,484,400	
日東精工	21,000	280.00	5,880,000	
三洋工業	18,000	152.00	2,736,000	
岡部	30,400	804.00	24,441,600	貸付有価証券 8,400株
ジーテクト	15,300	1,286.00	19,675,800	
中国工業	2,200	686.00	1,509,200	貸付有価証券 1,000株
東ブレ	28,100	2,097.00	58,925,700	貸付有価証券 12,000株（11,800株）
高周波熱錬	27,200	764.00	20,780,800	貸付有価証券 4,300株
東京製綱	99,000	163.00	16,137,000	貸付有価証券 46,000株
サンコール	7,800	505.00	3,939,000	
モリテック スチール	7,300	252.00	1,839,600	
パイオラックス	7,400	5,590.00	41,366,000	
日本発條	137,700	1,077.00	148,302,900	貸付有価証券 7,700株（7,700株）
中央発條	19,000	282.00	5,358,000	
アドバネクス	2,700	1,258.00	3,396,600	
立川ブラインド工業	6,100	708.00	4,318,800	貸付有価証券

				400株
三益半導体工業	10,800	1,035.00	11,178,000	
日本ドライケミカル	1,900	2,203.00	4,185,700	貸付有価証券 200株
日本製鋼所	242,000	355.00	85,910,000	
三浦工業	65,300	2,101.00	137,195,300	
タクマ	54,000	1,007.00	54,378,000	
ツガミ	42,000	409.00	17,178,000	
オークマ	95,000	787.00	74,765,000	貸付有価証券 35,000株(4,000株)
東芝機械	80,000	346.00	27,680,000	
アマダホールディングス	213,400	1,098.00	234,313,200	
アイダエンジニアリング	38,400	978.00	37,555,200	
滝澤鉄工所	46,000	126.00	5,796,000	
富士機械製造	47,800	1,149.00	54,922,200	貸付有価証券 14,600株(5,400株)
牧野フライス製作所	73,000	689.00	50,297,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
オーエスジー	66,700	2,101.00	140,136,700	貸付有価証券 31,100株(27,600株)
ダイジェット工業	17,000	138.00	2,346,000	
旭ダイヤモンド工業	39,400	1,009.00	39,754,600	貸付有価証券 3,100株
D M G 森精機	80,800	1,035.00	83,628,000	貸付有価証券 36,600株
ソディック	27,800	842.00	23,407,600	貸付有価証券 900株
ディスコ	18,600	9,540.00	177,444,000	
日東工器	8,500	2,229.00	18,946,500	
パンチ工業	5,800	767.00	4,448,600	
豊和工業	8,200	549.00	4,501,800	貸付有価証券 1,200株
O K K	57,000	109.00	6,213,000	
東洋機械金属	10,800	338.00	3,650,400	
津田駒工業	35,000	107.00	3,745,000	貸付有価証券 14,000株
エンシュウ	36,000	75.00	2,700,000	貸付有価証券 3,000株
島精機製作所	20,700	1,876.00	38,833,200	貸付有価証券 9,600株(500株)

フリー	2,100	2,942.00	6,178,200	
日阪製作所	18,500	823.00	15,225,500	貸付有価証券 1,300株
やまびこ	26,800	783.00	20,984,400	
ペガサスマシン製造	15,100	522.00	7,882,200	貸付有価証券 400株（400株）
ナプテスコ	76,100	2,526.00	192,228,600	
三井海洋開発	17,100	1,649.00	28,197,900	貸付有価証券 7,100株（400株）
レオン自動機	12,300	686.00	8,437,800	貸付有価証券 700株
S M C	43,900	26,140.00	1,147,546,000	
新川	13,100	458.00	5,999,800	貸付有価証券 1,900株（200株）
ホソカワミクロン	24,000	569.00	13,656,000	
ユニオンツール	6,300	2,958.00	18,635,400	貸付有価証券 1,700株
オイレス工業	18,900	1,683.00	31,808,700	貸付有価証券 600株
日精エー・エス・ビー機 械	5,300	2,222.00	11,776,600	貸付有価証券 2,400株
サトーホールディングス	19,700	2,396.00	47,201,200	
日本エアテック	5,100	692.00	3,529,200	貸付有価証券 400株
日精樹脂工業	10,600	678.00	7,186,800	貸付有価証券 4,900株
ワイエイシイ	5,900	864.00	5,097,600	貸付有価証券 2,700株
小松製作所	717,400	1,916.00	1,374,538,400	
住友重機械工業	427,000	465.00	198,555,000	貸付有価証券 21,000株
日立建機	65,400	1,788.00	116,935,200	貸付有価証券 20,900株
日工	22,000	343.00	7,546,000	
巴工業	5,900	1,489.00	8,785,100	
井関農機	150,000	221.00	33,150,000	貸付有価証券 70,000株（2,000株）
T O W A	14,100	715.00	10,081,500	貸付有価証券 4,500株
丸山製作所	31,000	178.00	5,518,000	
北川鉄工所	67,000	207.00	13,869,000	

タカキタ	3,600	516.00	1,857,600	貸付有価証券 1,600株
クボタ	702,600	1,536.50	1,079,544,900	貸付有価証券 114,300株
荏原実業	4,400	1,216.00	5,350,400	
三菱化工機	48,000	233.00	11,184,000	貸付有価証券 20,000株
月島機械	27,700	965.00	26,730,500	貸付有価証券 8,800株（8,800株）
帝国電機製作所	10,600	770.00	8,162,000	貸付有価証券 4,900株
東京機械製作所	55,000	42.00	2,310,000	貸付有価証券 21,000株
新東工業	33,200	995.00	33,034,000	
澁谷工業	12,200	1,321.00	16,116,200	貸付有価証券 4,100株（500株）
アイチ コーポレーショ ン	20,700	783.00	16,208,100	
小森コーポレーション	35,600	1,310.00	46,636,000	
鶴見製作所	10,900	1,610.00	17,549,000	
住友精密工業	23,000	340.00	7,820,000	
酒井重工業	28,000	183.00	5,124,000	
荏原製作所	324,000	470.00	152,280,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
石井鐵工所	21,000	153.00	3,213,000	
西島製作所	15,600	1,002.00	15,631,200	貸付有価証券 6,200株（1,300株）
北越工業	15,700	691.00	10,848,700	
ダイキン工業	203,600	8,412.00	1,712,683,200	
オルガノ	25,000	416.00	10,400,000	
トーヨーカネツ	78,000	246.00	19,188,000	
栗田工業	87,900	2,567.00	225,639,300	
椿本チエイン	83,000	697.00	57,851,000	
大同工業	29,000	194.00	5,626,000	
日本コンベヤ	48,000	148.00	7,104,000	
木村化工機	12,500	374.00	4,675,000	
アネスト岩田	23,600	1,078.00	25,440,800	
ダイフク	75,100	1,897.00	142,464,700	
サムコ	2,400	935.00	2,244,000	貸付有価証券

				500株
加藤製作所	33,000	437.00	14,421,000	貸付有価証券 15,000株
油研工業	27,000	187.00	5,049,000	
タダノ	67,000	1,045.00	70,015,000	
フジテック	40,700	1,146.00	46,642,200	貸付有価証券 13,300株(13,200株)
C K D	38,900	929.00	36,138,100	
キトー	17,600	841.00	14,801,600	貸付有価証券 5,000株
平和	43,300	2,333.00	101,018,900	貸付有価証券 9,100株
理想科学工業	15,400	1,736.00	26,734,400	
S A N K Y O	38,900	4,190.00	162,991,000	
日本金銭機械	12,900	908.00	11,713,200	貸付有価証券 5,200株(1,200株)
マースエンジニアリング	7,900	1,951.00	15,412,900	貸付有価証券 700株
福島工業	8,600	2,613.00	22,471,800	
オーイズミ	5,900	485.00	2,861,500	貸付有価証券 2,700株
ダイコク電機	5,800	1,316.00	7,632,800	貸付有価証券 2,600株
竹内製作所	20,700	1,624.00	33,616,800	貸付有価証券 3,200株
アマノ	43,300	1,777.00	76,944,100	貸付有価証券 2,600株
J U K I	20,800	1,022.00	21,257,600	貸付有価証券 9,700株
サンデンホールディングス	85,000	322.00	27,370,000	貸付有価証券 39,000株
蛇の目マシン工業	13,600	613.00	8,336,800	貸付有価証券 5,800株
マックス	21,000	1,156.00	24,276,000	
グローリー	47,700	3,825.00	182,452,500	
新晃工業	9,700	1,635.00	15,859,500	
大和冷機工業	22,500	944.00	21,240,000	
セガサミーホールディングス	150,300	1,227.00	184,418,100	
日本ピストンリング	5,800	1,471.00	8,531,800	

リケン	65,000	368.00	23,920,000	
T P R	17,200	2,954.00	50,808,800	貸付有価証券 700株
ツバキ・ナカシマ	13,000	1,544.00	20,072,000	貸付有価証券 6,000株
ホシザキ電機	30,700	9,390.00	288,273,000	貸付有価証券 1,000株
大豊工業	11,300	1,163.00	13,141,900	
日本精工	287,200	1,030.00	295,816,000	貸付有価証券 5,100株
N T N	347,000	359.00	124,573,000	
ジェイテクト	149,000	1,460.00	217,540,000	貸付有価証券 24,600株
不二越	130,000	392.00	50,960,000	貸付有価証券 60,000株
日本トムソン	48,000	402.00	19,296,000	
T H K	93,000	2,076.00	193,068,000	貸付有価証券 1,400株
ユーシン精機	5,400	2,026.00	10,940,400	
前澤給装工業	5,700	1,404.00	8,002,800	貸付有価証券 2,600株
イーグル工業	17,300	1,483.00	25,655,900	
前澤工業	10,200	301.00	3,070,200	
日本ピラー工業	14,100	979.00	13,803,900	
キッツ	62,300	487.00	30,340,100	貸付有価証券 19,500株(1,100株)
日立工機	37,400	744.00	27,825,600	
マキタ	91,200	6,980.00	636,576,000	
日立造船	110,800	534.00	59,167,200	貸付有価証券 2,600株
三菱重工業	2,490,000	418.10	1,041,069,000	
I H I	1,074,000	238.00	255,612,000	貸付有価証券 127,000株
日清紡ホールディングス	77,600	1,195.00	92,732,000	貸付有価証券 3,600株
イビデン	85,600	1,376.00	117,785,600	貸付有価証券 40,000株(30,700株)
コニカミノルタ	349,200	956.00	333,835,200	貸付有価証券 5,700株
ブラザー工業	180,700	1,294.00	233,825,800	

ミネベア	225,000	878.00	197,550,000	貸付有価証券 25,000株
日立製作所	3,567,000	526.60	1,878,382,200	
東芝	2,944,000	219.00	644,736,000	貸付有価証券 1,377,000株
三菱電機	1,492,000	1,179.50	1,759,814,000	
富士電機	421,000	389.00	163,769,000	
東洋電機製造	27,000	395.00	10,665,000	貸付有価証券 6,000株
安川電機	173,700	1,299.00	225,636,300	貸付有価証券 75,100株
シンフォニアテクノロジー	91,000	153.00	13,923,000	
明電舎	128,000	513.00	65,664,000	
オリジン電気	20,000	279.00	5,580,000	
山洋電気	37,000	525.00	19,425,000	
デンヨー	12,900	1,159.00	14,951,100	貸付有価証券 4,500株
東芝テック	100,000	442.00	44,200,000	貸付有価証券 47,000株
芝浦メカトロニクス	23,000	227.00	5,221,000	貸付有価証券 9,000株
マブチモーター	40,000	5,240.00	209,600,000	
日本電産	168,300	7,701.00	1,296,078,300	貸付有価証券 2,700株
東光高岳	7,800	1,563.00	12,191,400	
ダブル・スコープ	4,200	5,220.00	21,924,000	貸付有価証券 1,900株
ダイヘン	82,000	512.00	41,984,000	貸付有価証券 1,000株
田淵電機	15,800	527.00	8,326,600	貸付有価証券 6,300株
ヤーマン	1,800	2,214.00	3,985,200	貸付有価証券 800株
JVCケンウッド	102,600	291.00	29,856,600	貸付有価証券 47,000株
ミマキエンジニアリング	9,400	667.00	6,269,800	貸付有価証券 4,200株(200株)
第一精工	5,800	1,245.00	7,221,000	貸付有価証券 400株(400株)
日新電機	32,800	1,228.00	40,278,400	

大崎電気工業	26,000	806.00	20,956,000	貸付有価証券 11,000株
オムロン	157,900	3,350.00	528,965,000	
日東工業	22,400	1,794.00	40,185,600	
I D E C	18,300	1,070.00	19,581,000	
不二電機工業	1,300	1,408.00	1,830,400	貸付有価証券 200株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	269,000	481.00	129,389,000	
サクサホールディングス	35,000	214.00	7,490,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
メルコホールディングス	7,700	2,298.00	17,694,600	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
テクノメディカ	3,100	2,141.00	6,637,100	
日本電気	1,922,000	283.00	543,926,000	
富士通	1,348,000	416.60	561,576,800	
沖電気工業	606,000	159.00	96,354,000	貸付有価証券 84,000株
岩崎通信機	66,000	72.00	4,752,000	貸付有価証券 10,000株
電気興業	37,000	525.00	19,425,000	貸付有価証券 3,000株
サンケン電気	76,000	338.00	25,688,000	貸付有価証券 35,000株
ナカヨ	14,000	344.00	4,816,000	貸付有価証券 6,000株
アイホン	7,900	1,886.00	14,899,400	
ルネサスエレクトロニク ス	72,400	724.00	52,417,600	貸付有価証券 10,600株(1,100株)
セイコーエプソン	208,200	1,818.00	378,507,600	
ワコム	110,100	477.00	52,517,700	貸付有価証券 40,800株
アルバック	25,700	3,685.00	94,704,500	
アクセル	6,300	845.00	5,323,500	貸付有価証券 1,600株
E I Z O	13,800	2,832.00	39,081,600	貸付有価証券 1,900株
ジャパンディスプレイ	261,100	220.00	57,442,000	貸付有価証券 122,100株(60,300 株)
日本信号	38,600	931.00	35,936,600	

京三製作所	33,000	352.00	11,616,000	
能美防災	15,800	1,704.00	26,923,200	
ホーチキ	10,100	1,289.00	13,018,900	
エレコム	12,100	1,984.00	24,006,400	
日本無線	41,000	299.00	12,259,000	貸付有価証券 1,000株
パナソニック	1,597,500	1,033.50	1,651,016,250	
シャープ	1,182,000	129.00	152,478,000	貸付有価証券 552,000株（59,000 株）
アンリツ	83,900	619.00	51,934,100	貸付有価証券 4,800株
富士通ゼネラル	43,000	1,737.00	74,691,000	
日立国際電気	32,000	1,353.00	43,296,000	貸付有価証券 2,000株
ソニー	986,500	2,893.00	2,853,944,500	
T D K	84,400	6,250.00	527,500,000	
帝国通信工業	33,000	165.00	5,445,000	
ミツミ電機	53,200	523.00	27,823,600	貸付有価証券 24,200株（9,000株）
タムラ製作所	54,000	299.00	16,146,000	
アルプス電気	118,700	1,962.00	232,889,400	
池上通信機	44,000	143.00	6,292,000	貸付有価証券 20,000株
パイオニア	226,200	298.00	67,407,600	貸付有価証券 105,800株（12,600 株）
日本電波工業	12,600	763.00	9,613,800	
鈴木	4,000	545.00	2,180,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
日本トリム	3,800	5,220.00	19,836,000	貸付有価証券 1,000株（100株）
ローランド ディー ジー	6,900	2,198.00	15,166,200	
フォスター電機	17,500	2,374.00	41,545,000	
クラリオン	74,000	350.00	25,900,000	貸付有価証券 27,000株
S M K	41,000	578.00	23,698,000	貸付有価証券 5,000株
ヨコオ	10,000	517.00	5,170,000	

東光	28,000	364.00	10,192,000	貸付有価証券 1,000株
ティアック	100,000	42.00	4,200,000	貸付有価証券 46,000株
ホシデン	42,400	673.00	28,535,200	貸付有価証券 12,000株
ヒロセ電機	22,600	12,410.00	280,466,000	貸付有価証券 100株(100株)
日本航空電子工業	40,000	1,318.00	52,720,000	
TOA	16,500	1,071.00	17,671,500	貸付有価証券 1,400株
日立マクセル	23,200	1,713.00	39,741,600	貸付有価証券 2,100株
古野電気	16,600	713.00	11,835,800	貸付有価証券 1,000株
ユニデンホールディングス	44,000	127.00	5,588,000	貸付有価証券 20,000株
アルパイン	33,300	1,261.00	41,991,300	貸付有価証券 8,500株
スミダコーポレーション	11,400	737.00	8,401,800	貸付有価証券 3,800株(1,000株)
アイコム	7,700	2,057.00	15,838,900	貸付有価証券 2,200株
リオン	5,300	1,692.00	8,967,600	
船井電機	14,100	987.00	13,916,700	貸付有価証券 6,600株
横河電機	139,900	1,163.00	162,703,700	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
新電元工業	49,000	381.00	18,669,000	
アズビル	45,700	2,881.00	131,661,700	
東亜ディーケーケー	5,800	519.00	3,010,200	
日本光電工業	58,400	2,798.00	163,403,200	貸付有価証券 15,900株(2,300株)
チノー	5,000	1,032.00	5,160,000	
共和電業	17,100	411.00	7,028,100	
日本電子材料	5,500	438.00	2,409,000	
堀場製作所	25,900	4,200.00	108,780,000	貸付有価証券 5,200株
アドバンテスト	95,300	1,041.00	99,207,300	貸付有価証券 44,200株(5,400株)
小野測器	6,800	733.00	4,984,400	貸付有価証券

				200株
エスペック	14,500	1,469.00	21,300,500	貸付有価証券 2,200株
パナソニック デバイス SUNX	12,300	599.00	7,367,700	
キーエンス	31,700	61,390.00	1,946,063,000	貸付有価証券 300株(300株)
日置電機	7,300	2,500.00	18,250,000	
シスメックス	108,500	7,040.00	763,840,000	
日本マイクロニクス	18,200	1,123.00	20,438,600	貸付有価証券 8,500株(5,200株)
メガチップス	14,000	1,265.00	17,710,000	貸付有価証券 6,500株
OBARA GROUP	9,100	4,035.00	36,718,500	
澤藤電機	8,000	178.00	1,424,000	貸付有価証券 3,000株
コーセル	19,400	1,081.00	20,971,400	貸付有価証券 2,800株
新日本無線	10,200	431.00	4,396,200	貸付有価証券 4,100株(3,000株)
オブテックス	10,300	3,595.00	37,028,500	貸付有価証券 3,400株
千代田インテグレ	7,400	2,501.00	18,507,400	
アイ・オー・データ機器	4,300	628.00	2,700,400	
レーザーテック	16,400	1,586.00	26,010,400	貸付有価証券 400株
スタンレー電気	100,300	2,545.00	255,263,500	貸付有価証券 900株
岩崎電気	48,000	182.00	8,736,000	貸付有価証券 3,000株
ウシオ電機	84,900	1,496.00	127,010,400	
岡谷電機産業	7,500	372.00	2,790,000	貸付有価証券 400株(100株)
ヘリオス テクノ ホー ルディング	11,900	394.00	4,688,600	貸付有価証券 5,500株
日本セラミック	8,000	1,954.00	15,632,000	貸付有価証券 3,800株(2,000株)
遠藤照明	7,100	1,024.00	7,270,400	貸付有価証券 1,300株
日本デジタル研究所	11,800	1,610.00	18,998,000	
古河電池	10,000	638.00	6,380,000	貸付有価証券

				4,000株(3,000株)
双信電機	6,800	266.00	1,808,800	
山一電機	12,100	586.00	7,090,600	貸付有価証券 5,600株
図研	10,100	1,186.00	11,978,600	貸付有価証券 300株(300株)
日本電子	55,000	570.00	31,350,000	貸付有価証券 4,000株
カシオ計算機	140,200	2,271.00	318,394,200	貸付有価証券 59,200株
ファナック	143,100	17,485.00	2,502,103,500	貸付有価証券 12,900株
日本シイエムケイ	30,100	444.00	13,364,400	貸付有価証券 13,700株
エンプラス	7,100	4,170.00	29,607,000	貸付有価証券 600株(600株)
大真空	26,000	246.00	6,396,000	貸付有価証券 8,000株
ローム	68,900	4,740.00	326,586,000	
浜松ホトニクス	109,100	3,105.00	338,755,500	
三井ハイテック	20,300	692.00	14,047,600	
新光電気工業	52,800	633.00	33,422,400	貸付有価証券 13,900株
京セラ	229,500	4,957.00	1,137,631,500	
太陽誘電	68,000	1,098.00	74,664,000	貸付有価証券 3,600株
村田製作所	146,700	13,570.00	1,990,719,000	
ユーシン	18,500	723.00	13,375,500	貸付有価証券 7,700株(5,200株)
双葉電子工業	22,900	1,594.00	36,502,600	貸付有価証券 3,200株
北陸電気工業	56,000	133.00	7,448,000	貸付有価証券 8,000株
ニチコン	44,000	784.00	34,496,000	貸付有価証券 5,200株
日本ケミコン	113,000	158.00	17,854,000	貸付有価証券 12,000株
K O A	19,300	833.00	16,076,900	
市光工業	33,000	246.00	8,118,000	貸付有価証券 15,000株
小糸製作所	83,800	5,100.00	427,380,000	

ミツバ	23,700	1,739.00	41,214,300	
スター精密	26,500	1,262.00	33,443,000	貸付有価証券 6,400株
S C R E E Nホールディングス	143,000	890.00	127,270,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
キヤノン電子	12,800	1,656.00	21,196,800	
キヤノン	752,800	3,355.00	2,525,644,000	貸付有価証券 217,400株
リコー	452,800	1,146.00	518,908,800	
M U T O Hホールディングス	17,000	233.00	3,961,000	貸付有価証券 7,000株
東京エレクトロン	114,800	7,336.00	842,172,800	
トヨタ紡織	48,900	1,834.00	89,682,600	
鬼怒川ゴム工業	32,000	767.00	24,544,000	
ユニプレス	29,000	1,961.00	56,869,000	
豊田自動織機	127,300	5,060.00	644,138,000	
モリタホールディングス	24,400	1,316.00	32,110,400	
三櫻工業	17,700	615.00	10,885,500	
デンソー	345,400	4,524.00	1,562,589,600	
東海理化電機製作所	40,900	2,118.00	86,626,200	
三井造船	541,000	168.00	90,888,000	貸付有価証券 19,000株
川崎重工業	1,088,000	325.00	353,600,000	
名村造船所	42,000	843.00	35,406,000	貸付有価証券 14,900株（200株）
サノヤスホールディングス	17,000	222.00	3,774,000	貸付有価証券 2,500株
日本車輛製造	57,000	277.00	15,789,000	貸付有価証券 26,000株（8,000株）
ニチユ三菱フォークリフト	16,100	460.00	7,406,000	
近畿車輛	21,000	328.00	6,888,000	貸付有価証券 9,000株
日産自動車	1,962,600	1,041.50	2,044,047,900	
いすゞ自動車	405,200	1,162.00	470,842,400	
トヨタ自動車	1,739,000	5,952.00	10,350,528,000	
日野自動車	199,600	1,217.00	242,913,200	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
三菱自動車工業	555,200	843.00	468,033,600	

エフテック	7,300	1,066.00	7,781,800	貸付有価証券 3,100株（1,700株）
レシップホールディングス	4,600	770.00	3,542,000	貸付有価証券 2,000株
GMB	2,300	791.00	1,819,300	
ファルテック	2,400	1,350.00	3,240,000	貸付有価証券 1,100株
武蔵精密工業	14,900	2,234.00	33,286,600	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
日産車体	68,300	1,133.00	77,383,900	貸付有価証券 8,100株
新明和工業	61,000	798.00	48,678,000	貸付有価証券 3,000株
極東開発工業	27,800	1,138.00	31,636,400	貸付有価証券 400株（300株）
日信工業	31,300	1,516.00	47,450,800	貸付有価証券 7,300株
トピー工業	115,000	222.00	25,530,000	
ティラド	54,000	181.00	9,774,000	
曙ブレーキ工業	70,800	270.00	19,116,000	貸付有価証券 24,800株
タチエス	22,200	1,642.00	36,452,400	
NOK	67,700	1,922.00	130,119,400	
フタバ産業	42,600	449.00	19,127,400	貸付有価証券 2,800株
KYB	156,000	333.00	51,948,000	
シロキ工業	35,000	320.00	11,200,000	
大同メタル工業	19,500	870.00	16,965,000	貸付有価証券 4,900株
プレス工業	74,200	379.00	28,121,800	貸付有価証券 14,700株
ミクニ	13,300	369.00	4,907,700	
カルソニックカンセイ	107,000	837.00	89,559,000	
太平洋工業	31,100	1,133.00	35,236,300	貸付有価証券 14,500株（12,000株）
ケーヒン	32,100	1,681.00	53,960,100	
河西工業	17,200	1,164.00	20,020,800	
アイシン精機	140,700	4,240.00	596,568,000	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
富士機工	16,200	442.00	7,160,400	

マツダ	442,700	1,746.50	773,175,550	
ダイハツ工業	166,900	1,586.00	264,703,400	貸付有価証券 40,900株（26,900株）
今仙電機製作所	12,800	980.00	12,544,000	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,258,300	3,086.00	3,883,113,800	
スズキ	292,300	3,011.00	880,115,300	
富士重工業	441,800	3,975.00	1,756,155,000	
安永	4,600	494.00	2,272,400	貸付有価証券 2,100株
ヤマハ発動機	197,500	1,872.00	369,720,000	貸付有価証券 11,100株
ショーワ	36,300	982.00	35,646,600	貸付有価証券 4,400株
T B K	16,600	401.00	6,656,600	
エクセディ	19,000	2,488.00	47,272,000	貸付有価証券 3,500株（800株）
豊田合成	50,800	2,172.00	110,337,600	
愛三工業	24,500	886.00	21,707,000	
盟和産業	1,700	1,040.00	1,768,000	
ヨロズ	13,100	2,360.00	30,916,000	
エフ・シー・シー	22,900	1,902.00	43,555,800	
シマノ	56,400	17,640.00	994,896,000	貸付有価証券 200株
タカタ	25,300	438.00	11,081,400	貸付有価証券 11,800株（2,300株）
テイ・エス テック	32,500	2,634.00	85,605,000	
ジャムコ	6,100	2,816.00	17,177,600	貸付有価証券 2,800株
テルモ	214,300	4,035.00	864,700,500	貸付有価証券 400株（400株）
クリエートメディック	4,600	857.00	3,942,200	貸付有価証券 300株
日機装	50,300	827.00	41,598,100	
島津製作所	180,000	1,765.00	317,700,000	
J M S	26,000	295.00	7,670,000	
クボテック	3,000	512.00	1,536,000	貸付有価証券 1,300株（1,000株）
長野計器	8,400	645.00	5,418,000	貸付有価証券 3,100株（2,500株）

ブイ・テクノロジー	3,300	5,150.00	16,995,000	貸付有価証券 1,500株
東京計器	44,000	163.00	7,172,000	
愛知時計電機	18,000	305.00	5,490,000	貸付有価証券 1,000株
オーバル	13,600	241.00	3,277,600	貸付有価証券 6,200株
東京精密	27,000	2,207.00	59,589,000	貸付有価証券 4,300株
マニー	12,800	1,729.00	22,131,200	貸付有価証券 5,900株
ニコン	261,100	1,722.00	449,614,200	貸付有価証券 82,700株（6,600株）
トプコン	46,900	1,484.00	69,599,600	貸付有価証券 21,900株
オリンパス	208,300	4,375.00	911,312,500	貸付有価証券 4,000株
理研計器	11,300	1,024.00	11,571,200	
タムロン	11,300	1,845.00	20,848,500	
H O Y A	316,200	4,281.00	1,353,652,200	
ノーリツ鋼機	12,600	695.00	8,757,000	
エー・アンド・デイ	12,700	393.00	4,991,100	
シチズンホールディングス	172,100	638.00	109,799,800	
リズム時計工業	61,000	151.00	9,211,000	貸付有価証券 4,000株
大研医器	11,100	895.00	9,934,500	貸付有価証券 5,100株（400株）
メニコン	7,000	3,780.00	26,460,000	
松風	6,800	1,379.00	9,377,200	貸付有価証券 3,100株
セイコーホールディングス	90,000	446.00	40,140,000	
ニプロ	104,200	1,069.00	111,389,800	貸付有価証券 36,700株
スノーピーク	1,100	3,615.00	3,976,500	貸付有価証券 500株（400株）
パラマウントベッドホールディングス	14,700	4,115.00	60,490,500	
トランザクション	2,100	652.00	1,369,200	
S H O - B I	4,700	388.00	1,823,600	貸付有価証券

				200株
ニホンフラッシュ	4,100	1,051.00	4,309,100	貸付有価証券 1,900株(100株)
前田工織	15,400	1,144.00	17,617,600	貸付有価証券 4,800株
永大産業	20,000	406.00	8,120,000	
アートネイチャー	11,200	1,014.00	11,356,800	
ダンロップスポーツ	8,800	1,002.00	8,817,600	貸付有価証券 3,900株(100株)
バンダイナムコホールディングス	144,600	2,454.00	354,848,400	貸付有価証券 100株
アイフィスジャパン	2,300	431.00	991,300	
共立印刷	23,200	287.00	6,658,400	
SHOEI	6,700	1,864.00	12,488,800	
フランスベッドホールディングス	19,500	1,037.00	20,221,500	貸付有価証券 5,900株(3,000株)
パイロットコーポレーション	24,400	4,290.00	104,676,000	
萩原工業	2,900	2,411.00	6,991,900	
トッパン・フォームズ	25,000	1,253.00	31,325,000	
フジシールインターナショナル	17,000	3,990.00	67,830,000	貸付有価証券 900株
タカラトミー	46,000	822.00	37,812,000	貸付有価証券 6,000株(4,600株)
廣濟堂	13,000	332.00	4,316,000	貸付有価証券 6,000株
A s - m e エステール	3,700	642.00	2,375,400	貸付有価証券 1,700株
アーク	58,800	87.00	5,115,600	貸付有価証券 22,800株
タカノ	6,100	614.00	3,745,400	
プロネクサス	13,100	1,200.00	15,720,000	
ホクシン	11,100	118.00	1,309,800	貸付有価証券 200株
ウッドワン	26,000	250.00	6,500,000	
大建工業	55,000	314.00	17,270,000	
凸版印刷	395,000	944.00	372,880,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
大日本印刷	414,000	1,000.00	414,000,000	
図書印刷	26,000	548.00	14,248,000	貸付有価証券

				12,000株
共同印刷	47,000	338.00	15,886,000	貸付有価証券 2,000株
日本写真印刷	23,500	1,648.00	38,728,000	貸付有価証券 10,900株
光村印刷	14,000	219.00	3,066,000	
宝印刷	6,700	1,327.00	8,890,900	
アシックス	130,200	2,005.00	261,051,000	貸付有価証券 50,800株
ツツミ	7,000	2,383.00	16,681,000	貸付有価証券 100株
小松ウオール工業	4,700	1,801.00	8,464,700	
ヤマハ	102,800	3,390.00	348,492,000	貸付有価証券 1,100株(500株)
河合楽器製作所	5,200	1,980.00	10,296,000	貸付有価証券 1,400株(300株)
クリナップ	16,400	771.00	12,644,400	
ピジョン	79,200	2,937.00	232,610,400	貸付有価証券 37,000株
兼松日産農林	14,000	143.00	2,002,000	
キングジム	11,600	840.00	9,744,000	貸付有価証券 100株
リンテック	33,200	2,014.00	66,864,800	
T A S A K I	2,600	1,771.00	4,604,600	貸付有価証券 1,200株(100株)
イトーキ	29,400	796.00	23,402,400	貸付有価証券 11,100株(11,100株)
任天堂	86,100	16,000.00	1,377,600,000	
三菱鉛筆	10,500	4,830.00	50,715,000	
タカラスタンダード	58,000	1,023.00	59,334,000	
コクヨ	72,700	1,317.00	95,745,900	
ナカバヤシ	28,000	300.00	8,400,000	
グローブライド	6,800	1,447.00	9,839,600	貸付有価証券 500株
岡村製作所	48,800	1,075.00	52,460,000	
美津濃	75,000	519.00	38,925,000	
アデランス	24,300	673.00	16,353,900	貸付有価証券 11,300株(5,700株)
東京電力	1,186,100	619.00	734,195,900	貸付有価証券 52,000株

中部電力	427,800	1,571.50	672,287,700	
関西電力	570,600	996.70	568,717,020	
中国電力	193,300	1,520.00	293,816,000	貸付有価証券 17,100株（17,100株）
北陸電力	137,000	1,593.00	218,241,000	
東北電力	349,300	1,452.00	507,183,600	
四国電力	125,900	1,509.00	189,983,100	貸付有価証券 28,900株（11,700株）
九州電力	308,800	1,071.00	330,724,800	貸付有価証券 25,400株
北海道電力	130,900	943.00	123,438,700	
沖縄電力	14,800	3,030.00	44,844,000	
電源開発	119,200	3,515.00	418,988,000	
ファーストエスコ	5,700	595.00	3,391,500	
イーレックス	3,100	1,820.00	5,642,000	貸付有価証券 1,400株（100株）
東京瓦斯	1,561,000	524.70	819,056,700	
大阪瓦斯	1,447,000	432.40	625,682,800	貸付有価証券 12,000株（12,000株）
東邦瓦斯	352,000	799.00	281,248,000	貸付有価証券 9,000株
北海道瓦斯	34,000	279.00	9,486,000	貸付有価証券 14,000株
広島ガス	24,400	384.00	9,369,600	貸付有価証券 5,500株（2,700株）
西部瓦斯	157,000	260.00	40,820,000	貸付有価証券 7,000株
静岡ガス	39,700	755.00	29,973,500	
メタウォーター	9,000	2,808.00	25,272,000	貸付有価証券 4,200株
SBSホールディングス	13,800	760.00	10,488,000	貸付有価証券 6,400株
東武鉄道	747,000	561.00	419,067,000	貸付有価証券 88,000株（28,000株）
相鉄ホールディングス	240,000	690.00	165,600,000	貸付有価証券 112,000株
東京急行電鉄	814,000	943.00	767,602,000	
京浜急行電鉄	383,000	990.00	379,170,000	貸付有価証券 63,000株
小田急電鉄	448,000	1,225.00	548,800,000	貸付有価証券

