

【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29年6月22日提出
【計算期間】	第10期(自 平成28年4月1日至 平成29年3月31日)
【ファンド名】	マイバランスDC70
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

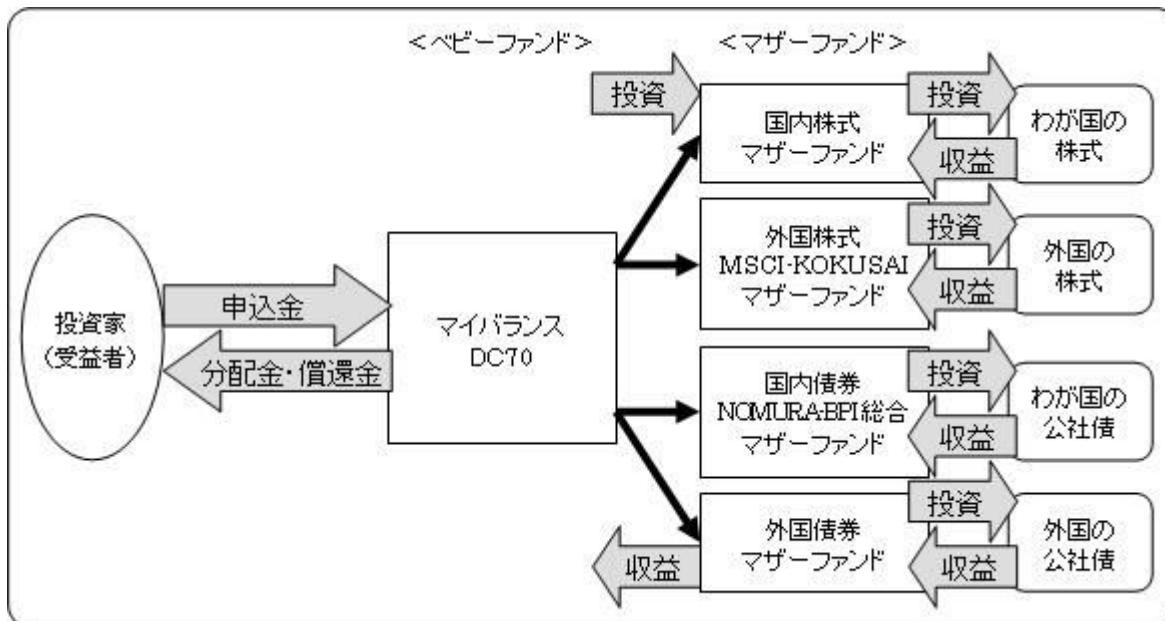
ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

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

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

《ファミリーファンド方式について》

ファンドは「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」「外国債券マザーファンド」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



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

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

信託金の限度額

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

できます。

<商品分類>

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

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

(マイバランスDC70)

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

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

す。

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

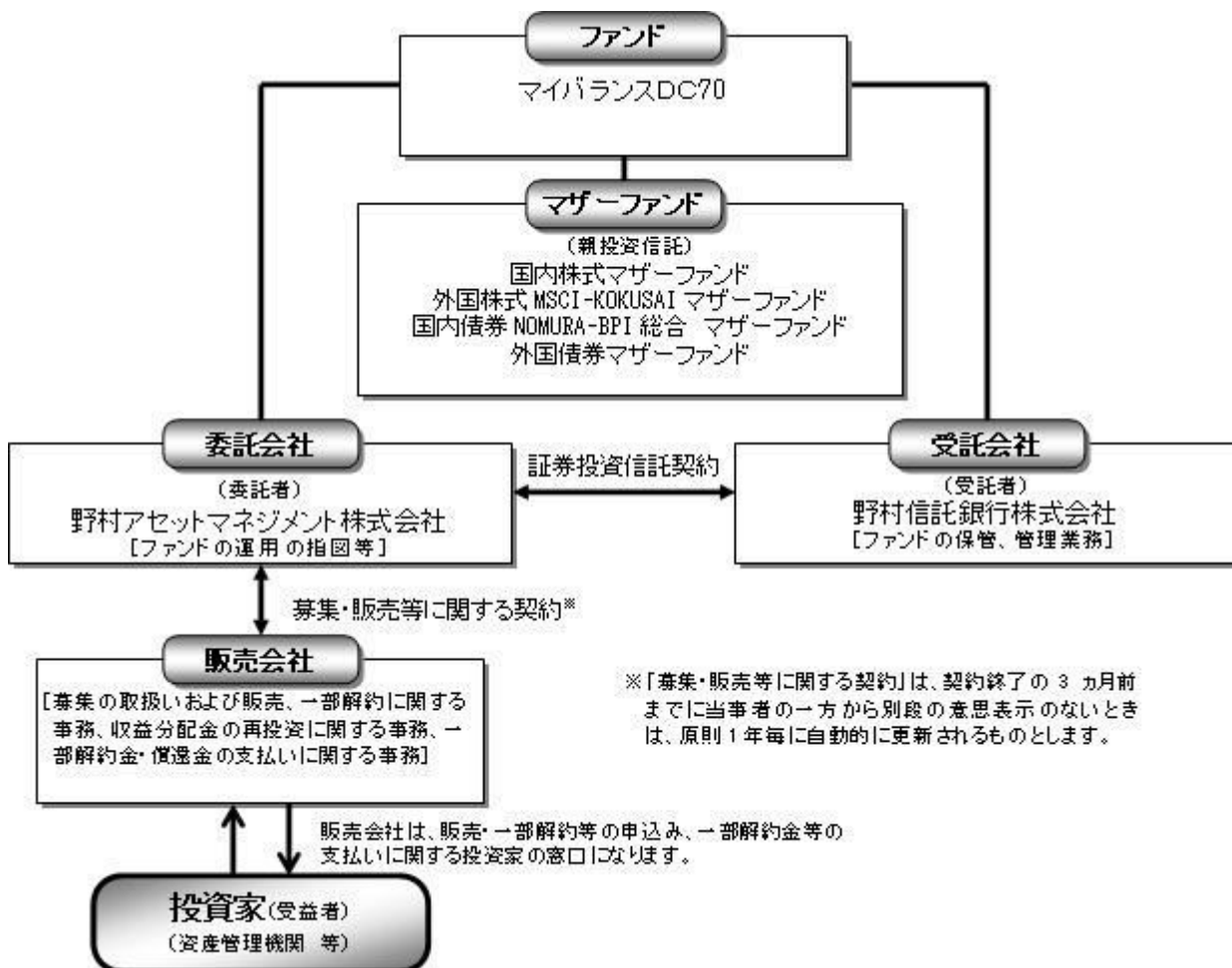
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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29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%

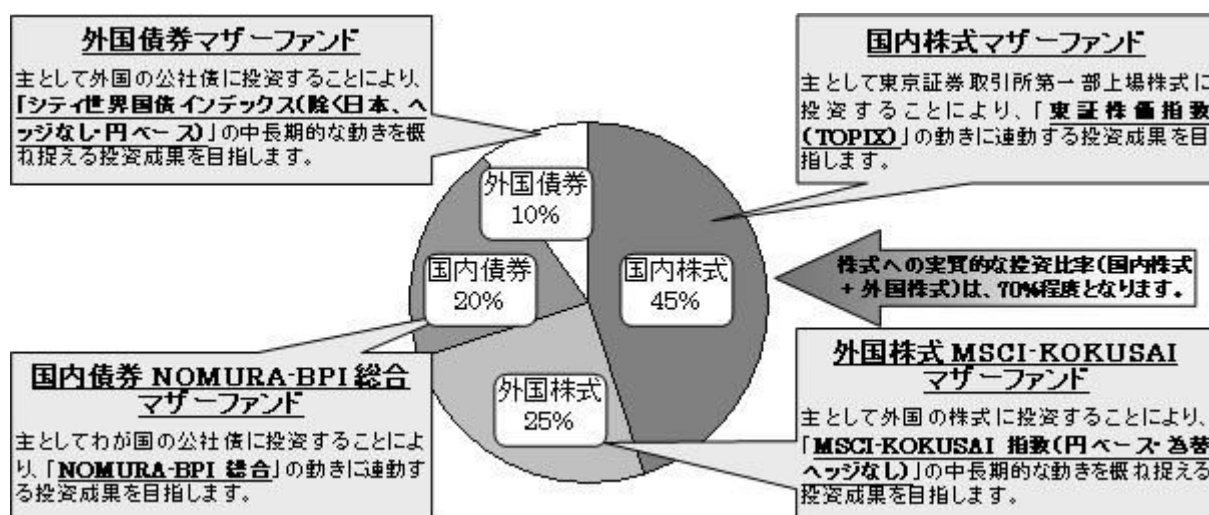
2【投資方針】

(1)【投資方針】

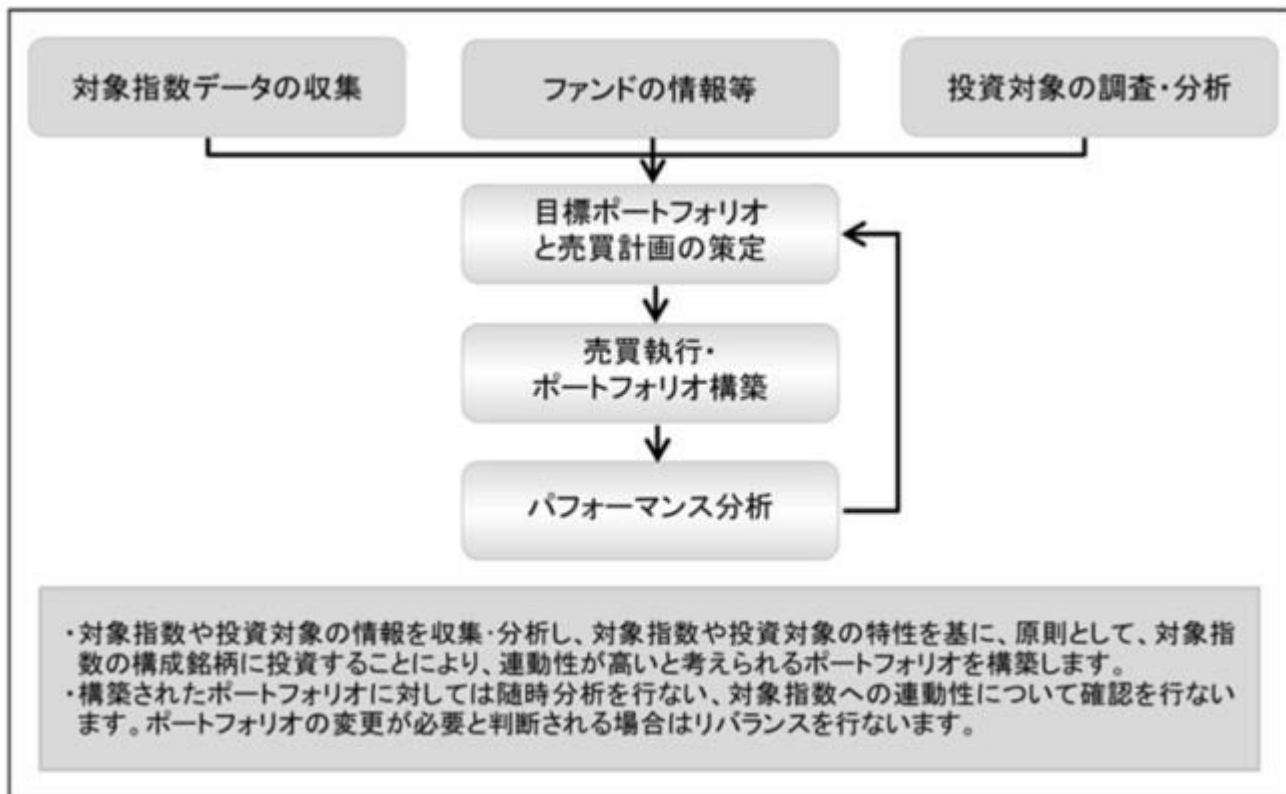
[1] 内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

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。

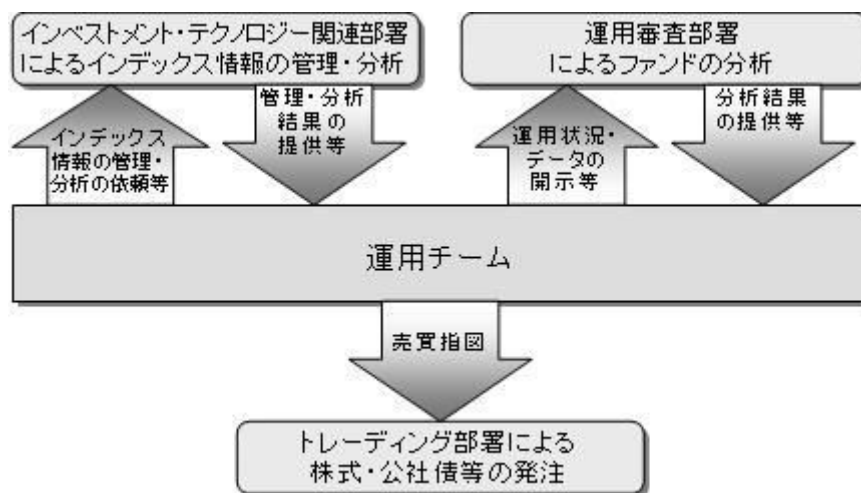
- 1 預金
- 2 指定金銭信託(上記「(2)投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。)
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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】

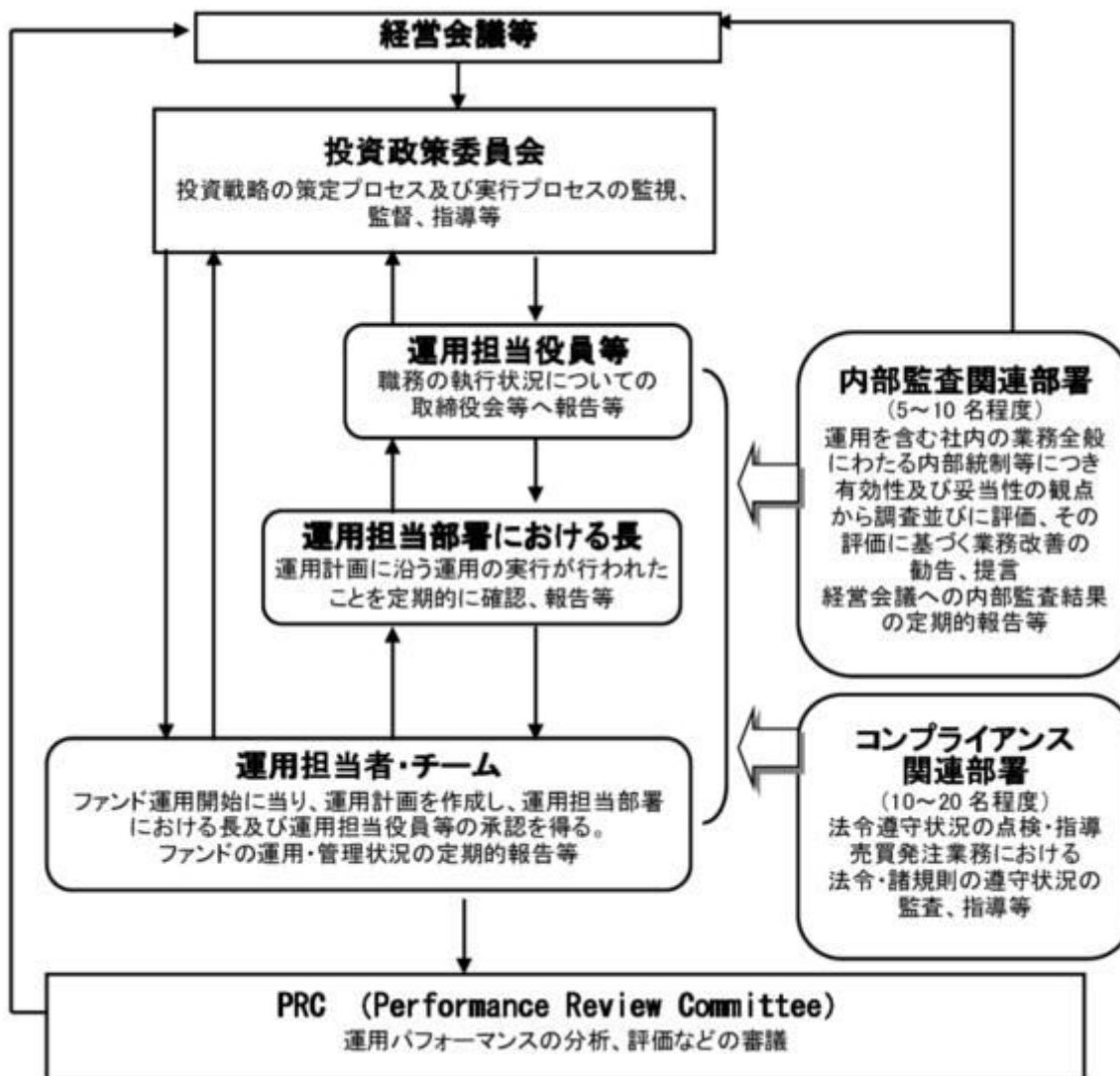
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ()委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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。

()委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

資金の借入れ(約款第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）を超過し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、当該運用収益を超過して分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドについて

「MSCI」の著作権等について

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

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

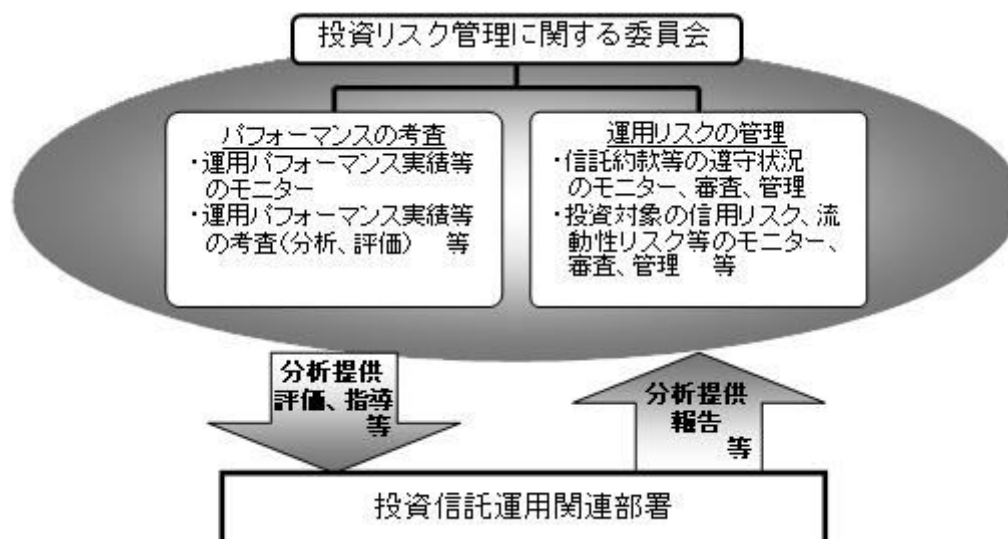
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

リスク管理体制図

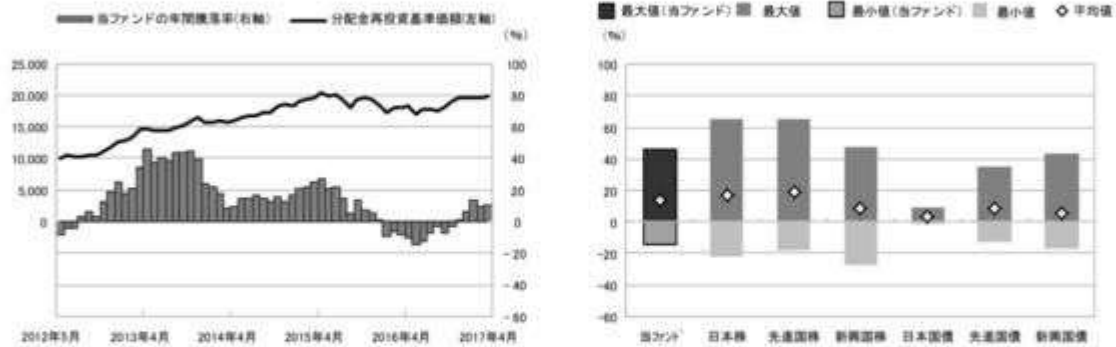


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

リスクの定量的比較

（2012年5月末～2017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	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	△14.4	△22.0	△17.5	△27.4	△1.8	△12.3	△17.4
平均値(%)	13.3	16.9	19.2	8.3	2.9	8.9	5.5

- ＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2012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、2012年5月から2017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。
- ＊2012年5月から2017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-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債：NOMURA-BPI国債
- 先進国債：シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし、円ベース)
- 新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(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-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村証券株式会社(以下「野村証券」)に帰属します。なお、野村証券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし、円ベース)・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし、円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・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値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や機会における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを予測するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。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、或いは伝達または手続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。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPMS, J.P. Morgan Securities PLC、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、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29年 6月22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29年 6月22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。

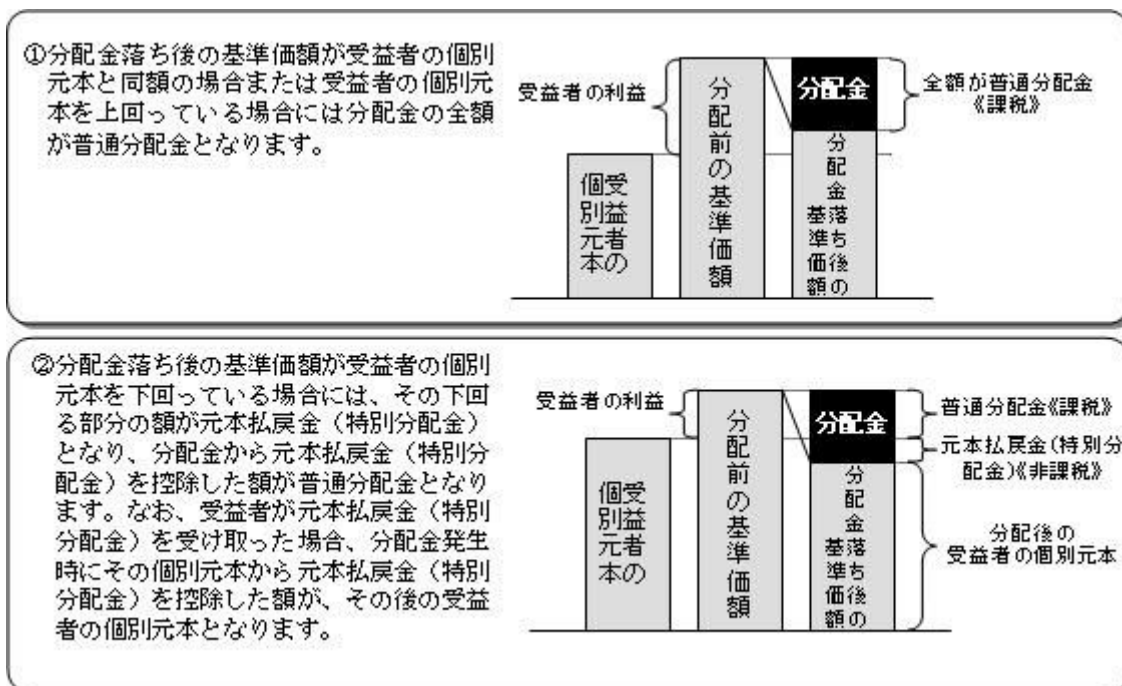
換金(解約)時および償還時の課税について

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29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29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	9,977,977,730	99.95
現金・預金・その他資産(負債控除後)		3,993,289	0.04
合計(純資産総額)		9,981,971,019	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	319,284,565,440	97.90
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,834,725,551	2.09
合計(純資産総額)		326,119,290,991	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	6,579,000,000	2.01

(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	228,620,560,707	62.35
	カナダ	13,558,408,548	3.69
	ドイツ	13,799,348,923	3.76
	イタリア	3,135,775,630	0.85
	フランス	14,481,765,713	3.94
	オランダ	4,734,375,224	1.29
	スペイン	4,980,448,031	1.35
	ベルギー	1,689,890,325	0.46

	オーストリア	306,496,205	0.08
	ルクセンブルグ	90,422,629	0.02
	フィンランド	1,437,009,705	0.39
	アイルランド	681,081,716	0.18
	ポルトガル	220,057,578	0.06
	イギリス	92,869,720	0.02
	イギリス	25,463,204,373	6.94
	スイス	12,771,702,115	3.48
	スウェーデン	4,224,800,526	1.15
	ノルウェー	889,439,848	0.24
	デンマーク	2,484,752,595	0.67
	オーストラリア	9,797,779,198	2.67
	ニュージーランド	238,728,690	0.06
	香港	4,513,010,390	1.23
	シンガポール	1,701,767,656	0.46
	イスラエル	353,700,386	0.09
	小計	350,267,396,431	95.53
投資信託受益証券	アメリカ	22,375,410	0.00
投資証券	アメリカ	7,209,509,719	1.96
	カナダ	80,036,092	0.02
	フランス	486,358,045	0.13
	イギリス	382,720,623	0.10
	オーストラリア	930,498,226	0.25
	香港	197,337,855	0.05
	シンガポール	148,182,245	0.04
	小計	9,434,642,805	2.57
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,910,545,140	1.88
合計（純資産総額）		366,634,959,786	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	4,527,421,877	1.23
	買建	カナダ	268,154,550	0.07
	買建	ドイツ	880,039,363	0.24
	買建	イギリス	494,834,086	0.13
	買建	スイス	246,257,951	0.06
	買建	オーストラリア	172,152,806	0.04

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	549,510,694,810	79.46
地方債証券	日本	53,269,528,920	7.70
特殊債券	日本	56,472,823,789	8.16
社債券	日本	28,020,362,090	4.05
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,230,259,450	0.61
合計（純資産総額）		691,503,669,059	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	287,382,194,053	43.85
	カナダ	13,339,987,546	2.03
	メキシコ	5,683,123,677	0.86
	ドイツ	41,298,217,333	6.30
	イタリア	63,072,972,217	9.62
	フランス	63,771,392,901	9.73
	オランダ	14,411,121,677	2.19
	スペイン	38,875,507,098	5.93
	ベルギー	17,183,352,099	2.62
	オーストリア	9,350,708,712	1.42
	フィンランド	3,894,587,110	0.59
	アイルランド	5,734,315,038	0.87
	イギリス	47,603,773,175	7.26
	スイス	1,192,227,589	0.18
	スウェーデン	2,923,909,355	0.44
	ノルウェー	1,746,259,534	0.26
	デンマーク	3,841,315,954	0.58
	ポーランド	4,360,368,829	0.66
	オーストラリア	13,929,943,016	2.12
	シンガポール	2,659,189,627	0.40
マレーシア	2,722,836,258	0.41	
南アフリカ	3,549,991,968	0.54	
	小計	648,527,294,766	98.96
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,752,287,744	1.03
合計（純資産総額）		655,279,582,510	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	3,072,287,680	1.4401	4,424,413,937	1.4591	4,482,774,953	44.90
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	1,074,259,469	2.3079	2,479,298,245	2.3241	2,496,686,431	25.01
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	1,531,783,423	1.2993	1,990,246,716	1.3056	1,999,896,437	20.03
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	462,366,844	2.1468	992,637,020	2.1598	998,619,909	10.00

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	1,736,400	5,667.17	9,840,473,988	6,035.00	10,479,174,000	3.21
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	10,681,400	511.05	5,458,729,470	709.20	7,575,248,880	2.32
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,131,500	4,998.71	5,656,040,365	4,769.00	5,396,123,500	1.65
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	634,500	6,026.03	3,823,516,035	8,442.00	5,356,449,000	1.64
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,128,700	3,363.11	3,795,942,257	4,124.00	4,654,758,800	1.42
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,285,200	3,034.09	3,899,412,468	3,232.00	4,153,766,400	1.27
7	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,394,500	3,258.34	4,543,755,130	2,955.50	4,121,444,750	1.26
8	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,137,800	166.02	3,177,257,556	203.60	3,896,456,080	1.19
9	日本	株式	ソニー	電気機器	1,008,700	2,723.38	2,747,073,406	3,759.00	3,791,703,300	1.16
10	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	886,900	4,547.54	4,033,213,226	3,706.00	3,286,851,400	1.00
11	日本	株式	ファナック	電気機器	144,800	16,387.82	2,372,956,336	22,655.00	3,280,444,000	1.00
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	560,900	5,249.21	2,944,281,889	5,342.00	2,996,327,800	0.91
13	日本	株式	キーエンス	電気機器	64,700	33,486.75	2,166,592,725	44,800.00	2,898,560,000	0.88
14	日本	株式	キャノン	電気機器	768,900	3,073.14	2,362,937,346	3,696.00	2,841,854,400	0.87
15	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,037,600	2,792.17	2,897,155,592	2,688.00	2,789,068,800	0.85
16	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	590,000	4,734.35	2,793,266,500	4,710.00	2,778,900,000	0.85
17	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	276,300	9,792.47	2,705,659,461	9,954.00	2,750,290,200	0.84
18	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	567,700	3,727.54	2,116,124,458	4,692.00	2,663,648,400	0.81

19	日本	株式	信越化学工業	化学	268,300	6,309.76	1,692,908,608	9,684.00	2,598,217,200	0.79
20	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,057,700	1,821.64	1,926,748,628	2,403.50	2,542,181,950	0.77
21	日本	株式	任天堂	その他製品	88,000	15,566.54	1,369,855,520	28,045.00	2,467,960,000	0.75
22	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,523,500	1,248.45	1,902,013,575	1,554.00	2,367,519,000	0.72
23	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	504,800	4,108.89	2,074,167,672	4,648.00	2,346,310,400	0.71
24	日本	株式	花王	化学	373,200	6,079.25	2,268,776,100	6,148.00	2,294,433,600	0.70
25	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,528,200	1,483.81	2,267,558,442	1,468.00	2,243,397,600	0.68
26	日本	株式	村田製作所	電気機器	149,800	12,894.62	1,931,614,076	14,945.00	2,238,761,000	0.68
27	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,048,400	2,136.71	2,240,126,764	2,130.00	2,233,092,000	0.68
28	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	118,800	19,371.83	2,301,373,404	18,685.00	2,219,778,000	0.68
29	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,640,200	957.35	1,570,245,470	1,330.50	2,182,286,100	0.66
30	日本	株式	ダイキン工業	機械	195,000	8,858.61	1,727,428,950	10,825.00	2,110,875,000	0.64

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	0.31
		建設業	2.95
		食料品	4.47
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	0.25
		化学	6.70
		医薬品	4.63
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.97
		ガラス・土石製品	0.98
		鉄鋼	1.20
		非鉄金属	0.94
		金属製品	0.71
		機械	5.08
		電気機器	12.57
		輸送用機器	8.75
		精密機器	1.55
		その他製品	1.85
		電気・ガス業	1.78
		陸運業	4.11
		海運業	0.23
		空運業	0.54
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.70		
卸売業	4.36		
小売業	4.66		
銀行業	7.95		

	証券、商品先物取引業	1.13
	保険業	2.54
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.38
	サービス業	3.74
合 計		97.90

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピ ュー タ・周 辺機 器	522,400	16,015.94	8,366,731,190	16,002.38	8,359,648,066	2.28
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェ ア	723,900	7,312.53	5,293,546,530	7,597.76	5,500,024,472	1.50
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	イン ター ネッ ト販 売・通 信販 売	39,590	97,545.60	3,861,830,461	102,206.51	4,046,355,739	1.10
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	イン ター ネッ トソ フト ウェ ア・ サー ビス	229,500	15,849.23	3,637,399,325	16,437.53	3,772,413,824	1.02
5	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ ガス ・消 耗燃 料	406,500	9,312.90	3,785,696,687	9,043.42	3,676,152,425	1.00
6	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	266,700	13,871.22	3,699,454,648	13,771.02	3,672,732,261	1.00
7	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	350,800	9,905.12	3,474,716,886	9,750.11	3,420,341,009	0.93
8	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	30,450	92,545.30	2,818,004,472	97,295.28	2,962,641,352	0.80
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	イン ター ネッ トソ フト ウェ ア・ サー ビス	29,030	94,546.53	2,744,685,921	99,208.35	2,880,018,621	0.78
10	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	467,900	6,256.14	2,927,248,898	6,058.62	2,834,831,854	0.77
11	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コン グロ マリ ット	867,400	3,324.37	2,883,560,495	3,236.31	2,807,178,070	0.76
12	アメリカ	株式	AT & T INC	各種 電気 通信 サー ビス	602,200	4,646.11	2,797,889,816	4,441.58	2,674,721,825	0.72
13	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	305,200	8,649.43	2,639,808,060	8,667.42	2,645,299,483	0.72
14	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	991,000	2,655.82	2,631,924,536	2,632.00	2,608,320,424	0.71
15	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭 用品	250,800	10,037.88	2,517,501,070	9,759.02	2,447,562,241	0.66
16	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	595,200	3,822.26	2,275,011,156	3,768.27	2,242,879,899	0.61
17	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種 金融 サー ビス	120,120	18,622.29	2,236,910,307	18,535.34	2,226,466,182	0.60
18	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ ガス ・消 耗燃 料	185,200	11,992.20	2,220,955,562	11,737.75	2,173,832,467	0.59
19	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種 電気 通信 サー ビス	399,900	5,459.06	2,183,079,560	5,193.90	2,077,042,330	0.56
20	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門 小売 り	119,500	16,354.65	1,954,381,062	17,374.59	2,076,264,079	0.56
21	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	467,700	4,174.69	1,952,504,310	4,405.97	2,060,672,683	0.56
22	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	68,930	28,857.95	1,989,179,072	29,130.17	2,007,942,825	0.54

23	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	465,000	3,978.95	1,850,215,855	4,165.58	1,936,996,886	0.52
24	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	402,000	4,741.42	1,906,051,283	4,786.58	1,924,206,326	0.52
25	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	メディア	148,300	12,596.55	1,868,068,406	12,891.83	1,911,858,923	0.52
26	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	219,100	8,396.88	1,839,758,095	8,605.87	1,885,548,089	0.51
27	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	270,500	7,060.71	1,909,922,715	6,964.52	1,883,904,878	0.51
28	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	183,200	9,906.75	1,814,916,707	10,194.16	1,867,570,845	0.50
29	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	152,200	12,630.01	1,922,287,596	12,263.04	1,866,435,464	0.50
30	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	492,600	3,754.15	1,849,296,035	3,756.03	1,850,224,073	0.50

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	不動産管理・開発	0.55
		エネルギー設備・サービス	0.65
		石油・ガス・消耗燃料	6.03
		化学	2.67
		建設資材	0.35
		容器・包装	0.29
		金属・鉱業	1.36
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.94
		建設関連製品	0.40
		建設・土木	0.33
		電気設備	0.77
		コングロマリット	2.14
		機械	1.54
		商社・流通業	0.29
		商業サービス・用品	0.36
		航空貨物・物流サービス	0.55
		旅客航空輸送業	0.14
		海運業	0.07
		陸運・鉄道	0.90
		運送インフラ	0.24
		自動車部品	0.47
		自動車	1.00
		家庭用耐久財	0.43
		レジャー用品	0.07
		繊維・アパレル・贅沢品	1.21
ホテル・レストラン・レジャー	1.80		
メディア	2.66		
販売	0.07		
インターネット販売・通信販売	1.67		

複合小売り	0.37
専門小売り	1.78
食品・生活必需品小売り	1.89
飲料	2.02
食品	2.10
タバコ	1.62
家庭用品	1.43
パーソナル用品	0.72
ヘルスケア機器・用品	1.95
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.89
バイオテクノロジー	2.27
医薬品	5.75
銀行	9.32
各種金融サービス	0.90
保険	4.08
インターネットソフトウェア・サービス	3.03
情報技術サービス	2.68
ソフトウェア	3.58
通信機器	0.82
コンピュータ・周辺機器	2.64
電子装置・機器・部品	0.40
半導体・半導体製造装置	2.47
各種電気通信サービス	2.39
無線通信サービス	0.36
電力	1.85
ガス	0.14
総合公益事業	1.10
水道	0.09
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01
消費者金融	0.51
資本市場	2.76
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	0.03
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.51
専門サービス	0.61
投資信託受益証券	0.00
投資証券	2.57
合 計	98.11

(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	100.90	8,274,210,000	100.97	8,279,622,000	0.1	2020/9/20	1.19
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	8,100,000,000	100.87	8,170,551,000	100.91	8,174,034,000	0.1	2020/6/20	1.18
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	8,100,000,000	100.75	8,161,236,000	100.68	8,155,809,000	0.2	2018/12/20	1.17
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	7,800,000,000	100.77	7,860,528,000	100.78	7,860,918,000	0.1	2019/12/20	1.13
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	7,500,000,000	100.67	7,550,250,000	101.15	7,586,775,000	0.1	2026/3/20	1.09
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	7,200,000,000	102.43	7,375,320,000	102.94	7,412,112,000	0.3	2025/12/20	1.07
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	100.83	7,360,736,000	100.85	7,362,415,000	0.1	2020/3/20	1.06
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	7,300,000,000	100.64	7,347,085,000	100.57	7,341,610,000	0.2	2018/9/20	1.06
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	6,900,000,000	100.59	6,941,124,000	101.09	6,975,762,000	0.1	2026/6/20	1.00
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	6,800,000,000	100.43	6,829,512,000	100.96	6,865,484,000	0.1	2026/12/20	0.99
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	6,200,000,000	101.03	6,264,356,000	101.14	6,270,990,000	0.1	2021/6/20	0.90
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	6,000,000,000	103.29	6,197,820,000	103.78	6,227,340,000	0.4	2025/9/20	0.90
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	5,900,000,000	103.28	6,093,756,000	103.71	6,119,303,000	0.4	2025/6/20	0.88
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	6,000,000,000	101.07	6,064,620,000	101.19	6,071,580,000	0.1	2021/9/20	0.87
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	100.99	6,059,700,000	101.09	6,065,640,000	0.1	2021/3/20	0.87
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	5,900,000,000	100.81	5,948,144,000	100.79	5,946,787,000	0.2	2019/3/20	0.85
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,800,000,000	100.51	5,830,044,000	101.03	5,859,914,000	0.1	2026/9/20	0.84
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,500,000,000	104.16	5,729,075,000	104.35	5,739,690,000	0.6	2023/3/20	0.83
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	105.52	5,592,825,000	105.75	5,604,750,000	0.8	2023/6/20	0.81
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	5,500,000,000	100.95	5,552,360,000	101.04	5,557,365,000	0.1	2020/12/20	0.80
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	100.96	5,553,075,000	100.94	5,552,030,000	0.2	2019/9/20	0.80
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	105.02	5,198,490,000	105.05	5,199,975,000	1.2	2020/12/20	0.75

23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,900,000,000	104.97	5,143,628,000	105.13	5,151,370,000	0.8	2022/9/20	0.74
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	4,900,000,000	103.26	5,059,985,000	103.72	5,082,525,000	0.4	2025/3/20	0.73
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	5,000,000,000	101.13	5,056,900,000	101.30	5,065,400,000	0.1	2021/12/20	0.73
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 8回	5,000,000,000	100.88	5,044,400,000	100.85	5,042,850,000	0.2	2019/6/20	0.72
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 3回	5,000,000,000	100.66	5,033,000,000	100.58	5,029,250,000	0.3	2018/6/20	0.72
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第37 2回	5,000,000,000	100.60	5,030,000,000	100.54	5,027,400,000	0.1	2019/1/15	0.72
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 9回	4,700,000,000	100.66	4,731,302,000	100.64	4,730,221,000	0.1	2019/6/20	0.68
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 46回	3,700,000,000	120.17	4,446,364,000	121.20	4,484,511,000	1.7	2033/9/20	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.46
地方債証券	7.70
特殊債券	8.16
社債券	4.05
合計	99.38

(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	43,200,000	15,418.19	6,660,659,316	14,488.56	6,259,060,890	6	2026/2/15	0.95
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,800,000	12,205.38	6,322,388,089	11,808.47	6,116,790,901	3.625	2020/2/15	0.93
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	11,843.68	6,229,780,179	11,525.47	6,062,397,549	2.625	2020/11/15	0.92
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	51,200,000	11,726.92	6,004,184,532	11,311.58	5,791,531,315	2.375	2024/8/15	0.88
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	12,050.62	5,940,955,814	11,691.53	5,763,926,921	3.375	2019/11/15	0.87
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,700,000	12,183.91	5,811,725,129	11,803.69	5,630,362,813	3.5	2020/5/15	0.85
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	12,378.52	5,669,365,242	11,949.76	5,472,991,798	3.625	2021/2/15	0.83
8	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	15,759.71	5,216,466,080	15,102.62	4,998,968,709	3.5	2026/4/25	0.76
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,700,000	10,999.74	4,916,886,187	10,978.58	4,907,426,947	2	2025/2/15	0.74
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,500,000	11,826.30	5,026,177,861	11,522.42	4,897,031,408	2.625	2020/8/15	0.74
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	32,000,000	15,860.37	5,075,320,048	15,289.94	4,892,781,440	4.25	2023/10/25	0.74
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,200,000	11,301.72	4,769,325,994	10,968.15	4,628,559,442	1.75	2023/5/15	0.70

13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,400,000	12,156.92	4,668,259,024	11,749.78	4,511,918,966	3.125	2021/5/15	0.68
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000	19,205.39	4,705,321,337	18,306.53	4,485,102,122	5.5	2029/4/25	0.68
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,500,000	11,651.62	4,369,360,335	11,431.13	4,286,675,454	2.75	2019/2/15	0.65
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,600,000	11,558.80	4,346,109,021	11,341.14	4,264,271,108	2.125	2020/8/31	0.65
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	12,061.00	4,450,510,389	11,206.38	4,135,154,607	3	2044/11/15	0.63
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,700,000	11,947.79	4,265,361,103	11,560.68	4,127,163,752	3.75	2018/11/15	0.62
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,300,000	11,470.89	4,163,935,678	11,126.39	4,038,880,064	2.25	2025/11/15	0.61
20	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	21,050,000	17,204.23	3,621,490,499	18,898.23	3,978,079,183	3.25	2044/1/22	0.60
21	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,000,000	18,143.16	3,628,632,753	19,847.17	3,969,434,000	3.5	2045/1/22	0.60
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	13,944.97	4,071,932,589	13,420.39	3,918,754,610	4.25	2020/3/1	0.59
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000	21,014.16	4,118,777,070	19,848.28	3,890,263,497	5.75	2032/10/25	0.59
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	11,651.84	3,961,627,968	11,315.06	3,847,121,220	2.125	2021/6/30	0.58
25	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000	20,581.96	3,992,900,919	19,610.20	3,804,380,478	6.5	2027/7/4	0.58
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	11,537.64	3,888,185,493	11,237.68	3,787,098,619	2	2022/2/15	0.57
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,600,000	13,271.86	3,928,470,708	12,785.32	3,784,456,422	4.5	2018/8/1	0.57
28	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	27,500,000	13,865.10	3,812,903,545	13,568.47	3,731,329,251	4	2020/4/30	0.56
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,300,000	13,545.73	3,697,986,434	13,307.39	3,632,919,586	2.5	2020/10/25	0.55
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	23,700,000	16,023.43	3,797,554,108	15,092.83	3,577,002,123	6.125	2027/11/15	0.54

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.96
合計	98.96

【投資不動産物件】

マイバランスDC70

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

マイバランスDC70

該当事項はありません。

(参考) 国内株式マザーファンド

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2017年06月限)	買建	430	日本円	6,545,501,980	6,579,000,000	2.01

(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(2017 年06月限)	買建	341	米ドル	40,334,825	4,488,862,683	40,681,300	4,527,421,877	1.23
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2017年06 月限)	買建	18	カナダド ル	3,296,520	269,094,930	3,285,000	268,154,550	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(2017年06月 限)	買建	208	ユーロ	7,126,990	861,296,737	7,282,080	880,039,363	0.24
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200株価指数先 物(2017年06月限)	買建	14	豪ドル	2,058,000	171,307,920	2,068,150	172,152,806	0.04
	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(2017年06月限)	買建	48	英ポンド	3,490,140	501,044,497	3,446,880	494,834,086	0.13
	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 (2017年06月限)	買建	25	スイスフ ラン	2,146,790	240,247,272	2,200,500	246,257,951	0.06

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

マイバランスDC70

平成29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
第10計算期間 (2017年 3月31日)	9,689	9,693	1.2865	1.2870
2016年 4月末日	7,703		1.1718	
5月末日	7,971		1.1924	
6月末日	7,449		1.1086	
7月末日	7,902		1.1561	
8月末日	7,956		1.1547	
9月末日	7,996		1.1473	
10月末日	8,306		1.1799	
11月末日	8,888		1.2395	
12月末日	9,178		1.2806	
2017年 1月末日	9,202		1.2762	
2月末日	9,356		1.2877	
3月末日	9,689		1.2865	
4月末日	9,981		1.2982	

【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
第10計算期間	2016年 4月 1日～2017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%
第10計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	9.3%

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
第10計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2017年 3月31日	2,013,180,892	994,706,771	7,531,622,693

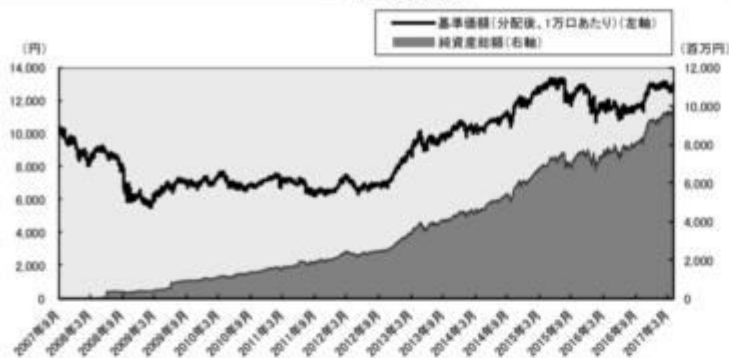
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

