

【表紙】

| | |
|--|--|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 平成28年5月11日提出 |
| 【発行者名】 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | C E O兼執行役社長 渡邊 国夫 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都中央区日本橋一丁目12番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 松井 秀仁 |
| 【電話番号】 | 03-3241-9511 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | 野村D C運用戦略ファンド |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】 | 継続募集額(平成28年5月12日から平成29年5月11日まで) 1兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

野村DC運用戦略ファンド

（以下「ファンド」といいます。また、ファンドの愛称を「ネクスト10」とします。）

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。ファンドを購入できる投資者については、後述の「(12)その他 申込みの方法」をご参照ください。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権（以下「受益権」といいます。）

なお、当初元本は1口当たり1円です。

信用格付

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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ます（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託者である野村アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、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にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

「基準価額」とは、純資産総額をその時の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。

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/>

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

(7) 【申込期間】

平成28年 5月12日から平成29年 5月11日まで

*なお、申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)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/>

(9) 【払込期日】

取得申込日の翌々営業日までに申込金額を申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に取得申込代金をお支払いいただく場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、野村アセットマネジメント株式会社(「委託者」または「委託会社」といいます。)の指定する口座を經由して、野村信託銀行株式会社(「受託者」または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込代金は申込みの販売会社にお支払いください。払込取扱場所についてご不明の場合は、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/>

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

申込みの方法

受益権の申込みを行なう投資者は、販売会社所定の方法で申込みを行いません。

受益権の申込みを行なう投資者は、確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会（以下「連合会」といいます。）等に限るものとします。

購入、換金の各お申込みの方法ならびに単位、および分配金のお取扱い等について、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。

取得申込みの受付の中止、既に受付けた取得申込みの受付の取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があります。取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、その他やむを得ない事情等があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度（「振替制度」と称する場合があります。）とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部【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】

「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。

国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、また為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」、「海外REITインデックスマザーファンド」、「野村マネーマザーファンド」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。

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、当該信託金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。

（野村DC運用戦略ファンド）

《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) |
|------------|-----------|-------------------|
| 単位型 | 国内 | 株式 |
| | 海外 | 債券 |
| | | 不動産投信 |
| 追加型 | 内外 | 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 |
|--|---|--|--------------|---------------|
| 株式 一般 大型株 中小型株 | 年1回 年2回 年4回 | グローバル (日本を含む) 日本 | | |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () | 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 | 北米 欧州 アジア オセアニア | ファミリーファンド | あり (適時ヘッジ) |
| 不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券、 不動産投信) 資産配分変更型)) | その他 () | 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング | ファンド・オブ・ファンズ | なし |
| 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | | | | |

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。

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」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

〔決算頻度による属性区分〕

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

〔投資対象地域による属性区分(重複使用可能)〕

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

〔投資形態による属性区分〕

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

〔為替ヘッジによる属性区分〕

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

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

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

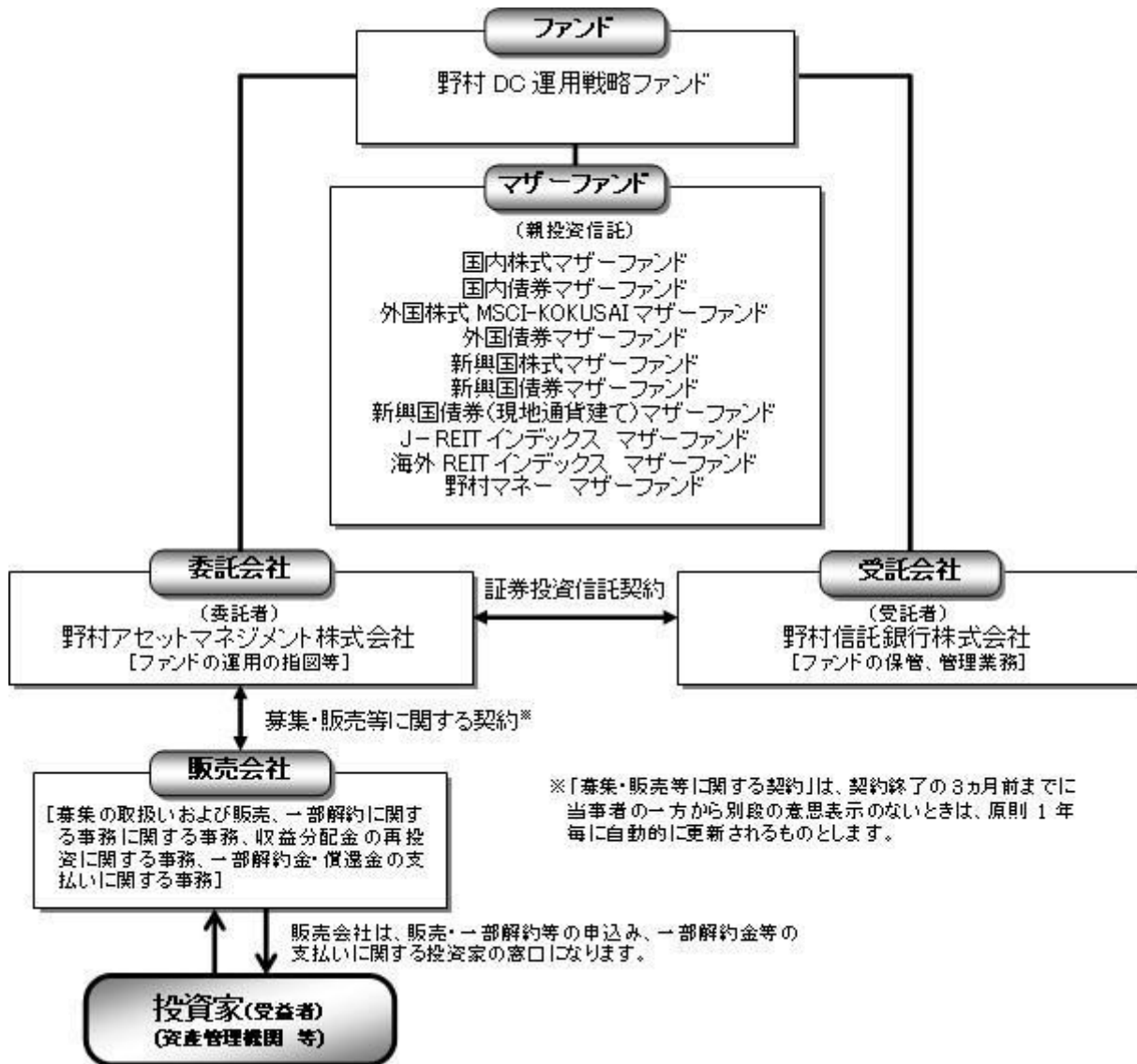
〔特殊型〕

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

(2)【ファンドの沿革】

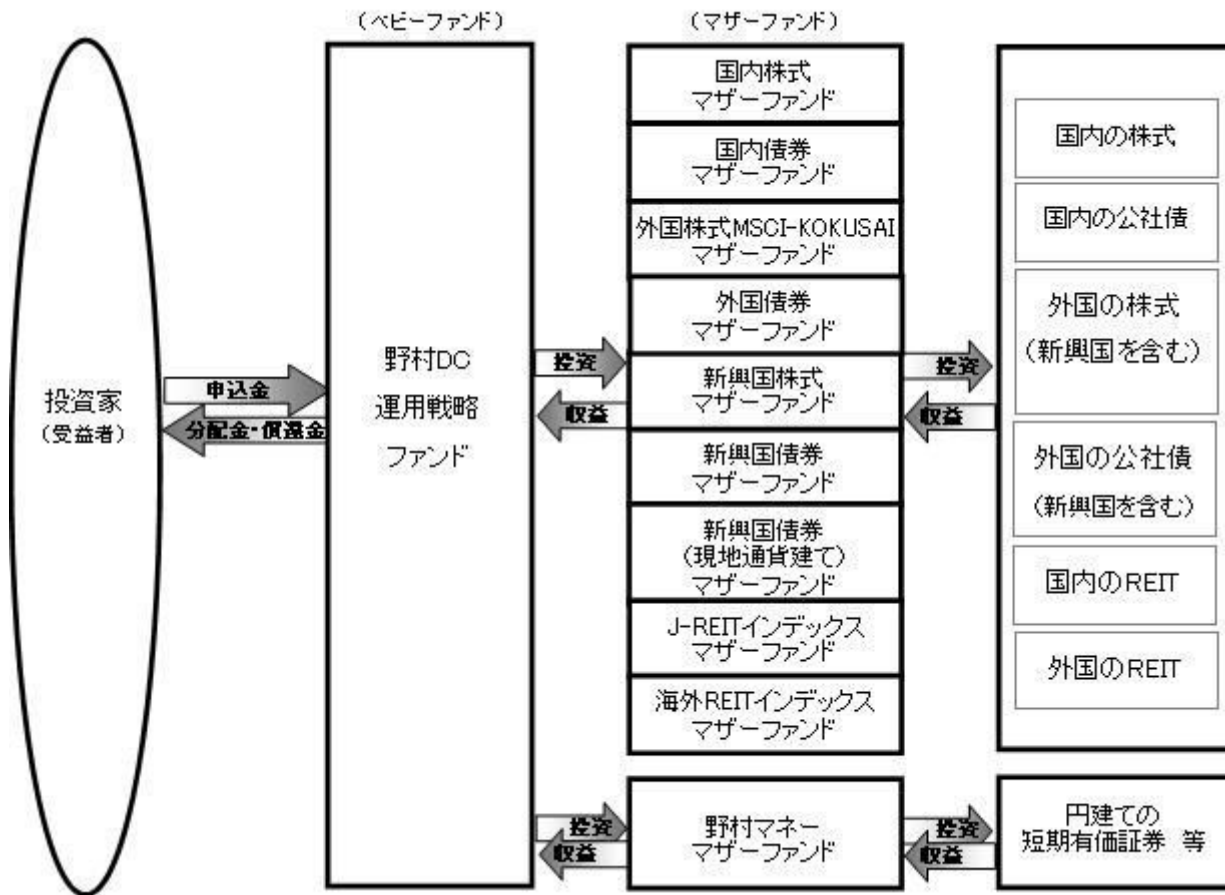
平成24年2月28日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



《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」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」、「野村マネー マザーファンド」を親投資信託（マザーファンド）とするファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



ファンドは、各マザーファンドへの投資を行なうと共に、為替予約取引等を活用します。

* 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。

委託会社の概況(平成28年3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] 運用にあたっては、世界の様々な指標の動きを計量的なアプローチを用いて分析し、リスク水準¹を一定範囲内程度に抑えつつ効率的に収益を獲得することを目指して、各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジション²を決定します。

- 1 リスク水準とは、推定されるポートフォリオの価格の変動の大きさのことです。ファンドでは、推定される基準価額の「振れ幅」（上下変動の程度）を表しています。リスク水準の調整にあたっては、基準価額の目標変動リスク値を、当年年率5%程度以下となることを目指して、リスク水準の異なる資産の配分比率や実質的な外貨のエクスポージャーを変更します。

基準価額の変動の方向は、上昇することも下落することもあり得ます。変動リスクの大きさは、必ずしもファンドの運用成績の良さを意味するものではありません。実際の運用成績は、マイナスとなる可能性があります。

ファンドで組入れる各資産と為替の過去の価格の変動リスク等の統計値から、それらを組み合わせた将来の価格の変動リスク値を推定し、資産配分と通貨配分により目標変動リスク値を調整します。ただし、目標変動リスク値はあくまでも推定に基づく統計的な目安ですので、実際の基準価額の変動リスクは、推定値からはずれることがあります。したがって、基準価額が目標変動リスク値で示される範囲より小さくしか値動きをしない場合もあれば、目標変動リスク値で示される範囲を超えて大きく値下がりする場合もあります。