				19,000株
京王電鉄	391,000	988.00	386,308,000	貸付有価証券 7,000株
京成電鉄	210,000	1,583.00	332,430,000	貸付有価証券 11,000株(1,000株)
富士急行	38,000	1,547.00	58,786,000	貸付有価証券 13,000株(4,000株)
新京成電鉄	18,000	435.00	7,830,000	
東日本旅客鉄道	255,600	9,713.00	2,482,642,800	貸付有価証券 14,700株(14,700株)
西日本旅客鉄道	134,600	6,949.00	935,335,400	
東海旅客鉄道	125,200	19,905.00	2,492,106,000	
西武ホールディングス	111,400	2,381.00	265,243,400	貸付有価証券 10,700株
鴻池運輸	19,800	1,317.00	26,076,600	
西日本鉄道	181,000	734.00	132,854,000	貸付有価証券 47,000株
ハマキョウレックス	10,700	1,943.00	20,790,100	貸付有価証券 3,100株
サカイ引越センター	5,500	3,405.00	18,727,500	貸付有価証券 2,500株
近鉄グループホールディングス	1,407,000	456.00	641,592,000	貸付有価証券 183,000株
阪急阪神ホールディングス	938,000	718.00	673,484,000	
南海電気鉄道	314,000	611.00	191,854,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
京阪電気鉄道	313,000	793.00	248,209,000	貸付有価証券 75,000株
神戸電鉄	34,000	357.00	12,138,000	貸付有価証券 15,000株(6,000株)
名古屋鉄道	509,000	526.00	267,734,000	貸付有価証券 238,000株
山陽電気鉄道	51,000	499.00	25,449,000	貸付有価証券 23,000株
日本通運	541,000	512.00	276,992,000	
ヤマトホールディングス	258,400	2,247.00	580,624,800	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
山九	184,000	514.00	94,576,000	
丸運	7,500	249.00	1,867,500	
丸全昭和運輸	47,000	395.00	18,565,000	貸付有価証券

				10,000株(10,000株)
センコー	63,000	686.00	43,218,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
トナミホールディングス	29,000	294.00	8,526,000	
ニッコンホールディングス	45,700	2,040.00	93,228,000	
日本石油輸送	16,000	232.00	3,712,000	
福山通運	85,000	549.00	46,665,000	貸付有価証券 39,000株(29,000株)
セイノーホールディングス	99,200	1,213.00	120,329,600	貸付有価証券 3,500株
神奈川中央交通	16,000	671.00	10,736,000	貸付有価証券 7,000株(5,000株)
日立物流	29,100	1,882.00	54,766,200	貸付有価証券 1,000株
丸和運輸機関	3,100	2,582.00	8,004,200	貸付有価証券 1,400株
C & F ロジホールディングス	13,400	870.00	11,658,000	
日本郵船	1,255,000	217.00	272,335,000	貸付有価証券 8,000株
商船三井	681,000	229.00	155,949,000	貸付有価証券 193,000株
川崎汽船	612,000	218.00	133,416,000	貸付有価証券 286,000株(1,000株)
N S ユナイテッド海運	62,000	152.00	9,424,000	
明治海運	12,500	361.00	4,512,500	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
飯野海運	72,300	447.00	32,318,100	貸付有価証券 5,200株
共栄タンカー	12,000	146.00	1,752,000	貸付有価証券 5,000株
乾汽船	11,000	822.00	9,042,000	貸付有価証券 1,900株
日本航空	267,700	4,122.00	1,103,459,400	
A N A ホールディングス	2,595,000	317.10	822,874,500	貸付有価証券 4,000株
パスコ	13,000	440.00	5,720,000	貸付有価証券 3,000株
トランコム	4,000	6,590.00	26,360,000	貸付有価証券 300株
日新	57,000	308.00	17,556,000	

三菱倉庫	99,000	1,478.00	146,322,000	
三井倉庫ホールディングス	81,000	300.00	24,300,000	貸付有価証券 26,000株（9,000株）
住友倉庫	102,000	573.00	58,446,000	
澁澤倉庫	36,000	289.00	10,404,000	
東陽倉庫	24,000	230.00	5,520,000	
日本トランスシティ	32,000	377.00	12,064,000	
ケイヒン	26,000	141.00	3,666,000	
中央倉庫	8,100	935.00	7,573,500	
安田倉庫	10,900	733.00	7,989,700	
東洋埠頭	40,000	149.00	5,960,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	11,300	333.00	3,762,900	
上組	167,000	1,059.00	176,853,000	
サンリツ	3,400	502.00	1,706,800	
キムラユニティー	3,500	1,106.00	3,871,000	貸付有価証券 1,600株
キューソー流通システム	3,900	2,628.00	10,249,200	
郵船ロジスティクス	12,800	1,309.00	16,755,200	貸付有価証券 6,000株（600株）
近鉄エクスプレス	25,000	1,496.00	37,400,000	貸付有価証券 7,400株（7,400株）
東海運	7,500	273.00	2,047,500	貸付有価証券 3,500株（2,500株）
エーアイティー	6,400	936.00	5,990,400	貸付有価証券 2,900株
内外トランスライン	3,500	1,013.00	3,545,500	
NEC ネットエスアイ	17,300	1,750.00	30,275,000	貸付有価証券 2,500株
システナ	13,500	1,914.00	25,839,000	
デジタルアーツ	6,700	2,448.00	16,401,600	貸付有価証券 2,900株（2,600株）
新日鉄住金ソリューションズ	23,000	2,209.00	50,807,000	
キューブシステム	6,000	659.00	3,954,000	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
コア	5,800	1,390.00	8,062,000	貸付有価証券 2,700株
ソフトクリエイトホールディングス	4,900	809.00	3,964,100	貸付有価証券 2,300株（1,900株）

ITホールディングス	45,700	2,664.00	121,744,800	
ネオス	4,100	579.00	2,373,900	貸付有価証券 1,900株(800株)
電算システム	4,800	1,629.00	7,819,200	貸付有価証券 2,000株
グリー	83,700	618.00	51,726,600	貸付有価証券 21,400株
コーエーテクモホール ディングス	32,700	1,723.00	56,342,100	貸付有価証券 100株(100株)
三菱総合研究所	5,300	3,565.00	18,894,500	
ボルテージ	2,700	1,276.00	3,445,200	貸付有価証券 200株
電算	1,500	2,301.00	3,451,500	貸付有価証券 700株
A G S	2,300	953.00	2,191,900	貸付有価証券 1,000株
ファインデックス	9,100	1,415.00	12,876,500	貸付有価証券 4,000株(2,800株)
ヒト・コミュニケーショ ンズ	3,100	2,201.00	6,823,100	貸付有価証券 1,400株(400株)
ブレインパッド	2,000	726.00	1,452,000	貸付有価証券 900株
K L a b	21,400	639.00	13,674,600	貸付有価証券 9,300株
ポルトゥウィン・ピッ トクルーホールディ	9,100	951.00	8,654,100	貸付有価証券 4,200株
イーブックイニシアティ ブジャパン	3,000	590.00	1,770,000	貸付有価証券 1,300株
ネクソン	132,100	1,919.00	253,499,900	
アイスタイル	21,000	1,001.00	21,021,000	貸付有価証券 9,000株
エムアップ	3,600	622.00	2,239,200	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
エイチーム	5,100	1,857.00	9,470,700	貸付有価証券 2,200株(200株)
テクノスジャパン	1,500	4,200.00	6,300,000	貸付有価証券 700株
e n i s h	4,100	624.00	2,558,400	貸付有価証券 1,800株
コロプラ	38,400	2,403.00	92,275,200	
モバイルクリエイト	9,000	460.00	4,140,000	貸付有価証券 4,200株(300株)

オルトプラス	5,100	397.00	2,024,700	貸付有価証券 1,200株（300株）
ブロードリーフ	14,200	1,359.00	19,297,800	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ハーツユナイテッドグループ	4,100	2,434.00	9,979,400	貸付有価証券 1,900株（1,100株）
メディアドゥ	2,900	1,583.00	4,590,700	
ブイキューブ	6,800	1,294.00	8,799,200	貸付有価証券 3,100株（200株）
サイバーリンクス	1,600	1,102.00	1,763,200	
VOYAGE GROUP	3,100	1,537.00	4,764,700	貸付有価証券 900株
オブティム	900	5,360.00	4,824,000	貸付有価証券 400株（100株）
ベリサーブ	1,600	4,280.00	6,848,000	貸付有価証券 700株（400株）
ティーガイア	13,700	1,303.00	17,851,100	貸付有価証券 3,800株
日本アジアグループ	11,700	538.00	6,294,600	
豆蔵ホールディングス	10,900	728.00	7,935,200	貸付有価証券 3,700株
テクマトリックス	5,900	1,905.00	11,239,500	貸付有価証券 2,700株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	241,100	317.00	76,428,700	貸付有価証券 105,400株（1,400株）
GMOペイメントゲートウェイ	12,000	7,620.00	91,440,000	貸付有価証券 5,500株（4,400株）
ザッパラス	7,700	397.00	3,056,900	貸付有価証券 3,600株（1,000株）
インターネットイニシアティブ	22,300	2,313.00	51,579,900	
さくらインターネット	6,800	1,381.00	9,390,800	貸付有価証券 3,100株（2,100株）
GMOクラウド	3,000	1,002.00	3,006,000	貸付有価証券 1,400株（700株）
SRAホールディングス	7,900	2,591.00	20,468,900	
Minorityソリューションズ	2,000	892.00	1,784,000	
システムインテグレータ	1,900	829.00	1,575,100	貸付有価証券 600株
朝日ネット	12,500	486.00	6,075,000	

コムチュア	2,300	2,366.00	5,441,800	
gumi	14,200	666.00	9,457,200	貸付有価証券 6,600株
パイプドHD	1,800	1,355.00	2,439,000	貸付有価証券 200株
フェイス	3,600	1,325.00	4,770,000	貸付有価証券 1,600株
ハイマックス	1,800	1,193.00	2,147,400	
野村総合研究所	96,700	3,790.00	366,493,000	貸付有価証券 100株（100株）
サイバネットシステム	11,300	942.00	10,644,600	貸付有価証券 5,200株（4,900株）
CEホールディングス	2,100	835.00	1,753,500	
インテージホールディングス	7,200	1,445.00	10,404,000	
東邦システムサイエンス	4,100	622.00	2,550,200	
ソースネクスト	6,900	459.00	3,167,100	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
ティー・ワイ・オー	19,000	178.00	3,382,000	貸付有価証券 8,300株（700株）
クレスコ	3,100	1,812.00	5,617,200	
フジ・メディア・ホールディングス	143,700	1,236.00	177,613,200	貸付有価証券 100株
オービック	47,600	5,950.00	283,220,000	
ジャストシステム	25,100	915.00	22,966,500	貸付有価証券 2,200株
TDCソフトウェアエンジニアリング	6,000	664.00	3,984,000	
ヤフー	989,000	479.00	473,731,000	貸付有価証券 102,900株
トレンドマイクロ	67,000	4,120.00	276,040,000	貸付有価証券 5,900株
インフォメーション・ディベロプメント	2,600	873.00	2,269,800	
日本オラクル	22,100	6,320.00	139,672,000	
アルファシステムズ	4,500	1,731.00	7,789,500	
フューチャーアーキテクト	16,600	877.00	14,558,200	
CAC Holdings	10,300	821.00	8,456,300	
ソフトバンク・テクノロ	3,700	1,499.00	5,546,300	

ジー				
トーセ	3,700	705.00	2,608,500	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコン サルタント	7,000	4,785.00	33,495,000	
伊藤忠テクノソリュー ションズ	31,300	2,124.00	66,481,200	貸付有価証券 6,200株
アイティフォー	17,900	489.00	8,753,100	
東計電算	2,400	1,987.00	4,768,800	
エクスネット	1,300	1,551.00	2,016,300	
大塚商会	37,100	5,940.00	220,374,000	
サイボウズ	18,300	342.00	6,258,600	
ソフトブレーン	20,200	160.00	3,232,000	貸付有価証券 300株
電通国際情報サービス	8,500	2,258.00	19,193,000	
E Mシステムズ	4,600	1,250.00	5,750,000	貸付有価証券 500株(100株)
ウェザーニューズ	4,600	3,780.00	17,388,000	貸付有価証券 100株(100株)
C I J	12,500	461.00	5,762,500	貸付有価証券 1,600株
東洋ビジネスエンジニア リング	1,400	1,355.00	1,897,000	貸付有価証券 100株
日本エンタープライズ	14,100	244.00	3,440,400	貸付有価証券 5,000株(400株)
WOWOW	6,600	2,387.00	15,754,200	貸付有価証券 3,000株(1,200株)
フュージョンパートナー	8,600	495.00	4,257,000	貸付有価証券 3,700株(1,000株)
日本コロムビア	4,700	454.00	2,133,800	貸付有価証券 1,500株
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,600	405.00	4,698,000	貸付有価証券 5,400株
ネットワンシステムズ	59,700	608.00	36,297,600	
アルゴグラフィックス	6,300	1,734.00	10,924,200	
マーベラス	23,300	1,010.00	23,533,000	貸付有価証券 10,900株(800株)
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	25,400	1,467.00	37,261,800	貸付有価証券 200株
日本ユニシス	38,100	1,491.00	56,807,100	貸付有価証券 16,300株(11,400株)

兼松エレクトロニクス	8,700	1,890.00	16,443,000	
東京放送ホールディングス	82,700	1,744.00	144,228,800	貸付有価証券 22,900株
日本テレビホールディングス	126,000	1,857.00	233,982,000	
朝日放送	13,600	683.00	9,288,800	
テレビ朝日ホールディングス	37,700	2,019.00	76,116,300	貸付有価証券 4,600株
スカパーJ S A Tホールディングス	104,700	655.00	68,578,500	貸付有価証券 1,000株
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,053.00	25,662,500	貸付有価証券 5,800株
日本BS放送	2,300	1,078.00	2,479,400	貸付有価証券 700株（700株）
U-NEXT	3,200	1,115.00	3,568,000	貸付有価証券 1,400株
コネクシオ	12,100	1,138.00	13,769,800	貸付有価証券 3,600株（3,500株）
日本通信	73,300	190.00	13,927,000	貸付有価証券 34,300株（17,700株）
クロップス	2,500	514.00	1,285,000	貸付有価証券 1,100株
日本電信電話	1,066,600	4,848.00	5,170,876,800	
KDDI	1,401,900	3,006.00	4,214,111,400	
光通信	16,600	8,570.00	142,262,000	
NTTドコモ	1,064,300	2,552.50	2,716,625,750	
エムティーアイ	17,700	782.00	13,841,400	貸付有価証券 7,900株
GMOインターネット	51,100	1,503.00	76,803,300	貸付有価証券 19,000株（7,200株）
カドカワ	43,100	1,735.00	74,778,500	
学研ホールディングス	46,000	253.00	11,638,000	
ゼンリン	18,200	2,261.00	41,150,200	
昭文社	7,500	614.00	4,605,000	貸付有価証券 800株
インプレスホールディングス	11,400	151.00	1,721,400	貸付有価証券 5,300株（100株）
アイネット	7,700	1,134.00	8,731,800	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
松竹	91,000	1,061.00	96,551,000	貸付有価証券 14,000株

東宝	98,500	2,961.00	291,658,500	貸付有価証券 25,200株
東映	51,000	1,002.00	51,102,000	
AOI Pro.	6,900	945.00	6,520,500	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	85,200	5,650.00	481,380,000	
ピー・シー・エー	1,800	1,414.00	2,545,200	
ビジネスブレイン太田昭 和	2,100	959.00	2,013,900	
D T S	15,300	2,153.00	32,940,900	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	58,400	3,040.00	177,536,000	
シーイーシー	9,000	1,473.00	13,257,000	
カブコン	35,300	2,745.00	96,898,500	
アイ・エス・ピー	1,700	841.00	1,429,700	貸付有価証券 700株
ジャステック	8,700	916.00	7,969,200	貸付有価証券 3,800株
S C S K	32,800	4,400.00	144,320,000	
日本システムウエア	5,200	932.00	4,846,400	貸付有価証券 2,400株
アイネス	19,500	1,157.00	22,561,500	
T K C	12,800	3,055.00	39,104,000	
富士ソフト	20,500	2,455.00	50,327,500	貸付有価証券 800株
N S D	29,300	1,664.00	48,755,200	
コナミホールディングス	62,300	3,330.00	207,459,000	貸付有価証券 6,800株
福井コンピュータホール ディングス	3,000	1,292.00	3,876,000	
J B C Cホールディング ス	11,500	678.00	7,797,000	
ミロク情報サービス	10,200	1,047.00	10,679,400	
ソフトバンクグループ	781,900	5,366.00	4,195,675,400	
ハウスイ	11,000	120.00	1,320,000	貸付有価証券 2,000株
高千穂交易	5,300	909.00	4,817,700	貸付有価証券 2,400株
伊藤忠食品	3,400	4,225.00	14,365,000	貸付有価証券 1,000株（800株）

エレマテック	6,400	2,043.00	13,075,200	
JALUX	4,400	2,169.00	9,543,600	貸付有価証券 1,600株(900株)
あらた	6,200	2,472.00	15,326,400	
トーメンデバイス	2,100	1,761.00	3,698,100	
東京エレクトロン デバ イス	5,000	1,511.00	7,555,000	
フィールズ	9,000	1,879.00	16,911,000	貸付有価証券 1,200株
双日	869,300	231.00	200,808,300	
アルフレッサ ホール ディングス	173,500	2,159.00	374,586,500	
横浜冷凍	34,200	1,066.00	36,457,200	貸付有価証券 13,400株(10,500株)
神栄	19,000	103.00	1,957,000	貸付有価証券 7,000株
山下医科器械	1,100	1,823.00	2,005,300	貸付有価証券 400株
ラサ商事	6,500	576.00	3,744,000	貸付有価証券 3,000株
アルコニックス	7,800	1,572.00	12,261,600	
神戸物産	8,900	2,606.00	23,193,400	貸付有価証券 4,100株(200株)
あい ホールディングス	24,600	3,265.00	80,319,000	貸付有価証券 1,700株
ディー・ビーエックス	3,700	1,084.00	4,010,800	
ダイワボウホールディ ングス	125,000	210.00	26,250,000	
マクニカ・富士エレホ ールディングス	24,800	1,338.00	33,182,400	
バイタルケーエスケー ・ホールディングス	23,900	888.00	21,223,200	貸付有価証券 11,100株(9,300株)
八洲電機	10,600	551.00	5,840,600	
UKCホールディングス	8,900	2,233.00	19,873,700	
OCHIホールディン グス	4,000	1,010.00	4,040,000	貸付有価証券 1,800株
TOKAIホールディ ングス	60,600	586.00	35,511,600	貸付有価証券 28,300株(13,100株)
三洋貿易	7,600	1,482.00	11,263,200	
ウイン・パートナーズ	5,000	1,481.00	7,405,000	貸付有価証券 300株

ミタチ産業	3,500	631.00	2,208,500	
シップヘルスケアホールディングス	28,000	2,835.00	79,380,000	
明治電機工業	4,300	1,118.00	4,807,400	貸付有価証券 1,900株
デリカフーズ	2,900	931.00	2,699,900	貸付有価証券 1,300株
スターティア	2,700	542.00	1,463,400	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
富士興産	5,300	413.00	2,188,900	
協栄産業	18,000	131.00	2,358,000	
小野建	12,000	986.00	11,832,000	
佐鳥電機	10,900	730.00	7,957,000	貸付有価証券 1,100株
エコートレーディング	3,100	582.00	1,804,200	貸付有価証券 100株
伯東	10,500	991.00	10,405,500	
コンドーテック	10,900	834.00	9,090,600	
中山福	8,600	761.00	6,544,600	貸付有価証券 400株
ナガイレーベン	19,900	2,314.00	46,048,600	貸付有価証券 3,400株
三菱食品	15,100	2,862.00	43,216,200	
松田産業	10,000	1,170.00	11,700,000	貸付有価証券 4,700株
第一興商	24,400	4,900.00	119,560,000	
メディカルホールディングス	138,000	1,782.00	245,916,000	
アドヴァン	14,000	1,018.00	14,252,000	貸付有価証券 700株
S P K	3,200	2,014.00	6,444,800	
萩原電気	3,500	1,947.00	6,814,500	
アズワン	10,800	4,260.00	46,008,000	貸付有価証券 700株
スズデン	4,400	1,050.00	4,620,000	貸付有価証券 2,000株
尾家産業	4,400	855.00	3,762,000	
シモジマ	9,500	1,117.00	10,611,500	貸付有価証券 4,400株
ドウシシャ	16,200	2,072.00	33,566,400	

小津産業	3,000	2,275.00	6,825,000	
高速	8,200	872.00	7,150,400	
たけびし	4,800	983.00	4,718,400	貸付有価証券 2,200株
黒田電気	25,700	1,685.00	43,304,500	
丸文	12,200	768.00	9,369,600	
ハビネット	12,500	1,022.00	12,775,000	貸付有価証券 2,800株
橋本総業	2,800	1,558.00	4,362,400	貸付有価証券 1,200株
エクセル	6,700	1,403.00	9,400,100	貸付有価証券 2,300株
マルカキカイ	4,500	1,603.00	7,213,500	貸付有価証券 500株
ガリバーインターナショナル	37,100	1,401.00	51,977,100	貸付有価証券 17,300株(14,000株)
日本エム・ディ・エム	11,500	608.00	6,992,000	貸付有価証券 5,100株
進和	8,100	1,527.00	12,368,700	
エスケイジャパン	3,300	373.00	1,230,900	貸付有価証券 1,500株(1,100株)
ダイトエレクトロン	6,300	727.00	4,580,100	貸付有価証券 100株
シークス	8,800	3,445.00	30,316,000	貸付有価証券 3,400株
田中商事	4,200	642.00	2,696,400	
オーハシテクニカ	7,800	1,188.00	9,266,400	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
白銅	3,900	1,061.00	4,137,900	
伊藤忠商事	1,082,900	1,386.00	1,500,899,400	
丸紅	1,358,100	570.00	774,117,000	貸付有価証券 50,100株(22,100株)
高島	26,000	178.00	4,628,000	
長瀬産業	83,000	1,237.00	102,671,000	
蝶理	8,800	1,457.00	12,821,600	
豊田通商	153,700	2,543.00	390,859,100	
三共生興	20,800	382.00	7,945,600	貸付有価証券 100株
兼松	293,000	164.00	48,052,000	
ツカモトコーポレーショ	25,000	110.00	2,750,000	貸付有価証券

ン				11,000株
三井物産	1,247,900	1,295.00	1,616,030,500	
日本紙パルプ商事	72,000	322.00	23,184,000	
日立ハイテクノロジーズ	47,800	3,170.00	151,526,000	
カメイ	18,000	1,132.00	20,376,000	
東都水産	23,000	175.00	4,025,000	
OUGホールディングス	20,000	231.00	4,620,000	
スターゼン	5,000	3,145.00	15,725,000	貸付有価証券 300株
山善	53,000	855.00	45,315,000	
椿本興業	16,000	299.00	4,784,000	
住友商事	868,700	1,118.50	971,640,950	
内田洋行	34,000	442.00	15,028,000	
三菱商事	1,035,500	1,906.00	1,973,663,000	
第一実業	31,000	493.00	15,283,000	
キャノンマーケティング ジャパン	39,400	1,966.00	77,460,400	
西華産業	45,000	227.00	10,215,000	
佐藤商事	12,300	644.00	7,921,200	貸付有価証券 600株
菱洋エレクトロ	15,900	1,338.00	21,274,200	貸付有価証券 1,700株
東京産業	13,700	414.00	5,671,800	
ユアサ商事	13,100	2,645.00	34,649,500	
神鋼商事	31,000	204.00	6,324,000	
小林産業	9,100	202.00	1,838,200	
阪和興業	138,000	475.00	65,550,000	貸付有価証券 1,000株
カナデン	13,200	887.00	11,708,400	
菱電商事	22,000	660.00	14,520,000	
フルサト工業	7,600	1,685.00	12,806,000	
岩谷産業	164,000	654.00	107,256,000	貸付有価証券 15,000株
すてきナイスグループ	59,000	142.00	8,378,000	
昭光通商	49,000	77.00	3,773,000	貸付有価証券 22,000株
ニチモウ	21,000	176.00	3,696,000	貸付有価証券 9,000株
極東貿易	20,000	226.00	4,520,000	

イワキ	21,000	188.00	3,948,000	
三愛石油	34,000	817.00	27,778,000	
稲畑産業	33,100	1,116.00	36,939,600	
G S I クレオス	36,000	121.00	4,356,000	
明和産業	12,700	364.00	4,622,800	
ワキタ	29,400	940.00	27,636,000	
東邦ホールディングス	44,200	2,408.00	106,433,600	貸付有価証券 20,600株（17,900株）
サンゲツ	48,000	2,041.00	97,968,000	
ミツウロコグループホールディングス	22,200	552.00	12,254,400	
シナネンホールディングス	30,000	440.00	13,200,000	
伊藤忠エネクス	35,500	903.00	32,056,500	
サンリオ	42,500	2,201.00	93,542,500	貸付有価証券 19,800株
サンワテクノス	8,800	711.00	6,256,800	
リョーサン	21,900	2,812.00	61,582,800	貸付有価証券 1,200株
新光商事	16,200	1,085.00	17,577,000	
トーヨー	6,200	2,456.00	15,227,200	
三信電気	19,100	889.00	16,979,900	
東陽テクニカ	19,500	1,155.00	22,522,500	貸付有価証券 1,900株
モスフードサービス	18,100	2,941.00	53,232,100	貸付有価証券 4,700株（100株）
加賀電子	12,500	1,428.00	17,850,000	
ソーダニッカ	14,200	462.00	6,560,400	貸付有価証券 6,600株
立花エレテック	10,200	1,178.00	12,015,600	
フォーバル	5,400	727.00	3,925,800	
P A L T A C	22,100	1,993.00	44,045,300	
三谷産業	14,600	350.00	5,110,000	貸付有価証券 6,900株（100株）
太平洋興発	57,000	77.00	4,389,000	貸付有価証券 20,000株
ヤマタネ	64,000	155.00	9,920,000	
丸紅建材リース	12,000	188.00	2,256,000	貸付有価証券 1,000株

日鉄住金物産	91,000	375.00	34,125,000	貸付有価証券 8,000株
トラスコ中山	15,800	4,470.00	70,626,000	貸付有価証券 1,800株
オートバックスセブン	52,800	1,900.00	100,320,000	貸付有価証券 22,200株
加藤産業	21,500	2,783.00	59,834,500	
イノテック	12,700	441.00	5,600,700	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	13,000	2,263.00	29,419,000	貸付有価証券 800株
J Kホールディングス	13,800	477.00	6,582,600	貸付有価証券 6,400株
日伝	5,700	2,915.00	16,615,500	
北沢産業	11,400	175.00	1,995,000	
杉本商事	7,900	1,237.00	9,772,300	
因幡電機産業	19,300	3,545.00	68,418,500	
バイテックホールディングス	4,200	929.00	3,901,800	貸付有価証券 1,900株
ミスミグループ本社	154,900	1,611.00	249,543,900	貸付有価証券 64,500株
アルテック	11,800	156.00	1,840,800	貸付有価証券 3,800株
タキヒヨー	23,000	460.00	10,580,000	
蔵王産業	2,200	1,321.00	2,906,200	
スズケン	62,800	3,825.00	240,210,000	
ジェコス	9,500	1,025.00	9,737,500	貸付有価証券 700株
ルネサスイーストン	8,600	431.00	3,706,600	
ローソン	52,300	9,420.00	492,666,000	
サンエー	9,400	5,320.00	50,008,000	貸付有価証券 1,200株
ダイユーエイト	3,600	710.00	2,556,000	貸付有価証券 1,400株
カワチ薬品	10,700	2,034.00	21,763,800	貸付有価証券 1,600株
エービーシー・マート	17,900	7,210.00	129,059,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
ハードオフコーポレーション	6,700	1,519.00	10,177,300	
アスクル	16,800	4,580.00	76,944,000	貸付有価証券

				600株
ゲオホールディングス	23,000	1,871.00	43,033,000	貸付有価証券 10,400株(300株)
アダストリア	25,400	3,415.00	86,741,000	
ジーフット	8,300	830.00	6,889,000	貸付有価証券 200株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	20,000	91.00	1,820,000	貸付有価証券 1,000株
くらコーポレーション	8,100	5,440.00	44,064,000	
キャンドウ	7,300	1,546.00	11,285,800	貸付有価証券 2,200株(1,800株)
パル	8,000	2,819.00	22,552,000	貸付有価証券 900株
エディオン	58,400	854.00	49,873,600	貸付有価証券 27,300株(9,800株)
サーラコーポレーション	11,800	623.00	7,351,400	
ワッツ	5,500	862.00	4,741,000	貸付有価証券 1,300株
ハローズ	4,500	2,252.00	10,134,000	
あみやき亭	2,700	4,510.00	12,177,000	貸付有価証券 100株
ひらまつ	19,000	742.00	14,098,000	貸付有価証券 8,800株(600株)
ゲンキー	2,800	3,890.00	10,892,000	貸付有価証券 1,200株(800株)
サッポロドラッグスト アー	1,400	2,202.00	3,082,800	貸付有価証券 400株
大黒天物産	3,300	4,885.00	16,120,500	貸付有価証券 1,500株
ハニーズ	12,100	1,178.00	14,253,800	貸付有価証券 2,200株
ファーマライズホール ディングス	3,100	606.00	1,878,600	
アルペン	12,300	1,856.00	22,828,800	貸付有価証券 3,100株
クオール	14,000	1,691.00	23,674,000	貸付有価証券 5,000株
ジェイアイエヌ	9,400	4,400.00	41,360,000	貸付有価証券 800株
ビックカメラ	71,300	1,022.00	72,868,600	貸付有価証券 10,500株(10,500株)
D C Mホールディングス	67,800	813.00	55,121,400	貸付有価証券

				20,400株(1,800株)
Monotaro	48,700	3,345.00	162,901,500	貸付有価証券 22,700株(4,400株)
東京一番フーズ	2,300	592.00	1,361,600	貸付有価証券 1,000株(800株)
ダイヤモンドダイニング	2,200	1,004.00	2,208,800	貸付有価証券 900株
きちり	3,700	668.00	2,471,600	貸付有価証券 1,600株(1,100株)
アークランドサービス	4,300	3,190.00	13,717,000	貸付有価証券 700株
J.フロントリテイリング	174,600	1,493.00	260,677,800	貸付有価証券 81,400株
ドトール・日レスホールディングス	24,200	1,818.00	43,995,600	貸付有価証券 1,600株
マツモトキヨシホールディングス	28,500	5,890.00	167,865,000	
ブロンコピリー	5,400	2,627.00	14,185,800	貸付有価証券 700株(700株)
スタートトゥデイ	42,000	4,540.00	190,680,000	
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,151.00	4,488,900	貸付有価証券 1,300株
物語コーポレーション	3,600	5,670.00	20,412,000	
ココカラファイン	14,400	4,890.00	70,416,000	
三越伊勢丹ホールディングス	274,400	1,315.00	360,836,000	
ウエルシアホールディングス	11,900	6,480.00	77,112,000	
クリエイティブSDホールディングス	20,300	2,830.00	57,449,000	貸付有価証券 500株
丸善CHIホールディングス	16,100	357.00	5,747,700	貸付有価証券 6,700株
ミサワ	1,600	516.00	825,600	貸付有価証券 200株
エー・ピーカンパニー	2,300	1,143.00	2,628,900	貸付有価証券 1,000株
チムニー	3,400	3,045.00	10,353,000	
シュッピン	3,900	1,301.00	5,073,900	貸付有価証券 1,800株(100株)
ネクステージ	2,200	543.00	1,194,600	貸付有価証券 900株
ジョイフル本田	22,400	2,522.00	56,492,800	

キリン堂ホールディングス	4,400	1,002.00	4,408,800	
ホットランド	3,600	1,121.00	4,035,600	貸付有価証券 1,600株
すかいらーく	42,200	1,486.00	62,709,200	貸付有価証券 14,300株
綿半ホールディングス	3,900	1,357.00	5,292,300	貸付有価証券 1,700株
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	45,700	1,070.00	48,899,000	貸付有価証券 4,500株
ブックオフコーポレー ション	7,800	892.00	6,957,600	貸付有価証券 3,700株
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	2,900	840.00	2,436,000	貸付有価証券 1,200株
あさひ	10,300	1,513.00	15,583,900	
日本調剤	3,500	4,025.00	14,087,500	貸付有価証券 1,600株（400株）
コスモス薬品	6,900	18,710.00	129,099,000	貸付有価証券 3,200株（2,300株）
トーエル	6,600	830.00	5,478,000	貸付有価証券 800株（800株）
一六堂	3,300	344.00	1,135,200	
セブン & アイ・ホール ディングス	577,300	4,792.00	2,766,421,600	貸付有価証券 269,700株
薬王堂	1,900	3,185.00	6,051,500	
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	37,000	1,055.00	39,035,000	貸付有価証券 400株
ツルハホールディングス	31,700	11,070.00	350,919,000	
サンマルクホールディン グス	10,900	3,105.00	33,844,500	
フェリシモ	3,900	1,059.00	4,130,100	
トリドール	16,900	2,272.00	38,396,800	
クスリのアオキ	12,300	6,150.00	75,645,000	
メディカルシステムネッ トワーク	15,600	460.00	7,176,000	
総合メディカル	6,700	3,820.00	25,594,000	貸付有価証券 3,000株
はるやま商事	5,700	736.00	4,195,200	
カップ・クリエイト	19,300	1,230.00	23,739,000	貸付有価証券 9,000株
ライトオン	10,300	1,858.00	19,137,400	貸付有価証券