運用実績 (2017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)

2017年3月	5 円
2016年3月	5 円
2015年3月	5 円
2014年3月	5 円
2013年4月	0 円
設定来累計	20 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	44.9
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	25.0
3	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	20.0
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	1.4
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.0
3	日本電信電話	情報・通信業	0.7
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.7
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.6

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.6
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.4
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.3
4	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	0.3
5	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.3

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

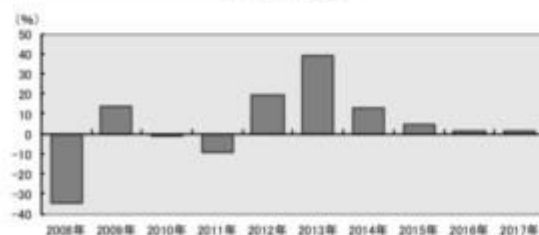
順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国債債券 利付(5年)第125回	国債証券	0.2
2	国債債券 利付(5年)第124回	国債証券	0.2
3	国債債券 利付(5年)第116回	国債証券	0.2
4	国債債券 利付(5年)第122回	国債証券	0.2
5	国債債券 利付(10年)第342回	国債証券	0.2

・「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 BOND	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。
 ・2017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ます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2【換金(解約)手続等】

受益者は、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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

一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、一部解約の実行の請求が行なわれかつ当該請求の受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込み分とします。

換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社
サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

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

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

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

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

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

2 残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)による評価をいいます。

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続

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

自動けいぞく投資契約に基づいて、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

換金(解約)の単位

受益者は、受益権を1口単位で換金できます。

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

換金(解約)代金の支払い開始日

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者にお支払いします。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(平成28年4月1日から平成29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9期 (平成28年 3月31日現在)	第10期 (平成29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	10,336,037	37,269,010
親投資信託受益証券	7,666,491,928	9,685,581,711
流動資産合計	7,687,739,645	9,722,850,721
資産合計	7,687,739,645	9,722,850,721
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,256,574	3,765,811
未払解約金	5,124,233	17,687,801
未払受託者報酬	1,186,526	1,446,139
未払委託者報酬	8,305,630	10,122,910
未払利息	-	59
その他未払費用	118,594	144,551
流動負債合計	17,991,557	33,167,271
負債合計	17,991,557	33,167,271
純資産の部		
元本等		
元本	6,513,148,572	7,531,622,693
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,156,599,516	2,158,060,757
(分配準備積立金)	1,639,934,434	1,628,849,546
元本等合計	7,669,748,088	9,689,683,450
純資産合計	7,669,748,088	9,689,683,450
負債純資産合計	7,687,739,645	9,722,850,721

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日	自	平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日
営業収益				
受取利息		8,606		-
有価証券売買等損益		494,820,888		810,376,643
営業収益合計		494,812,282		810,376,643
営業費用				
支払利息		-		6,695
受託者報酬		2,338,169		2,698,220
委託者報酬		16,367,102		18,887,455
その他費用		233,701		269,700
営業費用合計		18,938,972		21,862,070
営業利益又は営業損失（ ）		513,751,254		788,514,573
経常利益又は経常損失（ ）		513,751,254		788,514,573
当期純利益又は当期純損失（ ）		513,751,254		788,514,573
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（ ）		15,407,250		43,706,995
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,388,670,524		1,156,599,516
剰余金増加額又は欠損金減少額		575,970,450		437,144,684
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		575,970,450		437,144,684
剰余金減少額又は欠損金増加額		306,440,880		176,725,210
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		306,440,880		176,725,210
分配金		3,256,574		3,765,811
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,156,599,516		2,158,060,757

(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28年 4月 1日から平成29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9期 平成28年 3月31日現在	第10期 平成29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 6,513,148,572口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 7,531,622,693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 1.1776円 (10,000口当たり純資産額) (11,776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 1.2865円 (10,000口当たり純資産額) (12,865円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日	第10期 自 平成28年 4月 1日 至 平成29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>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	<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>161,173,494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>49,030,162円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,560,812,236円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,422,411,701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>4,193,427,593円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>7,531,622,693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>5,567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>3,765,811円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	161,173,494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	49,030,162円	収益調整金額	C	2,560,812,236円	分配準備積立金額	D	1,422,411,701円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,193,427,593円	当ファンドの期末残存口数	F	7,531,622,693口	10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	5,567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	3,765,811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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	161,173,494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	49,030,162円																																																											
収益調整金額	C	2,560,812,236円																																																											
分配準備積立金額	D	1,422,411,701円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,193,427,593円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	7,531,622,693口																																																											
10,000口当たり収益分配対象 額	G=E/F×10,000	5,567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	3,765,811円																																																											
	2. 追加情報																																																												

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

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日	第10期 自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</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>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第9期 平成28年 3月31日現在	第10期 平成29年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	2. 時価の算定方法 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日	第10期 自 平成28年 4月 1日 至 平成29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9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日	第10期 自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日
期首元本額 5,343,815,596円	期首元本額 6,513,148,572円
期中追加設定元本額 2,335,022,495円	期中追加設定元本額 2,013,180,892円
期中一部解約元本額 1,165,689,519円	期中一部解約元本額 994,706,771円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第9期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日	第10期 自 平成28年 4月 1日 至 平成29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	501,135,396	784,550,016
合計	501,135,396	784,550,016

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29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29年 3月31日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	2,987,910,587	4,304,085,200	
		外国債券マザーファンド	453,222,108	972,931,899	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,070,344,629	2,470,569,472	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,491,798,276	1,937,995,140	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：100.0%	6,003,275,600	9,685,581,711 100.0%	
合計				9,685,581,711	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「国内債券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29年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	28,007,642,825
株式	312,032,406,096
派生商品評価勘定	526,738
未収入金	43,355,500
未収配当金	2,877,446,828
未収利息	2,146,920
その他未収収益	93,333,175
差入委託証拠金	303,527,008
流動資産合計	343,360,385,090
資産合計	343,360,385,090
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	116,767,652
未払金	20,478,700
未払解約金	199,558,320
未払利息	44,935
有価証券貸借取引受入金	23,853,477,889
流動負債合計	24,190,327,496
負債合計	24,190,327,496
純資産の部	
元本等	
元本	221,566,331,400
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	97,603,726,194
元本等合計	319,170,057,594
純資産合計	319,170,057,594
負債純資産合計	343,360,385,090

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29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	1,4405円
(10,000口当たり純資産額)	(14,405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	22,327,416,070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28年 4月 1日 至 平成29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29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>	

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年 3月31日現在	
期首	平成28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	226,101,018,220円
同期中における追加設定元本額	31,844,136,407円
同期中における一部解約元本額	36,378,823,227円
期末元本額	221,566,331,400円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	178,169,715円
バランスセレクト50	421,760,865円
バランスセレクト70	494,436,379円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,391,854,105円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	4,180,689,607円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	8,035,215,067円
野村資産設計ファンド2015	71,549,154円
野村資産設計ファンド2020	84,936,697円
野村資産設計ファンド2025	113,078,883円
野村資産設計ファンド2030	106,076,188円
野村資産設計ファンド2035	82,071,951円
野村資産設計ファンド2040	251,163,350円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	77,362,962,726円
のむらップ・ファンド（保守型）	2,273,765,204円
のむらップ・ファンド（普通型）	5,057,450,138円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,583,198,096円
野村資産設計ファンド2045	26,877,218円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,183,393,034円
マイ・ロード	3,464,911,575円
ネクストコア	218,852,083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	443,472,372円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,425,078,694円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,225,604,388円
野村資産設計ファンド2050	32,008,341円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	9,809,373円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,928,699円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,301,781円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,073,328円

のむラップ・ファンド(やや保守型)	172,354,984円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	49,291,247円
インデックス・ブレンド(タイプ)	92,040円
インデックス・ブレンド(タイプ)	85,154円
インデックス・ブレンド(タイプ)	240,002円
インデックス・ブレンド(タイプ)	281,690円
インデックス・ブレンド(タイプ)	307,960円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	3,161,869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)	696,468,004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)	599,135,551円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	2,566,569,159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)	1,018,835,965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)	4,469,649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)	26,527,201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)	8,008,221円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	6,346,121,241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)	416,887,465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)	2,754,699,332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)	1,106,018,663円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,848,911,845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)	393,097,628円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	122,917,908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)	350,639,522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)	5,606,632,975円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	792,774,363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)	623,735,118円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	1,048,611,854円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	1,817,986,363円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,094,044円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	32,371,338円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	37,076,667円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	97,400,573円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,109,750,486円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,578,649,403円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,807,703,517円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	31,666,893,088円
マイバランスDC30	2,395,285,129円
マイバランスDC50	3,325,402,853円
マイバランスDC70	2,987,910,587円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,868,941,418円
野村DC運用戦略ファンド	362,758,159円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	3,073,258円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	177,289,416円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	3,965,492円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	7,213,988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29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	6,200	2,936.00	18,203,200	貸付有価証券 2,900株
		日本水産	206,000	555.00	114,330,000	
		マルハニチロ	30,100	3,370.00	101,437,000	貸付有価証券 700株
		カネコ種苗	5,400	1,463.00	7,900,200	
		サカタのタネ	23,400	3,485.00	81,549,000	貸付有価証券 9,200株(1,000株)
		ホクト	16,100	2,007.00	32,312,700	
		ホクリヨウ	1,700	827.00	1,405,900	貸付有価証券 500株(500株)
		住石ホールディングス	44,000	96.00	4,224,000	貸付有価証券 14,200株(12,600株)
		日鉄鉱業	4,400	6,020.00	26,488,000	
		三井松島産業	9,800	1,425.00	13,965,000	
		国際石油開発帝石	835,500	1,094.50	914,454,750	
		日本海洋掘削	5,500	2,341.00	12,875,500	貸付有価証券 2,500株(300株)
		石油資源開発	25,100	2,549.00	63,979,900	
		K & Oエナジーグループ	10,700	1,768.00	18,917,600	貸付有価証券 600株
		ショーボンドホールディングス	15,300	4,895.00	74,893,500	貸付有価証券 7,200株
		ミライト・ホールディングス	48,800	1,093.00	53,338,400	貸付有価証券 9,900株(4,400株)
		タマホーム	11,900	635.00	7,556,500	貸付有価証券 1,600株(1,300株)
		サンヨーホームズ	3,300	661.00	2,181,300	貸付有価証券 1,500株
ファーストコーポレーション	2,600	1,056.00	2,745,600	貸付有価証券 100株		

インベスターズクラウド	1,500	4,690.00	7,035,000	貸付有価証券 700株(700株)
ダイセキ環境ソリューション	4,400	1,253.00	5,513,200	貸付有価証券 1,800株
安藤・間	114,000	749.00	85,386,000	貸付有価証券 33,600株
東急建設	56,300	875.00	49,262,500	貸付有価証券 23,100株
コムシスホールディングス	62,000	1,989.00	123,318,000	貸付有価証券 100株
ミサワホーム	18,700	1,040.00	19,448,000	貸付有価証券 6,800株(4,500株)
ピーアールホールディングス	15,700	446.00	7,002,200	貸付有価証券 1,000株
高松コンストラクショングループ	12,000	2,603.00	31,236,000	
東建コーポレーション	5,900	8,750.00	51,625,000	
ソネック	2,000	683.00	1,366,000	
ヤマウラ	7,400	623.00	4,610,200	貸付有価証券 3,400株
大成建設	806,000	811.00	653,666,000	
大林組	475,600	1,041.00	495,099,600	
清水建設	485,000	998.00	484,030,000	貸付有価証券 33,000株
飛島建設	152,800	170.00	25,976,000	貸付有価証券 33,800株
長谷工コーポレーション	185,100	1,204.00	222,860,400	
松井建設	17,500	1,000.00	17,500,000	
銭高組	23,000	401.00	9,223,000	貸付有価証券 2,000株
鹿島建設	697,000	726.00	506,022,000	
不動テトラ	128,000	192.00	24,576,000	貸付有価証券 100株
大末建設	5,600	996.00	5,577,600	
鉄建建設	96,000	335.00	32,160,000	貸付有価証券 45,000株(1,000株)
西松建設	183,000	548.00	100,284,000	
三井住友建設	607,700	121.00	73,531,700	貸付有価証券 100株
大豊建設	57,000	554.00	31,578,000	
前田建設工業	104,000	986.00	102,544,000	

佐田建設	10,900	425.00	4,632,500	
ナカノフード建設	12,100	643.00	7,780,300	
奥村組	130,000	676.00	87,880,000	
東鉄工業	19,000	3,195.00	60,705,000	貸付有価証券 1,500株(300株)
イチケン	14,000	440.00	6,160,000	
浅沼組	55,000	320.00	17,600,000	
戸田建設	184,000	670.00	123,280,000	
熊谷組	249,000	290.00	72,210,000	
青木あすなろ建設	10,400	806.00	8,382,400	
北野建設	33,000	303.00	9,999,000	
植木組	20,000	256.00	5,120,000	
三井ホーム	20,000	622.00	12,440,000	
矢作建設工業	21,600	983.00	21,232,800	
ピーエス三菱	16,700	422.00	7,047,400	貸付有価証券 4,100株(1,100株)
日本ハウスホールディングス	32,300	488.00	15,762,400	貸付有価証券 600株
大東建託	58,300	15,295.00	891,698,500	
新日本建設	18,900	894.00	16,896,600	
N I P P O	37,000	2,111.00	78,107,000	
東亜道路工業	30,000	333.00	9,990,000	貸付有価証券 1,000株
前田道路	50,000	1,967.00	98,350,000	
日本道路	47,000	511.00	24,017,000	
東亜建設工業	12,900	2,019.00	26,045,100	貸付有価証券 400株(400株)
若築建設	91,000	146.00	13,286,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
東洋建設	45,600	400.00	18,240,000	貸付有価証券 100株(100株)
五洋建設	176,000	538.00	94,688,000	
大林道路	16,500	664.00	10,956,000	
世紀東急工業	23,100	531.00	12,266,100	
福田組	26,000	1,015.00	26,390,000	
住友林業	109,200	1,690.00	184,548,000	
日本基礎技術	17,600	357.00	6,283,200	
日成ビルド工業	47,000	551.00	25,897,000	

ヤマダ・エスバイエルホーム	81,000	79.00	6,399,000	
巴コーポレーション	19,700	366.00	7,210,200	
パナホーム	59,000	1,020.00	60,180,000	貸付有価証券 27,000株
大和ハウス工業	468,500	3,196.00	1,497,326,000	
ライト工業	30,500	1,132.00	34,526,000	
積水ハウス	499,000	1,831.00	913,669,000	貸付有価証券 56,600株(56,600株)
日特建設	13,500	434.00	5,859,000	
北陸電気工事	7,700	884.00	6,806,800	
ユアテック	25,000	766.00	19,150,000	
西部電気工業	2,600	2,212.00	5,751,200	貸付有価証券 1,200株(300株)
四電工	12,000	438.00	5,256,000	
中電工	20,000	2,359.00	47,180,000	
関電工	63,000	995.00	62,685,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
きんでん	105,500	1,554.00	163,947,000	
東京エネシス	16,000	958.00	15,328,000	
トーエネック	22,000	556.00	12,232,000	貸付有価証券 1,000株
住友電設	11,000	1,280.00	14,080,000	
日本電設工業	25,800	2,007.00	51,780,600	貸付有価証券 1,500株
協和エクシオ	62,100	1,611.00	100,043,100	
新日本空調	12,200	1,329.00	16,213,800	貸付有価証券 800株
N D S	2,500	2,900.00	7,250,000	
九電工	30,800	3,035.00	93,478,000	貸付有価証券 6,100株(4,000株)
三機工業	35,200	958.00	33,721,600	
日揮	148,000	1,935.00	286,380,000	
中外炉工業	48,000	217.00	10,416,000	貸付有価証券 6,000株
ヤマト	14,200	568.00	8,065,600	
太平電業	21,000	1,090.00	22,890,000	
高砂熱学工業	43,600	1,566.00	68,277,600	
三晃金属工業	1,400	3,085.00	4,319,000	

朝日工業社	3,600	3,165.00	11,394,000	
明星工業	28,700	641.00	18,396,700	
大気社	21,000	2,724.00	57,204,000	貸付有価証券 6,300株
ダイダン	21,000	1,060.00	22,260,000	
日比谷総合設備	17,700	1,632.00	28,886,400	
東芝プラントシステム	25,800	1,625.00	41,925,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
OSJBホールディングス	48,500	276.00	13,386,000	貸付有価証券 22,900株
東洋エンジニアリング	93,000	279.00	25,947,000	貸付有価証券 43,000株
千代田化工建設	114,000	718.00	81,852,000	貸付有価証券 9,000株
新興プランテック	32,600	847.00	27,612,200	
日本製粉	47,100	1,644.00	77,432,400	
日清製粉グループ本社	173,900	1,661.00	288,847,900	
日東富士製粉	1,000	4,020.00	4,020,000	
昭和産業	65,000	588.00	38,220,000	貸付有価証券 30,000株(30,000株)
鳥越製粉	12,600	820.00	10,332,000	貸付有価証券 400株
中部飼料	17,400	1,192.00	20,740,800	
フィード・ワン	95,400	198.00	18,889,200	
東洋精糖	24,000	116.00	2,784,000	
日本甜菜製糖	8,100	2,367.00	19,172,700	
三井製糖	11,200	2,709.00	30,340,800	
塩水港精糖	16,900	248.00	4,191,200	貸付有価証券 7,600株
日新製糖	6,700	1,873.00	12,549,100	
森永製菓	31,000	4,940.00	153,140,000	
中村屋	3,700	4,920.00	18,204,000	
江崎グリコ	39,700	5,400.00	214,380,000	
名糖産業	6,800	1,478.00	10,050,400	
不二家	91,000	263.00	23,933,000	
山崎製パン	116,200	2,290.00	266,098,000	貸付有価証券 54,300株
第一屋製パン	24,000	124.00	2,976,000	
モロゾフ	24,000	553.00	13,272,000	

亀田製菓	8,800	4,880.00	42,944,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
寿スピリッツ	11,300	2,737.00	30,928,100	貸付有価証券 4,000株
カルビー	64,700	3,795.00	245,536,500	貸付有価証券 23,400株(2,000株)
森永乳業	142,000	826.00	117,292,000	
六甲バター	7,100	2,424.00	17,210,400	
ヤクルト本社	85,000	6,180.00	525,300,000	貸付有価証券 23,500株(22,800株)
明治ホールディングス	93,900	9,270.00	870,453,000	
雪印メグミルク	34,200	3,065.00	104,823,000	
プリマハム	100,000	492.00	49,200,000	
日本ハム	108,000	2,989.00	322,812,000	貸付有価証券 2,000株
林兼産業	5,100	862.00	4,396,200	
丸大食品	76,000	487.00	37,012,000	
S Foods	8,500	3,240.00	27,540,000	貸付有価証券 4,000株(2,600株)
伊藤ハム米久ホールディングス	91,500	1,038.00	94,977,000	貸付有価証券 1,200株
サッポロホールディングス	51,900	3,010.00	156,219,000	貸付有価証券 21,200株
アサヒグループホールディングス	297,500	4,208.00	1,251,880,000	貸付有価証券 123,800株(8,300株)
キリンホールディングス	682,900	2,100.50	1,434,431,450	貸付有価証券 240,500株(42,000株)
宝ホールディングス	114,800	1,201.00	137,874,800	
オエノンホールディングス	40,000	248.00	9,920,000	
養命酒製造	4,900	2,097.00	10,275,300	
コカ・コーラウエスト	53,700	3,590.00	192,783,000	貸付有価証券 25,200株(2,500株)
コカ・コーライースト ジャパン	61,700	2,614.00	161,283,800	
サントリー食品インター ナショナル	108,600	4,690.00	509,334,000	
ダイドーグループホール ディングス	7,300	5,210.00	38,033,000	貸付有価証券 200株(200株)
伊藤園	47,000	4,065.00	191,055,000	貸付有価証券

				13,300株(500株)
キーコーヒー	14,000	2,181.00	30,534,000	貸付有価証券 100株(100株)
ユニカフェ	4,300	958.00	4,119,400	
ジャパンフーズ	2,000	1,353.00	2,706,000	貸付有価証券 800株
日清オイリオグループ	91,000	634.00	57,694,000	
不二製油グループ本社	42,300	2,607.00	110,276,100	
かどや製油	1,500	5,670.00	8,505,000	貸付有価証券 300株
J-オイルミルズ	7,400	4,200.00	31,080,000	
キッコーマン	111,000	3,325.00	369,075,000	
味の素	326,700	2,196.50	717,596,550	貸付有価証券 16,800株
キューピー	80,700	3,155.00	254,608,500	
ハウス食品グループ本社	58,700	2,428.00	142,523,600	
カゴメ	56,900	2,893.00	164,611,700	貸付有価証券 4,200株
焼津水産化学工業	7,500	1,287.00	9,652,500	
アリアケジャパン	13,000	7,010.00	91,130,000	貸付有価証券 3,600株(1,200株)
ピエトロ	1,900	1,639.00	3,114,100	貸付有価証券 800株
エバラ食品工業	3,800	2,070.00	7,866,000	
ニチレイ	78,000	2,754.00	214,812,000	
東洋水産	78,000	4,145.00	323,310,000	
イートアンド	1,800	2,209.00	3,976,200	貸付有価証券 800株
大冷	1,200	1,808.00	2,169,600	
日清食品ホールディングス	61,900	6,170.00	381,923,000	
永谷園ホールディングス	15,000	1,448.00	21,720,000	
一正蒲鉾	5,500	1,254.00	6,897,000	貸付有価証券 800株
フジッコ	15,400	2,541.00	39,131,400	貸付有価証券 400株
ロック・フィールド	15,300	1,823.00	27,891,900	貸付有価証券 100株
日本たばこ産業	879,000	3,618.00	3,180,222,000	貸付有価証券 413,100株

ケンコーマヨネーズ	6,400	2,737.00	17,516,800	貸付有価証券 1,400株
わらべや日洋ホールディングス	9,300	2,582.00	24,012,600	
なとり	7,900	1,850.00	14,615,000	貸付有価証券 3,700株(500株)
北の達人コーポレーション	6,800	870.00	5,916,000	貸付有価証券 3,000株
ユーグレナ	51,100	1,225.00	62,597,500	貸付有価証券 24,400株(2,700株)
ミヨシ油脂	54,000	141.00	7,614,000	
理研ビタミン	4,700	4,020.00	18,894,000	貸付有価証券 1,900株(100株)
片倉工業	18,600	1,393.00	25,909,800	
グンゼ	111,000	455.00	50,505,000	
東洋紡	587,000	193.00	113,291,000	
ユニチカ	406,000	93.00	37,758,000	貸付有価証券 7,000株
富士紡ホールディングス	7,200	3,075.00	22,140,000	
倉敷紡績	149,000	245.00	36,505,000	
シキボウ	80,000	141.00	11,280,000	
日本毛織	41,800	879.00	36,742,200	貸付有価証券 600株
ダイトウボウ	20,000	73.00	1,460,000	貸付有価証券 3,000株
トーア紡コーポレーション	6,300	543.00	3,420,900	貸付有価証券 100株(100株)
ダイトーリミテッド	16,600	429.00	7,121,400	貸付有価証券 7,800株
帝国繊維	15,500	1,644.00	25,482,000	
帝人	121,200	2,099.00	254,398,800	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
東レ	1,076,000	987.00	1,062,012,000	
サカイオーベックス	3,600	1,804.00	6,494,400	
住江織物	41,000	284.00	11,644,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
日本フェルト	8,500	511.00	4,343,500	
イチカワ	10,000	302.00	3,020,000	
日東製網	1,600	1,981.00	3,169,600	貸付有価証券 400株

アツギ	122,000	131.00	15,982,000	
ダイニック	28,000	196.00	5,488,000	
セーレン	36,900	1,661.00	61,290,900	
ソトー	5,500	1,129.00	6,209,500	
東海染工	21,000	141.00	2,961,000	
小松精練	20,900	706.00	14,755,400	
ワコールホールディングス	88,000	1,374.00	120,912,000	
ホギメディカル	9,300	7,010.00	65,193,000	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
レナウン	40,100	113.00	4,531,300	貸付有価証券 9,800株（7,000株）
クラウドシア	3,400	535.00	1,819,000	貸付有価証券 1,400株
T S Iホールディングス	61,100	801.00	48,941,100	
三陽商会	78,000	165.00	12,870,000	貸付有価証券 36,000株
ナイガイ	54,000	57.00	3,078,000	貸付有価証券 6,000株
オンワードホールディングス	96,000	763.00	73,248,000	貸付有価証券 10,000株
ルック	27,000	208.00	5,616,000	貸付有価証券 5,000株
キムラタン	626,000	7.00	4,382,000	貸付有価証券 146,000株（2,000株）
ゴールドウイン	6,300	5,850.00	36,855,000	貸付有価証券 100株
デサント	33,800	1,321.00	44,649,800	
キング	7,300	401.00	2,927,300	
ヤマトインターナショナル	9,100	417.00	3,794,700	
特種東海製紙	8,600	4,165.00	35,819,000	
王子ホールディングス	580,000	521.00	302,180,000	
日本製紙	66,400	2,002.00	132,932,800	貸付有価証券 4,700株
三菱製紙	21,100	732.00	15,445,200	
北越紀州製紙	82,800	776.00	64,252,800	貸付有価証券 12,500株
中越パルプ工業	59,000	230.00	13,570,000	貸付有価証券 19,000株（19,000株）

巴川製紙所	23,000	230.00	5,290,000	
大王製紙	59,100	1,423.00	84,099,300	貸付有価証券 27,700株（8,600株）
阿波製紙	2,700	602.00	1,625,400	
レンゴー	143,000	643.00	91,949,000	
トーモク	47,000	335.00	15,745,000	
ザ・パック	10,500	3,150.00	33,075,000	
クラレ	249,500	1,688.00	421,156,000	貸付有価証券 96,100株
旭化成	925,000	1,080.00	999,000,000	
共和レザー	8,600	873.00	7,507,800	
昭和電工	98,700	1,985.00	195,919,500	貸付有価証券 12,600株
住友化学	1,091,000	622.00	678,602,000	
住友精化	6,100	4,735.00	28,883,500	
日産化学工業	81,200	3,240.00	263,088,000	貸付有価証券 6,300株
ラサ工業	56,000	144.00	8,064,000	
クレハ	11,200	4,895.00	54,824,000	貸付有価証券 1,000株
多木化学	10,000	942.00	9,420,000	
テイカ	23,000	757.00	17,411,000	
石原産業	26,600	1,113.00	29,605,800	
片倉コープアグリ	20,000	251.00	5,020,000	
日東エフシー	8,700	981.00	8,534,700	貸付有価証券 800株
日本曹達	89,000	615.00	54,735,000	貸付有価証券 1,000株
東ソー	429,000	978.00	419,562,000	
トクヤマ	231,000	538.00	124,278,000	貸付有価証券 24,000株
セントラル硝子	151,000	474.00	71,574,000	
東亜合成	92,800	1,270.00	117,856,000	
大阪ソーダ	64,000	497.00	31,808,000	貸付有価証券 30,000株（26,000株）
関東電化工業	30,000	960.00	28,800,000	貸付有価証券 14,000株
デンカ	307,000	578.00	177,446,000	
信越化学工業	265,900	9,644.00	2,564,339,600	

日本カーバイド工業	50,000	153.00	7,650,000	
堺化学工業	55,000	390.00	21,450,000	
エア・ウォーター	122,300	2,052.00	250,959,600	
大陽日酸	114,200	1,302.00	148,688,400	貸付有価証券 32,000株
日本化学工業	55,000	238.00	13,090,000	
日本パーカライジング	75,800	1,376.00	104,300,800	
高压ガス工業	22,000	715.00	15,730,000	
チタン工業	17,000	195.00	3,315,000	
四国化成工業	21,000	1,201.00	25,221,000	
戸田工業	29,000	273.00	7,917,000	貸付有価証券 1,000株
ステラ ケミファ	7,200	3,180.00	22,896,000	貸付有価証券 3,300株
保土谷化学工業	5,200	3,780.00	19,656,000	貸付有価証券 200株
日本触媒	23,300	7,580.00	176,614,000	
大日精化工業	61,000	753.00	45,933,000	
カネカ	200,000	828.00	165,600,000	
三菱瓦斯化学	138,100	2,312.00	319,287,200	
三井化学	674,000	550.00	370,700,000	
J S R	149,000	1,877.00	279,673,000	
東京応化工業	27,700	3,695.00	102,351,500	
大阪有機化学工業	9,600	903.00	8,668,800	
三菱ケミカルホールディングス	998,800	861.40	860,366,320	
K Hネオケム	18,200	1,395.00	25,389,000	貸付有価証券 1,600株
ダイセル	199,900	1,341.00	268,065,900	
住友ベークライト	131,000	670.00	87,770,000	
積水化学工業	336,500	1,871.00	629,591,500	
日本ゼオン	125,000	1,271.00	158,875,000	
アイカ工業	47,500	2,932.00	139,270,000	
宇部興産	747,000	251.00	187,497,000	
積水樹脂	22,900	1,849.00	42,342,100	
タキロン	31,000	579.00	17,949,000	
旭有機材	48,000	234.00	11,232,000	
日立化成	82,400	3,080.00	253,792,000	

ニチバン	15,000	920.00	13,800,000	
リケンテクノス	32,000	532.00	17,024,000	貸付有価証券 5,700株(800株)
大倉工業	35,000	550.00	19,250,000	
積水化成工業	21,100	778.00	16,415,800	
群栄化学工業	3,600	3,640.00	13,104,000	
タイガースポリマー	7,300	718.00	5,241,400	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
ミライアル	5,300	994.00	5,268,200	
ダイキアクシス	2,500	1,861.00	4,652,500	
ダイキョーニシカワ	26,000	1,459.00	37,934,000	貸付有価証券 8,800株
日本化薬	96,000	1,510.00	144,960,000	
カーリットホールディングス	13,700	571.00	7,822,700	貸付有価証券 6,400株
日本精化	12,300	948.00	11,660,400	貸付有価証券 100株(100株)
扶桑化学工業	10,500	3,485.00	36,592,500	貸付有価証券 800株
A D E K A	63,800	1,622.00	103,483,600	
日油	114,000	1,182.00	134,748,000	
新日本理化	23,400	149.00	3,486,600	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
ハリマ化成グループ	12,600	782.00	9,853,200	
花王	376,600	6,104.00	2,298,766,400	貸付有価証券 160,000株
第一工業製薬	33,000	427.00	14,091,000	
日華化学	4,700	1,037.00	4,873,900	
ニイタカ	2,200	1,955.00	4,301,000	
三洋化成工業	9,300	4,675.00	43,477,500	貸付有価証券 1,700株
有機合成薬品工業	9,700	306.00	2,968,200	
大日本塗料	85,000	248.00	21,080,000	貸付有価証券 8,000株
日本ペイントホールディングス	114,400	3,875.00	443,300,000	貸付有価証券 28,700株(10,000株)
関西ペイント	155,800	2,363.00	368,155,400	貸付有価証券 31,700株
神東塗料	11,000	215.00	2,365,000	
中国塗料	42,500	827.00	35,147,500	

日本特殊塗料	10,400	1,720.00	17,888,000	
藤倉化成	20,100	646.00	12,984,600	
太陽ホールディングス	12,100	4,865.00	58,866,500	
D I C	58,500	4,110.00	240,435,000	
サカティンクス	30,300	1,533.00	46,449,900	貸付有価証券 3,600株
東洋インキ S C ホール ディングス	147,000	536.00	78,792,000	
T & K T O K A	10,700	1,060.00	11,342,000	貸付有価証券 3,500株
富士フイルムホールディ ングス	294,000	4,348.00	1,278,312,000	
資生堂	281,300	2,930.00	824,209,000	貸付有価証券 2,900株
ライオン	184,000	2,002.00	368,368,000	貸付有価証券 83,000株(37,000株)
高砂香料工業	9,700	3,570.00	34,629,000	
マンダム	14,800	5,220.00	77,256,000	
ミルボン	8,000	5,600.00	44,800,000	
ファンケル	31,500	1,600.00	50,400,000	貸付有価証券 11,800株(1,800株)
コーセー	24,000	10,070.00	241,680,000	
コタ	6,160	1,251.00	7,706,160	
シーズ・ホールディング ス	19,200	3,305.00	63,456,000	
シーボン	1,700	2,500.00	4,250,000	貸付有価証券 700株
ポーラ・オルビスホール ディングス	60,400	2,687.00	162,294,800	貸付有価証券 5,600株
ノエビアホールディング ス	9,300	4,610.00	42,873,000	
アジュバンコスメジャパ ン	2,800	910.00	2,548,000	貸付有価証券 1,300株
エステー	10,100	1,809.00	18,270,900	
アグロ カネショウ	5,700	1,417.00	8,076,900	
コニシ	23,300	1,339.00	31,198,700	
長谷川香料	18,800	2,114.00	39,743,200	貸付有価証券 200株
星光 P M C	8,100	1,305.00	10,570,500	貸付有価証券 3,800株(800株)

小林製薬	39,700	5,390.00	213,983,000	
荒川化学工業	12,700	2,038.00	25,882,600	
メック	11,500	1,274.00	14,651,000	貸付有価証券 5,400株（2,600株）
日本高純度化学	4,200	2,361.00	9,916,200	
タカラバイオ	31,800	1,528.00	48,590,400	貸付有価証券 2,500株
J C U	9,300	3,545.00	32,968,500	
新田ゼラチン	8,900	754.00	6,710,600	貸付有価証券 100株
O A T アグリオ	1,700	1,465.00	2,490,500	
デクセリアルズ	38,900	1,100.00	42,790,000	貸付有価証券 100株（100株）
アース製薬	10,700	5,970.00	63,879,000	
イハラケミカル工業	20,500	1,010.00	20,705,000	
北興化学工業	14,000	470.00	6,580,000	
大成ラミック	4,600	2,806.00	12,907,600	貸付有価証券 900株
クミアイ化学工業	30,600	634.00	19,400,400	貸付有価証券 14,300株（10,300株）
日本農薬	33,900	699.00	23,696,100	貸付有価証券 7,900株（500株）
アキレス	12,100	1,682.00	20,352,200	
有沢製作所	25,100	782.00	19,628,200	
日東電工	106,900	8,602.00	919,553,800	
レック	9,200	2,387.00	21,960,400	貸付有価証券 4,200株
きもと	26,500	227.00	6,015,500	貸付有価証券 3,300株
藤森工業	11,000	3,095.00	34,045,000	
前澤化成工業	9,700	1,162.00	11,271,400	
J S P	6,900	2,593.00	17,891,700	貸付有価証券 3,100株
エフピコ	13,100	5,180.00	67,858,000	貸付有価証券 100株
天馬	9,800	2,055.00	20,139,000	
信越ポリマー	29,000	784.00	22,736,000	
東リ	35,200	379.00	13,340,800	
ニフコ	26,000	5,590.00	145,340,000	貸付有価証券

				100株(100株)
日本バルカー工業	11,500	1,829.00	21,033,500	
ユニ・チャーム	300,100	2,667.50	800,516,750	貸付有価証券 75,000株(75,000株)
協和発酵キリン	177,400	1,762.00	312,578,800	貸付有価証券 46,100株
武田薬品工業	555,800	5,229.00	2,906,278,200	
アステラス製薬	1,514,500	1,466.00	2,220,257,000	
大日本住友製薬	104,900	1,838.00	192,806,200	貸付有価証券 46,100株
塩野義製薬	188,000	5,748.00	1,080,624,000	
田辺三菱製薬	172,700	2,318.00	400,318,600	
わかもと製薬	17,000	259.00	4,403,000	
あすか製薬	16,100	1,633.00	26,291,300	
日本新薬	34,000	5,670.00	192,780,000	
ビオフェルミン製薬	2,400	3,045.00	7,308,000	
中外製薬	147,600	3,825.00	564,570,000	貸付有価証券 48,800株
科研製薬	27,700	6,290.00	174,233,000	
エーザイ	182,500	5,764.00	1,051,930,000	
ロート製薬	72,600	2,086.00	151,443,600	貸付有価証券 15,600株
小野薬品工業	336,700	2,304.50	775,925,150	
久光製薬	41,800	6,360.00	265,848,000	貸付有価証券 10,500株(100株)
持田製薬	10,100	8,260.00	83,426,000	
参天製薬	267,800	1,612.00	431,693,600	
扶桑薬品工業	5,000	2,812.00	14,060,000	
日本ケミファ	2,100	5,290.00	11,109,000	
ツムラ	49,800	3,490.00	173,802,000	
日医工	34,700	1,731.00	60,065,700	貸付有価証券 16,300株
キッセイ薬品工業	26,300	2,918.00	76,743,400	
生化学工業	27,500	1,855.00	51,012,500	
栄研化学	12,400	3,085.00	38,254,000	
日水製薬	5,900	1,389.00	8,195,100	
鳥居薬品	10,100	2,872.00	29,007,200	
JCRファーマ	11,400	2,469.00	28,146,600	貸付有価証券

				2,500株(2,400株)
東和薬品	6,800	5,630.00	38,284,000	貸付有価証券 1,200株(700株)
富士製薬工業	4,800	3,160.00	15,168,000	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	25,200	6,020.00	151,704,000	貸付有価証券 3,800株
ゼリア新薬工業	30,300	1,712.00	51,873,600	
第一三共	436,200	2,507.00	1,093,553,400	
キョーリン製薬ホールディングス	36,200	2,351.00	85,106,200	
大幸薬品	7,400	1,893.00	14,008,200	貸付有価証券 2,100株
ダイト	8,800	2,248.00	19,782,400	
大塚ホールディングス	318,700	5,022.00	1,600,511,400	貸付有価証券 149,700株(600株)
大正製薬ホールディングス	31,700	9,040.00	286,568,000	
ペプチドリーム	27,700	5,250.00	145,425,000	貸付有価証券 11,300株
日本コークス工業	119,600	95.00	11,362,000	貸付有価証券 400株
昭和シェル石油	132,500	1,127.00	149,327,500	
ニチレキ	18,100	909.00	16,452,900	
東燃ゼネラル石油	241,000	1,300.00	313,300,000	
ユシロ化学工業	7,900	1,375.00	10,862,500	
ビーピー・カストロール	6,100	1,676.00	10,223,600	貸付有価証券 2,800株
富士石油	34,400	376.00	12,934,400	貸付有価証券 12,500株(12,500株)
MORESCO	5,100	1,700.00	8,670,000	貸付有価証券 200株
出光興産	70,300	3,870.00	272,061,000	貸付有価証券 100株
JXホールディングス	1,645,900	546.70	899,813,530	貸付有価証券 773,100株
コスモエネルギーホールディングス	44,700	1,912.00	85,466,400	貸付有価証券 2,800株
横浜ゴム	89,400	2,179.00	194,802,600	
東洋ゴム工業	78,300	2,000.00	156,600,000	
ブリヂストン	500,300	4,503.00	2,252,850,900	貸付有価証券

				209,500株(14,800株)
住友ゴム工業	138,700	1,897.00	263,113,900	貸付有価証券 65,200株
藤倉ゴム工業	12,400	686.00	8,506,400	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
オカモト	45,000	1,191.00	53,595,000	
フコク	6,200	913.00	5,660,600	貸付有価証券 2,200株
ニッタ	13,300	3,105.00	41,296,500	
住友理工	27,400	1,126.00	30,852,400	
三ツ星ベルト	34,000	1,034.00	35,156,000	
バンドー化学	27,000	988.00	26,676,000	
日東紡績	120,000	554.00	66,480,000	
旭硝子	730,000	902.00	658,460,000	貸付有価証券 264,000株(42,000株)
日本板硝子	67,500	809.00	54,607,500	貸付有価証券 7,600株(3,800株)
石塚硝子	21,000	228.00	4,788,000	
日本山村硝子	59,000	198.00	11,682,000	
日本電気硝子	306,000	673.00	205,938,000	
オハラ	5,600	1,234.00	6,910,400	貸付有価証券 2,600株(800株)
住友大阪セメント	275,000	463.00	127,325,000	
太平洋セメント	894,000	372.00	332,568,000	
日本ヒューム	14,200	685.00	9,727,000	
日本コンクリート工業	33,000	357.00	11,781,000	
三谷セキサン	7,400	2,571.00	19,025,400	
アジアパイルホールディングス	18,200	610.00	11,102,000	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	138,400	485.00	67,124,000	
日本カーボン	73,000	334.00	24,382,000	貸付有価証券 34,000株(7,000株)
東洋炭素	8,200	1,864.00	15,284,800	貸付有価証券 1,300株
ノリタケカンパニーリミテド	8,400	2,851.00	23,948,400	
TOTO	108,900	4,205.00	457,924,500	
日本碍子	187,100	2,520.00	471,492,000	

日本特殊陶業	127,700	2,544.00	324,868,800	
ダントーホールディングス	12,000	192.00	2,304,000	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
MARUWA	5,400	3,975.00	21,465,000	
品川リフラクトリーズ	37,000	303.00	11,211,000	
黒崎播磨	32,000	442.00	14,144,000	
ヨータイ	8,000	379.00	3,032,000	
イソライト工業	7,300	484.00	3,533,200	
東京窯業	18,000	210.00	3,780,000	貸付有価証券 3,400株
ニッカトー	4,800	435.00	2,088,000	
フジインコーポレーテッド	12,600	2,234.00	28,148,400	貸付有価証券 4,600株
エーアンドエーマテリアル	31,000	128.00	3,968,000	
ニチアス	77,000	1,119.00	86,163,000	
ニチハ	19,700	3,270.00	64,419,000	
新日鐵住金	668,300	2,565.00	1,714,189,500	
神戸製鋼所	256,200	1,016.00	260,299,200	貸付有価証券 109,200株
中山製鋼所	16,600	727.00	12,068,200	貸付有価証券 1,000株
合同製鐵	8,300	1,742.00	14,458,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	405,100	1,908.50	773,133,350	
日新製鋼	48,300	1,464.00	70,711,200	貸付有価証券 22,600株（22,600株）
東京製鐵	75,000	935.00	70,125,000	貸付有価証券 6,500株
共英製鋼	15,800	1,988.00	31,410,400	貸付有価証券 400株
大和工業	29,700	2,872.00	85,298,400	
東京鐵鋼	31,000	457.00	14,167,000	
大阪製鐵	9,300	2,013.00	18,720,900	
淀川製鋼所	20,500	3,020.00	61,910,000	
東洋鋼鈑	35,400	385.00	13,629,000	
丸一鋼管	49,600	3,165.00	156,984,000	
モリ工業	4,700	2,218.00	10,424,600	
大同特殊鋼	248,000	532.00	131,936,000	

日本高周波鋼業	52,000	85.00	4,420,000	
日本冶金工業	122,600	213.00	26,113,800	貸付有価証券 13,700株
山陽特殊製鋼	88,000	591.00	52,008,000	
愛知製鋼	8,700	4,430.00	38,541,000	
日立金属	150,800	1,562.00	235,549,600	
日本金属	3,500	1,435.00	5,022,500	貸付有価証券 1,200株
大平洋金属	95,000	388.00	36,860,000	貸付有価証券 35,000株（7,000株）
新日本電工	83,800	388.00	32,514,400	
栗本鐵工所	7,100	2,200.00	15,620,000	
虹技	21,000	231.00	4,851,000	貸付有価証券 2,000株
日本鑄鉄管	14,000	180.00	2,520,000	
三菱製鋼	103,000	240.00	24,720,000	
日亜鋼業	20,500	272.00	5,576,000	
日本精線	10,000	691.00	6,910,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	12,100	671.00	8,119,100	貸付有価証券 500株（100株）
新家工業	32,000	218.00	6,976,000	
大紀アルミニウム工業所	25,000	499.00	12,475,000	
日本軽金属ホールディングス	381,400	245.00	93,443,000	
三井金属鉱業	403,000	379.00	152,737,000	
東邦亜鉛	84,000	546.00	45,864,000	
三菱マテリアル	92,500	3,370.00	311,725,000	
住友金属鉱山	383,000	1,583.50	606,480,500	
DOWAホールディングス	163,000	802.00	130,726,000	貸付有価証券 3,000株
古河機械金属	231,000	205.00	47,355,000	貸付有価証券 1,000株
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,200	1,725.00	27,945,000	貸付有価証券 7,600株
東邦チタニウム	25,100	871.00	21,862,100	貸付有価証券 11,400株
UACJ	209,000	292.00	61,028,000	貸付有価証券 17,000株
古河電気工業	49,700	4,000.00	198,800,000	

住友電気工業	558,300	1,846.00	1,030,621,800	
フジクラ	195,000	801.00	156,195,000	貸付有価証券 1,600株
昭和電線ホールディングス	176,000	86.00	15,136,000	貸付有価証券 22,000株
東京特殊電線	2,100	1,767.00	3,710,700	
タツタ電線	27,700	506.00	14,016,200	
沖電線	15,000	233.00	3,495,000	貸付有価証券 5,000株(1,000株)
カナレ電気	2,100	2,224.00	4,670,400	
平河ヒューテック	7,000	1,251.00	8,757,000	貸付有価証券 300株
リヨービ	90,000	484.00	43,560,000	
アーレスティ	17,200	1,137.00	19,556,400	貸付有価証券 3,100株
アサヒホールディングス	22,300	2,014.00	44,912,200	
稲葉製作所	7,900	1,346.00	10,633,400	貸付有価証券 3,400株
宮地エンジニアリンググループ	43,000	214.00	9,202,000	
トーカロ	9,700	2,891.00	28,042,700	
アルファC o	4,900	2,000.00	9,800,000	貸付有価証券 2,300株(1,700株)
SUMCO	154,700	1,854.00	286,813,800	
川田テクノロジーズ	2,800	7,110.00	19,908,000	貸付有価証券 1,300株(1,200株)
RS Technologies	500	6,270.00	3,135,000	貸付有価証券 200株
東洋製罐グループホールディングス	105,300	1,808.00	190,382,400	
ホッカンホールディングス	38,000	504.00	19,152,000	
コロナ	7,700	1,131.00	8,708,700	
横河ブリッジホールディングス	26,000	1,290.00	33,540,000	
駒井ハルテック	2,800	2,230.00	6,244,000	
高田機工	13,000	267.00	3,471,000	
三和ホールディングス	147,100	1,042.00	153,278,200	
文化シャッター	41,200	860.00	35,432,000	
三協立山	19,400	1,660.00	32,204,000	貸付有価証券