変動リスク値は、「ボラティリティ」や「標準偏差」と呼ばれることもあります。

- 2 マザーファンドを通じて実質的に投資を行なう内外の株式およびREITへの投資比率、ファンドが投資する外貨建資産と為替予約取引等を加味した実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、以下の範囲内となります。

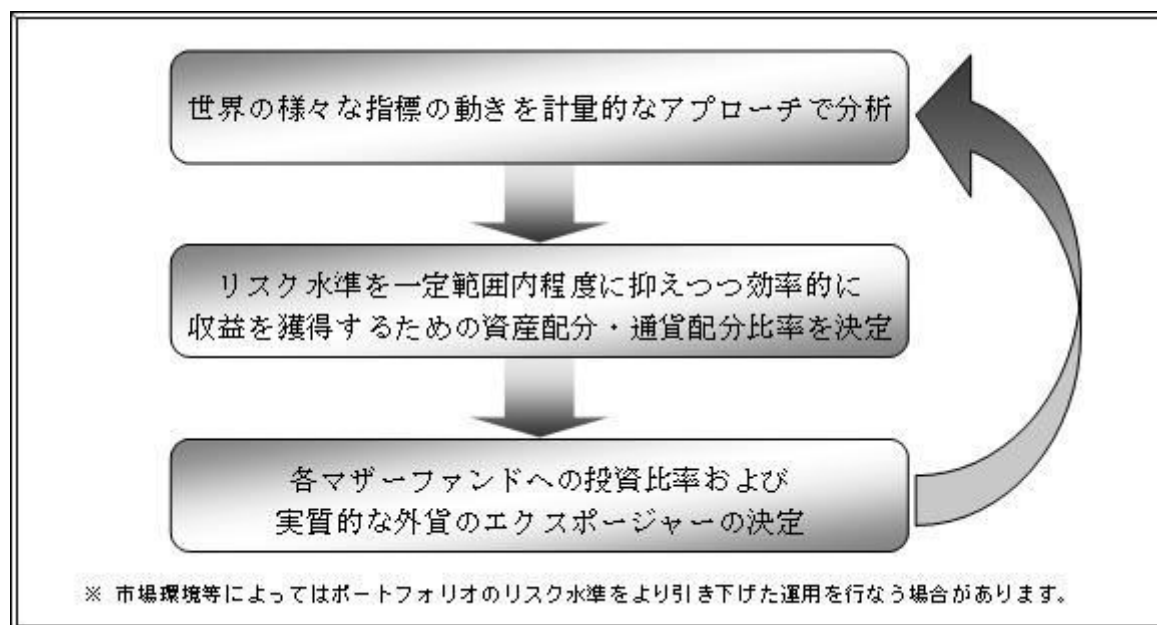
| 実質的な内外の株式 およびREITへの投資比率 | 実質的な外貨の エクスポージャー |
|----------------------------|---------------------|
| 純資産総額の50%以内 | 純資産総額の50%以内 |

各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジションは適宜見直しを行ないます。

一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

内外の株式およびREITをそれぞれ主な投資対象とする「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」、「海外REITインデックスマザーファンド」への投資比率の合計は、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

運用プロセスについて



[2] 為替予約取引等の利用については、外貨建資産の為替変動リスクを回避する目的（ヘッジ目的。代替ヘッジを含みます。）のほか、効率的に収益を獲得する目的（ヘッジ目的外）で活用します。

為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額は信託財産の純資産総額の100%以内とします。

実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内となるように調整を行ないます。

各マザーファンドの投資方針等について

[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、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。
- ・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。

「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。

[国内債券 マザーファンド]

- ・わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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

[外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド]

- ・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いません。

「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浮動株数ベースの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。

[外国債券マザーファンド]

- ・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)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。

[新興国株式マザーファンド]

- ・新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）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います。
- ・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。

Depository Receipt（預託証券）の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの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。

[新興国債券マザーファンド]

- ・新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）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いません。なお、一部ローンに投資する場合があります。
- ・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。
- ・投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）は、JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース)をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建のプレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

- ・現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、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（円換算ベース）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。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。
- ・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。

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（円換算ベース）は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

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は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建のエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数であり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[J-REITインデックス マザーファンド]

- ・J-REIT を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）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。
- ・J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と配当金の受け取りをあわせた投資成果）を表す指数です。
東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均を、2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

[海外REITインデックス マザーファンド]

- ・日本を除く世界各国のREIT を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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。
- ・REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
- ・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。
世界の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。なお、国によっては、「不動産投資信託証券」について、「REIT」という表記を用いていない場合もありますが、当ファンドにおいては、こうした場合も含め、全て「REIT」といいます。

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

S&P先進国REIT指数は、S&Pの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数から、REIT及びREITと同様の制度に基づく銘柄を抽出して算出するインデックスで、先進国に上場する不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて毎日算出されます。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。

[野村マネー マザーファンド]

- ・本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行

ないます。

- ・残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、実質的に国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）に投資を行ないます。

各マザーファンドの主要投資対象

| | |
|-------------------------|------------------------------------|
| 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。 |
| 国内債券マザーファンド | わが国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 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。 |
| 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。 |
| 新興国株式マザーファンド | 新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。 |
| 新興国債券マザーファンド | 新興国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。 |
| J-REITインデックス マザーファンド | J-REITを主要投資対象とします。 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。 |
| 野村マネー マザーファンド | 円建ての短期有価証券等を主要投資対象とします。 |

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

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」、および「」に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

二．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみたく資産

- ・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するもの
- ・流動性に考慮し、時価の取得が可能なもの
- ・前号または本号イに掲げるものに該当しないもの

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国内株式マザーファンド、国内債券マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、外国債券マザーファンド、新興国株式マザーファンド、新興国債券マザーファンド、新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド、J-REITインデックス マザーファンド、海外REITインデックス マザーファンドおよび野村マネー マザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）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
- 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の新株引受権証券を含みません。）
- 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．新株引受権証券および新株予約権証券
- 13．外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するブリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
- 14．前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
- 15．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。）
- 16．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。）
- 17．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。）

18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 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。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19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
23. 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ならびに第13号、第14号、第19号および第20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以下「株式」といい、第2号から第7号までの証券ならびに第13号、第14号、第19号および第20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以下「公社債」といい、第15号および第16号の証券ならびに第19号の証券または証書のうち第15号および第16号の証券の性質を有するものを以下「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、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 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
7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）
8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）
9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引
3. 金利先渡取引¹
4. 為替先渡取引²
5. 直物為替先渡取引³

1 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」という。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」という。）までの期間に係る国内又は海外において代表的利率として公表される預金契約又は金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」という。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額及び当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗

じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- 2 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引及び当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいう。以下この項において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいう。以下この項において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭又はその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- 3 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

（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。

（国内債券マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

（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。

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。

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。

（新興国株式マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14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エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）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

新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）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。

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。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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。

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。

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。

（新興国債券マザーファンド）

運用の基本方針

約款第14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、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）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

新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）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。なお、一部ローンに投資する場合があります。

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。

投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、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。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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。

（新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

運用の基本方針

約款第14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、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（円換算ベース）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

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、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（円換算ベース）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。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

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。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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。

（J - REITインデックス 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REIT指数(配当込み)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

わが国の不動産投資信託証券（以下「J-REIT」といいます。）を主要投資対象とします。

わが国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券
(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)とします。

(2)投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が30%を超えるJ-REITがある場合には、当該J-REITへ東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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。

(海外REITインデックス 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、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)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。

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)を委託会社において円換算した指数です。

2.運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）を主要投資対象とします。

海外の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)とします。

(2)投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

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

投資信託証券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。

株式への直接投資は行いません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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。

(野村マネー 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、本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

2.運用方法

(1)投資対象

本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(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。

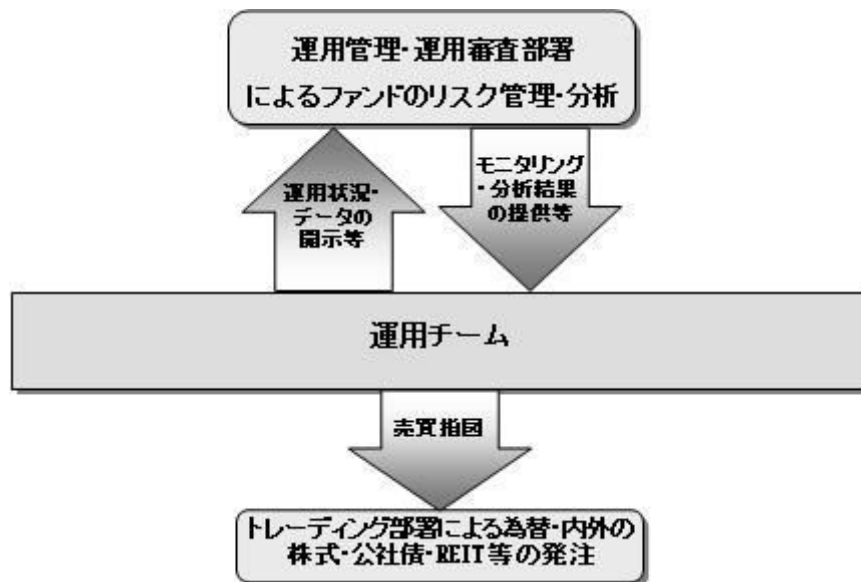
スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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。

（3）【運用体制】

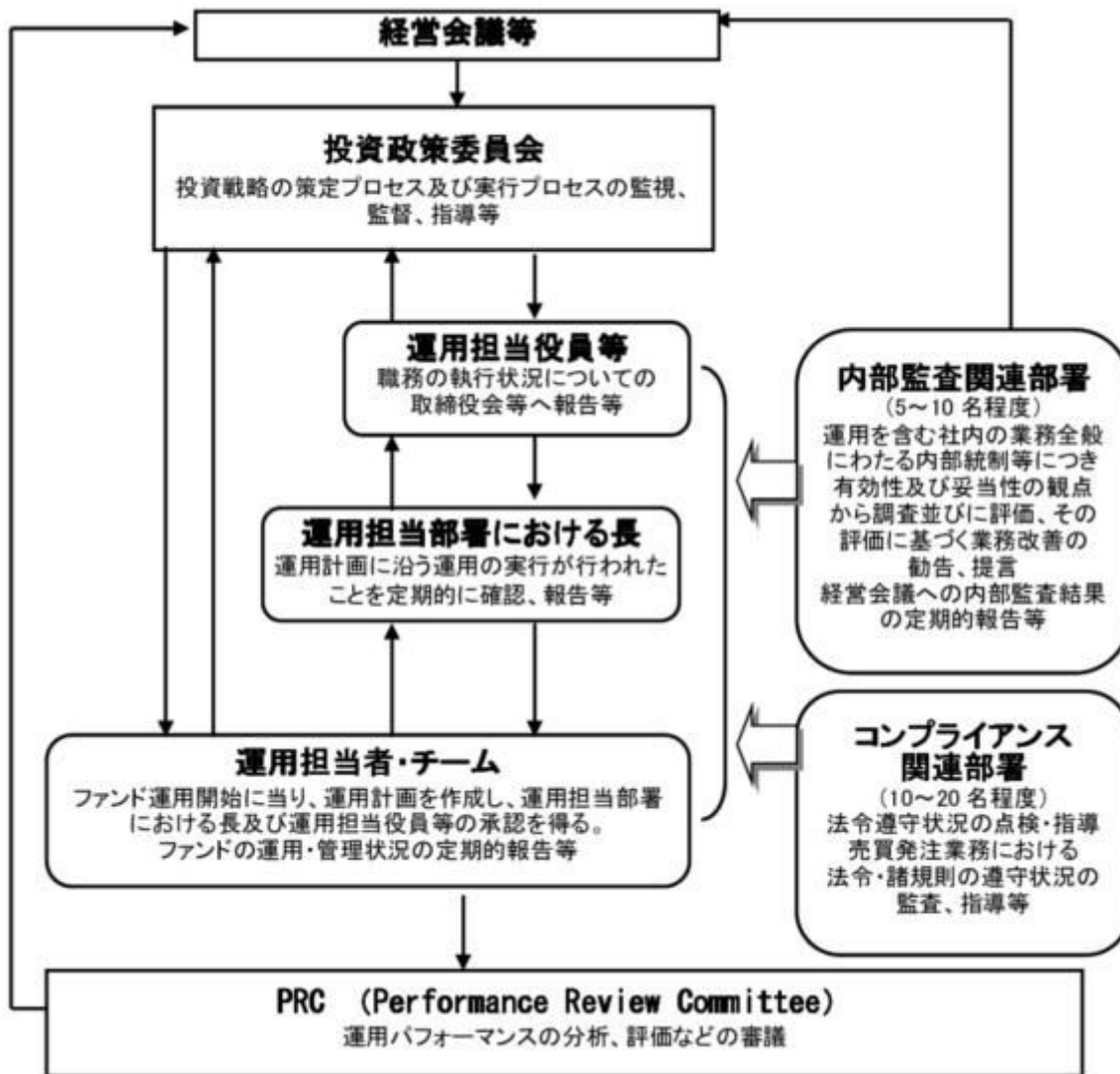
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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】