				4,700株
ジーンズメイト	4,400	210.00	924,000	貸付有価証券 1,500株(1,000株)
良品計画	15,800	23,800.00	376,040,000	貸付有価証券 2,500株(600株)
三城ホールディングス	17,000	462.00	7,854,000	
アルビス	3,600	1,943.00	6,994,800	
コナカ	16,200	551.00	8,926,200	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,427.00	2,425,900	貸付有価証券 700株(100株)
G-7ホールディングス	4,100	1,283.00	5,260,300	
イオン北海道	9,200	532.00	4,894,400	貸付有価証券 600株
コジマ	20,300	242.00	4,912,600	貸付有価証券 900株
ヒマラヤ	4,300	987.00	4,244,100	貸付有価証券 300株
コーナン商事	19,600	1,675.00	32,830,000	貸付有価証券 8,700株
エコス	5,300	1,202.00	6,370,600	貸付有価証券 200株(100株)
ワタミ	16,300	1,000.00	16,300,000	貸付有価証券 7,600株(5,500株)
マルシェ	3,300	824.00	2,719,200	貸付有価証券 1,500株
ドンキホーテホールディングス	89,200	3,910.00	348,772,000	貸付有価証券 2,800株
西松屋チェーン	27,200	1,128.00	30,681,600	貸付有価証券 400株
ゼンショーホールディングス	71,000	1,348.00	95,708,000	貸付有価証券 33,300株(2,700株)
幸楽苑ホールディングス	8,700	1,548.00	13,467,600	貸付有価証券 4,000株(1,800株)
ハークスレイ	3,800	1,090.00	4,142,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
サイゼリヤ	22,700	2,317.00	52,595,900	貸付有価証券 1,700株
V Tホールディングス	46,600	676.00	31,501,600	貸付有価証券 21,800株
魚力	4,300	1,235.00	5,310,500	貸付有価証券 100株
ポプラ	3,400	471.00	1,601,400	

ユナイテッドアローズ	19,700	4,655.00	91,703,500	
ハイデイ日高	12,500	2,832.00	35,400,000	
京都きもの友禅	9,400	861.00	8,093,400	貸付有価証券 4,400株
コロワイド	45,800	1,702.00	77,951,600	貸付有価証券 21,300株（100株）
ピーシーデポコーポレーション	11,400	1,101.00	12,551,400	貸付有価証券 5,300株（200株）
壱番屋	6,200	7,200.00	44,640,000	貸付有価証券 2,100株
トップカルチャー	5,000	479.00	2,395,000	
P L A N T	3,100	1,266.00	3,924,600	
スギホールディングス	24,700	5,940.00	146,718,000	
スクロール	20,900	440.00	9,196,000	貸付有価証券 9,700株（600株）
ヨンドシーホールディングス	10,500	2,780.00	29,190,000	貸付有価証券 3,700株（1,800株）
ファミリーマート	42,400	5,850.00	248,040,000	貸付有価証券 6,100株
木曽路	16,900	2,167.00	36,622,300	貸付有価証券 7,800株（5,500株）
サトレストランシステムズ	16,200	788.00	12,765,600	貸付有価証券 7,500株
千趣会	27,200	720.00	19,584,000	貸付有価証券 2,800株（300株）
タカキュー	10,600	188.00	1,992,800	貸付有価証券 2,000株
ケーヨー	23,200	509.00	11,808,800	貸付有価証券 10,100株（100株）
上新電機	32,000	865.00	27,680,000	
日本瓦斯	15,800	2,541.00	40,147,800	貸付有価証券 3,900株
ベスト電器	44,400	118.00	5,239,200	貸付有価証券 14,200株（14,100株）
ロイヤルホールディングス	22,900	2,273.00	52,051,700	貸付有価証券 1,000株
東天紅	10,000	131.00	1,310,000	貸付有価証券 2,000株
いなげや	15,400	1,415.00	21,791,000	貸付有価証券 7,100株
島忠	35,700	2,687.00	95,925,900	

チヨダ	16,300	3,240.00	52,812,000	貸付有価証券 3,200株
ライフコーポレーション	8,700	2,818.00	24,516,600	貸付有価証券 3,500株(100株)
リンガーハット	12,500	2,455.00	30,687,500	貸付有価証券 100株
さが美	11,000	95.00	1,045,000	貸付有価証券 4,000株(2,000株)
MrMax	12,000	283.00	3,396,000	
テナアライド	12,700	360.00	4,572,000	貸付有価証券 5,900株
AOKIホールディングス	31,500	1,360.00	42,840,000	貸付有価証券 2,000株
オークワ	22,000	1,005.00	22,110,000	
コメリ	21,300	2,300.00	48,990,000	貸付有価証券 4,800株
青山商事	26,500	4,325.00	114,612,500	貸付有価証券 100株
しまむら	16,000	14,050.00	224,800,000	
はせがわ	4,800	454.00	2,179,200	貸付有価証券 900株(900株)
高島屋	201,000	941.00	189,141,000	貸付有価証券 93,000株(4,000株)
松屋	27,800	1,035.00	28,773,000	貸付有価証券 12,600株(300株)
エイチ・ツー・オー テイリング	70,700	1,943.00	137,370,100	
近鉄百貨店	53,000	302.00	16,006,000	貸付有価証券 24,000株
丸栄	28,000	91.00	2,548,000	貸付有価証券 13,000株
ニッセンホールディングス	20,300	130.00	2,639,000	貸付有価証券 9,400株(3,300株)
パルコ	13,200	953.00	12,579,600	貸付有価証券 1,400株
丸井グループ	169,400	1,613.00	273,242,200	貸付有価証券 13,700株
アクシアル リテイリング	10,700	3,705.00	39,643,500	
井筒屋	75,000	55.00	4,125,000	貸付有価証券 9,000株
イオン	567,800	1,626.00	923,242,800	貸付有価証券

				156,300株(5,300株)
ユニグループ・ホールディングス	132,100	793.00	104,755,300	
イズミ	27,400	4,855.00	133,027,000	
東武ストア	17,000	291.00	4,947,000	
平和堂	28,000	2,336.00	65,408,000	
フジ	15,300	2,317.00	35,450,100	
ヤオコー	15,600	4,975.00	77,610,000	
ゼビオホールディングス	18,700	1,796.00	33,585,200	貸付有価証券 2,700株
ケーズホールディングス	29,100	3,730.00	108,543,000	貸付有価証券 400株(300株)
O l y m p i cグループ	8,100	514.00	4,163,400	
日産東京販売ホールディングス	23,100	278.00	6,421,800	
アインホールディングス	16,600	5,770.00	95,782,000	
元気寿司	3,900	2,230.00	8,697,000	
ヤマダ電機	419,600	532.00	223,227,200	貸付有価証券 61,200株(48,300株)
アークランドサカモト	23,400	1,192.00	27,892,800	
ニトリホールディングス	59,600	10,310.00	614,476,000	
グルメ杵屋	10,000	1,002.00	10,020,000	貸付有価証券 4,000株
愛眼	11,000	225.00	2,475,000	貸付有価証券 4,500株(3,500株)
ケーユーホールディングス	7,200	750.00	5,400,000	貸付有価証券 800株
吉野家ホールディングス	50,900	1,377.00	70,089,300	貸付有価証券 23,800株
松屋フーズ	6,600	2,776.00	18,321,600	貸付有価証券 3,100株(200株)
サガミチェーン	18,400	1,235.00	22,724,000	貸付有価証券 8,600株(6,000株)
関西スーパーマーケット	11,200	793.00	8,881,600	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
王将フードサービス	10,100	3,455.00	34,895,500	貸付有価証券 100株
プレナス	15,400	2,030.00	31,262,000	貸付有価証券 6,700株
ミニストップ	10,200	2,049.00	20,899,800	貸付有価証券 4,300株

アークス	25,800	2,521.00	65,041,800	
パローホールディングス	29,700	2,839.00	84,318,300	
藤久	1,100	1,725.00	1,897,500	
ベルク	6,800	4,250.00	28,900,000	
大庄	6,400	1,499.00	9,593,600	貸付有価証券 900株
ファーストリテイリング	27,600	36,020.00	994,152,000	貸付有価証券 12,900株（300株）
サンドラッグ	29,200	8,420.00	245,864,000	
サックスパーホールディングス	13,000	1,559.00	20,267,000	貸付有価証券 6,000株
ヤマザワ	2,900	1,685.00	4,886,500	貸付有価証券 200株
やまや	2,800	1,979.00	5,541,200	
ベルーナ	34,400	571.00	19,642,400	
島根銀行	2,900	1,174.00	3,404,600	貸付有価証券 1,300株
じもとホールディングス	99,000	148.00	14,652,000	
足利ホールディングス	101,300	322.00	32,618,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	19,000	2,615.00	49,685,000	
九州フィナンシャルグループ	211,200	649.00	137,068,800	
ゆうちょ銀行	265,200	1,385.00	367,302,000	貸付有価証券 58,100株
新生銀行	1,194,000	147.00	175,518,000	貸付有価証券 229,000株
あおぞら銀行	873,000	393.00	343,089,000	貸付有価証券 17,000株（17,000株）
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,072,400	521.50	5,774,256,600	
りそなホールディングス	1,614,400	401.60	648,343,040	貸付有価証券 28,700株（28,700株）
三井住友トラスト・ホールディングス	2,881,000	329.60	949,577,600	
三井住友フィナンシャルグループ	1,105,000	3,412.00	3,770,260,000	
第四銀行	175,000	387.00	67,725,000	貸付有価証券 61,000株
北越銀行	149,000	182.00	27,118,000	
西日本シティ銀行	450,000	199.00	89,550,000	

千葉銀行	532,000	561.00	298,452,000	
横浜銀行	921,000	511.00	470,631,000	
常陽銀行	499,000	386.00	192,614,000	貸付有価証券 193,000株（193,000 株）
群馬銀行	307,000	465.00	142,755,000	貸付有価証券 6,000株（6,000株）
武蔵野銀行	22,000	2,835.00	62,370,000	
千葉興業銀行	37,800	509.00	19,240,200	
筑波銀行	57,300	301.00	17,247,300	
七十七銀行	216,000	398.00	85,968,000	貸付有価証券 26,000株
青森銀行	101,000	328.00	33,128,000	貸付有価証券 42,000株（34,000株）
秋田銀行	90,000	307.00	27,630,000	
山形銀行	77,000	427.00	32,879,000	貸付有価証券 36,000株（8,000株）
岩手銀行	9,600	4,080.00	39,168,000	貸付有価証券 4,500株（2,300株）
東邦銀行	123,000	361.00	44,403,000	
東北銀行	70,000	138.00	9,660,000	
みちのく銀行	69,000	174.00	12,006,000	貸付有価証券 31,000株（18,000株）
ふくおかフィナンシャル グループ	597,000	367.00	219,099,000	
静岡銀行	404,000	812.00	328,048,000	貸付有価証券 13,000株
十六銀行	173,000	336.00	58,128,000	
スルガ銀行	131,000	1,978.00	259,118,000	
八十二銀行	250,000	485.00	121,250,000	
山梨中央銀行	85,000	413.00	35,105,000	貸付有価証券 1,000株
大垣共立銀行	184,000	340.00	62,560,000	貸付有価証券 13,000株
福井銀行	118,000	205.00	24,190,000	
北國銀行	154,000	296.00	45,584,000	貸付有価証券 3,000株
清水銀行	4,700	2,355.00	11,068,500	
富山銀行	2,700	3,595.00	9,706,500	貸付有価証券 1,200株

滋賀銀行	130,000	474.00	61,620,000	貸付有価証券 57,000株(5,000株)
南都銀行	133,000	306.00	40,698,000	貸付有価証券 5,000株
百五銀行	124,000	422.00	52,328,000	貸付有価証券 28,000株
京都銀行	263,000	734.00	193,042,000	
紀陽銀行	54,200	1,276.00	69,159,200	
三重銀行	61,000	200.00	12,200,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	939,000	148.00	138,972,000	貸付有価証券 51,000株
広島銀行	407,000	411.00	167,277,000	
山陰合同銀行	83,600	696.00	58,185,600	
中国銀行	97,800	1,172.00	114,621,600	
鳥取銀行	44,000	169.00	7,436,000	
伊予銀行	147,600	737.00	108,781,200	
百十四銀行	151,000	316.00	47,716,000	貸付有価証券 8,000株
四国銀行	107,000	217.00	23,219,000	貸付有価証券 15,000株
阿波銀行	113,000	545.00	61,585,000	
大分銀行	79,000	351.00	27,729,000	貸付有価証券 36,000株
宮崎銀行	92,000	274.00	25,208,000	
佐賀銀行	84,000	212.00	17,808,000	
十八銀行	85,000	250.00	21,250,000	貸付有価証券 17,000株
沖縄銀行	10,900	3,695.00	40,275,500	貸付有価証券 4,600株
琉球銀行	28,400	1,264.00	35,897,600	貸付有価証券 1,900株
セブン銀行	517,100	480.00	248,208,000	貸付有価証券 4,700株
みずほフィナンシャルグ ループ	19,489,300	168.10	3,276,151,330	貸付有価証券 341,200株(341,200 株)
高知銀行	53,000	116.00	6,148,000	
山口フィナンシャルグ ループ	129,000	1,023.00	131,967,000	貸付有価証券 55,000株(24,000株)
長野銀行	45,000	187.00	8,415,000	貸付有価証券

				21,000株(3,000株)
名古屋銀行	116,000	370.00	42,920,000	貸付有価証券 54,000株(4,000株)
北洋銀行	207,900	285.00	59,251,500	
愛知銀行	4,600	4,715.00	21,689,000	
第三銀行	78,000	150.00	11,700,000	貸付有価証券 26,000株(2,000株)
中京銀行	57,000	194.00	11,058,000	
東日本銀行	66,000	270.00	17,820,000	
大光銀行	49,000	210.00	10,290,000	
愛媛銀行	81,000	233.00	18,873,000	貸付有価証券 38,000株(28,000株)
トマト銀行	53,000	146.00	7,738,000	
みなと銀行	125,000	151.00	18,875,000	
京葉銀行	114,000	407.00	46,398,000	
関西アーバン銀行	19,200	1,109.00	21,292,800	
栃木銀行	74,000	428.00	31,672,000	
北日本銀行	4,300	2,860.00	12,298,000	貸付有価証券 300株
東和銀行	194,000	87.00	16,878,000	
福島銀行	170,000	82.00	13,940,000	貸付有価証券 31,000株
大東銀行	83,000	175.00	14,525,000	貸付有価証券 8,000株
トモニホールディングス	105,900	333.00	35,264,700	
フィデアホールディングス	84,400	177.00	14,938,800	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
池田泉州ホールディングス	146,400	405.00	59,292,000	
F P G	40,900	1,357.00	55,501,300	貸付有価証券 19,100株(12,200株)
S B Iホールディングス	165,700	1,143.00	189,395,100	
日本アジア投資	9,300	272.00	2,529,600	貸付有価証券 4,300株(2,100株)
ジャフコ	23,100	3,460.00	79,926,000	
大和証券グループ本社	1,291,000	692.30	893,759,300	
野村ホールディングス	2,655,300	502.90	1,335,350,370	
岡三証券グループ	118,000	588.00	69,384,000	
丸三証券	41,000	1,060.00	43,460,000	貸付有価証券

				4,700株
東洋証券	53,000	281.00	14,893,000	貸付有価証券 22,000株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	158,400	617.00	97,732,800	貸付有価証券 1,200株
光世証券	33,000	139.00	4,587,000	貸付有価証券 6,000株
水戸証券	42,700	312.00	13,322,400	貸付有価証券 3,000株
いちよし証券	30,900	959.00	29,633,100	
松井証券	67,500	959.00	64,732,500	貸付有価証券 4,800株
だいこう証券ビジネス	6,700	873.00	5,849,100	
マネックスグループ	162,400	291.00	47,258,400	貸付有価証券 53,600株(19,200株)
カブドットコム証券	122,300	360.00	44,028,000	
極東証券	18,500	1,353.00	25,030,500	貸付有価証券 8,600株
岩井コスモホールディングス	13,000	1,094.00	14,222,000	貸付有価証券 200株(200株)
藍澤證券	19,400	592.00	11,484,800	貸付有価証券 1,300株
マネースクウェアHD	4,700	1,081.00	5,080,700	
マネーパートナーズグループ	12,800	800.00	10,240,000	貸付有価証券 5,900株
小林洋行	3,900	245.00	955,500	貸付有価証券 1,800株(1,500株)
かんぽ生命保険	42,100	2,601.00	109,502,100	貸付有価証券 4,700株
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	306,500	3,188.00	977,122,000	
アニコムホールディングス	9,300	3,090.00	28,737,000	貸付有価証券 4,300株
MS&ADインシュアランスグループホール	412,400	3,136.00	1,293,286,400	貸付有価証券 3,700株
ソニーフィナンシャルホールディングス	132,200	1,438.00	190,103,600	
第一生命保険	884,200	1,362.50	1,204,722,500	
東京海上ホールディングス	559,100	3,800.00	2,124,580,000	
T&Dホールディングス	503,000	1,049.50	527,898,500	

全国保証	35,900	3,820.00	137,138,000	
クレディセゾン	104,700	1,959.00	205,107,300	貸付有価証券 400株
アクリーティブ	11,300	455.00	5,141,500	貸付有価証券 4,000株(100株)
芙蓉総合リース	15,800	4,805.00	75,919,000	
興銀リース	25,900	1,998.00	51,748,200	貸付有価証券 100株
東京センチュリーリース	32,400	4,175.00	135,270,000	貸付有価証券 1,000株
日本証券金融	60,800	452.00	27,481,600	貸付有価証券 2,900株
アイフル	231,000	398.00	91,938,000	貸付有価証券 107,400株(2,500株)
ポケットカード	13,800	543.00	7,493,400	貸付有価証券 5,400株
リコーリース	10,900	3,345.00	36,460,500	貸付有価証券 4,400株
イオンフィナンシャル サービス	90,500	2,656.00	240,368,000	
アコム	277,200	567.00	157,172,400	貸付有価証券 129,600株(10,400 株)
ジャックス	76,000	467.00	35,492,000	貸付有価証券 1,000株
オリエントコーポレー ション	596,700	224.00	133,660,800	
日立キャピタル	32,500	2,450.00	79,625,000	貸付有価証券 400株
アプラスフィナンシャル	66,200	102.00	6,752,400	貸付有価証券 30,900株
オリックス	977,200	1,605.50	1,568,894,600	
三菱UFJリース	350,000	494.00	172,900,000	
日本取引所グループ	405,200	1,724.00	698,564,800	
イー・ギャランティ	4,500	2,488.00	11,196,000	貸付有価証券 1,400株
アサックス	2,400	1,353.00	3,247,200	
NECキャピタルソ リューション	5,600	1,583.00	8,864,800	
いちごグループホール ディングス	114,500	465.00	53,242,500	貸付有価証券 53,500株(600株)
日本駐車場開発	150,900	125.00	18,862,500	

				貸付有価証券 70,500株
ヒューリック	287,700	1,076.00	309,565,200	貸付有価証券 67,400株(10,000株)
三栄建築設計	5,500	1,206.00	6,633,000	
野村不動産ホールディングス	91,500	2,080.00	190,320,000	
三重交通グループホールディングス	24,500	594.00	14,553,000	貸付有価証券 11,100株(4,200株)
サムティ	7,400	1,148.00	8,495,200	貸付有価証券 3,400株(3,000株)
ディア・ライフ	7,000	407.00	2,849,000	貸付有価証券 700株
エー・ディー・ワークス	94,800	45.00	4,266,000	貸付有価証券 1,100株
日本商業開発	4,600	2,261.00	10,400,600	貸付有価証券 2,100株
プレサンスコーポレーション	4,700	4,310.00	20,257,000	貸付有価証券 2,100株
ユニゾホールディングス	8,600	4,845.00	41,667,000	貸付有価証券 4,000株
日本管理センター	9,000	1,852.00	16,668,000	貸付有価証券 4,200株
サンセイランディック	3,200	1,035.00	3,312,000	貸付有価証券 100株
エストラスト	2,400	557.00	1,336,800	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
フージャースホールディングス	19,200	503.00	9,657,600	貸付有価証券 7,700株
オープンハウス	19,900	2,238.00	44,536,200	貸付有価証券 8,700株
東急不動産ホールディングス	333,900	764.00	255,099,600	
飯田グループホールディングス	127,800	2,195.00	280,521,000	
ムゲンエステート	2,000	2,146.00	4,292,000	
パーク24	69,700	3,150.00	219,555,000	貸付有価証券 15,600株
パラカ	4,800	1,435.00	6,888,000	
三井不動産	732,000	2,808.00	2,055,456,000	
三菱地所	1,026,000	2,090.50	2,144,853,000	貸付有価証券 177,000株

平和不動産	26,100	1,400.00	36,540,000	
東京建物	150,700	1,402.00	211,281,400	貸付有価証券 800株
ダイビル	35,500	950.00	33,725,000	
京阪神ビルディング	22,900	598.00	13,694,200	
住友不動産	331,000	3,294.00	1,090,314,000	
大京	256,000	179.00	45,824,000	貸付有価証券 20,000株
テーオーシー	53,500	952.00	50,932,000	
東京楽天地	23,000	476.00	10,948,000	
レオパレス 2 1	162,600	680.00	110,568,000	
スターツコーポレーショ ン	15,800	2,504.00	39,563,200	
フジ住宅	17,600	684.00	12,038,400	貸付有価証券 7,500株
空港施設	16,700	509.00	8,500,300	
明和地所	7,600	644.00	4,894,400	
住友不動産販売	9,900	2,167.00	21,453,300	
ゴールドクレスト	10,900	1,682.00	18,333,800	貸付有価証券 1,600株
日本エスリード	5,400	1,043.00	5,632,200	貸付有価証券 2,400株
日神不動産	18,300	375.00	6,862,500	
タカラレーベン	60,200	666.00	40,093,200	貸付有価証券 17,500株（4,300株）
サンヨーハウジング名古 屋	7,800	990.00	7,722,000	
イオンモール	89,000	1,667.00	148,363,000	
ファースト住建	5,100	1,341.00	6,839,100	
トーセイ	21,000	815.00	17,115,000	貸付有価証券 8,400株（500株）
穴吹興産	15,000	256.00	3,840,000	
エヌ・ティ・ティ都市開 発	85,700	1,101.00	94,355,700	
サンフロンティア不動産	16,700	1,136.00	18,971,200	貸付有価証券 7,800株（5,800株）
エフ・ジェー・ネクスト	12,000	513.00	6,156,000	貸付有価証券 5,600株
ランドビジネス	9,300	276.00	2,566,800	
グランディハウス	12,000	363.00	4,356,000	

日本空港ビルデング	44,000	4,000.00	176,000,000	貸付有価証券 20,600株（300株）
日本工営	49,000	355.00	17,395,000	貸付有価証券 12,000株
ネクスト	41,300	1,381.00	57,035,300	貸付有価証券 11,800株
ジェイエシーリクルー トメント	6,700	1,334.00	8,937,800	
日本M&Aセンター	22,600	6,550.00	148,030,000	貸付有価証券 1,000株
ノバレーゼ	3,700	856.00	3,167,200	貸付有価証券 1,700株（1,000株）
アコーディア・ゴルフ	40,500	1,057.00	42,808,500	貸付有価証券 500株
中広	1,400	623.00	872,200	
タケエイ	12,800	962.00	12,313,600	貸付有価証券 5,900株
トラスト・テック	5,900	1,500.00	8,850,000	
パソナグループ	12,700	826.00	10,490,200	貸付有価証券 5,900株（4,500株）
C D S	3,300	893.00	2,946,900	貸付有価証券 1,500株
リンクアンドモチベー ション	29,500	142.00	4,189,000	貸付有価証券 12,300株（200株）
G C Aサヴィアン	12,900	1,184.00	15,273,600	貸付有価証券 600株
エス・エム・エス	18,200	2,151.00	39,148,200	貸付有価証券 2,600株
テンプホールディングス	102,400	1,632.00	167,116,800	
リニカル	8,600	2,012.00	17,303,200	貸付有価証券 3,600株
クックパッド	32,500	1,803.00	58,597,500	貸付有価証券 15,200株
エスクリ	6,200	632.00	3,918,400	貸付有価証券 2,800株（1,900株）
アイ・ケイ・ケイ	7,800	680.00	5,304,000	貸付有価証券 1,300株
学情	5,400	1,309.00	7,068,600	貸付有価証券 2,400株（500株）
スタジオアリス	6,700	2,460.00	16,482,000	
シミックホールディング ス	6,600	1,420.00	9,372,000	貸付有価証券 2,800株（1,800株）

N J S	2,900	1,212.00	3,514,800	
総合警備保障	48,700	6,100.00	297,070,000	
カカコム	104,900	2,090.00	219,241,000	貸付有価証券 40,300株（33,700株）
ルネサンス	7,400	1,246.00	9,220,400	貸付有価証券 3,400株
ディップ	16,200	2,650.00	42,930,000	貸付有価証券 7,500株
オプトホールディング	9,100	626.00	5,696,600	貸付有価証券 2,200株
新日本科学	13,800	425.00	5,865,000	貸付有価証券 6,400株
ツクイ	17,300	1,472.00	25,465,600	貸付有価証券 7,200株（1,500株）
キャリアデザインセン ター	4,000	971.00	3,884,000	貸付有価証券 1,100株（1,000株）
エムスリー	126,500	2,832.00	358,248,000	
ツカダ・グローバルホー ルディング	10,600	727.00	7,706,200	貸付有価証券 2,700株
アウトソーシング	6,800	3,880.00	26,384,000	貸付有価証券 1,500株
ウェルネット	5,500	4,010.00	22,055,000	貸付有価証券 2,500株
ディー・エヌ・エー	65,500	1,939.00	127,004,500	
博報堂D Yホールディン グス	202,400	1,275.00	258,060,000	
ぐるなび	16,900	2,673.00	45,173,700	
エスアールジータカミヤ	11,700	442.00	5,171,400	貸付有価証券 5,400株
ジャパンベストレス キューシステム	16,600	233.00	3,867,800	貸付有価証券 7,700株（1,100株）
ファンコミュニケーション ズ	33,700	845.00	28,476,500	貸付有価証券 15,700株（6,300株）
ジェイコムホールディン グス	3,000	2,706.00	8,118,000	貸付有価証券 1,400株
WDBホールディングス	5,200	1,009.00	5,246,800	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
ティア	6,100	644.00	3,928,400	貸付有価証券 2,800株（500株）
バリューコマース	13,500	390.00	5,265,000	
インフォマート	21,100	1,012.00	21,353,200	貸付有価証券

				9,800株(200株)
J Pホールディングス	36,200	410.00	14,842,000	貸付有価証券 16,900株(1,300株)
E P Sホールディングス	16,300	1,376.00	22,428,800	
レグス	2,100	636.00	1,335,600	
プレステージ・インター ナショナル	12,300	1,270.00	15,621,000	貸付有価証券 1,500株
アミューズ	8,100	2,324.00	18,824,400	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ドリームインキュベータ	4,900	2,401.00	11,764,900	貸付有価証券 2,200株
クイック	7,500	882.00	6,615,000	
T A C	8,000	202.00	1,616,000	貸付有価証券 3,700株
ケネディクス	196,100	492.00	96,481,200	
電通	162,800	5,650.00	919,820,000	貸付有価証券 42,100株(600株)
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	6,800	459.00	3,121,200	
ぴあ	4,400	2,045.00	8,998,000	貸付有価証券 2,000株
イオンファンタジー	5,100	2,255.00	11,500,500	貸付有価証券 2,100株
シーティーエス	3,300	785.00	2,590,500	
ネクシィーズ	5,200	975.00	5,070,000	貸付有価証券 2,400株(1,900株)
みらかホールディングス	37,300	4,625.00	172,512,500	
アルプス技研	5,400	2,365.00	12,771,000	貸付有価証券 2,200株
ダイオーズ	2,600	1,048.00	2,724,800	
日本空調サービス	12,800	608.00	7,782,400	貸付有価証券 200株
オリエンタルランド	157,900	7,970.00	1,258,463,000	貸付有価証券 4,000株(2,500株)
ダスキン	41,300	2,022.00	83,508,600	
明光ネットワークジャ パン	16,900	1,227.00	20,736,300	貸付有価証券 4,700株(4,300株)
ファルコホールディン グス	6,400	1,363.00	8,723,200	
秀英予備校	2,600	428.00	1,112,800	貸付有価証券 1,200株

田谷	2,400	686.00	1,646,400	貸付有価証券 1,100株
ラウンドワン	45,600	635.00	28,956,000	貸付有価証券 21,300株(20,300株)
リゾートトラスト	61,200	2,529.00	154,774,800	貸付有価証券 28,600株
ビー・エム・エル	8,600	4,360.00	37,496,000	
ワタベウェディング	4,300	442.00	1,900,600	
りらいあコミュニケー ションズ	24,100	1,041.00	25,088,100	
リソー教育	27,100	344.00	9,322,400	貸付有価証券 12,100株(1,600株)
早稲田アカデミー	1,900	897.00	1,704,300	貸付有価証券 800株
ユー・エス・エス	176,800	1,798.00	317,886,400	
東京個別指導学院	7,100	678.00	4,813,800	貸付有価証券 2,800株
サイバーエージェント	35,700	5,230.00	186,711,000	貸付有価証券 16,200株(14,400株)
楽天	683,300	1,085.50	741,722,150	
テー・オー・ダブリュー	8,800	701.00	6,168,800	貸付有価証券 3,600株
セントラルスポーツ	5,000	2,296.00	11,480,000	貸付有価証券 2,300株(100株)
フルキャストホールディ ングス	13,400	791.00	10,599,400	貸付有価証券 5,900株
リゾートソリューション	14,000	310.00	4,340,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
テクノプロ・ホールディ ングス	23,700	3,340.00	79,158,000	貸付有価証券 100株(100株)
インターワークス	1,900	782.00	1,485,800	
ファーストロジック	500	3,160.00	1,580,000	
リブセンス	9,800	509.00	4,988,200	貸付有価証券 4,500株(2,400株)
ジャパンマテリアル	6,100	3,005.00	18,330,500	貸付有価証券 2,800株
ベクトル	4,500	2,833.00	12,748,500	貸付有価証券 1,700株(1,500株)
ウチヤマホールディン グス	7,500	512.00	3,840,000	貸付有価証券 3,500株
サクセスホールディン グ	1,400	1,468.00	2,055,200	

ス				
キャリアリンク	1,900	1,606.00	3,051,400	貸付有価証券 600株
I B J	8,500	466.00	3,961,000	貸付有価証券 1,500株
アサンテ	5,400	1,581.00	8,537,400	
N・フィールド	5,200	1,699.00	8,834,800	貸付有価証券 2,300株
M&Aキャピタルパートナーズ	1,200	1,861.00	2,233,200	貸付有価証券 500株
ライドオン・エクスプレス	2,400	1,845.00	4,428,000	貸付有価証券 1,000株(700株)
E R Iホールディングス	3,700	847.00	3,133,900	貸付有価証券 1,400株(500株)
アビスト	1,600	2,264.00	3,622,400	貸付有価証券 700株(700株)
ウィルグループ	3,300	1,015.00	3,349,500	
日本ビューホテル	1,600	1,816.00	2,905,600	貸付有価証券 500株
リクルートホールディングス	294,500	3,435.00	1,011,607,500	
エラン	1,200	947.00	1,136,400	貸付有価証券 500株
日本郵政	322,100	1,502.00	483,794,200	
ベルシステム24ホールディングス	21,400	1,246.00	26,664,400	貸付有価証券 10,000株(500株)
リロ・ホールディング	5,500	15,090.00	82,995,000	貸付有価証券 400株
東祥	4,400	4,465.00	19,646,000	
エイチ・アイ・エス	23,800	3,145.00	74,851,000	貸付有価証券 9,700株
ラックランド	2,000	1,694.00	3,388,000	貸付有価証券 800株
共立メンテナンス	11,000	9,710.00	106,810,000	貸付有価証券 4,600株
イチネンホールディングス	15,300	1,000.00	15,300,000	貸付有価証券 100株
建設技術研究所	8,600	964.00	8,290,400	
スペース	7,900	1,360.00	10,744,000	
燦ホールディングス	2,900	1,388.00	4,025,200	
スバル興業	10,000	389.00	3,890,000	

東京テアトル	56,000	121.00	6,776,000	貸付有価証券 25,000株
ナガワ	2,700	2,652.00	7,160,400	貸付有価証券 700株
よみうりランド	29,000	577.00	16,733,000	貸付有価証券 13,000株
東京都競馬	100,000	226.00	22,600,000	貸付有価証券 45,000株（25,000株）
常磐興産	54,000	152.00	8,208,000	貸付有価証券 23,000株（1,000株）
カナモト	20,400	2,649.00	54,039,600	貸付有価証券 8,500株
東京ドーム	117,000	510.00	59,670,000	
西尾レントオール	11,800	2,666.00	31,458,800	
トランス・コスモス	16,900	2,924.00	49,415,600	貸付有価証券 4,400株
乃村工藝社	31,200	1,633.00	50,949,600	貸付有価証券 9,500株
藤田観光	53,000	582.00	30,846,000	貸付有価証券 24,000株
日本管財	12,500	1,780.00	22,250,000	
トーカイ	6,500	3,295.00	21,417,500	
白洋舎	15,000	260.00	3,900,000	
セコム	151,900	8,366.00	1,270,795,400	
セントラル警備保障	6,400	2,695.00	17,248,000	
丹青社	27,300	854.00	23,314,200	貸付有価証券 12,700株（9,400株）
メイテック	18,200	3,935.00	71,617,000	貸付有価証券 1,900株
アサツー ディ・ケイ	25,600	2,898.00	74,188,800	
応用地質	13,800	1,220.00	16,836,000	
船井総研ホールディングス	20,300	1,810.00	36,743,000	
進学会	7,000	587.00	4,109,000	
オオバ	7,900	453.00	3,578,700	
学究社	2,100	1,204.00	2,528,400	貸付有価証券 900株（300株）
ベネッセホールディングス	48,900	3,240.00	158,436,000	
イオンディライト	14,100	3,615.00	50,971,500	

	ナック	8,900	872.00	7,760,800	貸付有価証券 3,600株
	ニチイ学館	25,400	779.00	19,786,600	貸付有価証券 11,800株（9,100株）
	ダイセキ	27,400	1,842.00	50,470,800	
	ステップ	4,900	993.00	4,865,700	
小計	銘柄数：1,929 組入時価比率：98.1%			278,413,493,530 100.0%	
合計				278,413,493,530	

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成28年 3月31日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28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				
株価指数先物取引				
買建	4,735,882,020	-	4,716,250,000	19,802,120
合計	4,735,882,020	-	4,716,250,000	19,802,120

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 3月31日現在)

資産の部

流動資産

(平成28年 3月31日現在)

預金	5,376,214,088
コール・ローン	926,850,700
株式	309,377,723,661
投資信託受益証券	29,537,371
投資証券	8,767,212,705
派生商品評価勘定	122,524,775
未収入金	29,106,169
未収配当金	661,634,499
未収利息	11
差入委託証拠金	1,419,254,884
流動資産合計	326,710,058,863
資産合計	326,710,058,863
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,614,926
未払金	38,729,970
未払解約金	206,616,677
その他未払費用	3,663,400
流動負債合計	278,624,973
負債合計	278,624,973
純資産の部	
元本等	
元本	162,042,393,593
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	164,389,040,297
元本等合計	326,431,433,890
純資産合計	326,431,433,890
負債純資産合計	326,710,058,863