				8,500株(900株)
アルインコ	10,200	965.00	9,843,000	
東洋シャッター	3,600	627.00	2,257,200	
L I X I Lグループ	206,400	2,825.00	583,080,000	
日本ファイルコン	10,700	550.00	5,885,000	貸付有価証券 300株(300株)
ノーリツ	29,000	2,112.00	61,248,000	貸付有価証券 1,100株(500株)
長府製作所	15,800	2,603.00	41,127,400	貸付有価証券 900株
リンナイ	25,200	8,860.00	223,272,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
ダイニチ工業	7,500	713.00	5,347,500	
日東精工	21,100	462.00	9,748,200	
三洋工業	19,000	206.00	3,914,000	
岡部	30,700	1,012.00	31,068,400	
ジーテクト	15,400	1,967.00	30,291,800	
中国工業	2,100	700.00	1,470,000	
東プレ	28,500	2,897.00	82,564,500	貸付有価証券 10,300株(9,300株)
高周波熱錬	27,500	904.00	24,860,000	
東京製綱	10,000	1,685.00	16,850,000	貸付有価証券 4,700株(800株)
サンコール	7,900	560.00	4,424,000	
モリテック スチール	7,400	299.00	2,212,600	
パイオラックス	22,400	2,549.00	57,097,600	
日本発條	139,400	1,229.00	171,322,600	
中央発條	17,000	362.00	6,154,000	
アドバネクス	2,600	1,487.00	3,866,200	
立川ブラインド工業	6,200	903.00	5,598,600	
三益半導体工業	12,500	1,764.00	22,050,000	
日本ドライケミカル	1,900	2,448.00	4,651,200	
日本製鋼所	49,000	1,794.00	87,906,000	
三浦工業	60,600	1,787.00	108,292,200	
タクマ	47,400	1,089.00	51,618,600	
ツガミ	40,000	740.00	29,600,000	
オークマ	96,000	1,166.00	111,936,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)

東芝機械	88,000	452.00	39,776,000	
アマダホールディングス	199,400	1,271.00	253,437,400	
アイダエンジニアリング	42,100	988.00	41,594,800	貸付有価証券 11,200株
滝澤鉄工所	43,000	177.00	7,611,000	
富士機械製造	45,100	1,458.00	65,755,800	貸付有価証券 21,000株（20,900株）
牧野フライス製作所	74,000	965.00	71,410,000	貸付有価証券 27,000株（16,000株）
オーエスジー	67,500	2,277.00	153,697,500	貸付有価証券 31,700株（29,100株）
ダイジェット工業	17,000	177.00	3,009,000	
旭ダイヤモンド工業	41,600	816.00	33,945,600	貸付有価証券 6,900株（5,500株）
D M G 森精機	87,600	1,736.00	152,073,600	貸付有価証券 41,100株（6,700株）
ソディック	37,600	1,100.00	41,360,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
ディスコ	17,300	16,930.00	292,889,000	
日東工器	8,600	2,549.00	21,921,400	貸付有価証券 4,000株
パンチ工業	5,300	1,158.00	6,137,400	
豊和工業	8,300	664.00	5,511,200	貸付有価証券 300株
O K K	54,000	118.00	6,372,000	貸付有価証券 3,000株
東洋機械金属	10,000	550.00	5,500,000	貸付有価証券 3,400株
津田駒工業	33,000	168.00	5,544,000	貸付有価証券 15,000株
エンシュウ	36,000	92.00	3,312,000	貸付有価証券 17,000株（14,000株）
島精機製作所	19,300	4,190.00	80,867,000	貸付有価証券 5,600株（2,000株）
N C ホールディングス	4,800	903.00	4,334,400	
フリー	8,700	1,430.00	12,441,000	貸付有価証券 4,000株
ヤマシンフィルタ	2,900	2,356.00	6,832,400	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
日阪製作所	20,100	914.00	18,371,400	
やまびこ	27,100	1,304.00	35,338,400	貸付有価証券

				2,400株
ペガサスミシン製造	14,200	883.00	12,538,600	貸付有価証券 400株(400株)
ナブテスコ	77,000	2,950.00	227,150,000	
三井海洋開発	14,900	2,367.00	35,268,300	貸付有価証券 5,000株
レオン自動機	12,500	1,030.00	12,875,000	
S M C	44,400	32,920.00	1,461,648,000	貸付有価証券 4,300株(4,300株)
新川	12,300	833.00	10,245,900	
ホソカワミクロン	4,900	4,235.00	20,751,500	
ユニオンツール	6,400	3,490.00	22,336,000	貸付有価証券 400株
オイレス工業	19,100	2,052.00	39,193,200	貸付有価証券 400株
日精イー・エス・ビー機 械	4,700	2,776.00	13,047,200	貸付有価証券 2,200株
サトーホールディングス	18,400	2,372.00	43,644,800	
日本エアテック	4,800	800.00	3,840,000	
日精樹脂工業	11,700	1,182.00	13,829,400	貸付有価証券 800株
オカダアイヨン	3,100	1,103.00	3,419,300	
ワイエイシイ	5,500	1,421.00	7,815,500	貸付有価証券 2,500株
小松製作所	683,500	2,901.50	1,983,175,250	貸付有価証券 193,200株
住友重機械工業	432,000	776.00	335,232,000	
日立建機	66,200	2,775.00	183,705,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
日工	4,500	2,015.00	9,067,500	
巴工業	6,000	1,818.00	10,908,000	
井関農機	152,000	228.00	34,656,000	貸付有価証券 6,000株(2,000株)
T O W A	12,100	1,987.00	24,042,700	
丸山製作所	3,100	1,871.00	5,800,100	
北川鉄工所	6,800	2,193.00	14,912,400	
ローツェ	5,200	3,330.00	17,316,000	貸付有価証券 2,100株(600株)
タカキタ	4,900	559.00	2,739,100	
クボタ	709,100	1,671.00	1,184,906,100	貸付有価証券

				101,800株（96,200株）
荏原実業	4,100	1,434.00	5,879,400	
三菱化工機	49,000	217.00	10,633,000	貸付有価証券 9,000株
月島機械	28,100	1,175.00	33,017,500	
帝国電機製作所	10,800	1,109.00	11,977,200	貸付有価証券 600株
東京機械製作所	56,000	66.00	3,696,000	貸付有価証券 9,000株
新東工業	33,600	967.00	32,491,200	
澁谷工業	12,400	3,025.00	37,510,000	貸付有価証券 500株（500株）
アイチ コーポレーション	21,000	856.00	17,976,000	
小森コーポレーション	35,600	1,429.00	50,872,400	
鶴見製作所	11,000	1,627.00	17,897,000	
住友精密工業	23,000	357.00	8,211,000	
酒井重工業	28,000	341.00	9,548,000	
荏原製作所	67,100	3,635.00	243,908,500	
石井鐵工所	2,200	1,729.00	3,803,800	
西島製作所	14,400	1,094.00	15,753,600	
北越工業	15,900	1,020.00	16,218,000	
ダイキン工業	193,200	11,185.00	2,160,942,000	
オルガノ	28,000	500.00	14,000,000	
トーヨーカネツ	68,000	295.00	20,060,000	
栗田工業	83,800	2,693.00	225,673,400	
椿本チエイン	84,000	928.00	77,952,000	
大同工業	29,000	292.00	8,468,000	
木村化工機	12,700	335.00	4,254,500	貸付有価証券 300株（100株）
アネスト岩田	25,700	1,014.00	26,059,800	貸付有価証券 800株
ダイフク	70,600	2,775.00	195,915,000	
サムコ	3,500	960.00	3,360,000	貸付有価証券 500株
加藤製作所	7,700	2,756.00	21,221,200	貸付有価証券 800株
油研工業	28,000	226.00	6,328,000	

タダノ	74,000	1,299.00	96,126,000	
フジテック	41,200	1,222.00	50,346,400	貸付有価証券 6,500株(5,700株)
C K D	42,400	1,408.00	59,699,200	
キトー	17,800	1,188.00	21,146,400	貸付有価証券 400株
平和	43,900	2,768.00	121,515,200	貸付有価証券 20,500株
理想科学工業	14,100	1,951.00	27,509,100	
S A N K Y O	39,400	3,720.00	146,568,000	
日本金銭機械	13,000	1,428.00	18,564,000	貸付有価証券 4,600株(1,200株)
マースエンジニアリング	8,000	2,310.00	18,480,000	
福島工業	8,700	3,880.00	33,756,000	貸付有価証券 400株
オーイズミ	5,900	585.00	3,451,500	貸付有価証券 2,800株(200株)
ダイコク電機	5,800	1,664.00	9,651,200	貸付有価証券 1,800株
竹内製作所	25,800	2,098.00	54,128,400	
アマノ	43,800	2,223.00	97,367,400	
J U K I	22,300	1,311.00	29,235,300	
サンデンホールディングス	86,000	370.00	31,820,000	貸付有価証券 11,000株(10,000株)
蛇の目マシン工業	13,700	777.00	10,644,900	貸付有価証券 1,400株
マックス	22,000	1,480.00	32,560,000	
グローリー	45,200	3,650.00	164,980,000	
新晃工業	9,900	1,599.00	15,830,100	貸付有価証券 4,400株
大和冷機工業	22,700	1,158.00	26,286,600	
セガサミーホールディングス	140,400	1,492.00	209,476,800	
日本ピストンリング	5,500	2,485.00	13,667,500	
リケン	6,600	4,910.00	32,406,000	
T P R	15,800	3,655.00	57,749,000	
ツバキ・ナカシマ	15,800	1,841.00	29,087,800	貸付有価証券 7,400株
ホシザキ	31,000	8,760.00	271,560,000	貸付有価証券 12,500株

大豊工業	11,500	1,662.00	19,113,000	
日本精工	290,700	1,592.00	462,794,400	
N T N	328,000	554.00	181,712,000	
ジェイテクト	150,900	1,729.00	260,906,100	
不二越	142,000	570.00	80,940,000	貸付有価証券 29,000株
日本トムソン	45,200	605.00	27,346,000	
T H K	100,000	2,803.00	280,300,000	貸付有価証券 1,400株
ユーシン精機	6,300	2,918.00	18,383,400	貸付有価証券 2,400株
前澤給装工業	5,400	1,542.00	8,326,800	貸付有価証券 1,800株
イーグル工業	15,300	1,511.00	23,118,300	
前澤工業	9,400	334.00	3,139,600	
日本ピラー工業	14,300	1,501.00	21,464,300	
キッツ	67,900	742.00	50,381,800	
日立工機	37,900	864.00	32,745,600	貸付有価証券 11,300株(1,500株)
マキタ	184,600	3,900.00	719,940,000	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
日立造船	112,200	634.00	71,134,800	
三菱重工業	2,372,000	446.60	1,059,335,200	
I H I	1,088,000	351.00	381,888,000	貸付有価証券 129,000株
スター精密	24,800	1,707.00	42,333,600	貸付有価証券 11,200株(11,200株)
日清紡ホールディングス	78,600	1,113.00	87,481,800	
イビデン	99,100	1,734.00	171,839,400	貸付有価証券 11,400株(11,400株)
コニカミノルタ	331,400	996.00	330,074,400	
ブラザー工業	183,000	2,325.00	425,475,000	
ミネベアミツミ	257,600	1,485.00	382,536,000	
日立製作所	3,399,000	602.50	2,047,897,500	
東芝	3,166,000	241.40	764,272,400	貸付有価証券 1,473,000株
三菱電機	1,509,900	1,597.00	2,411,310,300	
富士電機	426,000	661.00	281,586,000	
東洋電機製造	6,000	1,698.00	10,188,000	貸付有価証券

				100株
安川電機	164,100	2,234.00	366,599,400	貸付有価証券 21,900株(500株)
シンフォニアテクノロジー	92,000	325.00	29,900,000	
明電舎	130,000	395.00	51,350,000	貸付有価証券 1,000株
オリジン電気	21,000	305.00	6,405,000	
山洋電気	37,000	831.00	30,747,000	
デンヨー	13,100	1,684.00	22,060,400	
東芝テック	89,000	623.00	55,447,000	
芝浦メカトロニクス	23,000	290.00	6,670,000	貸付有価証券 4,000株
マブチモーター	40,000	6,270.00	250,800,000	
日本電産	183,400	10,595.00	1,943,123,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,700	3,145.00	5,346,500	貸付有価証券 700株
東光高岳	7,200	2,033.00	14,637,600	
ダブル・スコープ	13,700	1,635.00	22,399,500	貸付有価証券 6,400株(100株)
ダイヘン	77,000	724.00	55,748,000	
田淵電機	21,400	337.00	7,211,800	貸付有価証券 10,100株
ヤーマン	1,800	5,340.00	9,612,000	貸付有価証券 800株(800株)
JVCケンウッド	103,900	290.00	30,131,000	貸付有価証券 200株(200株)
ミマキエンジニアリング	12,700	643.00	8,166,100	貸付有価証券 3,000株
第一精工	6,600	1,757.00	11,596,200	貸付有価証券 900株
日新電機	28,400	1,286.00	36,522,400	貸付有価証券 100株
大崎電気工業	28,000	967.00	27,076,000	貸付有価証券 1,000株
オムロン	150,500	4,885.00	735,192,500	
日東工業	20,800	1,536.00	31,948,800	
I D E C	18,500	1,215.00	22,477,500	
不二電機工業	1,500	1,288.00	1,932,000	貸付有価証券 400株

ジーエス・ユアサ コーポレーション	273,000	519.00	141,687,000	貸付有価証券 7,000株(1,000株)
サクサホールディングス	36,000	215.00	7,740,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
メルコホールディングス	7,800	3,215.00	25,077,000	
テクノメディカ	3,200	2,120.00	6,784,000	
日本電気	1,946,000	268.00	521,528,000	
富士通	1,365,000	680.90	929,428,500	
沖電気工業	61,300	1,602.00	98,202,600	貸付有価証券 1,700株
岩崎通信機	62,000	84.00	5,208,000	
電気興業	40,000	564.00	22,560,000	
サンケン電気	83,000	489.00	40,587,000	貸付有価証券 2,000株
ナカヨ	15,000	373.00	5,595,000	
アイホン	8,000	1,800.00	14,400,000	
ルネサスエレクトロニクス	73,300	1,167.00	85,541,100	貸付有価証券 35,000株
セイコーエプソン	210,800	2,344.00	494,115,200	
ワコム	109,800	402.00	44,139,600	貸付有価証券 36,300株(500株)
アルバック	23,900	5,190.00	124,041,000	
アクセル	5,900	811.00	4,784,900	貸付有価証券 800株
E I Z O	14,000	3,200.00	44,800,000	
ジャパンディスプレイ	264,300	260.00	68,718,000	貸付有価証券 124,900株(16,500株)
日本信号	39,000	1,001.00	39,039,000	
京三製作所	33,000	430.00	14,190,000	
能美防災	16,000	1,529.00	24,464,000	
ホーチキ	10,300	1,457.00	15,007,100	
エレコム	12,200	2,121.00	25,876,200	貸付有価証券 3,800株
日本無線	8,700	1,383.00	12,032,100	貸付有価証券 800株
パナソニック	1,625,532	1,258.00	2,044,919,256	
アンリツ	103,200	842.00	86,894,400	
富士通ゼネラル	48,000	2,200.00	105,600,000	

日立国際電気	37,000	2,551.00	94,387,000	貸付有価証券 1,000株
ソニー	999,600	3,766.00	3,764,493,600	
T D K	79,700	7,050.00	561,885,000	
帝国通信工業	31,000	189.00	5,859,000	
タムラ製作所	55,000	494.00	27,170,000	
アルプス電気	130,700	3,155.00	412,358,500	
池上通信機	45,000	146.00	6,570,000	貸付有価証券 14,000株
パイオニア	212,700	221.00	47,006,700	貸付有価証券 94,500株（1,400株）
日本電波工業	13,700	817.00	11,192,900	
鈴木	5,400	636.00	3,434,400	
日本トリム	3,400	3,720.00	12,648,000	貸付有価証券 1,600株（600株）
ローランド ディー . ジー .	7,200	3,350.00	24,120,000	
フォスター電機	16,600	1,908.00	31,672,800	貸付有価証券 800株
クラリオン	75,000	459.00	34,425,000	
S M K	36,000	396.00	14,256,000	
ヨコオ	10,100	1,378.00	13,917,800	
ティアック	102,000	42.00	4,284,000	貸付有価証券 48,000株（3,000株）
ホシデン	42,900	1,045.00	44,830,500	
ヒロセ電機	22,900	15,400.00	352,660,000	
日本航空電子工業	41,000	1,429.00	58,589,000	
T O A	16,700	966.00	16,132,200	貸付有価証券 1,400株
日立マクセル	21,100	2,031.00	42,854,100	貸付有価証券 100株
古野電気	18,200	717.00	13,049,400	
ユニデンホールディングス	42,000	182.00	7,644,000	
アルパイン	33,700	1,601.00	53,953,700	貸付有価証券 6,900株
スミダコーポレーション	11,600	1,660.00	19,256,000	貸付有価証券 900株（900株）
アイコム	7,800	2,559.00	19,960,200	
リオン	5,400	1,541.00	8,321,400	

本多通信工業	4,500	1,451.00	6,529,500	
船井電機	15,900	946.00	15,041,400	貸付有価証券 6,500株
横河電機	153,500	1,752.00	268,932,000	
新電元工業	55,000	466.00	25,630,000	
アズビル	42,900	3,740.00	160,446,000	
東亜ディーケーケー	7,000	567.00	3,969,000	貸付有価証券 100株(100株)
日本光電工業	59,200	2,489.00	147,348,800	貸付有価証券 1,800株
チノー	5,000	1,235.00	6,175,000	
共和電業	16,000	467.00	7,472,000	
日本電子材料	5,600	628.00	3,516,800	
堀場製作所	28,000	5,970.00	167,160,000	貸付有価証券 7,500株
アドバンテスト	96,500	2,080.00	200,720,000	貸付有価証券 3,600株(3,000株)
小野測器	6,900	792.00	5,464,800	
エスペック	12,500	1,386.00	17,325,000	
キーエンス	64,100	44,580.00	2,857,578,000	
日置電機	7,400	2,342.00	17,330,800	
シスメックス	110,000	6,750.00	742,500,000	
日本マイクロニクス	26,400	989.00	26,109,600	貸付有価証券 12,400株
メガチップス	13,200	3,050.00	40,260,000	貸付有価証券 6,200株
O B A R A G R O U P	8,300	4,920.00	40,836,000	
澤藤電機	9,000	787.00	7,083,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
コーセル	19,600	1,513.00	29,654,800	
イリソ電子工業	4,500	7,140.00	32,130,000	
新日本無線	12,000	456.00	5,472,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
オブテックスグループ	10,700	3,035.00	32,474,500	貸付有価証券 1,900株
千代田インテグレ	7,500	2,381.00	17,857,500	
アイ・オー・データ機器	4,400	1,081.00	4,756,400	貸付有価証券 1,800株(100株)
レーザーテック	31,100	1,492.00	46,401,200	貸付有価証券

				800株(800株)
スタンレー電気	101,000	3,175.00	320,675,000	貸付有価証券 8,400株
岩崎電気	52,000	171.00	8,892,000	
ウシオ電機	85,900	1,407.00	120,861,300	貸付有価証券 38,100株
岡谷電機産業	7,600	400.00	3,040,000	貸付有価証券 3,500株(100株)
ヘリオス テクノ ホールディング	13,000	677.00	8,801,000	貸付有価証券 200株
日本セラミック	11,600	2,417.00	28,037,200	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
遠藤照明	7,100	887.00	6,297,700	
古河電池	10,000	762.00	7,620,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
双信電機	6,900	299.00	2,063,100	
山一電機	13,300	1,647.00	21,905,100	貸付有価証券 5,600株
図研	9,200	1,364.00	12,548,800	
日本電子	52,000	592.00	30,784,000	
カシオ計算機	113,800	1,549.00	176,276,200	
ファナック	143,500	22,820.00	3,274,670,000	
日本シイエムケイ	30,500	713.00	21,746,500	貸付有価証券 700株
エンプラス	6,400	3,085.00	19,744,000	貸付有価証券 200株(200株)
大真空	5,200	1,416.00	7,363,200	貸付有価証券 1,800株
ローム	68,400	7,400.00	506,160,000	
浜松ホトニクス	110,400	3,205.00	353,832,000	貸付有価証券 27,500株
三井ハイテック	18,700	1,124.00	21,018,800	
新光電気工業	53,500	747.00	39,964,500	
京セラ	232,300	6,202.00	1,440,724,600	
太陽誘電	68,800	1,406.00	96,732,800	
村田製作所	148,500	15,835.00	2,351,497,500	
ユーシン	19,500	731.00	14,254,500	貸付有価証券 8,900株(5,200株)
双葉電子工業	23,100	1,962.00	45,322,200	
北陸電気工業	57,000	137.00	7,809,000	

ニチコン	44,600	1,037.00	46,250,200	
日本ケミコン	122,000	365.00	44,530,000	貸付有価証券 4,000株
K O A	19,600	1,467.00	28,753,200	
市光工業	30,000	550.00	16,500,000	貸付有価証券 7,000株(2,000株)
小糸製作所	84,800	5,790.00	490,992,000	貸付有価証券 21,300株
ミツバ	26,000	2,188.00	56,888,000	
S C R E E Nホールディングス	29,000	8,190.00	237,510,000	
キャノン電子	13,000	1,804.00	23,452,000	
キャノン	762,000	3,471.00	2,644,902,000	貸付有価証券 358,100株
リコー	425,600	916.00	389,849,600	
M U T O Hホールディングス	19,000	241.00	4,579,000	貸付有価証券 8,000株
東京エレクトロン	94,400	12,155.00	1,147,432,000	
トヨタ紡織	49,500	2,583.00	127,858,500	
芦森工業	32,000	159.00	5,088,000	
ユニプレス	27,300	2,319.00	63,308,700	
豊田自動織機	128,900	5,530.00	712,817,000	貸付有価証券 5,900株
モリタホールディングス	24,700	1,618.00	39,964,600	
三櫻工業	17,900	833.00	14,910,700	
デンソー	349,000	4,897.00	1,709,053,000	
東海理化電機製作所	37,300	2,243.00	83,663,900	
三井造船	511,000	172.00	87,892,000	
川崎重工業	1,101,000	338.00	372,138,000	
名村造船所	42,500	666.00	28,305,000	貸付有価証券 200株(200株)
サノヤスホールディングス	17,200	290.00	4,988,000	貸付有価証券 8,100株
日本車輛製造	52,000	296.00	15,392,000	貸付有価証券 21,000株(5,000株)
ニチユ三菱フォークリフト	16,800	714.00	11,995,200	貸付有価証券 2,600株
近畿車輛	2,100	2,560.00	5,376,000	貸付有価証券 200株
日産自動車	1,669,500	1,073.50	1,792,208,250	

いすゞ自動車	410,200	1,472.50	604,019,500	
トヨタ自動車	1,720,900	6,042.00	10,397,677,800	貸付有価証券 19,200株
日野自動車	202,000	1,347.00	272,094,000	
三菱自動車工業	518,700	669.00	347,010,300	
エフテック	7,600	1,415.00	10,754,000	貸付有価証券 2,300株(2,100株)
レシップホールディングス	4,600	850.00	3,910,000	貸付有価証券 1,900株
G M B	2,300	1,486.00	3,417,800	
ファルテック	2,500	1,351.00	3,377,500	
武蔵精密工業	16,500	2,846.00	46,959,000	貸付有価証券 5,500株(5,400株)
日産車体	62,200	1,002.00	62,324,400	
新明和工業	57,000	1,063.00	60,591,000	貸付有価証券 8,000株
極東開発工業	28,200	1,848.00	52,113,600	
日信工業	31,600	1,996.00	63,073,600	貸付有価証券 900株(700株)
トピー工業	11,600	2,958.00	34,312,800	貸付有価証券 500株
ティラド	55,000	330.00	18,150,000	
曙ブレーキ工業	65,700	348.00	22,863,600	貸付有価証券 26,700株(4,300株)
タチエス	24,000	2,217.00	53,208,000	
N O K	68,500	2,584.00	177,004,000	
フタバ産業	43,100	799.00	34,436,900	
K Y B	158,000	580.00	91,640,000	
大同メタル工業	17,800	978.00	17,408,400	貸付有価証券 2,600株
プレス工業	75,200	557.00	41,886,400	
ミクニ	18,000	452.00	8,136,000	
カルソニックカンセイ	96,000	1,280.00	122,880,000	貸付有価証券 20,000株(6,000株)
太平洋工業	29,200	1,583.00	46,223,600	
ケーヒン	32,500	1,826.00	59,345,000	
河西工業	19,100	1,430.00	27,313,000	貸付有価証券 3,400株
アイシン精機	129,500	5,470.00	708,365,000	

富士機工	14,000	553.00	7,742,000	
マツダ	448,200	1,603.00	718,464,600	
今仙電機製作所	12,900	1,005.00	12,964,500	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,273,800	3,351.00	4,268,503,800	
スズキ	280,500	4,622.00	1,296,471,000	貸付有価証券 34,500株(1,500株)
富士重工業	439,500	4,083.00	1,794,478,500	
安永	5,100	1,621.00	8,267,100	貸付有価証券 2,400株(1,000株)
ヤマハ発動機	199,900	2,681.00	535,931,900	貸付有価証券 92,400株
ショーワ	36,800	945.00	34,776,000	
T B K	18,100	502.00	9,086,200	
エクセディ	19,200	3,180.00	61,056,000	
豊田合成	45,700	2,831.00	129,376,700	
愛三工業	24,800	937.00	23,237,600	
盟和産業	2,200	1,254.00	2,758,800	
ヨロズ	13,200	1,713.00	22,611,600	貸付有価証券 800株
エフ・シー・シー	23,100	2,222.00	51,328,200	
シマノ	57,000	16,250.00	926,250,000	貸付有価証券 4,600株
タカタ	25,600	480.00	12,288,000	貸付有価証券 12,200株(3,000株)
テイ・エス テック	32,900	2,992.00	98,436,800	
ジャムコ	8,300	2,475.00	20,542,500	貸付有価証券 3,900株(100株)
テルモ	217,000	3,865.00	838,705,000	貸付有価証券 5,700株
クリエートメディック	4,700	973.00	4,573,100	
日機装	49,000	1,275.00	62,475,000	
島津製作所	182,200	1,769.00	322,311,800	
J M S	26,000	336.00	8,736,000	
クボテック	3,000	565.00	1,695,000	貸付有価証券 1,400株(900株)
長野計器	11,100	717.00	7,958,700	
ブイ・テクノロジー	2,900	17,160.00	49,764,000	
東京計器	49,000	231.00	11,319,000	貸付有価証券

				15,000株
愛知時計電機	1,900	3,755.00	7,134,500	
オーバル	13,800	265.00	3,657,000	貸付有価証券 6,100株
東京精密	27,400	3,505.00	96,037,000	
マニー	18,800	2,621.00	49,274,800	
ニコン	246,700	1,614.00	398,173,800	貸付有価証券 15,800株
トプコン	71,300	1,992.00	142,029,600	
オリンパス	225,900	4,280.00	966,852,000	貸付有価証券 24,200株(3,000株)
理研計器	12,500	1,694.00	21,175,000	
タムロン	12,500	2,013.00	25,162,500	貸付有価証券 700株
H O Y A	291,200	5,356.00	1,559,667,200	
ノーリツ鋼機	14,300	898.00	12,841,400	
エー・アンド・デイ	12,900	451.00	5,817,900	貸付有価証券 100株
シチズン時計	154,900	714.00	110,598,600	
リズム時計工業	57,000	191.00	10,887,000	
大研医器	12,600	800.00	10,080,000	貸付有価証券 4,000株(400株)
メニコン	9,700	3,410.00	33,077,000	貸付有価証券 3,000株
松風	7,400	1,323.00	9,790,200	貸付有価証券 3,400株
セイコーホールディングス	100,000	454.00	45,400,000	貸付有価証券 13,000株(13,000株)
ニプロ	98,000	1,570.00	153,860,000	貸付有価証券 3,200株
スノーピーク	2,200	3,175.00	6,985,000	貸付有価証券 1,000株(500株)
パラマウントベッドホールディングス	13,600	4,460.00	60,656,000	貸付有価証券 4,700株(100株)
トランザクション	6,200	1,106.00	6,857,200	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
S H O - B I	4,700	456.00	2,143,200	
ニホンフラッシュ	6,600	1,400.00	9,240,000	貸付有価証券 1,600株(100株)
前田工織	14,200	1,393.00	19,780,600	

永大産業	19,000	527.00	10,013,000	
アートネイチャー	15,100	745.00	11,249,500	
ダンロップスポーツ	8,900	1,037.00	9,229,300	
バンダイナムコホールディングス	156,100	3,330.00	519,813,000	
アイフィスジャパン	3,200	437.00	1,398,400	
共立印刷	23,500	336.00	7,896,000	
S H O E I	6,400	2,779.00	17,785,600	
フランスベッドホールディングス	17,800	926.00	16,482,800	貸付有価証券 8,300株
パイロットコーポレーション	24,700	4,555.00	112,508,500	
萩原工業	3,900	2,778.00	10,834,200	
トッパン・フォームズ	25,300	1,090.00	27,577,000	
フジシールインターナショナル	31,700	2,408.00	76,333,600	
タカラトミー	55,000	1,113.00	61,215,000	
廣済堂	14,200	379.00	5,381,800	貸付有価証券 6,700株
A s - m e エステール	3,800	673.00	2,557,400	貸付有価証券 100株
アーク	59,500	102.00	6,069,000	貸付有価証券 27,900株
タカノ	6,200	1,010.00	6,262,000	
プロネクサス	13,200	1,202.00	15,866,400	
ホクシン	10,000	204.00	2,040,000	貸付有価証券 600株
ウッドワン	24,000	287.00	6,888,000	
大建工業	10,000	2,061.00	20,610,000	
凸版印刷	400,000	1,135.00	454,000,000	
大日本印刷	408,000	1,200.00	489,600,000	
図書印刷	19,000	511.00	9,709,000	貸付有価証券 7,000株
共同印刷	44,000	362.00	15,928,000	
日本写真印刷	24,200	2,638.00	63,839,600	貸付有価証券 11,100株
光村印刷	13,000	266.00	3,458,000	
宝印刷	7,400	1,665.00	12,321,000	貸付有価証券 3,100株

アシックス	140,600	1,788.00	251,392,800	貸付有価証券 61,400株
ツツミ	5,300	2,080.00	11,024,000	貸付有価証券 800株
小松ウオール工業	4,800	1,853.00	8,894,400	
ヤマハ	95,400	3,065.00	292,401,000	
河合楽器製作所	5,500	2,333.00	12,831,500	
クリナップ	16,600	820.00	13,612,000	
ピジョン	85,500	3,555.00	303,952,500	貸付有価証券 600株
兼松サステック	15,000	231.00	3,465,000	貸付有価証券 1,000株
キングジム	11,800	871.00	10,277,800	
リンテック	33,600	2,373.00	79,732,800	
T A S A K I	3,900	2,196.00	8,564,400	貸付有価証券 1,800株（400株）
イトーキ	29,800	702.00	20,919,600	貸付有価証券 700株（100株）
任天堂	87,200	25,835.00	2,252,812,000	
三菱鉛筆	11,700	5,580.00	65,286,000	貸付有価証券 3,200株（1,000株）
タカラスタンダード	29,200	1,772.00	51,742,400	
コクヨ	73,600	1,435.00	105,616,000	
ナカバヤシ	25,000	266.00	6,650,000	
グローブライド	6,900	1,849.00	12,758,100	
岡村製作所	49,400	989.00	48,856,600	
美津濃	76,000	574.00	43,624,000	
東京電力ホールディングス	1,200,700	436.00	523,505,200	貸付有価証券 8,300株
中部電力	466,400	1,491.00	695,402,400	
関西電力	577,600	1,367.00	789,579,200	貸付有価証券 28,000株
中国電力	195,700	1,232.00	241,102,400	貸付有価証券 92,800株
北陸電力	138,700	1,080.00	149,796,000	貸付有価証券 63,100株（600株）
東北電力	353,600	1,508.00	533,228,800	
四国電力	127,500	1,223.00	155,932,500	貸付有価証券 59,000株（4,300株）
九州電力	312,600	1,186.00	370,743,600	貸付有価証券

				95,600株(38,300株)
北海道電力	132,500	842.00	111,565,000	貸付有価証券 42,300株
沖縄電力	20,800	2,646.00	55,036,800	貸付有価証券 1,000株
電源開発	112,600	2,605.00	293,323,000	
エフオン	5,200	967.00	5,028,400	貸付有価証券 100株(100株)
イーレックス	17,800	1,313.00	23,371,400	貸付有価証券 8,400株(300株)
東京瓦斯	1,518,000	506.60	769,018,800	
大阪瓦斯	1,373,000	423.00	580,779,000	
東邦瓦斯	355,000	787.00	279,385,000	
北海道瓦斯	35,000	275.00	9,625,000	貸付有価証券 14,000株(6,000株)
広島ガス	29,100	364.00	10,592,400	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
西部瓦斯	159,000	256.00	40,704,000	
静岡ガス	43,500	755.00	32,842,500	
メタウォーター	8,000	2,899.00	23,192,000	貸付有価証券 3,800株
S B Sホールディングス	14,000	804.00	11,256,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
東武鉄道	756,000	564.00	426,384,000	貸付有価証券 58,000株(28,000株)
相鉄ホールディングス	226,000	517.00	116,842,000	貸付有価証券 106,000株
東京急行電鉄	769,000	788.00	605,972,000	
京浜急行電鉄	388,000	1,222.00	474,136,000	貸付有価証券 112,000株
小田急電鉄	226,700	2,166.00	491,032,200	貸付有価証券 16,500株
京王電鉄	395,000	882.00	348,390,000	貸付有価証券 2,000株
京成電鉄	106,100	2,583.00	274,056,300	貸付有価証券 2,600株
富士急行	39,000	987.00	38,493,000	貸付有価証券 18,000株(3,000株)
新京成電鉄	18,000	415.00	7,470,000	
東日本旅客鉄道	273,800	9,694.00	2,654,217,200	
西日本旅客鉄道	136,200	7,241.00	986,224,200	

東海旅客鉄道	117,700	18,140.00	2,135,078,000	
西武ホールディングス	195,500	1,837.00	359,133,500	
鴻池運輸	20,000	1,378.00	27,560,000	
西日本鉄道	170,000	469.00	79,730,000	貸付有価証券 79,000株
ハマキョウレックス	9,200	2,281.00	20,985,200	
サカイ引越センター	4,900	3,095.00	15,165,500	貸付有価証券 2,300株
近鉄グループホールディングス	1,425,000	401.00	571,425,000	貸付有価証券 170,000株
阪急阪神ホールディングス	178,800	3,620.00	647,256,000	
南海電気鉄道	299,000	542.00	162,058,000	
京阪ホールディングス	317,000	681.00	215,877,000	貸付有価証券 1,000株
神戸電鉄	35,000	385.00	13,475,000	貸付有価証券 16,000株
名古屋鉄道	515,000	501.00	258,015,000	貸付有価証券 242,000株
山陽電気鉄道	52,000	566.00	29,432,000	貸付有価証券 24,000株
日本通運	547,000	572.00	312,884,000	
ヤマトホールディングス	253,100	2,332.50	590,355,750	貸付有価証券 6,300株
山九	186,000	675.00	125,550,000	
丸運	7,600	254.00	1,930,400	
丸全昭和運輸	47,000	442.00	20,774,000	貸付有価証券 12,000株（12,000株）
センコー	67,200	717.00	48,182,400	貸付有価証券 6,600株（5,700株）
トナミホールディングス	29,000	405.00	11,745,000	
ニッコンホールディングス	48,000	2,375.00	114,000,000	
日本石油輸送	1,600	2,555.00	4,088,000	
福山通運	86,000	668.00	57,448,000	貸付有価証券 1,000株
セイノーホールディングス	100,400	1,250.00	125,500,000	貸付有価証券 400株
神奈川中央交通	17,000	711.00	12,087,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）

日立物流	29,500	2,313.00	68,233,500	
丸和運輸機関	3,500	2,560.00	8,960,000	貸付有価証券 100株
C & F ロジホールディング グス	14,700	1,508.00	22,167,600	
九州旅客鉄道	105,500	3,425.00	361,337,500	
日本郵船	1,196,000	235.00	281,060,000	貸付有価証券 138,000株
商船三井	742,000	350.00	259,700,000	貸付有価証券 221,000株(77,000 株)
川崎汽船	537,000	296.00	158,952,000	貸付有価証券 247,000株(1,000株)
N S ユナイテッド海運	63,000	240.00	15,120,000	
明治海運	12,700	465.00	5,905,500	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
飯野海運	73,200	487.00	35,648,400	
共栄タンカー	12,000	233.00	2,796,000	
乾汽船	10,300	931.00	9,589,300	貸付有価証券 1,800株
日本航空	255,000	3,526.00	899,130,000	
A N A ホールディングス	2,627,000	339.80	892,654,600	
パスコ	13,000	353.00	4,589,000	貸付有価証券 6,000株
トランコム	4,100	5,760.00	23,616,000	
日新	58,000	372.00	21,576,000	
三菱倉庫	93,000	1,534.00	142,662,000	貸付有価証券 1,000株
三井倉庫ホールディング ス	82,000	332.00	27,224,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
住友倉庫	103,000	612.00	63,036,000	
澁澤倉庫	37,000	354.00	13,098,000	
東陽倉庫	24,200	346.00	8,373,200	
日本トランスシティ	32,000	467.00	14,944,000	
ケイヒン	26,000	159.00	4,134,000	
中央倉庫	8,200	1,082.00	8,872,400	
安田倉庫	11,000	749.00	8,239,000	貸付有価証券 5,100株
東洋埠頭	41,000	182.00	7,462,000	貸付有価証券 2,000株

宇徳	11,500	418.00	4,807,000	
上組	169,000	962.00	162,578,000	
サンリツ	3,400	527.00	1,791,800	
キムラユニティー	3,600	1,162.00	4,183,200	貸付有価証券 1,500株
キューソー流通システム	4,500	2,746.00	12,357,000	
郵船ロジスティクス	13,000	1,121.00	14,573,000	
近鉄エクスプレス	25,300	1,682.00	42,554,600	貸付有価証券 4,100株(3,900株)
東海運	7,600	456.00	3,465,600	貸付有価証券 3,600株(2,500株)
エーアイティー	8,700	1,006.00	8,752,200	
内外トランスライン	4,200	1,111.00	4,666,200	
NEC ネットエスアイ	15,300	2,153.00	32,940,900	
システナ	11,100	1,711.00	18,992,100	
デジタルアーツ	6,200	3,045.00	18,879,000	貸付有価証券 2,800株(2,600株)
新日鉄住金ソリューションズ	23,300	2,406.00	56,059,800	
キューブシステム	6,000	683.00	4,098,000	
コア	5,900	1,334.00	7,870,600	貸付有価証券 500株
ソフトクリエイトホールディングス	6,700	1,279.00	8,569,300	貸付有価証券 2,000株(1,900株)
T I S	46,300	2,832.00	131,121,600	貸付有価証券 11,800株
ネオス	4,100	455.00	1,865,500	貸付有価証券 1,900株(800株)
電算システム	4,900	1,646.00	8,065,400	貸付有価証券 300株
グリー	85,000	701.00	59,585,000	
コーエーテクモホールディングス	33,100	2,113.00	69,940,300	貸付有価証券 100株(100株)
三菱総合研究所	5,400	3,225.00	17,415,000	
ボルテージ	2,500	1,241.00	3,102,500	貸付有価証券 700株
電算	1,500	2,260.00	3,390,000	貸付有価証券 700株
A G S	3,500	1,836.00	6,426,000	貸付有価証券 1,600株

ファインデックス	10,300	1,064.00	10,959,200	貸付有価証券 4,100株（2,800株）
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	1,834.00	5,685,400	貸付有価証券 1,300株（500株）
ブレインパッド	3,000	1,158.00	3,474,000	貸付有価証券 1,400株（500株）
K L a b	26,700	740.00	19,758,000	貸付有価証券 12,600株（500株）
ポルトウウィン・ピットクルーホールディ	10,000	1,194.00	11,940,000	
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	1,408.00	3,097,600	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ネクソン	153,300	1,769.00	271,187,700	
アイスタイル	29,400	916.00	26,930,400	貸付有価証券 13,700株（100株）
エムアップ	3,900	866.00	3,377,400	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
エイチーム	7,700	2,661.00	20,489,700	貸付有価証券 3,100株（200株）
テクノスジャパン	10,800	1,060.00	11,448,000	貸付有価証券 5,100株（1,000株）
e n i s h	4,100	555.00	2,275,500	貸付有価証券 1,900株
コロプラ	39,200	1,032.00	40,454,400	貸付有価証券 18,600株
モバイルクリエイト	10,200	376.00	3,835,200	貸付有価証券 4,800株（1,000株）
オルトプラス	5,800	880.00	5,104,000	貸付有価証券 2,700株（2,600株）
ブロードリーフ	34,400	762.00	26,212,800	
ハーツユナイテッドグループ	7,300	1,514.00	11,052,200	貸付有価証券 3,500株（1,900株）
メディアドゥ	3,000	2,623.00	7,869,000	貸付有価証券 1,400株
ブイキューブ	7,700	609.00	4,689,300	貸付有価証券 3,600株（400株）
サイバーリンクス	2,100	1,010.00	2,121,000	
ディー・エル・イー	4,700	570.00	2,679,000	貸付有価証券 2,200株（200株）
フィックスターズ	2,000	3,310.00	6,620,000	貸付有価証券 900株
VOYAGE GROU	4,800	1,799.00	8,635,200	貸付有価証券

P				2,200株(2,200株)
オプティム	2,900	2,934.00	8,508,600	貸付有価証券 1,400株
セレス	2,500	1,512.00	3,780,000	貸付有価証券 1,100株
ベリサーブ	1,600	2,841.00	4,545,600	貸付有価証券 700株(400株)
ティーガイア	13,900	1,915.00	26,618,500	貸付有価証券 1,700株
日本アジアグループ	15,800	393.00	6,209,400	貸付有価証券 1,300株
豆蔵ホールディングス	10,200	863.00	8,802,600	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	8,700	1,322.00	11,501,400	貸付有価証券 3,200株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	292,900	248.00	72,639,200	貸付有価証券 137,400株
GMOペイメントゲート ウェイ	11,400	5,550.00	63,270,000	貸付有価証券 5,400株
ザッパラス	7,200	501.00	3,607,200	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
システムリサーチ	1,400	2,072.00	2,900,800	貸付有価証券 600株(600株)
インターネットイニシア ティブ	20,500	2,009.00	41,184,500	
さくらインターネット	11,300	916.00	10,350,800	貸付有価証券 4,900株(2,000株)
GMOクラウド	3,100	2,299.00	7,126,900	貸付有価証券 1,400株(600株)
SRAホールディングス	7,400	2,944.00	21,785,600	
Minorityソリュー ションズ	3,100	1,346.00	4,172,600	
システムインテグレータ	1,900	693.00	1,316,700	貸付有価証券 300株(100株)
朝日ネット	12,700	495.00	6,286,500	
アドソル日進	2,800	1,250.00	3,500,000	貸付有価証券 1,300株
フリービット	7,700	894.00	6,883,800	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
コムチュア	2,400	3,900.00	9,360,000	貸付有価証券 1,100株
サイバーコム	1,900	1,025.00	1,947,500	貸付有価証券

				800株
メディカル・データ・ビジョン	2,300	3,775.00	8,682,500	貸付有価証券 1,000株(900株)
gumi	15,800	1,190.00	18,802,000	貸付有価証券 7,300株(1,100株)
ショーケース・ティービー	1,600	1,297.00	2,075,200	貸付有価証券 700株
PCIホールディングス	1,600	2,656.00	4,249,600	貸付有価証券 700株
パイブドHD	2,500	1,143.00	2,857,500	貸付有価証券 400株
アイピーシー	1,100	997.00	1,096,700	貸付有価証券 500株
オープンドア	1,400	3,055.00	4,277,000	貸付有価証券 600株
LINE	23,500	4,275.00	100,462,500	貸付有価証券 9,200株(4,700株)
AOI TYO Holdings	11,400	838.00	9,553,200	
ソルクシーズ	4,000	566.00	2,264,000	
フェイス	3,700	1,216.00	4,499,200	貸付有価証券 200株
ハイマックス	1,800	1,498.00	2,696,400	
野村総合研究所	104,400	4,100.00	428,040,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
サイバネットシステム	11,400	728.00	8,299,200	貸付有価証券 5,400株(1,100株)
CEホールディングス	2,100	1,052.00	2,209,200	貸付有価証券 900株
インテージホールディングス	8,000	2,000.00	16,000,000	
東邦システムサイエンス	4,600	675.00	3,105,000	
ソースネクスト	8,400	569.00	4,779,600	貸付有価証券 3,600株(2,600株)
フォーカスシステムズ	5,400	556.00	3,002,400	貸付有価証券 800株
クレスコ	3,200	2,778.00	8,889,600	
フジ・メディア・ホールディングス	145,500	1,536.00	223,488,000	貸付有価証券 9,200株
オービック	48,200	5,300.00	255,460,000	
ジャストシステム	22,600	1,378.00	31,142,800	