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・配当等収益と売買益（評価益を含みません。）等の全額とします。

収益分配金額は、上記の範囲内で、基準価額水準等を勘案し、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・配当等収益とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年2月17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、原則、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。

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には制限を設けません。

デリバティブの利用(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

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。

外国為替予約取引等の利用(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外国為替予約取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(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(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(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。

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、上場投資信託証券を除きます。)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、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()の規定にかかわらず、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。

先物取引等の運用指図(約款第22条)

- ()委託者は、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。)
- ()委託者は、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行なうことの指図をすることができます。
- ()委託者は、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。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- ()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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および有価証券店頭指数等スワップ取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ホに掲げるものをいいます。以下同じ。)(これらを総称して以下「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。
- ()スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ()委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

信用取引の指図範囲(約款第21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。

- ()上記()の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25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各号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。

公社債の借入れ(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、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。
- ()上記()の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ()信託財産の一部解約等の事由により、上記()の借入れにかかる公社債の時価総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借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ()上記()の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第27条)

- ()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ()金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、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。
- ()金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ()委託者は、金利先渡取引および為替先渡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。

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。

直物為替先渡取引の運用指図(約款第31条)

- () 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- () 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、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。
- () 直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- () 委託者は、直物為替先渡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。

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

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

- () 委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数
- () 当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

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。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の株価変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。

[REITの価格変動リスク]

REITは、保有不動産の状況、市場金利の変動、不動産市況や株式市場の動向等により、価格が変動します。ファンドは実質的にREITに投資を行ないますので、これらの影響を受けます。

[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。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の債券価格の変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。

[為替変動リスク]

ファンドは、為替変動リスクの低減を図る目的（ヘッジ目的）のほか、効率的に収益を追求する目的（ヘッジ目的外）で為替予約取引等を活用しますので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

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

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

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

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

各マザーファンド（「野村マネー マザーファンド」を除く）が対象とするインデックスの著作権等について

国内株式マザーファンドについて

「東証株価指数（TOPIX）」

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値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うことができます。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

本ファンドは、(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ありません。

(株)東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

(株)東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本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。

国内債券マザーファンドについて

「NOMURA-BPI国債指数」

「NOMURA-BPI国債指数」は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権と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、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて

新興国株式マザーファンドについて

「MSCI-KOKUSA I指数」

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」

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

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

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

「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。

新興国債券マザーファンドについて

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドについて

「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス」
「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド」

本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性及びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。

当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

J-REITインデックスマザーファンドについて

「東証REIT指数」

東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有します。

㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができるものとします。

㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本ファンドは、東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

本ファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

㈱東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

㈱東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は本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。

海外REITインデックスマザーファンドについて

「S&P先進国REIT指数」

本ファンドは、スタンダード&プアーズ及びその関連会社（以下、S&P）により、何ら支援、推奨、販売または販促されるものではありません。

S&Pは、ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、証券への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S&P先進国REIT指数（除く日本）の一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックする能力に関して、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。

S&Pは、被許諾者とは、S&PおよびS&P先進国REIT指数（除く日本）の特定のトレードマークとトレードネームのライセンス使用を与えているのみの関係であり、S&P先進国REIT指数（除く日本）は、被許諾者あるいは本ファンドに関係なくS&Pにより決定、作成、および計算されています。

S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）の決定、作成、および計算において、被許諾者あるいは本ファンドの所有者の要求を考慮に入れる義務を一切負いません。

S&Pは、本ファンドの発行価格および発行数量の決定、あるいは本ファンドの発行または販売のタイミングや本ファンドを換金する際の方程式の決定または計算について、責任を負うものではなく、参加もしていません。

S&Pは、本ファンドの管理、マーケティングまたは売買に関連するいかなる義務または責任も負いません。

S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそこに含まれるデータの正確性および/または完全性について保証するものではなく、それに関連する過誤、省略または中断に対して責任を負うことはありません。

S&Pは、被許諾者、ファンドの所有者またはその他のいかなる個人・法人がS&P先進国REIT指数（除く日本）またはそこに含まれるデータを使用することによって得られる結果について、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の保証を行いません。

S&Pは、明示的あるいは黙示的保証を行なうものではなく、かつ、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそこに含まれるデータに関連して、特定の目的あるいは使用のための市場性または適切性について何ら保証を行な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、S&Pは、たとえ特別の損害、懲罰的損害、間接的損害あるいは結果的損害（逸失利益を含む）につき、その可能性について通知を受けていたとしても、かかる損害について責任を負いません。

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、審議を行いません。

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、適切な管理を行いません。

リスク管理体制図

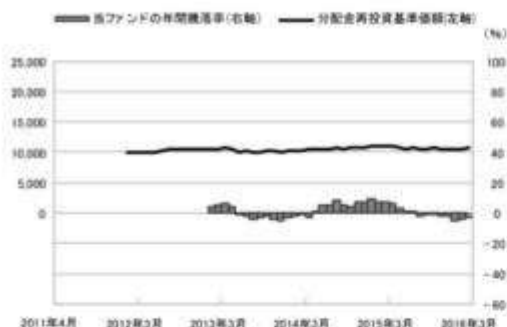


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

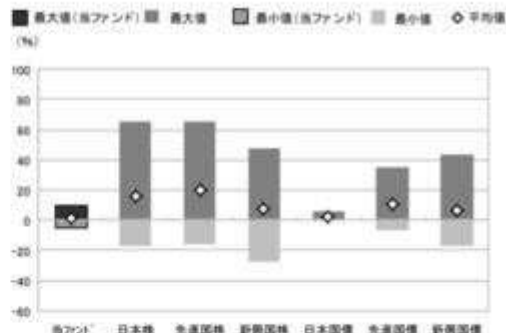
リスクの定量的比較

(2011年4月末～2016年3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(%) | 9.2 | 65.0 | 65.7 | 47.4 | 6.1 | 34.9 | 43.7 |
| 最小値(%) | △4.9 | △17.0 | △15.6 | △27.4 | 0.4 | △6.3 | △17.4 |
| 平均値(%) | 1.2 | 16.2 | 19.8 | 7.3 | 2.4 | 10.4 | 6.2 |

- * 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。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2013年2月から2016年3月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2011年4月から2016年3月の5年間(当ファンドは2013年2月から2016年3月)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(東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。新東京証券取引所は、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、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(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)については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、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は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示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持っており、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「JPMS LLC」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)についての援助、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関連させる或いはそれを目的とする種類の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または承認を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する職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。JPMS LLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSC, JP Morgan Securities PLC, またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年1.296%（税抜年1.20%）以内（平成28年5月11日現在年1.296%（税抜年1.20%））の率（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とします。

信託報酬は、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ファンドから支払われます。

信託報酬率の配分は下記の通り（税抜）とします。

| < 委託会社 > | < 販売会社 > | < 受託会社 > |
|----------|----------|----------|
| 年0.60% | 年0.55% | 年0.05% |

上記配分は、平成28年5月11日現在の信託報酬率における配分です。

支払先の役務の内容

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

(4) 【その他の手数料等】

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

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息および信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用（債権回収に要する弁護士費用等を含む。）等は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。

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

ファンドに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等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。

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以下の通りです。

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。

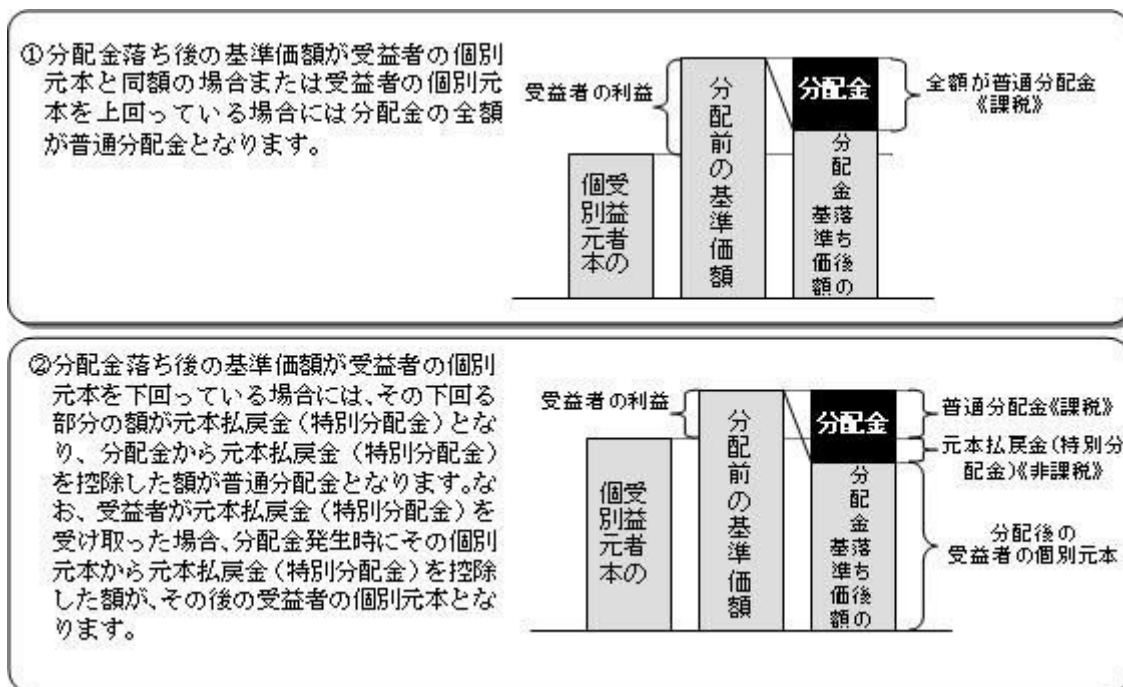
換金(解約)時および償還時の課税について

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。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

分配金の課税について

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



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

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(平成28年3月末現在)が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は平成28年 3月31日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