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>

3.費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 (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。</p> <p>(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。</p> <p>配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成28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	2.0145円
(10,000口当たり純資産額)	(20,145円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年 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28年 3月31日現在	
期首	平成27年 4月 1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	148,838,024,019円
同期中における追加設定元本額	39,073,211,752円
同期中における一部解約元本額	25,868,842,178円
期末元本額	162,042,393,593円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	63,877,730円
バランスセレクト50	200,197,052円
バランスセレクト70	187,017,799円
野村外国株式インデックスファンド	562,906,891円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,928,730,816円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	10,449,606,955円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	5,914,346,598円
野村資産設計ファンド2015	40,155,177円

野村資産設計ファンド2020	41,685,304円
野村資産設計ファンド2025	51,755,031円
野村資産設計ファンド2030	49,725,801円
野村資産設計ファンド2035	35,843,577円
野村資産設計ファンド2040	120,288,621円
野村外国株インデックス(野村投資一任口座向け)	16,151,154,036円
のむらップ・ファンド(保守型)	909,698,149円
のむらップ・ファンド(普通型)	5,321,030,200円
のむらップ・ファンド(積極型)	4,348,637,358円
野村資産設計ファンド2045	11,243,323円
野村インデックスファンド・外国株式	2,399,367,796円
マイ・ロード	1,605,618,429円
ネクストコア	91,424,896円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	90,125,466円
野村外国株インデックス(野村SMA・EW向け)	419,986,531円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	255,449,841円
野村資産設計ファンド2050	5,982,732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)	621,174,109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)	458,454,869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)	9,968,654,390円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,059,647,559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)	9,484,300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)	38,333,062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)	28,085,850円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	131,905,208円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	1,438,567,280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)	571,710,177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)	238,971,736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)	34,287,441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)	267,715,278円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	4,738,552,915円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	638,670,106円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	896,315,750円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	183,618,555円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	638,140,049円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,543,295円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	16,718,860円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	14,009,564円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	55,942,217,572円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,377,593,501円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,418,609,211円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,967,166,917円
マイバランスDC30	741,726,442円
マイバランスDC50	1,288,036,184円
マイバランスDC70	969,913,008円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	12,907,515,229円

野村DC運用戦略ファンド	143,110,969円
野村DC運用戦略ファンドM	540,384円
野村DC運用戦略ファンドA	1,522,425円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	31,262,400円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	261,652円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	501,237円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 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	42,400	43.37	1,838,888.00	
		CAMERON INTERNATIONAL CORP	18,200	67.68	1,231,776.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	4,300	114.33	491,619.00	
		FMC TECHNOLOGIES INC	22,500	27.09	609,525.00	
		HALLIBURTON CO	83,200	36.02	2,996,864.00	
		HELMERICH & PAYNE	10,600	58.31	618,086.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,600	31.10	1,138,260.00	
		OCEANEERING INTL INC	9,500	32.72	310,840.00	
		SCHLUMBERGER LTD	122,000	74.41	9,078,020.00	
		WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	85,000	7.67	651,950.00	
		ANADARKO PETE	49,500	46.39	2,296,305.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	7,400	24.89	184,186.00	
		APACHE CORPORATION	36,900	48.64	1,794,816.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	43,600	22.71	990,156.00	
		CHENIERE ENERGY INC	22,000	33.71	741,620.00	
		CHEVRON CORP	181,900	95.25	17,325,975.00	
		CIMAREX ENERGY CO	9,000	96.56	869,040.00	
		COLUMBIA PIPELINE GROUP	37,000	25.13	929,810.00	
		CONCHO RESOURCES INC	12,300	101.95	1,253,985.00	
		CONOCOPHILLIPS	119,400	40.08	4,785,552.00	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,000	29.75	238,000.00			
DEVON ENERGY CORP	43,400	26.20	1,137,080.00			

EOG RESOURCES INC	53,200	73.66	3,918,712.00
EQT CORP	15,000	66.33	994,950.00
EXXON MOBIL CORP	402,000	84.52	33,977,040.00
HESS CORP	27,500	50.97	1,401,675.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	34.39	570,874.00
KINDER MORGAN INC	183,600	17.86	3,279,096.00
MARATHON OIL CORP	79,400	10.53	836,082.00
MARATHON PETROLEUM CORP	50,800	36.58	1,858,264.00
MURPHY OIL CORP	15,000	24.42	366,300.00
NOBLE ENERGY INC	41,100	30.78	1,265,058.00
OCCIDENTAL PETE CORP	73,800	68.60	5,062,680.00
ONEOK INC	19,800	29.04	574,992.00
PHILLIPS 66	51,700	87.62	4,529,954.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,600	140.41	2,190,396.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	8.24	156,560.00
RANGE RESOURCES CORP	16,700	32.36	540,412.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	40,000	7.70	308,000.00
SPECTRA ENERGY CORP	65,300	30.55	1,994,915.00
TESORO CORP	11,300	86.47	977,111.00
VALERO ENERGY CORP	46,200	63.98	2,955,876.00
WILLIAMS COS	69,500	15.66	1,088,370.00
AIR PRODUCTS	19,840	145.25	2,881,760.00
AIRGAS INC	6,320	141.85	896,492.00
ALBEMARLE CORP	11,100	63.99	710,289.00
ASHLAND INC	5,900	110.66	652,894.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,500	28.91	419,195.00
CELANESE CORP-SERIES A	14,300	66.03	944,229.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,900	31.98	732,342.00
DOW CHEM CO	108,000	51.48	5,559,840.00
DU PONT E I DE NEMOURS	84,600	64.17	5,428,782.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	14,200	73.27	1,040,434.00
ECOLAB INC	25,600	112.42	2,877,952.00
FMC CORP	13,200	41.28	544,896.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	7,700	114.58	882,266.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	36,600	85.90	3,143,940.00

MONSANTO CO	42,700	91.09	3,889,543.00
MOSAIC CO/THE	31,300	28.12	880,156.00
PPG INDUSTRIES	25,800	111.90	2,887,020.00
PRAXAIR INC	27,600	115.00	3,174,000.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,690	284.43	2,187,266.70
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,100	46.92	192,372.00
WR GRACE & CO	6,700	71.58	479,586.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,500	154.83	851,565.00
VULCAN MATERIALS CO	12,800	105.49	1,350,272.00
AVERY DENNISON CORP	9,100	72.40	658,840.00
BALL CORP	12,400	70.90	879,160.00
CROWN HOLDINGS INC	13,300	49.60	659,680.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	37,600	41.00	1,541,600.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	8,900	59.44	529,016.00
SEALED AIR CORP	19,200	48.03	922,176.00
WESTROCK CO	24,300	38.25	929,475.00
ALCOA INC	125,000	9.68	1,210,000.00
FREEMONT-MCMORAN INC	110,000	10.29	1,131,900.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	51,700	26.75	1,382,975.00
NUCOR CORP	30,700	48.31	1,483,117.00
B/E AEROSPACE INC	10,100	46.57	470,357.00
BOEING CO	61,400	128.58	7,894,812.00
GENERAL DYNAMICS	25,730	131.73	3,389,412.90
HONEYWELL INTERNATIONAL	70,600	112.17	7,919,202.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	7,700	120.01	924,077.00
LOCKHEED MARTIN	26,790	222.96	5,973,098.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,600	198.73	3,298,918.00
RAYTHEON COMPANY	29,100	123.76	3,601,416.00
ROCKWELL COLLINS INC	12,800	92.51	1,184,128.00
TEXTRON INC	26,400	36.32	958,848.00
TRANSDIGM GROUP INC	5,230	221.20	1,156,876.00
UNITED TECHNOLOGIES	81,500	100.25	8,170,375.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	15,800	55.80	881,640.00
MASCO CORP	32,900	31.60	1,039,640.00
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	8,400	37.20	312,480.00

FLUOR CORP	13,900	54.36	755,604.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,300	43.77	538,371.00	
QUANTA SERVICES INC	16,300	22.62	368,706.00	
ACUITY BRANDS INC	4,170	216.35	902,179.50	
AMETEK INC	23,300	50.32	1,172,456.00	
EATON CORP PLC	44,500	62.75	2,792,375.00	
EMERSON ELEC	63,400	54.56	3,459,104.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,900	114.35	1,475,115.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16,900	38.91	657,579.00	
3M CORP	59,350	166.75	9,896,612.50	
DANAHER CORP	59,500	95.03	5,654,285.00	
GENERAL ELEC CO	911,500	31.83	29,013,045.00	
JARDINE MATHESON	23,400	56.22	1,315,548.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,600	182.01	1,747,296.00	
AGCO CORP	6,300	51.39	323,757.00	
CATERPILLAR INC DEL	56,300	76.51	4,307,513.00	
CUMMINS INC	16,100	109.31	1,759,891.00	
DEERE & COMPANY	30,300	80.12	2,427,636.00	
DOVER CORP	15,300	64.33	984,249.00	
FLOWSERVE CORP	12,300	44.04	541,692.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	31,700	102.63	3,253,371.00	
INGERSOLL-RAND PLC	25,100	62.07	1,557,957.00	
PACCAR	34,500	54.57	1,882,665.00	
PARKER HANNIFIN CORP	13,200	110.99	1,465,068.00	
PENTAIR PLC	17,400	54.07	940,818.00	
SNAP-ON INC	5,460	158.54	865,628.40	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,500	105.17	1,524,965.00	
WABCO HOLDINGS INC	5,200	106.24	552,448.00	
WABTEC CORP	9,400	79.21	744,574.00	
XYLEM INC	17,000	41.04	697,680.00	
AERCAP HOLDINGS NV	8,700	39.11	340,257.00	
FASTENAL CO	26,200	48.93	1,281,966.00	
GRAINGER(W.W.) INC	5,480	233.50	1,279,580.00	
UNITED RENTALS INC	8,600	62.79	539,994.00	
ADT CORP/THE	15,800	41.30	652,540.00	

CINTAS CORP	9,100	89.73	816,543.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	22,900	48.35	1,107,215.00
STERICYCLE INC	8,100	125.68	1,018,008.00
TYCO INTERNATIONAL PLC	40,300	36.62	1,475,786.00
WASTE CONNECTIONS INC	11,700	64.56	755,352.00
WASTE MANAGEMENT INC	42,800	59.63	2,552,164.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,700	74.55	1,021,335.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	18,300	48.71	891,393.00
FEDEX CORPORATION	25,950	161.57	4,192,741.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	67,400	105.73	7,126,202.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	15,400	41.38	637,252.00
DELTA AIR LINES INC	19,100	49.33	942,203.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	44.98	688,194.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,300	59.82	556,326.00
AMERCO	680	345.05	234,634.00
CSX CORP	93,200	26.30	2,451,160.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	34,600	10.24	354,304.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,700	84.14	732,018.00
KANSAS CITY SOUTHERN	10,800	85.80	926,640.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,700	84.75	2,432,325.00
UNION PAC CORP	82,400	80.56	6,638,144.00
AUTOLIV INC	8,500	118.58	1,007,930.00
BORGWARNER INC	21,300	37.92	807,696.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	27,300	74.91	2,045,043.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	25,200	32.77	825,804.00
JOHNSON CONTROLS INC	61,900	38.88	2,406,672.00
LEAR CORP	7,400	111.65	826,210.00
FORD MOTOR COMPANY	358,000	13.35	4,779,300.00
GENERAL MOTORS CO	136,700	30.99	4,236,333.00
HARLEY-DAVIDSON INC	18,800	49.48	930,224.00
TESLA MOTORS INC	9,350	226.89	2,121,421.50
DR HORTON INC	31,700	30.17	956,389.00
GARMIN LTD	11,400	39.86	454,404.00
HARMAN INTERNATIONAL	7,000	87.01	609,070.00
JARDEN CORP	20,000	58.86	1,177,200.00

LEGGETT & PLATT INC	13,400	47.95	642,530.00
LENNAR CORP-A	16,800	47.81	803,208.00
MOHAWK INDUSTRIES	6,020	191.12	1,150,542.40
NEWELL RUBBERMAID INC	25,500	44.37	1,131,435.00
PULTEGROUP INC	29,500	18.41	543,095.00
TOLL BROTHERS INC	16,400	29.04	476,256.00
WHIRLPOOL CORP	7,660	177.35	1,358,501.00
HASBRO INC	10,800	78.55	848,340.00
MATTEL INC	33,400	33.59	1,121,906.00
POLARIS INDUSTRIES INC	6,200	97.25	602,950.00
COACH INC	26,500	40.32	1,068,480.00
HANESBRANDS INC	37,700	28.48	1,073,696.00
LULULEMON ATHLETICA INC	10,600	67.80	718,680.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	17,900	56.87	1,017,973.00
NIKE INC-B	131,200	62.04	8,139,648.00
PVH CORP	8,200	98.92	811,144.00
RALPH LAUREN CORPORATION	5,800	96.92	562,136.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	17,100	85.64	1,464,444.00
V F CORP	33,100	65.24	2,159,444.00
ARAMARK	21,600	32.98	712,368.00
CARNIVAL CORP	40,300	52.37	2,110,511.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,050	466.15	1,421,757.50
DARDEN RESTAURANTS INC	10,900	66.58	725,722.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	48,600	22.73	1,104,678.00
LAS VEGAS SANDS CORP	37,900	52.23	1,979,517.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	19,900	71.55	1,423,845.00
MCDONALD'S CORP	88,500	125.83	11,135,955.00
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	10,400	16.95	176,280.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	42,300	21.29	900,567.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	15,000	54.18	812,700.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,900	80.35	1,357,915.00
STARBUCKS CORP	143,700	60.01	8,623,437.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	16,200	83.66	1,355,292.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,900	76.41	832,869.00
WYNN RESORTS LTD	7,700	93.99	723,723.00

YUM BRANDS INC	41,500	82.25	3,413,375.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	19,300	33.00	636,900.00
CBS CORP-CL B	41,400	54.61	2,260,854.00
CHARTER COMMUNICATION-A	8,240	203.52	1,677,004.80
COMCAST CORP-CL A	239,200	60.80	14,543,360.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	14,300	28.09	401,687.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	26,500	26.64	705,960.00
DISH NETWORK CORP-A	22,000	47.37	1,042,140.00
DISNEY (WALT) CO	151,300	98.91	14,965,083.00
INTERPUBRIC GROUP	39,200	22.88	896,896.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	57,400	37.69	2,163,406.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	23,700	38.69	916,953.00
LIBERTY MEDIA CORP-A	8,170	38.63	315,607.10
LIBERTY MEDIA CORP-C	19,300	37.81	729,733.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	37,400	12.75	476,850.00
OMNICOM GROUP	23,100	83.32	1,924,692.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,100	64.83	460,293.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	204,000	3.96	807,840.00
TEGNA INC	20,600	23.70	488,220.00
TIME WARNER CABLE-A	27,350	205.79	5,628,356.50
TIME WARNER INC	77,200	72.16	5,570,752.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	112,200	27.91	3,131,502.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	42,800	28.20	1,206,960.00
VIACOM INC-CLASS B	34,100	40.11	1,367,751.00
GENUINE PARTS CO	14,800	99.12	1,466,976.00
LKQ CORP	30,000	31.12	933,600.00
AMAZON.COM INC	38,490	598.69	23,043,578.10
EXPEDIA INC	11,700	107.80	1,261,260.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	43,600	25.21	1,099,156.00
NETFLIX INC	39,100	102.19	3,995,629.00
PRICELINE GROUP INC/THE	4,800	1,317.03	6,321,744.00
TRIPADVISOR INC	11,500	66.58	765,670.00
DOLLAR GENERAL CORP	28,100	86.14	2,420,534.00
DOLLAR TREE INC	21,300	83.20	1,772,160.00

KOHL'S CORP	19,100	46.05	879,555.00
MACYS INC	30,400	44.10	1,340,640.00
NORDSTROM INC	13,700	57.50	787,750.00
TARGET CORP	56,700	83.60	4,740,120.00
ADVANCE AUTO PARTS	7,150	163.79	1,171,098.50
AUTONATION INC	7,100	47.97	340,587.00
AUTOZONE	2,940	802.52	2,359,408.80
BED BATH & BEYOND	15,600	49.59	773,604.00
BEST BUY COMPANY INC	30,500	31.57	962,885.00
CARMAX INC	19,300	50.81	980,633.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,300	46.99	390,017.00
FOOT LOCKER INC	13,400	65.74	880,916.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	10,000	31.76	317,600.00
GAP INC	22,900	29.66	679,214.00
HOME DEPOT	122,500	133.42	16,343,950.00
L BRANDS, INC	24,000	88.37	2,120,880.00
LOWE'S COS INC	88,500	76.02	6,727,770.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,600	276.64	2,655,744.00
ROSS STORES INC	39,400	58.34	2,298,596.00
SIGNET JEWELERS LTD	7,100	119.68	849,728.00
STAPLES INC	62,000	11.01	682,620.00
TIFFANY & CO	12,700	72.59	921,893.00
TJX COS INC	64,300	78.68	5,059,124.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13,200	90.70	1,197,240.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,940	194.11	1,153,013.40
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	42,360	157.60	6,675,936.00
CVS HEALTH CORP	106,700	104.05	11,102,135.00
KROGER CO	89,000	38.09	3,390,010.00
RITE AID CORP	100,000	8.11	811,000.00
SYSCO CORP	54,200	46.63	2,527,346.00
WAL-MART STORES INC	154,500	68.80	10,629,600.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	84,300	83.63	7,050,009.00
WHOLE FOODS MARKET INC	33,200	31.87	1,058,084.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	11,000	98.53	1,083,830.00
COCA COLA CO	399,200	46.58	18,594,736.00

COCA COLA ENTERPRISES	20,700	51.09	1,057,563.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,800	151.60	2,546,880.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	18,100	89.94	1,627,914.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	18,000	96.07	1,729,260.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	13,730	134.90	1,852,177.00	
PEPSICO INC	140,800	102.69	14,458,752.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	58,200	36.62	2,131,284.00	
BUNGE LIMITED	13,800	56.50	779,700.00	
CAMPBELL SOUP CO	17,500	64.16	1,122,800.00	
CONAGRA INC	41,200	44.95	1,851,940.00	
GENERAL MILLS	57,800	63.31	3,659,318.00	
HERSHEY CO/THE	14,300	91.85	1,313,455.00	
HORMEL FOODS CORP	27,600	43.95	1,213,020.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	11,200	130.18	1,458,016.00	
KELLOGG CO	25,700	76.83	1,974,531.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	58,600	78.90	4,623,540.00	
MCCORMICK & CO INC.	11,300	99.75	1,127,175.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	19,200	84.99	1,631,808.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	153,300	40.46	6,202,518.00	
TYSON FOODS INC-CL A	28,500	67.56	1,925,460.00	
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	17,500	40.36	706,300.00	
ALTRIA GROUP INC	188,900	62.58	11,821,362.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	149,700	98.69	14,773,893.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	82,500	50.48	4,164,600.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,800	92.12	1,179,136.00	
CLOROX CO	12,600	127.97	1,612,422.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	82,500	70.72	5,834,400.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	35,100	135.71	4,763,421.00	
PROCTER & GAMBLE CO	262,800	82.68	21,728,304.00	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	6,100	80.88	493,368.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,600	94.42	2,039,472.00	
ABBOTT LABORATORIES	144,000	41.65	5,997,600.00	
BARD (C R)	7,030	202.88	1,426,246.40	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	52,900	41.26	2,182,654.00	
BECTON,DICKINSON	20,410	152.54	3,113,341.40	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	130,600	18.82	2,457,892.00
DENTSPLY SIRONA INC	22,900	62.06	1,421,174.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	21,100	88.89	1,875,579.00
HOLOGIC INC	23,100	34.50	796,950.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,560	598.28	2,129,876.80
MEDTRONIC PLC	136,200	75.42	10,272,204.00
RESMED INC	13,200	56.89	750,948.00
ST JUDE MEDICAL INC	27,000	55.05	1,486,350.00
STRYKER CORP	32,900	107.05	3,521,945.00
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,700	156.05	733,435.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,500	79.80	758,100.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,400	106.70	1,963,280.00
AETNA INC	33,700	114.19	3,848,203.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,800	87.09	1,637,292.00
ANTHEM INC	25,250	139.97	3,534,242.50
CARDINAL HEALTH INC	31,700	81.78	2,592,426.00
CENTENE CORP	16,100	62.46	1,005,606.00
CIGNA CORP	24,920	137.46	3,425,503.20
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	16,000	73.03	1,168,480.00
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	18,800	20.47	384,836.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC- COMMON	65,000	69.05	4,488,250.00
HCA HOLDINGS INC	31,300	78.10	2,444,530.00
HENRY SCHEIN INC	8,060	172.87	1,393,332.20
HUMANA INC	14,370	184.89	2,656,869.30
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,900	117.85	1,166,715.00
MCKESSON CORP	22,140	157.73	3,492,142.20
MEDNAX INC	9,100	65.34	594,594.00
PATTERSON COS INC	8,700	46.31	402,897.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	14,100	72.26	1,018,866.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	91,800	129.68	11,904,624.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,700	125.33	1,090,371.00
ABBVIE INC	157,600	57.00	8,983,200.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,820	134.82	2,941,772.40
ALKERMES PLC	13,800	32.21	444,498.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,200	59.08	425,376.00

AMGEN INC	72,690	149.48	10,865,701.20
BAXALTA INC	65,700	40.15	2,637,855.00
BIOGEN INC	21,520	254.18	5,469,953.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,300	78.10	1,194,930.00
CELGENE CORP	76,000	98.80	7,508,800.00
GILEAD SCIENCES INC	138,800	91.97	12,765,436.00
INCYTE CORP	16,000	68.35	1,093,600.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,100	38.63	467,423.00
MEDIVATION INC	15,400	37.39	575,806.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,450	359.68	2,679,616.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,340	109.94	477,139.60
VERTEX PHARMACEUTICALS	24,000	78.40	1,881,600.00
ALLERGAN PLC	37,980	274.94	10,442,221.20
BRISTOL MYERS SQUIBB	160,800	63.44	10,201,152.00
ELI LILLY & CO.	96,500	71.78	6,926,770.00
ENDO INTERNATIONAL PLC	20,500	28.45	583,225.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,800	124.03	719,374.00
JOHNSON & JOHNSON	267,200	108.98	29,119,456.00
MALLINCKRODT PLC	11,100	59.91	665,001.00
MERCK & CO INC	269,100	53.22	14,321,502.00
MYLAN NV	40,400	46.40	1,874,560.00
PERRIGO CO PLC	13,950	129.62	1,808,199.00
PFIZER INC	596,500	30.07	17,936,755.00
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	800	141.94	113,552.00
ZOETIS INC	46,000	44.02	2,024,920.00
BANK OF AMERICA CORP	1,003,000	13.48	13,520,440.00
BB&T CORPORATION	75,900	33.53	2,544,927.00
CIT GROUP INC	16,600	32.03	531,698.00
CITIGROUP	287,000	41.88	12,019,560.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,100	21.25	1,064,625.00
COMERICA INC	17,300	38.23	661,379.00
FIFTH THIRD BANCORP	76,700	16.87	1,293,929.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,700	67.02	918,174.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,000	9.59	719,250.00
JPMORGAN CHASE & CO	355,600	59.71	21,232,876.00

KEYCORP	81,000	11.15	903,150.00
M & T BANK CORP	14,100	111.97	1,578,777.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	30,500	16.09	490,745.00
PNC FINANCIAL	48,700	85.35	4,156,545.00
REGIONS FINANCIAL CORP	126,000	7.90	995,400.00
SIGNATURE BANK	4,890	138.26	676,091.40
SUNTRUST BKS INC.	49,600	36.49	1,809,904.00
US BANCORP	168,800	40.99	6,919,112.00
WELLS FARGO CO	468,700	48.65	22,802,255.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	114,600	142.46	16,325,916.00
CME GROUP INC	31,200	95.57	2,981,784.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,450	233.21	2,670,254.50
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,200	15.93	512,946.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	25,800	98.94	2,552,652.00
MOODYS CORP	16,900	95.86	1,620,034.00
MSCI INC	9,300	73.15	680,295.00
NASDAQ INC	11,100	65.17	723,387.00
VOYA FINANCIAL INC	21,100	30.53	644,183.00
AFLAC INC	40,800	63.73	2,600,184.00
ALLEGHANY CORP	1,510	491.77	742,572.70
ALLSTATE CORP	37,200	67.72	2,519,184.00
AMERICAN INTL GROUP	119,400	54.52	6,509,688.00
AON PLC	26,300	103.96	2,734,148.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,100	71.47	864,787.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,800	44.37	745,416.00
ASSURANT INC	6,200	78.36	485,832.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,500	54.99	522,405.00
CHUBB LTD	44,600	119.74	5,340,404.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,700	65.87	968,289.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,020	196.80	791,136.00
FNF GROUP	24,400	33.98	829,112.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	39,400	46.31	1,824,614.00
LINCOLN NATIONAL CORP	23,900	39.97	955,283.00
LOEWS CORP	26,900	38.55	1,036,995.00
MARKEL CORP	1,360	889.47	1,209,679.20

MARSH & MCLENNAN COS	50,100	60.74	3,043,074.00
METLIFE INC	91,400	44.73	4,088,322.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	28,000	39.77	1,113,560.00
PROGRESSIVE CO	56,900	35.03	1,993,207.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	43,500	72.95	3,173,325.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,400	119.99	527,956.00
TORCHMARK CORP	12,200	54.80	668,560.00
TRAVELERS COS INC/THE	29,500	117.43	3,464,185.00
UNUM GROUP	22,700	31.29	710,283.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,400	118.74	1,472,376.00
WR BERKLEY CORP	9,900	56.15	555,885.00
XL GROUP PLC	28,800	36.89	1,062,432.00
CBRE GROUP INC	29,600	28.69	849,224.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	56,000	6.09	341,040.00
JONES LANG LASALLE INC	4,210	115.69	487,054.90
REALOGY HOLDINGS CORP	14,000	35.37	495,180.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	16,700	55.10	920,170.00
ALPHABET INC-CL A	28,140	768.34	21,621,087.60
ALPHABET INC-CL C	30,040	750.53	22,545,921.20
EBAY INC	104,100	24.04	2,502,564.00
FACEBOOK INC-A	219,300	114.70	25,153,710.00
LINKEDIN CORP - A	11,300	113.83	1,286,279.00
TWITTER INC	56,700	16.36	927,612.00
VERISIGN INC	9,900	89.59	886,941.00
YAHOO! INC	86,900	36.56	3,177,064.00
ZILLOW GROUP INC - C	8,600	23.05	198,230.00
ACCENTURE PLC-CL A	60,300	115.37	6,956,811.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,870	215.96	1,267,685.20
AUTOMATIC DATA PROCESS	44,400	89.15	3,958,260.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	58,800	62.45	3,672,060.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,900	63.18	1,699,542.00
FISERV INC	21,900	102.08	2,235,552.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,400	147.76	1,093,424.00
GARTNER INC	8,100	88.30	715,230.00
GLOBAL PAYMENTS INC	12,400	62.78	778,472.00

INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	88,800	148.41	13,178,808.00
MASTERCARD INC-CLASS A	95,500	93.81	8,958,855.00
PAYCHEX INC	31,700	53.29	1,689,293.00
PAYPAL HOLDINGS INC	105,700	39.04	4,126,528.00
SABRE CORP	20,000	28.58	571,600.00
TERADATA CORP	13,200	26.11	344,652.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,300	46.75	762,025.00
VANTIV INC - CL A	15,100	53.87	813,437.00
VISA INC-CLASS A SHARES	187,500	76.78	14,396,250.00
WESTERN UNION CO	49,100	19.33	949,103.00
XEROX CORP	89,000	10.83	963,870.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	48,700	34.07	1,659,209.00
ADOBE SYSTEMS INC.	47,900	93.78	4,492,062.00
ANSYS INC	8,400	88.57	743,988.00
AUTODESK INC.	22,000	57.90	1,273,800.00
CA INC	30,900	30.89	954,501.00
CDK GLOBAL INC	12,800	46.71	597,888.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,700	86.34	578,478.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,900	77.79	1,159,071.00
ELECTRONIC ARTS	29,600	66.41	1,965,736.00
FORTINET INC	13,900	29.40	408,660.00
INTUIT INC	24,100	103.18	2,486,638.00
MICROSOFT CORP	732,700	55.05	40,335,135.00
MOBILEYE NV	8,400	37.03	311,052.00
NETSUITE INC	3,900	67.40	262,860.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	25,000	18.44	461,000.00
ORACLE CORPORATION	308,200	40.97	12,626,954.00
RED HAT INC	17,800	74.04	1,317,912.00
SALESFORCE.COM INC	61,000	74.30	4,532,300.00
SERVICENOW INC	14,300	61.07	873,301.00
SPLUNK INC	12,800	48.60	622,080.00
SYMANTEC CORP	65,200	18.38	1,198,376.00
SYNOPSIS INC	14,900	48.13	717,137.00
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	4,900	45.36	222,264.00
VMWARE INC - CLASS A	7,400	52.09	385,466.00

WORKDAY INC-CLASS A	10,700	76.14	814,698.00	
CISCO SYSTEMS	489,000	28.46	13,916,940.00	
F5 NETWORKS INC	7,000	105.47	738,290.00	
HARRIS CORP	11,900	78.71	936,649.00	
JUNIPER NETWORKS INC	33,500	25.51	854,585.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,100	74.89	1,130,839.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,710	161.99	1,248,942.90	
QUALCOMM INC	145,000	50.99	7,393,550.00	
APPLE INC	538,200	109.56	58,965,192.00	
EMC CORP	187,300	26.70	5,000,910.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	175,200	17.89	3,134,328.00	
HP INC	174,000	12.30	2,140,200.00	
NETAPP INC	27,900	26.66	743,814.00	
SAN DISK CORPORATION	19,400	75.95	1,473,430.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	29,000	34.17	990,930.00	
WESTERN DIGITAL CORP	22,000	46.14	1,015,080.00	
AMPHENOL CORP-CL A	29,600	57.71	1,708,216.00	
ARROW ELECTRS INC	9,300	63.76	592,968.00	
AVNET	12,200	44.24	539,728.00	
CDW CORPORATION	14,100	41.51	585,291.00	
CORNING INC	113,800	20.84	2,371,592.00	
FLEXTRONICS INTL LTD	55,000	11.94	656,700.00	
FLIR SYSTEMS INC	12,600	33.78	425,628.00	
TE CONNECTIVITY LTD	37,100	61.18	2,269,778.00	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,200	24.78	574,896.00	
ANALOG DEVICES INC	30,400	59.11	1,796,944.00	
APPLIED MATERIALS	114,500	21.04	2,409,080.00	
BROADCOM LTD	37,510	156.93	5,886,444.30	
INTEL CORP	456,100	32.71	14,919,031.00	
KLA TENCOR CORP	15,000	72.56	1,088,400.00	
LAM RESEARCH	15,400	82.19	1,265,726.00	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	22,500	44.78	1,007,550.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	41,000	10.32	423,120.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,100	36.54	990,234.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	19,800	48.84	967,032.00	

MICRON TECHNOLOGY	103,100	10.48	1,080,488.00	
NVIDIA CORP	52,600	35.76	1,880,976.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	13,274	81.75	1,085,149.50	
QORVO INC	13,900	51.23	712,097.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,200	77.85	1,416,870.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	98,000	58.37	5,720,260.00	
XILINX INC	25,000	47.87	1,196,750.00	
AT & T INC	594,300	39.37	23,397,591.00	
CENTURYLINK INC	53,000	31.87	1,689,110.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	114,000	5.63	641,820.00	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	29,000	52.84	1,532,360.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	12,100	99.96	1,209,516.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	393,100	54.04	21,243,124.00	
SPRINT CORP	71,000	3.45	244,950.00	
T-MOBILE US INC	27,100	38.44	1,041,724.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,500	66.02	3,135,950.00	
DUKE ENERGY CORP	66,100	80.35	5,311,135.00	
EDISON INTERNATIONAL	31,800	71.60	2,276,880.00	
ENTERGY CORP	17,400	79.23	1,378,602.00	
EVERSOURCE ENERGY	30,900	58.39	1,804,251.00	
EXELON CORPORATION	89,400	35.43	3,167,442.00	
FIRSTENERGY CORP	40,300	35.79	1,442,337.00	
NEXTERA ENERGY INC	44,500	118.50	5,273,250.00	
OGE ENERGY CORP	19,600	28.59	560,364.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	10,500	74.69	784,245.00	
PPL CORPORATION	65,400	37.70	2,465,580.00	
SOUTHERN CO.	87,400	51.21	4,475,754.00	
XCEL ENERGY INC	48,300	41.56	2,007,348.00	
AGL RESOURCES INC	11,500	64.92	746,580.00	
ATMOS ENERGY CORP	9,700	74.05	718,285.00	
ALLIANT ENERGY CORP	10,800	73.89	798,012.00	
AMEREN CORPORATION	23,100	49.75	1,149,225.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	38,900	20.85	811,065.00	
CMS ENERGY CORP	27,300	42.22	1,152,606.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,600	76.48	2,187,328.00	

DOMINION RESOURCES INC/VA	57,200	74.75	4,275,700.00	
DTE ENERGY COMPANY	17,000	90.72	1,542,240.00	
PG&E CORP	47,300	59.44	2,811,512.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	49,300	46.54	2,294,422.00	
SCANA CORP	13,100	69.50	910,450.00	
SEMPRA ENERGY	23,000	103.47	2,379,810.00	
TECO ENERGY INC	22,400	27.53	616,672.00	
WEC ENERGY GROUP INC	30,200	59.61	1,800,222.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,100	68.61	1,173,231.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	47,100	15.96	751,716.00	
ALLY FINANCIAL INC	42,100	18.23	767,483.00	
AMERICAN EXPRESS CO	81,100	60.29	4,889,519.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51,700	69.15	3,575,055.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	41,700	50.26	2,095,842.00	
NAVIENT CORP	33,900	11.97	405,783.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	80,500	28.38	2,284,590.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,200	163.05	847,860.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,800	95.57	1,605,576.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	106,000	37.14	3,936,840.00	
BLACKROCK INC	11,900	341.37	4,062,303.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	29,100	24.66	717,606.00	
EATON VANCE CORP	11,700	33.31	389,727.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,800	39.14	1,479,492.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	37,060	156.50	5,799,890.00	
INVESCO LTD	41,200	31.26	1,287,912.00	
LEGG MASON INC	9,200	34.63	318,596.00	
MORGAN STANLEY	139,700	25.07	3,502,279.00	
NORTHERN TRUST CORP	21,400	65.48	1,401,272.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,000	47.75	573,000.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	114,800	28.17	3,233,916.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,900	42.81	552,249.00	
STATE STREET CORP	39,300	58.52	2,299,836.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	24,000	73.90	1,773,600.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,400	31.62	803,148.00	
H & R BLOCK INC	22,400	26.41	591,584.00	