TDCソフトウェアエンジニアリング	6,100	1,348.00	8,222,800	
ヤフー	1,001,300	514.00	514,668,200	貸付有価証券 58,600株
トレンドマイクロ	74,000	4,950.00	366,300,000	貸付有価証券 26,700株
インフォメーション・ディベロプメント	4,000	1,184.00	4,736,000	貸付有価証券 1,800株
日本オラクル	22,400	6,360.00	142,464,000	
アルファシステムズ	4,600	1,960.00	9,016,000	
フューチャー	18,900	880.00	16,632,000	
CAC Holdings	10,400	1,074.00	11,169,600	
ソフトバンク・テクノロジー	3,300	3,950.00	13,035,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
トーセ	3,800	808.00	3,070,400	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルティング	7,100	5,580.00	39,618,000	貸付有価証券 3,000株
伊藤忠テクノソリューションズ	31,600	3,270.00	103,332,000	
アイティフォー	18,100	619.00	11,203,900	
東計電算	2,500	2,311.00	5,777,500	
エクスネット	2,500	967.00	2,417,500	
大塚商会	37,600	6,040.00	227,104,000	
サイボウズ	18,500	442.00	8,177,000	貸付有価証券 300株
ソフトブレーン	19,000	530.00	10,070,000	貸付有価証券 8,900株(7,400株)
電通国際情報サービス	8,600	2,519.00	21,663,400	
デジタルガレージ	20,300	2,299.00	46,669,700	
EMシステムズ	4,800	1,808.00	8,678,400	貸付有価証券 800株
ウェザーニューズ	4,700	3,610.00	16,967,000	貸付有価証券 2,200株(200株)
C I J	11,700	556.00	6,505,200	貸付有価証券 100株
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,663.00	2,328,200	
日本エンタープライズ	14,300	279.00	3,989,700	貸付有価証券 1,000株

WOWOW	6,700	3,860.00	25,862,000	貸付有価証券 600株
スカラ	9,600	888.00	8,524,800	貸付有価証券 4,500株
日本コロムビア	4,200	693.00	2,910,600	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	11,700	743.00	8,693,100	貸付有価証券 5,400株
ネットワンシステムズ	60,500	903.00	54,631,500	
システムソフト	24,600	151.00	3,714,600	貸付有価証券 11,800株
アルゴグラフィックス	6,400	2,333.00	14,931,200	
マーベラス	23,600	872.00	20,579,200	貸付有価証券 11,100株(800株)
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	25,700	1,609.00	41,351,300	
日本ユニシス	38,600	1,520.00	58,672,000	
兼松エレクトロニクス	8,800	2,838.00	24,974,400	
東京放送ホールディング ス	92,100	1,988.00	183,094,800	
日本テレビホールディン グス	127,500	1,917.00	244,417,500	
朝日放送	13,800	759.00	10,474,200	
テレビ朝日ホールディン グス	38,200	2,104.00	80,372,800	貸付有価証券 400株
スカパーJ S A Tホール ディングス	90,900	470.00	42,723,000	貸付有価証券 900株(900株)
テレビ東京ホールディン グス	11,400	2,545.00	29,013,000	貸付有価証券 1,100株
日本BS放送	3,100	1,065.00	3,301,500	貸付有価証券 1,500株(700株)
ビジョン	1,600	4,350.00	6,960,000	貸付有価証券 100株(100株)
U-NEXT	3,600	943.00	3,394,800	貸付有価証券 1,600株
ワイヤレスゲート	4,800	1,495.00	7,176,000	貸付有価証券 2,300株
コネクシオ	12,300	1,706.00	20,983,800	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
日本通信	116,900	191.00	22,327,900	貸付有価証券 54,800株

クロップス	3,000	591.00	1,773,000	貸付有価証券 1,300株
日本電信電話	1,121,400	4,752.00	5,328,892,800	
K D D I	1,382,000	2,922.00	4,038,204,000	
光通信	16,800	10,880.00	182,784,000	
N T T ドコモ	1,043,900	2,592.50	2,706,310,750	
エムティーアイ	21,400	675.00	14,445,000	貸付有価証券 4,000株
G M O インターネット	51,000	1,316.00	67,116,000	貸付有価証券 7,400株(2,000株)
カドカワ	40,500	1,596.00	64,638,000	
学研ホールディングス	4,700	3,085.00	14,499,500	
ゼンリン	18,500	2,367.00	43,789,500	
昭文社	7,600	698.00	5,304,800	貸付有価証券 2,100株
インプレスホールディングス	11,500	139.00	1,598,500	貸付有価証券 900株(100株)
アイネット	7,900	1,234.00	9,748,600	
松竹	92,000	1,311.00	120,612,000	
東宝	91,400	2,951.00	269,721,400	
東映	52,000	951.00	49,452,000	貸付有価証券 2,000株
エヌ・ティ・ティ・データ	86,300	5,280.00	455,664,000	
ピー・シー・エー	2,000	1,536.00	3,072,000	貸付有価証券 900株
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	1,001.00	2,402,400	貸付有価証券 1,100株
D T S	14,400	2,778.00	40,003,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	53,800	3,150.00	169,470,000	
シーイーシー	8,300	2,135.00	17,720,500	
カブコン	32,700	2,171.00	70,991,700	貸付有価証券 9,200株(1,800株)
アイ・エス・ビー	2,700	901.00	2,432,700	
ジャステック	8,800	1,040.00	9,152,000	
S C S K	38,000	4,420.00	167,960,000	
日本システムウエア	4,600	1,409.00	6,481,400	貸付有価証券 1,800株(500株)
アイネス	17,600	1,075.00	18,920,000	

T K C	12,900	3,180.00	41,022,000	
富士ソフト	20,700	2,838.00	58,746,600	
N S D	29,600	1,608.00	47,596,800	
コナミホールディングス	63,100	4,725.00	298,147,500	貸付有価証券 100株
福井コンピュータホールディングス	4,000	2,605.00	10,420,000	貸付有価証券 700株
J B C Cホールディングス	11,700	781.00	9,137,700	
ミロク情報サービス	10,300	1,839.00	18,941,700	
ソフトバンクグループ	628,900	7,862.00	4,944,411,800	
ハウスイ	11,000	127.00	1,397,000	
高千穂交易	5,400	1,004.00	5,421,600	貸付有価証券 2,500株
伊藤忠食品	3,400	4,585.00	15,589,000	貸付有価証券 1,300株
エレマテック	5,600	1,922.00	10,763,200	
J A L U X	4,500	2,684.00	12,078,000	貸付有価証券 1,600株(900株)
あらた	6,300	3,030.00	19,089,000	貸付有価証券 2,900株(1,400株)
トーメンデバイス	2,100	2,220.00	4,662,000	
東京エレクトロン デバイス	5,000	1,610.00	8,050,000	
フィールズ	10,700	1,156.00	12,369,200	貸付有価証券 5,000株(800株)
双日	825,000	279.00	230,175,000	
アルフレッサ ホールディングス	165,300	1,929.00	318,863,700	
横浜冷凍	34,600	1,106.00	38,267,600	貸付有価証券 16,100株(12,900株)
神栄	19,000	190.00	3,610,000	貸付有価証券 8,000株
山下医科器械	1,100	1,728.00	1,900,800	貸付有価証券 100株(100株)
ラサ商事	6,000	717.00	4,302,000	貸付有価証券 200株
ラクーン	6,600	491.00	3,240,600	貸付有価証券 2,500株
アルコニックス	7,900	1,843.00	14,559,700	貸付有価証券 1,000株(1,000株)

神戸物産	7,500	4,300.00	32,250,000	
あい ホールディングス	19,900	2,645.00	52,635,500	貸付有価証券 5,100株(4,300株)
ディービーエックス	5,000	1,323.00	6,615,000	貸付有価証券 2,300株
ダイワボウホールディングス	119,000	328.00	39,032,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,800	1,579.00	40,738,200	貸付有価証券 4,800株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,200	1,032.00	27,038,400	貸付有価証券 9,000株(8,800株)
八洲電機	10,800	667.00	7,203,600	
U K Cホールディングス	9,000	2,044.00	18,396,000	
O C H Iホールディングス	4,000	1,275.00	5,100,000	貸付有価証券 1,800株
T O K A Iホールディングス	61,400	856.00	52,558,400	貸付有価証券 28,300株
大阪工機	1,600	751.00	1,201,600	
三洋貿易	7,600	1,757.00	13,353,200	
ビューティガレージ	1,400	1,802.00	2,522,800	貸付有価証券 500株(500株)
ウイン・パートナーズ	10,100	953.00	9,625,300	貸付有価証券 600株
ミタチ産業	3,200	651.00	2,083,200	
シップヘルスケアホールディングス	26,800	2,961.00	79,354,800	
明治電機工業	4,800	1,326.00	6,364,800	貸付有価証券 400株
デリカフーズ	2,900	1,088.00	3,155,200	貸付有価証券 600株
スターティア	3,200	508.00	1,625,600	
コメダホールディングス	18,900	1,792.00	33,868,800	貸付有価証券 8,700株(100株)
富士興産	5,000	503.00	2,515,000	
協栄産業	17,000	164.00	2,788,000	
小野建	12,100	1,359.00	16,443,900	貸付有価証券 400株
佐鳥電機	10,300	811.00	8,353,300	
エコトレーディング	3,200	651.00	2,083,200	
伯東	9,500	1,031.00	9,794,500	

コンドーテック	11,100	933.00	10,356,300	
中山福	8,000	835.00	6,680,000	貸付有価証券 100株
ナガイレーベン	20,200	2,299.00	46,439,800	
三菱食品	15,300	3,450.00	52,785,000	貸付有価証券 200株
松田産業	10,200	1,490.00	15,198,000	
第一興商	22,700	4,465.00	101,355,500	
メディバルホールディングス	139,700	1,746.00	243,916,200	
S P K	3,000	2,540.00	7,620,000	
萩原電気	4,800	2,158.00	10,358,400	
アズワン	10,900	4,820.00	52,538,000	
スズデン	5,000	1,088.00	5,440,000	
尾家産業	4,500	1,181.00	5,314,500	
シモジマ	8,500	1,162.00	9,877,000	
ドウシシャ	16,400	2,061.00	33,800,400	貸付有価証券 3,300株
小津産業	3,100	2,225.00	6,897,500	貸付有価証券 1,400株
高速	8,300	1,126.00	9,345,800	
たけびし	4,900	1,443.00	7,070,700	貸付有価証券 2,300株
黒田電気	19,100	2,424.00	46,298,400	
リックス	3,100	1,619.00	5,018,900	貸付有価証券 1,400株
丸文	12,300	714.00	8,782,200	
ハピネット	11,600	1,723.00	19,986,800	貸付有価証券 200株
橋本総業ホールディングス	2,900	1,462.00	4,239,800	貸付有価証券 1,300株
日本ライフライン	11,900	2,136.00	25,418,400	貸付有価証券 2,100株
エクセル	6,000	1,497.00	8,982,000	貸付有価証券 2,200株
マルカキカイ	4,500	1,803.00	8,113,500	
I D O M	37,600	706.00	26,545,600	貸付有価証券 15,900株(14,000株)
日本エム・ディ・エム	10,500	778.00	8,169,000	
進和	8,200	1,873.00	15,358,600	

エスケイジャパン	2,600	291.00	756,600	
ダイترون	6,400	1,225.00	7,840,000	
シークス	10,000	4,480.00	44,800,000	貸付有価証券 4,200株
田中商事	4,300	686.00	2,949,800	
オーハシテクニカ	7,900	1,380.00	10,902,000	
白銅	3,500	1,729.00	6,051,500	
伊藤忠商事	1,023,200	1,580.00	1,616,656,000	
丸紅	1,374,900	685.50	942,493,950	
高島	24,000	197.00	4,728,000	
長瀬産業	84,000	1,551.00	130,284,000	
蝶理	8,900	1,939.00	17,257,100	
豊田通商	155,600	3,370.00	524,372,000	
三共生興	21,100	390.00	8,229,000	貸付有価証券 100株
兼松	297,000	200.00	59,400,000	
ツカモトコーポレーショ ン	25,000	124.00	3,100,000	
三井物産	1,263,300	1,612.50	2,037,071,250	
日本紙パルプ商事	73,000	371.00	27,083,000	貸付有価証券 2,000株
日立ハイテクノロジーズ	48,400	4,535.00	219,494,000	
カメイ	18,200	1,238.00	22,531,600	
東都水産	2,100	1,860.00	3,906,000	
OUGホールディングス	22,000	261.00	5,742,000	
スターゼン	5,800	4,470.00	25,926,000	
山善	53,600	1,002.00	53,707,200	
椿本興業	16,000	409.00	6,544,000	
住友商事	879,400	1,497.50	1,316,901,500	
内田洋行	6,900	2,581.00	17,808,900	
三菱商事	1,048,200	2,405.50	2,521,445,100	
第一実業	32,000	697.00	22,304,000	
キャノンマーケティング ジャパン	39,800	2,214.00	88,117,200	
西華産業	45,000	352.00	15,840,000	
佐藤商事	12,500	871.00	10,887,500	
菱洋エレクトロ	13,300	1,643.00	21,851,900	

東京産業	13,900	456.00	6,338,400	貸付有価証券 1,500株
ユアサ商事	13,200	3,085.00	40,722,000	
神鋼商事	3,500	2,396.00	8,386,000	
小林産業	10,200	281.00	2,866,200	貸付有価証券 300株
阪和興業	140,000	791.00	110,740,000	
カナデン	13,300	1,077.00	14,324,100	
菱電商事	22,000	733.00	16,126,000	
フルサト工業	7,700	1,687.00	12,989,900	貸付有価証券 300株
岩谷産業	155,000	648.00	100,440,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
すてきナイスグループ	59,000	152.00	8,968,000	
昭光通商	50,000	84.00	4,200,000	貸付有価証券 23,000株
ニチモウ	20,000	181.00	3,620,000	貸付有価証券 6,000株（1,000株）
極東貿易	21,000	233.00	4,893,000	
イワキ	21,000	298.00	6,258,000	
三愛石油	37,400	943.00	35,268,200	
稲畑産業	33,500	1,357.00	45,459,500	
G S I クレオス	34,000	137.00	4,658,000	
明和産業	12,900	409.00	5,276,100	
ワキタ	29,700	1,058.00	31,422,600	
東邦ホールディングス	44,700	2,330.00	104,151,000	貸付有価証券 18,100株（17,300株）
サンゲツ	47,900	1,861.00	89,141,900	
ミツウロコグループホールディングス	22,500	690.00	15,525,000	
シナネンホールディングス	6,000	2,110.00	12,660,000	
伊藤忠エネクス	30,800	920.00	28,336,000	
サンリオ	43,100	2,045.00	88,139,500	貸付有価証券 12,800株
サンワテクノス	8,200	1,126.00	9,233,200	
リョーサン	20,800	3,350.00	69,680,000	貸付有価証券 100株
新光商事	15,300	1,215.00	18,589,500	

トーヨー	6,300	2,601.00	16,386,300	
三信電気	15,400	1,271.00	19,573,400	貸付有価証券 400株
東陽テクニカ	17,200	1,011.00	17,389,200	貸付有価証券 2,500株
モスフードサービス	18,300	3,245.00	59,383,500	貸付有価証券 8,600株（100株）
加賀電子	12,600	1,976.00	24,897,600	
ソーダニッカ	14,400	502.00	7,228,800	貸付有価証券 6,700株
立花エレテック	9,400	1,384.00	13,009,600	
フォーバル	6,100	665.00	4,056,500	
PALTAC	22,300	3,100.00	69,130,000	
三谷産業	14,800	377.00	5,579,600	貸付有価証券 6,100株
太平洋興発	58,000	97.00	5,626,000	貸付有価証券 27,000株
ヤマタネ	7,000	1,518.00	10,626,000	
丸紅建材リース	14,000	233.00	3,262,000	
日鉄住金物産	12,200	4,680.00	57,096,000	
トラスコ中山	31,900	2,581.00	82,333,900	貸付有価証券 8,900株
オートバックスセブン	51,700	1,652.00	85,408,400	貸付有価証券 19,800株
モリト	11,200	915.00	10,248,000	貸付有価証券 5,200株
加藤産業	21,800	2,856.00	62,260,800	
イノテック	12,000	676.00	8,112,000	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	13,200	2,580.00	34,056,000	
J Kホールディングス	14,000	662.00	9,268,000	
日伝	5,800	3,350.00	19,430,000	
北沢産業	11,500	216.00	2,484,000	貸付有価証券 100株
杉本商事	8,000	1,520.00	12,160,000	
因幡電機産業	19,600	3,980.00	78,008,000	
バイテックホールディングス	5,700	1,350.00	7,695,000	貸付有価証券 1,600株
ミスミグループ本社	157,200	2,012.00	316,286,400	
アルテック	11,900	217.00	2,582,300	貸付有価証券

				5,600株
タキヒヨー	21,000	450.00	9,450,000	
蔵王産業	2,300	1,460.00	3,358,000	
スズケン	63,600	3,650.00	232,140,000	
ジェコス	9,600	1,084.00	10,406,400	
ルネサスイーストン	12,800	580.00	7,424,000	貸付有価証券 400株(200株)
ローソン	44,100	7,550.00	332,955,000	貸付有価証券 20,700株(20,700株)
サンエー	10,500	5,060.00	53,130,000	
カワチ薬品	10,800	3,010.00	32,508,000	
エービーシー・マート	25,400	6,510.00	165,354,000	貸付有価証券 2,300株
ハードオフコーポレーション	6,100	1,116.00	6,807,600	
アスクル	14,600	3,265.00	47,669,000	貸付有価証券 5,600株(500株)
ゲオホールディングス	23,300	1,222.00	28,472,600	貸付有価証券 10,800株(1,100株)
アダストリア	21,400	2,773.00	59,342,200	
ジーフット	8,400	745.00	6,258,000	貸付有価証券 200株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	1,800	705.00	1,269,000	
くらコーポレーション	9,100	4,650.00	42,315,000	貸付有価証券 900株(100株)
キャンドゥ	7,400	1,773.00	13,120,200	貸付有価証券 2,100株(1,700株)
パルグループホールディングス	7,100	2,700.00	19,170,000	
エディオン	54,100	1,023.00	55,344,300	貸付有価証券 25,400株(14,000株)
サーラコーポレーション	17,400	622.00	10,822,800	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ワッツ	6,000	1,321.00	7,926,000	貸付有価証券 1,300株
ハローズ	4,600	2,247.00	10,336,200	貸付有価証券 2,100株
あみやき亭	2,700	4,130.00	11,151,000	貸付有価証券 1,200株
ひらまつ	19,200	667.00	12,806,400	貸付有価証券

				7,400株(600株)
ゲンキー	2,800	6,880.00	19,264,000	貸付有価証券 800株
大黒天物産	3,300	5,040.00	16,632,000	貸付有価証券 1,500株
ハニーズホールディングス	13,500	1,113.00	15,025,500	貸付有価証券 5,800株
ファーマライズホールディングス	3,200	530.00	1,696,000	貸付有価証券 100株(100株)
アルペン	10,700	1,935.00	20,704,500	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
クオール	15,800	1,645.00	25,991,000	
ジェイアイエヌ	9,500	5,810.00	55,195,000	貸付有価証券 4,000株(3,400株)
ビックカメラ	80,200	1,023.00	82,044,600	
DCMホールディングス	84,800	1,027.00	87,089,600	貸付有価証券 35,900株(9,800株)
MonotaRO	49,500	3,440.00	170,280,000	貸付有価証券 8,700株
東京一番フーズ	3,500	565.00	1,977,500	貸付有価証券 1,600株(800株)
ダイヤモンドダイニング	3,100	1,713.00	5,310,300	貸付有価証券 1,400株
きちり	3,700	656.00	2,427,200	貸付有価証券 1,700株(1,200株)
アークランドサービスホールディングス	4,400	3,060.00	13,464,000	貸付有価証券 2,000株
J.フロントリテイリング	176,800	1,650.00	291,720,000	貸付有価証券 900株
ドトール・日レスホールディングス	24,500	2,179.00	53,385,500	
マツモトキヨシホールディングス	26,400	5,280.00	139,392,000	
ブロンコビリー	7,300	2,887.00	21,075,100	貸付有価証券 3,400株(300株)
スタートトゥデイ	127,500	2,463.00	314,032,500	
トレジャー・ファクトリー	4,000	793.00	3,172,000	貸付有価証券 1,800株
物語コーポレーション	4,000	5,100.00	20,400,000	貸付有価証券 700株(600株)
ココカラファイン	14,600	4,825.00	70,445,000	
三越伊勢丹ホールディング	277,900	1,222.00	339,593,800	

グス				
H a m e e	3,100	1,053.00	3,264,300	貸付有価証券 1,400株（100株）
ウエルシアホールディングス	27,600	3,115.00	85,974,000	
クリエイイトSDホールディングス	20,600	2,648.00	54,548,800	
丸善CHIホールディングス	16,300	356.00	5,802,800	貸付有価証券 500株
ミサワ	2,500	440.00	1,100,000	貸付有価証券 1,000株
ティーライフ	1,300	1,850.00	2,405,000	
エー・ピーカンパニー	2,300	943.00	2,168,900	貸付有価証券 1,000株
チムニー	4,300	2,704.00	11,627,200	
シュッピン	5,300	1,627.00	8,623,100	貸付有価証券 1,300株（100株）
ネクステージ	5,400	1,270.00	6,858,000	貸付有価証券 200株
ジョイフル本田	22,700	3,710.00	84,217,000	
鳥貴族	3,400	2,414.00	8,207,600	貸付有価証券 1,500株（800株）
キリン堂ホールディングス	4,500	800.00	3,600,000	
ホットランド	6,500	1,200.00	7,800,000	貸付有価証券 2,300株（1,600株）
すかいらーく	59,900	1,631.00	97,696,900	貸付有価証券 22,900株
綿半ホールディングス	5,600	1,729.00	9,682,400	貸付有価証券 1,700株
ヨシックス	1,400	1,324.00	1,853,600	貸付有価証券 500株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	46,300	1,018.00	47,133,400	
ブックオフコーポレーション	7,900	790.00	6,241,000	貸付有価証券 3,700株（800株）
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,600	809.00	4,530,400	貸付有価証券 2,500株
B E E N O S	1,600	1,511.00	2,417,600	貸付有価証券 700株
あさひ	10,400	1,298.00	13,499,200	
日本調剤	4,900	3,785.00	18,546,500	貸付有価証券

				2,200株
コスモス薬品	7,000	21,740.00	152,180,000	貸付有価証券 800株(400株)
トーエル	6,700	961.00	6,438,700	貸付有価証券 3,100株(800株)
一六堂	2,900	396.00	1,148,400	
オンリー	1,600	855.00	1,368,000	
セブン & アイ・ホールディングス	584,700	4,362.00	2,550,461,400	貸付有価証券 221,500株(17,800株)
薬王堂	6,900	2,778.00	19,168,200	貸付有価証券 1,100株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	37,500	988.00	37,050,000	貸付有価証券 17,700株
ツルハホールディングス	27,900	10,300.00	287,370,000	
サンマルクホールディングス	9,000	3,270.00	29,430,000	
フェリシモ	4,000	1,016.00	4,064,000	
トリドールホールディングス	17,200	2,419.00	41,606,800	
TOKYO BASE	1,800	2,938.00	5,288,400	
サツドラホールディングス	1,800	2,205.00	3,969,000	
ダイユー・リックホールディングス	4,500	733.00	3,298,500	
バロックジャパンリミテッド	8,200	1,240.00	10,168,000	貸付有価証券 3,800株
クスリのアオキホールディングス	11,100	4,965.00	55,111,500	貸付有価証券 5,200株
メディカルシステムネットワーク	15,800	540.00	8,532,000	貸付有価証券 7,300株
総合メディカル	6,700	4,190.00	28,073,000	貸付有価証券 1,500株
はるやまホールディングス	6,500	976.00	6,344,000	貸付有価証券 1,200株
ノジマ	16,300	1,418.00	23,113,400	貸付有価証券 800株
カッパ・クリエイト	19,500	1,235.00	24,082,500	貸付有価証券 9,300株(1,800株)
ライトオン	10,400	962.00	10,004,800	貸付有価証券 4,900株
ジーンズメイト	4,400	265.00	1,166,000	貸付有価証券

				500株
良品計画	18,500	24,390.00	451,215,000	貸付有価証券 8,600株
三城ホールディングス	17,200	468.00	8,049,600	貸付有価証券 100株(100株)
アドヴァン	14,200	1,204.00	17,096,800	
アルビス	3,600	3,445.00	12,402,000	貸付有価証券 1,600株
コナカ	17,800	610.00	10,858,000	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,513.00	2,572,100	貸付有価証券 700株(100株)
G-7ホールディングス	4,100	2,516.00	10,315,600	
イオン北海道	14,000	606.00	8,484,000	貸付有価証券 600株
コジマ	20,500	300.00	6,150,000	貸付有価証券 900株
ヒマラヤ	4,300	823.00	3,538,900	貸付有価証券 300株
コーナン商事	19,800	2,105.00	41,679,000	貸付有価証券 9,200株
エコス	5,400	1,175.00	6,345,000	貸付有価証券 200株(100株)
ワタミ	16,500	1,247.00	20,575,500	貸付有価証券 7,700株(5,400株)
マルシェ	3,100	813.00	2,520,300	貸付有価証券 1,400株(100株)
ドンキホーテホールディングス	90,400	3,860.00	348,944,000	貸付有価証券 1,100株
西松屋チェーン	24,500	1,255.00	30,747,500	
ゼンショーホールディングス	72,300	1,865.00	134,839,500	貸付有価証券 33,900株(700株)
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,676.00	14,748,800	貸付有価証券 4,100株(1,900株)
ハークスレイ	3,400	1,101.00	3,743,400	
サイゼリヤ	23,000	2,798.00	64,354,000	貸付有価証券 100株
V Tホールディングス	47,200	578.00	27,281,600	貸付有価証券 3,300株
魚力	4,300	1,295.00	5,568,500	
ポブラ	3,500	530.00	1,855,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)

フジ・コーポレーション	2,100	2,305.00	4,840,500	貸付有価証券 900株
ユナイテッドアローズ	18,600	3,370.00	62,682,000	貸付有価証券 8,700株
ハイデイ日高	15,200	2,407.00	36,586,400	
京都きもの友禅	8,900	955.00	8,499,500	貸付有価証券 3,300株
コロワイド	46,300	1,866.00	86,395,800	貸付有価証券 21,700株
ピーシーデポコーポレーション	18,500	532.00	9,842,000	貸付有価証券 8,800株
壱番屋	9,800	3,680.00	36,064,000	
トップカルチャー	5,000	490.00	2,450,000	貸付有価証券 2,300株(2,100株)
P L A N T	3,200	1,177.00	3,766,400	貸付有価証券 800株
スギホールディングス	30,600	5,110.00	156,366,000	貸付有価証券 14,200株
ヴィア・ホールディングス	10,600	1,111.00	11,776,600	貸付有価証券 4,900株
スクロール	21,100	346.00	7,300,600	貸付有価証券 2,100株
ヨンドシーホールディングス	10,600	2,477.00	26,256,200	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ユニー・ファミリーマートホールディングス	61,300	6,640.00	407,032,000	貸付有価証券 14,000株(1,000株)
木曽路	17,100	2,445.00	41,809,500	貸付有価証券 3,500株
サトレストランシステムズ	16,400	843.00	13,825,200	貸付有価証券 7,700株
千趣会	25,300	802.00	20,290,600	貸付有価証券 200株(200株)
タカキュー	10,800	195.00	2,106,000	
ケーヨー	23,500	569.00	13,371,500	貸付有価証券 11,000株(100株)
上新電機	33,000	1,136.00	37,488,000	
日本瓦斯	25,600	3,245.00	83,072,000	
ベスト電器	45,000	152.00	6,840,000	貸付有価証券 17,400株(14,100株)
ロイヤルホールディングス	23,000	2,249.00	51,727,000	貸付有価証券 1,000株

東天紅	11,000	167.00	1,837,000	
いなげや	15,500	1,551.00	24,040,500	貸付有価証券 7,100株（2,400株）
島忠	36,100	2,711.00	97,867,100	貸付有価証券 1,400株
チヨダ	16,500	2,611.00	43,081,500	
ライフコーポレーション	10,600	3,255.00	34,503,000	
リンガーハット	15,700	2,283.00	35,843,100	
さが美	13,000	128.00	1,664,000	貸付有価証券 5,000株
MrMax	17,400	402.00	6,994,800	
テナライド	12,800	386.00	4,940,800	貸付有価証券 6,100株
AOKIホールディングス	27,900	1,289.00	35,963,100	
オークワ	20,000	1,131.00	22,620,000	
コメリ	21,500	2,753.00	59,189,500	貸付有価証券 5,000株（100株）
青山商事	29,200	3,820.00	111,544,000	
しまむら	16,200	14,710.00	238,302,000	
はせがわ	7,400	445.00	3,293,000	貸付有価証券 1,500株（1,000株）
高島屋	234,000	974.00	227,916,000	貸付有価証券 81,000株（4,000株）
松屋	30,400	1,054.00	32,041,600	貸付有価証券 11,400株（300株）
エイチ・ツー・オー リテイリング	71,500	1,790.00	127,985,000	貸付有価証券 5,700株
近鉄百貨店	53,000	341.00	18,073,000	貸付有価証券 22,000株
丸栄	29,000	84.00	2,436,000	貸付有価証券 7,000株
パルコ	13,400	1,191.00	15,959,400	貸付有価証券 1,200株（500株）
丸井グループ	147,000	1,513.00	222,411,000	
アクシアル リテイリング	10,800	4,240.00	45,792,000	
井筒屋	7,600	407.00	3,093,200	
イオン	574,800	1,625.00	934,050,000	貸付有価証券 193,100株（94,800 株）

イズミ	27,700	4,995.00	138,361,500	
東武ストア	1,700	3,035.00	5,159,500	
平和堂	28,300	2,702.00	76,466,600	
フジ	15,500	2,433.00	37,711,500	
ヤオコー	15,800	4,230.00	66,834,000	貸付有価証券 7,000株
ゼビオホールディングス	19,000	1,726.00	32,794,000	
ケーズホールディングス	64,400	2,042.00	131,504,800	貸付有価証券 30,200株(30,200株)
Olympicグループ	8,200	601.00	4,928,200	
日産東京販売ホールディングス	20,500	407.00	8,343,500	
アインホールディングス	18,200	7,510.00	136,682,000	貸付有価証券 7,300株(200株)
元気寿司	3,500	2,208.00	7,728,000	貸付有価証券 1,600株
ヤマダ電機	467,200	555.00	259,296,000	貸付有価証券 217,100株(204,200株)
アークランドサカモト	23,600	1,338.00	31,576,800	
ニトリホールディングス	60,400	14,070.00	849,828,000	
グルメ杵屋	10,000	1,063.00	10,630,000	貸付有価証券 4,000株
愛眼	10,200	199.00	2,029,800	貸付有価証券 4,700株(3,500株)
ケーユーホールディングス	7,300	911.00	6,650,300	貸付有価証券 100株
吉野家ホールディングス	48,700	1,619.00	78,845,300	貸付有価証券 20,300株
松屋フーズ	6,700	4,150.00	27,805,000	貸付有価証券 3,100株(200株)
サガミチェーン	17,500	1,359.00	23,782,500	貸付有価証券 8,200株
関西スーパーマーケット	11,400	1,545.00	17,613,000	貸付有価証券 5,400株(5,200株)
王将フードサービス	10,200	4,115.00	41,973,000	貸付有価証券 500株
プレナス	15,600	2,466.00	38,469,600	貸付有価証券 7,200株
ミニストップ	10,300	2,093.00	21,557,900	
アークス	26,100	2,663.00	69,504,300	

パローホールディングス	30,100	2,627.00	79,072,700	
藤久	1,100	1,742.00	1,916,200	
ベルク	6,200	4,330.00	26,846,000	貸付有価証券 200株
大庄	7,500	1,562.00	11,715,000	貸付有価証券 1,000株
ファーストリテイリング	23,300	34,920.00	813,636,000	貸付有価証券 8,300株（500株）
サンドラッグ	53,100	3,735.00	198,328,500	
サックスパーホールディングス	13,100	1,265.00	16,571,500	貸付有価証券 2,100株
ヤマザワ	2,900	1,811.00	5,251,900	
やまや	2,900	1,669.00	4,840,100	
ベルーナ	34,800	833.00	28,988,400	
島根銀行	2,900	1,392.00	4,036,800	
じもとホールディングス	100,200	189.00	18,937,800	
めぶきフィナンシャルグループ	673,600	445.00	299,752,000	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	20,200	3,335.00	67,367,000	
九州フィナンシャルグループ	229,100	681.00	156,017,100	
ゆうちょ銀行	395,500	1,381.00	546,185,500	
富山第一銀行	35,500	530.00	18,815,000	貸付有価証券 16,400株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	914,600	515.40	471,384,840	
西日本フィナンシャルホールディングス	94,700	1,113.00	105,401,100	
新生銀行	1,330,000	205.00	272,650,000	貸付有価証券 411,000株
あおぞら銀行	884,000	410.00	362,440,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,586,100	699.70	7,407,094,170	
りそなホールディングス	1,634,300	597.90	977,147,970	
三井住友トラスト・ホールディングス	291,600	3,860.00	1,125,576,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,118,600	4,045.00	4,524,737,000	
第四銀行	171,000	441.00	75,411,000	貸付有価証券 4,000株

北越銀行	15,100	2,872.00	43,367,200	貸付有価証券 700株
千葉銀行	539,000	715.00	385,385,000	
群馬銀行	310,400	581.00	180,342,400	
武蔵野銀行	22,300	3,300.00	73,590,000	
千葉興業銀行	38,300	615.00	23,554,500	
筑波銀行	58,100	312.00	18,127,200	
七十七銀行	219,000	482.00	105,558,000	
青森銀行	108,000	382.00	41,256,000	
秋田銀行	89,000	347.00	30,883,000	
山形銀行	78,000	485.00	37,830,000	貸付有価証券 36,000株(8,000株)
岩手銀行	9,100	4,715.00	42,906,500	貸付有価証券 1,000株(100株)
東邦銀行	125,000	419.00	52,375,000	貸付有価証券 2,000株
東北銀行	71,000	154.00	10,934,000	
みちのく銀行	84,000	187.00	15,708,000	貸付有価証券 39,000株(18,000株)
ふくおかフィナンシャル グループ	567,000	482.00	273,294,000	貸付有価証券 13,000株
静岡銀行	380,000	906.00	344,280,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
十六銀行	188,000	359.00	67,492,000	
スルガ銀行	142,800	2,344.00	334,723,200	貸付有価証券 21,500株
八十二銀行	269,600	629.00	169,578,400	
山梨中央銀行	86,000	498.00	42,828,000	
大垣共立銀行	216,000	331.00	71,496,000	
福井銀行	119,000	264.00	31,416,000	貸付有価証券 11,000株
北國銀行	148,000	423.00	62,604,000	貸付有価証券 3,000株
清水銀行	4,700	3,390.00	15,933,000	
富山銀行	2,700	4,120.00	11,124,000	
滋賀銀行	131,000	571.00	74,801,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
南都銀行	13,500	4,075.00	55,012,500	
百五銀行	126,000	444.00	55,944,000	

京都銀行	250,000	811.00	202,750,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
紀陽銀行	52,500	1,706.00	89,565,000	
三重銀行	6,200	2,350.00	14,570,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	92,900	1,747.00	162,296,300	
広島銀行	412,000	473.00	194,876,000	貸付有価証券 4,000株
山陰合同銀行	84,000	892.00	74,928,000	貸付有価証券 400株
中国銀行	99,000	1,620.00	160,380,000	貸付有価証券 1,200株
鳥取銀行	4,400	1,750.00	7,700,000	
伊予銀行	149,400	749.00	111,900,600	貸付有価証券 22,900株
百十四銀行	153,000	376.00	57,528,000	
四国銀行	107,000	291.00	31,137,000	貸付有価証券 17,000株
阿波銀行	119,000	706.00	84,014,000	貸付有価証券 6,000株
大分銀行	80,000	435.00	34,800,000	貸付有価証券 38,000株
宮崎銀行	93,000	343.00	31,899,000	
佐賀銀行	85,000	305.00	25,925,000	
十八銀行	86,000	359.00	30,874,000	
沖縄銀行	13,600	4,260.00	57,936,000	
琉球銀行	28,800	1,601.00	46,108,800	
セブン銀行	523,700	364.00	190,626,800	貸付有価証券 65,500株(11,400株)
みずほフィナンシャルグ グループ	18,967,100	204.00	3,869,288,400	
高知銀行	51,000	131.00	6,681,000	
山口フィナンシャルグ グループ	131,000	1,207.00	158,117,000	貸付有価証券 40,000株(24,000株)
長野銀行	4,600	2,010.00	9,246,000	貸付有価証券 2,100株(300株)
名古屋銀行	11,300	4,010.00	45,313,000	貸付有価証券 5,400株(1,000株)
北洋銀行	228,000	422.00	96,216,000	貸付有価証券 8,000株
愛知銀行	4,700	6,190.00	29,093,000	

第三銀行	7,900	1,661.00	13,121,900	
中京銀行	5,700	2,350.00	13,395,000	貸付有価証券 200株
大光銀行	48,000	221.00	10,608,000	
愛媛銀行	16,900	1,361.00	23,000,900	貸付有価証券 7,800株(5,600株)
トマト銀行	5,400	1,575.00	8,505,000	
みなと銀行	12,600	2,069.00	26,069,400	
京葉銀行	114,000	481.00	54,834,000	
関西アーバン銀行	19,500	1,415.00	27,592,500	
栃木銀行	77,100	513.00	39,552,300	
北日本銀行	4,300	3,215.00	13,824,500	
東和銀行	261,000	118.00	30,798,000	
福島銀行	152,000	94.00	14,288,000	貸付有価証券 44,000株
大東銀行	73,000	169.00	12,337,000	貸付有価証券 18,000株(11,000株)
トモニホールディングス	115,100	590.00	67,909,000	貸付有価証券 9,700株
フィデアホールディングス	135,500	207.00	28,048,500	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
池田泉州ホールディングス	148,200	460.00	68,172,000	貸付有価証券 1,500株
F P G	49,800	987.00	49,152,600	貸付有価証券 11,900株
S B Iホールディングス	157,900	1,552.00	245,060,800	貸付有価証券 20,500株(20,500株)
日本アジア投資	13,400	436.00	5,842,400	貸付有価証券 6,200株(300株)
ジャフコ	23,300	3,740.00	87,142,000	
大和証券グループ本社	1,307,000	677.90	886,015,300	貸付有価証券 174,000株
野村ホールディングス	2,856,000	691.90	1,976,066,400	
岡三証券グループ	119,000	679.00	80,801,000	
丸三証券	44,400	918.00	40,759,200	貸付有価証券 20,800株
東洋証券	50,000	257.00	12,850,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	160,300	579.00	92,813,700	貸付有価証券 30,900株
光世証券	33,000	181.00	5,973,000	貸付有価証券

				4,000株
水戸証券	43,200	299.00	12,916,800	貸付有価証券 3,100株
いちよし証券	31,200	839.00	26,176,800	
松井証券	79,800	871.00	69,505,800	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
だいこう証券ビジネス	6,800	620.00	4,216,000	
マネックスグループ	149,800	267.00	39,996,600	貸付有価証券 60,200株(17,400株)
カブドットコム証券	104,200	362.00	37,720,400	
極東証券	18,700	1,600.00	29,920,000	
岩井コスモホールディングス	13,200	1,089.00	14,374,800	貸付有価証券 400株
藍澤証券	26,100	652.00	17,017,200	
マネーパートナーズグループ	17,800	464.00	8,259,200	貸付有価証券 8,200株
小林洋行	4,000	285.00	1,140,000	貸付有価証券 1,800株(1,500株)
かんぼ生命保険	52,700	2,551.00	134,437,700	貸付有価証券 5,900株
SOMPOホールディングス	292,100	4,079.00	1,191,475,900	
アニコムホールディングス	9,500	2,350.00	22,325,000	貸付有価証券 2,300株
MS&ADインシュアランスグループホール	417,500	3,540.00	1,477,950,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	133,800	1,789.00	239,368,200	
第一生命ホールディングス	842,400	1,996.50	1,681,851,600	
東京海上ホールディングス	566,000	4,696.00	2,657,936,000	
T&Dホールディングス	509,200	1,616.00	822,867,200	
アドバンスクリエイト	3,300	1,911.00	6,306,300	貸付有価証券 1,100株
全国保証	39,300	3,790.00	148,947,000	貸付有価証券 18,400株
クレディセゾン	106,000	1,986.00	210,516,000	
アクリーティブ	11,500	375.00	4,312,500	貸付有価証券 4,100株
芙蓉総合リース	16,000	4,990.00	79,840,000	貸付有価証券

				1,600株
興銀リース	26,200	2,376.00	62,251,200	貸付有価証券 5,700株(300株)
東京センチュリー	28,100	3,790.00	106,499,000	
日本証券金融	61,500	592.00	36,408,000	貸付有価証券 6,700株
アイフル	234,300	327.00	76,616,100	貸付有価証券 111,000株(3,200株)
ポケットカード	10,500	608.00	6,384,000	貸付有価証券 900株
リコーリース	11,000	3,570.00	39,270,000	貸付有価証券 5,200株(900株)
イオンフィナンシャル サービス	89,200	2,097.00	187,052,400	
アコム	280,600	445.00	124,867,000	貸付有価証券 114,400株(1,700株)
ジャックス	77,000	484.00	37,268,000	
オリエントコーポレー ション	302,000	201.00	60,702,000	貸付有価証券 60,400株
日立キャピタル	32,900	2,692.00	88,566,800	貸付有価証券 100株
アプラスフィナンシャル	67,000	107.00	7,169,000	貸付有価証券 31,300株
オリックス	989,300	1,647.50	1,629,871,750	
三菱UFJリース	354,300	555.00	196,636,500	
日本取引所グループ	434,400	1,585.00	688,524,000	
イー・ギャランティ	4,100	2,448.00	10,036,800	貸付有価証券 1,900株(500株)
アサックス	2,400	1,590.00	3,816,000	
NECキャピタルソ リューション	5,700	1,709.00	9,741,300	貸付有価証券 700株
いちご	132,800	326.00	43,292,800	貸付有価証券 62,400株(15,000株)
日本駐車場開発	168,400	148.00	24,923,200	貸付有価証券 20,000株
ヒューリック	291,400	1,047.00	305,095,800	貸付有価証券 14,200株
三栄建築設計	5,600	1,525.00	8,540,000	
野村不動産ホールディン グス	92,700	1,774.00	164,449,800	
三重交通グループホール	24,800	375.00	9,300,000	貸付有価証券

ディングス				11,600株
サムティ	11,200	1,108.00	12,409,600	貸付有価証券 5,400株(3,000株)
ディア・ライフ	9,500	391.00	3,714,500	貸付有価証券 400株(100株)
エー・ディー・ワークス	128,000	39.00	4,992,000	貸付有価証券 10,700株
日本商業開発	7,900	1,820.00	14,378,000	貸付有価証券 3,600株
プレサンスコーポレーション	21,700	1,340.00	29,078,000	貸付有価証券 3,200株
ユニゾホールディングス	11,500	2,747.00	31,590,500	貸付有価証券 5,400株
THEグローバル社	4,900	533.00	2,611,700	
日本管理センター	10,000	1,361.00	13,610,000	貸付有価証券 4,700株
サンセイランディック	2,900	777.00	2,253,300	貸付有価証券 100株
エストラスト	2,400	651.00	1,562,400	貸付有価証券 100株
フージャースホールディングス	18,000	638.00	11,484,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
オープンハウス	20,200	2,664.00	53,812,800	
東急不動産ホールディングス	338,000	604.00	204,152,000	
飯田グループホールディングス	116,500	1,708.00	198,982,000	
ムゲンエステート	4,800	844.00	4,051,200	
ファーストブラザーズ	1,400	1,756.00	2,458,400	
ハウズドゥ	1,700	1,758.00	2,988,600	貸付有価証券 700株(700株)
シーアールイー	2,000	1,541.00	3,082,000	
ケイアイスター不動産	2,800	1,565.00	4,382,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
パーク24	70,900	2,914.00	206,602,600	貸付有価証券 20,800株(6,800株)
パラカ	4,000	2,238.00	8,952,000	
三井不動産	741,000	2,374.00	1,759,134,000	
三菱地所	1,039,000	2,030.00	2,109,170,000	貸付有価証券 30,000株
平和不動産	26,400	1,574.00	41,553,600	貸付有価証券

				1,800株
東京建物	162,100	1,468.00	237,962,800	
ダイビル	35,900	978.00	35,110,200	
京阪神ビルディング	23,100	613.00	14,160,300	
住友不動産	335,000	2,886.00	966,810,000	
大京	260,000	221.00	57,460,000	
テーオーシー	54,100	917.00	49,609,700	貸付有価証券 11,700株
東京楽天地	23,000	539.00	12,397,000	
レオパレス21	176,300	575.00	101,372,500	
スターツコーポレーション	14,200	2,324.00	33,000,800	
フジ住宅	17,800	728.00	12,958,400	
空港施設	16,900	563.00	9,514,700	
明和地所	7,700	708.00	5,451,600	
住友不動産販売	12,600	3,585.00	45,171,000	
ゴールドクレスト	12,600	1,999.00	25,187,400	貸付有価証券 1,000株
日本エスリード	5,400	1,514.00	8,175,600	貸付有価証券 2,500株
日神不動産	16,500	571.00	9,421,500	
日本エスコン	18,600	407.00	7,570,200	貸付有価証券 8,800株(4,700株)
タカラレーベン	60,900	496.00	30,206,400	貸付有価証券 27,000株(5,200株)
サンヨーハウジング名古屋	7,200	958.00	6,897,600	
イオンモール	90,000	1,752.00	157,680,000	貸付有価証券 41,800株
ファースト住建	5,200	1,526.00	7,935,200	
トーセイ	19,100	732.00	13,981,200	貸付有価証券 4,400株
穴吹興産	1,500	2,765.00	4,147,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	86,800	966.00	83,848,800	
サンフロンティア不動産	15,000	970.00	14,550,000	貸付有価証券 500株(100株)
エフ・ジェー・ネクスト	12,200	965.00	11,773,000	貸付有価証券 5,700株
インテリックス	3,200	822.00	2,630,400	貸付有価証券