野村DC運用戦略ファンド

| 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 | 3,828,481,198 | 78.54 |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) | | 1,046,068,491 | 21.45 |
| 合計(純資産総額) | | 4,874,549,689 | 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 | 278,413,493,530 | 98.09 |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) | | 5,408,041,387 | 1.90 |
| 合計(純資産総額) | | 283,821,534,917 | 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 | 4,716,250,000 | 1.66 |

(参考)国内債券マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------------------|------|---------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 8,359,780,680 | 99.55 |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) | | 37,145,719 | 0.44 |
| 合計(純資産総額) | | 8,396,926,399 | 100.00 |

(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 | 199,669,611,662 | 61.16 |
| | カナダ | 11,796,937,372 | 3.61 |
| | ドイツ | 11,847,076,741 | 3.62 |

| | | | |
|--------------------|----------|-----------------|--------|
| | イタリア | 2,850,570,607 | 0.87 |
| | フランス | 12,420,731,207 | 3.80 |
| | オランダ | 3,926,239,018 | 1.20 |
| | スペイン | 4,126,231,449 | 1.26 |
| | ベルギー | 1,895,353,793 | 0.58 |
| | オーストリア | 238,063,064 | 0.07 |
| | ルクセンブルグ | 37,187,900 | 0.01 |
| | フィンランド | 1,319,220,175 | 0.40 |
| | アイルランド | 654,047,347 | 0.20 |
| | ポルトガル | 217,309,516 | 0.06 |
| | イギリス | 24,692,454,001 | 7.56 |
| | スイス | 11,774,300,206 | 3.60 |
| | スウェーデン | 3,827,514,395 | 1.17 |
| | ノルウェー | 758,368,357 | 0.23 |
| | デンマーク | 2,577,901,609 | 0.78 |
| | オーストラリア | 8,208,103,549 | 2.51 |
| | ニュージーランド | 227,846,818 | 0.06 |
| | 香港 | 3,908,181,450 | 1.19 |
| | シンガポール | 1,601,212,423 | 0.49 |
| | イスラエル | 803,261,002 | 0.24 |
| | 小計 | 309,377,723,661 | 94.77 |
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 29,537,371 | 0.00 |
| 投資証券 | アメリカ | 6,547,977,464 | 2.00 |
| | カナダ | 78,162,640 | 0.02 |
| | フランス | 525,294,333 | 0.16 |
| | イギリス | 404,383,217 | 0.12 |
| | オーストラリア | 891,878,268 | 0.27 |
| | 香港 | 174,205,982 | 0.05 |
| | シンガポール | 145,310,801 | 0.04 |
| | 小計 | 8,767,212,705 | 2.68 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 8,256,960,153 | 2.52 |
| 合計（純資産総額） | | 326,431,433,890 | 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 | 5,592,791,515 | 1.71 |
| | 買建 | カナダ | 328,649,428 | 0.10 |
| | 買建 | ドイツ | 1,087,769,032 | 0.33 |
| | 買建 | イギリス | 676,874,176 | 0.20 |
| | 買建 | スイス | 324,191,646 | 0.09 |

（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 | 272,933,904,413 | 42.07 |
| | カナダ | 13,227,629,166 | 2.03 |
| | メキシコ | 6,263,350,884 | 0.96 |
| | ドイツ | 34,736,974,892 | 5.35 |
| | イタリア | 75,348,888,170 | 11.61 |
| | フランス | 58,493,616,769 | 9.01 |
| | オランダ | 14,321,902,204 | 2.20 |
| | スペイン | 46,479,522,632 | 7.16 |
| | ベルギー | 15,675,155,245 | 2.41 |
| | オーストリア | 9,255,957,363 | 1.42 |
| | フィンランド | 3,325,164,311 | 0.51 |
| | アイルランド | 6,504,363,412 | 1.00 |
| | イギリス | 50,505,152,121 | 7.78 |
| | スイス | 1,814,200,304 | 0.27 |
| | スウェーデン | 3,221,604,294 | 0.49 |
| | ノルウェー | 1,843,108,632 | 0.28 |
| | デンマーク | 4,258,397,012 | 0.65 |
| | ポーランド | 3,881,657,431 | 0.59 |
| | オーストラリア | 11,592,907,971 | 1.78 |
| | シンガポール | 2,462,981,946 | 0.37 |
| マレーシア | 3,067,700,762 | 0.47 | |
| 南アフリカ | 2,744,351,939 | 0.42 | |
| | 小計 | 641,958,491,873 | 98.96 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 6,735,449,996 | 1.03 |
| 合計（純資産総額） | | 648,693,941,869 | 100.00 |

（参考）新興国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 | アメリカ | 1,062,947,094 | 7.66 |
| | メキシコ | 594,366,021 | 4.28 |
| | ブラジル | 898,913,291 | 6.48 |
| | チリ | 84,019,342 | 0.60 |
| | コロンビア | 40,646,095 | 0.29 |
| | ギリシャ | 56,702,855 | 0.40 |
| | トルコ | 200,667,646 | 1.44 |
| | チェコ | 26,030,214 | 0.18 |

| | | | |
|--------------------|----------|----------------|--------|
| | ハンガリー | 40,561,607 | 0.29 |
| | ポーランド | 187,455,128 | 1.35 |
| | 香港 | 2,862,840,276 | 20.64 |
| | マレーシア | 470,276,804 | 3.39 |
| | タイ | 300,654,309 | 2.16 |
| | フィリピン | 197,139,590 | 1.42 |
| | インドネシア | 363,942,957 | 2.62 |
| | 韓国 | 2,119,601,936 | 15.28 |
| | 台湾 | 1,670,409,506 | 12.04 |
| | インド | 1,076,932,538 | 7.76 |
| | カタール | 130,682,208 | 0.94 |
| | エジプト | 23,785,093 | 0.17 |
| | 南アフリカ | 921,230,837 | 6.64 |
| | アラブ首長国連邦 | 109,180,616 | 0.78 |
| | 小計 | 13,438,985,963 | 96.89 |
| 投資証券 | メキシコ | 20,895,477 | 0.15 |
| | トルコ | 7,240,871 | 0.05 |
| | 南アフリカ | 54,091,963 | 0.38 |
| | 小計 | 82,228,311 | 0.59 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 348,605,409 | 2.51 |
| 合計（純資産総額） | | 13,869,819,683 | 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 | 324,447,407 | 2.33 |

（参考）新興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 | 6,891,415,063 | 98.05 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 136,934,911 | 1.94 |
| 合計（純資産総額） | | 7,028,349,974 | 100.00 |

（参考）新興国債券（現地通貨建て）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 | メキシコ | 187,942,764 | 9.72 |
| | ブラジル | 202,576,908 | 10.48 |

| | | | |
|--------------------|--------|---------------|--------|
| | コロンビア | 113,957,800 | 5.89 |
| | ペルー | 32,241,835 | 1.66 |
| | トルコ | 178,644,355 | 9.24 |
| | ハンガリー | 100,358,326 | 5.19 |
| | ポーランド | 185,814,672 | 9.61 |
| | ロシア | 96,631,920 | 5.00 |
| | ルーマニア | 54,195,221 | 2.80 |
| | マレーシア | 188,588,192 | 9.76 |
| | タイ | 169,546,950 | 8.77 |
| | フィリピン | 12,837,828 | 0.66 |
| | インドネシア | 189,079,286 | 9.78 |
| | 南アフリカ | 169,512,751 | 8.77 |
| | 小計 | 1,881,928,808 | 97.42 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 49,791,380 | 2.57 |
| 合計（純資産総額） | | 1,931,720,188 | 100.00 |

（参考）J-REITインデックス マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 投資証券 | 日本 | 19,951,889,900 | 98.04 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 398,021,713 | 1.95 |
| 合計（純資産総額） | | 20,349,911,613 | 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（%） |
|------------|----|------|-------------|---------|
| REIT指数先物取引 | 買建 | 日本 | 396,480,000 | 1.94 |

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（%） |
|-------|------|----------------|---------|
| 投資証券 | アメリカ | 13,119,457,916 | 69.98 |
| | カナダ | 343,675,103 | 1.83 |
| | ドイツ | 38,316,684 | 0.20 |
| | イタリア | 19,198,397 | 0.10 |

| | | | |
|--------------------|----------|----------------|--------|
| | フランス | 862,060,045 | 4.59 |
| | オランダ | 105,383,145 | 0.56 |
| | スペイン | 87,770,298 | 0.46 |
| | ベルギー | 125,965,859 | 0.67 |
| | アイルランド | 45,454,014 | 0.24 |
| | イギリス | 1,085,967,282 | 5.79 |
| | オーストラリア | 1,522,676,328 | 8.12 |
| | ニュージーランド | 89,675,996 | 0.47 |
| | 香港 | 321,364,223 | 1.71 |
| | シンガポール | 549,340,761 | 2.93 |
| | イスラエル | 7,166,348 | 0.03 |
| | 小計 | 18,323,472,399 | 97.75 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 421,492,788 | 2.24 |
| 合計（純資産総額） | | 18,744,965,187 | 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 | 133,769,188 | 0.71 |
| | 買建 | フランス | 16,297,074 | 0.08 |

（参考）野村マネー マザーファンド

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 地方債証券 | 日本 | 824,948,341 | 3.91 |
| 特殊債券 | 日本 | 5,173,858,455 | 24.54 |
| 社債券 | 日本 | 2,605,184,073 | 12.35 |
| コマーシャルペーパー | 日本 | 1,699,711,382 | 8.06 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | | 10,775,087,986 | 51.11 |
| 合計（純資産総額） | | 21,078,790,237 | 100.00 |

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村DC運用戦略ファンド

| 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) | 投資 比率 (%) |
|----|----------|---------------|-----------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 外国債券マザーファンド | 718,545,008 | 2.2387 | 1,608,615,942 | 2.2522 | 1,618,307,067 | 33.19 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | J-REITインデックス マザーファンド | 247,633,622 | 1.9577 | 484,813,435 | 2.0267 | 501,879,061 | 10.29 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 新興国債券マザーファンド | 236,226,512 | 1.6500 | 389,795,562 | 1.6959 | 400,616,541 | 8.21 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 野村マネー マザーファンド | 379,067,282 | 1.0211 | 387,065,601 | 1.0211 | 387,065,601 | 7.94 |
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 海外REITインデックス マザーファンド | 149,022,778 | 1.9639 | 292,666,467 | 2.1074 | 314,050,602 | 6.44 |
| 6 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド | 143,110,969 | 1.9166 | 274,297,080 | 2.0145 | 288,297,047 | 5.91 |
| 7 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内債券マザーファンド | 106,855,593 | 1.3309 | 142,219,433 | 1.3535 | 144,629,045 | 2.96 |
| 8 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド | 95,493,906 | 1.1830 | 112,971,395 | 1.2213 | 116,626,707 | 2.39 |
| 9 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内株式マザーファンド | 45,415,062 | 1.2039 | 54,677,318 | 1.2553 | 57,009,527 | 1.16 |