	AES CORP	65,000	11.62	755,300.00	
	CALPINE CORP	31,000	14.77	457,870.00	
	NRG ENERGY INC	29,400	12.94	380,436.00	
	CERNER CORP	29,300	52.72	1,544,696.00	
	IMS HEALTH HOLDINGS INC	16,300	26.03	424,289.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,400	40.12	1,299,888.00	
	ILLUMINA INC	14,270	157.43	2,246,526.10	
	METTLER-TOLEDO INTL	2,700	343.24	926,748.00	
	QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	8,800	64.70	569,360.00	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,670	140.79	5,444,349.30	
	WATERS CORP	8,000	132.16	1,057,280.00	
	DUN & BRADSTREET CORP	3,600	103.52	372,672.00	
	EQUIFAX INC	11,300	113.90	1,287,070.00	
	IHS INC-CLASS A	6,600	123.53	815,298.00	
	MANPOWERGROUP INC	7,000	80.96	566,720.00	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	33,400	52.80	1,763,520.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	13,300	45.85	609,805.00	
	VERISK ANALYTICS INC	15,200	78.73	1,196,696.00	
小計	銘柄数：599			1,772,005,783.30	
				(199,669,611,662)	
	組入時価比率：61.2%			64.5%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	14,100	32.33	455,853.00	
	ARC RESOURCES LTD	33,500	18.54	621,090.00	
	CAMECO CORP	38,600	16.95	654,270.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	106,300	34.66	3,684,358.00	
	CENOVUS ENERGY INC	79,000	17.03	1,345,370.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	48,800	17.97	876,936.00	
	ENBRIDGE INC	88,300	50.09	4,422,947.00	
	ENCANA CORP	79,000	7.67	605,930.00	
	HUSKY ENERGY INC	35,745	16.10	575,494.50	
	IMPERIAL OIL	28,300	43.24	1,223,692.00	
	INTER PIPELINE LTD	33,100	25.93	858,283.00	
	KEYERA CORP	16,100	38.41	618,401.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	36,200	34.79	1,259,398.00	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	15,100	28.76	434,276.00	

PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,600	24.32	452,352.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	17,000	19.42	330,140.00
SUNCOR ENERGY INC	152,460	35.65	5,435,199.00
TOURMALINE OIL CORP	17,300	27.37	473,501.00
TRANSCANADA CORP	68,800	50.72	3,489,536.00
VERESEN INC	24,800	8.70	215,760.00
VERMILION ENERGY INC	10,500	37.78	396,690.00
AGRIUM INC	12,600	117.15	1,476,090.00
METHANEX CORP	8,200	42.16	345,712.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	81,800	22.58	1,847,044.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,660	243.15	646,779.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	20,600	47.66	981,796.00
BARRICK GOLD	113,000	17.82	2,013,660.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	62,800	4.06	254,968.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,400	6.75	475,200.00
FRANCO-NEVADA CORP	16,500	81.30	1,341,450.00
GOLDCORP INC	80,000	21.26	1,700,800.00
KINROSS GOLD CORP	118,600	4.46	528,956.00
SILVER WHEATON CORP	39,200	22.88	896,896.00
TECK RESOURCES LTD	58,200	10.14	590,148.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,000	3.32	288,840.00
YAMANA GOLD INC	97,000	3.97	385,090.00
WEST FRASER TIMBER	6,800	53.91	366,588.00
BOMBARDIER B SHEARS	167,000	1.32	220,440.00
CAE INC	26,000	15.01	390,260.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,500	47.40	687,300.00
FINNING INTERNATIONAL INC	14,900	19.05	283,845.00
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	10,400	39.93	415,272.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	76,900	81.27	6,249,663.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	14,000	173.75	2,432,500.00
LINAMAR CORP	4,800	62.00	297,600.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	38,800	55.97	2,171,636.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	23,100	39.06	902,286.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	19,800	51.00	1,009,800.00
SHAW COMMUNICATIONS-B	40,400	25.25	1,020,100.00

THOMSON REUTERS CORP	33,000	52.49	1,732,170.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,000	134.06	938,420.00
DOLLARAMA INC	11,500	88.91	1,022,465.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	40,100	57.89	2,321,389.00
EMPIRE CO LTD A	16,200	22.52	364,824.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	22.20	208,680.00
LOBLAW COMPANIES	21,400	73.81	1,579,534.00
METRO INC	23,200	44.75	1,038,200.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,800	117.04	561,792.00
SAPUTO INC	23,900	42.27	1,010,253.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	31,300	35.10	1,098,630.00
BANK OF MONTREAL	61,800	79.02	4,883,436.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	116,200	63.55	7,384,510.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	38,300	97.80	3,745,740.00
NATIONAL BANK OF CANADA	33,400	42.81	1,429,854.00
ROYAL BANK OF CANADA	143,300	75.44	10,810,552.00
TORONTO DOMINION BANK	178,900	56.27	10,066,703.00
ELEMENT FINANCIAL CORP	36,000	13.80	496,800.00
ONEX CORP	8,000	79.70	637,600.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,170	717.24	1,556,410.80
GREAT-WEST LIFECO INC	28,000	35.43	992,040.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,900	39.01	386,199.00
INTACT FINANCIAL CORP	12,700	90.41	1,148,207.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	191,800	18.45	3,538,710.00
POWER CORPORATION OF CANADA	35,000	29.78	1,042,300.00
POWER FINANCIAL CORP	24,300	32.20	782,460.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	58,800	41.65	2,449,020.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	84,700	45.25	3,832,675.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,300	20.68	233,684.00
CGI GROUP INC - CLASS A	21,400	61.79	1,322,306.00
CONSTELLATION SOFTWARE	1,790	540.00	966,600.00
OPEN TEXT CORP	12,100	67.71	819,291.00
BLACKBERRY LTD	50,900	10.38	528,342.00
BCE INC	14,100	59.43	837,963.00

	TELUS CORP	19,300	42.49	820,057.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	34,800	52.19	1,816,212.00	
	FORTIS INC	27,300	40.47	1,104,831.00	
	ATCO LTD CL1	6,800	39.40	267,920.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	12,400	36.29	449,996.00	
	CI FINANCIAL CORP	22,600	28.88	652,688.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	38.39	395,417.00	
小計	銘柄数：90			135,925,076.30	
				(11,796,937,372)	
	組入時価比率：3.6%			3.8%	
ユ-口	SAIPEM	549,700	0.35	195,693.20	
	TECHNIP SA	9,800	49.58	485,884.00	
	TENARIS SA	46,000	10.95	503,700.00	
	ENI SPA	244,800	13.52	3,309,696.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	44,500	11.41	507,745.00	
	NESTE OYJ	12,500	30.38	379,750.00	
	OMV AG	14,000	25.32	354,480.00	
	REPSOL SA	104,318	10.07	1,050,482.26	
	TOTAL SA	211,500	40.98	8,667,270.00	
	VOPAK	7,100	44.27	314,317.00	
	AIR LIQUIDE	33,000	100.95	3,331,350.00	
	AKZO NOBEL	24,000	60.37	1,448,880.00	
	ARKEMA	6,700	66.45	445,215.00	
	BASF SE	88,700	67.12	5,953,544.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,800	26.72	368,805.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	39.89	255,328.00	
	K+S AG	17,300	20.91	361,743.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	17,500	48.92	856,100.00	
	LANXESS	8,300	41.94	348,102.00	
	LINDE AG	17,910	130.90	2,344,419.00	
	OCI	8,000	17.58	140,640.00	
	SOLVAY SA	7,300	89.66	654,518.00	
	SYMRISE AG	11,500	59.86	688,390.00	
	UMICORE	8,800	44.36	390,412.00	
	CRH PLC	82,200	25.23	2,073,906.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,700	75.95	1,040,515.00	

IMERYS	3,800	61.16	232,408.00
ARCELORMITTAL	96,000	3.84	369,504.00
ARCELORMITTAL-RIGHTS	96,000	1.15	110,812.80
THYSSENKRUPP AG	36,300	18.19	660,478.50
VOESTALPINE AG	11,000	29.08	319,880.00
STORA ENSO OYJ-R	54,000	8.07	435,780.00
UPM-KYMMENE OYJ	50,500	16.31	823,655.00
AIRBUS GROUP SE	57,400	59.96	3,441,704.00
FINMECCANICA SPA	41,000	11.31	463,710.00
SAFRAN SA	30,100	62.12	1,869,812.00
THALES (EX THOMSON-CSF)	9,900	77.45	766,755.00
ZODIAC AEROSPACE	19,500	17.96	350,317.50
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	45,500	38.73	1,762,442.50
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,525	26.69	494,524.87
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,100	35.03	283,783.50
BOUYGUES	20,100	37.20	747,820.50
FERROVIAL SA	46,392	18.92	877,736.64
VINCI	46,000	66.29	3,049,340.00
LEGRAND SA	25,300	49.81	1,260,319.50
OSRAM LICHT AG	8,850	45.26	400,551.00
PRYSMIAN SPA	19,400	20.10	389,940.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,800	56.12	3,019,256.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	91,500	25.12	2,298,937.50
SIEMENS AG	76,500	93.33	7,139,745.00
ALSTOM	15,500	22.88	354,717.50
ANDRITZ AG	8,000	48.34	386,720.00
CNH INDUSTRIAL NV	92,000	6.15	566,260.00
GEA GROUP AG	17,500	43.20	756,000.00
KONE OYJ	31,900	43.29	1,380,951.00
MAN SE	3,200	95.69	306,208.00
METSO OYJ	10,400	21.20	220,480.00
WARTSILA OYJ	14,700	40.28	592,116.00
ZARDOYA OTIS S.A	16,872	10.20	172,094.40
BRENNTAG AG	15,190	50.08	760,715.20
REXEL SA	28,600	12.60	360,503.00

BIC	2,810	134.95	379,209.50
EDENRED	18,700	17.21	321,827.00
BOLLORE	87,000	3.48	303,543.00
DEUTSCHE POST AG-REG	94,000	24.99	2,349,530.00
TNT EXPRESS NV	43,000	7.88	339,055.00
DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	22,600	14.06	317,869.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	80,000	7.06	564,880.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	50,200	14.50	727,900.00
ADP	2,800	109.70	307,160.00
AENA SA	6,500	114.25	742,625.00
ATLANTIA SPA	39,300	24.65	968,745.00
FRAPORT AG	3,800	53.47	203,186.00
GRUPE EUROTUNNEL SE - REGR	45,000	9.88	444,645.00
CONTINENTAL AG	10,630	200.60	2,132,378.00
MICHELIN B	17,800	91.33	1,625,674.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	11,300	31.28	353,464.00
VALEO	7,630	136.50	1,041,495.00
BAYER MOTOREN WERK	31,800	82.11	2,611,098.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	5,300	70.46	373,438.00
DAIMLER AG	92,900	67.93	6,310,697.00
FERRARI NV	12,740	37.22	474,182.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,000	7.24	644,360.00
PEUGEOT CITROEN	43,700	15.35	671,013.50
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	15,200	46.58	708,016.00
RENAULT	18,800	87.84	1,651,392.00
VOLKSWAGEN AG	3,450	128.90	444,705.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	17,830	113.55	2,024,596.50
ADIDAS AG	20,200	104.60	2,112,920.00
CHRISTIAN DIOR SE	5,380	163.85	881,513.00
HERMES INTERNATIONAL	2,470	316.25	781,137.50
HUGO BOSS AG	6,300	57.00	359,100.00
KERING	7,230	161.25	1,165,837.50
LUXOTTICA GROUP SPA	16,500	50.10	826,650.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	26,860	154.50	4,149,870.00

ACCOR SA	20,700	37.50	776,353.50
PADDY POWER PLC	8,100	121.45	983,745.00
SODEXO	9,000	95.80	862,200.00
ALTICE NV - A	36,830	15.97	588,175.10
ALTICE NV - B	10,010	16.14	161,561.40
AXEL SPRINGER SE	4,400	47.92	210,848.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,300	28.65	467,076.50
JC DECAUX SA	6,800	38.56	262,242.00
LAGARDERE S.C.A	11,600	23.70	274,920.00
NUMERICABLE-SFR	11,000	37.67	414,425.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	20,900	45.89	959,205.50
PUBLICIS GROUPE	18,400	62.66	1,152,944.00
RELX NV	97,000	15.67	1,520,475.00
RTL GROUP	3,900	74.67	291,213.00
SES FDR	31,600	25.85	817,018.00
TELENET GROUP HOLDING NV	5,200	45.25	235,326.00
VIVENDI SA	113,200	18.93	2,142,876.00
WOLTERS KLUWER	28,900	35.81	1,035,053.50
ZALANDO SE	8,100	28.85	233,685.00
INDITEX SA	105,600	30.11	3,179,616.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	54,100	24.40	1,320,040.00
CASINO GUICHARD	5,900	50.68	299,012.00
COLRUYT SA	7,000	51.27	358,890.00
DELHAIZE GROUP	9,800	92.73	908,754.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	57,000	4.75	270,864.00
JERONIMO MARTINS	25,200	14.44	364,014.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	81,200	19.98	1,622,782.00
METRO AG	16,600	27.40	454,840.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	77,400	111.30	8,614,620.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,700	69.66	675,702.00
HEINEKEN NV	22,000	80.77	1,776,940.00
PERNOD-RICARD	20,500	100.25	2,055,125.00
REMY COINTREAU	2,300	67.43	155,089.00
DANONE	56,700	63.55	3,603,285.00
KERRY GROUP PLC-A	16,100	82.18	1,323,098.00

HENKEL AG & CO KGAA	10,000	88.00	880,000.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,400	98.93	1,721,382.00	
BEIERSDORF AG	10,000	80.55	805,500.00	
LOREAL-ORD	24,210	160.70	3,890,547.00	
UNILEVER NV-CVA	157,100	40.32	6,335,057.50	
ESSILOR INTERNATIONAL	19,900	108.80	2,165,120.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	20,900	77.91	1,628,319.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	37,100	63.95	2,372,545.00	
GRIFOLS SA	28,800	19.76	569,232.00	
BAYER AG	79,700	103.40	8,240,980.00	
MERCK KGAA	12,600	74.07	933,282.00	
ORION OYJ	9,600	28.99	278,304.00	
SANOFI	113,300	71.27	8,074,891.00	
U.C.B. SA	12,300	67.75	833,325.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	617,242	5.94	3,671,972.65	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD	3,400,000	0.03	131,240.00	
BANCO DE SABADELL SA	484,505	1.62	787,320.62	
BANCO POPOLARE SPA	33,900	6.46	218,994.00	
BANCO SANTANDER SA	1,397,815	3.97	5,557,712.44	
BANK OF IRELAND	2,850,000	0.26	741,000.00	
BANKIA SA	430,000	0.86	371,950.00	
BANKINTER S.A.	65,000	6.27	407,745.00	
BCO POPULAR ESPANOL	162,434	2.35	383,019.37	
BNP PARIBAS	102,300	44.45	4,547,235.00	
CAIXABANK	248,288	2.64	656,473.47	
COMMERZBANK AG	102,000	7.67	782,442.00	
CREDIT AGRICOLE SA	103,000	9.57	986,225.00	
ERSTE GROUP BANK AG	26,800	24.56	658,342.00	
ING GROEP NV	375,000	10.86	4,074,375.00	
INTESA SANPAOLO	1,216,000	2.41	2,940,288.00	
INTESA SANPAOLO-RSP	92,000	2.27	209,392.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROUPE NV	24,000	46.31	1,111,440.00	
NATIXIS	87,000	4.36	379,755.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	13.16	144,815.00	

SOCIETE GENERALE	69,700	32.79	2,285,811.50
UNICREDIT SPA	464,000	3.27	1,517,280.00
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	90,000	3.38	304,560.00
DEUTSCHE BOERSE AG	18,900	74.74	1,412,586.00
EURAZEO	3,876	59.49	230,583.24
EXOR SPA	11,200	32.51	364,112.00
GROUPE BRUXELLES LAM	7,800	73.02	569,556.00
WENDEL	2,900	95.53	277,037.00
AEGON NV	180,000	4.90	882,720.00
AGEAS	20,000	35.26	705,300.00
ALLIANZ SE	44,090	144.55	6,373,209.50
ASSICURAZIONI GENERALI	113,700	13.16	1,496,292.00
AXA	191,200	20.65	3,948,280.00
CNP ASSURANCES	16,500	13.73	226,545.00
HANNOVER RUECK SE	5,700	102.95	586,815.00
MAPFRE SA	111,000	1.93	215,007.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	16,060	179.65	2,885,179.00
NN GROUP NV	23,200	29.22	677,904.00
SAMPO OYJ-A	43,200	42.08	1,817,856.00
SCOR SE	15,400	31.49	484,946.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	2.03	218,066.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	32,900	27.42	902,282.50
IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00
VONOVIA SE	45,200	31.76	1,435,552.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,600	44.17	512,430.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	41,900	37.74	1,581,515.50
ATOS SE	8,600	71.86	617,996.00
CAP GEMINI SA	16,000	84.05	1,344,800.00
DASSAULT SYSTEMES SA	12,100	70.70	855,470.00
GEMALTO	7,600	65.45	497,420.00
SAP SE	94,800	71.16	6,745,968.00
NOKIA OYJ	560,000	5.33	2,987,600.00
INGENICO GROUP	5,500	102.70	564,850.00
ASML HOLDING NV	33,200	89.29	2,964,428.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	109,000	12.65	1,379,395.00

STMICROELECTRONICS NV	57,700	4.90	282,730.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	311,400	15.94	4,965,273.00	
ELISA CORPORATION	13,700	34.32	470,184.00	
ILIAD SA	2,440	232.40	567,056.00	
KONINKLIJKE KPN NV	311,000	3.68	1,146,657.00	
ORANGE	190,300	15.59	2,966,777.00	
PROXIMUS	15,100	30.47	460,097.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,110,000	0.95	1,058,940.00	
TELECOM ITALIA-RNC	570,000	0.77	442,320.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	74,600	4.79	358,005.40	
TELEFONICA SA	435,617	10.07	4,388,841.27	
ELECTRICITE DE FRANCE	22,800	10.14	231,306.00	
ENDESA S.A.	31,700	17.24	546,508.00	
ENEL SPA	677,000	4.00	2,708,000.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	220,000	3.17	698,720.00	
FORTUM OYJ	44,000	13.42	590,480.00	
IBERDROLA SA	528,709	5.95	3,146,347.25	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,200	77.22	787,644.00	
TERNA SPA	142,000	5.08	721,360.00	
ENAGAS	21,300	26.84	571,798.50	
GAS NATURAL SDG	32,800	17.93	588,104.00	
SNAM SPA	205,000	5.53	1,133,650.00	
E.ON SE	194,000	8.67	1,682,174.00	
ENGIE	141,100	13.83	1,952,118.50	
RWE AG	46,200	11.38	525,987.00	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	29,900	16.16	483,184.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,700	21.29	930,591.50	
DEUTSCHE BANK AG-REG	133,100	15.15	2,017,130.50	
MEDIOBANCA SPA-ORD	53,000	6.33	335,490.00	
ENEL GREEN POWER SPA	160,000	1.94	310,720.00	
QIAGEN NV	22,300	19.53	435,630.50	
BUREAU VERITAS SA	25,500	19.57	499,035.00	
RANDSTAD HOLDING NV	12,700	49.17	624,522.50	
小計銘柄数：233			309,569,544.38	
			(39,532,030,817)	

	組入時価比率：12.1%			12.8%
英ポンド	PETROFAC LTD	26,000	9.16	238,290.00
	BP PLC	1,766,000	3.55	6,279,013.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	380,000	17.06	6,484,700.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	382,000	17.14	6,547,480.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	12,700	30.46	386,842.00
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,150	27.32	523,178.00
	REXAM PLC	65,555	6.32	414,635.37
	ANGLO AMERICAN PLC	137,000	5.35	733,909.00
	ANTOFAGASTA PLC	41,000	4.69	192,577.00
	BHP BILLITON PLC	204,300	7.93	1,621,324.80
	FRESNILLO PLC	20,900	9.38	196,146.50
	GLENCORE PLC	1,188,000	1.51	1,800,414.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	9,000	62.80	565,200.00
	RIO TINTO PLC-REG	120,100	19.73	2,369,573.00
	MONDI PLC	34,200	13.50	461,700.00
	BAE SYSTEMS PLC	306,000	5.12	1,566,720.00
	COBHAM PLC	113,000	2.20	248,600.00
	MEGGITT PLC	78,000	4.07	318,006.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	177,000	6.90	1,221,300.00
	SMITHS GROUP PLC	37,500	10.87	407,625.00
	IMI PLC	25,900	9.57	247,863.00
	WEIR GROUP PLC	22,000	11.06	243,320.00
	ASHTREAD GROUP PLC	46,800	8.70	407,160.00
	BUNZLE	33,100	20.33	672,923.00
	TRAVIS PERKINS PLC	24,700	18.31	452,257.00
	WOLSELEY PLC	24,200	39.95	966,790.00
	AGGREKO PLC	26,233	10.85	284,628.05
	BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	9.45	244,884.50
	G4S PLC	152,000	1.93	293,512.00
	ROYAL MAIL PLC	88,000	4.84	426,624.00
EASYJET PLC	16,300	15.20	247,760.00	
GKN PLC	169,000	2.93	496,353.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	98,000	5.70	559,090.00	
PERSIMMON PLC	29,500	21.02	620,090.00	

TAYLOR WIMPEY PLC	319,000	1.90	608,333.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	12,400	32.54	403,496.00
BURBERRY GROUP PLC	42,300	13.70	579,510.00
CARNIVAL PLC	18,700	36.92	690,404.00
COMPASS GROUP PLC	158,500	12.30	1,949,550.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	22,900	28.23	646,467.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	69,000	4.59	316,848.00
TUI AG-DI	46,652	10.28	479,582.56
WHITBREAD PLC	17,500	39.78	696,150.00
WILLIAM HILL PLC	85,000	3.30	280,840.00
ITV PLC	365,000	2.43	888,045.00
PEARSON	79,000	9.05	715,345.00
RELX PLC	106,600	13.06	1,392,196.00
SKY PLC	99,800	10.34	1,031,932.00
WPP PLC	124,300	16.35	2,032,305.00
MARKS & SPENCER PLC	155,000	4.05	628,370.00
NEXT PLC	14,000	55.60	778,400.00
DIXONS CARPHONE PLC	92,000	4.28	393,760.00
KINGFISHER PLC	217,000	3.77	818,958.00
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	25,300	3.78	95,634.00
MORRISON SUPERMARKETS	213,000	2.02	430,473.00
SAINSBURY	123,800	2.80	347,754.20
TESCO PLC	787,000	1.93	1,524,812.50
COCA-COLA HBC AG-CDI	19,800	15.05	297,990.00
DIAGEO PLC	242,700	18.96	4,601,592.00
SABMILLER PLC	93,800	42.59	3,994,942.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,400	33.69	1,158,936.00
TATE & LYLE ORD.	42,500	5.77	245,225.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	179,700	40.75	7,322,775.00
IMPERIAL BRANDS PLC	92,600	38.54	3,569,267.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	61,700	67.71	4,177,707.00
UNILEVER PLC	124,400	31.90	3,968,360.00
SMITH & NEPHEW PLC	85,800	11.49	985,842.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	9.03	338,625.00
ASTRAZENECA PLC	121,900	39.15	4,772,994.50

GLAXOSMITHKLINE PLC	469,100	14.12	6,623,692.00
SHIRE PLC	56,800	39.17	2,224,856.00
BARCLAYS PLC	1,630,000	1.51	2,471,895.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,887,000	4.37	8,247,133.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,530,000	0.67	3,749,340.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	341,000	2.23	762,817.00
STANDARD CHARTERED PLC	316,428	4.72	1,493,856.58
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	30,200	28.20	851,640.00
ADMIRAL GROUP PLC	19,800	19.69	389,862.00
AVIVA PLC	389,000	4.60	1,789,400.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	136,083	3.73	507,589.59
LEGAL & GENERAL	576,000	2.35	1,355,904.00
OLD MUTUAL PLC	468,000	1.96	920,556.00
PRUDENTIAL PLC	249,300	13.02	3,245,886.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	98,750	4.77	471,432.50
ST JAMES S PLACE PLC	49,900	9.26	462,074.00
STANDARD LIFE PLC	186,000	3.57	664,206.00
AUTO TRADER GROUP PLC	95,000	3.92	372,780.00
WORLDPAY GROUP PLC	105,000	2.72	285,600.00
SAGE GROUP PLC (THE)	105,000	6.27	658,875.00
ARM HOLDINGS PLC	134,000	10.24	1,372,160.00
BT GROUP PLC	817,000	4.46	3,644,637.00
INMARSAT PLC	42,500	9.65	410,125.00
VODAFONE GROUP PLC	2,561,000	2.22	5,698,225.00
SSE PLC	96,900	15.08	1,461,252.00
CENTRICA PLC	490,000	2.30	1,129,450.00
NATIONAL GRID PLC	359,600	9.93	3,572,626.00
SEVERN TRENT PLC	22,100	21.94	484,874.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,000	9.29	622,765.00
PROVIDENT FINANCIAL PLC	14,300	29.59	423,137.00
3I GROUP PLC	97,000	4.61	447,752.00
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	94,000	2.79	262,448.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,000	13.32	333,000.00
ICAP PLC	54,000	4.73	255,636.00
INVESTEC PLC	55,000	5.03	276,925.00

	SCHRODERS PLC	11,800	27.10	319,780.00	
	CAPITA PLC	64,000	10.48	670,720.00	
	EXPERIAN PLC	94,600	12.46	1,178,716.00	
	INTERTEK GROUP PLC	15,100	31.81	480,331.00	
小計	銘柄数：108			152,497,863.15	
				(24,692,454,001)	
	組入時価比率：7.6%			8.0%	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	830	501.00	415,830.00	
	GIVAUDAN-REG	894	1,912.00	1,709,328.00	
	SIKA AG-BR	209	3,853.00	805,277.00	
	SYNGENTA AG	8,900	400.10	3,560,890.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	44,300	44.92	1,989,956.00	
	GEBERIT AG-REG	3,670	361.40	1,326,338.00	
	ABB LTD	213,400	18.89	4,031,126.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	176.60	340,838.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,310	177.50	765,025.00	
	SULZER AG-REG	1,300	95.35	123,955.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,250	137.10	719,775.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	50,000	64.15	3,207,500.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,950	338.00	997,100.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	66.65	306,590.00	
	DUFREY AG-REG	4,000	118.50	474,000.00	
	ARYZTA AG	8,500	39.55	336,175.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	190	1,044.00	198,360.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	95	5,875.00	558,125.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	10	70,835.00	708,350.00	
	NESTLE SA-REG	308,000	72.25	22,253,000.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,030	122.90	618,187.00	
	ACTELION LTD	9,770	142.20	1,389,294.00	
	GALENICA AG-REG	368	1,425.00	524,400.00	
	NOVARTIS-REG	219,900	70.05	15,403,995.00	
	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	67,880	236.90	16,080,772.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	3,200	62.05	198,560.00	
	BALOISE HOLDING AG	5,000	122.90	614,500.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,180	257.30	818,214.00	
		33,700	89.10	3,002,670.00	

	SWISS RE LTD				
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,420	222.30	3,205,566.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,300	84.40	531,720.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,460	523.50	1,287,810.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	174,300	13.74	2,394,882.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,000	41.46	912,120.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,530	389.50	595,935.00	
	UBS GROUP AG	351,100	15.81	5,550,891.00	
	LONZA AG-REG	5,020	162.00	813,240.00	
	ADECCO SA-REG	16,300	63.05	1,027,715.00	
	SGS SA-REG	523	2,029.00	1,061,167.00	
小計	銘柄数：39			100,859,176.00	
				(11,774,300,206)	
	組入時価比率：3.6%			3.8%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	20,100	137.40	2,761,740.00	
	BOLIDEN AB	26,000	129.90	3,377,400.00	
	ASSA ABLOY AB-B	97,000	160.80	15,597,600.00	
	SKANSKA AB-B SHS	37,500	187.10	7,016,250.00	
	ALFA LAVAL AB	27,700	136.90	3,792,130.00	
	ATLAS COPCO AB-A	64,800	204.30	13,238,640.00	
	ATLAS COPCO AB-B	38,200	191.80	7,326,760.00	
	SANDVIK AB	103,000	85.10	8,765,300.00	
	SKF AB-B SHARES	38,800	147.90	5,738,520.00	
	VOLVO AB-B SHS	150,000	88.90	13,335,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	29,400	137.60	4,045,440.00	
	ELECTROLUX AB-B	23,300	213.70	4,979,210.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	59.25	2,251,500.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	92,300	273.00	25,197,900.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,800	270.80	2,112,240.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,900	277.20	5,239,080.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	58,400	259.10	15,131,440.00	
	GETINGE AB-B SHS	19,100	190.90	3,646,190.00	
	NORDEA BANK AB	293,000	78.75	23,073,750.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	146,000	79.30	11,577,800.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	145,000	104.40	15,138,000.00	

	SWEDBANK AB	86,500	175.10	15,146,150.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,800	138.40	2,325,120.00	
	INVESTOR AB-B SHS	44,400	290.80	12,911,520.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	23,600	232.30	5,482,280.00	
	ERICSSON LM-B	292,000	81.75	23,871,000.00	
	HEXAGON AB-B SHS	24,400	315.70	7,703,080.00	
	TELIA AB	251,000	42.42	10,647,420.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6,100	453.30	2,765,130.00	
	TELE 2 AB-B SHS	28,400	76.10	2,161,240.00	
小計	銘柄数：30			276,354,830.00	
				(3,827,514,395)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	105,500	131.90	13,915,450.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,800	322.00	5,409,600.00	
	NORSK HYDRO	130,000	34.29	4,457,700.00	
	SCHIBSTED ASA	7,800	235.30	1,835,340.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,100	222.70	2,026,570.00	
	ORKLA ASA	80,000	75.70	6,056,000.00	
	DNB ASA	95,600	98.30	9,397,480.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,700	141.70	2,791,490.00	
	TELENOR ASA	71,900	139.60	10,037,240.00	
小計	銘柄数：9			55,926,870.00	
				(758,368,357)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,300	438.30	4,076,190.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,500	299.90	6,747,750.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	21,600	470.20	10,156,320.00	
	ISS A/S	14,100	261.60	3,688,560.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	375	8,615.00	3,230,625.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	660	8,855.00	5,844,300.00	
	DSV A/S	18,200	275.40	5,012,280.00	
	PANDORA A/S	10,820	867.00	9,380,940.00	
	CARLSBERG B	10,500	629.00	6,604,500.00	
	COLOPLAST-B	10,500	500.50	5,255,250.00	

	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,600	654.50	1,701,700.00	
	GENMAB A/S	5,100	858.50	4,378,350.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	188,800	358.00	67,590,400.00	
	DANSKE BANK AS	68,600	185.80	12,745,880.00	
	TRYG A/S	11,800	128.40	1,515,120.00	
	TDC A/S	76,800	32.22	2,474,496.00	
小計	銘柄数：16			150,402,661.00	
				(2,577,901,609)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	25,500	32.78	835,890.00	
	OIL SEARCH LTD	130,000	6.72	873,600.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	175,000	4.94	864,500.00	
	SANTOS LTD.	167,000	4.03	673,010.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	71,100	25.96	1,845,756.00	
	INCITEC PIVOT LTD	161,000	3.20	515,200.00	
	ORICA LTD	36,600	15.61	571,326.00	
	BORAL LTD	67,000	6.10	408,700.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	44,000	17.57	773,080.00	
	AMCOR	113,000	14.23	1,607,990.00	
	ALUMINA LTD	233,000	1.30	302,900.00	
	BHP BILLITON LIMITED	308,400	16.62	5,125,608.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,000	2.57	364,940.00	
	ILUKA RESOURCES LTD	37,800	6.56	247,968.00	
	NEWCREST MINING	75,000	16.79	1,259,250.00	
	RIO TINTO LTD	41,000	41.99	1,721,590.00	
	SOUTH32 LTD	500,000	1.43	717,500.00	
	CIMIC GROUP LTD	8,938	34.58	309,076.04	
	BRAMBLES LTD	155,000	12.09	1,873,950.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	44,133	3.97	175,208.01	
	ASCIANO LTD	61,000	8.98	547,780.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	209,000	3.95	825,550.00	
	SYDNEY AIRPORT	107,900	6.65	717,535.00	
	TRANSURBAN GROUP	195,004	11.24	2,191,844.96	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,000	10.05	522,600.00	
	CROWN RESORTS LTD	36,000	12.23	440,280.00	

FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	42.57	221,364.00
TABCORP HOLDINGS	78,000	4.12	321,360.00
TATTS GROUP LTD	147,000	3.61	530,670.00
REA GROUP LTD	5,400	53.21	287,334.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	4.71	249,630.00
WESFARMERS LIMITED	107,900	41.27	4,453,033.00
WOOLWORTHS LIMITED	122,900	21.87	2,687,823.00
COCA-COLA AMATIL LTD	52,000	8.58	446,160.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	9.50	684,000.00
COCHLEAR LTD	5,200	101.14	525,928.00
HEALTHSCOPE LTD	176,000	2.61	459,360.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,100	60.57	854,037.00
SONIC HEALTHCARE LTD	37,300	18.51	690,423.00
CSL LIMITED	45,100	100.36	4,526,236.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	281,700	23.11	6,510,087.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,115	11.73	411,898.95
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	44,300	8.77	388,511.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	164,600	73.31	12,066,826.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	252,400	25.64	6,471,536.00
WESTPAC BANKING CORP	320,600	29.89	9,582,734.00
ASX LTD	18,200	41.25	750,750.00
CHALLENGER LIMITED	56,000	8.20	459,200.00
AMP LIMITED	285,000	5.69	1,621,650.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	232,000	5.46	1,266,720.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	261,000	2.88	751,680.00
QBE INSURANCE	133,000	10.74	1,428,420.00
SUNCORP GROUP LTD	126,000	11.59	1,460,340.00
COMPUTERSHARE LTD	47,000	9.72	456,840.00
TELSTRA CORP LTD	417,000	5.22	2,176,740.00
TPG TELECOM LTD	27,000	11.24	303,480.00
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	43,000	8.20	352,600.00
AUSNET SERVICES	163,400	1.50	245,100.00
APA GROUP	107,000	8.70	930,900.00
AGL ENERGY LTD	64,500	18.15	1,170,675.00
DUET GROUP	229,000	2.28	522,120.00