				1,400株
ランドビジネス	8,200	284.00	2,328,800	
グランディハウス	12,200	411.00	5,014,200	
日本空港ビルデング	44,600	3,865.00	172,379,000	貸付有価証券 20,900株
日本工営	9,900	2,919.00	28,898,100	
ネクスト	36,500	755.00	27,557,500	貸付有価証券 17,500株
ジェイエシーリクルー トメント	9,100	1,816.00	16,525,600	貸付有価証券 3,200株(100株)
日本M&Aセンター	42,700	3,620.00	154,574,000	貸付有価証券 100株(100株)
中広	1,400	697.00	975,800	
タケエイ	12,900	1,048.00	13,519,200	貸付有価証券 5,000株
トラスト・テック	6,000	1,948.00	11,688,000	
コシダカホールディング ス	5,100	2,365.00	12,061,500	
パソナグループ	11,000	800.00	8,800,000	貸付有価証券 4,800株(3,800株)
CDS	3,300	1,056.00	3,484,800	貸付有価証券 300株
リンクアンドモチベー ション	34,800	695.00	24,186,000	貸付有価証券 16,300株
GCA	13,100	946.00	12,392,600	貸付有価証券 3,900株(1,300株)
エス・エム・エス	21,000	2,823.00	59,283,000	貸付有価証券 5,300株
テンプホールディングス	114,400	2,074.00	237,265,600	貸付有価証券 9,100株
リニカル	8,700	1,469.00	12,780,300	貸付有価証券 4,100株
クックパッド	33,000	940.00	31,020,000	貸付有価証券 5,400株(1,000株)
エスクリ	5,200	773.00	4,019,600	貸付有価証券 2,300株(1,400株)
アイ・ケイ・ケイ	6,600	801.00	5,286,600	貸付有価証券 100株(100株)
学情	6,200	1,270.00	7,874,000	貸付有価証券 2,500株(600株)
スタジオアリス	6,000	2,289.00	13,734,000	

シミックホールディングス	7,500	1,434.00	10,755,000	貸付有価証券 1,700株（1,600株）
N J S	3,300	1,340.00	4,422,000	
総合警備保障	53,800	4,155.00	223,539,000	
カカクコム	105,500	1,515.00	159,832,500	
セントケア・ホールディング	1,900	1,681.00	3,193,900	貸付有価証券 800株（800株）
サイネックス	1,100	1,162.00	1,278,200	貸付有価証券 500株（500株）
ルネサンス	7,500	1,790.00	13,425,000	貸付有価証券 3,500株
ディップ	19,100	2,429.00	46,393,900	貸付有価証券 8,900株
オプトホールディング	10,600	1,054.00	11,172,400	貸付有価証券 100株
新日本科学	16,500	583.00	9,619,500	貸付有価証券 6,500株
ツクイ	35,000	659.00	23,065,000	
キャリアデザインセンター	3,100	1,178.00	3,651,800	
エムスリー	128,100	2,763.00	353,940,300	貸付有価証券 13,200株
ツカダ・グローバルホールディング	10,800	603.00	6,512,400	貸付有価証券 2,700株
アウトソーシング	9,000	4,420.00	39,780,000	貸付有価証券 4,000株（3,800株）
ウェルネット	11,100	1,356.00	15,051,600	貸付有価証券 4,300株
ワールドホールディングス	3,300	2,330.00	7,689,000	貸付有価証券 1,500株
ディー・エヌ・エー	66,300	2,259.00	149,771,700	貸付有価証券 700株
博報堂D Yホールディングス	204,900	1,320.00	270,468,000	
ぐるなび	21,400	2,330.00	49,862,000	
エスアールジータカミヤ	15,900	587.00	9,333,300	貸付有価証券 7,300株
ジャパンベストレスキューシステム	18,300	257.00	4,703,100	貸付有価証券 8,600株（4,600株）
ファンコミュニケーションズ	37,600	831.00	31,245,600	貸付有価証券 4,700株（4,700株）

ライク	2,600	2,852.00	7,415,200	貸付有価証券 1,200株
ビジネス・ブレイクスルー	4,700	419.00	1,969,300	
W D Bホールディングス	5,300	1,478.00	7,833,400	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
ティア	7,100	785.00	5,573,500	貸付有価証券 500株(500株)
C D G	1,000	1,854.00	1,854,000	
バリューコマース	13,600	433.00	5,888,800	貸付有価証券 300株(300株)
インフォーマート	62,700	636.00	39,877,200	貸付有価証券 29,700株(1,600株)
J Pホールディングス	42,500	280.00	11,900,000	貸付有価証券 19,900株(1,400株)
E P Sホールディングス	18,300	1,564.00	28,621,200	
レグス	3,300	773.00	2,550,900	
プレステージ・インターナショナル	20,900	1,003.00	20,962,700	貸付有価証券 1,900株
アミューズ	8,200	2,491.00	20,426,200	
ドリームインキュベータ	4,500	2,201.00	9,904,500	貸付有価証券 1,800株
クイック	7,600	1,180.00	8,968,000	
T A C	8,100	223.00	1,806,300	
ケネディクス	187,500	443.00	83,062,500	貸付有価証券 88,100株
電通	164,800	6,040.00	995,392,000	貸付有価証券 55,400株
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,900	970.00	6,693,000	貸付有価証券 3,100株
ぴあ	4,500	2,935.00	13,207,500	貸付有価証券 2,100株
イオンファンタジー	4,300	2,890.00	12,427,000	貸付有価証券 1,800株
シーティーエス	7,900	685.00	5,411,500	貸付有価証券 300株
ネクシィーズグループ	5,300	1,676.00	8,882,800	貸付有価証券 2,500株(2,000株)
みらかホールディングス	37,800	5,120.00	193,536,000	
アルプス技研	5,900	3,605.00	21,269,500	
ダイオーズ	2,700	1,050.00	2,835,000	

日本空調サービス	14,200	670.00	9,514,000	貸付有価証券 400株
オリエンタルランド	159,800	6,383.00	1,020,003,400	貸付有価証券 7,600株（7,600株）
ダスキン	37,900	2,428.00	92,021,200	
明光ネットワークジャパン	18,300	1,222.00	22,362,600	貸付有価証券 3,600株（3,600株）
ファルコホールディングス	6,900	1,508.00	10,405,200	貸付有価証券 2,700株
秀英予備校	2,900	480.00	1,392,000	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
田谷	2,500	660.00	1,650,000	貸付有価証券 1,100株
ラウンドワン	46,100	885.00	40,798,500	貸付有価証券 100株
リゾートトラスト	57,200	1,960.00	112,112,000	貸付有価証券 20,400株（1,300株）
ビー・エム・エル	19,300	2,451.00	47,304,300	
ワタベウェディング	2,200	598.00	1,315,600	貸付有価証券 900株
りらいあコミュニケーションズ	24,400	1,095.00	26,718,000	
リソー教育	25,200	677.00	17,060,400	貸付有価証券 600株
早稲田アカデミー	1,900	1,276.00	2,424,400	
ユー・エス・エス	179,000	1,856.00	332,224,000	
東京個別指導学院	4,800	1,588.00	7,622,400	貸付有価証券 2,200株
サイバーエージェント	77,800	3,295.00	256,351,000	貸付有価証券 31,200株（15,200株）
楽天	755,500	1,115.00	842,382,500	貸付有価証券 331,900株（62,000株）
クリーク・アンド・リバー社	5,200	985.00	5,122,000	貸付有価証券 400株
テー・オー・ダブリュー	11,800	720.00	8,496,000	貸付有価証券 3,600株
セントラルスポーツ	5,000	3,505.00	17,525,000	
フルキャストホールディングス	15,200	1,094.00	16,628,800	貸付有価証券 4,100株
リソルホールディングス	15,000	351.00	5,265,000	貸付有価証券 7,000株

テクノプロ・ホールディングス	24,100	4,295.00	103,509,500	
アトラ	1,700	683.00	1,161,100	貸付有価証券 700株
インターワークス	3,000	1,107.00	3,321,000	
Keepers 技研	1,600	2,011.00	3,217,600	
ファーストロジック	800	2,788.00	2,230,400	貸付有価証券 300株(300株)
デザインワン・ジャパン	2,000	1,617.00	3,234,000	貸付有価証券 900株(700株)
イー・ガーディアン	4,800	1,781.00	8,548,800	貸付有価証券 2,200株(1,300株)
リブセンス	9,900	524.00	5,187,600	貸付有価証券 4,400株(2,400株)
ジャパンマテリアル	10,800	1,848.00	19,958,400	貸付有価証券 5,100株
ベクトル	12,000	1,349.00	16,188,000	貸付有価証券 5,600株(3,000株)
ウチヤマホールディングス	6,700	443.00	2,968,100	貸付有価証券 700株
サクセスホールディングス	1,400	1,409.00	1,972,600	
キャリアリンク	3,300	686.00	2,263,800	貸付有価証券 1,400株
I B J	11,500	578.00	6,647,000	貸付有価証券 4,900株
アサンテ	5,400	1,626.00	8,780,400	
N・フィールド	7,000	1,391.00	9,737,000	貸付有価証券 3,300株(100株)
バリューHR	1,100	2,694.00	2,963,400	貸付有価証券 200株
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	5,480.00	10,412,000	貸付有価証券 900株
ライドオン・エクスプレス	3,700	867.00	3,207,900	貸付有価証券 1,700株(1,300株)
E R Iホールディングス	3,800	848.00	3,222,400	貸付有価証券 900株
アビスト	2,300	4,000.00	9,200,000	貸付有価証券 1,000株(700株)
ウィルグループ	5,900	945.00	5,575,500	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
エスクロー・エージェン	2,500	1,472.00	3,680,000	貸付有価証券

ト・ジャパン				1,100株(1,100株)
日本ビューホテル	3,000	1,404.00	4,212,000	貸付有価証券 900株(400株)
リクルートホールディングス	323,000	5,680.00	1,834,640,000	
エラン	2,000	1,841.00	3,682,000	
土木管理総合試験所	1,500	680.00	1,020,000	貸付有価証券 100株
日本郵政	385,800	1,397.00	538,962,600	
ベルシステム24ホールディングス	22,500	966.00	21,735,000	貸付有価証券 10,500株
一蔵	1,100	1,111.00	1,222,100	
ソラスト	6,800	1,563.00	10,628,400	貸付有価証券 1,400株
リログループ	55,500	1,846.00	102,453,000	
東祥	3,200	4,725.00	15,120,000	貸付有価証券 300株
エイチ・アイ・エス	24,100	2,600.00	62,660,000	貸付有価証券 9,000株
ラックランド	2,600	2,031.00	5,280,600	貸付有価証券 1,200株
共立メンテナンス	24,000	3,315.00	79,560,000	貸付有価証券 11,200株(9,800株)
イチネンホールディングス	15,100	1,161.00	17,531,100	貸付有価証券 500株
建設技術研究所	9,300	1,143.00	10,629,900	
スペース	8,000	1,369.00	10,952,000	
燦ホールディングス	2,900	1,624.00	4,709,600	
スバル興業	11,000	483.00	5,313,000	
東京テアトル	56,000	146.00	8,176,000	
タナベ経営	2,900	1,362.00	3,949,800	
ナガワ	2,700	3,940.00	10,638,000	
よみうりランド	29,000	430.00	12,470,000	貸付有価証券 13,000株
東京都競馬	101,000	258.00	26,058,000	
常磐興産	5,400	1,606.00	8,672,400	貸付有価証券 2,100株(100株)
カナモト	20,600	2,997.00	61,738,200	
東京ドーム	59,000	1,034.00	61,006,000	
西尾レントオール	11,900	3,130.00	37,247,000	

トランス・コスモス	17,200	2,616.00	44,995,200	
乃村工藝社	31,600	1,961.00	61,967,600	貸付有価証券 100株
藤田観光	48,000	348.00	16,704,000	貸付有価証券 21,000株
KNT-CTホールディングス	84,000	138.00	11,592,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
日本管財	12,700	1,796.00	22,809,200	
トーカイ	6,500	4,070.00	26,455,000	
白洋舎	1,400	2,856.00	3,998,400	
セコム	153,800	7,969.00	1,225,632,200	
セントラル警備保障	6,500	1,699.00	11,043,500	貸付有価証券 100株
丹青社	25,500	983.00	25,066,500	貸付有価証券 8,200株（7,900株）
メイテック	17,900	4,520.00	80,908,000	貸付有価証券 1,700株
アサツー ディ・ケイ	24,100	2,823.00	68,034,300	
応用地質	14,000	1,380.00	19,320,000	貸付有価証券 200株
船井総研ホールディングス	18,700	1,969.00	36,820,300	
進学会	6,200	584.00	3,620,800	
オオバ	11,500	516.00	5,934,000	貸付有価証券 5,300株
学究社	3,900	1,531.00	5,970,900	貸付有価証券 900株（600株）
ベネッセホールディングス	49,500	3,480.00	172,260,000	
イオンディライト	16,700	3,495.00	58,366,500	
ナック	9,000	968.00	8,712,000	貸付有価証券 3,600株
ニチイ学館	25,700	844.00	21,690,800	貸付有価証券 11,100株（9,200株）
ダイセキ	25,800	2,270.00	58,566,000	貸付有価証券 1,200株
ステップ	4,900	1,531.00	7,501,900	
小計	銘柄数：1,991 組入時価比率：97.8%		312,032,406,096 100.0%	
合計			312,032,406,096	

(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29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29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	7,239,887,008	-	7,123,875,000	116,240,914
合計	7,239,887,008	-	7,123,875,000	116,240,914

(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29年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	8,628,559,752
コール・ローン	673,934,381
株式	346,165,525,144
投資信託受益証券	23,698,454
投資証券	9,255,537,649
派生商品評価勘定	53,281,257
未収入金	38,714,685
未収配当金	667,272,812
差入委託証拠金	2,497,048,738
流動資産合計	368,003,572,872
資産合計	368,003,572,872
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,344,756

(平成29年 3月31日現在)

未払金	3,538,595,883
未払解約金	96,836,434
未払利息	1,081
その他未払費用	2,314,400
流動負債合計	3,651,092,554
負債合計	3,651,092,554
純資産の部	
元本等	
元本	157,848,148,117
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	206,504,332,201
元本等合計	364,352,480,318
純資産合計	364,352,480,318
負債純資産合計	368,003,572,872

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</p> <p>(株式、投資証券)</p> <p>受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(投資信託受益証券)</p> <p>受取配当金は、投資信託受益証券の収益分配金を、原則として収益分配金落の売買が行なわれる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>配当株式</p> <p>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</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>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> <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29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	2,3082円
(10,000口当たり純資産額)	(23,082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28年 4月 1日 至 平成29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、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成29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29年 3月31日現在

期首	平成28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	162,042,393,593円
同期中における追加設定元本額	25,464,062,503円
同期中における一部解約元本額	29,658,307,979円
期末元本額	157,848,148,117円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	56,305,333円
バランスセレクト50	177,879,911円
バランスセレクト70	173,844,266円
野村外国株式インデックスファンド	558,511,277円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,671,959,785円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	8,025,722,266円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	5,141,767,715円
野村資産設計ファンド2015	27,470,529円
野村資産設計ファンド2020	32,610,809円
野村資産設計ファンド2025	43,796,632円
野村資産設計ファンド2030	41,035,697円
野村資産設計ファンド2035	31,725,271円
野村資産設計ファンド2040	96,985,703円
野村外国株インデックス（野村投資一任口座向け）	15,855,656,967円
のむラップ・ファンド（保守型）	978,642,923円
のむラップ・ファンド（普通型）	5,241,102,762円
のむラップ・ファンド（積極型）	4,126,307,425円
野村資産設計ファンド2045	10,372,087円
野村インデックスファンド・外国株式	3,011,835,177円
マイ・ロード	1,483,419,527円
ネクストコア	136,539,032円

野村インデックスファンド・海外5資産バランス	85,321,443円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	554,662,250円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,055,615,343円
野村資産設計ファンド2050	12,348,732円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,781,629円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	741,539円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	501,273円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	415,364円
のむラップ・ファンド(やや保守型)	122,882,103円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	87,114,839円
インデックス・ブレンド(タイプ)	39,831円
インデックス・ブレンド(タイプ)	42,852円
インデックス・ブレンド(タイプ)	149,515円
インデックス・ブレンド(タイプ)	175,867円
インデックス・ブレンド(タイプ)	203,400円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	45,768,316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)	445,672,787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)	383,379,354円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	4,947,597,390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)	3,273,346,313円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,860,100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)	20,746,593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)	11,273,610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)	106,704,577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)	1,175,162,406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)	462,017,543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)	188,654,290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)	52,436,276円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	224,369,794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)	4,100,237,575円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	506,871,900円
野村MSCI-KOKUSAインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,573,089,951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)	298,530,621円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,514,456,345円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,290,001円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	13,934,551円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	13,320,585円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA(確定拠出年金向け)	57,909,675,125円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,332,662,431円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,435,884,073円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,045,603,337円
マイバランスDC30	768,749,026円
マイバランスDC50	1,426,628,611円
マイバランスDC70	1,070,344,629円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA	14,348,735,324円
野村DC運用戦略ファンド	229,748,994円

野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	1,938,035円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	63,510,527円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,660,830円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	2,799,223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29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	38,300	59.31	2,271,573.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	4,300	114.07	490,501.00	
		HALLIBURTON CO	84,600	49.02	4,147,092.00	
		HELMERICH & PAYNE	10,600	66.53	705,218.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,500	40.07	1,462,555.00	
		SCHLUMBERGER LTD	135,700	77.84	10,562,888.00	
		TECHNIPFMC PLC	43,300	32.18	1,393,394.00	
		WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	85,000	6.60	561,000.00	
		ANADARKO PETE	53,600	62.17	3,332,312.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	14,700	22.90	336,630.00	
		APACHE CORPORATION	36,600	52.09	1,906,494.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	45,700	23.24	1,062,068.00	
		CHENIERE ENERGY INC	19,500	46.03	897,585.00	
		CHEVRON CORP	183,900	107.78	19,820,742.00	
		CIMAREX ENERGY CO	9,000	121.08	1,089,720.00	
		CONCHO RESOURCES INC	14,200	127.72	1,813,624.00	
		CONOCOPHILLIPS	121,100	50.00	6,055,000.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	9,400	44.62	419,428.00	
		DEVON ENERGY CORP	45,800	41.45	1,898,410.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	8,500	102.67	872,695.00	
ENBRIDGE INC	66,616	41.29	2,750,574.64			
EOG RESOURCES INC	56,300	97.17	5,470,671.00			
EQT CORP	16,500	60.68	1,001,220.00			

EXXON MOBIL CORP	403,700	83.70	33,789,690.00
HESS CORP	27,400	48.98	1,342,052.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	28.10	466,460.00
KINDER MORGAN INC	185,800	21.43	3,981,694.00
MARATHON OIL CORP	81,200	15.85	1,287,020.00
MARATHON PETROLEUM CORP	51,000	50.14	2,557,140.00
MURPHY OIL CORP	16,700	28.28	472,276.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	18,800	36.71	690,148.00
NOBLE ENERGY INC	40,700	34.31	1,396,417.00
OCCIDENTAL PETE CORP	74,700	64.27	4,800,969.00
ONEOK INC	19,800	54.92	1,087,416.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	21,700	31.90	692,230.00
PHILLIPS 66	45,000	78.59	3,536,550.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,650	182.48	3,038,292.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	14,000	31.13	435,820.00
RANGE RESOURCES CORP	19,000	28.61	543,590.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	46,800	8.09	378,612.00
TARGA RESOURCES CORP	17,800	59.06	1,051,268.00
TESORO CORP	11,300	80.64	911,232.00
VALERO ENERGY CORP	44,000	66.23	2,914,120.00
WILLIAMS COS	78,500	29.06	2,281,210.00
AIR PRODUCTS	19,900	135.60	2,698,440.00
ALBEMARLE CORP	11,100	105.14	1,167,054.00
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,800	124.01	719,258.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	21,200	32.12	680,944.00
CELANESE CORP-SERIES A	13,500	89.89	1,213,515.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,900	29.67	679,443.00
DOW CHEM CO	109,500	64.18	7,027,710.00
DU PONT E I DE NEMOURS	84,900	81.64	6,931,236.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	14,100	81.08	1,143,228.00
ECOLAB INC	25,700	125.34	3,221,238.00
FMC CORP	13,200	61.50	811,800.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	7,600	132.37	1,006,012.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	33,700	91.27	3,075,799.00
MONSANTO CO	42,800	113.35	4,851,380.00

MOSAIC CO/THE	31,200	29.35	915,720.00
PPG INDUSTRIES	25,700	105.23	2,704,411.00
PRAXAIR INC	28,000	118.60	3,320,800.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,540	310.21	2,338,983.40
VALSPAR CORP	7,300	110.90	809,570.00
WR GRACE & CO	6,700	68.60	459,620.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,910	211.56	1,250,319.60
VULCAN MATERIALS CO	12,800	117.69	1,506,432.00
AVERY DENNISON CORP	8,700	80.48	700,176.00
BALL CORP	15,800	73.62	1,163,196.00
CROWN HOLDINGS INC	13,100	52.52	688,012.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	37,600	51.14	1,922,864.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	8,800	91.11	801,768.00
SEALED AIR CORP	19,200	43.30	831,360.00
WESTROCK CO	24,300	52.56	1,277,208.00
FREEMONT-MCMORAN INC	124,100	13.31	1,651,771.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	51,000	32.93	1,679,430.00
NUCOR CORP	30,600	60.10	1,839,060.00
ARCONIC INC	43,666	26.56	1,159,768.96
B/E AEROSPACE INC	10,100	64.49	651,349.00
BOEING CO	57,180	177.98	10,176,896.40
GENERAL DYNAMICS	25,310	188.78	4,778,021.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,600	202.39	930,994.00
L3 TECHNOLOGIES INC	7,270	166.66	1,211,618.20
LOCKHEED MARTIN	25,740	270.54	6,963,699.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,210	239.06	3,875,162.60
RAYTHEON COMPANY	28,700	153.16	4,395,692.00
ROCKWELL COLLINS INC	12,800	98.39	1,259,392.00
TEXTRON INC	26,400	47.32	1,249,248.00
TRANSDIGM GROUP INC	5,230	220.03	1,150,756.90
UNITED TECHNOLOGIES	76,300	112.45	8,579,935.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	15,300	60.97	932,841.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	91,700	42.14	3,864,238.00
MASCO CORP	32,900	33.82	1,112,678.00

SMITH (A.O.) CORP	14,400	51.14	736,416.00	
FLUOR CORP	13,900	52.70	732,530.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,300	55.33	680,559.00	
ACUITY BRANDS INC	4,380	206.56	904,732.80	
AMETEK INC	21,900	54.12	1,185,228.00	
EATON CORP PLC	43,400	74.20	3,220,280.00	
EMERSON ELEC	63,000	59.61	3,755,430.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,400	155.38	1,926,712.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16,900	44.06	744,614.00	
3M CORP	58,640	191.28	11,216,659.20	
GENERAL ELEC CO	861,400	29.87	25,730,018.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	70,600	125.41	8,853,946.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	24,100	64.40	1,552,040.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	22,000	42.47	934,340.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,960	208.93	2,080,942.80	
AGCO CORP	6,300	60.36	380,268.00	
CATERPILLAR INC DEL	57,200	93.22	5,332,184.00	
CUMMINS INC	15,600	151.96	2,370,576.00	
DEERE & COMPANY	25,800	109.17	2,816,586.00	
DOVER CORP	15,300	80.07	1,225,071.00	
FLOWSERVE CORP	12,200	48.00	585,600.00	
FORTIVE CORP	29,500	59.62	1,758,790.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	30,500	132.61	4,044,605.00	
INGERSOLL-RAND PLC	25,100	80.90	2,030,590.00	
MIDDLEBY CORP	5,700	136.45	777,765.00	
PACCAR	34,100	67.64	2,306,524.00	
PARKER HANNIFIN CORP	12,700	160.05	2,032,635.00	
PENTAIR PLC	16,700	62.89	1,050,263.00	
SNAP-ON INC	5,450	168.31	917,289.50	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,400	132.64	1,910,016.00	
WABCO HOLDINGS INC	5,200	117.45	610,740.00	
WABTEC CORP	9,000	77.26	695,340.00	
XYLEM INC	17,000	49.90	848,300.00	
AERCAP HOLDINGS NV	15,000	45.91	688,650.00	
FASTENAL CO	27,600	51.32	1,416,432.00	

GRAINGER(W.W.) INC	5,540	233.86	1,295,584.40
UNITED RENTALS INC	7,900	124.17	980,943.00
CINTAS CORP	7,800	126.98	990,444.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	22,900	62.82	1,438,578.00
STERICYCLE INC	7,900	81.36	642,744.00
WASTE CONNECTIONS INC	16,500	87.86	1,449,690.00
WASTE MANAGEMENT INC	43,300	72.93	3,157,869.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,600	77.65	1,056,040.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	17,700	56.62	1,002,174.00
FEDEX CORPORATION	24,690	194.17	4,794,057.30
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	67,300	106.66	7,178,218.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,500	42.54	531,750.00
DELTA AIR LINES INC	17,700	46.27	818,979.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	53.83	823,599.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,600	70.78	537,928.00
AMERCO	680	380.23	258,556.40
CSX CORP	90,300	47.34	4,274,802.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,700	91.90	799,530.00
KANSAS CITY SOUTHERN	10,600	87.00	922,200.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,000	114.25	3,199,000.00
UNION PAC CORP	80,400	106.94	8,597,976.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	7,600	80.73	613,548.00
AUTOLIV INC	8,400	101.36	851,424.00
BORGWARNER INC	21,300	41.96	893,748.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	25,900	81.00	2,097,900.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	24,800	35.79	887,592.00
LEAR CORP	6,900	141.35	975,315.00
FORD MOTOR COMPANY	363,000	11.68	4,239,840.00
GENERAL MOTORS CO	134,400	35.41	4,759,104.00
HARLEY-DAVIDSON INC	16,800	61.01	1,024,968.00
TESLA INC	12,410	277.92	3,448,987.20
DR HORTON INC	33,600	33.43	1,123,248.00
GARMIN LTD	11,400	51.09	582,426.00
LEGGETT & PLATT INC	13,400	50.41	675,494.00

LENNAR CORP-A	20,100	51.30	1,031,130.00
MOHAWK INDUSTRIES	5,940	228.91	1,359,725.40
NEWELL BRANDS INC	42,200	47.36	1,998,592.00
PULTEGROUP INC	28,900	23.83	688,687.00
TOLL BROTHERS INC	14,200	36.39	516,738.00
WHIRLPOOL CORP	7,120	170.15	1,211,468.00
HASBRO INC	10,700	99.58	1,065,506.00
MATTEL INC	33,400	25.40	848,360.00
POLARIS INDUSTRIES INC	6,200	83.58	518,196.00
COACH INC	27,900	41.69	1,163,151.00
HANESBRANDS INC	37,700	20.71	780,767.00
LULULEMON ATHLETICA INC	10,600	50.76	538,056.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,100	38.13	613,893.00
NIKE INC-B	129,200	56.04	7,240,368.00
PVH CORP	8,000	103.62	828,960.00
RALPH LAUREN CORPORATION	5,800	81.90	475,020.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	18,400	20.09	369,656.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	18,700	18.37	343,519.00
V F CORP	31,900	54.13	1,726,747.00
ARAMARK	23,200	37.13	861,416.00
CARNIVAL CORP	33,200	59.29	1,968,428.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,740	443.92	1,216,340.80
DARDEN RESTAURANTS INC	11,800	82.83	977,394.00
DOMINOS PIZZA INC	4,610	184.11	848,747.10
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	18,966	58.77	1,114,631.82
LAS VEGAS SANDS CORP	42,100	57.03	2,400,963.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	32,200	94.64	3,047,408.00
MCDONALD'S CORP	81,000	129.32	10,474,920.00
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,400	18.49	340,216.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,900	27.33	1,227,117.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	16,100	51.24	824,964.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,900	99.65	1,684,085.00
STARBUCKS CORP	142,000	58.16	8,258,720.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,900	85.10	927,590.00
WYNN RESORTS LTD	7,700	114.30	880,110.00

YUM BRANDS INC	33,200	64.02	2,125,464.00
CBS CORP-CL B	37,400	69.34	2,593,316.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	21,140	328.12	6,936,456.80
COMCAST CORP-CL A	464,400	37.51	17,419,644.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	14,300	28.70	410,410.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,200	28.05	594,660.00
DISH NETWORK CORP-A	21,800	63.20	1,377,760.00
DISNEY (WALT) CO	147,300	113.18	16,671,414.00
INTERPUBRIC GROUP	39,200	24.58	963,536.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	10,100	86.64	875,064.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	59,500	35.08	2,087,260.00
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	11,286	23.40	264,092.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	35.70	856,800.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	19,300	39.06	753,858.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	9,870	39.19	386,805.30
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	37,400	13.24	495,176.00
OMNICOM GROUP	23,000	85.90	1,975,700.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,800	78.67	613,626.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	163,000	5.21	849,230.00
TEGNA INC	20,600	25.86	532,716.00
TIME WARNER INC	74,500	98.04	7,303,980.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	101,500	32.36	3,284,540.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	42,800	31.67	1,355,476.00
VIACOM INC-CLASS B	34,100	46.36	1,580,876.00
GENUINE PARTS CO	14,400	92.34	1,329,696.00
LKQ CORP	30,000	29.60	888,000.00
AMAZON.COM INC	39,320	876.34	34,457,688.80
EXPEDIA INC	11,700	129.46	1,514,682.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	42,300	19.90	841,770.00
NETFLIX INC	41,900	148.06	6,203,714.00
PRICELINE GROUP INC/THE	4,814	1,789.20	8,613,208.80
TRIPADVISOR INC	12,300	43.31	532,713.00
DOLLAR GENERAL CORP	27,100	70.86	1,920,306.00
DOLLAR TREE INC	22,700	79.44	1,803,288.00

KOHL'S CORP	17,200	40.43	695,396.00
MACYS INC	30,400	29.46	895,584.00
NORDSTROM INC	12,700	46.45	589,915.00
TARGET CORP	51,000	55.25	2,817,750.00
ADVANCE AUTO PARTS	7,110	148.67	1,057,043.70
AUTONATION INC	7,100	43.49	308,779.00
AUTOZONE	2,750	719.08	1,977,470.00
BED BATH & BEYOND	15,600	39.93	622,908.00
BEST BUY COMPANY INC	28,400	48.59	1,379,956.00
CARMAX INC	18,300	60.06	1,099,098.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,200	49.12	402,784.00
FOOT LOCKER INC	13,400	75.37	1,009,958.00
GAP INC	22,900	24.45	559,905.00
HOME DEPOT	118,700	146.95	17,442,965.00
L BRANDS, INC	24,000	47.51	1,140,240.00
LOWE'S COS INC	84,900	82.30	6,987,270.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,250	272.41	2,519,792.50
ROSS STORES INC	39,000	66.61	2,597,790.00
SIGNET JEWELERS LTD	5,400	70.67	381,618.00
STAPLES INC	62,000	8.74	541,880.00
TIFFANY & CO	11,900	95.25	1,133,475.00
TJX COS INC	62,800	79.77	5,009,556.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13,000	68.65	892,450.00
ULTA BEAUTY INC	5,680	285.51	1,621,696.80
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	42,670	167.89	7,163,866.30
CVS HEALTH CORP	104,100	78.85	8,208,285.00
KROGER CO	86,000	29.20	2,511,200.00
RITE AID CORP	99,000	4.42	437,580.00
SYSCO CORP	49,600	52.02	2,580,192.00
WAL-MART STORES INC	150,800	71.59	10,795,772.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	89,900	83.31	7,489,569.00
WHOLE FOODS MARKET INC	31,600	29.27	924,932.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	20,000	46.36	927,200.00
COCA COLA CO	399,200	42.60	17,005,920.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	17,100	162.44	2,777,724.00

DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,800	97.34	1,732,652.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	17,900	95.57	1,710,703.00
MONSTER BEVERAGE CORP	38,400	46.26	1,776,384.00
PEPSICO INC	139,700	112.18	15,671,546.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	54,900	46.11	2,531,439.00
BUNGE LIMITED	13,800	79.58	1,098,204.00
CAMPBELL SOUP CO	19,100	57.11	1,090,801.00
CONAGRA BRANDS INC	40,000	40.28	1,611,200.00
GENERAL MILLS	58,000	59.07	3,426,060.00
HERSHEY CO/THE	13,700	108.90	1,491,930.00
HORMEL FOODS CORP	27,300	34.21	933,933.00
INGREDION INC	6,800	120.43	818,924.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	11,300	131.26	1,483,238.00
KELLOGG CO	25,500	72.54	1,849,770.00
KRAFT HEINZ CO/THE	59,500	91.10	5,420,450.00
MCCORMICK & CO INC.	11,300	97.53	1,102,089.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,800	89.00	1,584,200.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	150,800	43.28	6,526,624.00
TYSON FOODS INC-CL A	27,600	61.64	1,701,264.00
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	17,500	55.65	973,875.00
ALTRIA GROUP INC	190,100	72.05	13,696,705.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	151,100	113.52	17,152,872.00
REYNOLDS AMERICAN INC	83,600	62.82	5,251,752.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	25,700	50.03	1,285,771.00
CLOROX CO	12,400	135.29	1,677,596.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	82,500	73.23	6,041,475.00
KIMBERLY-CLARK CORP	35,000	132.24	4,628,400.00
PROCTER & GAMBLE CO	249,000	90.20	22,459,800.00
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,600	140.10	364,260.00
COTY INC-CL A	47,635	18.22	867,909.70
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,800	73.49	426,242.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,400	85.34	1,826,276.00
ABBOTT LABORATORIES	168,000	44.55	7,484,400.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,100	113.96	809,116.00
BARD (C R)	6,960	248.54	1,729,838.40

BAXTER INTERNATIONAL INC.	47,100	52.25	2,460,975.00
BECTON,DICKINSON	20,590	183.71	3,782,588.90
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131,400	24.45	3,212,730.00
DANAHER CORP	60,900	85.72	5,220,348.00
DENTSPLY SIRONA INC	22,000	62.65	1,378,300.00
DEXCOM INC	8,300	85.03	705,749.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	21,100	93.86	1,980,446.00
HOLOGIC INC	24,700	42.71	1,054,937.00
IDEXX LABORATORIES INC	8,600	154.52	1,328,872.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,710	766.26	2,842,824.60
MEDTRONIC PLC	135,900	80.99	11,006,541.00
RESMED INC	14,100	71.52	1,008,432.00
STRYKER CORP	33,000	131.95	4,354,350.00
TELEFLEX INC	4,330	194.58	842,531.40
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,700	198.14	931,258.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,700	91.17	793,179.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,700	121.36	2,390,792.00
AETNA INC	34,300	126.91	4,353,013.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	15,600	89.14	1,390,584.00
ANTHEM INC	25,780	167.08	4,307,322.40
CARDINAL HEALTH INC	31,000	81.67	2,531,770.00
CENTENE CORP	16,800	72.15	1,212,120.00
CIGNA CORP	25,100	147.60	3,704,760.00
DAVITA INC	15,700	68.50	1,075,450.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	11,600	61.38	712,008.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC- COMMON	60,400	66.56	4,020,224.00
HCA HOLDINGS INC	28,600	89.25	2,552,550.00
HENRY SCHEIN INC	7,610	170.83	1,300,016.30
HUMANA INC	14,630	206.87	3,026,508.10
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,800	143.98	1,411,004.00
MCKESSON CORP	21,800	149.48	3,258,664.00
MEDNAX INC	9,100	69.44	631,904.00
PATTERSON COS INC	8,700	45.27	393,849.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,300	98.37	1,308,321.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	93,800	164.99	15,476,062.00

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,600	125.66	1,080,676.00	
ABBVIE INC	158,500	65.46	10,375,410.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,600	122.08	2,636,928.00	
ALKERMES PLC	15,200	58.94	895,888.00	
AMGEN INC	72,520	164.38	11,920,837.60	
BIOGEN INC	21,260	269.06	5,720,215.60	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,800	89.12	1,497,216.00	
CELGENE CORP	75,600	124.34	9,400,104.00	
GILEAD SCIENCES INC	128,500	67.53	8,677,605.00	
INCYTE CORP	16,700	137.77	2,300,759.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,620	386.18	2,942,691.60	
SEATTLE GENETICS INC	9,700	63.06	611,682.00	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,340	136.35	591,759.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	23,800	107.29	2,553,502.00	
ALLERGAN PLC	36,590	239.80	8,774,282.00	
BRISTOL MYERS SQUIBB	163,000	55.36	9,023,680.00	
ELI LILLY & CO.	96,900	84.76	8,213,244.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,600	145.68	815,808.00	
JOHNSON & JOHNSON	264,800	124.66	33,009,968.00	
MALLINCKRODT PLC	9,700	45.39	440,283.00	
MERCK & CO INC	268,600	63.45	17,042,670.00	
MYLAN NV	43,100	39.59	1,706,329.00	
PERRIGO CO PLC	13,800	66.93	923,634.00	
PFIZER INC	591,000	34.35	20,300,850.00	
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	1,500	120.35	180,525.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	88,800	32.71	2,904,648.00	
ZOETIS INC	45,800	53.47	2,448,926.00	
BANK OF AMERICA CORP	984,100	23.87	23,490,467.00	
BB&T CORPORATION	79,500	45.23	3,595,785.00	
CIT GROUP INC	19,400	43.31	840,214.00	
CITIGROUP	277,600	60.51	16,797,576.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,400	34.88	1,757,952.00	
COMERICA INC	16,200	69.13	1,119,906.00	
FIFTH THIRD BANCORP	73,700	25.73	1,896,301.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,500	94.59	1,371,555.00	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	107,000	13.59	1,454,130.00
JPMORGAN CHASE & CO	348,400	89.03	31,018,052.00
KEYCORP	102,800	17.99	1,849,372.00
M & T BANK CORP	13,700	156.64	2,145,968.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	30,500	18.41	561,505.00
PNC FINANCIAL	47,000	121.53	5,711,910.00
REGIONS FINANCIAL CORP	121,000	14.68	1,776,280.00
SIGNATURE BANK	5,070	149.86	759,790.20
SUNTRUST BKS INC.	46,900	56.08	2,630,152.00
US BANCORP	165,800	52.12	8,641,496.00
WELLS FARGO CO	464,600	56.24	26,129,104.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	119,270	167.36	19,961,027.20
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,200	26.27	845,894.00
VOYA FINANCIAL INC	18,700	38.07	711,909.00
AFLAC INC	40,000	72.32	2,892,800.00
ALLEGHANY CORP	1,510	616.24	930,522.40
ALLSTATE CORP	36,100	81.64	2,947,204.00
AMERICAN INTL GROUP	100,300	62.57	6,275,771.00
AON PLC	25,700	118.48	3,044,936.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,100	95.29	1,153,009.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,600	56.77	942,382.00
ASSURANT INC	5,200	95.44	496,288.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,500	67.47	573,495.00
CHUBB LTD	45,400	137.05	6,222,070.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,500	72.33	1,121,115.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,010	234.89	941,908.90
FNF GROUP	24,400	39.15	955,260.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	35,900	47.81	1,716,379.00
LINCOLN NATIONAL CORP	22,300	65.43	1,459,089.00
LOEWS CORP	27,700	46.86	1,298,022.00
MARKEL CORP	1,340	969.48	1,299,103.20
MARSH & MCLENNAN COS	49,500	74.11	3,668,445.00
METLIFE INC	91,400	53.12	4,855,168.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	27,900	63.11	1,760,769.00
PROGRESSIVE CO	56,500	39.48	2,230,620.00

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	41,800	107.30	4,485,140.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,300	126.50	796,950.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,200	145.54	611,268.00
TORCHMARK CORP	11,200	77.17	864,304.00
TRAVELERS COS INC/THE	27,500	121.03	3,328,325.00
UNUM GROUP	22,500	46.82	1,053,450.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,600	131.17	1,652,742.00
WR BERKLEY CORP	9,900	70.73	700,227.00
XL GROUP LTD	26,400	40.14	1,059,696.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	16,600	60.53	1,004,798.00
ALPHABET INC-CL A	28,830	849.48	24,490,508.40
ALPHABET INC-CL C	30,240	831.50	25,144,560.00
COSTAR GROUP INC	3,210	206.73	663,603.30
EBAY INC	102,300	33.70	3,447,510.00
FACEBOOK INC-A	227,900	142.41	32,455,239.00
MERCADOLIBRE INC	3,910	212.56	831,109.60
TWITTER INC	53,900	14.92	804,188.00
VERISIGN INC	8,800	87.19	767,272.00
YAHOO! INC	88,700	46.62	4,135,194.00
ZILLOW GROUP INC - C	10,900	33.28	362,752.00
ACCENTURE PLC-CL A	60,500	120.52	7,291,460.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,900	248.88	1,219,512.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	43,600	102.17	4,454,612.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	11,400	67.90	774,060.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	58,700	59.24	3,477,388.00
COMPUTER SCIENCES CORP	13,800	71.15	981,870.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	30,300	80.05	2,425,515.00
FIRST DATA CORP- CLASS A	30,200	15.71	474,442.00
FISERV INC	20,700	115.93	2,399,751.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,850	148.10	1,310,685.00
GARTNER INC	8,100	108.75	880,875.00
GLOBAL PAYMENTS INC	14,600	80.70	1,178,220.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	88,020	173.86	15,303,157.20
MASTERCARD INC	93,900	112.67	10,579,713.00
PAYCHEX INC	31,500	59.13	1,862,595.00

PAYPAL HOLDINGS INC	106,200	43.54	4,623,948.00
SABRE CORP	20,000	21.54	430,800.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,300	53.26	868,138.00
VANTIV INC - CL A	16,100	64.24	1,034,264.00
VISA INC-CLASS A SHARES	182,000	89.01	16,199,820.00
WESTERN UNION CO	45,800	20.49	938,442.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,700	50.19	2,895,963.00
ADOBE SYSTEMS INC.	48,600	129.61	6,299,046.00
ANSYS INC	8,300	106.77	886,191.00
AUTODESK INC.	18,900	86.32	1,631,448.00
CA INC	30,900	31.78	982,002.00
CADENCE DESIGN SYS INC	26,800	31.35	840,180.00
CDK GLOBAL INC	12,800	64.80	829,440.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	12,600	103.12	1,299,312.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,900	84.11	1,253,239.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	21,701	63.99	1,388,646.99
ELECTRONIC ARTS	29,000	90.26	2,617,540.00
FORTINET INC	13,900	37.85	526,115.00
INTUIT INC	23,500	115.62	2,717,070.00
MICROSOFT CORP	718,900	65.71	47,238,919.00
MOBILEYE NV	17,000	61.07	1,038,190.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	25,000	17.26	431,500.00
ORACLE CORPORATION	300,100	44.68	13,408,468.00
RED HAT INC	17,800	85.92	1,529,376.00
SALESFORCE.COM INC	62,400	82.56	5,151,744.00
SERVICENOW INC	15,700	86.94	1,364,958.00
SPLUNK INC	12,800	62.64	801,792.00
SYMANTEC CORP	60,800	30.65	1,863,520.00
SYNOPSYS INC	14,900	72.21	1,075,929.00
VMWARE INC - CLASS A	6,200	91.42	566,804.00
WORKDAY INC-CLASS A	12,000	83.70	1,004,400.00
CISCO SYSTEMS	489,000	33.74	16,498,860.00
F5 NETWORKS INC	6,200	142.48	883,376.00
HARRIS CORP	11,900	111.79	1,330,301.00

JUNIPER NETWORKS INC	33,500	27.70	927,950.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,500	84.87	1,230,615.00
PALO ALTO NETWORKS INC	9,000	113.50	1,021,500.00
APPLE INC	518,900	143.93	74,685,277.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	163,200	23.62	3,854,784.00
HP INC	167,000	17.65	2,947,550.00
NETAPP INC	26,700	41.90	1,118,730.00
SEAGATE TECHNOLOGY	28,600	47.12	1,347,632.00
WESTERN DIGITAL CORP	27,800	83.75	2,328,250.00
XEROX CORP	84,000	7.38	619,920.00
AMPHENOL CORP-CL A	30,400	71.89	2,185,456.00
ARROW ELECTRS INC	8,900	73.88	657,532.00
AVNET	12,200	45.61	556,442.00
CDW CORPORATION	14,000	57.38	803,320.00
CORNING INC	90,700	27.56	2,499,692.00
FLEX LTD	50,500	16.79	847,895.00
FLIR SYSTEMS INC	12,700	36.58	464,566.00
TE CONNECTIVITY LTD	34,300	74.87	2,568,041.00
TRIMBLE INC	23,200	32.20	747,040.00
ADVANCED MICRO DEVICES	78,000	14.05	1,095,900.00
ANALOG DEVICES INC	35,700	82.20	2,934,540.00
APPLIED MATERIALS	105,800	38.89	4,114,562.00
BROADCOM LTD	39,250	220.04	8,636,570.00
INTEL CORP	461,700	35.75	16,505,775.00
KLA TENCOR CORP	15,000	95.64	1,434,600.00
LAM RESEARCH	16,000	128.70	2,059,200.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	41,000	15.61	640,010.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,000	44.92	1,212,840.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	20,600	73.88	1,521,928.00
MICRON TECHNOLOGY	100,900	28.97	2,923,073.00
NVIDIA CORP	52,100	109.40	5,699,740.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,000	103.75	2,905,000.00
QORVO INC	12,700	69.08	877,316.00
QUALCOMM INC	144,100	57.20	8,242,520.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,100	98.14	1,776,334.00
	97,500	81.04	7,901,400.00