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 | 78.54 |
| 合計 | 78.54 |

(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 | 1,739,000 | 7,974.75 | 13,868,090,250 | 5,952.00 | 10,350,528,000 | 3.64 |
| 2 | 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 11,072,400 | 832.21 | 9,214,562,004 | 521.50 | 5,774,256,600 | 2.03 |
| 3 | 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 1,066,600 | 4,233.49 | 4,515,440,434 | 4,848.00 | 5,170,876,800 | 1.82 |
| 4 | 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 926,200 | 4,318.96 | 4,000,220,752 | 4,690.00 | 4,343,878,000 | 1.53 |
| 5 | 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 1,401,900 | 2,888.85 | 4,049,878,815 | 3,006.00 | 4,214,111,400 | 1.48 |
| 6 | 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 781,900 | 7,055.73 | 5,516,875,287 | 5,366.00 | 4,195,675,400 | 1.47 |
| 7 | 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 1,258,300 | 4,058.38 | 5,106,659,554 | 3,086.00 | 3,883,113,800 | 1.36 |
| 8 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,105,000 | 5,127.99 | 5,666,428,950 | 3,412.00 | 3,770,260,000 | 1.32 |
| 9 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 19,489,300 | 230.89 | 4,499,884,477 | 168.10 | 3,276,151,330 | 1.15 |
| 10 | 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 583,200 | 6,083.06 | 3,547,640,592 | 5,136.00 | 2,995,315,200 | 1.05 |
| 11 | 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 986,500 | 3,532.58 | 3,484,890,170 | 2,893.00 | 2,853,944,500 | 1.00 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----|----|-----------------|--------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 12 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 577,300 | 5,163.50 | 2,980,888,550 | 4,792.00 | 2,766,421,600 | 0.97 |
| 13 | 日本 | 株式 | NTTドコモ | 情報・通信業 | 1,064,300 | 2,248.93 | 2,393,536,199 | 2,552.50 | 2,716,625,750 | 0.95 |
| 14 | 日本 | 株式 | キヤノン | 電気機器 | 752,800 | 4,097.29 | 3,084,439,912 | 3,355.00 | 2,525,644,000 | 0.88 |
| 15 | 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 143,100 | 24,010.47 | 3,435,898,257 | 17,485.00 | 2,502,103,500 | 0.88 |
| 16 | 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道 | 陸運業 | 125,200 | 21,219.41 | 2,656,670,132 | 19,905.00 | 2,492,106,000 | 0.87 |
| 17 | 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 255,600 | 10,951.94 | 2,799,315,864 | 9,713.00 | 2,482,642,800 | 0.87 |
| 18 | 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 1,639,800 | 1,784.57 | 2,926,337,886 | 1,496.50 | 2,453,960,700 | 0.86 |
| 19 | 日本 | 株式 | 花王 | 化学 | 393,900 | 5,678.82 | 2,236,887,198 | 6,003.00 | 2,364,581,700 | 0.83 |
| 20 | 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 1,026,000 | 2,679.60 | 2,749,269,600 | 2,090.50 | 2,144,853,000 | 0.75 |
| 21 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 559,100 | 4,874.05 | 2,725,081,355 | 3,800.00 | 2,124,580,000 | 0.74 |
| 22 | 日本 | 株式 | ブリヂストン | ゴム製品 | 494,200 | 4,735.41 | 2,340,239,622 | 4,205.00 | 2,078,111,000 | 0.73 |
| 23 | 日本 | 株式 | 三井不動産 | 不動産業 | 732,000 | 3,419.59 | 2,503,139,880 | 2,808.00 | 2,055,456,000 | 0.72 |
| 24 | 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 1,962,600 | 1,226.21 | 2,406,559,746 | 1,041.50 | 2,044,047,900 | 0.72 |
| 25 | 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 146,700 | 17,593.56 | 2,580,975,252 | 13,570.00 | 1,990,719,000 | 0.70 |
| 26 | 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 1,035,500 | 2,519.60 | 2,609,045,800 | 1,906.00 | 1,973,663,000 | 0.69 |
| 27 | 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 31,700 | 62,488.33 | 1,980,880,061 | 61,390.00 | 1,946,063,000 | 0.68 |
| 28 | 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 3,567,000 | 774.78 | 2,763,640,260 | 526.60 | 1,878,382,200 | 0.66 |
| 29 | 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 1,492,000 | 1,491.38 | 2,225,138,960 | 1,179.50 | 1,759,814,000 | 0.62 |
| 30 | 日本 | 株式 | 富士重工業 | 輸送用機器 | 441,800 | 4,284.53 | 1,892,905,354 | 3,975.00 | 1,756,155,000 | 0.61 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内 / 国外 | 業種 | 投資比率 (%) |
|--------|---------|----------|----------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.10 |
| | | 鉱業 | 0.29 |
| | | 建設業 | 3.11 |
| | | 食料品 | 4.96 |
| | | 繊維製品 | 0.73 |
| | | パルプ・紙 | 0.25 |
| | | 化学 | 6.00 |
| | | 医薬品 | 5.53 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.48 |
| | | ゴム製品 | 0.97 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.85 |
| | | 鉄鋼 | 1.17 |
| | | 非鉄金属 | 0.80 |
| | | 金属製品 | 0.64 |
| | | 機械 | 4.54 |
| | | 電気機器 | 11.40 |
| | | 輸送用機器 | 9.63 |
| 精密機器 | 1.58 | | |
| その他製品 | 1.54 | | |
| 電気・ガス業 | 2.09 | | |

| | | |
|-----|------------|-------|
| | 陸運業 | 4.53 |
| | 海運業 | 0.21 |
| | 空運業 | 0.68 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 0.20 |
| | 情報・通信業 | 8.01 |
| | 卸売業 | 4.13 |
| | 小売業 | 4.98 |
| | 銀行業 | 7.25 |
| | 証券、商品先物取引業 | 1.07 |
| | 保険業 | 2.27 |
| | その他金融業 | 1.37 |
| | 不動産業 | 2.80 |
| | サービス業 | 3.75 |
| 合 計 | | 98.09 |

(参考) 国内債券マザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|---------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 38回 | 180,000,000 | 101.02 | 181,851,000 | 104.56 | 188,220,600 | 0.4 | 2025/3/20 | 2.24 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第9 9回 | 140,000,000 | 118.35 | 165,690,000 | 124.30 | 174,025,600 | 2.1 | 2027/12/20 | 2.07 |
| 3 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第12 3回 | 170,000,000 | 100.08 | 170,136,000 | 101.21 | 172,068,900 | 0.1 | 2020/3/20 | 2.04 |
| 4 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (2年)第36 0回 | 130,000,000 | 100.23 | 130,301,000 | 100.55 | 130,720,200 | 0.1 | 2018/1/15 | 1.55 |
| 5 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 20回 | 110,000,000 | 105.92 | 116,517,800 | 106.90 | 117,593,300 | 1 | 2021/12/20 | 1.40 |
| 6 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第2 89回 | 100,000,000 | 103.90 | 103,908,000 | 102.92 | 102,929,000 | 1.5 | 2017/12/20 | 1.22 |
| 7 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第12 2回 | 100,000,000 | 100.18 | 100,182,400 | 101.15 | 101,159,000 | 0.1 | 2019/12/20 | 1.20 |
| 8 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (2年)第35 7回 | 100,000,000 | 100.21 | 100,219,000 | 100.45 | 100,453,000 | 0.1 | 2017/10/15 | 1.19 |
| 9 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第1 40回 | 80,000,000 | 113.86 | 91,094,700 | 123.31 | 98,653,600 | 1.7 | 2032/9/20 | 1.17 |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 25回 | 90,000,000 | 104.38 | 93,950,200 | 106.47 | 95,829,300 | 0.8 | 2022/9/20 | 1.14 |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 05回 | 90,000,000 | 105.66 | 95,094,800 | 105.64 | 95,084,100 | 1.3 | 2019/12/20 | 1.13 |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 28回 | 90,000,000 | 103.16 | 92,844,000 | 105.49 | 94,946,400 | 0.6 | 2023/3/20 | 1.13 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|------|---------------------------|------------|--------|------------|--------|------------|-----|------------|------|
| 13 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第1 46回 | 70,000,000 | 113.50 | 79,451,200 | 123.53 | 86,476,600 | 1.7 | 2033/9/20 | 1.02 |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 18回 | 80,000,000 | 105.41 | 84,328,000 | 106.59 | 85,278,400 | 1 | 2021/9/20 | 1.01 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第1 53回 | 70,000,000 | 106.43 | 74,504,200 | 116.47 | 81,529,700 | 1.3 | 2035/6/20 | 0.97 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第11 7回 | 80,000,000 | 100.63 | 80,504,000 | 101.28 | 81,024,800 | 0.2 | 2019/3/20 | 0.96 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第12 4回 | 80,000,000 | 101.48 | 81,185,600 | 101.27 | 81,019,200 | 0.1 | 2020/6/20 | 0.96 |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第11 6回 | 80,000,000 | 100.64 | 80,512,000 | 101.17 | 80,938,400 | 0.2 | 2018/12/20 | 0.96 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (30年)第4 5回 | 60,000,000 | 102.70 | 61,621,900 | 125.42 | 75,253,200 | 1.5 | 2044/12/20 | 0.89 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 29回 | 70,000,000 | 104.16 | 72,912,700 | 107.08 | 74,956,700 | 0.8 | 2023/6/20 | 0.89 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 12回 | 70,000,000 | 106.04 | 74,229,400 | 106.60 | 74,626,300 | 1.2 | 2020/12/20 | 0.88 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 24回 | 70,000,000 | 104.20 | 72,941,400 | 106.25 | 74,378,500 | 0.8 | 2022/6/20 | 0.88 |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第12 6回 | 70,000,000 | 101.22 | 70,854,700 | 101.37 | 70,964,600 | 0.1 | 2020/12/20 | 0.84 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第12 5回 | 70,000,000 | 100.29 | 70,203,000 | 101.32 | 70,929,600 | 0.1 | 2020/9/20 | 0.84 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第2 96回 | 65,000,000 | 104.96 | 68,225,950 | 104.29 | 67,793,700 | 1.5 | 2018/9/20 | 0.80 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第4 9回 | 60,000,000 | 111.54 | 66,929,400 | 111.42 | 66,852,000 | 2.1 | 2021/3/22 | 0.79 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第2 88回 | 65,000,000 | 104.00 | 67,603,250 | 102.78 | 66,807,000 | 1.7 | 2017/9/20 | 0.79 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 32回 | 60,000,000 | 102.68 | 61,611,100 | 105.89 | 63,535,800 | 0.6 | 2023/12/20 | 0.75 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 31回 | 60,000,000 | 104.28 | 62,569,800 | 105.78 | 63,468,000 | 0.6 | 2023/9/20 | 0.75 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (20年)第1 13回 | 50,000,000 | 120.40 | 60,204,400 | 126.73 | 63,368,000 | 2.1 | 2029/9/20 | 0.75 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 99.55 |
| 合計 | 99.55 |