	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,600	64.58	1,911,568.00	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	25,000	6.26	156,500.00	
	SEEK LTD	32,800	15.84	519,552.00	
小計	銘柄数：64			95,166,417.96	
				(8,208,103,549)	
	組入時価比率：2.5%			2.7%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	69,000	7.76	535,440.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,110	6.40	621,504.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,000	8.45	295,750.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	170,000	3.61	613,700.00	
	CONTACT ENERGY LTD	76,000	4.97	377,720.00	
	MIGHTY RIVER POWER	60,000	2.88	173,100.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	120,000	2.57	308,400.00	
小計	銘柄数：7			2,925,614.00	
				(227,846,818)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	262,540	102.30	26,857,842.00	
	NWS HOLDINGS LTD	135,500	12.24	1,658,520.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	13.34	1,427,380.00	
	MTR CORP	139,500	38.25	5,335,875.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	128,000	30.50	3,904,000.00	
	LI & FUNG LTD	563,600	4.56	2,570,016.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	75,000	26.80	2,010,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	223,000	29.65	6,611,950.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	78,000	11.70	912,600.00	
	SANDS CHINA LTD	234,800	31.75	7,454,900.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	108,333	8.97	971,747.01	
	SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	5.51	914,660.00	
	WYNN MACAU LTD	168,400	12.10	2,037,640.00	
	WH GROUP LIMITED	590,000	5.62	3,315,800.00	
	BANK OF EAST ASIA	120,860	29.00	3,504,940.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	363,500	22.85	8,305,975.00	
	HANG SENG BANK	73,000	136.00	9,928,000.00	
	FIRST PACIFIC CO	226,000	5.69	1,285,940.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING	110,200	186.30	20,530,260.00	

	LTD				
	AIA GROUP LTD	1,162,400	43.90	51,029,360.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	263,540	50.30	13,256,062.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	14.72	3,135,360.00	
	HENDERSON LAND	111,017	48.55	5,389,875.35	
	HYSAN DEVELOPMENT	65,000	32.85	2,135,250.00	
	KERRY PROPERTIES	57,000	21.05	1,199,850.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	516,666	7.48	3,864,661.68	
	SINO LAND CO.LTD	286,000	12.38	3,540,680.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	168,000	95.70	16,077,600.00	
	SWIRE PACIFIC-A	58,500	82.55	4,829,175.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	21.15	2,470,320.00	
	WHARF(HOLDING)	133,000	42.75	5,685,750.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	87,000	34.10	2,966,700.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	61.50	1,346,850.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	259,600	10.70	2,777,720.00	
	PCCW LTD	386,000	5.02	1,937,720.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	60,000	75.80	4,548,000.00	
	CLP HLDGS	185,500	70.00	12,985,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	135,000	79.20	10,692,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	662,554	14.44	9,567,279.76	
小計	銘柄数：39			268,973,258.80	
				(3,908,181,450)	
	組入時価比率：1.2%			1.3%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	141,000	3.22	454,020.00	
	KEPPEL CORP.	142,700	5.97	851,919.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	99,040	3.08	305,043.20	
	SEMBCORP MARINE	72,600	1.68	121,968.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	163,000	0.98	160,555.00	
	NOBLE GROUP LTD	412,481	0.46	191,803.66	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	55,040	11.47	631,308.80	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	207,000	2.95	610,650.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	614,600	0.84	519,337.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	151,000	4.07	614,570.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	11,800	40.90	482,620.00	

	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	615,320	0.42	261,511.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	184,000	3.40	625,600.00	
	DBS GROUP HLDGS	171,000	15.49	2,648,790.00	
	OCBC-ORD	297,500	8.95	2,662,625.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	125,500	19.05	2,390,775.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	7.90	608,300.00	
	CAPITALAND LIMITED	246,000	3.11	765,060.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	8.22	304,140.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	294,000	1.95	574,770.00	
	UOL GROUP LIMITED	48,700	6.05	294,635.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	770,000	3.85	2,964,500.00	
	STARHUB LTD	53,000	3.31	175,430.00	
	小計 銘柄数：23			19,219,930.66	
				(1,601,212,423)	
				0.5%	
	組入時価比率：0.5%				
新シケル	DELEK GROUP LTD	470	621.00	291,870.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	44,000	16.50	726,000.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	88,100	205.80	18,130,980.00	
	BANK HAPOALIM BM	102,000	19.69	2,008,380.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	138,000	13.56	1,871,280.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,000	43.79	569,270.00	
	AZRIELI GROUP	3,100	148.40	460,040.00	
	NICE SYSTEMS LTD	5,300	246.50	1,306,450.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	186,000	8.65	1,608,900.00	
	小計 銘柄数：9			26,973,170.00	
				(803,261,002)	
				0.3%	
	組入時価比率：0.2%				
合計				309,377,723,661	
				(309,377,723,661)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(平成28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		262,135.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%		262,135.00 (29,537,371) 0.3%	
	合計			29,537,371 (29,537,371)	
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	34,100	630,168.00	
		AMERICAN TOWER CORP	41,000	4,194,710.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	91,000	926,380.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,330	2,517,103.90	
		BOSTON PROPERTIES	14,700	1,862,784.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17,300	440,804.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,300	693,216.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,300	2,807,839.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,000	1,236,620.00	
		DUKE REALTY CORP	34,000	760,580.00	
		EQUINIX INC	6,490	2,129,433.90	
		EQUITY RESIDENTIAL	35,100	2,627,235.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,300	1,463,805.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,000	1,017,610.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,520	1,016,728.80	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	54,400	1,605,344.00	
		HCP INC	45,600	1,479,264.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	73,900	1,216,394.00	
		IRON MOUNTAIN INC	19,000	638,590.00	
		KIMCO REALTY CORP	40,500	1,160,730.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	15,000	500,250.00	
		MACERICH CO /THE	13,300	1,051,232.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,200	730,656.00	
		PROLOGIS INC	50,700	2,214,069.00	
PUBLIC STORAGE	14,240	3,890,510.40			
REALTY INCOME CORP	23,800	1,480,598.00			
REGENCY CENTERS CORP	8,800	660,616.00			
SIMON PROPERTY GROUP INC	29,970	6,165,728.10			

	SL GREEN REALTY CORP	9,800	939,428.00	
	UDR INC	25,700	983,025.00	
	VENTAS INC	31,700	1,995,832.00	
	VEREIT INC	88,000	777,920.00	
	VORNADO REALTY TRUST	16,600	1,559,902.00	
	WELLTOWER INC	34,500	2,376,360.00	
	WEYERHAEUSER CO	76,000	2,359,800.00	
小計	銘柄数：35	1,044,150	58,111,266.10	
			(6,547,977,464)	
	組入時価比率：2.0%		74.4%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	282,472.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,400	383,040.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	235,083.00	
小計	銘柄数：3	34,900	900,595.00	
			(78,162,640)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	3,100	259,067.00	
	GECINA SA	3,400	407,320.00	
	ICADE	3,000	203,550.00	
	KLEPIERRE	21,200	891,566.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	9,600	2,352,000.00	
小計	銘柄数：5	40,300	4,113,503.00	
			(525,294,333)	
	組入時価比率：0.2%		6.0%	
英ポンド	BRITISH LAND	94,000	666,460.00	
	HAMMERSON PLC	73,000	420,845.00	
	INTU PROPERTIES PLC	88,000	277,816.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,500	843,975.00	
	SEGRO PLC	70,000	288,330.00	
小計	銘柄数：5	402,500	2,497,426.00	
			(404,383,217)	
	組入時価比率：0.1%		4.6%	
豪ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	92,000	723,120.00	
	GOODMAN GROUP	174,000	1,160,580.00	
	GPT GROUP	179,000	887,840.00	

	LENLEASE GROUP	53,000	723,450.00	
	MIRVAC GROUP	350,000	663,250.00	
	SCENTRE GROUP	513,000	2,252,070.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	230,000	959,100.00	
	VICINITY CENTRES	328,704	1,035,417.60	
	WESTFIELD CORP	193,000	1,935,790.00	
小計	銘柄数：9	2,112,704	10,340,617.60	(891,878,268)
	組入時価比率：0.3%			10.1%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,827,800.00	
	LINK REIT	219,000	10,161,600.00	
小計	銘柄数：2	479,000	11,989,400.00	(174,205,982)
	組入時価比率：0.1%			2.0%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	213,000	513,330.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	192,000	288,000.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	249,900	529,788.00	
	SUNTEC REIT	243,000	413,100.00	
小計	銘柄数：4	897,900	1,744,218.00	(145,310,801)
	組入時価比率：0.0%			1.7%
合計			8,767,212,705	(8,767,212,705)
合計			8,796,750,076	(8,796,750,076)

(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28年 3月31日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
		うち1年超	
市場取引			
株価指数先物取引			

買建	7,906,072,014	-	8,010,275,800	104,203,786
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,795,276,207	-	1,784,502,000	10,774,207
米ドル	1,488,133,800	-	1,475,977,000	12,156,800
カナダドル	77,413,680	-	78,102,000	688,320
ユーロ	25,423,008	-	25,538,000	114,992
英ポンド	113,104,754	-	113,337,000	232,246
豪ドル	59,964,485	-	60,368,000	403,515
香港ドル	14,645,300	-	14,520,000	125,300
シンガポールドル	16,591,180	-	16,660,000	68,820
売建	135,581,070	-	136,100,800	519,730
米ドル	94,405,920	-	94,642,800	236,880
スウェーデンクローナ	9,599,800	-	9,695,000	95,200
デンマーククローネ	22,989,150	-	23,139,000	149,850
豪ドル	8,586,200	-	8,624,000	37,800
合計	-	-	-	92,909,849

(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28年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,683,428,326
コール・ローン	1,594,619,455
国債証券	513,500,283,410
地方債証券	51,844,038,015
特殊債券	57,388,085,432
社債券	30,007,290,360
未収入金	4,413,142,000
未収利息	933,136,963
前払費用	17,746,584
流動資産合計	661,381,770,545
資産合計	661,381,770,545
負債の部	
流動負債	
未払金	4,860,451,000
未払解約金	347,098,499
流動負債合計	5,207,549,499
負債合計	5,207,549,499
純資産の部	
元本等	
元本	499,328,368,105
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	156,845,852,941
元本等合計	656,174,221,046
純資産合計	656,174,221,046
負債純資産合計	661,381,770,545

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28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	1.3141円
(10,000口当たり純資産額)	(13,141円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 4月 1日 至 平成28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、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 2em;">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 style="padding-left: 2em;">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 style="padding-left: 2em;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成28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>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 3月31日現在	平成27年 4月 1日
期首	平成27年 4月 1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	409,123,668,357円
同期中における追加設定元本額	151,219,224,028円
同期中における一部解約元本額	61,014,524,280円
期末元本額	499,328,368,105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	377,862,948円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	17,103,965,956円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	20,341,613,648円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,467,077,615円
野村資産設計ファンド2015	576,739,255円
野村資産設計ファンド2020	300,947,479円
野村資産設計ファンド2025	218,599,237円
野村資産設計ファンド2030	133,466,947円
野村資産設計ファンド2035	68,867,435円
野村資産設計ファンド2040	144,739,944円
野村日本債券インデックスファンド	1,533,778,935円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	257,355,915,371円
のむらップ・ファンド（保守型）	8,061,849,345円
のむらップ・ファンド（普通型）	3,815,857,484円
のむらップ・ファンド（積極型）	652,247,723円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	19,402,351,182円
野村資産設計ファンド2045	10,415,763円
野村円債投資インデックスファンド	2,165,237,315円
野村インデックスファンド・国内債券	1,029,608,785円
マイ・ロード	31,707,712,951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	199,563,693円
野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）	69,806,739円
野村時間分散投資「日経225・国内債券」（限定追加型）	57,939,129円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	5,160,757,118円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,213,125,530円
野村資産設計ファンド2050	4,120,111円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,088,274,716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）	267,776,780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）	12,002,420,432円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,759,637,564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）	50,780,046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）	40,708,691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）	7,456,607円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,122,542,529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）	385,219,500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）	2,100,614,826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）	930,532,673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）	200,267,970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）	390,921,439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）	864,885,912円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,865,378,971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）	703,855,387円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	591,348,261円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	11,247,122,561円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	16,227,290,363円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	7,198,327,532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）	40,965,636,773円

マイバランスDC30	6,155,245,875円
マイバランスDC50	3,888,091,478円
マイバランスDC70	1,171,516,090円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	7,890,219,800円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	36,513,751円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	691,244円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	922,696円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 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28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359回	300,000,000	301,557,000	
		国庫債券 利付(2年)第360回	4,200,000,000	4,223,268,000	
		国庫債券 利付(2年)第362回	1,200,000,000	1,207,380,000	
		国庫債券 利付(5年)第105回	4,500,000,000	4,521,285,000	
		国庫債券 利付(5年)第106回	5,600,000,000	5,632,424,000	
		国庫債券 利付(5年)第107回	3,800,000,000	3,826,106,000	
		国庫債券 利付(5年)第108回	1,800,000,000	1,809,270,000	
		国庫債券 利付(5年)第109回	2,800,000,000	2,817,332,000	
		国庫債券 利付(5年)第110回	1,000,000,000	1,010,130,000	
		国庫債券 利付(5年)第111回	1,400,000,000	1,416,926,000	
		国庫債券 利付(5年)第112回	2,200,000,000	2,230,536,000	
		国庫債券 利付(5年)第113回	7,000,000,000	7,081,620,000	
		国庫債券 利付(5年)第114回	1,500,000,000	1,519,500,000	
		国庫債券 利付(5年)第115回	7,300,000,000	7,376,796,000	
		国庫債券 利付(5年)第116回	8,100,000,000	8,195,013,000	
		国庫債券 利付(5年)第117回	5,900,000,000	5,975,579,000	
国庫債券 利付(5年)第118回	5,000,000,000	5,068,700,000			

国庫債券 利付(5年)第119回	4,000,000,000	4,042,040,000	
国庫債券 利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,579,585,000	
国庫債券 利付(5年)第121回	3,500,000,000	3,538,465,000	
国庫債券 利付(5年)第122回	7,800,000,000	7,890,402,000	
国庫債券 利付(5年)第123回	7,300,000,000	7,388,841,000	
国庫債券 利付(5年)第124回	8,100,000,000	8,203,194,000	
国庫債券 利付(5年)第125回	8,200,000,000	8,308,896,000	
国庫債券 利付(5年)第126回	4,500,000,000	4,562,010,000	
国庫債券 利付(5年)第127回	1,000,000,000	1,014,510,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	2,960,000,000	4,540,995,200	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,338,606,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,348,065,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,100,000,000	1,658,932,000	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,743,300,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,856,153,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,914,598,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,600,000,000	2,029,824,000	
国庫債券 利付(10年)第288回	1,850,000,000	1,901,430,000	
国庫債券 利付(10年)第289回	2,000,000,000	2,058,580,000	
国庫債券 利付(10年)第290回	1,250,000,000	1,289,450,000	
国庫債券 利付(10年)第291回	1,400,000,000	1,441,440,000	
国庫債券 利付(10年)第292回	1,600,000,000	1,659,936,000	
国庫債券 利付(10年)第293回	750,000,000	783,652,500	
国庫債券 利付(10年)第294回	500,000,000	521,325,000	
国庫債券 利付(10年)第295回	1,600,000,000	1,661,136,000	
国庫債券 利付(10年)第297回	1,100,000,000	1,148,774,000	
国庫債券 利付(10年)第298回	1,500,000,000	1,562,415,000	
国庫債券 利付(10年)第299回	1,400,000,000	1,463,588,000	
国庫債券 利付(10年)第300回	1,000,000,000	1,051,380,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第301回	1,500,000,000	1,583,430,000	
国庫債券 利付(10年)第302回	700,000,000	736,666,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	3,300,000,000	3,485,328,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,052,670,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,331,609,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,192,180,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,802,102,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,808,290,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,165,600,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,898,172,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,880,208,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,277,145,500	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,437,824,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,341,482,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	2,600,000,000	2,790,918,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,495,438,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,928,700,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,411,136,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,988,380,000	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,741,605,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,430,528,000	

国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,558,424,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,885,868,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,400,160,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,900,000,000	5,217,373,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,226,315,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,800,000,000	4,054,372,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,500,000,000	5,802,280,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,675,293,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	4,800,000,000	5,149,968,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	2,009,820,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	6,400,000,000	6,777,152,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	5,500,000,000	5,829,890,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,350,182,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	4,700,000,000	4,951,215,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,700,000,000	2,846,124,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,835,124,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	4,900,000,000	5,123,783,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,900,000,000	6,168,509,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	6,000,000,000	6,274,560,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	5,900,000,000	6,110,453,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	1,300,000,000	1,319,513,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	136,047,000	

国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	262,624,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	208,449,600	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,256,112,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	195,046,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	935,529,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	796,212,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	124,955,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	76,991,200	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	283,877,500	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	197,467,200	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	286,662,200	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	373,227,100	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,086,280,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,239,750,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,262,736,600	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,636,332,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	2,021,835,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,159,664,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,900,000,000	2,637,143,000	
国庫債券 利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,892,940,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	835,200,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	840,000,000	1,170,943,200	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	978,047,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	680,410,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,175,329,000	
国庫債券 利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,184,740,500	
国庫債券 利付(30年)第28回	700,000,000	990,731,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	800,000,000	1,121,680,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	900,000,000	1,249,065,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,000,000,000	1,372,840,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,663,059,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	2,000,000,000	2,680,180,000	
国庫債券 利付(30年)第34回	2,300,000,000	3,199,553,000	
国庫債券 利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,107,323,000	
国庫債券 利付(30年)第36回	1,800,000,000	2,442,816,000	
国庫債券 利付(30年)第37回	2,100,000,000	2,810,073,000	

国庫債券 利付(30年)第38回	1,400,000,000	1,845,522,000	
国庫債券 利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,154,576,000	
国庫債券 利付(30年)第40回	1,100,000,000	1,455,850,000	
国庫債券 利付(30年)第41回	1,000,000,000	1,299,980,000	
国庫債券 利付(30年)第42回	1,200,000,000	1,560,876,000	
国庫債券 利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,694,056,000	
国庫債券 利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,827,700,000	
国庫債券 利付(30年)第45回	1,900,000,000	2,383,018,000	
国庫債券 利付(30年)第46回	1,300,000,000	1,632,969,000	
国庫債券 利付(30年)第47回	1,900,000,000	2,438,916,000	
国庫債券 利付(30年)第48回	1,400,000,000	1,723,554,000	
国庫債券 利付(30年)第49回	1,400,000,000	1,725,948,000	
国庫債券 利付(30年)第50回	300,000,000	320,940,000	
国庫債券 利付(20年)第36回	380,000,000	397,841,000	
国庫債券 利付(20年)第37回	320,000,000	335,494,400	
国庫債券 利付(20年)第38回	170,000,000	179,712,100	
国庫債券 利付(20年)第39回	511,000,000	539,186,760	
国庫債券 利付(20年)第40回	525,000,000	557,555,250	
国庫債券 利付(20年)第41回	255,000,000	267,982,050	
国庫債券 利付(20年)第42回	683,000,000	740,030,500	
国庫債券 利付(20年)第43回	400,000,000	443,240,000	
国庫債券 利付(20年)第44回	150,000,000	166,095,000	
国庫債券 利付(20年)第45回	242,000,000	267,001,020	
国庫債券 利付(20年)第46回	90,000,000	99,079,200	
国庫債券 利付(20年)第47回	1,230,000,000	1,362,089,700	
国庫債券 利付(20年)第48回	200,000,000	225,488,000	
国庫債券 利付(20年)第49回	200,000,000	222,840,000	
国庫債券 利付(20年)第50回	183,000,000	202,066,770	
国庫債券 利付(20年)第51回	310,000,000	345,656,200	
国庫債券 利付(20年)第52回	100,000,000	112,616,000	
国庫債券 利付(20年)第53回	250,000,000	282,980,000	
国庫債券 利付(20年)第54回	250,000,000	284,422,500	
国庫債券 利付(20年)第55回	231,000,000	261,425,010	
国庫債券 利付(20年)第56回	120,000,000	136,430,400	
国庫債券 利付(20年)第57回	210,000,000	237,434,400	
国庫債券 利付(20年)第58回	180,000,000	204,415,200	

国庫債券	利付（20年）第59回	230,000,000	259,377,900
国庫債券	利付（20年）第60回	780,000,000	863,733,000
国庫債券	利付（20年）第61回	300,000,000	324,831,000
国庫債券	利付（20年）第62回	440,000,000	471,156,400
国庫債券	利付（20年）第63回	300,000,000	343,020,000
国庫債券	利付（20年）第64回	400,000,000	462,236,000
国庫債券	利付（20年）第65回	455,000,000	527,777,250
国庫債券	利付（20年）第66回	300,000,000	345,645,000
国庫債券	利付（20年）第67回	310,000,000	360,898,900
国庫債券	利付（20年）第68回	290,000,000	344,615,700
国庫債券	利付（20年）第69回	560,000,000	660,956,800
国庫債券	利付（20年）第70回	540,000,000	653,383,800
国庫債券	利付（20年）第71回	200,000,000	238,674,000
国庫債券	利付（20年）第72回	670,000,000	797,166,000
国庫債券	利付（20年）第73回	1,600,000,000	1,896,960,000
国庫債券	利付（20年）第74回	1,300,000,000	1,552,044,000
国庫債券	利付（20年）第75回	600,000,000	718,998,000
国庫債券	利付（20年）第76回	910,000,000	1,074,036,600
国庫債券	利付（20年）第77回	700,000,000	832,510,000
国庫債券	利付（20年）第78回	800,000,000	947,424,000
国庫債券	利付（20年）第79回	860,000,000	1,026,461,600
国庫債券	利付（20年）第80回	900,000,000	1,082,556,000
国庫債券	利付（20年）第81回	360,000,000	430,988,400
国庫債券	利付（20年）第82回	820,000,000	989,502,200
国庫債券	利付（20年）第83回	1,370,000,000	1,659,083,700
国庫債券	利付（20年）第84回	1,200,000,000	1,441,488,000
国庫債券	利付（20年）第85回	400,000,000	485,832,000
国庫債券	利付（20年）第86回	1,400,000,000	1,728,412,000
国庫債券	利付（20年）第87回	500,000,000	612,290,000
国庫債券	利付（20年）第88回	1,100,000,000	1,363,208,000
国庫債券	利付（20年）第89回	470,000,000	577,644,100
国庫債券	利付（20年）第90回	1,500,000,000	1,850,115,000
国庫債券	利付（20年）第91回	250,000,000	310,975,000
国庫債券	利付（20年）第92回	1,550,000,000	1,901,741,500
国庫債券	利付（20年）第93回	300,000,000	366,153,000
国庫債券	利付（20年）第94回	200,000,000	246,296,000

国庫債券 利付(20年)第95回	700,000,000	880,495,000	
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	494,172,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	1,300,000,000	1,625,975,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	371,790,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,610,384,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,913,041,600	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	320,602,500	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	643,385,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	764,772,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	500,128,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,382,410,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	506,516,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	377,208,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,972,656,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,111,509,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,386,770,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	1,021,712,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,275,326,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	1,800,000,000	2,281,248,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	2,500,000,000	3,176,325,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	642,030,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,416,052,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,900,000,000	2,419,802,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	630,900,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	987,096,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	964,760,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	2,000,000,000	2,500,760,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,359,809,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	2,300,000,000	2,947,703,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,266,300,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	1,700,000,000	2,208,249,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,269,730,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	800,000,000	1,004,088,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,500,000,000	1,886,160,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	500,000,000	621,305,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,800,000,000	2,240,370,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	983,672,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,599,481,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,743,882,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	900,000,000	1,122,696,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	400,000,000	492,788,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	850,899,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,232,620,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	960,280,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	851,200,000	

	国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,836,291,000	
	国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	2,097,103,000	
	国庫債券 利付(20年)第142回	1,250,000,000	1,562,062,500	
	国庫債券 利付(20年)第143回	1,700,000,000	2,070,005,000	
	国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,802,100,000	
	国庫債券 利付(20年)第145回	2,600,000,000	3,211,468,000	
	国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,964,912,000	
	国庫債券 利付(20年)第147回	2,700,000,000	3,293,082,000	
	国庫債券 利付(20年)第148回	2,500,000,000	3,006,100,000	
	国庫債券 利付(20年)第149回	2,600,000,000	3,125,252,000	
	国庫債券 利付(20年)第150回	2,930,000,000	3,469,530,200	
	国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,097,602,000	
	国庫債券 利付(20年)第152回	3,400,000,000	3,899,936,000	
	国庫債券 利付(20年)第153回	3,450,000,000	4,018,249,500	
	国庫債券 利付(20年)第154回	3,500,000,000	4,009,215,000	
	国庫債券 利付(20年)第155回	2,300,000,000	2,547,480,000	
	国庫債券 利付(20年)第156回	1,000,000,000	992,660,000	
	ポーランド共和国 第12回円貨債券(2012)	100,000,000	101,104,000	
	ポーランド共和国 第15回円貨債券(2013)	100,000,000	101,292,000	
小計	銘柄数:261 組入時価比率:78.3%	455,315,000,000	513,500,283,410 78.7%	
合計			513,500,283,410	
地方債証券	日本円 東京都 公募第648回	300,000,000	306,537,000	

東京都	公募第655回	100,000,000	102,686,000	
東京都	公募第659回	300,000,000	310,521,000	
東京都	公募第660回	100,000,000	103,418,000	
東京都	公募第664回	100,000,000	103,699,000	
東京都	公募第668回	200,000,000	208,864,000	
東京都	公募第671回	100,000,000	104,421,000	
東京都	公募第685回	100,000,000	104,546,000	
東京都	公募第690回	200,000,000	211,622,000	
東京都	公募第703回	100,000,000	105,356,000	
東京都	公募第707回	100,000,000	104,867,000	
東京都	公募第708回	100,000,000	105,239,000	
東京都	公募第710回	100,000,000	104,742,000	
東京都	公募第712回	100,000,000	104,571,000	
東京都	公募第715回	100,000,000	104,644,000	
東京都	公募第716回	200,000,000	209,422,000	
東京都	公募(30年)第7回	100,000,000	137,100,000	
東京都	公募第10回	200,000,000	268,402,000	
東京都	公募(7年)第1回	300,000,000	302,343,000	
東京都	公募(7年)第3回	100,000,000	101,370,000	
東京都	公募第1回	300,000,000	331,335,000	
東京都	公募第7回	100,000,000	119,523,000	
東京都	公募(20年)第16回	200,000,000	245,972,000	
東京都	公募(20年)第17回	200,000,000	247,970,000	
東京都	公募第23回	100,000,000	126,553,000	
東京都	公募(20年)第26回	300,000,000	365,193,000	
北海道	公募平成19年度第2回	500,000,000	509,910,000	
北海道	公募平成19年度第4回	100,000,000	102,308,000	
北海道	公募平成20年度第7回	300,000,000	312,324,000	
北海道	公募平成21年度第6回	100,000,000	105,137,000	
北海道	公募平成21年度第10回	100,000,000	105,142,000	
北海道	公募平成24年度第6回	100,000,000	104,619,000	
北海道	公募平成24年度第9回	100,000,000	104,370,000	
北海道	公募平成25年度第1回	300,000,000	309,657,000	
北海道	公募(5年)平成25年度 第8回	100,000,000	100,606,000	
北海道	公募(5年)平成26年度 第8回	200,000,000	200,604,000	

北海道 公募(5年)平成26年度 第10回	100,000,000	100,204,000	
宮城県 公募(5年)第9回1号	500,000,000	503,715,000	
神奈川県 公募第155回	100,000,000	103,462,000	
神奈川県 公募第156回	101,000,000	105,083,430	
神奈川県 公募第184回	100,000,000	105,070,000	
神奈川県 公募第188回	200,000,000	211,950,000	
神奈川県 公募第196回	100,000,000	104,216,000	
神奈川県 公募第200回	100,000,000	105,571,000	
神奈川県 公募第205回	100,000,000	104,573,000	
神奈川県 公募第206回	100,000,000	104,637,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	206,224,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	137,479,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	368,364,000	
神奈川県 公募(5年)第56回	100,000,000	100,452,000	
大阪府 公募第303回	300,000,000	306,666,000	
大阪府 公募第304回	150,000,000	153,673,500	
大阪府 公募第320回	400,000,000	418,516,000	
大阪府 公募第337回	200,000,000	210,732,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	105,298,000	
大阪府 公募第356回	100,000,000	105,507,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	108,743,440	
大阪府 公募第384回	100,000,000	104,605,000	
大阪府 公募第387回	300,000,000	310,500,000	
大阪府 公募第5回	100,000,000	125,430,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	121,789,000	
大阪府 公募第98回	200,000,000	201,040,000	
大阪府 公募(5年)第99回	240,000,000	240,921,600	
大阪府 公募(5年)第101回	148,000,000	148,520,960	
大阪府 公募第102回	100,000,000	100,339,000	
京都府 公募平成19年度第1回	100,000,000	102,598,000	
京都府 公募平成20年度第3回	140,000,000	145,800,200	
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	105,297,000	
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	104,758,000	
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	117,034,000	
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	208,124,000	

兵庫県	公募平成19年度第2回	100,000,000	101,898,000	
兵庫県	公募平成20年度第3回	100,000,000	103,571,000	
兵庫県	公募平成20年度第12回	100,000,000	104,618,000	
兵庫県	公募平成20年度第16回	100,000,000	104,250,000	
兵庫県	公募平成21年度第13回	100,000,000	104,560,000	
兵庫県	公募平成21年度第25回	100,000,000	105,241,000	
兵庫県	公募平成22年度第1回	100,000,000	105,448,000	
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	134,323,000	
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	346,365,000	
兵庫県	公募(15年)第3回	100,000,000	113,054,000	
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	311,931,000	
兵庫県	公募第2回	100,000,000	124,747,000	
兵庫県	公募第9回	100,000,000	125,701,000	
静岡県	公募平成19年度第1回	100,000,000	101,979,000	
静岡県	公募平成19年度第4回	200,000,000	205,330,000	
静岡県	公募平成19年度第7回	100,000,000	102,906,000	
静岡県	公募平成21年度第2回	100,000,000	105,166,000	
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	105,453,000	
静岡県	公募(5年)平成24年度 第8回	100,000,000	100,295,000	
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	104,219,000	
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	172,924,950	
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	104,026,000	
静岡県	公募平成26年度第9回	100,000,000	103,978,000	
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	122,066,000	
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	121,669,000	
愛知県	公募平成19年度第3回	111,000,000	113,818,290	
愛知県	公募平成19年度第4回	100,000,000	102,828,000	
愛知県	公募平成20年度第7回	210,000,000	217,982,100	
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	122,899,000	
愛知県	公募平成20年度第10回	100,000,000	104,297,000	
愛知県	公募平成21年度第3回	114,000,000	119,930,280	
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	105,284,000	
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	105,436,000	
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	104,906,000	
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	105,666,000	

愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	105,672,000
愛知県	公募(5年)平成24年度第6回	1,100,000,000	1,102,046,000
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	453,476,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	123,107,000
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	126,975,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	115,130,000
広島県	公募平成20年度第3回	300,000,000	311,742,000
広島県	公募平成22年度第6回	200,000,000	211,536,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	104,900,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	210,792,000
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	300,000,000	301,572,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	112,012,957
埼玉県	公募平成19年度第7回	200,000,000	206,074,000
埼玉県	公募平成20年度第1回	100,000,000	103,085,000
埼玉県	公募平成21年度第5回	100,000,000	104,751,000
埼玉県	公募平成22年度第2回	200,000,000	210,908,000
埼玉県	公募平成24年度第4回	100,000,000	104,924,000
埼玉県	公募(5年)平成24年度第8回	200,000,000	200,484,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	106,112,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	156,057,120
埼玉県	公募(5年)平成25年度第7回	100,000,000	100,578,000
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	104,672,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	104,513,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	207,886,000
福岡県	公募平成19年度第6回	100,000,000	102,452,000
福岡県	公募平成19年度第8回	100,000,000	102,702,000
福岡県	公募平成20年度第3回	100,000,000	103,463,000
福岡県	公募平成22年度第5回	100,000,000	104,008,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	105,414,000
福岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	100,246,000
福岡県	公募平成26年度第4回	100,000,000	100,313,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	114,534,000
福岡県	公募(30年)平成19年	100,000,000	137,985,000

度第1回			
福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	127,284,000	
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	123,177,000	
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	119,990,000	
千葉県 公募平成20年度第1回	100,000,000	103,089,000	
千葉県 公募平成20年度第6回	200,000,000	208,238,000	
千葉県 公募平成21年度第1回	100,000,000	104,532,000	
千葉県 公募平成21年度第11回	180,000,000	189,397,800	
千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	106,079,000	
千葉県 公募平成24年度第2回	100,000,000	105,269,000	
千葉県 公募平成24年度第4回	100,000,000	100,238,000	
千葉県 公募平成24年度第8回	100,000,000	105,245,000	
千葉県 公募平成25年度第2回	900,000,000	904,050,000	
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	105,817,000	
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	126,367,000	
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	116,073,000	
新潟県 公募平成20年度第2回	200,000,000	208,670,000	
新潟県 公募平成21年度第2回	150,000,000	158,283,000	
長野県 公募平成25年度第1回	1,100,000,000	1,106,435,000	
群馬県 公募第8回	100,000,000	105,466,000	
群馬県 公募(5年)第4回	600,000,000	603,162,000	
岐阜県 公募平成19年度第1回	190,000,000	195,432,100	
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	193,875,462	
共同発行市場地方債 公募第51回	100,000,000	102,281,000	
共同発行市場地方債 公募第56回	400,000,000	410,884,000	
共同発行市場地方債 公募第58回	270,500,000	278,003,670	
共同発行市場地方債 公募第62回	100,000,000	103,642,000	
共同発行市場地方債 公募第63回	100,000,000	104,110,000	
共同発行市場地方債 公募第64回	262,000,000	272,584,800	
共同発行市場地方債 公募第65回	700,000,000	726,768,000	
共同発行市場地方債 公募第66回	181,000,000	187,858,090	
共同発行市場地方債 公募第68回	900,000,000	939,375,000	
共同発行市場地方債 公募第70回	110,000,000	114,271,300	
共同発行市場地方債 公募第74回	500,000,000	523,960,000	