TEXAS INSTRUMENTS INC			
XILINX INC	25,000	57.88	1,447,000.00
AT & T INC	598,000	41.76	24,972,480.00
CENTURYLINK INC	52,200	23.41	1,222,002.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	114,000	2.13	242,820.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	30,100	57.06	1,717,506.00
VERIZON COMMUNICATIONS	397,100	49.06	19,481,726.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,500	32.81	508,555.00
SPRINT CORP	75,000	8.52	639,000.00
T-MOBILE US INC	28,300	65.13	1,843,179.00
ALLIANT ENERGY CORP	22,900	39.57	906,153.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	48,200	67.16	3,237,112.00
DUKE ENERGY CORP	67,300	82.04	5,521,292.00
EDISON INTERNATIONAL	31,700	79.49	2,519,833.00
ENTERGY CORP	17,100	75.85	1,297,035.00
EVERSOURCE ENERGY	30,700	58.62	1,799,634.00
EXELON CORPORATION	90,500	35.70	3,230,850.00
FIRSTENERGY CORP	41,800	31.37	1,311,266.00
NEXTERA ENERGY INC	45,200	128.13	5,791,476.00
OGE ENERGY CORP	19,600	35.17	689,332.00
PG&E CORP	49,600	66.36	3,291,456.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,100	83.28	924,408.00
PPL CORPORATION	66,800	37.24	2,487,632.00
SOUTHERN CO.	94,800	49.67	4,708,716.00
WESTAR ENERGY INC	13,400	54.36	728,424.00
XCEL ENERGY INC	49,400	44.31	2,188,914.00
ATMOS ENERGY CORP	10,500	79.00	829,500.00
UGI CORP	16,300	49.56	807,828.00
AMEREN CORPORATION	22,900	54.69	1,252,401.00
CENTERPOINT ENERGY INC	38,400	27.51	1,056,384.00
CMS ENERGY CORP	27,300	44.63	1,218,399.00
CONSOLIDATED EDISON INC	29,300	77.74	2,277,782.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	61,300	77.41	4,745,233.00
DTE ENERGY COMPANY	17,000	101.27	1,721,590.00
NISOURCE INC	30,300	23.59	714,777.00

PUBLIC SVC ENTERPRISE	48,700	43.91	2,138,417.00
SCANA CORP	12,900	65.55	845,595.00
SEMPRA ENERGY	22,900	110.23	2,524,267.00
WEC ENERGY GROUP INC	30,600	60.43	1,849,158.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,800	77.00	1,293,600.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	47,100	14.24	670,704.00
ALLY FINANCIAL INC	42,100	20.51	863,471.00
AMERICAN EXPRESS CO	75,200	79.21	5,956,592.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	47,200	87.14	4,113,008.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,500	68.66	2,643,410.00
NAVIENT CORP	29,900	14.87	444,613.00
SYNCHRONY FINANCIAL	80,500	34.43	2,771,615.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,200	163.94	852,488.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,000	129.66	1,944,900.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	102,100	47.53	4,852,813.00
BLACKROCK INC	11,890	383.04	4,554,345.60
CME GROUP INC	33,200	118.85	3,945,820.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	25,600	34.88	892,928.00
EATON VANCE CORP	11,700	44.89	525,213.00
FRANKLIN RESOURCES INC	35,900	42.22	1,515,698.00
GOLDMAN SACHS GROUP	34,920	231.22	8,074,202.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	58,400	60.03	3,505,752.00
INVESCO LTD	39,600	30.72	1,216,512.00
MOODYS CORP	16,800	111.62	1,875,216.00
MORGAN STANLEY	137,200	43.43	5,958,596.00
MSCI INC	8,500	96.71	822,035.00
NASDAQ INC	11,100	69.39	770,229.00
NORTHERN TRUST CORP	20,700	87.19	1,804,833.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,100	76.09	920,689.00
S&P GLOBAL INC	25,400	129.40	3,286,760.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	116,700	41.14	4,801,038.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,700	50.28	638,556.00
STATE STREET CORP	37,200	80.04	2,977,488.00
T ROWE PRICE GROUP INC	23,900	68.21	1,630,219.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,300	38.90	984,170.00
	22,400	23.19	519,456.00

	H & R BLOCK INC				
	AES CORP	65,000	11.08	720,200.00	
	CALPINE CORP	34,700	10.83	375,801.00	
	CERNER CORP	30,100	59.17	1,781,017.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	31,200	53.32	1,663,584.00	
	ILLUMINA INC	14,200	173.16	2,458,872.00	
	METTLER-TOLEDO INTL	2,620	478.69	1,254,167.80	
	QUINTILES IMS HOLDINGS INC	14,200	79.93	1,135,006.00	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,200	153.91	5,879,362.00	
	WATERS CORP	8,000	156.28	1,250,240.00	
	DUN & BRADSTREET CORP	3,600	105.83	380,988.00	
	EQUIFAX INC	11,700	136.56	1,597,752.00	
	IHS MARKIT LTD	35,373	41.63	1,472,577.99	
	MANPOWERGROUP INC	6,200	102.96	638,352.00	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	34,200	41.08	1,404,936.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	13,300	48.62	646,646.00	
	VERISK ANALYTICS INC	15,000	80.79	1,211,850.00	
	CBRE GROUP INC	29,600	34.74	1,028,304.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,000	7.63	869,820.00	
	JONES LANG LASALLE INC	4,700	110.15	517,705.00	
	小計銘柄数：599			2,024,883,338.00	
				(227,171,661,690)	
	組入時価比率：62.3%			65.5%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	16,600	30.92	513,272.00	
	ARC RESOURCES LTD	32,900	19.06	627,074.00	
	CAMECO CORP	38,600	14.95	577,070.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	108,300	43.40	4,700,220.00	
	CENOVUS ENERGY INC	78,500	15.05	1,181,425.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	53,700	14.51	779,187.00	
	ENBRIDGE INC	91,800	55.05	5,053,590.00	
	ENCANA CORP	95,000	15.36	1,459,200.00	
	HUSKY ENERGY INC	35,745	15.10	539,749.50	
	IMPERIAL OIL	28,500	40.68	1,159,380.00	
	INTER PIPELINE LTD	36,200	28.24	1,022,288.00	
	KEYERA CORP	17,800	39.30	699,540.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,400	42.17	1,577,158.00	

PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	17,200	27.64	475,408.00	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	20,726	27.97	579,706.22	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,600	24.26	548,276.00	
SUNCOR ENERGY INC	162,800	41.19	6,705,732.00	
TOURMALINE OIL CORP	21,600	29.56	638,496.00	
TRANSCANADA CORP	84,600	61.27	5,183,442.00	
VERESEN INC	29,000	14.59	423,110.00	
VERMILION ENERGY INC	12,000	49.01	588,120.00	
AGRIUM INC	12,400	128.00	1,587,200.00	
METHANEX CORP	8,200	64.34	527,588.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	81,200	22.94	1,862,728.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,660	289.01	768,766.60	
AGNICO EAGLE MINES LTD	21,600	56.39	1,218,024.00	
BARRICK GOLD	112,000	25.12	2,813,440.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	70,800	4.64	328,512.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,000	14.23	924,950.00	
FRANCO-NEVADA CORP	16,900	86.66	1,464,554.00	
GOLDCORP INC	82,900	19.54	1,619,866.00	
KINROSS GOLD CORP	118,600	4.64	550,304.00	
SILVER WHEATON CORP	41,600	27.08	1,126,528.00	
TECK RESOURCES LTD	54,900	29.70	1,630,530.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	98,000	4.10	401,800.00	
YAMANA GOLD INC	97,000	3.71	359,870.00	
WEST FRASER TIMBER	6,800	55.99	380,732.00	
BOMBARDIER B SHEARS	189,000	2.09	395,010.00	
CAE INC	26,000	20.36	529,360.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,500	52.41	759,945.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	15,200	24.79	376,808.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	75,000	98.60	7,395,000.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,600	197.35	2,683,960.00	
LINAMAR CORP	4,800	61.16	293,568.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	37,700	58.21	2,194,517.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,800	35.74	743,392.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,300	74.60	1,588,980.00	
	40,400	27.65	1,117,060.00	

SHAW COMMUNICATIONS INC-B				
CANADIAN TIRE CORP LTD A	6,400	156.49	1,001,536.00	
DOLLARAMA INC	10,700	110.88	1,186,416.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	40,400	60.46	2,442,584.00	
EMPIRE CO LTD A	16,200	20.01	324,162.00	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	20.51	192,794.00	
LOBLAW COMPANIES	21,000	72.21	1,516,410.00	
METRO INC	23,200	41.01	951,432.00	
WESTON(GEORGE)LTD	4,800	115.88	556,224.00	
SAPUTO INC	23,900	46.13	1,102,507.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	31,300	14.75	461,675.00	
BANK OF MONTREAL	63,200	99.84	6,309,888.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	117,900	79.39	9,360,081.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	38,900	113.78	4,426,042.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	33,400	55.99	1,870,066.00	
ROYAL BANK OF CANADA	144,800	97.87	14,171,576.00	
TORONTO DOMINION BANK	181,200	66.22	11,999,064.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	36,000	12.18	438,480.00	
ONEX CORPORATION	8,000	95.62	764,960.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,190	620.02	1,357,843.80	
GREAT-WEST LIFECO INC	30,000	37.22	1,116,600.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,900	57.96	573,804.00	
INTACT FINANCIAL CORP	12,600	94.89	1,195,614.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	193,400	23.74	4,591,316.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	34,800	31.69	1,102,812.00	
POWER FINANCIAL CORP	24,300	35.40	860,220.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	59,100	48.70	2,878,170.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	21,400	64.58	1,382,012.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,910	652.02	1,245,358.20	
OPEN TEXT CORP	26,200	45.39	1,189,218.00	
BLACKBERRY LTD	50,900	9.27	471,843.00	
BCE INC	15,400	58.77	905,058.00	
TELUS CORP	19,300	43.15	832,795.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	34,700	58.82	2,041,054.00	

	EMERA INC	4,900	46.98	230,202.00	
	FORTIS INC	38,400	44.10	1,693,440.00	
	HYDRO ONE LTD	17,300	24.05	416,065.00	
	ATCO LTD CL1	6,800	52.00	353,600.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	12,400	39.14	485,336.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	85,600	48.87	4,183,272.00	
	CI FINANCIAL CORP	24,200	26.55	642,510.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	40.13	413,339.00	
	THOMSON REUTERS CORP	32,400	57.94	1,877,256.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,300	19.98	225,774.00	
	小計 銘柄数：91			162,014,845.32	
				(13,617,347,749)	
	組入時価比率：3.7%			3.9%	
ユーロ	SAIPEM SPA	589,700	0.43	254,101.73	
	TENARIS SA	46,000	16.14	742,440.00	
	ENAGAS	22,800	23.99	547,086.00	
	ENI SPA	249,000	15.32	3,814,680.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	50,000	14.15	707,500.00	
	NESTE OYJ	12,500	36.88	461,000.00	
	OMV AG	15,000	37.52	562,800.00	
	REPSOL SA	108,781	14.60	1,588,202.60	
	SNAM SPA	233,000	3.99	931,534.00	
	TOTAL SA	221,900	47.07	10,445,942.50	
	VOPAK	7,100	40.69	288,934.50	
	AIR LIQUIDE	37,600	106.80	4,015,680.00	
	AKZO NOBEL	24,800	77.33	1,917,784.00	
	ARKEMA	6,700	93.46	626,182.00	
	BASF SE	89,600	93.00	8,332,800.00	
	COVESTRO AG	8,800	72.01	633,688.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,900	30.63	517,731.50	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	45.47	291,040.00	
	K+S AG	18,800	21.28	400,064.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	18,000	63.72	1,146,960.00	
	LANXESS	8,900	63.72	567,108.00	
	LINDE AG	18,220	156.40	2,849,608.00	
	SOLVAY SA	7,300	114.10	832,930.00	

SYMRISE AG	12,100	60.70	734,470.00
UMICORE	9,400	53.38	501,772.00
CRH PLC	82,300	32.83	2,701,909.00
HEIDELBERGCEMENT AG	14,300	87.98	1,258,114.00
IMERYS	3,800	78.70	299,060.00
ARCELORMITTAL	178,000	7.97	1,420,262.00
THYSSENKRUPP AG	36,300	22.94	832,903.50
VOESTALPINE AG	11,000	38.11	419,210.00
STORA ENSO OYJ-R	54,000	11.05	596,700.00
UPM-KYMMENE OYJ	52,900	22.21	1,174,909.00
AIRBUS SE	56,700	71.64	4,061,988.00
DASSAULT AVIATION SA	200	1,172.85	234,570.00
LEONARDO SPA	41,000	13.47	552,270.00
SAFRAN SA	30,400	70.04	2,129,216.00
THALES SA	10,500	90.47	949,935.00
ZODIAC AEROSPACE	19,500	23.40	456,300.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	48,100	47.62	2,290,762.50
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,012	31.61	600,969.32
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	9,300	32.40	301,320.00
BOUYGUES	20,100	38.43	772,443.00
EIFFAGE SA	6,100	73.23	446,703.00
FERROVIAL SA	46,466	18.70	868,914.20
HOCHTIEF AG	2,000	154.60	309,200.00
VINCI	48,900	74.16	3,626,424.00
LEGRAND SA	26,400	56.06	1,479,984.00
OSRAM LICHT AG	8,850	57.46	508,521.00
PRYSMIAN SPA	19,400	24.48	474,912.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	54,400	68.38	3,719,872.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	91,600	30.00	2,748,000.00
SIEMENS AG	74,600	127.75	9,530,150.00
ALSTOM	15,500	27.70	429,350.00
ANDRITZ AG	7,200	48.44	348,768.00
CNH INDUSTRIAL NV	99,000	9.01	892,485.00
GEA GROUP AG	17,000	39.76	676,005.00
KONE OYJ	32,300	40.91	1,321,393.00

MAN SE	3,700	96.49	357,013.00
METSO OYJ	10,300	28.49	293,447.00
WARTSILA OYJ	14,700	50.20	737,940.00
ZARDOYA OTIS S.A	17,546	8.66	151,948.36
BRENNTAG AG	15,190	52.53	797,930.70
REXEL SA	28,600	17.00	486,200.00
EDENRED	21,400	22.00	470,800.00
SOCIETE BIC SA	2,810	115.05	323,290.50
BOLLORE	87,000	3.59	312,417.00
DEUTSCHE POST AG-REG	92,600	31.86	2,950,699.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,600	15.06	340,469.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	80,000	6.11	489,520.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	63,010	15.13	953,341.30
ADP	2,800	116.30	325,640.00
AENA SA	6,500	147.00	955,500.00
ATLANTIA SPA	38,700	24.10	932,670.00
FRAPORT AG	3,800	65.83	250,154.00
GRUPE EUROTUNNEL SE - REGR	45,000	9.16	412,200.00
CONTINENTAL AG	10,450	206.30	2,155,835.00
MICHELIN (CGDE)	17,500	112.30	1,965,250.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	11,300	39.15	442,395.00
SCHAEFFLER AG	16,000	16.51	264,240.00
VALEO SA	22,800	62.49	1,424,772.00
BAYER MOTOREN WERK	31,600	85.58	2,704,328.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	5,300	73.61	390,133.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	94,000	69.33	6,517,020.00
FERRARI NV	11,600	69.50	806,200.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,000	10.27	914,030.00
PEUGEOT CITROEN	47,300	18.95	896,335.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	15,200	51.00	775,200.00
RENAULT SA	18,600	81.51	1,516,086.00
VOLKSWAGEN AG	3,250	140.95	458,087.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	17,900	136.20	2,437,980.00
SEB SA	2,000	129.40	258,800.00
ADIDAS AG	18,450	177.80	3,280,410.00

CHRISTIAN DIOR SE	5,380	216.05	1,162,349.00	
HERMES INTERNATIONAL	2,620	438.75	1,149,525.00	
HUGO BOSS AG	6,300	67.34	424,242.00	
KERING SA	7,470	241.30	1,802,511.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	16,500	51.75	853,875.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,240	202.90	5,526,996.00	
ACCOR SA	16,400	39.02	639,928.00	
PADDY POWER PLC	8,700	99.32	864,084.00	
SODEXO	8,900	109.10	970,990.00	
ALTICE NV - A	36,830	21.43	789,266.90	
ALTICE NV - B	10,010	21.42	214,414.20	
AXEL SPRINGER SE	4,400	51.50	226,600.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,300	20.18	328,934.00	
JC DECAUX SA	6,800	32.31	219,742.00	
LAGARDERE S.C.A	11,600	26.98	313,026.00	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	22,300	40.97	913,742.50	
PUBLICIS GROUPE	18,100	64.75	1,171,975.00	
RTL GROUP	3,900	75.02	292,578.00	
SES FDR	34,400	21.00	722,400.00	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,200	55.59	289,068.00	
VIVENDI SA	100,000	17.63	1,763,000.00	
ZALANDO SE	8,100	37.42	303,102.00	
INDITEX SA	106,800	32.55	3,476,340.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	55,200	21.99	1,213,848.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	51.56	304,204.00	
COLRUYT SA	6,000	45.31	271,890.00	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	56,000	5.40	302,848.00	
JERONIMO MARTINS	23,000	16.48	379,040.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	123,200	19.81	2,440,592.00	
METRO AG	18,200	30.00	546,000.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	74,300	103.05	7,656,615.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	21,900	35.22	771,318.00	
HEINEKEN HOLDING NV	9,700	73.90	716,830.00	
HEINEKEN NV	22,300	79.45	1,771,735.00	
PERNOD RICARD SA	20,700	109.80	2,272,860.00	

REMY COINTREAU	2,300	88.87	204,401.00	
DANONE	57,800	63.55	3,673,190.00	
KERRY GROUP PLC-A	15,800	73.74	1,165,092.00	
HENKEL AG & CO KGAA	9,900	104.25	1,032,075.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,300	119.75	2,071,675.00	
BEIERSDORF AG	10,000	88.50	885,000.00	
LOREAL-ORD	24,630	179.05	4,410,001.50	
UNILEVER NV-CVA	158,900	46.72	7,424,602.50	
ESSILOR INTERNATIONAL	20,400	113.00	2,305,200.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	20,800	78.80	1,639,040.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	39,600	74.60	2,954,160.00	
GRIFOLS SA	28,800	23.08	664,848.00	
BAYER AG-REG	80,700	106.80	8,618,760.00	
MERCK KGAA	12,500	105.90	1,323,750.00	
ORION OYJ	9,500	48.83	463,885.00	
SANOFI	113,200	84.24	9,535,968.00	
UCB SA	12,100	72.36	875,556.00	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	27,900	22.86	637,933.50	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	642,000	7.21	4,628,820.00	
BANCO DE SABADELL SA	530,000	1.71	906,300.00	
BANCO SANTANDER SA	1,422,000	5.74	8,169,390.00	
BANK OF IRELAND	2,850,000	0.23	669,750.00	
BANKIA SA	430,000	1.05	455,370.00	
BANKINTER S.A.	65,000	7.81	507,650.00	
BCO POPULAR ESPANOL	300,260	0.92	276,239.20	
BNP PARIBAS	103,400	61.80	6,390,120.00	
CAIXABANK	345,000	4.03	1,390,350.00	
COMMERZBANK AG	102,000	8.53	870,774.00	
CREDIT AGRICOLE SA	108,000	12.64	1,365,120.00	
ERSTE GROUP BANK AG	28,900	30.69	887,085.50	
ING GROEP NV	379,000	14.03	5,317,370.00	
INTESA SANPAOLO	1,234,000	2.52	3,117,084.00	
INTESA SANPAOLO-RSP	92,000	2.37	218,040.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	24,400	61.97	1,512,068.00	

MEDIOBANCA S.P.A.	53,000	8.49	449,970.00
NATIXIS	87,000	5.72	497,901.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	21.10	232,155.00
SOCIETE GENERALE	74,200	47.07	3,492,594.00
UNICREDIT SPA	184,317	14.28	2,632,046.76
EURAZEO	4,069	60.90	247,802.10
EXOR NV	10,400	48.00	499,200.00
GROUPE BRUXELLES LAM	7,800	85.06	663,468.00
WENDEL	2,900	116.15	336,835.00
AEGON NV	170,000	4.79	814,300.00
AGEAS	19,000	36.62	695,780.00
ALLIANZ SE-REG	44,590	172.75	7,702,922.50
ASSICURAZIONI GENERALI	112,000	14.71	1,647,520.00
AXA	189,700	24.21	4,593,585.50
CNP ASSURANCES	16,500	19.19	316,717.50
HANNOVER RUECK SE	5,600	107.65	602,840.00
MAPFRE SA	98,000	3.23	316,736.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,550	183.55	2,854,202.50
NN GROUP NV	30,000	30.65	919,650.00
POSTE ITALIANE SPA	50,000	6.24	312,000.00
SAMPO OYJ-A SHS	43,000	44.36	1,907,480.00
SCOR SE	15,400	35.11	540,771.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	2.06	220,634.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,200	41.90	469,280.00
AMADEUS IT GROUP SA	42,600	47.02	2,003,265.00
ATOS SE	8,600	115.00	989,000.00
CAP GEMINI SA	15,800	85.68	1,353,744.00
DASSAULT SYSTEMES SA	12,800	80.86	1,035,008.00
GEMALTO	7,600	51.41	390,716.00
SAP SE	95,900	91.39	8,764,301.00
NOKIA OYJ	568,000	4.99	2,836,592.00
INGENICO GROUP	5,500	87.18	479,490.00
ASML HOLDING NV	36,200	124.05	4,490,610.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	108,900	19.13	2,083,257.00
STMICROELECTRONICS NV	60,000	14.36	861,900.00

DEUTSCHE TELEKOM-REG	319,900	16.27	5,206,372.50	
ELISA OYJ	14,500	33.11	480,095.00	
ILIAD SA	2,710	210.45	570,319.50	
KONINKLIJKE KPN NV	341,000	2.79	953,777.00	
ORANGE SA	194,000	14.62	2,837,250.00	
PROXIMUS	15,100	29.46	444,846.00	
SFR GROUP SA	7,700	29.36	226,072.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,130,000	0.84	955,415.00	
TELECOM ITALIA-RNC	570,000	0.68	389,880.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	74,600	4.59	342,861.60	
TELEFONICA SA	443,000	10.45	4,629,350.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	37,000	7.85	290,450.00	
ENDESA S.A.	31,700	21.74	689,316.50	
ENEL SPA	747,000	4.36	3,262,896.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	235,000	3.15	740,955.00	
FORTUM OYJ	44,000	14.63	643,720.00	
IBERDROLA SA	541,000	6.63	3,587,912.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	43,200	17.88	772,416.00	
TERNA SPA	152,000	4.59	697,984.00	
GAS NATURAL SDG	32,800	20.21	663,052.00	
E.ON SE	215,000	7.30	1,569,930.00	
ENGIE	152,000	13.00	1,976,000.00	
INNOGY SE	12,700	34.87	442,912.50	
RWE AG	49,600	15.08	748,216.00	
SUEZ	33,300	14.50	483,016.50	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	46,100	17.30	797,530.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	202,600	16.03	3,248,691.00	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	18,900	85.37	1,613,493.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,030	406.30	418,489.00	
QIAGEN NV	21,474	27.14	582,804.36	
BUREAU VERITAS SA	25,500	19.10	487,050.00	
RANDSTAD HOLDING NV	11,600	54.04	626,864.00	
RELX NV	95,400	17.29	1,649,466.00	
WOLTERS KLUWER	29,900	38.62	1,154,738.00	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	34,200	30.55	1,044,810.00	

	IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00	
	VONOVIA SE	44,600	32.71	1,459,089.00	
小計	銘柄数：235			365,469,292.83	
				(43,779,566,588)	
	組入時価比率：12.0%			12.6%	
英ポンド	PETROFAC LTD	26,000	9.41	244,660.00	
	BP PLC	1,845,000	4.61	8,517,442.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	426,100	21.23	9,046,103.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	365,300	22.21	8,115,139.50	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	12,000	35.81	429,720.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,150	30.56	585,224.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	136,400	12.62	1,722,050.00	
	ANTOFAGASTA PLC	41,000	8.40	344,400.00	
	BHP BILLITON PLC	207,100	12.70	2,631,205.50	
	FRESNILLO PLC	20,900	15.55	324,995.00	
	GLENCORE PLC	1,197,000	3.17	3,800,475.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	8,800	69.80	614,240.00	
	RIO TINTO PLC-REG	121,000	32.90	3,980,900.00	
	MONDI PLC	34,300	19.77	678,111.00	
	BAE SYSTEMS PLC	306,000	6.55	2,004,300.00	
	COBHAM PLC	169,500	1.35	229,503.00	
	MEGGITT PLC	78,000	4.48	349,986.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	174,000	7.66	1,332,840.00	
	DCC PLC	8,600	70.40	605,440.00	
	SMITHS GROUP PLC	37,100	16.31	605,101.00	
	IMI PLC	25,900	12.28	318,052.00	
	WEIR GROUP PLC	22,000	19.50	429,000.00	
	ASHTREAD GROUP PLC	47,600	16.78	798,728.00	
	BUNZLE	33,100	23.25	769,575.00	
	TRAVIS PERKINS PLC	24,700	15.10	372,970.00	
	WOLSELEY PLC	24,200	50.80	1,229,360.00	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	8.75	226,625.00	
	G4S PLC	152,000	3.06	465,424.00	
	ROYAL MAIL PLC	88,000	4.19	368,720.00	
	EASYJET PLC	16,300	10.07	164,141.00	

GKN PLC	169,000	3.67	620,230.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	98,000	5.45	534,100.00
PERSIMMON PLC	29,500	21.01	619,795.00
TAYLOR WIMPEY PLC	319,000	1.92	614,713.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	12,400	31.83	394,692.00
BURBERRY GROUP PLC	41,900	17.40	729,060.00
CARNIVAL PLC	18,700	46.13	862,631.00
COMPASS GROUP PLC	161,100	15.09	2,430,999.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	18,183	39.37	715,864.71
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	69,000	4.71	325,542.00
TUI AG-DI	49,000	11.26	551,740.00
WHITBREAD PLC	17,300	39.41	681,793.00
WILLIAM HILL PLC	85,000	2.87	244,120.00
ITV PLC	353,000	2.11	746,242.00
PEARSON	78,000	6.68	521,040.00
SKY PLC	99,000	9.77	967,230.00
WPP PLC	123,400	17.35	2,140,990.00
MARKS & SPENCER PLC	153,000	3.31	507,042.00
NEXT PLC	14,000	42.60	596,400.00
DIXONS CARPHONE PLC	92,000	3.16	291,364.00
KINGFISHER PLC	214,000	3.25	695,500.00
MORRISON SUPERMARKETS	213,000	2.42	516,099.00
SAINSBURY	150,000	2.65	397,800.00
TESCO PLC	787,000	1.89	1,487,430.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	16,700	20.61	344,187.00
DIAGEO PLC	245,600	23.09	5,670,904.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,000	25.95	882,300.00
TATE & LYLE ORD.	48,000	7.77	372,960.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	181,700	53.10	9,648,270.00
IMPERIAL BRANDS PLC	93,800	38.41	3,603,327.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	61,600	73.39	4,520,824.00
UNILEVER PLC	125,400	39.94	5,009,103.00
SMITH & NEPHEW PLC	84,000	12.18	1,023,120.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	7.59	284,625.00
SHIRE PLC	87,400	47.33	4,137,079.00

ASTRAZENECA PLC	123,500	49.27	6,084,845.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	475,500	16.79	7,983,645.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,900	20.09	279,251.00
BARCLAYS PLC	1,640,000	2.28	3,740,020.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,929,000	6.56	12,654,240.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,280,000	0.66	4,185,620.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	341,000	2.42	826,584.00
STANDARD CHARTERED PLC	322,000	7.66	2,466,520.00
ADMIRAL GROUP PLC	21,900	19.90	435,810.00
AVIVA PLC	395,000	5.28	2,085,600.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	136,083	3.41	464,043.03
LEGAL & GENERAL	577,000	2.47	1,425,190.00
OLD MUTUAL PLC	488,000	2.16	1,058,472.00
PRUDENTIAL PLC	252,100	16.87	4,252,927.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	98,750	5.85	578,181.25
ST JAMES S PLACE PLC	49,000	10.62	520,380.00
STANDARD LIFE PLC	187,000	3.55	665,533.00
AUTO TRADER GROUP PLC	95,000	3.89	369,550.00
WORLDPAY GROUP PLC	166,000	2.91	483,558.00
SAGE GROUP PLC (THE)	105,000	6.34	666,225.00
BT GROUP PLC	816,000	3.17	2,586,720.00
INMARSAT PLC	42,500	8.35	355,087.50
VODAFONE GROUP PLC	2,599,000	2.08	5,426,712.00
SSE PLC	99,000	14.65	1,450,350.00
CENTRICA PLC	524,000	2.17	1,140,224.00
NATIONAL GRID PLC	368,000	10.06	3,702,080.00
SEVERN TRENT PLC	23,700	23.66	560,742.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,000	9.90	663,300.00
PROVIDENT FINANCIAL PLC	14,300	29.37	419,991.00
3I GROUP PLC	97,000	7.37	715,375.00
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	94,000	2.67	251,450.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,000	13.07	326,750.00
INVESTEC PLC	61,000	6.04	368,440.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	30,000	31.33	939,900.00
SCHRODERS PLC	13,300	30.40	404,320.00

	CAPITA PLC	64,000	5.53	353,920.00	
	EXPERIAN PLC	90,900	16.22	1,474,398.00	
	INTERTEK GROUP PLC	16,300	39.50	643,850.00	
	RELX PLC	105,800	15.66	1,656,828.00	
小計	銘柄数：104			179,660,177.99	
				(25,166,797,732)	
	組入時価比率：6.9%				7.3%
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	830	585.50	485,965.00	
	GIVAUDAN-REG	886	1,802.00	1,596,572.00	
	SIKA AG-BR	204	6,050.00	1,234,200.00	
	SYNGENTA AG-REG	8,950	440.70	3,944,265.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	43,900	59.00	2,590,100.00	
	GEBERIT AG-REG	3,580	439.40	1,573,052.00	
	ABB LTD	184,100	23.37	4,302,417.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	190.00	366,700.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,870	193.40	748,458.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,250	140.80	739,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	51,100	78.05	3,988,355.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,930	356.10	1,043,373.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	69.50	319,700.00	
	DUFREY AG-REG	4,500	149.10	670,950.00	
	ARYZTA AG	8,500	31.64	268,940.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	230	1,322.00	304,060.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	5,655.00	588,120.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	10	66,475.00	664,750.00	
	NESTLE SA-REG	303,000	77.30	23,421,900.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,000	136.40	682,000.00	
	ACTELION LTD-NEW LINE	9,390	279.50	2,624,505.00	
	GALENICA AG-REG	360	1,060.00	381,600.00	
	NOVARTIS-REG	217,500	75.05	16,323,375.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	68,420	257.90	17,645,518.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	3,200	70.85	226,720.00	
	BALOISE HOLDING AG	5,000	138.30	691,500.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,180	324.40	1,031,592.00	
	SWISS RE LTD	30,900	90.00	2,781,000.00	
		14,730	280.80	4,136,184.00	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG				
	SWISSCOM AG-REG	2,560	458.00	1,172,480.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	195,000	15.08	2,940,600.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,000	49.91	1,098,020.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,690	544.50	920,205.00	
	UBS GROUP AG	357,000	15.95	5,694,150.00	
	LONZA AG-REG	5,710	189.50	1,082,045.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	15,300	70.75	1,082,475.00	
	SGS SA-REG	515	2,125.00	1,094,375.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,800	87.05	591,940.00	
小計	銘柄数：38			111,051,361.00	
				(12,445,526,027)	
	組入時価比率：3.4%			3.6%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	17,100	184.10	3,148,110.00	
	BOLIDEN AB	26,300	272.90	7,177,270.00	
	ASSA ABLOY AB-B	96,300	184.10	17,728,830.00	
	SKANSKA AB-B SHS	34,100	210.20	7,167,820.00	
	ALFA LAVAL AB	27,700	168.40	4,664,680.00	
	ATLAS COPCO AB-A	66,000	313.70	20,704,200.00	
	ATLAS COPCO AB-B	38,200	282.30	10,783,860.00	
	SANDVIK AB	103,000	132.40	13,637,200.00	
	SKF AB-B SHARES	38,800	176.60	6,852,080.00	
	VOLVO AB-B SHS	152,000	131.70	20,018,400.00	
	SECURITAS AB-B SHS	29,000	138.50	4,016,500.00	
	ELECTROLUX AB-B	23,300	242.60	5,652,580.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	77.30	2,937,400.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	91,700	227.70	20,880,090.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,800	301.60	2,352,480.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,900	290.30	5,486,670.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	60,000	287.20	17,232,000.00	
	GETINGE AB-B SHS	19,100	154.70	2,954,770.00	
	NORDEA BANK AB	295,000	101.70	30,001,500.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	150,000	99.20	14,880,000.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	148,000	122.10	18,070,800.00	
	SWEDBANK AB	88,100	220.90	19,461,290.00	

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,800	192.90	3,240,720.00	
	INVESTOR AB-B SHS	44,100	372.00	16,405,200.00	
	KINNEVIK AB - B	23,600	238.90	5,638,040.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,400	595.50	2,024,700.00	
	ERICSSON LM-B	297,000	58.65	17,419,050.00	
	HEXAGON AB-B SHS	25,800	362.00	9,339,600.00	
	TELIA CO AB	247,000	37.51	9,264,970.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6,800	501.50	3,410,200.00	
	TELE 2 AB-B SHS	34,000	84.90	2,886,600.00	
小計	銘柄数：31			325,437,610.00	
				(4,084,242,005)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	111,300	148.20	16,494,660.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,800	326.00	5,476,800.00	
	NORSK HYDRO	130,000	50.40	6,552,000.00	
	SCHIBSTED ASA	7,800	219.10	1,708,980.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,100	196.00	1,783,600.00	
	MARINE HARVEST ASA	37,200	133.10	4,951,320.00	
	ORKLA ASA	80,000	76.45	6,116,000.00	
	DNB ASA	94,000	137.70	12,943,800.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,700	132.00	2,600,400.00	
	TELENOR ASA	71,900	142.10	10,216,990.00	
小計	銘柄数：10			68,844,550.00	
				(901,175,159)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,100	438.60	3,991,260.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,500	274.40	6,174,000.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	21,200	563.00	11,935,600.00	
	ISS A/S	16,100	267.90	4,313,190.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	375	11,300.00	4,237,500.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	620	11,750.00	7,285,000.00	
	DSV A/S	19,000	358.80	6,817,200.00	
	PANDORA A/S	10,800	765.00	8,262,000.00	
	CARLSBERG B	10,500	646.00	6,783,000.00	

	COLOPLAST-B	11,700	537.00	6,282,900.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	144.90	1,883,700.00	
	GENMAB A/S	5,490	1,413.00	7,757,370.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	186,700	236.40	44,135,880.00	
	DANSKE BANK AS	66,900	235.80	15,775,020.00	
	TRYG A/S	11,800	126.10	1,487,980.00	
	TDC A/S	76,800	36.22	2,781,696.00	
	DONG ENERGY A/S	14,100	262.60	3,702,660.00	
小計	銘柄数：17			143,605,956.00	
				(2,312,055,891)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	25,500	29.98	764,490.00	
	OIL SEARCH LTD	129,000	7.29	940,410.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	175,000	7.14	1,249,500.00	
	SANTOS LTD.	176,000	3.83	674,080.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	73,500	32.33	2,376,255.00	
	INCITEC PIVOT LTD	161,000	3.77	606,970.00	
	ORICA LTD	36,600	17.81	651,846.00	
	BORAL LTD	115,000	5.87	675,050.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	44,000	20.69	910,360.00	
	AMCOR	112,000	15.29	1,712,480.00	
	ALUMINA LTD	233,000	1.81	422,895.00	
	BHP BILLITON LIMITED	313,700	24.07	7,550,759.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	148,000	6.21	919,080.00	
	NEWCREST MINING	75,000	22.40	1,680,000.00	
	RIO TINTO LTD	40,800	60.49	2,467,992.00	
	SOUTH32 LTD	507,000	2.79	1,414,530.00	
	CIMIC GROUP LTD	8,938	36.37	325,075.06	
	BRAMBLES LTD	153,000	9.45	1,445,850.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	44,133	3.98	175,649.34	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,000	5.35	1,021,850.00	
	SYDNEY AIRPORT	107,900	6.71	724,009.00	
	TRANSURBAN GROUP	198,000	11.72	2,320,560.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,000	18.02	937,040.00	
	CROWN RESORTS LTD	36,000	11.86	426,960.00	

DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	5,900	57.96	341,964.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	28.93	150,436.00
TABCORP HOLDINGS	78,000	4.74	369,720.00
TATTS GROUP LTD	147,000	4.45	654,150.00
REA GROUP LTD	5,400	59.62	321,948.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	4.47	236,910.00
WESFARMERS LIMITED	110,700	45.49	5,035,743.00
WOOLWORTHS LIMITED	123,600	26.70	3,300,120.00
COCA-COLA AMATIL LTD	60,000	10.81	648,600.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	12.34	888,480.00
COCHLEAR LTD	5,800	135.69	787,002.00
HEALTHSCOPE LTD	176,000	2.28	401,280.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,100	70.18	989,538.00
SONIC HEALTHCARE LTD	38,000	22.24	845,120.00
CSL LIMITED	44,600	125.49	5,596,854.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	285,700	32.27	9,219,539.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,115	12.04	422,784.60
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	44,300	12.03	532,929.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	168,000	86.52	14,535,360.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	259,400	33.49	8,687,306.00
WESTPAC BANKING CORP	326,300	35.26	11,505,338.00
AMP LIMITED	281,000	5.15	1,447,150.00
CHALLENGER LIMITED	56,000	12.59	705,040.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	228,000	6.08	1,386,240.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	261,000	2.83	738,630.00
QBE INSURANCE	132,000	12.93	1,706,760.00
SUNCORP GROUP LTD	126,000	13.26	1,670,760.00
COMPUTERSHARE LTD	47,000	14.14	664,580.00
TELSTRA CORP LTD	414,000	4.62	1,912,680.00
TPG TELECOM LTD	33,000	6.95	229,350.00
VOCUS GROUP LTD	54,000	4.34	234,360.00
AUSNET SERVICES	163,400	1.69	276,146.00
APA GROUP	111,000	8.99	997,890.00
AGL ENERGY LTD	65,700	26.05	1,711,485.00
DUET GROUP	229,000	2.78	636,620.00

	ASX LTD	19,600	50.71	993,916.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,500	90.05	2,656,475.00	
	SEEK LTD	32,800	15.96	523,488.00	
小計	銘柄数：62			116,356,382.00	
				(9,988,031,830)	
	組入時価比率：2.7%			2.9%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	69,000	8.29	572,010.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	91,110	6.78	617,725.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,000	8.43	295,050.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	189,000	3.45	652,050.00	
	CONTACT ENERGY LTD	76,000	4.99	379,240.00	
	MERCURY NZ LTD	60,000	3.18	190,800.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	120,000	2.80	336,000.00	
小計	銘柄数：7			3,042,875.80	
				(238,652,748)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	264,540	96.75	25,594,245.00	
	NWS HOLDINGS LTD	159,500	14.26	2,274,470.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	11.24	1,202,680.00	
	MTR CORP	148,000	44.00	6,512,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	140,000	31.00	4,340,000.00	
	LI & FUNG LTD	563,600	3.38	1,904,968.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	75,000	31.10	2,332,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	223,000	43.10	9,611,300.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	94,000	16.12	1,515,280.00	
	SANDS CHINA LTD	233,600	36.40	8,503,040.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	108,333	10.88	1,178,663.04	
	SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	6.38	1,059,080.00	
	WYNN MACAU LTD	148,400	16.30	2,418,920.00	
	WH GROUP LIMITED	810,000	6.68	5,410,800.00	
	BANK OF EAST ASIA	120,860	32.40	3,915,864.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	363,500	32.10	11,668,350.00	
	HANG SENG BANK	75,600	158.90	12,012,840.00	
	FIRST PACIFIC CO	226,000	5.72	1,292,720.00	
	AIA GROUP LTD	1,176,000	49.60	58,329,600.00	

	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	104.90	2,297,310.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	379,600	10.04	3,811,184.00	
	PCCW LTD	386,000	4.54	1,752,440.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	65,000	61.55	4,000,750.00	
	CLP HLDGS	159,000	81.95	13,030,050.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	132,000	66.90	8,830,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	754,809	15.54	11,729,731.86	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	112,000	194.40	21,772,800.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	261,040	52.45	13,691,548.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	33.70	2,729,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	20.70	4,409,100.00	
	HENDERSON LAND	107,818	48.35	5,213,000.30	
	HYSAN DEVELOPMENT	65,000	35.00	2,275,000.00	
	KERRY PROPERTIES	57,000	27.00	1,539,000.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	549,666	9.58	5,265,800.28	
	SINO LAND CO.LTD	314,000	13.80	4,333,200.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	115.00	15,985,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	53,500	77.85	4,164,975.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	24.90	2,908,320.00	
	WHARF(HOLDING)	133,000	67.65	8,997,450.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	75,000	62.70	4,702,500.00	
	小計銘柄数：40			304,516,979.48	
				(4,397,225,183)	
	組入時価比率：1.2%			1.3%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	161,000	3.76	605,360.00	
	KEPPEL CORP.	142,700	6.89	983,203.00	
	SEBACORP INDUSTRIES	99,040	3.19	315,937.60	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	1.13	184,190.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	52,040	10.17	529,246.80	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	207,000	2.59	536,130.00	
	SATS LTD	59,000	4.90	289,100.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	614,600	1.02	626,892.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	148,000	3.58	529,840.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	44.39	443,900.00	

	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	620,320	0.38	238,823.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	184,000	3.55	653,200.00	
	DBS GROUP HLDGS	172,000	19.30	3,319,600.00	
	OCBC-ORD	303,000	9.71	2,942,130.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	130,000	22.02	2,862,600.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	786,000	3.93	3,088,980.00	
	STARHUB LTD	69,000	2.89	199,410.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	7.76	597,520.00	
	CAPITALAND LIMITED	246,000	3.63	892,980.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	41,000	10.22	419,020.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	266,000	2.75	731,500.00	
	UOL GROUP LIMITED	48,700	7.00	340,900.00	
小計	銘柄数：22			21,330,462.60	
				(1,712,196,232)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シケル	FRUTAROM	3,800	202.50	769,500.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	50,000	15.40	770,000.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,300	414.60	953,580.00	
	BANK HAPOALIM BM	102,000	22.08	2,252,160.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	142,000	16.00	2,272,000.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,000	61.44	798,720.00	
	NICE LTD	5,900	243.40	1,436,060.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	204,000	6.51	1,328,040.00	
	AZRIELI GROUP	4,100	192.20	788,020.00	
小計	銘柄数：9			11,368,080.00	
				(351,046,310)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				346,165,525,144	
				(346,165,525,144)	

(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29年 3月31日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	211,235.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	509,000	211,235.00 (23,698,454) 0.3%	
	合計			23,698,454 (23,698,454)	
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,900	656,355.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	834,632.00	
		AMERICAN TOWER CORP	41,600	5,029,856.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	95,000	1,055,450.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,230	2,425,323.60	
		BOSTON PROPERTIES	14,900	1,957,562.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,000	636,600.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,200	660,264.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	51,000	663,000.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	35,000	3,311,700.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,300	1,613,232.00	
		DUKE REALTY CORP	34,000	882,640.00	
		EQUINIX INC	7,450	2,958,693.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	34,800	2,164,212.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,190	1,439,608.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,800	873,200.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,910	921,379.40	
		GGP INC	56,500	1,296,110.00	
		HCP INC	44,700	1,385,253.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	70,100	1,299,654.00	
		IRON MOUNTAIN INC	24,400	863,516.00	
		KIMCO REALTY CORP	40,000	878,400.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	545,259.00	
		MACERICH CO /THE	12,300	790,152.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,200	1,139,936.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	632,055.00	
PROLOGIS INC	51,400	2,630,652.00			
PUBLIC STORAGE	14,450	3,170,330.00			

	REALTY INCOME CORP	24,700	1,455,571.00	
	REGENCY CENTERS CORP	15,100	1,004,150.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,000	1,427,040.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	30,720	5,223,628.80	
	SL GREEN REALTY CORP	9,800	1,030,568.00	
	UDR INC	25,300	914,595.00	
	VENTAS INC	34,800	2,244,600.00	
	VEREIT INC	95,000	805,600.00	
	VORNADO REALTY TRUST	16,500	1,656,105.00	
	WELLTOWER INC	35,300	2,498,534.00	
	WEYERHAEUSER CO	72,200	2,446,858.00	
小計	銘柄数 : 39	1,171,150	63,422,274.10	
			(7,115,344,931)	
	組入時価比率 : 2.0%		76.6%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	312,936.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	438,893.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	224,388.00	
小計	銘柄数 : 3	37,400	976,217.00	
			(82,051,038)	
	組入時価比率 : 0.0%		0.9%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	3,100	237,894.00	
	GECINA SA	4,000	492,000.00	
	ICADE	3,700	250,120.00	
	KLEPIERRE	20,500	739,127.50	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	9,570	2,057,550.00	
小計	銘柄数 : 5	40,870	3,776,691.50	
			(452,409,874)	
	組入時価比率 : 0.1%		4.9%	
英ポンド	BRITISH LAND	92,000	545,100.00	
	HAMMERSON PLC	74,000	415,140.00	
	INTU PROPERTIES PLC	88,000	239,272.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,500	795,925.00	
	SEGRO PLC	91,200	413,956.80	
小計	銘柄数 : 5	422,700	2,409,393.80	
			(337,507,883)	