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|----------|----|-------------------------------|--------------------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 株式 | APPLE INC | コンピュータ・周辺機器 | 538,200 | 14,019.62 | 7,545,363,893 | 12,345.22 | 6,644,197,835 | 2.03 |
| 2 | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア | 732,700 | 4,716.50 | 3,455,782,242 | 6,203.03 | 4,544,963,012 | 1.39 |
| 3 | アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | 石油・ガス・消耗燃料 | 402,000 | 9,551.06 | 3,839,527,771 | 9,523.71 | 3,828,532,867 | 1.17 |
| 4 | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品 | 267,200 | 11,416.46 | 3,050,479,093 | 12,279.86 | 3,281,180,302 | 1.00 |
| 5 | アメリカ | 株式 | GENERAL ELEC CO | コングロマリット | 911,500 | 2,861.37 | 2,608,139,603 | 3,586.60 | 3,269,189,911 | 1.00 |
| 6 | アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | インターネットソフトウェア・サービス | 219,300 | 9,770.96 | 2,142,771,664 | 12,924.39 | 2,834,320,043 | 0.86 |
| 7 | アメリカ | 株式 | AT & T INC | 各種電気通信サービス | 594,300 | 3,721.52 | 2,211,702,076 | 4,436.21 | 2,636,440,554 | 0.80 |
| 8 | スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品 | 308,000 | 8,630.02 | 2,658,048,213 | 8,434.46 | 2,597,815,220 | 0.79 |
| 9 | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | インターネット販売・カタログ販売 | 38,490 | 44,643.63 | 1,718,333,483 | 67,460.38 | 2,596,550,380 | 0.79 |
| 10 | アメリカ | 株式 | WELLS FARGO CO | 銀行 | 468,700 | 6,130.30 | 2,873,275,678 | 5,481.88 | 2,569,358,093 | 0.78 |
| 11 | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | インターネットソフトウェア・サービス | 30,040 | 63,558.89 | 1,909,309,099 | 84,569.72 | 2,540,474,401 | 0.77 |
| 12 | アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品 | 262,800 | 9,239.57 | 2,428,161,404 | 9,316.38 | 2,448,345,295 | 0.75 |
| 13 | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | インターネットソフトウェア・サービス | 28,140 | 65,083.40 | 1,831,446,896 | 86,576.55 | 2,436,264,151 | 0.74 |
| 14 | アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS | 各種電気通信サービス | 393,100 | 5,514.96 | 2,167,930,809 | 6,089.22 | 2,393,675,212 | 0.73 |
| 15 | アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 355,600 | 6,877.09 | 2,445,496,573 | 6,728.12 | 2,392,520,468 | 0.73 |
| 16 | アメリカ | 株式 | COCA COLA CO | 飲料 | 399,200 | 4,578.46 | 1,827,724,490 | 5,248.63 | 2,095,254,852 | 0.64 |
| 17 | アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品 | 596,500 | 3,893.55 | 2,322,507,520 | 3,388.28 | 2,021,113,553 | 0.61 |
| 18 | アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | 石油・ガス・消耗燃料 | 181,900 | 11,755.38 | 2,138,303,736 | 10,732.77 | 1,952,290,863 | 0.59 |
| 19 | スイス | 株式 | ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE) | 医薬品 | 67,880 | 30,882.83 | 2,096,327,162 | 27,655.70 | 1,877,269,323 | 0.57 |
| 20 | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT | 専門小売り | 122,500 | 12,980.99 | 1,590,172,472 | 15,033.76 | 1,841,636,286 | 0.56 |
| 21 | アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 各種金融サービス | 114,600 | 16,232.47 | 1,860,241,675 | 16,052.39 | 1,839,604,215 | 0.56 |
| 22 | スイス | 株式 | NOVARTIS-REG | 医薬品 | 219,900 | 11,234.97 | 2,470,572,047 | 8,177.63 | 1,798,262,376 | 0.55 |
| 23 | アメリカ | 株式 | DISNEY (WALT) CO | メディア | 151,300 | 11,911.48 | 1,802,208,242 | 11,145.17 | 1,686,265,552 | 0.51 |
| 24 | アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 456,100 | 3,529.50 | 1,609,806,509 | 3,685.76 | 1,681,076,413 | 0.51 |
| 25 | アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | タバコ | 149,700 | 8,774.72 | 1,313,576,973 | 11,120.38 | 1,664,722,263 | 0.50 |
| 26 | アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A | メディア | 239,200 | 6,386.25 | 1,527,592,625 | 6,850.94 | 1,638,745,805 | 0.50 |
| 27 | アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 飲料 | 140,800 | 10,870.02 | 1,530,499,342 | 11,571.10 | 1,629,212,175 | 0.49 |
| 28 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | 情報技術サービス | 187,500 | 7,480.06 | 1,402,511,956 | 8,651.57 | 1,622,169,450 | 0.49 |
| 29 | アメリカ | 株式 | MERCK & CO INC | 医薬品 | 269,100 | 6,500.39 | 1,749,255,516 | 5,996.82 | 1,613,746,845 | 0.49 |
| 30 | アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS | 通信機器 | 489,000 | 3,092.28 | 1,512,129,321 | 3,206.87 | 1,568,160,799 | 0.48 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内 / 国外 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|---------|-------------------------|----------|
| 株式 | 国外 | エネルギー設備・サービス | 0.71 |
| | | 石油・ガス・消耗燃料 | 5.99 |
| | | 化学 | 2.57 |
| | | 建設資材 | 0.32 |
| | | 容器・包装 | 0.29 |
| | | 金属・鉱業 | 1.14 |
| | | 紙製品・林産品 | 0.08 |
| | | 航空宇宙・防衛 | 2.01 |
| | | 建設関連製品 | 0.24 |
| | | 建設・土木 | 0.33 |
| | | 電気設備 | 0.75 |
| | | コングロマリット | 2.18 |
| | | 機械 | 1.30 |
| | | 商社・流通業 | 0.29 |
| | | 商業サービス・用品 | 0.45 |
| | | 航空貨物・物流サービス | 0.59 |
| | | 旅客航空輸送業 | 0.17 |
| | | 海運業 | 0.07 |
| | | 陸運・鉄道 | 0.80 |
| | | 運送インフラ | 0.22 |
| | | 自動車部品 | 0.56 |
| | | 自動車 | 1.03 |
| | | 家庭用耐久財 | 0.47 |
| | | レジャー用品 | 0.08 |
| | | 繊維・アパレル・贅沢品 | 1.27 |
| | | ホテル・レストラン・レジャー | 1.87 |
| | | メディア | 2.97 |
| | | 販売 | 0.09 |
| | | インターネット販売・カタログ販売 | 1.26 |
| | | 複合小売り | 0.54 |
| | | 専門小売り | 1.99 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 2.18 |
| | | 飲料 | 2.50 |
| | | 食品 | 2.30 |
| | | タバコ | 1.62 |
| | | 家庭用品 | 1.58 |
| | | パーソナル用品 | 0.71 |
| | | ヘルスケア機器・用品 | 1.63 |
| | | 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 | 2.29 |

| | | |
|----------|--------------------|-------|
| | 医薬品 | 6.42 |
| | 銀行 | 8.05 |
| | 各種金融サービス | 1.41 |
| | 保険 | 4.11 |
| | 不動産管理・開発 | 0.63 |
| | インターネットソフトウェア・サービス | 2.77 |
| | 情報技術サービス | 2.58 |
| | ソフトウェア | 3.20 |
| | 通信機器 | 1.12 |
| | コンピュータ・周辺機器 | 2.54 |
| | 電子装置・機器・部品 | 0.39 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 1.76 |
| | 各種電気通信サービス | 2.96 |
| | 無線通信サービス | 0.40 |
| | 電力 | 1.79 |
| | ガス | 0.20 |
| | 総合公益事業 | 1.29 |
| | 水道 | 0.09 |
| | 貯蓄・抵当・不動産金融 | 0.02 |
| | 消費者金融 | 0.50 |
| | 資本市場 | 1.80 |
| | 各種消費者サービス | 0.02 |
| | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.07 |
| | ヘルスケア・テクノロジー | 0.06 |
| | ライフサイエンス・ツール/サービス | 0.44 |
| | 専門サービス | 0.47 |
| 投資信託受益証券 | | 0.00 |
| 投資証券 | | 2.68 |
| 合 計 | | 97.47 |

(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 N/B | 51,100,000 | 12,328.84 | 6,300,040,480 | 12,355.18 | 6,313,499,583 | 3.625 | 2020/2/15 | 0.97 |
| 2 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 49,300,000 | 12,190.50 | 6,009,919,224 | 12,203.77 | 6,016,459,271 | 3.375 | 2019/11/15 | 0.92 |
| 3 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 50,100,000 | 11,847.60 | 5,935,647,882 | 11,963.00 | 5,993,465,872 | 2.625 | 2020/11/15 | 0.92 |
| 4 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 49,600,000 | 12,092.55 | 5,997,908,745 | 11,904.90 | 5,904,833,213 | 4.25 | 2017/11/15 | 0.91 |
| 5 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 35,000,000 | 15,263.10 | 5,342,087,060 | 15,522.98 | 5,433,046,319 | 6 | 2026/2/15 | 0.83 |
| 6 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 43,400,000 | 12,313.44 | 5,344,034,124 | 12,324.81 | 5,348,969,472 | 3.5 | 2020/5/15 | 0.82 |
| 7 | ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 23,900,000 | 21,405.58 | 5,115,934,129 | 21,714.10 | 5,189,671,812 | 6.5 | 2027/7/4 | 0.80 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|------|------|--------------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|------|
| 8 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 28,500,000 | 16,595.35 | 4,729,675,214 | 16,784.88 | 4,783,693,080 | 4.25 | 2023/10/25 | 0.73 |
| 9 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 39,900,000 | 11,979.91 | 4,779,985,573 | 11,845.04 | 4,726,172,724 | 3.5 | 2018/2/15 | 0.72 |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 37,000,000 | 12,294.27 | 4,548,883,212 | 12,248.66 | 4,532,006,998 | 3.625 | 2019/8/15 | 0.69 |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 36,400,000 | 12,104.82 | 4,406,156,816 | 12,280.35 | 4,470,050,607 | 3.125 | 2021/5/15 | 0.68 |
| 12 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 34,200,000 | 12,458.30 | 4,260,740,103 | 12,515.40 | 4,280,267,666 | 3.625 | 2021/2/15 | 0.65 |
| 13 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 20,100,000 | 19,805.56 | 3,980,918,587 | 20,387.49 | 4,097,886,806 | 5.5 | 2029/4/25 | 0.63 |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 33,000,000 | 11,447.87 | 3,777,798,360 | 12,080.52 | 3,986,574,106 | 3 | 2044/11/15 | 0.61 |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 34,500,000 | 11,514.47 | 3,972,493,330 | 11,461.22 | 3,954,123,719 | 1.875 | 2017/9/30 | 0.60 |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 33,700,000 | 11,503.96 | 3,876,835,685 | 11,620.12 | 3,915,982,125 | 2 | 2022/2/15 | 0.60 |
| 17 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 19,800,000 | 19,343.70 | 3,830,053,998 | 19,664.52 | 3,893,575,554 | 6 | 2025/10/25 | 0.60 |
| 18 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 25,900,000 | 14,684.10 | 3,803,181,960 | 14,569.29 | 3,773,446,887 | 4.25 | 2019/9/1 | 0.58 |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 31,500,000 | 11,861.20 | 3,736,280,736 | 11,949.36 | 3,764,048,813 | 2.625 | 2020/8/15 | 0.58 |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 32,600,000 | 11,073.43 | 3,609,939,233 | 11,390.36 | 3,713,258,206 | 1.75 | 2023/5/15 | 0.57 |
| 21 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 30,600,000 | 12,236.16 | 3,744,264,992 | 12,126.74 | 3,710,783,792 | 3.75 | 2018/11/15 | 0.57 |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 31,200,000 | 11,469.60 | 3,578,517,686 | 11,826.11 | 3,689,748,679 | 2.375 | 2024/8/15 | 0.56 |
| 23 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 16,600,000 | 21,519.79 | 3,572,286,057 | 22,205.11 | 3,686,049,007 | 5.75 | 2032/10/25 | 0.56 |
| 24 | イギリス | 国債証券 | UK TSY 3 1/4% 2044 | 19,000,000 | 18,540.44 | 3,522,685,048 | 19,226.38 | 3,653,012,351 | 3.25 | 2044/1/22 | 0.56 |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY NOTE | 31,000,000 | 11,815.93 | 3,662,939,141 | 11,738.08 | 3,638,806,757 | 2.875 | 2018/3/31 | 0.56 |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 30,400,000 | 11,634.81 | 3,536,985,091 | 11,941.43 | 3,630,197,389 | 2.5 | 2024/5/15 | 0.55 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 29,800,000 | 12,202.52 | 3,636,352,163 | 11,890.82 | 3,543,464,560 | 4.75 | 2017/8/15 | 0.54 |
| 28 | スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 23,800,000 | 14,715.55 | 3,502,301,733 | 14,630.58 | 3,482,080,182 | 4.3 | 2019/10/31 | 0.53 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 29,300,000 | 11,692.65 | 3,425,947,078 | 11,665.46 | 3,417,979,977 | 2.375 | 2018/6/30 | 0.52 |
| 30 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 20,500,000 | 16,183.99 | 3,317,718,789 | 16,606.10 | 3,404,252,140 | 3.5 | 2026/4/25 | 0.52 |