共同発行市場地方債	公募第75回	310,000,000	325,965,000	
共同発行市場地方債	公募第82回	300,000,000	315,600,000	
共同発行市場地方債	公募第84回	500,000,000	526,215,000	
共同発行市場地方債	公募第85回	100,000,000	105,630,000	
共同発行市場地方債	公募第88回	100,000,000	104,813,000	
共同発行市場地方債	公募第89回	100,000,000	104,331,000	
共同発行市場地方債	公募第92回	110,000,000	114,977,500	
共同発行市場地方債	公募第93回	300,000,000	316,935,000	
共同発行市場地方債	公募第94回	300,000,000	317,091,000	
共同発行市場地方債	公募第96回	100,000,000	106,135,000	
共同発行市場地方債	公募第101回	300,000,000	315,990,000	
共同発行市場地方債	公募第102回	150,000,000	157,962,000	
共同発行市場地方債	公募第103回	100,000,000	105,223,000	
共同発行市場地方債	公募第108回	200,000,000	211,302,000	
共同発行市場地方債	公募第110回	200,000,000	210,358,000	
共同発行市場地方債	公募第111回	200,000,000	210,492,000	
共同発行市場地方債	公募第113回	200,000,000	209,128,000	
共同発行市場地方債	公募第115回	100,000,000	104,835,000	
共同発行市場地方債	公募第116回	200,000,000	209,726,000	
共同発行市場地方債	公募第118回	100,000,000	105,209,000	
共同発行市場地方債	公募第119回	200,000,000	210,046,000	
共同発行市場地方債	公募第120回	300,000,000	312,708,000	
共同発行市場地方債	公募第121回	100,000,000	103,475,000	
共同発行市場地方債	公募第122回	100,000,000	103,907,000	
共同発行市場地方債	公募第124回	100,000,000	106,073,000	
共同発行市場地方債	公募第126回	100,000,000	105,510,000	

回			
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	313,467,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	105,324,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	104,592,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	208,670,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	208,088,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	161,105,450	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	557,479,800	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	123,754,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	122,553,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	104,785,000	
島根県 公募平成25年度第3回	700,000,000	703,710,000	
福島県 公募平成24年度第2回	100,000,000	100,238,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	206,940,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	104,341,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	146,927,400	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	104,341,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	244,773,716	
大阪市 公募平成20年度第3回	110,000,000	114,495,700	
大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	105,486,000	
大阪市 公募平成25年度第1回	800,000,000	805,840,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	104,585,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	116,353,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	127,473,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	124,626,000	
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	120,692,000	
名古屋市 公募第460回	200,000,000	204,964,000	
名古屋市 公募第464回	300,000,000	311,712,000	
名古屋市 公募第469回	100,000,000	104,792,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	106,021,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	313,182,000	

名古屋市 公募(6年)第1回	200,000,000	201,010,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	217,242,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	108,724,000	
京都市 公募平成19年度第2回	300,000,000	308,661,000	
京都市 公募平成19年度第4回	190,000,000	195,614,500	
京都市 公募平成20年度第4回	200,000,000	208,600,000	
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	105,776,000	
京都市 公募平成25年度第3回	100,000,000	100,675,000	
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	119,147,000	
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	114,482,000	
神戸市 公募平成21年度第7回	100,000,000	105,257,000	
横浜市 公募平成20年度第3回	100,000,000	103,713,000	
横浜市 公募公債平成20年度5回	200,000,000	208,320,000	
横浜市 公募平成21年度第4回	200,000,000	208,976,000	
横浜市 公募平成22年度第5回	100,000,000	105,645,000	
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	209,628,000	
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	208,200,000	
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	208,720,000	
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	206,646,000	
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	115,421,000	
札幌市 公募平成19年度第3回	100,000,000	102,533,000	
札幌市 公募平成22年度第4回	100,000,000	104,187,000	
札幌市 公募(5年)平成24年度第8回	200,000,000	200,444,000	
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	103,704,000	
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	205,860,000	
川崎市 公募第81回	100,000,000	104,536,000	
川崎市 公募第82回	100,000,000	105,115,000	
川崎市 公募第85回	100,000,000	104,341,000	
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	118,312,000	
川崎市 公募第32回	150,000,000	150,301,500	
北九州市 公募(5年)平成25年度第2回	100,000,000	100,707,000	
北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	121,210,000	
福岡市 公募平成20年度第3回	100,000,000	103,308,000	
福岡市 公募平成24年度第5回	100,000,000	100,241,000	
福岡市 公募(5年)平成25年度	300,000,000	302,226,000	

		第2回			
		福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	117,306,000	
		福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,855,000	
		福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	165,414,400	
		広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	104,838,000	
		仙台市 公募平成25年度第1回	600,000,000	603,174,000	
		千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	105,967,000	
		鹿児島県 公募(5年)平成25年度第1回	100,000,000	100,546,000	
		福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	102,738,000	
		徳島県 公募平成22年度第1回	400,000,000	418,724,000	
		山梨県 公募平成19年度第1回	200,000,000	205,742,000	
		山梨県 公募平成21年度第1回	100,000,000	104,755,000	
		岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	105,408,000	
		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	126,003,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	379,977,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	124,395,000	
		東京都住宅供給公社債券 第5回	200,000,000	205,484,000	
	小計	銘柄数：279 組入時価比率：7.9%	49,021,020,000	51,844,038,015 7.9%	
	合計			51,844,038,015	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	100,000,000	103,095,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	158,151,360	
		新関西国際空港社債 財投機関債第10回	100,000,000	100,156,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	109,100,000	
		原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第2回	200,000,000	200,376,000	
		原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第3回	2,100,000,000	2,103,675,000	
		原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第5回	3,590,000,000	3,591,328,300	
		韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	100,000,000	100,521,000	

日本政策投資銀行債券 政府保証第 18回	100,000,000	102,569,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第 22回	100,000,000	115,351,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第25回	100,000,000	100,470,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第26回	100,000,000	101,696,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第47回	100,000,000	109,149,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 5回	100,000,000	104,129,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 9回	141,000,000	146,924,820	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 10回	100,000,000	100,571,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 16回	102,000,000	106,984,740	
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	213,258,000	
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	135,746,000	
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	244,300,000	
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	247,872,000	
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	306,542,000	
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	104,062,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第39回	100,000,000	125,406,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第47回	100,000,000	126,739,000	
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	210,506,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第89回	100,000,000	119,343,000	
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	104,024,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第103回	350,000,000	416,703,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	121,719,000	

券 財投機関債第105回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第127回	300,000,000	301,332,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第130回	200,000,000	206,972,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第134回	200,000,000	206,468,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第145回	300,000,000	351,783,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第149回	100,000,000	119,436,000	
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	109,007,000	
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	109,175,000	
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	102,798,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第56回	205,000,000	210,746,150	
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	140,897,360	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第60回	283,000,000	294,243,590	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第62回	100,000,000	103,895,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第67回	341,000,000	354,875,290	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第69回	100,000,000	104,190,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第71回	100,000,000	103,745,000	
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	250,242,000	
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	250,478,000	
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	314,421,000	
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	253,508,000	
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	421,176,000	
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	251,352,000	

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	246,338,000	
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	133,216,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	440,000,000	466,479,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	147,512,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	104,944,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	147,012,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	128,360,000	
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	104,925,000	
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	120,116,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	228,331,020	
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	118,861,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	391,917,000	
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	209,816,000	
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	209,576,000	
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	209,034,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	400,000,000	421,004,000	
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	121,626,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	202,562,080	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	415,380,000	
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	211,780,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	287,455,040	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,517,000	

券 政府保証債第 2 0 7 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 1 回	137,000,000	143,412,970	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 3 回	145,000,000	151,675,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 6 回	100,000,000	117,753,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 9 回	100,000,000	117,651,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 2 0 回	100,000,000	104,782,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 2 5 回	190,000,000	197,873,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 3 4 回	100,000,000	103,524,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承 継 財投機関債第 3 3 回	100,000,000	140,059,000	
公営企業債券 政府保証第 8 7 5 回	100,000,000	101,904,000	
公営企業債券 政府保証第 8 8 0 回	131,000,000	134,557,960	
公営企業債券 政府保証第 8 8 1 回	200,000,000	205,316,000	
公営企業債券 政府保証第 8 8 6 回	203,000,000	210,967,750	
公営企業債券 3 0 年第 4 回財投機 関債	100,000,000	141,050,000	
公営企業債券 政府保証 1 5 年第 1 回	300,000,000	319,611,000	
政保 地方公営企業等金融機構債 券 第 2 回	400,000,000	416,552,000	
地方公営企業等金融機構債券 第 1 回	200,000,000	208,674,000	
地方公営企業等金融機構債券(2 0 年) 第 1 回	100,000,000	122,054,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 回	100,000,000	105,189,000	
地方公共団体金融機構債券 第 2 回	100,000,000	104,504,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保 証第 5 回	200,000,000	208,184,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0 年 第 4 回	100,000,000	123,680,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0 年 第 6 回	300,000,000	376,671,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 回	100,000,000	111,056,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 3	200,000,000	210,292,000	

回			
地方公共団体金融機構債券 政府保証第16回	100,000,000	104,202,000	
地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	104,925,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	315,912,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第1回	100,000,000	100,544,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	110,262,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第4回	500,000,000	503,620,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	108,987,000	
地方公共団体金融機構債券 第37回	300,000,000	314,856,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	104,713,000	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	628,674,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	107,447,000	
地方公共団体金融機構債券 F144回	200,000,000	204,530,000	
地方公共団体金融機構債券 F145回	200,000,000	215,996,000	
地方公共団体金融機構債券 第42回	100,000,000	104,806,000	
地方公共団体金融機構債券 第44回	100,000,000	104,844,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	100,000,000	105,151,000	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	109,232,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	106,132,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第10回	300,000,000	303,399,000	
地方公共団体金融機構債券 第51回	300,000,000	316,341,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(4年) 第6回	400,000,000	400,960,000	

地方公共団体金融機構債券 第52回	300,000,000	316,383,000	
地方公共団体金融機構債券(15年) 第2回	200,000,000	221,468,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	121,590,040	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第14回	300,000,000	301,869,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第38回	100,000,000	115,870,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	104,062,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	103,631,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第39回	100,000,000	114,757,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	416,248,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	300,000,000	309,456,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	196,792,470	
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債	100,000,000	109,196,000	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	100,000,000	126,615,000	
公営企業債券 第29回財投機関債	500,000,000	514,845,000	
首都高速道路社債 第12回	100,000,000	100,686,000	
首都高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	104,769,000	
阪神高速道路 第13回	100,000,000	100,447,000	
阪神高速道路債券 政府保証第5回	100,000,000	104,965,000	
日本政策金融公庫債券 政府保証第22回	2,000,000,000	2,011,160,000	
中小企業債券 第6回財投機関債	100,000,000	101,446,000	
都市再生債券 財投機関債第21回	300,000,000	312,567,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	105,578,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	109,019,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	119,044,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	120,000,000	125,718,000	

東京交通債券 第342回	200,000,000	228,750,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	180,625,360	
関西国際空港社債 財投機関債第26回	300,000,000	314,580,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	105,422,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	264,000,000	275,051,040	
預金保険機構債券 政府保証第194回	300,000,000	300,327,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	243,792,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回	200,000,000	207,186,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	115,221,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第25回	300,000,000	313,299,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回	100,000,000	105,387,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	115,855,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	121,896,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	100,000,000	106,272,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	124,305,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	346,365,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	124,189,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	100,000,000	105,551,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	210,850,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	200,000,000	228,880,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	100,000,000	133,305,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	205,906,000	
私学振興債券 財投機関債第7回	300,000,000	307,335,000	

沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	106,022,000	
商工債券 利付第753回い号	100,000,000	100,391,000	
農林債券 利付第745回い号	100,000,000	100,347,000	
農林債券 利付第751回い号	200,000,000	200,848,000	
農林債券 利付第752回い号	100,000,000	100,454,000	
農林債券 利付第756回い号	100,000,000	100,547,000	
農林債券 利付第759回い号	100,000,000	100,864,000	
農林債券 利付第760回い号	100,000,000	100,906,000	
農林債券 利付第761回い号	100,000,000	100,666,000	
農林債券 利付第764回い号	100,000,000	100,837,000	
農林債券 利付第765回い号	300,000,000	302,139,000	
農林債券 利付第767回い号	300,000,000	302,151,000	
農林債券 利付第773回い号	300,000,000	301,803,000	
農林債券 利付第777回い号	300,000,000	301,977,000	
しんきん中金債券 利付第271回	350,000,000	351,256,500	
しんきん中金債券 利付第277回	100,000,000	100,355,000	
しんきん中金債券 利付第284回	100,000,000	100,846,000	
しんきん中金債券 利付第286回	100,000,000	100,807,000	
しんきん中金債券 利付第287回	100,000,000	100,692,000	
しんきん中金債券 利付第290回	100,000,000	100,725,000	
しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	100,511,000	
商工債券 利付(3年)第172回	200,000,000	200,326,000	
商工債券 利付(3年)第174回	200,000,000	200,236,000	
商工債券 利付(3年)第178回	1,000,000,000	1,001,640,000	
商工債券 利付(3年)第181回	500,000,000	501,000,000	
商工債券 利付(3年)第182回	100,000,000	100,188,000	
商工債券 利付(10年)第5回	600,000,000	618,120,000	
あおぞら債券 利付(3年)第71 回	400,000,000	400,636,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	100,000,000	124,607,000	
東日本高速道路 第21回	100,000,000	101,187,000	
東日本高速道路 第26回	100,000,000	100,833,000	
東日本高速道路 第27回	100,000,000	100,650,000	
中日本高速道路債券 政府保証第1 3回	138,000,000	140,608,200	

中日本高速道路債券 政府保証第1 4回	100,000,000	102,258,000	
中日本高速道路債券 財投機関債第 3回	100,000,000	102,777,000	
中日本高速道路社債 第32回	200,000,000	203,036,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	101,682,000	
中日本高速道路社債 第46回	1,500,000,000	1,506,975,000	
中日本高速道路社債 第47回	100,000,000	100,476,000	
中日本高速道路社債 第53回	100,000,000	100,222,000	
西日本高速道路債券 政府保証第8 回	100,000,000	101,890,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	209,770,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	103,829,000	
銀行等保有株式取得機構債券 政府 保証第28回	400,000,000	400,304,000	
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	209,800,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第69回	100,000,000	114,922,000	
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債 券	15,355,000	15,963,825	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫 債券	54,378,000	56,541,156	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫 債券	100,360,000	105,135,128	
貸付債権担保第10回住宅金融公庫 債券	98,118,000	101,019,349	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公 庫債券	61,605,000	65,027,773	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫 債券	82,758,000	89,743,602	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公 庫債券	21,586,000	23,230,853	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫 債券	54,444,000	57,753,650	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫 債券	59,696,000	63,872,332	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫 債券	58,590,000	61,214,832	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫 債券	120,880,000	127,600,928	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫	104,645,000	110,881,842	

債券			
貸付債権担保第4回住宅金融公庫債券	104,128,000	112,995,540	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	59,582,000	63,696,137	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	29,714,000	31,885,499	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	40,277,000	44,039,274	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	137,841,000	149,150,854	
貸付債権担保5種第16回住宅金融支援機構債券	34,882,000	36,419,598	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	144,444,000	153,611,860	
貸付債権担保5種第17回住宅金融支援機構債券	71,678,000	75,042,565	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	205,452,000	221,795,706	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	147,586,000	157,614,468	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	79,442,000	86,968,335	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	200,343,000	217,031,571	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	202,719,000	214,093,563	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	241,647,000	254,618,610	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	237,912,000	252,450,802	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	157,888,000	166,773,936	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	71,226,000	76,438,318	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	145,356,000	155,895,763	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	86,121,000	90,260,836	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	175,622,000	184,194,109	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	83,400,000	87,398,196	

貸付債権担保第 2 2 回住宅金融公庫 債券	42,962,000	45,233,830	
貸付債権担保第 7 0 回住宅金融支援 機構債券	249,375,000	263,716,556	
貸付債権担保第 3 3 回住宅金融支援 機構債券	51,197,000	55,027,047	
貸付債権担保第 3 4 回住宅金融支援 機構債券	52,833,000	56,767,473	
貸付債権担保第 3 5 回住宅金融支援 機構債券	56,282,000	60,360,193	
貸付債権担保第 4 6 回住宅金融支援 機構債券	68,858,000	74,543,605	
貸付債権担保第 5 5 回住宅金融支援 機構債券	157,790,000	168,041,616	
貸付債権担保第 5 6 回住宅金融支援 機構債券	232,569,000	247,751,104	
貸付債権担保第 5 7 回住宅金融支援 機構債券	78,089,000	83,259,272	
貸付債権担保第 7 6 回住宅金融支援 機構債券	164,612,000	173,769,365	
貸付債権担保 S 種第 3 回住宅金融公 庫債券	20,001,000	21,141,857	
貸付債権担保 S 種第 1 4 回住宅金融 支援機構債券	162,515,000	169,373,133	
貸付債権担保 S 種第 1 5 回住宅金融 支援機構債券	65,500,000	68,137,030	
貸付債権担保第 1 回住宅金融公庫債 券	26,764,000	27,495,727	
貸付債権担保第 7 回住宅金融公庫債 券	56,040,000	57,728,485	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援 機構債券	319,935,000	338,891,148	
貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援 機構債券	157,388,000	167,548,969	
貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援 機構債券	248,352,000	261,089,974	
貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援 機構債券	171,884,000	182,692,065	
貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援 機構債券	163,626,000	173,232,482	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援 機構債券	92,847,000	96,612,874	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援	93,619,000	97,569,721	

		機構債券			
		貸付債権担保第9 0回住宅金融支援 機構債券	93,649,000	97,107,457	
		貸付債権担保第9 2回住宅金融支援 機構債券	189,946,000	195,243,593	
		貸付債権担保第9 3回住宅金融支援 機構債券	190,318,000	193,730,401	
		貸付債権担保第9 4回住宅金融支援 機構債券	95,846,000	98,973,454	
		貸付債権担保第9 6回住宅金融支援 機構債券	96,232,000	98,992,896	
		貸付債権担保第9 7回住宅金融支援 機構債券	289,587,000	299,763,087	
		貸付債権担保第9 8回住宅金融支援 機構債券	292,029,000	303,832,812	
		貸付債権担保第9 9回住宅金融支援 機構債券	195,246,000	202,839,116	
		貸付債権担保第1 0 0回住宅金融支 援機構債券	97,617,000	101,113,640	
	小計	銘柄数：276 組入時価比率：8.7%	54,308,183,000	57,388,085,432	8.8%
	合計			57,388,085,432	
社債券	日本円	ノルデア・バンク 第6回円貨社債 (2014)	100,000,000	100,108,000	
		新韓銀行 第5回円貨社債(201 4)	200,000,000	199,336,000	
		クレディ・アグリコル・エス・ エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	102,281,000	
		ザ・ホンコン・アンド・シャンハ イ・バンキング 第2回円貨社債	200,000,000	200,708,000	
		マラヤン・バンキング・ベルハッ ド 第2回円貨社債(2015)	200,000,000	193,356,000	
		スタンダード・チャータード 第2 回円貨社債(2015)	100,000,000	97,283,000	
		スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債(2015)	100,000,000	91,853,000	
		成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	209,806,000	
		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	108,046,000	
		パークレイズ・バンク・ピーエル シー 第7回円貨社債	100,000,000	99,963,000	

ナショナル・オーストラリア銀行 第11回円貨社債(2015)	200,000,000	200,656,000	
ラボバンク・ネダーランド 第16 回円貨社債(2012)(コー	100,000,000	101,177,000	
ラボバンク・ネダーランド 第18 回円貨社債(2012)(コー	100,000,000	101,014,000	
ラボバンク・ネダーランド 第25 回円貨社債(2014)(コー	100,000,000	100,695,000	
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨 社債(2014)	200,000,000	202,162,000	
清水建設 第18回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,597,000	
大和ハウス工業 第5回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	101,976,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,828,000	
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,643,000	
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	101,591,000	
キリンホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,444,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,984,000	
野村不動産ホールディングス 第5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,944,000	
森ビル 第13回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,125,000	
東急不動産ホールディングス 第2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,032,000	
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	104,222,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,324,000	
住友化学 第43回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	105,899,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,769,000	
エア・ウォーター 第2回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,782,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,508,000	
宇部興産 第10回社債間限定同順	100,000,000	100,610,000	

位特約付			
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,321,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,616,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,680,000	
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,417,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,218,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,156,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,272,000	
住友大阪セメント 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,924,000	
新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,503,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,472,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,032,000	
神戸製鋼所 第63回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,391,000	
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	100,844,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFEス保証)	100,000,000	101,334,000	
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,530,000	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,478,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	220,318,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,727,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,969,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,881,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,712,000	

パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,902,000	
ソニー 第26回	100,000,000	105,572,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,605,000	
川崎重工業 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,189,000	
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債	300,000,000	303,024,000	
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,372,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	105,499,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,042,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,286,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,983,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,212,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,533,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,512,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,118,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,707,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,719,000	
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	102,676,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	105,299,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,900,000	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,546,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,412,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,601,000	

クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,446,000	
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,273,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	103,959,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	206,372,000	
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	123,239,000	
みずほコーポレート銀行 第31回特定社債間限定同順位特約付	2,000,000,000	2,008,440,000	
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	301,194,000	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	107,271,000	
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	110,245,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,666,000	
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	102,977,000	
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	104,344,000	
三菱東京UFJ銀行 第140回特定社債間限定同順位特約付	500,000,000	501,715,000	
三菱東京UFJ銀行 第12回(劣後特約付)	300,000,000	307,980,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	308,415,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	102,999,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	106,895,000	
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,194,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	321,513,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	107,428,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	321,579,000	
三井住友信託銀行 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,670,000	

セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,380,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,498,000	
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	200,000,000	206,470,000	
三井住友銀行 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,372,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	107,288,000	
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,638,000	
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,781,000	
NTTファイナンス 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,110,000	
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,671,000	
ホンダファイナンス 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,728,000	
ホンダファイナンス 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,541,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,912,000	
オリエントコーポレーション 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,170,000	
日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,784,000	
日立キャピタル 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,381,000	
日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,480,000	
オリックス 第144回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,352,000	
オリックス 第164回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,282,000	
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	100,922,000	
三井住友ファイナンス&リース 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,600,000	
三菱UFJリース 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,461,000	
三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,458,000	

大和証券グループ本社 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,799,000	
大和証券グループ本社 第22回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,795,000	
大和証券グループ本社 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,373,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	106,733,000	
野村ホールディングス 第41回	200,000,000	202,992,000	
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	103,040,000	
三井不動産 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,847,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	113,838,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	104,334,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,682,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	104,718,000	
東京建物 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,997,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,467,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,524,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,982,000	
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	104,028,000	
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	105,639,000	
オリックス不動産投資法人 第5回特定投資法人債間限定同順位特	100,000,000	101,384,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	102,890,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,776,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,307,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,692,000	

小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,830,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	111,212,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	226,884,000	
東日本旅客鉄道 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,946,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,925,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,159,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	122,680,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,414,000	
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,217,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	249,552,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,194,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,055,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,924,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	101,601,000	
住友倉庫 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,234,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	105,706,000	
KDDI 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,548,000	
NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,290,000	
東京電力 第455回	200,000,000	208,500,000	
東京電力 第459回	100,000,000	106,256,000	
東京電力 第542回	100,000,000	102,413,000	
東京電力 第544回	100,000,000	103,457,000	
東京電力 第547回	100,000,000	105,972,000	
東京電力 第548回	100,000,000	111,369,000	
東京電力 第559回	100,000,000	102,991,000	
東京電力 第560回	100,000,000	108,684,000	

東京電力 第565回	300,000,000	309,645,000	
中部電力 第482回	200,000,000	213,176,000	
中部電力 第500回	200,000,000	209,038,000	
関西電力 第448回	200,000,000	208,808,000	
関西電力 第469回	100,000,000	103,926,000	
関西電力 第482回	100,000,000	103,931,000	
関西電力 第484回	100,000,000	103,157,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,499,000	
関西電力 第497回	200,000,000	208,538,000	
関西電力 第498回	200,000,000	201,236,000	
中国電力 第314回	100,000,000	105,772,000	
中国電力 第330回	100,000,000	109,375,000	
中国電力 第377回	200,000,000	212,110,000	
中国電力 第378回	100,000,000	105,284,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	106,084,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	105,173,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	105,825,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	103,695,000	
東北電力 第431回	400,000,000	415,072,000	
東北電力 第473回	100,000,000	101,753,000	
東北電力 第475回	100,000,000	103,554,000	
東北電力 第481回	200,000,000	206,930,000	
四国電力 第281回	200,000,000	212,102,000	
九州電力 第400回	100,000,000	106,115,000	
九州電力 第409回	100,000,000	104,350,000	
九州電力 第420回	300,000,000	304,206,000	
九州電力 第424回	200,000,000	211,890,000	
北海道電力 第296回	100,000,000	104,158,000	
北海道電力 第316回	207,000,000	214,965,360	
北海道電力 第323回	100,000,000	107,836,000	
電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,491,000	
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,612,000	
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,563,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,293,000	

	位特約付			
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,416,000	
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,594,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	126,797,000	
	大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,149,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,656,000	
	東京都競馬 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,360,000	
	ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,987,000	
小計	銘柄数：208 組入時価比率：4.6%	28,907,000,000	30,007,290,360	4.6%
合計			30,007,290,360	
合計			652,739,697,217	

(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28年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,023,201,985
コール・ローン	1,071,519,167
国債証券	641,958,491,873
派生商品評価勘定	4,647,568
未収入金	121,294,229
未収利息	6,097,148,304
前払費用	460,369,689
流動資産合計	651,736,672,815
資産合計	651,736,672,815
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,404,867
未払金	2,702,714,270
未払解約金	327,443,909

(平成28年 3月31日現在)

その他未払費用	5,167,900
流動負債合計	3,042,730,946
負債合計	3,042,730,946
純資産の部	
元本等	
元本	288,024,418,427
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	360,669,523,442
元本等合計	648,693,941,869
純資産合計	648,693,941,869
負債純資産合計	651,736,672,815

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28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	2.2522円
(10,000口当たり純資産額)	(22,522円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 4月 1日
至 平成28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、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なっております。

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年 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28年 3月31日現在

期首	平成27年 4月 1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	216,605,939,702円
同期中における追加設定元本額	100,202,657,752円
同期中における一部解約元本額	28,784,179,027円
期末元本額	288,024,418,427円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	82,773,952円
バランスセレクト50	85,952,090円

バランスセレクト70	64,533,575円
野村外国債券インデックスファンド	283,039,469円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,679,415,894円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	29,959,521,471円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,453,419,684円
野村資産設計ファンド2015	45,872,852円
野村資産設計ファンド2020	47,672,687円
野村資産設計ファンド2025	44,525,481円
野村資産設計ファンド2030	38,058,125円
野村資産設計ファンド2035	24,547,768円
野村資産設計ファンド2040	68,784,519円
野村外国債券インデックス(野村投資一任口座向け)	175,170,401,792円
のむらップ・ファンド(保守型)	3,788,011,704円
のむらップ・ファンド(普通型)	5,907,265,837円
のむらップ・ファンド(積極型)	1,450,598,767円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	2,161,527,506円
野村資産設計ファンド2045	4,958,095円
野村インデックスファンド・外国債券	551,191,180円
マイ・ロード	7,904,791,581円
ネクストコア	460,480,178円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	77,528,443円
野村外国債券インデックス(野村SMA・EW向け)	2,009,457,814円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,308,102,432円
野村資産設計ファンド2050	1,966,087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)	43,567,824円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,564,523,693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)	631,067,016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)	9,899,313,292円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,727,747,244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)	8,159,514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)	35,976,675円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	4,393,230円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	6,993,458,773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)	510,661,786円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	1,856,437,502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)	205,591,647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)	103,243,347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)	230,320,227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)	2,038,269,018円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,099,525,303円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,216,763,431円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	138,662,883円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	4,708,988円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,416,906円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	4,970,608円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	517,675,133円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,777,908,652円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	2,333,047,039円

マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,096,495,279円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	12,202,074,675円
マイバランスDC30	987,147,480円
マイバランスDC50	571,547,559円
マイバランスDC70	344,222,491円
野村DC外国債券インデックスファンド	2,456,788,625円
野村DC運用戦略ファンド	718,545,008円
野村DC運用戦略ファンドM	5,698,491円
野村DC運用戦略ファンドA	3,050,874円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	10,755,603円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	101,808円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	181,820円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 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28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	4,365,312.40	
		US TREASURY BOND	10,500,000.00	12,895,722.00	
		US TREASURY BOND	9,300,000.00	11,500,757.58	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	16,772,929.37	
		US TREASURY BOND	18,500,000.00	25,126,757.35	
		US TREASURY BOND	19,400,000.00	25,676,202.64	
		US TREASURY BOND	31,200,000.00	32,745,373.44	
		US TREASURY BOND	35,000,000.00	48,216,598.50	
		US TREASURY BOND	8,800,000.00	12,724,937.28	
		US TREASURY BOND	17,700,000.00	25,407,795.99	
		US TREASURY BOND	12,000,000.00	16,616,250.00	
		US TREASURY BOND	5,000,000.00	6,810,156.00	
		US TREASURY BOND	2,800,000.00	3,826,046.84	
		US TREASURY BOND	2,200,000.00	2,955,906.14	

US TREASURY BOND	22,300,000.00	23,347,054.13	
US TREASURY BOND	16,600,000.00	20,489,326.88	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	8,582,108.64	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,023,437.00	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,108,042.88	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,877,226.20	
US TREASURY N/B	11,500,000.00	11,540,429.40	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,023,046.00	
US TREASURY N/B	18,300,000.00	18,785,378.22	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	25,029,374.40	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,216,593.12	
US TREASURY N/B	24,600,000.00	25,191,937.50	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,494,355.15	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,011,914.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,203,553.90	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,007,187.20	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	16,938,947.74	
US TREASURY N/B	22,300,000.00	22,788,682.20	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,391,500.00	
US TREASURY N/B	29,800,000.00	31,447,147.32	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	22,258,439.49	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,987,109.00	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	35,091,619.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,988,436.80	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,002,226.50	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,834,589.15	
US TREASURY N/B	49,600,000.00	52,403,560.64	
US TREASURY N/B	18,600,000.00	19,063,545.48	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,586,365.70	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,999,530.80	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	17,467,072.74	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,008,593.60	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	41,943,314.91	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,368,191.14	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,999,140.60	

US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,308,124.80	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,052,156.25	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,170,117.00	
US TREASURY N/B	13,500,000.00	13,556,952.45	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	30,333,510.62	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,609,237.75	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,888,569.56	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,443,296.62	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	5,172,187.20	
US TREASURY N/B	20,600,000.00	20,933,139.08	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	25,844,647.80	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,161,601.30	
US TREASURY N/B	30,600,000.00	32,932,053.54	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,050,585.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,590,136.15	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,593,242.05	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,152,394.34	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,033,593.60	
US TREASURY N/B	27,500,000.00	28,962,010.00	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,561,523.10	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,067,500.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,070,000.00	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	26,021,951.85	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	9,695,937.50	
US TREASURY N/B	26,400,000.00	28,192,311.84	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,775,975.90	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,002,890.60	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	8,066,640.23	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,799,062.50	
US TREASURY N/B	37,000,000.00	40,220,154.40	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,000,234.30	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,979,437.28	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,998,359.30	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,914,100.91	
US TREASURY N/B	49,300,000.00	53,394,207.24	

US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,784,187.28	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,827,632.70	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,020,624.40	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,874,515.34	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,020,156.20	
US TREASURY N/B	51,100,000.00	56,030,347.73	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,713,710.87	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,001,250.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,130,155.20	
US TREASURY N/B	43,400,000.00	47,470,442.60	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,917,440.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,181,250.00	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,370,389.80	
US TREASURY N/B	31,500,000.00	33,404,764.05	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,275,077.60	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,207,655.80	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,636,500.00	
US TREASURY N/B	50,100,000.00	53,190,147.96	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	7,149,031.08	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,514,484.11	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	37,986,046.02	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,171,093.50	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,753,944.90	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,034,351.49	
US TREASURY N/B	36,400,000.00	39,670,310.68	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,204,375.00	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	9,043,921.44	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	10,151,656.25	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,855,250.00	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,536,679.14	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,616,249.60	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,350,625.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,192,187.20	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,863,061.88	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,011,328.00	

US TREASURY N/B	33,700,000.00	34,753,125.00	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,415,202.76	
US TREASURY N/B	5,900,000.00	5,988,038.62	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,073,046.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,139,062.00	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,911,428.96	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	27,974,529.90	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,622,851.10	
US TREASURY N/B	12,800,000.00	12,860,999.68	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,161,718.00	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,466,170.60	
US TREASURY N/B	32,600,000.00	32,954,013.18	
US TREASURY N/B	16,300,000.00	17,317,475.34	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	18,137,436.24	
US TREASURY N/B	27,300,000.00	29,462,670.51	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	32,216,874.24	
US TREASURY N/B	24,300,000.00	25,245,420.66	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	3,946,515.56	
US TREASURY N/B	300,000.00	427,945.29	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,728,281.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,454,531.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	683,046.85	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,774,218.75	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	6,578,906.00	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	7,487,734.10	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	10,301,757.62	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	11,076,249.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,703,749.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,964,687.20	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	10,264,007.52	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,885,038.80	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,396,405.90	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	7,186,054.20	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,537,249.92	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,856,484.15	