		組入時価比率：0.1%		3.6%
豪ドル	DEXUS PROPERTY GROUP		91,000	902,720.00
	GOODMAN GROUP		174,000	1,379,820.00
	GPT GROUP		179,000	930,800.00
	LENDLEASE GROUP		53,000	837,400.00
	MIRVAC GROUP		340,000	754,800.00
	SCENTRE GROUP		518,000	2,268,840.00
	STOCKLAND TRUST GROUP		227,000	1,069,170.00
	VICINITY CENTRES		328,704	946,667.52
	WESTFIELD CORP		191,000	1,699,900.00
小計	銘柄数：9		2,101,704	10,790,117.52 (926,223,687)
	組入時価比率：0.3%			10.0%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	1,866,800.00
	LINK REIT		215,000	11,663,750.00
小計	銘柄数：2		475,000	13,530,550.00 (195,381,142)
	組入時価比率：0.1%			2.1%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		239,000	602,280.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		192,000	299,520.00
	CAPITALAND MALL TRUST		249,900	489,804.00
	SUNTEC REIT		243,000	434,970.00
小計	銘柄数：4		923,900	1,826,574.00 (146,619,094)
	組入時価比率：0.0%			1.6%
合計				9,255,537,649 (9,255,537,649)
合計				9,279,236,103 (9,279,236,103)

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29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	8,604,987,815	-	8,640,094,926	35,107,111
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	539,715,510	-	544,544,900	4,829,390
米ドル	502,487,160	-	507,008,400	4,521,240
カナダドル	33,335,800	-	33,616,000	280,200
ニュージーランドドル	3,892,550	-	3,920,500	27,950
合計	-	-	-	39,936,501

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成29年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,980,279,468
国債証券	544,815,612,880

(平成29年 3月31日現在)

地方債証券	54,040,358,253
特殊債券	57,868,662,170
社債券	27,962,347,860
未収入金	2,428,555,800
未収利息	907,072,393
前払費用	11,959,308
流動資産合計	692,014,848,132
資産合計	692,014,848,132
負債の部	
流動負債	
未払金	2,909,856,000
未払解約金	1,118,448,600
未払利息	6,385
流動負債合計	4,028,310,985
負債合計	4,028,310,985
純資産の部	
元本等	
元本	529,579,862,968
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	158,406,674,179
元本等合計	687,986,537,147
純資産合計	687,986,537,147
負債純資産合計	692,014,848,132

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29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	1.2991円
(10,000口当たり純資産額)	(12,991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28年 4月 1日
至 平成29年 3月31日

1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 3月31日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年 3月31日現在

期首	平成28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	499,328,368,105円
同期中における追加設定元本額	86,855,218,642円
同期中における一部解約元本額	56,603,723,779円
期末元本額	529,579,862,968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	422,027,603円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	18,776,125,783円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	18,799,177,271円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,580,836,266円
野村資産設計ファンド2015	482,549,118円
野村資産設計ファンド2020	327,370,484円

野村資産設計ファンド2025	247,548,712円
野村資産設計ファンド2030	146,349,005円
野村資産設計ファンド2035	79,082,251円
野村資産設計ファンド2040	155,771,659円
野村日本債券インデックスファンド	1,210,745,413円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	279,442,486,108円
のむらップ・ファンド(保守型)	10,062,134,648円
のむらップ・ファンド(普通型)	4,328,550,112円
のむらップ・ファンド(積極型)	717,349,966円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	14,368,441,567円
野村資産設計ファンド2045	12,273,247円
野村円債投資インデックスファンド	1,751,889,740円
野村インデックスファンド・国内債券	1,673,194,174円
マイ・ロード	34,734,526,525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	332,360,772円
野村ターゲットブライズ「日経225」(国内債券運用移行型)	47,593,942円
野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	21,255,342円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	5,526,922,361円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	583,472,423円
野村資産設計ファンド2050	10,951,269円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	7,863,309円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,530,394円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,048,876円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	884,802円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	394,183,998円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	35,027,278円
インデックス・ブレンド(タイプ)	687,909円
インデックス・ブレンド(タイプ)	312,339円
インデックス・ブレンド(タイプ)	538,561円
インデックス・ブレンド(タイプ)	413,214円
インデックス・ブレンド(タイプ)	194,709円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	339,213,201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)	939,535,756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)	269,378,588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)	7,278,712,341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)	1,733,623,187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)	18,421,585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)	26,504,432円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	3,600,599円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,134,100,901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)	374,875,808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)	2,064,493,416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)	883,710,078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)	368,439,571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)	394,129,328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)	900,399,076円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,781,995,566円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,070,268,432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）	639,052,414円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	12,838,199,051円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	19,053,036,144円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	8,466,851,659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）	42,674,764,391円
マイバランスDC30	7,420,128,557円
マイバランスDC50	4,988,221,006円
マイバランスDC70	1,491,798,276円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	9,036,441,388円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	94,027,920円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	5,820,170円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	6,448,977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29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29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366回	4,000,000,000	4,017,440,000	
		国庫債券 利付(2年)第368回	1,500,000,000	1,507,410,000	
		国庫債券 利付(2年)第369回	1,500,000,000	1,507,710,000	
		国庫債券 利付(2年)第372回	5,000,000,000	5,030,000,000	
		国庫債券 利付(5年)第113回	5,500,000,000	5,536,355,000	
		国庫債券 利付(5年)第114回	1,500,000,000	1,511,880,000	
		国庫債券 利付(5年)第115回	7,300,000,000	7,347,085,000	
		国庫債券 利付(5年)第116回	8,100,000,000	8,161,236,000	
		国庫債券 利付(5年)第117回	5,900,000,000	5,948,144,000	
		国庫債券 利付(5年)第118回	5,000,000,000	5,044,400,000	
		国庫債券 利付(5年)第119回	4,700,000,000	4,731,302,000	
		国庫債券 利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,553,075,000	
		国庫債券 利付(5年)第121回	3,500,000,000	3,525,095,000	

国庫債券 利付(5年)第122回	7,800,000,000	7,860,528,000	
国庫債券 利付(5年)第123回	7,300,000,000	7,360,736,000	
国庫債券 利付(5年)第124回	8,100,000,000	8,170,551,000	
国庫債券 利付(5年)第125回	8,200,000,000	8,274,210,000	
国庫債券 利付(5年)第126回	5,500,000,000	5,552,360,000	
国庫債券 利付(5年)第127回	6,000,000,000	6,059,700,000	
国庫債券 利付(5年)第128回	6,200,000,000	6,264,356,000	
国庫債券 利付(5年)第129回	6,000,000,000	6,064,620,000	
国庫債券 利付(5年)第130回	5,000,000,000	5,056,900,000	
国庫債券 利付(5年)第131回	500,000,000	505,610,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	1,960,000,000	2,779,515,200	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,233,243,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,239,948,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,300,000,000	1,798,017,000	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,300,000,000	1,726,166,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,692,236,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,737,106,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,719,495,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	1,700,000,000	1,396,397,000	
国庫債券 利付(10年)第297回	1,100,000,000	1,130,822,000	
国庫債券 利付(10年)第298回	1,500,000,000	1,539,450,000	
国庫債券 利付(10年)第299回	1,400,000,000	1,441,720,000	
国庫債券 利付(10年)第300回	1,000,000,000	1,033,730,000	
国庫債券 利付(10年)第301回	1,500,000,000	1,556,625,000	
国庫債券 利付(10年)第302回	700,000,000	724,871,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	3,300,000,000	3,429,822,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,036,870,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,265,968,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,140,520,000	

国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,774,579,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,780,393,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,122,490,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,848,777,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,859,850,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,198,490,000	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,384,768,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,309,516,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	3,600,000,000	3,804,336,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,473,528,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,899,378,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,362,304,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,957,411,000	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,686,620,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,377,088,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,520,840,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,842,911,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,352,608,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,900,000,000	5,143,628,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,196,516,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,260,270,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,500,000,000	5,729,075,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,592,825,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	4,015,916,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,983,277,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	3,400,000,000	3,553,612,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	4,000,000,000	4,184,480,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,291,306,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	3,700,000,000	3,846,668,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,700,000,000	2,808,432,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,791,427,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	4,900,000,000	5,059,985,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,900,000,000	6,093,756,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	6,000,000,000	6,197,820,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	7,200,000,000	7,375,320,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	7,500,000,000	7,550,250,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	6,900,000,000	6,941,124,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,830,044,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	6,800,000,000	6,829,512,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	800,000,000	802,768,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	132,017,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	255,578,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	202,844,800	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,218,375,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	189,649,500	

国庫債券 利付（30年）第6回	700,000,000	908,565,000	
国庫債券 利付（30年）第7回	600,000,000	772,512,000	
国庫債券 利付（30年）第8回	100,000,000	121,675,000	
国庫債券 利付（30年）第9回	65,000,000	75,108,150	
国庫債券 利付（30年）第10回	250,000,000	277,082,500	
国庫債券 利付（30年）第11回	160,000,000	192,249,600	
国庫債券 利付（30年）第12回	220,000,000	278,412,200	
国庫債券 利付（30年）第13回	290,000,000	362,685,600	
国庫債券 利付（30年）第14回	800,000,000	1,053,264,000	
国庫債券 利付（30年）第15回	900,000,000	1,200,465,000	
国庫債券 利付（30年）第16回	915,000,000	1,222,650,450	
国庫債券 利付（30年）第17回	1,200,000,000	1,585,164,000	
国庫債券 利付（30年）第18回	1,500,000,000	1,957,830,000	
国庫債券 利付（30年）第19回	1,600,000,000	2,087,664,000	
国庫債券 利付（30年）第20回	1,900,000,000	2,546,589,000	
国庫債券 利付（30年）第21回	1,400,000,000	1,829,632,000	
国庫債券 利付（30年）第22回	600,000,000	805,710,000	
国庫債券 利付（30年）第23回	840,000,000	1,129,506,000	
国庫債券 利付（30年）第24回	700,000,000	940,807,000	
国庫債券 利付（30年）第25回	500,000,000	655,025,000	
国庫債券 利付（30年）第26回	850,000,000	1,130,772,000	
国庫債券 利付（30年）第27回	1,550,000,000	2,098,204,000	
国庫債券 利付（30年）第28回	700,000,000	951,153,000	
国庫債券 利付（30年）第29回	1,500,000,000	2,015,295,000	
国庫債券 利付（30年）第30回	900,000,000	1,195,695,000	
国庫債券 利付（30年）第31回	1,600,000,000	2,098,432,000	
国庫債券 利付（30年）第32回	1,900,000,000	2,538,970,000	
国庫債券 利付（30年）第33回	2,000,000,000	2,552,260,000	
国庫債券 利付（30年）第34回	2,300,000,000	3,042,187,000	
国庫債券 利付（30年）第35回	2,300,000,000	2,949,129,000	
国庫債券 利付（30年）第36回	1,800,000,000	2,314,386,000	
国庫債券 利付（30年）第37回	2,300,000,000	2,909,017,000	
国庫債券 利付（30年）第38回	1,400,000,000	1,742,118,000	
国庫債券 利付（30年）第39回	1,600,000,000	2,029,712,000	
国庫債券 利付（30年）第40回	1,100,000,000	1,370,149,000	
国庫債券 利付（30年）第41回	1,000,000,000	1,222,290,000	

国庫債券	利付(30年)第42回	1,200,000,000	1,467,156,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,589,874,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,712,620,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,900,000,000	2,232,063,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,114,460,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,900,000,000	2,281,349,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,400,000,000	1,609,664,000
国庫債券	利付(30年)第49回	1,800,000,000	2,069,064,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,900,000,000	1,891,089,000
国庫債券	利付(30年)第51回	2,400,000,000	2,076,528,000
国庫債券	利付(30年)第52回	2,000,000,000	1,828,600,000
国庫債券	利付(30年)第53回	2,400,000,000	2,252,328,000
国庫債券	利付(30年)第54回	800,000,000	791,392,000
国庫債券	利付(20年)第40回	525,000,000	544,535,250
国庫債券	利付(20年)第41回	255,000,000	263,575,650
国庫債券	利付(20年)第42回	683,000,000	720,749,410
国庫債券	利付(20年)第43回	400,000,000	430,584,000
国庫債券	利付(20年)第44回	150,000,000	161,910,000
国庫債券	利付(20年)第45回	242,000,000	260,493,640
国庫債券	利付(20年)第46回	90,000,000	96,882,300
国庫債券	利付(20年)第47回	1,230,000,000	1,331,155,200
国庫債券	利付(20年)第48回	200,000,000	219,718,000
国庫債券	利付(20年)第49回	200,000,000	217,816,000
国庫債券	利付(20年)第50回	183,000,000	197,841,300
国庫債券	利付(20年)第51回	310,000,000	337,974,400
国庫債券	利付(20年)第52回	100,000,000	109,992,000
国庫債券	利付(20年)第53回	250,000,000	276,300,000
国庫債券	利付(20年)第54回	250,000,000	277,485,000
国庫債券	利付(20年)第55回	231,000,000	255,250,380
国庫債券	利付(20年)第56回	120,000,000	133,269,600
国庫債券	利付(20年)第57回	210,000,000	232,121,400
国庫債券	利付(20年)第58回	180,000,000	199,774,800
国庫債券	利付(20年)第59回	230,000,000	253,710,700
国庫債券	利付(20年)第60回	780,000,000	847,212,600
国庫債券	利付(20年)第61回	300,000,000	319,494,000
国庫債券	利付(20年)第62回	440,000,000	464,164,800

国庫債券	利付（20年）第63回	300,000,000	335,100,000	
国庫債券	利付（20年）第64回	400,000,000	451,012,000	
国庫債券	利付（20年）第65回	455,000,000	515,273,850	
国庫債券	利付（20年）第66回	300,000,000	337,833,000	
国庫債券	利付（20年）第67回	310,000,000	352,457,600	
国庫債券	利付（20年）第68回	290,000,000	335,799,700	
国庫債券	利付（20年）第69回	560,000,000	644,526,400	
国庫債券	利付（20年）第70回	540,000,000	635,515,200	
国庫債券	利付（20年）第71回	200,000,000	232,482,000	
国庫債券	利付（20年）第72回	670,000,000	776,449,600	
国庫債券	利付（20年）第73回	1,600,000,000	1,849,632,000	
国庫債券	利付（20年）第74回	1,300,000,000	1,512,875,000	
国庫債券	利付（20年）第75回	600,000,000	700,836,000	
国庫債券	利付（20年）第76回	910,000,000	1,048,438,300	
国庫債券	利付（20年）第77回	700,000,000	812,070,000	
国庫債券	利付（20年）第78回	800,000,000	924,800,000	
国庫債券	利付（20年）第79回	860,000,000	1,001,220,600	
国庫債券	利付（20年）第80回	900,000,000	1,055,187,000	
国庫債券	利付（20年）第81回	360,000,000	420,577,200	
国庫債券	利付（20年）第82回	820,000,000	964,910,400	
国庫債券	利付（20年）第83回	1,370,000,000	1,617,833,000	
国庫債券	利付（20年）第84回	1,200,000,000	1,406,640,000	
国庫債券	利付（20年）第85回	400,000,000	473,980,000	
国庫債券	利付（20年）第86回	1,400,000,000	1,683,948,000	
国庫債券	利付（20年）第87回	500,000,000	596,940,000	
国庫債券	利付（20年）第88回	1,100,000,000	1,328,745,000	
国庫債券	利付（20年）第89回	470,000,000	563,421,900	
国庫債券	利付（20年）第90回	1,500,000,000	1,804,590,000	
国庫債券	利付（20年）第91回	250,000,000	303,120,000	
国庫債券	利付（20年）第92回	1,550,000,000	1,856,218,000	
国庫債券	利付（20年）第93回	300,000,000	357,615,000	
国庫債券	利付（20年）第94回	200,000,000	240,390,000	
国庫債券	利付（20年）第95回	700,000,000	858,256,000	
国庫債券	利付（20年）第96回	400,000,000	482,324,000	
国庫債券	利付（20年）第97回	1,300,000,000	1,586,780,000	
国庫債券	利付（20年）第98回	300,000,000	363,066,000	

国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,549,190,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,867,016,000	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	312,500,000	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	626,800,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	745,512,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	488,152,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,324,061,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	493,796,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	367,755,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,924,496,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,085,031,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,351,988,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	995,456,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,218,230,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,500,000,000	3,086,975,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	2,500,000,000	3,092,675,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	624,745,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,377,893,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,900,000,000	2,355,981,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	614,650,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	962,264,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	941,728,000	

国庫債券 利付(20年)第121回	1,500,000,000	1,827,105,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,325,522,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	2,000,000,000	2,493,840,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,233,640,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,136,709,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,235,210,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	800,000,000	977,384,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,500,000,000	1,834,605,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	800,000,000	967,512,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,600,000,000	1,936,704,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	957,232,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,556,438,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,695,890,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,698,200,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	400,000,000	479,140,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	828,499,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,199,290,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	935,568,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	828,758,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	3,000,000,000	3,599,370,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	2,040,272,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	1,250,000,000	1,519,937,500	

回			
国庫債券 利付(20年)第143回	2,500,000,000	2,965,600,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,755,420,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,600,000,000	3,124,056,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	3,700,000,000	4,446,364,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,700,000,000	3,202,524,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,500,000,000	2,922,800,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,600,000,000	3,038,490,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	2,930,000,000	3,375,184,200	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,017,331,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	3,200,000,000	3,572,064,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	3,450,000,000	3,904,158,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	3,500,000,000	3,894,345,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,800,000,000	3,013,752,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,900,000,000	2,806,040,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	3,900,000,000	3,618,810,000	
国庫債券 利付(20年)第158回	2,800,000,000	2,741,620,000	
国庫債券 利付(20年)第159回	3,000,000,000	2,986,830,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	800,000,000	809,928,000	
メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	298,779,000	
ポーランド共和国 第15回円貨債券(2013)	100,000,000	100,786,000	
小計	銘柄数: 259	498,584,000,000	544,815,612,880

		組入時価比率：79.2%		79.5%
合計				544,815,612,880
地方債証券	日本円	東京都 公募第659回	300,000,000	305,808,000
		東京都 公募第660回	100,000,000	101,887,000
		東京都 公募第664回	100,000,000	102,359,000
		東京都 公募第668回	200,000,000	205,944,000
		東京都 公募第671回	100,000,000	103,086,000
		東京都 公募第685回	100,000,000	103,538,000
		東京都 公募第690回	200,000,000	209,360,000
		東京都 公募第703回	100,000,000	104,526,000
		東京都 公募第707回	100,000,000	104,164,000
		東京都 公募第708回	100,000,000	104,484,000
		東京都 公募第710回	100,000,000	104,067,000
		東京都 公募第712回	100,000,000	104,045,000
		東京都 公募第715回	100,000,000	104,171,000
		東京都 公募第716回	200,000,000	208,458,000
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	132,060,000
		東京都 公募第10回	200,000,000	257,748,000
		東京都 公募(7年)第3回	100,000,000	100,801,000
		東京都 公募第1回	300,000,000	328,116,000
		東京都 公募(20年)第3回	100,000,000	115,306,000
		東京都 公募第7回	100,000,000	117,061,000
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	238,726,000
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	240,540,000
		東京都 公募第23回	100,000,000	122,453,000
		東京都 公募(20年)第26回	100,000,000	117,699,000
		北海道 公募平成20年度第7回	300,000,000	307,512,000
		北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	103,783,000
		北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	103,908,000
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	104,327,000
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	104,181,000
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	309,522,000
		北海道 公募(5年)平成25年度第8回	100,000,000	100,407,000
		北海道 公募(5年)平成26年度第8回	200,000,000	200,734,000

北海道 公募(5年)平成26年度 第10回	100,000,000	100,311,000	
北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	103,064,000	
北海道 公募平成28年度第13回	200,000,000	199,900,000	
宮城県 公募(5年)第9回1号	500,000,000	502,075,000	
神奈川県 公募第155回	100,000,000	101,923,000	
神奈川県 公募第156回	101,000,000	103,415,920	
神奈川県 公募第184回	100,000,000	104,170,000	
神奈川県 公募第188回	200,000,000	210,114,000	
神奈川県 公募第196回	100,000,000	103,831,000	
神奈川県 公募第200回	100,000,000	104,968,000	
神奈川県 公募第205回	100,000,000	104,118,000	
神奈川県 公募第206回	100,000,000	104,084,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	205,144,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	132,945,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	358,182,000	
大阪府 公募第320回	400,000,000	412,004,000	
大阪府 公募第337回	200,000,000	208,668,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	104,668,000	
大阪府 公募第356回	100,000,000	104,876,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	108,309,760	
大阪府 公募第381回	100,000,000	104,145,000	
大阪府 公募第382回	100,000,000	104,094,000	
大阪府 公募第383回	100,000,000	104,251,000	
大阪府 公募第384回	100,000,000	104,090,000	
大阪府 公募第387回	300,000,000	308,949,000	
大阪府 公募第389回	100,000,000	103,042,000	
大阪府 公募第5回	100,000,000	121,916,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	118,411,000	
大阪府 公募第98回	200,000,000	200,774,000	
大阪府 公募(5年)第99回	240,000,000	240,782,400	
大阪府 公募(5年)第101回	148,000,000	148,512,080	
大阪府 公募第102回	100,000,000	100,353,000	
大阪府 公募(5年)第130回	600,000,000	599,274,000	
京都府 公募平成20年度第3回	140,000,000	143,705,800	
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	104,589,000	

京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	104,274,000
京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	113,071,000
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	206,806,000
兵庫県	公募平成20年度第3回	100,000,000	101,968,000
兵庫県	公募平成20年度第12回	100,000,000	102,967,000
兵庫県	公募平成20年度第16回	100,000,000	102,850,000
兵庫県	公募平成21年度第13回	100,000,000	103,327,000
兵庫県	公募平成21年度第25回	100,000,000	103,985,000
兵庫県	公募平成22年度第1回	100,000,000	104,349,000
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	129,901,000
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	340,743,000
兵庫県	公募(15年)第3回	100,000,000	110,757,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	309,906,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	121,311,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	122,547,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	116,764,000
静岡県	公募平成21年度第2回	100,000,000	103,619,000
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	104,006,000
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	104,400,602
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	103,834,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	106,568,130
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	172,032,300
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	103,410,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	206,664,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	114,787,226
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	297,612,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	118,524,000
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,476,000
愛知県	公募平成20年度第7回	210,000,000	215,237,400
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	119,568,000
愛知県	公募平成20年度第10回	100,000,000	102,882,000
愛知県	公募平成21年度第3回	114,000,000	118,156,440
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	104,012,000
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	104,210,000
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	103,928,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	104,790,000

愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	104,824,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	116,762,000
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	444,840,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	118,922,000
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	119,851,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	111,444,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,700,000
広島県	公募平成20年度第3回	300,000,000	306,978,000
広島県	公募平成22年度第6回	200,000,000	209,392,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	104,410,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	209,700,000
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	300,000,000	301,026,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,477,865
埼玉県	公募平成21年度第5回	100,000,000	103,431,000
埼玉県	公募平成22年度第2回	200,000,000	208,444,000
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	312,903,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	105,479,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	155,191,320
埼玉県	公募(5年)平成25年度第7回	100,000,000	100,356,000
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	104,162,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	104,067,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	104,187,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	206,674,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	411,072,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	102,380,000
福岡県	公募平成20年度第3回	100,000,000	101,899,000
福岡県	公募平成22年度第5回	100,000,000	103,253,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	104,516,000
福岡県	公募平成26年度第4回	100,000,000	100,261,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	112,131,000
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	133,287,000
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	120,135,000

福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	119,681,000	
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,043,000	
千葉県 公募平成20年度第6回	200,000,000	205,040,000	
千葉県 公募平成21年度第1回	100,000,000	103,101,000	
千葉県 公募平成21年度第11回	180,000,000	187,047,000	
千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	105,163,000	
千葉県 公募平成24年度第2回	100,000,000	104,526,000	
千葉県 公募平成24年度第7回	100,000,000	104,062,000	
千葉県 公募平成24年度第8回	100,000,000	104,690,000	
千葉県 公募平成25年度第2回	900,000,000	902,313,000	
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	105,244,000	
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	105,475,000	
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	122,527,000	
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	112,106,000	
新潟県 公募平成20年度第2回	200,000,000	205,694,000	
新潟県 公募平成21年度第2回	150,000,000	156,060,000	
長野県 公募平成25年度第1回	1,100,000,000	1,103,993,000	
群馬県 公募第8回	100,000,000	104,647,000	
群馬県 公募第12回	100,000,000	103,141,000	
群馬県 公募(5年)第4回	600,000,000	601,998,000	
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	116,802,000	
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	192,979,446	
大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	942,003,700	
共同発行市場地方債 公募第62回	100,000,000	101,959,000	
共同発行市場地方債 公募第63回	200,000,000	204,556,000	
共同発行市場地方債 公募第64回	262,000,000	268,020,760	
共同発行市場地方債 公募第65回	700,000,000	715,519,000	
共同発行市場地方債 公募第66回	181,000,000	185,074,310	
共同発行市場地方債 公募第68回	900,000,000	924,552,000	
共同発行市場地方債 公募第70回	110,000,000	112,783,000	
共同発行市場地方債 公募第74回	500,000,000	516,525,000	
共同発行市場地方債 公募第75回	310,000,000	321,150,700	
共同発行市場地方債 公募第82回	300,000,000	311,745,000	
共同発行市場地方債 公募第84回	500,000,000	520,120,000	
共同発行市場地方債 公募第85回	100,000,000	104,319,000	

共同発行市場地方債 公募第 8 8 回	100,000,000	103,776,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 9 回	100,000,000	103,433,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 2 回	110,000,000	114,016,100	
共同発行市場地方債 公募第 9 3 回	300,000,000	313,665,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 4 回	300,000,000	313,860,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 6 回	100,000,000	105,014,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 1 回	300,000,000	313,452,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 2 回	150,000,000	156,715,500	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 3 回	100,000,000	104,425,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 4 回	200,000,000	209,294,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 8 回	200,000,000	209,754,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 0 回	200,000,000	208,846,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 1 回	200,000,000	208,988,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 2 回	100,000,000	104,301,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 3 回	800,000,000	831,936,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 4 回	243,700,000	254,232,714	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 5 回	100,000,000	104,282,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 6 回	200,000,000	208,696,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 8 回	100,000,000	104,690,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 9 回	200,000,000	208,998,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 0 回	300,000,000	311,547,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 1 回	100,000,000	103,206,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 2 回	400,000,000	414,216,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 4 回	100,000,000	105,412,000	

共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	104,881,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	311,925,000	
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	104,362,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	104,720,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	104,100,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	207,500,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	206,844,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	160,049,900	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	553,656,600	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,022,070,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	100,000,000	99,380,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	100,000,000	99,195,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	120,304,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	115,797,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	103,837,000	
島根県 公募平成25年度第3回	700,000,000	702,478,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,862,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	205,850,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,917,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	146,098,120	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	104,301,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,917,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	243,530,760	
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,862,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,704,000	
大阪市 公募平成20年度第3回	110,000,000	112,575,100	
大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	104,085,000	
大阪市 公募平成25年度第1回	800,000,000	803,336,000	

大阪市	公募平成25年度第6回	100,000,000	104,197,000
大阪市	公募平成26年度第5回	100,000,000	103,628,000
大阪市	公募(5年)平成28年度第5回	100,000,000	99,862,000
大阪市	公募(15年)第1回	100,000,000	114,489,000
大阪市	公募(20年)第5回	100,000,000	124,143,000
大阪市	公募(20年)第6回	100,000,000	121,560,000
大阪市	公募(20年)第17回	100,000,000	117,377,000
名古屋市	公募第464回	300,000,000	306,957,000
名古屋市	公募第469回	100,000,000	103,565,000
名古屋市	公募第478回	100,000,000	105,121,000
名古屋市	公募第481回	100,000,000	104,080,000
名古屋市	公募第488回	300,000,000	310,968,000
名古屋市	公募(6年)第1回	200,000,000	200,604,000
名古屋市	公募(12年)第1回	200,000,000	214,622,000
名古屋市	公募(15年)第2回	100,000,000	106,383,000
京都市	公募平成20年度第4回	200,000,000	205,764,000
京都市	公募平成23年度第4回	100,000,000	104,895,000
京都市	公募平成25年度第3回	100,000,000	100,412,000
京都市	公募(20年)第2回	100,000,000	116,579,000
京都市	公募(20年)第13回	100,000,000	111,399,000
神戸市	公募平成21年度第7回	100,000,000	103,686,000
神戸市	公募平成26年度第17回	300,000,000	303,720,000
神戸市	公募平成28年度第1回	200,000,000	198,394,000
横浜市	公募平成20年度第3回	100,000,000	102,191,000
横浜市	公募公債平成20年度5回	200,000,000	205,338,000
横浜市	公募平成21年度第4回	200,000,000	206,526,000
横浜市	公募平成22年度第5回	100,000,000	104,563,000
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	208,698,000
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	207,628,000
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	207,862,000
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	205,436,000
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	300,723,000
横浜市	公募(20年)第26回	100,000,000	118,201,000
横浜市	公募(20年)第30回	100,000,000	111,693,000
札幌市	公募平成22年度第4回	100,000,000	103,280,000

札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	118,468,000	
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	103,266,000	
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	204,822,000	
川崎市 公募第81回	100,000,000	103,032,000	
川崎市 公募第82回	100,000,000	103,683,000	
川崎市 公募第85回	100,000,000	103,943,000	
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	114,279,000	
北九州市 公募(5年)平成25年度第2回	100,000,000	100,412,000	
北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	117,512,000	
福岡市 公募平成20年度第3回	100,000,000	101,814,000	
福岡市 公募(5年)平成25年度第2回	300,000,000	301,242,000	
福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	113,610,000	
福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,263,000	
福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	164,364,800	
広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	103,582,000	
広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	102,654,000	
広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	513,540,000	
仙台市 公募平成25年度第1回	600,000,000	602,304,000	
千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	105,163,000	
三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	146,691,500	
鹿児島県 公募(5年)平成25年度第1回	100,000,000	100,327,000	
鹿児島県 公募(5年)平成28年度第1回	100,000,000	99,864,000	
福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	102,541,000	
福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	198,478,000	
徳島県 公募平成22年度第1回	400,000,000	414,952,000	
山梨県 公募平成21年度第1回	100,000,000	103,459,000	
山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	208,578,000	
岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	104,076,000	
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	121,247,000	
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	365,370,000	
福岡北九州高速道路債券 第117	100,000,000	119,886,000	

		回		
	小計	銘柄数：288	51,562,340,000	54,040,358,253
		組入時価比率：7.9%		7.9%
	合計			54,040,358,253
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	102,114,000
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	157,761,780
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	201,690,270
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,182,000
		原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第3回	2,100,000,000	2,103,255,000
		韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	100,000,000	100,520,000
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	113,782,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回	100,000,000	101,239,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	311,631,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	107,706,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第5回	100,000,000	102,909,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	141,000,000	146,001,270
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	106,719,540
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	140,000,000	145,784,800
		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	210,702,000
		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	131,950,000
		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	240,178,000
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回	100,000,000	120,094,000
		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	242,748,000

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	290,516,000	
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	102,260,000	
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	122,755,000	
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	124,044,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第80回	100,000,000	104,901,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第84回	400,000,000	418,812,000	
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	208,652,000	
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	116,791,000	
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	103,666,000	
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	407,669,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	118,952,000	
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	301,125,000	
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	206,596,000	
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	206,152,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	206,706,000	
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	334,092,000	
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	113,310,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	81,507,000	
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	107,534,000	
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	107,682,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第58回	136,000,000	138,721,360	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	283,000,000	289,418,440	

券 政府保証債第 6 0 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 2 回	100,000,000	102,294,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 7 回	341,000,000	349,770,520	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 9 回	100,000,000	102,700,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 7 1 回	100,000,000	102,475,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 2 回	200,000,000	243,512,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 7 回	200,000,000	243,726,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 8 回	300,000,000	311,289,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 9 回	200,000,000	246,198,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 0 0 回	400,000,000	416,628,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 0 6 回	200,000,000	244,222,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 1 4 回	200,000,000	239,486,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 2 3 回	100,000,000	126,499,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 3 7 回	440,000,000	462,928,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 4 9 回	140,000,000	146,704,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 5 5 回	100,000,000	104,480,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 5 7 回	140,000,000	146,372,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 5 回	100,000,000	121,182,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 8 回	100,000,000	104,610,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 9 回	100,000,000	116,646,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 0 回	218,000,000	227,772,940	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 1 回	100,000,000	115,590,000	

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	369,732,000	
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	209,300,000	
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	209,130,000	
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	208,740,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	900,000,000	945,333,000	
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	118,083,000	
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	202,683,600	
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	415,288,000	
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	211,210,000	
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	286,663,520	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	314,022,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	143,107,460	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	151,382,900	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	100,000,000	114,103,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	118,936,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	100,000,000	114,004,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	100,000,000	104,401,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	118,842,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	197,176,300	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	103,129,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	300,000,000	326,382,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	151,000,000	149,787,470	

券 政府保証債第 2 7 1 回			
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	136,581,000	
公営企業債券 政府保証第 8 8 6 回	203,000,000	207,504,570	
公営企業債券 3 0 年第 4 回財投機 関債	100,000,000	136,945,000	
公営企業債券 政府保証 1 5 年第 1 回	300,000,000	315,744,000	
政保 地方公営企業等金融機構債 券 第 2 回	400,000,000	410,580,000	
地方公営企業等金融機構債券 第 1 回	200,000,000	205,204,000	
地方公営企業等金融機構債券(2 0 年) 第 1 回	100,000,000	119,636,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 回	100,000,000	103,663,000	
地方公共団体金融機構債券 第 2 回	100,000,000	103,227,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保 証第 5 回	200,000,000	206,252,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0 年 第 4 回	100,000,000	121,143,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0 年 第 6 回	300,000,000	368,901,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 回	100,000,000	109,695,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 3 回	200,000,000	208,142,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保 証第 1 6 回	100,000,000	103,547,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 6 回	100,000,000	103,997,000	
地方公共団体金融機構債券 第 2 7 回	300,000,000	313,119,000	
地方公共団体金融機構債券 第 2 8 回	100,000,000	104,522,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 4 回	100,000,000	109,171,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 6 回	100,000,000	108,132,000	
地方公共団体金融機構債券 第 3 7 回	400,000,000	416,344,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 8 回	194,000,000	202,879,380	

政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	104,447,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	105,663,170	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	106,626,720	
地方公共団体金融機構債券 第41 回	600,000,000	624,372,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 2回	100,000,000	106,683,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 4回	200,000,000	203,876,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 5回	200,000,000	214,398,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第42回	108,000,000	113,050,080	
地方公共団体金融機構債券 第42 回	100,000,000	104,124,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回	202,000,000	210,770,840	
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回	145,000,000	152,261,600	
地方公共団体金融機構債券 第44 回	100,000,000	104,319,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	223,000,000	234,085,330	
地方公共団体金融機構債券 F16 0回	100,000,000	107,875,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回	13,000,000	13,724,100	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	105,790,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第10回	300,000,000	302,847,000	
地方公共団体金融機構債券 第51 回	600,000,000	629,718,000	
地方公共団体金融機構債券 第52 回	300,000,000	315,624,000	
地方公共団体金融機構債券(15 年) 第2回	200,000,000	218,536,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	121,287,280	
政保 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,163,000	

(6年) 第14回			
地方公共団体金融機構債券(20年) 第38回	100,000,000	113,371,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	103,669,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	103,295,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第39回	100,000,000	112,336,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	414,548,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	320,000,000	328,630,400	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	195,571,530	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	521,246,540	
地方公共団体金融機構債券 第79回	100,000,000	102,615,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	115,063,880	
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債	100,000,000	107,868,000	
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債	200,000,000	226,370,000	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	100,000,000	123,814,000	
首都高速道路社債 第12回	100,000,000	100,460,000	
首都高速道路社債 第13回	100,000,000	100,489,000	
首都高速道路 第17回	200,000,000	199,830,000	
首都高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	103,723,000	
阪神高速道路 第13回	100,000,000	100,383,000	
阪神高速道路 第15回	200,000,000	199,890,000	
阪神高速道路債券 政府保証第5回	100,000,000	103,930,000	
日本政策金融公庫債券 政府保証第22回	2,000,000,000	2,008,300,000	
都市再生債券 財投機関債第21回	300,000,000	307,512,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	104,608,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,587,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	117,148,000	

民間都市開発推進機構 政府保証第 16回	360,000,000	376,495,200	
東京交通債券 第342回	200,000,000	223,796,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	177,420,990	
関西国際空港社債 財投機関債第2 6回	300,000,000	311,706,000	
関西国際空港社債 財投機関債第3 2回	100,000,000	104,915,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機 関債	100,000,000	104,475,000	
中部国際空港債券 政府保証第18 回	368,000,000	383,260,960	
預金保険機構債券 政府保証第20 9回	2,000,000,000	2,009,240,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第3回	200,000,000	240,034,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	113,443,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第25回	300,000,000	308,553,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第41回	100,000,000	104,042,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	114,140,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	119,710,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第73回	100,000,000	105,163,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	121,577,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	342,591,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	121,471,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	104,585,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	208,966,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	226,492,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	128,324,000	

成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	208,214,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,570,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	104,961,000	
農林債券 利付第756回い号	100,000,000	100,314,000	
農林債券 利付第759回い号	100,000,000	100,526,000	
農林債券 利付第760回い号	100,000,000	100,558,000	
農林債券 利付第761回い号	100,000,000	100,434,000	
農林債券 利付第764回い号	100,000,000	100,600,000	
農林債券 利付第765回い号	300,000,000	301,605,000	
農林債券 利付第767回い号	300,000,000	301,707,000	
農林債券 利付第773回い号	300,000,000	301,656,000	
農林債券 利付第777回い号	300,000,000	301,962,000	
農林債券 利付第781回い号	100,000,000	100,743,000	
しんきん中金債券 利付第284回	100,000,000	100,495,000	
しんきん中金債券 利付第286回	100,000,000	100,484,000	
しんきん中金債券 利付第287回	100,000,000	100,434,000	
しんきん中金債券 利付第290回	100,000,000	100,509,000	
しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	100,494,000	
しんきん中金債券 利付第308回	100,000,000	100,663,000	
しんきん中金債券 利付第316回	100,000,000	100,079,000	
しんきん中金債券 利付第317回	300,000,000	299,937,000	
商工債券 利付(3年)第202回	1,100,000,000	1,099,560,000	
商工債券 利付(3年)第203回	1,100,000,000	1,099,846,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	100,000,000	121,742,000	
東日本高速道路 第21回	100,000,000	100,684,000	
東日本高速道路 第26回	100,000,000	100,621,000	
東日本高速道路 第27回	100,000,000	100,495,000	
東日本高速道路 第34回	100,000,000	100,692,000	
東日本高速道路 第36回	200,000,000	200,082,000	
中日本高速道路社債 第32回	200,000,000	201,824,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	101,263,000	
中日本高速道路社債 第61回	100,000,000	100,735,000	
中日本高速道路 第62回	200,000,000	201,350,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	102,968,000	
中日本高速道路 第66回	1,200,000,000	1,198,356,000	

西日本高速道路 第20回	200,000,000	208,210,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	103,229,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	297,984,000	
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	207,938,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回	200,000,000	206,788,000	
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	112,664,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第97回	100,000,000	99,972,000	
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	13,440,000	13,866,988	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	45,801,000	47,296,860	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	81,945,000	85,198,216	
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	83,868,000	85,875,799	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	52,158,000	54,570,829	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	61,452,000	65,578,501	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	18,325,000	19,512,093	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	41,154,000	43,164,784	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	46,364,000	49,150,012	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	50,061,000	51,952,304	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	90,628,000	94,615,632	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	87,980,000	92,610,387	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	79,412,000	84,809,633	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	138,810,000	147,180,243	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	22,659,000	24,066,577	
貸付債権担保第25回住宅金融支援	33,458,000	36,382,229	

機構債券			
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	113,058,000	121,397,158	
貸付債権担保5種第16回住宅金融支援機構債券	28,543,000	29,657,033	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	120,064,000	126,219,681	
貸付債権担保5種第17回住宅金融支援機構債券	58,202,000	60,618,547	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	152,103,000	162,167,655	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	110,322,000	116,448,180	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	62,494,000	67,855,360	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	146,406,000	156,812,538	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	154,830,000	161,871,668	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	198,186,000	206,834,837	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	195,882,000	205,480,218	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	127,690,000	133,572,678	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	52,507,000	55,691,024	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	117,432,000	124,443,864	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	66,396,000	68,943,614	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	140,256,000	145,709,153	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	67,085,000	69,663,076	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	35,320,000	36,907,987	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	195,447,000	204,674,052	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	41,515,000	44,377,459	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	43,358,000	46,311,113	

貸付債権担保第3 5 回住宅金融支援機構債券	44,361,000	47,283,502	
貸付債権担保第4 6 回住宅金融支援機構債券	51,092,000	54,607,640	
貸付債権担保第5 5 回住宅金融支援機構債券	128,068,000	134,815,902	
貸付債権担保第5 6 回住宅金融支援機構債券	186,213,000	196,074,840	
貸付債権担保第5 7 回住宅金融支援機構債券	62,083,000	65,421,823	
貸付債権担保第7 6 回住宅金融支援機構債券	125,380,000	131,084,790	
貸付債権担保S種第3 回住宅金融公庫債券	17,102,000	17,911,950	
貸付債権担保S種第1 4 回住宅金融支援機構債券	129,935,000	134,693,219	
貸付債権担保S種第1 5 回住宅金融支援機構債券	52,774,000	54,646,421	
貸付債権担保第1 回住宅金融公庫債券	22,828,000	23,165,854	
貸付債権担保第7 回住宅金融公庫債券	48,280,000	49,234,012	
貸付債権担保第2 3 回住宅金融支援機構債券	121,552,000	131,567,884	
貸付債権担保第3 2 回住宅金融支援機構債券	119,910,000	127,903,200	
貸付債権担保第3 9 回住宅金融支援機構債券	246,815,000	259,706,147	
貸付債権担保第5 8 回住宅金融支援機構債券	128,676,000	135,407,041	
貸付債権担保第6 4 回住宅金融支援機構債券	208,998,000	217,614,987	
貸付債権担保第7 1 回住宅金融支援機構債券	192,726,000	199,997,551	
貸付債権担保第7 3 回住宅金融支援機構債券	143,350,000	150,768,362	
貸付債権担保第7 5 回住宅金融支援機構債券	124,938,000	130,973,754	
貸付債権担保第8 3 回住宅金融支援機構債券	294,264,000	305,172,366	
貸付債権担保第8 4 回住宅金融支援機構債券	513,716,000	532,040,249	
貸付債権担保第8 8 回住宅金融支援	75,543,000	77,884,833	

		機構債券			
		貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	77,932,000	80,445,307	
		貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	78,578,000	80,736,537	
		貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	162,396,000	165,872,898	
		貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	166,394,000	168,387,400	
		貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	86,007,000	88,191,577	
		貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	88,806,000	90,718,881	
		貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	263,673,000	270,947,738	
		貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	268,254,000	276,867,635	
		貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	179,340,000	184,833,184	
		貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	89,604,000	92,082,446	
		貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	90,080,000	92,888,694	
		貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	297,159,000	296,329,926	
		貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	198,766,000	199,398,075	
		貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	199,550,000	199,761,523	
		貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,279,000	
		貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,328,000	
	小計	銘柄数：292 組入時価比率：8.4%	55,049,754,000	57,868,662,170 8.5%	
	合計			57,868,662,170	
社債券	日本円	クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	101,258,000	
		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	199,802,000	
		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	196,052,000	

スタンダード・チャータード 第2 回円貨社債(2015)	100,000,000	99,778,000	
スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債(2015)	100,000,000	96,957,000	
エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	100,105,000	
エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	101,497,000	
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	107,060,000	
ルノー 第17回円貨社債(201 5)	300,000,000	302,574,000	
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	99,927,000	
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	200,398,000	
オーストラリア・ニューゼーランド 銀行 第10回円貨社債	200,000,000	199,524,000	
ラボバンク・ネーデルランド 第23 回円貨社債(2013)	100,000,000	100,365,000	
ラボバンク・ネーデルランド 第25 回円貨社債(2014)	100,000,000	100,165,000	
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨 社債(2014)	200,000,000	200,718,000	
清水建設 第18回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,685,000	
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	101,116,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	104,186,000	
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	100,417,000	
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	100,770,000	
麒麟ホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,086,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	200,000,000	199,930,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,840,000	
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	102,938,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回	200,000,000	196,010,000	

特定投資法人債間限定同順位特			
森ビル 第13回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,925,000	
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	103,042,000	
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	102,336,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,184,000	
住友化学 第43回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	104,395,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,490,000	
エア・ウォーター 第2回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,242,000	
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	202,728,000	
宇部興産 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,436,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,601,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,002,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	104,269,000	
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	103,306,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,879,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	200,746,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,982,000	
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	100,547,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	104,422,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,587,000	
神戸製鋼所 第63回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,158,000	
ジェイ エフ イー ホールディン グス 第22回(JFE保証)	100,000,000	102,028,000	

住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,230,000	
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,392,000	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,421,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	218,526,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,191,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,913,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,796,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,817,000	
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,524,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,919,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,700,000	
ソニー 第26回	100,000,000	104,259,000	
ソニー 第32回	200,000,000	199,618,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,264,000	
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	301,272,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	104,935,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,119,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,730,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,157,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,445,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,362,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,616,000	

豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,687,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,364,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,899,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,954,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,553,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,621,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,710,000	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,185,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,326,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,143,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,978,000	
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,331,000	
あおぞら銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,988,000	
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	103,088,000	
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	205,264,000	
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	122,707,000	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	105,088,000	
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	107,757,000	
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	111,726,000	
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	103,483,000	
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	307,125,000	
三井住友フィナンシャルグループ	100,000,000	102,625,000	

第3回劣後特約付			
三井住友フィナンシャルグループ	100,000,000	106,359,000	
第4回劣後特約付			
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,739,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	316,359,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	105,916,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	317,130,000	
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	100,519,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,910,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,416,000	
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	205,854,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	105,763,000	
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,495,000	
みずほ銀行 第38回特定社債間限定同順位特約付	1,000,000,000	1,005,710,000	
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,463,000	
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,381,000	
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	100,371,000	
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	100,358,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,289,000	
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	200,200,000	
日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,029,000	
日立キャピタル 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,117,000	
日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,519,000	
オリックス 第164回社債間限定	100,000,000	102,339,000	

同順位特約付			
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	100,525,000	
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	100,322,000	
三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,937,000	
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	100,599,000	
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	100,676,000	
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	102,437,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	105,154,000	
野村ホールディングス 第41回	200,000,000	201,722,000	
日本取引所グループ 第1回社債間限定同順位特約付 特定投資家	100,000,000	100,190,000	
三井不動産 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,009,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	111,347,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,336,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,157,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,755,000	
東京建物 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,896,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,764,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,570,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,110,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,306,000	
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	102,824,000	
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	104,214,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投	100,000,000	101,721,000	

資法人 第 5 回特定投資法人債			
東武鉄道 第 1 0 2 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,656,000	
東京急行電鉄 第 7 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,137,000	
東京急行電鉄 第 8 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,741,000	
小田急電鉄 第 6 8 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	213,246,000	
東日本旅客鉄道 第 1 5 回	100,000,000	108,833,000	
東日本旅客鉄道 第 1 9 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	222,182,000	
東日本旅客鉄道 第 5 8 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,208,000	
東日本旅客鉄道 第 7 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	119,347,000	
東日本旅客鉄道 第 1 0 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,742,000	
西日本旅客鉄道 第 1 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,869,000	
西日本旅客鉄道 第 3 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,238,000	
東海旅客鉄道 第 1 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,574,000	
東海旅客鉄道 第 5 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	245,888,000	
東海旅客鉄道 第 7 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,239,000	
東海旅客鉄道 第 7 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,218,000	
西武ホールディングス 第 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,290,000	
名古屋鉄道 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,349,000	
日本通運 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,490,000	
日本通運 第 1 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,988,000	
日本梱包運輸倉庫 第 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,449,000	
横浜高速鉄道 第 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,730,000	
A N A ホールディングス 第 3 2 回	100,000,000	96,708,000	

社債間限定同順位特約付			
三菱倉庫 第14回	100,000,000	101,083,000	
住友倉庫 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,784,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	104,424,000	
KDDI 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,092,000	
NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,373,000	
東京電力 第455回	200,000,000	205,642,000	
東京電力 第459回	100,000,000	104,422,000	
東京電力 第544回	100,000,000	102,113,000	
東京電力 第547回	100,000,000	105,289,000	
東京電力 第548回	100,000,000	114,063,000	
東京電力 第559回	100,000,000	102,745,000	
東京電力 第560回	100,000,000	111,845,000	
東京電力 第565回	300,000,000	309,384,000	
中部電力 第482回	200,000,000	209,258,000	
中部電力 第500回	200,000,000	208,486,000	
関西電力 第448回	200,000,000	205,028,000	
関西電力 第469回	100,000,000	102,493,000	
関西電力 第482回	100,000,000	103,325,000	
関西電力 第484回	100,000,000	102,801,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,853,000	
関西電力 第497回	200,000,000	209,350,000	
関西電力 第498回	200,000,000	201,592,000	
中国電力 第330回	100,000,000	107,659,000	
中国電力 第377回	200,000,000	211,108,000	
中国電力 第378回	100,000,000	104,908,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	105,568,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	104,811,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	106,117,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	103,434,000	
東北電力 第473回	100,000,000	101,641,000	
東北電力 第475回	100,000,000	103,462,000	
東北電力 第481回	200,000,000	206,998,000	
四国電力 第281回	200,000,000	211,330,000	

	九州電力 第400回	100,000,000	104,885,000	
	九州電力 第409回	100,000,000	103,208,000	
	九州電力 第424回	200,000,000	211,962,000	
	北海道電力 第296回	100,000,000	102,403,000	
	北海道電力 第316回	207,000,000	213,619,860	
	北海道電力 第323回	100,000,000	108,864,000	
	北海道電力 第338回	100,000,000	97,770,000	
	電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,504,000	
	電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,668,000	
	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,439,000	
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,253,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,462,000	
	東京電力パワーグリッド 第1回	100,000,000	99,944,000	
	東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	99,918,000	
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,136,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,997,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,306,000	
	東京都競馬 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,212,000	
	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	101,116,000	
小計	銘柄数：208 組入時価比率：4.1%	27,107,000,000	27,962,347,860 4.1%	
合計			27,962,347,860	
合計			684,686,981,163	

(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29年 3月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	891,606,951
コール・ローン	646,696,107
国債証券	645,342,275,110
派生商品評価勘定	3,274,344
未収利息	6,163,034,887
前払費用	245,610,748
流動資産合計	653,292,498,147
資産合計	653,292,498,147
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	242,190
未払金	1,188,653,435
未払解約金	97,223,773
未払利息	1,037
その他未払費用	5,330,700
流動負債合計	1,291,451,135
負債合計	1,291,451,135
純資産の部	
元本等	
元本	303,724,840,423
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	348,276,206,589
元本等合計	652,001,047,012
純資産合計	652,001,047,012
負債純資産合計	653,292,498,147

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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29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	2,1467円
(10,000口当たり純資産額)	(21,467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28年 4月 1日 至 平成29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、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成29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29年 3月31日現在	
期首	平成28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	288,024,418,427円
同期中における追加設定元本額	43,758,627,938円
同期中における一部解約元本額	28,058,205,942円
期末元本額	303,724,840,423円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	90,861,568円
バランスセレクト50	94,152,878円
バランスセレクト70	74,989,395円
野村外国債券インデックスファンド	290,534,535円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,896,184,471円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	28,477,688,959円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,563,818,392円
野村資産設計ファンド2015	40,449,969円
野村資産設計ファンド2020	48,351,509円
野村資産設計ファンド2025	50,675,123円
野村資産設計ファンド2030	41,054,614円
野村資産設計ファンド2035	28,523,026円
野村資産設計ファンド2040	73,742,601円
野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け）	188,010,046,391円
のむらップ・ファンド（保守型）	4,875,799,503円
のむらップ・ファンド（普通型）	6,898,726,526円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,633,992,404円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	1,754,115,878円
野村資産設計ファンド2045	6,178,329円
野村インデックスファンド・外国債券	664,357,969円
マイ・ロード	8,298,939,971円
ネクストコア	672,523,586円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	90,823,876円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	2,484,094,122円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	678,757,777円
野村資産設計ファンド2050	5,561,395円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	3,751,599円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	866,628円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	729,747円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	790,290円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	279,852,281円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	64,850,176円
インデックス・ブレンド(タイプ)	16,921円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,936円
インデックス・ブレンド(タイプ)	23,393円
インデックス・ブレンド(タイプ)	24,340円
インデックス・ブレンド(タイプ)	21,074円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	22,576,134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)	18,277,571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)	2,277,189,680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)	652,939,705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)	6,174,595,203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)	1,750,770,968円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	3,044,427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)	24,091,271円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	2,181,849円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,204,666,890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)	511,116,540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)	1,876,423,247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)	200,812,643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)	195,354,864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)	238,829,938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)	2,182,332,453円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,079,647,437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)	1,966,320,379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)	429,458,272円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,636,255円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,375,481円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,668,292円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	530,449,494円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,134,847,387円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	2,900,464,411円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,576,407,701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)	12,741,199,457円
マイバランスDC30	1,232,194,280円
マイバランスDC50	755,199,854円
マイバランスDC70	453,222,108円
野村DC外国債券インデックスファンド	3,196,915,443円
野村DC運用戦略ファンド	1,128,432,310円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	22,900,597円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	27,260,651円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	888,377円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,267,702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29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29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	19,300,000.00	22,343,519.29	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	15,657,710.62	
		US TREASURY BOND	21,100,000.00	26,770,625.00	
		US TREASURY BOND	13,800,000.00	17,184,233.34	
		US TREASURY BOND	51,200,000.00	51,511,997.44	
		US TREASURY BOND	43,200,000.00	55,775,247.84	
		US TREASURY BOND	18,800,000.00	25,419,654.84	
		US TREASURY BOND	23,700,000.00	31,846,875.00	
		US TREASURY BOND	12,000,000.00	15,558,750.00	
		US TREASURY BOND	5,000,000.00	6,380,468.50	
		US TREASURY BOND	800,000.00	1,024,312.48	
		US TREASURY BOND	100,000.00	124,625.00	
		US TREASURY BOND	25,300,000.00	24,610,177.79	
		US TREASURY BOND	16,000,000.00	18,191,249.60	
		US TREASURY N/B	200,000.00	203,085.92	
		US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,686,597.48	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,997,187.20	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,993,359.20	
		US TREASURY N/B	14,000,000.00	13,949,686.80	
		US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,637,792.65	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,193,812.44	
		US TREASURY N/B	15,200,000.00	15,675,592.80	
		US TREASURY N/B	600,000.00	599,179.68	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,750,718.22			
US TREASURY N/B	15,500,000.00	15,473,964.65			

US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,396,655.18	
US TREASURY N/B	31,200,000.00	31,676,530.08	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,523,241.55	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,562.50	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,928,218.64	
US TREASURY N/B	18,400,000.00	18,456,061.12	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,605,276.68	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,989,187.20	
US TREASURY N/B	19,600,000.00	19,556,358.64	
US TREASURY N/B	28,800,000.00	28,931,624.64	
US TREASURY N/B	800,000.00	797,906.24	
US TREASURY N/B	27,400,000.00	27,479,202.44	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,935,546.00	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,388,468.72	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,984,690.54	
US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,415,046.34	
US TREASURY N/B	700,000.00	694,886.71	
US TREASURY N/B	35,700,000.00	37,164,256.92	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,701,128.80	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,269.50	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,001,875.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	700,300.72	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,514,726.40	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,524,492.05	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,088,843.75	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,499,413.50	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,516,269.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	997,656.20	
US TREASURY N/B	37,500,000.00	38,544,431.25	
US TREASURY N/B	900,000.00	891,597.60	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,513,202.80	
US TREASURY N/B	16,200,000.00	16,270,875.00	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,742,202.72	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,016,874.80	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	25,669,335.30	

US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,974,570.20	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,994,335.50	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,636,750.00	
US TREASURY N/B	27,600,000.00	28,643,625.00	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,394,093.68	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,640,991.26	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,389,445.26	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,949,375.00	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,584,959.85	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	27,478,406.25	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,971,757.70	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,848,468.64	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,969,296.80	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,849,343.75	
US TREASURY N/B	49,300,000.00	51,770,773.03	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,697,561.84	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,801,546.74	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,886,093.60	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,814,546.78	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,992,734.20	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,361,609.24	
US TREASURY N/B	51,800,000.00	54,901,929.04	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,679,011.55	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,950,624.80	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	21,190,170.81	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,180,749.76	
US TREASURY N/B	47,700,000.00	50,483,738.61	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,478,163.90	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,738,116.98	
US TREASURY N/B	13,200,000.00	13,200,000.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,165,155.20	
US TREASURY N/B	42,500,000.00	43,844,725.50	
US TREASURY N/B	37,600,000.00	38,164,000.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,060,468.60	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,602,124.96	

US TREASURY N/B	52,600,000.00	54,270,460.28	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,953,000.00	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,367,491.79	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,893,905.90	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	48,988,105.94	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,039,062.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,745,312.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,829,812.50	
US TREASURY N/B	12,900,000.00	13,112,647.47	
US TREASURY N/B	38,400,000.00	40,354,498.56	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,642,382.25	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,371,875.00	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,847,772.71	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,089,984.04	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,331,937.50	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,150,000.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,033,593.00	
US TREASURY N/B	26,000,000.00	26,089,375.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,981,562.40	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,501,718.44	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,895,703.00	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	33,801,362.86	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,225,859.01	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,792,491.94	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	29,650,779.00	
US TREASURY N/B	23,900,000.00	23,608,718.75	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	27,151,875.00	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,091,697.60	
US TREASURY N/B	12,800,000.00	12,484,000.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,013,202.80	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	21,554,843.20	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,883,125.00	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	24,121,092.50	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,604,687.50	
US TREASURY N/B	42,200,000.00	41,220,824.96	

US TREASURY N/B	30,400,000.00	29,461,874.24	
US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,768,295.42	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	17,370,936.24	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,691,936.16	
US TREASURY N/B	29,100,000.00	29,568,326.67	
US TREASURY N/B	23,100,000.00	22,998,937.50	
US TREASURY N/B	24,700,000.00	24,105,656.25	
US TREASURY N/B	26,500,000.00	26,052,812.50	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,552,499.20	
US TREASURY N/B	36,300,000.00	35,925,656.25	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,190,687.50	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,799,234.27	
US TREASURY N/B	100,000.00	126,648.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,921.87	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,707,781.18	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,658,304.47	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	8,926,312.32	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,262,500.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,920,000.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,238,749.60	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	9,512,952.54	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,156,875.00	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,707,343.40	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,644,218.75	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,272,000.00	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,494,023.10	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	8,861,156.25	
US TREASURY N/B	16,100,000.00	15,311,351.16	
US TREASURY N/B	25,200,000.00	25,676,436.24	
US TREASURY N/B	15,400,000.00	17,131,295.72	
US TREASURY N/B	23,200,000.00	25,820,873.84	
US TREASURY N/B	18,900,000.00	20,147,694.84	
US TREASURY N/B	30,600,000.00	31,157,014.86	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	36,692,437.50	
US TREASURY N/B	26,000,000.00	23,324,841.80	

小計	US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,550,812.50	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,937,656.20	
	US TREASURY N/B	15,100,000.00	14,990,287.93	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,028,554.35	
	US TREASURY NOTE	19,800,000.00	20,149,592.76	
	銘柄数：170	2,482,400,000.00	2,569,163,151.95 (288,234,414,017)	
	組入時価比率：44.2%		44.6%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	4,600,000.00	4,966,666.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,513,875.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,300,000.00	6,560,505.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,992,710.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	9,575,050.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	9,966,600.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,688,090.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	7,128,197.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,900,013.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,074,080.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,433,906.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,783,396.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,122,100.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	11,450,565.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,719,360.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,653,590.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,117,753.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	8,974,385.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	5,855,879.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	932,420.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,680,000.00	8,035,439.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	5,073,786.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	7,190,750.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	8,330,624.00	
CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	11,734,780.00		
CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,974,780.00		
CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	566,805.00		

小計	銘柄数：27 組入時価比率：2.1%	147,780,000.00	164,316,104.20 (13,810,768,558) 2.1%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	70,000,000.00	68,607,700.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	116,900,000.00	120,248,016.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,000,000.00	46,001,760.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	70,700,000.00	73,018,253.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	124,300,000.00	122,823,316.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,400,000.00	47,611,564.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,700,000.00	36,139,733.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,000,000.00	7,324,080.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	83,100,000.00	85,452,561.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,100,000.00	52,037,022.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,500,000.00	46,331,620.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,363,200.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	58,092,940.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	34,009,025.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	66,563,202.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	87,577,450.00
	小計	銘柄数：16 組入時価比率：0.9%	925,400,000.00
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	6,543,539.20
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,374,350.00
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	8,034,089.00
	BELGIUM KINGDOM	7,200,000.00	8,680,680.00
	BELGIUM KINGDOM	4,800,000.00	5,809,065.60
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	7,928,320.00
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,686,280.00
	BELGIUM KINGDOM	10,000,000.00	11,630,000.00
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,307,483.60
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,029,993.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	973,409.00
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,856,071.50
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	9,791,392.00
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	8,388,586.40

BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	944,757.00	
BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,295,694.40	
BELGIUM KINGDOM GOVT	1,600,000.00	1,672,480.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,676,216.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,600,000.00	17,360,455.60	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	17,537,267.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,017,700.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,800,000.00	18,827,665.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	7,556,799.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,700,000.00	2,720,927.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,300,000.00	14,119,679.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,900,000.00	9,884,544.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	9,801,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	27,500,000.00	30,909,835.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,600,000.00	12,422,532.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,900,000.00	9,628,496.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,900,000.00	2,966,186.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	11,606,959.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,000,000.00	21,570,637.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	7,346,316.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,900,000.00	17,429,210.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,700,000.00	7,960,270.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	921,960.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000,000.00	17,631,880.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,247,242.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,429,020.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,800,000.00	6,462,720.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	7,528,896.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,400,000.00	8,750,470.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	11,296,903.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,066,785.00	
BUNDESobligation	2,400,000.00	2,461,296.00	
BUNDESobligation	10,000,000.00	10,250,000.00	
BUNDESobligation	3,000,000.00	3,060,450.00	
BUNDESobligation	3,000,000.00	3,091,200.00	

BUNDESobligation	1,600,000.00	1,635,136.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,700,000.00	19,411,590.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,700,000.00	7,440,685.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,591,590.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,627,340.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,862,617.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,136,450.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	9,432,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,500,000.00	15,095,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,500,000.00	8,344,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,504,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,745,688.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,760,248.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,000,000.00	15,997,660.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,100,000.00	20,238,717.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,443,736.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,671,555.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	6,795,369.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,300,000.00	9,658,608.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,059,960.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	31,511,808.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,335,760.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,025,642.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	11,140,545.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,776,482.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	10,434,236.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	8,512,776.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	13,391,856.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	14,743,231.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	8,238,527.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,300,000.00	5,745,608.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,500,000.00	11,463,695.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,336,339.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,600,000.00	31,412,408.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,467,600.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	15,300,000.00	16,469,379.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,036,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	500,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,084,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	823,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,080,000.00	12,137,032.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,100,000.00	6,814,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	32,496,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	18,137,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,013,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,812,916.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,871,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,019,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,800,000.00	14,986,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	5,289,413.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,970,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	11,754,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,700,000.00	25,407,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	3,920,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	7,904,124.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,300,000.00	11,163,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,166,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	18,820,830.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,610,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	18,279,469.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,911,224.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,995,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	10,141,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	10,375,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,200,000.00	25,308,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	8,973,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,500,000.00	23,985,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	25,643,790.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,681,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	8,880,000.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	10,889,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	7,774,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,431,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,600,000.00	20,220,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,140,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	8,132,400.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,540,722.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,100,000.00	2,338,192.50	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,236,600.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,300,000.00	2,365,315.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,315,060.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,505,056.00	
FINNISH GOVERNMENT	4,200,000.00	4,588,630.20	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,131,040.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,042,349.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,009,772.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,314,327.50	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	692,475.70	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,129,452.80	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,242,176.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,300,000.00	10,537,322.30	
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	2,823,940.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,110,143.10	
FRANCE (GOVT OF)	4,000,000.00	3,944,840.00	
FRANCE (GOVT OF)	5,500,000.00	6,326,815.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,870,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,200,000.00	2,305,010.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	610,282.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	11,602,332.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,800,000.00	27,448,372.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,200,000.00	2,220,680.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	12,618,651.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	4,917,600.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	12,726,532.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	16,532,473.20	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,300,000.00	29,944,005.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,033,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	13,661,450.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	17,374,815.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	16,648,189.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	22,407,138.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	12,269,906.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	32,000,000.00	40,073,600.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,703,240.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	28,587,240.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	5,098,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	40,858,640.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,421,120.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000.00	36,539,300.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,019,700.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000.00	31,612,526.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	9,966,316.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	16,742,996.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,900,000.00	24,303,150.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,200,000.00	16,906,480.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	7,048,411.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,800,000.00	5,794,848.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	3,600,000.00	3,982,896.00	
IRISH GOVERNMENT	5,600,000.00	6,029,408.00	
IRISH GOVERNMENT	3,400,000.00	3,946,975.00	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,067,811.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,151,000.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,768,085.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	1,000,000.00	979,640.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	2,600,000.00	2,915,198.00	
IRISH TSY 2% 2045	2,500,000.00	2,485,797.50	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,600,000.00	7,925,280.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,470,000.00	7,928,172.45	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,800,000.00	7,039,067.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	7,861,120.00	

NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,049,844.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,583,870.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,900,000.00	9,156,629.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	405,256.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,699,300.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,247,560.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,220,810.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,560,318.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,358,950.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,025,200.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,033,486.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	11,096,233.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	5,490,751.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	7,772,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,200,000.00	9,824,030.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	6,261,727.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,366,010.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,743,750.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,643,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,400,000.00	2,453,280.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,600,000.00	6,414,800.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,159,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	3,948,450.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	6,007,500.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,999,400.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,900,000.00	4,348,574.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,328,500.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,394,250.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,533,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	6,100,000.00	9,620,163.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,220,300.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,200,000.00	7,987,985.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,800,000.00	8,173,342.60	
REPUBLIC OF IRELAND	3,400,000.00	4,138,174.00	
SPANISH GOVERNMENT	18,500,000.00	26,735,774.50	

小計	SPANISH GOVERNMENT	8,500,000.00	12,517,100.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	6,612,361.60	
	銘柄数：226	1,721,750,000.00	2,114,724,062.95	
	組入時価比率：38.9%		(253,322,795,500)	39.2%
英ポンド	UK TREASURY	100,000.00	104,590.00	
	UK TREASURY	8,550,000.00	8,679,960.00	
	UK TREASURY	8,600,000.00	9,335,300.00	
	UK TREASURY	19,600,000.00	20,346,760.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	3,157,230.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,610,960.00	
	UK TREASURY	16,090,000.00	17,032,874.00	
	UK TREASURY	7,000,000.00	7,855,400.00	
	UK TREASURY	2,200,000.00	2,299,660.00	
	UK TREASURY	9,340,000.00	12,354,952.00	
	UK TREASURY	8,900,000.00	10,242,120.00	
	UK TREASURY	4,850,000.00	5,706,025.00	
	UK TREASURY	8,700,000.00	9,278,550.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,616,630.00	
	UK TREASURY	11,200,000.00	12,789,280.00	
	UK TREASURY	12,450,000.00	16,443,960.00	
	UK TREASURY	9,530,000.00	12,530,997.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,165,170.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,116,230.00	
	UK TREASURY	5,750,000.00	7,914,300.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,525,780.00	
	UK TREASURY	4,900,000.00	6,978,580.00	
	UK TREASURY	4,400,000.00	6,836,720.00	
	UK TREASURY	4,200,000.00	6,165,180.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,474,190.00	
	UK TREASURY	6,100,000.00	9,578,830.00	
	UK TREASURY	20,000,000.00	27,618,000.00	
	UK TREASURY	5,950,000.00	9,409,925.00	
UK TREASURY	5,350,000.00	8,787,910.00		
UK TREASURY	8,750,000.00	13,661,375.00		

小計	UK TREASURY	2,800,000.00	3,670,520.00	
	UK TREASURY	5,800,000.00	9,715,580.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	21,050,000.00	27,670,225.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,500,000.00	11,436,100.00	
	銘柄数：34	262,310,000.00	340,109,863.00	(47,642,589,609)
	組入時価比率：7.3%			7.4%
スイスフラン 小計	SWITZERLAND GOVERNMENT	4,900,000.00	5,445,370.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,600,000.00	5,230,080.00	
	銘柄数：2	8,500,000.00	10,675,450.00	(1,196,397,681)
	組入時価比率：0.2%			0.2%
スウェーデンク ローナ 小計	SWEDISH GOVERNMENT	4,600,000.00	5,037,584.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	45,500,000.00	54,381,600.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	53,400,000.00	63,150,840.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	26,600,000.00	28,870,336.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	41,700,000.00	48,697,260.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	9,100,000.00	9,430,839.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,300,000.00	22,211,651.40	
	銘柄数：7	197,200,000.00	231,780,111.80	(2,908,840,403)
組入時価比率：0.4%			0.5%	
ノルウェークロ ネ 小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,300,000.00	29,550,885.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	30,755,232.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,983,540.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	49,973,700.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,828,075.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,699,530.00	
	銘柄数：6	123,500,000.00	134,790,962.00	(1,764,413,692)
組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーククロ ネ	KINGDOM OF DENMARK	4,500,000.00	4,563,225.00	
	KINGDOM OF DENMARK	30,800,000.00	34,501,544.00	
	KINGDOM OF DENMARK	41,100,000.00	47,223,900.00	
	KINGDOM OF DENMARK	30,100,000.00	33,031,740.00	
	KINGDOM OF DENMARK	31,400,000.00	35,237,080.00	

小計	KINGDOM OF DENMARK	48,300,000.00	81,690,756.00
	銘柄数：6	186,200,000.00	236,248,245.00 (3,803,596,744)
	組入時価比率：0.6%		0.6%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	2,300,000.00	2,352,964.40
	POLAND GOVERNMENT BOND	14,400,000.00	14,516,640.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,200,000.00	6,022,680.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	5,949,060.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	12,031,290.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,143,760.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	33,481,420.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	12,516,360.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	10,711,300.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,158,125.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	22,921,570.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,122,425.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,518,070.00
小計	銘柄数：13	142,000,000.00	149,445,664.40 (4,248,740,238)
	組入時価比率：0.7%		0.7%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,400,000.00	8,601,600.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,700,000.00	14,616,009.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,376,164.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,100,000.00	14,100,866.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	6,737,528.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	11,673,716.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,400,000.00	9,859,920.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,541,046.70
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	8,035,880.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	18,300,000.00	19,201,732.50
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,600,000.00	14,226,660.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,250,000.00	13,279,241.25
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	799,786.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	378,960.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,509,302.50
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,244,904.00

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,680,087.60
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,748,278.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,113,280.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	177,000.00
	銘柄数：20 組入時価比率：2.1%	147,550,000.00	159,901,963.75 (13,725,984,568) 2.1%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,665,760.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	6,450,000.00	6,624,117.75
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,000,000.00	4,243,600.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	3,059,566.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,498,000.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,153,000.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,455,250.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,686,611.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,557,104.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	569,500.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,900,000.00	3,107,350.00
	小計	銘柄数：11 組入時価比率：0.4%	30,830,000.00
リングギ	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,397,600.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,008,040.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	904,362.30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,399,330.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	12,102,847.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	9,931,020.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,412,252.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,072,000.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,769,600.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,477,736.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	10,081,812.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,795,191.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	589,234.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	8,863,588.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	5,613,108.00

	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,687,138.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,886,051.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,499,360.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,265,980.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,469,864.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	368,620.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,650,558.60	
小計	銘柄数：22	108,000,000.00	107,245,297.40	
			(2,719,740,742)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,600,000.00	23,823,267.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,300,000.00	25,139,838.35	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	25,309,290.06	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,200,000.00	24,886,199.52	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	70,000,000.00	79,145,423.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,000,000.00	25,180,559.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	25,374,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,400,000.00	43,367,750.72	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	47,100,000.00	34,650,047.58	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,500,000.00	25,426,500.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	4,648,712.16	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,600,000.00	18,041,777.76	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,100,000.00	30,169,698.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,100,000.00	43,307,105.26	
小計	銘柄数：14	455,800,000.00	428,470,169.91	
			(3,582,010,620)	
	組入時価比率：0.5%		0.6%	
合計			645,342,275,110	
			(645,342,275,110)	

(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

平成29年 3月31日現在

種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	521,705,846	-	524,738,000	3,032,154
米ドル	244,407,100	-	246,774,000	2,366,900
ユーロ	215,750,190	-	215,622,000	128,190
英ポンド	27,584,956	-	28,014,000	429,044
豪ドル	33,963,600	-	34,328,000	364,400
合計	521,705,846	-	524,738,000	3,032,154

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

マイバランスDC70

平成29年 4月28日現在

資産総額	9,986,032,974円
負債総額	4,061,955円
純資産総額（ - ）	9,981,971,019円
発行済口数	7,689,221,582口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2982円

（参考）国内株式マザーファンド

平成29年 4月28日現在

資産総額	368,456,015,175円
負債総額	42,336,724,184円
純資産総額（ - ）	326,119,290,991円
発行済口数	223,499,863,396口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4591円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成29年 4月28日現在

資産総額	367,846,629,661円
負債総額	1,211,669,875円
純資産総額（ - ）	366,634,959,786円
発行済口数	157,752,312,614口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3241円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

平成29年 4月28日現在

資産総額	696,178,015,188円
負債総額	4,674,346,129円
純資産総額（ - ）	691,503,669,059円
発行済口数	529,632,718,239口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3056円

（参考）外国債券マザーファンド

平成29年 4月28日現在

資産総額	656,233,247,697円
負債総額	953,665,187円
純資産総額（ - ）	655,279,582,510円
発行済口数	303,398,182,550口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1598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29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。

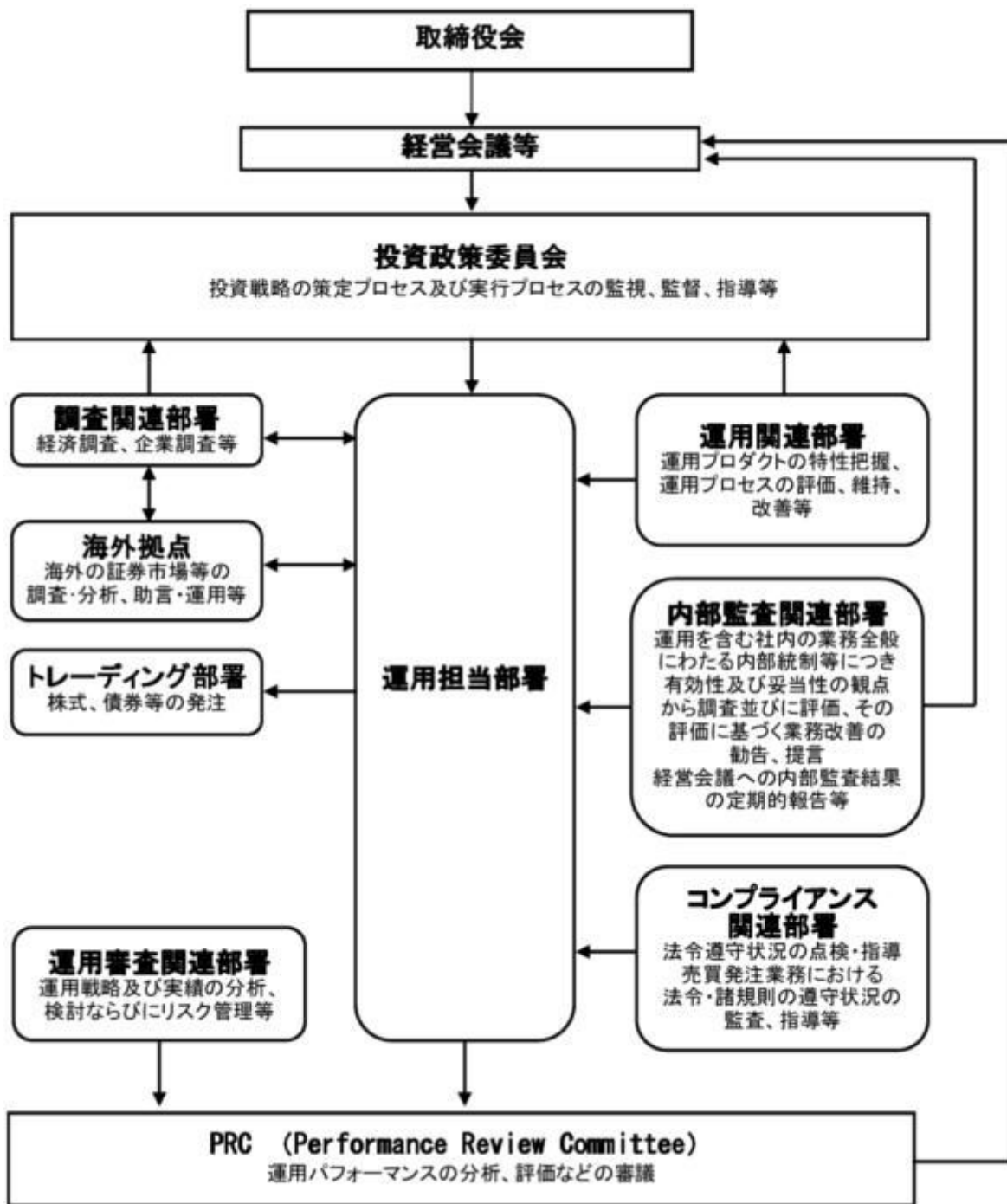
代表執行役・執行役

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29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	945	21,495,848
単位型株式投資信託	73	364,698
追加型公社債投資信託	15	5,572,106
単位型公社債投資信託	343	1,956,381
合計	1,376	29,389,033

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27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(平成28年4月1日から平成28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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		411	208
金銭の信託		56,824	55,341
有価証券		17,100	24,100
前払金		15	34
前払費用		29	2
未収入金		330	511
未収委託者報酬		12,679	14,131
未収運用受託報酬		7,436	7,309
繰延税金資産		2,594	2,028
その他		73	56
貸倒引当金		9	10
流動資産計		97,486	103,715
固定資産			

有形固定資産			1,322		1,176
建物	2	413		403	
器具備品	2	909		773	
無形固定資産			7,254		7,681
ソフトウェア		7,253		7,680	
その他		1		0	
投資その他の資産			24,840		23,225
投資有価証券		11,593		9,216	
関係会社株式		10,149		10,958	
従業員長期貸付金		30		-	
長期差入保証金		49		45	
長期前払費用		60		49	
前払年金費用		2,776		2,777	
その他		179		176	
貸倒引当金		0		-	
固定資産計			33,417		32,083
資産合計			130,903		135,799

区分	注記 番号	前事業年度 (平成27年 3月31日)		当事業年度 (平成28年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			118		118
未払金	1		11,602		11,855
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		32		31	
未払手数料		4,883		4,537	
その他未払金		6,684		7,284	
未払費用	1		10,221		8,872
未払法人税等			1,961		1,838
前受収益			-		45
賞与引当金			4,558		4,809
外国税支払損失引当金			1,721		-
流動負債計			30,182		27,538
固定負債					
退職給付引当金			2,467		2,708
時効後支払損引当金			521		526
繰延税金負債			747		68
固定負債計			3,735		3,303
負債合計			33,918		30,842
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			90,092		99,606
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			11,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		-		2,000	
利益剰余金			61,182		68,696
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		60,497		68,011	

別途積立金		24,606		24,606
繰越利益剰余金		35,890		43,405
評価・換算差額等			6,893	5,349
その他有価証券評価差額金			6,893	5,349
純資産合計			96,985	104,956
負債・純資産合計			130,903	135,799

(2)【損益計算書】

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

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)		当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,038		7,323	
受取利息		5		4	
金銭の信託運用益		347		-	
為替差益		-		281	
その他		366		382	
営業外収益計			4,756		7,991
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,196	
時効後支払損引当金繰入額		28		72	
その他		137		52	
営業外費用計			166		1,321
經常利益			27,146		36,196
特別利益					
投資有価証券等売却益		794		50	
株式報酬受入益		142		96	
特別利益計			936		146
特別損失					
投資有価証券売却損		-		95	
投資有価証券等評価損		91		-	
固定資産除却損	3	357		60	
外国税支払損失引当金繰入額		1,721		-	
特別損失計			2,169		156
税引前当期純利益			25,913		36,186
法人税、住民税及び事業税			8,433		9,806
法人税等調整額			2,488		744
当期純利益			19,967		25,635

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249

会計方針の変更による累積的影響額						81	81	81
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	25,966	51,258	80,168
当期変動額								
剰余金の配当						10,043	10,043	10,043
当期純利益						19,967	19,967	19,967
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	9,923	9,923	9,923
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本			
	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	その他 資本 剰余金	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	株主 資本 合計
当期首残高	17,180	11,729	-	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092
当期変動額									
剰余金の配当							19,933	19,933	19,933
当期純利益							25,635	25,635	25,635
合併による増加			2,000	2,000			144	144	2,144
吸収分割による増加							1,668	1,668	1,668
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	2,000	2,000	-	-	7,514	7,514	9,514
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

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

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
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、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="687 353 986 479"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(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	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p>								
6. 連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。</p>								

[注記事項]

貸借対照表関係

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

損益計算書関係

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。
受取配当金 3,966百万円	受取配当金 7,081百万円
2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損	3. 固定資産除却損
建物 円 - 百万	建物 1百万円
器具備品 15	器具備品 4
ソフトウェア 342	ソフトウェア 54
ア	ア
合計 357	合計 60

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	34,973百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	6,790円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

金融商品関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、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	27,398	27,398	-
その他有価証券	27,398	27,398	-
(5)関係会社株式	3,064	196,109	193,045
資産計	100,378	293,423	193,045
(6)未払金	11,602	11,602	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	32	32	-
未払手数料	4,883	4,883	-
その他未払金	6,684	6,684	-
(7)未払費用	10,221	10,221	-

(8)未払法人税等	1,961	1,961	-
負債計	23,784	23,784	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	411	-	-	-
金銭の信託	56,824	-	-	-

未収委託者報酬	12,679	-	-	-
有価証券	17,100	-	-	-
合計	87,015	-	-	-

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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28年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	208	208	-
(2)金銭の信託	55,341	55,341	-
(3)未収委託者報酬	14,131	14,131	-
(4)未収運用受託報酬	7,309	7,309	-

(5)有価証券及び投資有価証券	32,071	32,071	-
その他有価証券	32,071	32,071	-
(6)関係会社株式	3,064	180,880	177,816
資産計	112,127	289,944	177,816
(7)未払金	11,855	11,855	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	4,537	4,537	-
その他未払金	7,284	7,284	-
(8)未払費用	8,872	8,872	-
(9)未払法人税等	1,838	1,838	-
負債計	22,566	22,566	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,245百万円、関係会社株式7,894百万円）は、市場価

格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1. 売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

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

4. その他有価証券(平成27年3月31日)

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

小計	17,100	17,100	-
合計	27,398	17,382	10,015

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成28年3月31日)

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

4．その他有価証券(平成28年3月31日)

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

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

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

退職給付関係

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	15,775 百万円
年金資産	15,764
	11
非積立型制度の退職給付債務	2,917
未積立退職給付債務	2,928
未認識数理計算上の差異	3,409
未認識過去勤務費用	411
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69
退職給付引当金	2,708
前払年金費用	2,777
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	811 百万円
利息費用	181
期待運用収益	402
数理計算上の差異の費用処理額	314
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	863
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	43%
株式	43%
生保一般勘定	13%
その他	1%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%
3. 確定拠出制度	
当社の確定拠出制度への要拠出額は、191百万円でした。	

税効果会計関係

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

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

企業結合等関係

1. 会社分割について

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

(1) 企業結合の概要

会社分割の目的

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

会社分割日程

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

会社分割の方法

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

(2) 実施した会計処理の概要

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

2. 吸収合併について

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

(1) 企業結合の概要

吸収合併の目的

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

吸収合併日程

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

吸収合併の方法

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

(2) 実施した会計処理の概要

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

セグメント情報等

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

（２）地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（１）製品・サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

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

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

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

㈱野村総合研究所

流動資産合計 229,418

固定資産合計 273,220

流動負債合計 87,832

固定負債合計 65,965

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

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

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

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

1株当たり情報

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	18,829円58銭	1株当たり純資産額	20,377円23銭
1株当たり当期純利益	3,876円72銭	1株当たり当期純利益	4,977円07銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	19,967百万円	損益計算書上の当期純利益	25,635百万円
普通株式に係る当期純利益	19,967百万円	普通株式に係る当期純利益	25,635百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

中間財務諸表

中間貸借対照表

		平成28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		231
金銭の信託		54,692
有価証券		4,400
未収委託者報酬		13,740
未収運用受託報酬		7,312
繰延税金資産		907
その他		612
貸倒引当金		10
流動資産計		81,887
固定資産		
有形固定資産	1	1,065
無形固定資産		7,506
ソフトウェア		7,505
その他		0
投資その他の資産		21,276
投資有価証券		7,976
関係会社株式		10,341
前払年金費用		2,689
その他		269
固定資産計		29,848
資産合計		111,736

		平成28年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
関係会社短期借入金		7,500
未払収益分配金		1
未払償還金		31
未払手数料		4,386
その他未払金	2	1,424
未払費用		7,900
未払法人税等		759
賞与引当金		2,268
その他		155
流動負債計		24,428
固定負債		
退職給付引当金		2,821
時効後支払損引当金		538
繰延税金負債		1,073
固定負債計		4,432
負債合計		28,860
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		78,415
資本剰余金		17,180
資本準備金		13,729
その他資本剰余金		11,729
利益剰余金		2,000
利益準備金		47,505
その他利益剰余金		685
別途積立金		46,820
繰越利益剰余金		24,606
繰越利益剰余金		22,213
評価・換算差額等		4,459
その他有価証券評価差額金		4,459
純資産合計		82,875

負債・純資産合計		111,736
----------	--	---------

中間損益計算書

区分	注記 番号	自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日
		金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		46,569
運用受託報酬		14,052
その他営業収益		112
営業収益計		60,735
営業費用		
支払手数料		19,457
調査費		13,191
その他営業費用		3,046
営業費用計		35,695
一般管理費	1	12,666
営業利益		12,373
営業外収益	2	6,027
営業外費用	3	26
経常利益		18,374
特別利益	4	76
税引前中間純利益		18,451
法人税、住民税及び事業税		2,145
法人税等調整額		2,524
中間純利益		13,781

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		

当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当中間期変動額									
剰余金の配当							34,973	34,973	34,973
中間純利益							13,781	13,781	13,781
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	-	-	-	-	-	-	21,191	21,191	21,191
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	22,213	47,505	78,415

(単位:百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	5,349	5,349	104,956
当中間期変動額			
剰余金の配当			34,973
中間純利益			13,781
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	889	889	889
当中間期変動額合計	889	889	22,081
当中間期末残高	4,459	4,459	82,875

[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 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
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)、並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法によっております。 (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(5年)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。

	<p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>
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。

[会計方針の変更]

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、当中間会計期間において、中間財務諸表に与える影響額は軽微であります。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

平成28年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	3,889百万円
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

<p>自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日</p>

1	減価償却実施額		
	有形固定資産	115百万円	
	無形固定資産	1,211百万円	
2	営業外収益のうち主要なもの		
	受取配当金	4,882百万円	
	金銭信託運用益	938百万円	
3	営業外費用のうち主要なもの		
	支払利息	11百万円	
	時効後支払損引当金繰入	14百万円	
4	特別利益の内訳		
	投資有価証券等売却益	5百万円	
	関係会社清算益	41百万円	
	株式報酬受入益	30百万円	

中間株主資本等変動計算書関係

自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日					
1	発行済株式に関する事項				
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株
2	配当に関する事項				
	配当金支払額				
	平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。				
	・普通株式の配当に関する事項				
	(1) 配当金の総額		34,973百万円		
	(2) 1株当たり配当額		6,790円		
	(3) 基準日		平成28年3月31日		
	(4) 効力発生日		平成28年6月24日		

金融商品関係

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成28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	231	231	-
(2)金銭の信託	54,692	54,692	-
(3)未収委託者報酬	13,740	13,740	-
(4)未収運用受託報酬	7,312	7,312	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,173	11,173	-
(6)関係会社株式	3,064	165,608	162,544

資産計	90,215	252,759	162,544
(7)未払金	5,844	5,844	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	4,386	4,386	-
その他未払金	1,424	1,424	-
(8)未払費用	7,900	7,900	-
(9)未払法人税等	759	759	-
負債計	22,004	22,044	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,202百万円、関係会社株式7,277百万円）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、「(5) 有価証券及び投資有価証券」「(6) 関係会社株式」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28年9月30日）

1．満期保有目的の債券(平成28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28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	165,608	162,544
合計	3,064	165,608	162,544

3．その他有価証券(平成28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	6,773	282	6,490
小計	6,773	282	6,490
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	4,400	4,400	-
小計	4,400	4,400	-
合計	11,173	4,682	6,490

セグメント情報等

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28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28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日
1 株当たり純資産額		16,090円12銭
1 株当たり中間純利益		2,675円66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	13,781百万円
	普通株主に帰属しない金額	-
	普通株式に係る中間純利益	13,781百万円
	期中平均株式数	5,150千株

[重要な後発事象]

平成28年10月27日開催の臨時株主総会において、親会社である野村ホールディングス株式会社に対して、保有する株式会社野村総合研究所、株式会社ジャフコ及び朝日火災海上保険株式会社の全株式を剰余金の配当として現物配当（適格現物分配）することを決議し、同日に配当を実施いたしました。

なお、平成28年9月30日現在における有価証券の保有目的は、株式会社野村総合研究所については関連会社株式、株式会社ジャフコ及び朝日火災海上保険株式会社についてはその他有価証券であります。

1. 配当財産の種類及び帳簿価額

株式会社野村総合研究所	普通株式	47,725,700株	3,064百万円
株式会社ジャフコ	普通株式	2,304,000株	282百万円
朝日火災海上保険株式会社	普通株式	124,300株	87百万円

2. 剰余金の配当効力発生日

平成28年10月27日（木）

3. 配当原資

利益剰余金

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29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
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

株式会社 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29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28年 6月23日	有価証券届出書
平成28年 6月23日	有価証券報告書
平成28年12月21日	有価証券届出書の訂正届出書
平成28年12月21日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成28年6月6日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年5月19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28年4月1日から平成29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29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28年11月21日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成28年10月27日付で、親会社である野村ホールディングス株式会社に対して、保有する株式を現物配当している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は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。