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 |

(参考) 新興国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 | 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS | コンピ ュー タ・周 辺機 器 | 3,670 | 129,435.22 | 475,027,282 | 128,968.80 | 473,315,496 | 3.41 |
| 2 | 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 半導 体・半 導体 製造 装 置 | 818,000 | 507.62 | 415,238,776 | 563.63 | 461,053,430 | 3.32 |

| | | | | | | | | | | |
|----|-------|----|-------------------------------|--------------------|-----------|------------|-------------|------------|-------------|------|
| 3 | 香港 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | インターネットソフトウェア・サービス | 171,800 | 2,215.19 | 380,571,010 | 2,298.64 | 394,907,383 | 2.84 |
| 4 | 香港 | 株式 | CHINA MOBILE LTD | 無線通信サービス | 204,500 | 1,521.09 | 311,064,551 | 1,233.59 | 252,270,587 | 1.81 |
| 5 | 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS | メディア | 13,290 | 13,666.31 | 181,625,371 | 15,607.80 | 207,427,662 | 1.49 |
| 6 | 香港 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 2,806,000 | 102.27 | 286,973,997 | 73.37 | 205,894,459 | 1.48 |
| 7 | 香港 | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA-H | 銀行 | 2,465,000 | 89.44 | 220,470,996 | 63.64 | 156,876,051 | 1.13 |
| 8 | アメリカ | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | インターネットソフトウェア・サービス | 16,600 | 9,299.31 | 154,368,671 | 8,885.94 | 147,506,684 | 1.06 |
| 9 | 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | 電子装置・機器・部品 | 470,557 | 305.17 | 143,601,295 | 292.11 | 137,455,817 | 0.99 |
| 10 | インド | 株式 | INFOSYS LTD | 情報技術サービス | 61,510 | 1,717.76 | 105,659,892 | 2,050.11 | 126,102,574 | 0.90 |
| 11 | 香港 | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H | 銀行 | 2,660,000 | 70.03 | 186,301,714 | 47.22 | 125,611,850 | 0.90 |
| 12 | ブラジル | 株式 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF | 銀行 | 99,968 | 1,044.71 | 104,438,479 | 1,004.06 | 100,374,120 | 0.72 |
| 13 | アメリカ | 株式 | PJSC GAZPROM-ADR | 石油・ガス・消耗燃料 | 198,800 | 633.23 | 125,888,081 | 493.03 | 98,014,630 | 0.70 |
| 14 | アメリカ | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR | インターネットソフトウェア・サービス | 4,500 | 23,581.03 | 106,114,666 | 21,396.80 | 96,285,623 | 0.69 |
| 15 | インド | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 貯蓄・抵当・不動産金融 | 50,350 | 2,021.09 | 101,761,965 | 1,896.01 | 95,464,104 | 0.68 |
| 16 | ブラジル | 株式 | AMBEV SA | 飲料 | 154,956 | 613.00 | 94,988,047 | 598.43 | 92,731,481 | 0.66 |
| 17 | 香港 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 171,000 | 765.42 | 130,887,827 | 539.78 | 92,304,004 | 0.66 |
| 18 | メキシコ | 株式 | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 無線通信サービス | 1,035,300 | 95.15 | 98,509,160 | 87.69 | 90,793,636 | 0.65 |
| 19 | 韓国 | 株式 | HYUNDAI MOTOR CO LTD | 自動車 | 5,200 | 16,561.05 | 86,117,460 | 15,332.30 | 79,727,960 | 0.57 |
| 20 | 香港 | 株式 | CNOOC LTD | 石油・ガス・消耗燃料 | 602,000 | 171.49 | 103,239,647 | 131.78 | 79,335,834 | 0.57 |
| 21 | インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | 石油・ガス・消耗燃料 | 43,660 | 1,552.86 | 67,797,896 | 1,779.98 | 77,714,145 | 0.56 |
| 22 | 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS PFD | コンピュータ・周辺機器 | 675 | 100,545.23 | 67,868,035 | 110,333.40 | 74,475,045 | 0.53 |
| 23 | ブラジル | 株式 | BANCO BRADESCO SA - PREF | 銀行 | 83,674 | 903.85 | 75,629,119 | 876.87 | 73,371,639 | 0.52 |
| 24 | アメリカ | 株式 | LUKOIL PJSC-SPON ADR | 石油・ガス・消耗燃料 | 16,820 | 5,520.05 | 92,847,299 | 4,355.08 | 73,252,479 | 0.52 |
| 25 | 南アフリカ | 株式 | STEINHOFF INTERNATIONAL H NV | 家庭用耐久財 | 95,620 | 582.84 | 55,731,805 | 722.33 | 69,069,386 | 0.49 |
| 26 | 香港 | 株式 | CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 保険 | 246,000 | 509.31 | 125,291,633 | 277.52 | 68,270,658 | 0.49 |
| 27 | インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVS LTD | 情報技術サービス | 15,630 | 4,257.80 | 66,549,547 | 4,232.14 | 66,148,504 | 0.47 |
| 28 | メキシコ | 株式 | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 飲料 | 60,200 | 956.98 | 57,610,213 | 1,088.35 | 65,518,977 | 0.47 |
| 29 | アメリカ | 株式 | PJSC SBERBANK OF RUSSIA | 銀行 | 357,500 | 162.05 | 57,936,250 | 180.91 | 64,676,128 | 0.46 |
| 30 | 南アフリカ | 株式 | SASOL LTD | 石油・ガス・消耗燃料 | 18,750 | 3,426.47 | 64,246,494 | 3,389.07 | 63,545,235 | 0.45 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内 / 国外 | 業種 | 投資比率 (%) |
|-------------------------|---------|------------------|----------|
| 株式 | 国外 | エネルギー設備・サービス | 0.09 |
| | | 石油・ガス・消耗燃料 | 7.43 |
| | | 化学 | 2.20 |
| | | 建設資材 | 1.11 |
| | | 容器・包装 | 0.09 |
| | | 金属・鉱業 | 2.81 |
| | | 紙製品・林産品 | 0.34 |
| | | 航空宇宙・防衛 | 0.25 |
| | | 建設関連製品 | 0.05 |
| | | 建設・土木 | 1.01 |
| | | 電気設備 | 0.21 |
| | | コングロマリット | 2.44 |
| | | 機械 | 0.68 |
| | | 商社・流通業 | 0.07 |
| | | 商業サービス・用品 | 0.14 |
| | | 航空貨物・物流サービス | 0.11 |
| | | 旅客航空輸送業 | 0.24 |
| | | 海運業 | 0.12 |
| | | 陸運・鉄道 | 0.13 |
| | | 運送インフラ | 0.99 |
| | | 自動車部品 | 0.81 |
| | | 自動車 | 2.61 |
| | | 家庭用耐久財 | 0.92 |
| | | レジャー用品 | 0.06 |
| | | 繊維・アパレル・贅沢品 | 0.49 |
| | | ホテル・レストラン・レジャー | 0.54 |
| | | メディア | 2.23 |
| | | 販売 | 0.04 |
| | | インターネット販売・カタログ販売 | 0.39 |
| | | 複合小売り | 0.74 |
| | | 専門小売り | 0.44 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.83 |
| | | 飲料 | 1.57 |
| 食品 | 2.19 | | |
| タバコ | 0.77 | | |
| 家庭用品 | 0.72 | | |
| パーソナル用品 | 0.90 | | |
| ヘルスケア機器・用品 | 0.04 | | |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 0.60 | | |

| | | |
|------|--------------------|-------|
| | バイオテクノロジー | 0.02 |
| | 医薬品 | 1.84 |
| | 銀行 | 16.22 |
| | 各種金融サービス | 1.66 |
| | 保険 | 3.67 |
| | 不動産管理・開発 | 2.37 |
| | インターネットソフトウェア・サービス | 5.47 |
| | 情報技術サービス | 2.16 |
| | ソフトウェア | 0.18 |
| | 通信機器 | 0.03 |
| | コンピュータ・周辺機器 | 5.13 |
| | 電子装置・機器・部品 | 2.26 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 4.88 |
| | 各種電気通信サービス | 1.99 |
| | 無線通信サービス | 4.70 |
| | 電力 | 1.37 |
| | ガス | 0.49 |
| | 総合公益事業 | 0.11 |
| | 水道 | 0.28 |
| | 貯蓄・抵当・不動産金融 | 0.81 |
| | 消費者金融 | 0.16 |
| | 資本市場 | 1.25 |
| | 各種消費者サービス | 0.21 |
| | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.92 |
| | ライフサイエンス・ツール/サービス | 0.03 |
| 投資証券 | | 0.59 |
| 合計 | | 97.48 |