	US TREASURY N/B	9,300,000.00	9,541,218.75	
	US TREASURY N/B	9,600,000.00	9,833,249.28	
	US TREASURY N/B	18,200,000.00	20,029,951.76	
	US TREASURY N/B	15,700,000.00	18,952,843.75	
	US TREASURY N/B	23,200,000.00	27,966,873.84	
	US TREASURY N/B	15,900,000.00	18,311,085.54	
	US TREASURY N/B	18,600,000.00	20,436,750.00	
	US TREASURY N/B	33,000,000.00	35,379,606.90	
	US TREASURY N/B	9,200,000.00	8,908,905.56	
	US TREASURY N/B	14,700,000.00	15,748,523.07	
	US TREASURY NOTE	31,000,000.00	32,293,279.70	
小計	銘柄数：165	2,244,300,000.00	2,422,203,624.54 (272,933,904,413)	
	組入時価比率：42.1%		42.4%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	4,600,000.00	5,123,526.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,824,724.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,745,044.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,600,000.00	6,663,096.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,000,000.00	9,122,850.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,600,000.00	8,713,004.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,243,936.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,995,038.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	7,425,633.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,933,038.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	5,056,642.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,157,560.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,724,776.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,390,775.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,514,825.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,200,000.00	10,386,156.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,033,224.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,306,081.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,877,090.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	3,692,084.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,180,000.00	7,709,186.80	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	4,707,300.00		
	CANADIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	10,613,120.00		
	CANADIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	8,882,624.00		
	CANADIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	9,460,395.00		
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,107,872.00		
	銘柄数：26	132,280,000.00	152,409,599.80	(13,227,629,166)	
	組入時価比率：2.0%			2.1%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,400,000.00	6,468,512.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	60,800,000.00	64,486,972.80		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	108,800,000.00	109,285,248.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	89,500,000.00	97,976,008.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	29,000,000.00	28,858,161.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	60,700,000.00	67,155,930.60		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	78,800,000.00	82,809,028.80		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	27,400,000.00	28,723,228.20		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,700,000.00	39,398,906.40		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	71,600,000.00	79,361,583.20		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	34,600,000.00	41,364,023.20		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	41,000,000.00	46,142,384.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,247,720.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	63,401,064.00		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	36,927,722.50		
	MEX BONOS DESARR FIX RT	54,200,000.00	61,029,254.20		
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	94,529,779.00		
	小計	銘柄数：17	863,000,000.00	959,165,525.90	(6,263,350,884)
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,783,322.10		
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,154,400.00		
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,463,320.00		
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	8,276,044.00		
	BELGIUM KINGDOM	7,200,000.00	8,960,040.00		
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	6,242,690.00		
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	8,195,840.00		
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,478,269.00		

BELGIUM KINGDOM	7,300,000.00	8,708,900.00
BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	8,955,705.60
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,078,892.00
BELGIUM KINGDOM	6,800,000.00	11,124,528.00
BELGIUM KINGDOM	3,700,000.00	5,787,717.60
BELGIUM KINGDOM GOVT	2,000,000.00	2,178,840.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	2,500,000.00	2,722,250.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,891,984.80
BELGIUM KINGDOM GOVT	7,600,000.00	11,842,183.20
BELGIUM KINGDOM GOVT	9,500,000.00	15,904,919.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,700,000.00	11,972,961.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,600,000.00	18,742,104.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,700,000.00	22,407,211.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,305,460.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,100,000.00	18,719,523.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,100,000.00	18,739,462.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,900,000.00	13,932,425.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	10,435,652.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	23,800,000.00	27,267,660.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,000,000.00	21,849,734.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,600,000.00	13,959,231.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,500,000.00	9,401,625.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	11,965,694.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,800,000.00	16,662,860.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	5,853,093.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	9,085,784.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,300,000.00	9,962,490.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,700,000.00	17,675,822.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	26,187,708.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,800,000.00	6,624,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	6,796,529.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,400,000.00	6,225,832.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,900,000.00	5,948,798.70
BUNDESobligation	1,700,000.00	1,743,265.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,150,000.00	5,820,787.50

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,700,000.00	9,922,350.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,026,550.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000.00	3,468,745.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	8,308,495.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,332,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	3,994,550.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,000,000.00	15,864,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,600,000.00	10,818,720.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,566,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,813,860.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,200,000.00	4,706,940.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	6,265,350.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,100,000.00	16,613,925.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,535,335.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,692,450.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,194,190.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	23,900,000.00	40,639,560.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,738,300.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,227,840.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	6,264,475.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	9,092,415.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,600,000.00	11,320,412.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,400,000.00	15,393,825.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	9,431,181.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	9,779,759.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	8,681,194.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	6,687,188.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	10,075,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000,000.00	10,517,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	4,559,895.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,500,000.00	19,530,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,300,000.00	11,024,708.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	19,947,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	10,640,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	19,806,273.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	9,900,000.00	10,655,805.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	23,800,000.00	26,294,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,737,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,000,000.00	19,024,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,905,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,400,000.00	18,692,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	523,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	25,900,000.00	29,549,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,300,000.00	12,015,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,600,000.00	16,936,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,600,000.00	14,685,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000.00	12,822,062.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	8,182,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	9,172,020.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,400,000.00	12,806,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,700,000.00	15,982,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	12,519,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,900,000.00	18,183,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000.00	5,787,338.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	9,223,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	16,727,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	14,850,810.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,797,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	19,802,457.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,171,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,600,000.00	13,635,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	24,810,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	9,930,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	17,436,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	22,974,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	10,012,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	12,369,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,572,370.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	12,156,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	21,801,600.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	10,554,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,716,900.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,126,982.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,557,373.50	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,502,107.10	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,297,400.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,373,990.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,545,894.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,422,468.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,211,440.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,390,477.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	695,156.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,400,000.00	1,915,586.40	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,337,160.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,500,000.00	8,749,067.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,500,000.00	4,276,545.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,700,000.00	10,416,752.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,549,474.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	4,636,476.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	12,093,105.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	6,842,642.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	13,129,665.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,267,300.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	12,375,925.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,078,297.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,300,000.00	19,454,715.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	14,156,460.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	17,951,635.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,562,420.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	20,214,462.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	13,125,781.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,500,000.00	37,460,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	9,023,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	30,490,020.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,500,000.00	26,658,200.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,895,600.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	32,089,951.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,600,000.00	28,864,910.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	13,863,891.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,800,000.00	15,120,714.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,400,000.00	12,532,114.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,400,000.00	15,028,540.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	8,107,810.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,800,000.00	6,682,262.00	
FRENCH TREASURY NOTE	1,000,000.00	1,018,850.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	3,600,000.00	4,127,137.20	
IRISH GOVERNMENT	7,500,000.00	8,182,402.50	
IRISH GOVERNMENT	5,600,000.00	6,284,885.60	
IRISH GOVERNMENT	3,400,000.00	4,125,658.60	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,279,169.70	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,296,372.50	
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	8,465,814.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	1,500,000.00	1,744,476.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,500,000.00	1,602,270.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	1,300,000.00	1,591,518.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,258,520.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,640,256.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	7,166,646.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,619,190.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	8,134,470.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,048,140.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,761,930.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,997,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,726,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,438,130.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,526,110.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,580,188.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,633,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,300,000.00	9,981,720.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	4,763,750.00	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	8,078,940.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5,200,000.00	8,646,508.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	5,151,020.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,604,250.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,275,946.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,392,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,849,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000.00	1,826,990.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,400,000.00	2,451,360.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,600,000.00	5,431,680.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,291,440.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	4,050,090.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	6,145,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,590,956.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,365,100.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,747,920.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,600,000.00	7,498,671.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,900,000.00	9,342,402.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,500,000.00	6,618,240.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,400,000.00	4,235,012.80	
	SPANISH GOVERNMENT	18,400,000.00	19,756,264.00	
	SPANISH GOVERNMENT	9,800,000.00	14,571,041.80	
	SPANISH GOVERNMENT	7,300,000.00	11,117,170.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	6,808,193.60	
小計	銘柄数：207	1,627,350,000.00	2,068,453,758.80	
			(264,141,544,998)	
	組入時価比率：40.7%		41.1%	
英ポンド	UK TREASURY	4,900,000.00	4,940,670.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	6,215,280.00	
	UK TREASURY	20,400,000.00	20,765,160.00	
	UK TREASURY	4,600,000.00	5,142,800.00	
	UK TREASURY	14,200,000.00	14,712,620.00	
	UK TREASURY	3,000,000.00	3,325,800.00	
	UK TREASURY	6,400,000.00	7,420,160.00	
	UK TREASURY	13,500,000.00	14,192,550.00	

	UK TREASURY	7,200,000.00	8,153,280.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	6,948,240.00	
	UK TREASURY	8,200,000.00	9,440,660.00	
	UK TREASURY	4,650,000.00	5,473,050.00	
	UK TREASURY	8,300,000.00	8,651,920.00	
	UK TREASURY	7,200,000.00	7,727,040.00	
	UK TREASURY	8,600,000.00	9,557,180.00	
	UK TREASURY	12,800,000.00	16,743,680.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	8,561,930.00	
	UK TREASURY	3,750,000.00	5,617,500.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	9,152,870.00	
	UK TREASURY	7,250,000.00	9,493,875.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	9,126,070.00	
	UK TREASURY	6,900,000.00	9,194,940.00	
	UK TREASURY	4,900,000.00	7,071,190.00	
	UK TREASURY	4,200,000.00	5,697,300.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,810,140.00	
	UK TREASURY	6,100,000.00	8,771,800.00	
	UK TREASURY	14,300,000.00	17,782,050.00	
	UK TREASURY	5,950,000.00	8,491,245.00	
	UK TREASURY	4,250,000.00	6,239,850.00	
	UK TREASURY	7,250,000.00	9,973,100.00	
	UK TREASURY	5,000,000.00	7,048,000.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	19,000,000.00	22,560,600.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,400,000.00	9,911,680.00	
小計	銘柄数：33	255,800,000.00	311,914,230.00	
			(50,505,152,121)	
	組入時価比率：7.8%		7.9%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	8,800,000.00	10,072,480.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,600,000.00	5,468,040.00	
小計	銘柄数：2	12,400,000.00	15,540,520.00	
			(1,814,200,304)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	7,000,000.00	7,424,403.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,200,000.00	18,473,038.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	49,400,000.00	61,304,214.40	

小計	SWEDISH GOVERNMENT	48,700,000.00	58,668,890.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,900,000.00	19,447,974.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	38,300,000.00	45,090,590.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,300,000.00	22,197,698.60	
	銘柄数：7 組入時価比率：0.5%	193,800,000.00	232,606,808.30 (3,221,604,294) 0.5%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	21,900,000.00	22,847,065.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	24,100,000.00	27,158,290.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	31,864,200.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	15,403,960.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	33,500,000.00	38,648,950.00	
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.3%	121,400,000.00	135,922,465.50 (1,843,108,632) 0.3%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	25,100,000.00	29,038,692.00	
	KINGDOM OF DENMARK	52,100,000.00	61,207,080.00	
	KINGDOM OF DENMARK	31,100,000.00	34,346,840.00	
	KINGDOM OF DENMARK	14,500,000.00	22,934,650.00	
	KINGDOM OF DENMARK	18,600,000.00	20,869,200.00	
小計	KINGDOM OF DENMARK 銘柄数：6 組入時価比率：0.7%	187,200,000.00	248,447,900.40 (4,258,397,012) 0.7%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,527,902.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	9,013,366.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,100,000.00	8,487,180.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,500,000.00	9,728,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	6,103,989.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	12,531,900.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,200,000.00	5,117,512.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	23,100,000.00	26,380,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,738,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	11,305,944.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,600,000.00	10,557,216.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	14,300,000.00	14,885,113.10	

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,706,030.00	
	銘柄数：13	118,600,000.00	130,082,353.60 (3,881,657,431)	
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,148,820.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,295,323.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,852,750.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	11,390,496.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,978,349.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	13,939,329.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	887,583.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	11,054,813.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	9,496,195.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	8,817,538.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,381,220.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	16,000,000.00	17,036,784.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	8,835,750.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,800,000.00	5,807,692.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,100,000.00	6,450,713.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,368,650.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,719,165.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	4,949,352.00	
	小計	銘柄数：18	121,700,000.00	134,410,527.20 (11,592,907,971)
		組入時価比率：1.8%		1.8%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	305,070.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,192,164.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,366,104.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,100,000.00	4,292,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,000,000.00	4,346,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,580,000.00	2,679,768.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,308,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,563,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,636,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,788,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,591,664.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	574,290.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,800,000.00	1,918,800.00
	銘柄数：13	27,480,000.00	29,564,061.30 (2,462,981,946)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,923,620.50
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,300,000.00	4,375,198.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,371,084.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,713,897.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,028,749.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	12,297,971.70
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	10,026,810.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,439,168.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,159,570.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,887,493.70
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,533,829.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	7,665,567.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,922,594.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,056,625.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,753,716.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,721,280.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,948,964.30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,577,500.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,598,226.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	374,350.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,661,492.80
小計	銘柄数：21	105,800,000.00	107,037,709.80 (3,067,700,762)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,300,000.00	10,324,330.66
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,800,000.00	23,544,399.90
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,800,000.00	22,763,360.06
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	24,049,884.15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,200,000.00	23,587,968.60
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	61,900,000.00	67,419,208.27

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,300,000.00	21,429,394.83	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	23,550,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	41,000,000.00	36,233,081.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	47,100,000.00	32,728,551.27	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,700,000.00	14,669,280.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,600,000.00	16,991,608.68	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,300,000.00	10,929,273.24	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	40,300,000.00	35,752,064.40	
小計	銘柄数：14	407,400,000.00	363,972,405.76	
			(2,744,351,939)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
合計			641,958,491,873	
			(641,958,491,873)	

(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28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	1,990,018,022	-	1,987,699,000	2,319,022
米ドル	846,232,090	-	839,391,500	6,840,590
カナダドル	43,012,500	-	43,390,000	377,500
ユーロ	813,852,672	-	817,216,000	3,363,328
英ポンド	169,763,160	-	170,005,500	242,340
スウェーデンクローナ	38,410,400	-	38,780,000	369,600
ズロチ	35,922,000	-	35,796,000	126,000
豪ドル	42,825,200	-	43,120,000	294,800
売建	139,894,823	-	140,333,100	438,277
米ドル	73,052,882	-	73,229,000	176,118
ユーロ	50,823,316	-	51,076,000	252,684
英ポンド	16,018,625	-	16,028,100	9,475
合計	-	-	-	2,757,299

（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28年 4月28日現在

資産総額	7,711,964,655円
負債総額	8,346,994円
純資産総額（ - ）	7,703,617,661円
発行済口数	6,574,016,052口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1718円

（参考）国内株式マザーファンド

平成28年 4月28日現在

資産総額	334,593,001,426円
負債総額	51,968,744,449円
純資産総額（ - ）	282,624,256,977円
発行済口数	226,292,854,333口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2489円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成28年 4月28日現在

資産総額	323,648,061,856円
負債総額	1,387,476,051円
純資産総額（ - ）	322,260,585,805円
発行済口数	160,698,752,783口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0054円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

平成28年 4月28日現在

資産総額	669,326,674,588円
負債総額	2,660,561,822円
純資産総額（ - ）	666,666,112,766円
発行済口数	502,914,115,095口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3256円

（参考）外国債券マザーファンド

平成28年 4月28日現在

資産総額	631,979,032,133円
負債総額	1,401,164,753円
純資産総額（ - ）	630,577,867,380円
発行済口数	289,153,914,216口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1808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28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

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

株主総会

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

取締役会

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

代表執行役・執行役

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

委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成28年4月28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	908	17,667,817
単位型株式投資信託	54	229,042
追加型公社債投資信託	18	6,299,468
単位型公社債投資信託	219	1,571,962
合計	1,199	25,768,289

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26年4月1日から平成27年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(平成27年4月1日から平成27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26年3月31日)	当事業年度 (平成27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		247	411
金銭の信託		51,758	56,824
有価証券		11,800	17,100
前払金		0	15
前払費用		28	29
未収入金		287	330
未収委託者報酬		10,741	12,679
未収収益		5,999	7,436
繰延税金資産		2,010	2,594
その他		159	73
貸倒引当金		8	9
流動資産計		83,026	97,486
固定資産			

有形固定資産			1,508		1,322
建物	2	442		413	
器具備品	2	1,065		909	
無形固定資産			8,249		7,254
ソフトウェア		8,248		7,253	
電話加入権		1		0	
その他		0		0	
投資その他の資産			22,052		24,840
投資有価証券		11,747		11,593	
関係会社株式		9,609		10,149	
従業員長期貸付金		35		30	
長期差入保証金		50		49	
長期前払費用		80		60	
前払年金費用		347		2,776	
その他		181		179	
貸倒引当金		0		0	
固定資産計			31,810		33,417
資産合計			114,837		130,903

区分	注記 番号	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			106		118
未払金	1		9,720		11,602
未払収益分配金		2		1	
未払償還金		33		32	
未払手数料		4,493		4,883	
その他未払金		5,191		6,684	
未払費用	1		8,420		10,221
未払法人税等			1,960		1,961
賞与引当金			3,984		4,558
外国税支払損失引当金			-		1,721
流動負債計			24,191		30,182
固定負債					
退職給付引当金			-		2,467
時効後支払損引当金			505		521
繰延税金負債			3,211		747
固定負債計			3,716		3,735
負債合計			27,907		33,918
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			80,249		90,092
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			51,339		61,182
利益剰余金			685		685
その他利益剰余金		50,654		60,497	
別途積立金		24,606		24,606	

繰越利益剰余金		26,048		35,890	
評価・換算差額等			6,679		6,893
その他有価証券評価差額金			6,679		6,893
純資産合計			86,929		96,985
負債・純資産合計			114,837		130,903

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成25年 4 月 1 日 至 平成26年 3 月31日)		当事業年度 (自 平成26年 4 月 1 日 至 平成27年 3 月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			87,258		96,159
運用受託報酬			24,589		31,466
その他営業収益			188		221
営業収益計			112,036		127,847
営業費用					
支払手数料			44,194		47,060
広告宣伝費			793		823
公告費			0		-
受益証券発行費			6		5
調査費			20,794		28,326
調査費		1,250		1,299	
委託調査費		19,544		27,027	
委託計算費			941		1,156
営業雑経費			2,926		3,275
通信費		188		193	
印刷費		948		951	
協会費		76		77	
諸経費		1,712		2,053	
営業費用計			69,656		80,648
一般管理費					
給料			11,091		11,660
役員報酬	2	292		289	
給料・手当		6,823		6,874	
賞与		3,975		4,496	
交際費			131		131
旅費交通費			454		472
租税公課			387		501
不動産賃借料			1,212		1,218
退職給付費用			1,069		723
固定資産減価償却費			3,518		3,120
諸経費			6,596		6,815
一般管理費計			24,460		24,643
営業利益			17,919		22,555

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)		当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27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	3,680		4,038	
収益分配金		0		-	
受取利息		3		5	
金銭の信託運用益		379		347	
その他		336		366	
営業外収益計			4,400		4,756
営業外費用					
支払利息	1	11		-	
時効後支払損引当金繰入額		24		28	
その他		132		137	
営業外費用計			169		166
經常利益			22,151		27,146
特別利益					
投資有価証券等売却益		-		794	
株式報酬受入益		203		142	
特別利益計			203		936
特別損失					
投資有価証券償還損		51		-	
投資有価証券等評価損		2		91	
関係会社株式評価損		2,491		-	
固定資産除却損	3	17		357	
外国税支払損失引当金繰入額		-		1,721	
特別損失計			2,562		2,169
税引前当期純利益			19,792		25,913
法人税、住民税及び事業税			7,608		8,433
法人税等調整額			90		2,488
当期純利益			12,273		19,967

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	株 主 資 本 合 計
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	17,740	43,032	71,942

会計方針の変更による累積的影響額								
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	17,740	43,032	71,942
当期変動額								
剰余金の配当						3,966	3,966	3,966
当期純利益						12,273	12,273	12,273
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	8,307	8,307	8,307
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249

(単位：百万円)

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,659	30	4,628	76,570
会計方針の変更による累積的影響額				
会計方針の変更を反映した当期首残高	4,659	30	4,628	76,570
当期変動額				
剰余金の配当				3,966
当期純利益				12,273
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	2,020	30	2,051	2,051
当期変動額合計	2,020	30	2,051	10,358
当期末残高	6,679	-	6,679	86,929

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本				株
	資本剰余金		利益剰余金		
			その他利益剰余金		

	資本金	資本 準備金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金	利益 剰余金 合計	主 資 本 合 計
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249
会計方針の変 更による累積 的影響額						81	81	81
会計方針の変 更を反映した 当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	25,966	51,258	80,168
当期変動額								
剰余金の配当						10,043	10,043	10,043
当期純利益						19,967	19,967	19,967
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)								
当期変動額合 計	-	-	-	-	-	9,923	9,923	9,923
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法によっております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0" data-bbox="691 678 986 801"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。ただし、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 外国税支払損失引当金 将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p>								

5. 消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。
6. 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

[会計方針の変更]

(退職給付に関する会計基準等の適用)	
<p>「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。)を当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更、割引率の決定方法を平均残存勤務期間に基づく割引率から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更しております。</p>	
<p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。</p>	
<p>この結果、当事業年度の期首の前払年金費用が127百万円減少し、繰越利益剰余金が81百万円減少しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前純利益はそれぞれ38百万円増加しております。</p>	

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (平成26年3月31日)	当事業年度末 (平成27年3月31日)												
<p>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。</p> <table border="0"> <tr> <td>未払金</td> <td>4,601百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td>1,607</td> </tr> </table>	未払金	4,601百万円	未払費用	1,607	<p>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。</p> <table border="0"> <tr> <td>未払金</td> <td>4,979百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td>1,411</td> </tr> </table>	未払金	4,979百万円	未払費用	1,411				
未払金	4,601百万円												
未払費用	1,607												
未払金	4,979百万円												
未払費用	1,411												
<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>565百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>2,849</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>3,414</td> </tr> </table>	建物	565百万円	器具備品	2,849	合計	3,414	<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>607百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3,052</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>3,659</td> </tr> </table>	建物	607百万円	器具備品	3,052	合計	3,659
建物	565百万円												
器具備品	2,849												
合計	3,414												
建物	607百万円												
器具備品	3,052												
合計	3,659												

損益計算書関係

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)								
<p>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。</p> <table border="0"> <tr> <td>受取配当金</td> <td>3,568百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td>5</td> </tr> </table>	受取配当金	3,568百万円	支払利息	5	<p>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。</p> <table border="0"> <tr> <td>受取配当金</td> <td>3,966百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td>-</td> </tr> </table>	受取配当金	3,966百万円	支払利息	-
受取配当金	3,568百万円								
支払利息	5								
受取配当金	3,966百万円								
支払利息	-								

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 器具備品 6百万円 ソフトウェア 11	3. 固定資産除却損 器具備品 15百万円 ソフトウェア 342
合計 17	合計 357

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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

(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26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	10,043百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,950円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月2日

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	10,043百万円
--------	-----------

配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,950円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月2日

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

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月26日

金融商品関係

前事業年度（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26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	247	247	-
(2)金銭の信託	51,758	51,758	-
(3)未収委託者報酬	10,741	10,741	-
(4)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	22,467	22,467	-
(5)関係会社株式	3,064	141,441	138,377
資産計	88,278	226,656	138,377
(6)未払金	9,720	9,720	-
未払収益分配金	2	2	-
未払償還金	33	33	-
未払手数料	4,493	4,493	-
その他未払金	5,191	5,191	-
(7)未払費用	8,420	8,420	-
(8)未払法人税等	1,960	1,960	-
負債計	20,100	20,100	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,080百万円、関係会社株式6,545百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について2,494百万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	247	-	-	-
金銭の信託	51,758	-	-	-
未収委託者報酬	10,741	-	-	-
有価証券	11,800	-	-	-
合計	74,547	-	-	-

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	411	-	-	-
金銭の信託	56,824	-	-	-
未収委託者報酬	12,679	-	-	-
有価証券	17,100	-	-	-
合計	87,015	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成26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26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26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	141,441	138,377
合計	3,064	141,441	138,377

4. その他有価証券(平成26年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	10,667	282	10,384
小計	10,667	282	10,384
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	11,800	11,800	-
小計	11,800	11,800	-
合計	22,467	12,082	10,384

5. 事業年度中に売却したその他有価証券(自平成25年4月1日至平成26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	-	-	-
投資信託	761	-	51
合計	761	-	51

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

当事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1. 売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

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

合計	3,064	196,109	193,045
----	-------	---------	---------

4．その他有価証券(平成27年3月31日)

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

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

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

退職給付関係

前事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	
1．採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2．確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	15,209 百万円
勤務費用	750
利息費用	228
数理計算上の差異の発生額	25
退職給付の支払額	494
その他	11
退職給付債務の期末残高	15,680
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	12,456 百万円
期待運用収益	311
数理計算上の差異の発生額	428
事業主からの拠出額	2,065
退職給付の支払額	475
年金資産の期末残高	14,786

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

及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	13,485 百万円
年金資産	14,786
	1,301
非積立型制度の退職給付債務	2,194
未積立退職給付債務	893
未認識数理計算上の差異	1,733
未認識過去勤務費用	492
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	347
前払年金費用	347
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	347

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	750 百万円
利息費用	228
期待運用収益	311
数理計算上の差異の費用処理額	284
過去勤務費用の費用処理額	40
その他	12
確定給付制度に係る退職給付費用	899

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	30%
株式	18%
受益証券等	14%
生保一般勘定	19%
その他	19%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.6%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、170百万円でした。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	15,680 百万円
会計方針の変更による累積的影響額	127
会計方針の変更を反映した期首残高	15,808
勤務費用	746
利息費用	213
数理計算上の差異の発生額	1,128
退職給付の支払額	724
その他	46
退職給付債務の期末残高	17,218

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	14,786 百万円
期待運用収益	369
数理計算上の差異の発生額	975
事業主からの拠出額	558
退職給付の支払額	573
年金資産の期末残高	16,117

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	14,474 百万円
年金資産	16,117
	1,643
非積立型制度の退職給付債務	2,743
未積立退職給付債務	1,100
未認識数理計算上の差異	1,861
未認識過去勤務費用	451
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309
退職給付引当金	2,467
前払年金費用	2,776
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	746 百万円
利息費用	213
期待運用収益	369
数理計算上の差異の費用処理額	24
過去勤務費用の費用処理額	40
その他	24
確定給付制度に係る退職給付費用	550

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	1.1%
退職一時金制度の割引率	0.8%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (平成26年3月31日)	当事業年度末 (平成27年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
関係会社株式評価減 1,947	関係会社株式評価減 1,784
賞与引当金 1,434	賞与引当金 1,504
退職給付引当金 -	退職給付引当金 789
所有株式税務簿価通算差異 776	所有株式税務簿価通算差異 690
外国税支払損失引当金 -	外国税支払損失引当金 567
投資有価証券評価減 502	投資有価証券評価減 475
未払事業税 425	未払事業税 387
ゴルフ会員権評価減 408	ゴルフ会員権評価減 296
減価償却超過額 206	減価償却超過額 186
関連会社株式譲渡益 -	関連会社株式譲渡益 169
時効後支払損引当金 181	時効後支払損引当金 166
子会社株式売却損 172	子会社株式売却損 153
未払社会保険料 100	未払社会保険料 92
その他 126	その他 214
繰延税金資産小計 6,284	繰延税金資産小計 7,479
評価性引当額 3,602	評価性引当額 1,500
繰延税金資産合計 2,681	繰延税金資産合計 5,979
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 3,757	その他有価証券評価差額金 3,243
前払年金費用 125	前払年金費用 888
繰延税金負債合計 3,882	繰延税金負債合計 4,132
繰延税金負債の純額 1,200	繰延税金資産の純額 1,847
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 38.0%	法定実効税率 36.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.4%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 6.7%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 6.0%
住民税等均等割 0.0%	住民税等均等割 0.0%
タックスヘイブン税制 1.4%	タックスヘイブン税制 1.2%
外国税額控除 0.3%	外国税額控除 0.2%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 0.5%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 1.8%
評価性引当額 4.7%	評価性引当額 7.3%
その他 0.1%	その他 2.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 37.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 22.9%

<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について、前事業年度の38%から36%に変更されております。</p> <p>この変更により、繰延税金負債の純額が111百万円増加し、法人税等調整額（貸方）は111百万円減少しております。</p>	<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の36%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33%に、平成28年4月1日に開始する前事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32%となります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産の純額は73百万円減少し、法人税等調整額が479百万円、その他有価証券評価差額金が405百万円、それぞれ増加しております。</p>
---	--

セグメント情報等

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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)	8,000	短期借入金	-
							資金の返済	10,000		
							借入金利息の支払	5	未払費用	-

(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 21.5%	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)	5,073	未払費用	716

(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(*3)	36,867	未払手数料	3,854

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)	1,959	未払費用	760
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	資金の返済	3,000	短期借入金	-
							借入金利息の支払	6	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㈱(東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

㈱野村総合研究所

流動資産合計	191,892
固定資産合計	249,548
流動負債合計	84,950
固定負債合計	55,262
純資産合計	301,227
売上高	355,777
税引前当期純利益	47,854
当期純利益	28,759

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接 21.4%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*1)	3,990	未払費用	547

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は(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	229,418
固定資産合計	273,220
流動負債合計	87,832
固定負債合計	65,965
純資産合計	348,841
売上高	358,952
税引前当期純利益	51,509
当期純利益	34,167

1株当たり情報

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,877円25銭	1株当たり純資産額	18,829円58銭
1株当たり当期純利益	2,382円87銭	1株当たり当期純利益	3,876円72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	12,273百万円	損益計算書上の当期純利益	19,967百万円
普通株式に係る当期純利益	12,273百万円	普通株式に係る当期純利益	19,967百万円
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27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		282
金銭の信託		55,445
有価証券		4,900
未収委託者報酬		15,728
未収収益		6,953
繰延税金資産		1,750
その他		560
貸倒引当金		11
流動資産計		85,609
固定資産		

有形固定資産	1	1,203
無形固定資産		6,862
ソフトウェア		6,861
その他		1
投資その他の資産		25,539
投資有価証券		12,316
関係会社株式		10,149
前払年金費用		2,786
その他		287
固定資産計		33,604
資産合計		119,214

平成27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		1
未払償還金		32
未払手数料		5,797
その他未払金	2	3,270
未払費用		8,217
未払法人税等		1,452
賞与引当金		2,436
外国税支払損失引当金		1,704
その他		114
流動負債計		23,026
固定負債		
退職給付引当金		2,580
時効後支払損失引当金		515
繰延税金負債		927
固定負債計		4,023
負債合計		27,050
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		84,911
資本剰余金		17,180
資本剰余金		11,729
資本準備金		11,729
利益剰余金		56,001
利益準備金		685
その他利益剰余金		55,316
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		30,709
評価・換算差額等		7,252
その他有価証券評価差額金		7,252
純資産合計		92,164
負債・純資産合計		119,214

中間損益計算書

		自 平成27年4月1日 至 平成27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		53,884
運用受託報酬		14,970

その他営業収益			103
営業収益計			68,958
営業費用			
支払手数料			24,815
調査費			13,494
その他営業費用			2,877
営業費用計			41,187
一般管理費	1		12,544
営業利益			15,225
営業外収益	2		5,927
営業外費用	3		1,299
経常利益			19,853
特別利益	4		46
特別損失	5		53
税引前中間純利益			19,846
法人税、住民税及び事業税			4,530
法人税等調整額			855
中間純利益			14,460

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	資本剰余金合計		その他利益剰余金			
					別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092
当中間期変動額								
剰余金の配当						19,933	19,933	19,933
中間純利益						14,460	14,460	14,460
吸収分割による増加						291	291	291
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)								
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	5,180	5,180	5,180

当中間期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	30,709	56,001	84,911
---------	--------	--------	--------	-----	--------	--------	--------	--------

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	6,893	6,893	96,985
当中間期変動額			
剰余金の配当			19,933
中間純利益			14,460
吸収分割による増加			291
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	359	359	359
当中間期変動額合計	359	359	4,821
当中間期末残高	7,252	7,252	92,164

[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...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 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3 固定資産の減価償却の方法	(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。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間に基づく定額法によっております。
4 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、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。 (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>(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、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。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 外国税支払損失引当金 将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p>
5 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。
6 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27年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	3,781百万円
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27年4月1日 至 平成27年9月30日	
1 減価償却実施額 有形固定資産 151百万円 無形固定資産 1,125百万円	
2 営業外収益のうち主要なもの 受取配当金 5,586百万円	
3 営業外費用のうち主要なもの 金銭信託運用損 1,200百万円 時効後支払損引当金繰入 48百万円	

4	特別利益の内訳		
	株式報酬受入益	46	百万円
5	特別損失の内訳		
	固定資産除却損	53	百万円

中間株主資本等変動計算書関係

自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日				
1	発行済株式に関する事項			
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少
	普通株式	5,150,693株	-	-
				当中間会計期間末 5,150,693株
2	配当に関する事項			
	配当金支払額			
	平成27年 5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。			
	・普通株式の配当に関する事項			
	(1) 配当金の総額		19,933	百万円
	(2) 1株当たり配当額		3,870	円
	(3) 基準日		平成27年 3月31日	
	(4) 効力発生日		平成27年 6月26日	

金融商品関係

当中間会計期間（自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成27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	282	282	-
(2)金銭の信託	55,445	55,445	-
(3)未収委託者報酬	15,728	15,728	-
(4)未収収益	6,953	6,953	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	15,728	15,728	-
(6)関係会社株式	3,064	198,495	195,431
資産計	97,202	292,634	195,431
(7)未払金	9,101	9,101	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	32	32	-
未払手数料	5,797	5,797	-
その他未払金	3,270	3,270	-
(8)未払費用	8,217	8,217	-
(9)未払法人税等	1,452	1,452	-
負債計	18,771	18,771	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収収益

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,487百万円、関係会社株式7,085百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

有価証券関係

当中間会計期間末（平成27年9月30日）

1．満期保有目的の債券(平成27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27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	198,495	195,431
合計	3,064	198,495	195,431

3. その他有価証券(平成27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
小計	10,828	282	10,545
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの 譲渡性預金	4,900	4,900	-
小計	4,900	4,900	-
合計	15,728	5,182	10,545

企業結合等関係

会社分割について

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

1. 企業結合の概要

(1) 会社分割の目的

本件会社分割により、当社は、NFR&Tが行ってきた投資信託の運用・管理に係る事務および機関投資家向けの顧問関連事業をNFR&Tから承継し、野村グループのアセット・マネジメント部門内における営業、運用、管理業務を集約します。ファンドおよび運用会社の分析・評価業務は、NFR&Tが集約して行います。

これらの再編により、運用オペレーションの効率化と堅牢性の向上を図り、顧客に対する質の高いサービスの提供が可能となります。また、再編後の当社及びNFR&T両社は、それぞれの専門性を発揮することにより、品質の高い運用商品の提供を行い、投資家の多様なニーズに応えられると判断いたしました。

(2) 会社分割日程

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

(3) 会社分割の方法

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

2. 実施した会計処理の概要

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

セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27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27年4月1日 至 平成27年9月30日
1 株当たり純資産額	17,893円56銭
1 株当たり中間純利益	2,807円57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	14,460百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	14,460百万円
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	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 平成28年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。
株式会社 武蔵野銀行	45,743百万円	

* 平成28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27年 6月25日	有価証券届出書
平成27年 6月25日	有価証券報告書
平成27年12月22日	有価証券届出書の訂正届出書
平成27年12月22日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成27年6月12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26年4月1日から平成27年3月31日までの第56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27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成28年5月20日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマイバランスDC70の平成27年4月1日から平成28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28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27年11月20日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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、分析的な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27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27年4月1日から平成27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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。