(参考) 新興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 | RUSSIA | 1,844,500 | 13,250.04 | 244,397,010 | 13,782.45 | 254,217,367 | 7.5 | 2030/3/31 | 3.61 |
| 2 | アメリカ | 国債証券 | PHILIPPINES GLOBAL | 700,000 | 18,386.96 | 128,708,730 | 18,465.75 | 129,260,254 | 10.625 | 2025/3/16 | 1.83 |
| 3 | アメリカ | 国債証券 | RUSSIA | 620,000 | 18,002.37 | 111,614,723 | 18,676.71 | 115,795,602 | 12.75 | 2028/6/24 | 1.64 |
| 4 | アメリカ | 国債証券 | BRAZIL GLOBAL | 1,000,000 | 13,662.45 | 136,624,500 | 11,465.19 | 114,651,900 | 7.125 | 2037/1/20 | 1.63 |
| 5 | アメリカ | 国債証券 | TURKEY GLOBAL | 850,000 | 13,503.17 | 114,776,975 | 13,485.00 | 114,622,513 | 7.375 | 2025/2/5 | 1.63 |
| 6 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 900,000 | 12,343.46 | 111,091,212 | 12,476.49 | 112,288,437 | 5.55 | 2045/1/21 | 1.59 |
| 7 | アメリカ | 国債証券 | INDONESIA GLOBAL | 700,000 | 15,230.95 | 106,616,689 | 15,257.99 | 106,805,992 | 8.5 | 2035/10/12 | 1.51 |
| 8 | アメリカ | 国債証券 | PHILIPPINES GLOBAL | 550,000 | 18,843.16 | 103,637,430 | 19,023.55 | 104,629,526 | 9.5 | 2030/2/2 | 1.48 |
| 9 | アメリカ | 国債証券 | BRAZIL GLOBAL | 820,000 | 13,568.18 | 111,259,105 | 12,620.16 | 103,485,312 | 8.25 | 2034/1/20 | 1.47 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|------|------|------------------------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| 10 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 900,000 | 11,319.33 | 101,873,988 | 11,465.19 | 103,186,710 | 5.75 | 2110/10/12 | 1.46 |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF INDONESIA | 700,000 | 14,954.24 | 104,679,720 | 14,471.36 | 101,299,579 | 7.75 | 2038/1/17 | 1.44 |
| 12 | アメリカ | 国債証券 | PANAMA GLOBAL | 600,000 | 16,254.09 | 97,524,540 | 16,169.58 | 97,017,480 | 8.875 | 2027/9/30 | 1.38 |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF COLOMBIA | 800,000 | 12,621.56 | 100,972,548 | 11,803.23 | 94,425,840 | 6.125 | 2041/1/18 | 1.34 |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 710,000 | 13,357.26 | 94,836,559 | 13,225.81 | 93,903,287 | 6.05 | 2040/1/11 | 1.33 |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | PHILIPPINES GLOBAL | 600,000 | 14,808.03 | 88,848,180 | 15,509.19 | 93,055,178 | 6.375 | 2032/1/15 | 1.32 |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | MEXICO GLOBAL | 599,000 | 15,627.20 | 93,606,938 | 15,465.33 | 92,637,327 | 7.5 | 2033/4/8 | 1.31 |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF PERU | 550,000 | 16,986.51 | 93,425,805 | 16,620.30 | 91,411,650 | 8.75 | 2033/11/21 | 1.30 |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 800,000 | 11,394.76 | 91,158,120 | 11,239.83 | 89,918,640 | 4.75 | 2044/3/8 | 1.27 |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 700,000 | 12,451.14 | 87,157,980 | 12,208.87 | 85,462,146 | 5.875 | 2019/1/15 | 1.21 |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 700,000 | 11,593.16 | 81,152,136 | 11,611.67 | 81,281,718 | 3.625 | 2022/3/15 | 1.15 |
| 21 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF INDONESIA | 600,000 | 12,879.32 | 77,275,944 | 13,541.69 | 81,250,145 | 6.75 | 2044/1/15 | 1.15 |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF COLOMBIA | 700,000 | 11,333.19 | 79,332,354 | 11,183.49 | 78,284,430 | 5.625 | 2044/2/26 | 1.11 |
| 23 | アメリカ | 国債証券 | TURKEY GLOBAL | 600,000 | 12,651.71 | 75,910,262 | 12,484.94 | 74,909,664 | 7 | 2019/3/11 | 1.06 |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | PERU GLOBAL | 500,000 | 15,111.51 | 75,557,574 | 14,817.42 | 74,087,100 | 7.35 | 2025/7/21 | 1.05 |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | TURKEY GLOBAL | 600,000 | 12,366.63 | 74,199,780 | 12,202.96 | 73,217,774 | 5.75 | 2024/3/22 | 1.04 |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF TURKEY | 600,000 | 12,493.39 | 74,960,370 | 12,096.75 | 72,580,501 | 6 | 2041/1/14 | 1.03 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 630,000 | 11,928.43 | 75,149,109 | 11,408.85 | 71,875,755 | 4.875 | 2021/1/22 | 1.02 |
| 28 | アメリカ | 国債証券 | RUSSIA FOREIGN BOND | 600,000 | 11,617.30 | 69,703,848 | 11,853.94 | 71,123,684 | 5 | 2020/4/29 | 1.01 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | RUSSIAN FEDERATION | 600,000 | 11,352.51 | 68,115,060 | 11,800.36 | 70,802,208 | 4.875 | 2023/9/16 | 1.00 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN STATES | 600,000 | 11,718.72 | 70,312,320 | 11,780.69 | 70,684,164 | 4 | 2023/10/2 | 1.00 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.05 |
| 合計 | 98.05 |

(参考)新興国債券(現地通貨建て)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 | ロシア | 国債証券 | RUSSIA FOREIGN BOND | 60,000,000 | 159.15 | 95,495,400 | 161.05 | 96,631,920 | 7.85 | 2018/3/10 | 5.00 |
| 2 | コロンビア | 国債証券 | REPUBLIC OF COLOMBIA | 1,780,000,000 | 3.68 | 65,545,578 | 3.80 | 67,737,010 | 7.75 | 2021/4/14 | 3.50 |
| 3 | タイ | 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 15,000,000 | 354.54 | 53,182,308 | 358.09 | 53,714,880 | 3.65 | 2021/12/17 | 2.78 |
| 4 | ブラジル | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL | 2,100,000 | 2,423.00 | 50,883,198 | 2,468.82 | 51,845,326 | | 2018/1/1 | 2.68 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|--------|------|-----------------------------|---------------|----------|------------|----------|------------|-------|------------|------|
| 5 | メキシコ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7,550,000 | 655.95 | 49,524,775 | 655.91 | 49,521,384 | 4.75 | 2018/6/14 | 2.56 |
| 6 | コロンビア | 国債証券 | REPUBLIC OF COLOMBIA | 1,070,000,000 | 4.05 | 43,425,128 | 4.31 | 46,220,790 | 9.85 | 2027/6/28 | 2.39 |
| 7 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 1,460,000 | 2,960.11 | 43,217,732 | 2,961.84 | 43,242,975 | 4.378 | 2019/11/29 | 2.23 |
| 8 | ブラジル | 国債証券 | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 136,000 | 2,695.08 | 36,656,085 | 2,849.87 | 38,758,299 | 10 | 2021/1/1 | 2.00 |
| 9 | ルーマニア | 国債証券 | ROMANIA | 950,000 | 3,404.22 | 32,340,123 | 3,377.90 | 32,090,101 | 5.85 | 2023/4/26 | 1.66 |
| 10 | トルコ | 国債証券 | TURKEY GOVERNMENT BOND | 800,000 | 3,806.13 | 30,449,072 | 3,904.46 | 31,235,726 | 8.8 | 2018/11/14 | 1.61 |
| 11 | 南アフリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 3,800,000 | 823.87 | 31,307,158 | 821.22 | 31,206,707 | 10.5 | 2026/12/21 | 1.61 |
| 12 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 1,030,000 | 2,924.46 | 30,122,033 | 2,936.66 | 30,247,648 | 1.5 | 2020/4/25 | 1.56 |
| 13 | タイ | 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 8,700,000 | 344.36 | 29,960,017 | 344.96 | 30,011,604 | 3.875 | 2019/6/13 | 1.55 |
| 14 | ブラジル | 国債証券 | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 112,000 | 2,361.25 | 26,449,465 | 2,654.00 | 29,724,905 | 10 | 2025/1/1 | 1.53 |
| 15 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 830,000 | 3,415.81 | 28,351,283 | 3,407.72 | 28,284,143 | 5.25 | 2020/10/25 | 1.46 |
| 16 | ブラジル | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL | 1,310,000 | 1,927.04 | 25,244,315 | 2,037.27 | 26,688,302 | | 2019/7/1 | 1.38 |
| 17 | 南アフリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 4,360,000 | 593.92 | 25,895,165 | 591.89 | 25,806,404 | 7 | 2031/2/28 | 1.33 |
| 18 | タイ | 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 6,700,000 | 363.02 | 24,322,565 | 376.55 | 25,229,348 | 3.58 | 2027/12/17 | 1.30 |
| 19 | トルコ | 国債証券 | TURKEY GOVERNMENT BOND | 610,000 | 3,970.02 | 24,217,123 | 4,096.16 | 24,986,594 | 10.5 | 2020/1/15 | 1.29 |
| 20 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 800,000 | 3,077.02 | 24,616,209 | 3,106.09 | 24,848,771 | 3.25 | 2025/7/25 | 1.28 |
| 21 | インドネシア | 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT | 2,800,000,000 | 0.86 | 24,266,718 | 0.87 | 24,563,980 | 8.375 | 2024/3/15 | 1.27 |
| 22 | ハンガリー | 国債証券 | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 52,000,000 | 46.57 | 24,218,448 | 46.94 | 24,410,511 | 6.5 | 2019/6/24 | 1.26 |
| 23 | インドネシア | 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT | 2,390,000,000 | 1.00 | 23,961,542 | 1.01 | 24,264,845 | 11 | 2025/9/15 | 1.25 |
| 24 | トルコ | 国債証券 | TURKEY GOVERNMENT BOND | 640,000 | 3,462.65 | 22,160,997 | 3,575.70 | 22,884,480 | 8 | 2025/3/12 | 1.18 |
| 25 | メキシコ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 2,700,000 | 836.21 | 22,577,698 | 838.02 | 22,626,779 | 10 | 2024/12/5 | 1.17 |
| 26 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 760,000 | 2,923.54 | 22,218,952 | 2,925.79 | 22,236,051 | 4.24 | 2018/2/7 | 1.15 |
| 27 | ブラジル | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL | 1,020,000 | 2,079.48 | 21,210,699 | 2,172.55 | 22,160,063 | | 2019/1/1 | 1.14 |
| 28 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 750,000 | 2,892.17 | 21,691,336 | 2,893.46 | 21,700,987 | 3.58 | 2018/9/28 | 1.12 |
| 29 | インドネシア | 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT | 2,480,000,000 | 0.83 | 20,780,035 | 0.86 | 21,391,267 | 8.375 | 2034/3/15 | 1.10 |
| 30 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 750,000 | 2,808.68 | 21,065,100 | 2,824.77 | 21,185,794 | 3.418 | 2022/8/15 | 1.09 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 97.42 |
| 合計 | 97.42 |

（参考）J - R E I Tインデックス 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) | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|-------------------------|-------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 2,391 | 574,563 | 1,373,780,363 | 667,000 | 1,594,797,000 | 7.83 |
| 2 | 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 2,217 | 567,083 | 1,257,223,049 | 650,000 | 1,441,050,000 | 7.08 |
| 3 | 日本 | 投資証券 | 日本リートファンド投資法人 投資証券 | 4,322 | 242,604 | 1,048,536,367 | 270,200 | 1,167,804,400 | 5.73 |
| 4 | 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 6,303 | 156,152 | 984,228,148 | 168,000 | 1,058,904,000 | 5.20 |
| 5 | 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 4,660 | 177,668 | 827,933,112 | 181,900 | 847,654,000 | 4.16 |
| 6 | 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 3,110 | 232,991 | 724,602,935 | 251,900 | 783,409,000 | 3.84 |
| 7 | 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 投資証券 | 4,093 | 172,144 | 704,588,261 | 174,500 | 714,228,500 | 3.50 |
| 8 | 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券 | 1,478 | 403,803 | 596,821,964 | 458,500 | 677,663,000 | 3.33 |
| 9 | 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 2,202 | 292,907 | 644,981,682 | 284,900 | 627,349,800 | 3.08 |
| 10 | 日本 | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 1,016 | 529,565 | 538,038,665 | 584,000 | 593,344,000 | 2.91 |
| 11 | 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 投資証券 | 820 | 610,166 | 500,336,491 | 700,000 | 574,000,000 | 2.82 |
| 12 | 日本 | 投資証券 | GLP投資法人 投資証券 | 4,393 | 119,985 | 527,096,104 | 128,300 | 563,621,900 | 2.76 |
| 13 | 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券 | 5,626 | 81,332 | 457,577,432 | 99,100 | 557,536,600 | 2.73 |
| 14 | 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 投資証券 | 6,187 | 65,289 | 403,946,344 | 84,400 | 522,182,800 | 2.56 |
| 15 | 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 2,965 | 157,973 | 468,391,569 | 166,500 | 493,672,500 | 2.42 |
| 16 | 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 840 | 552,317 | 463,947,029 | 541,000 | 454,440,000 | 2.23 |
| 17 | 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 686 | 622,959 | 427,350,173 | 646,000 | 443,156,000 | 2.17 |
| 18 | 日本 | 投資証券 | 森トラスト総合リート投資法人 投資証券 | 2,236 | 223,083 | 498,815,782 | 194,600 | 435,125,600 | 2.13 |
| 19 | 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 821 | 461,489 | 378,882,566 | 433,500 | 355,903,500 | 1.74 |
| 20 | 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 1,490 | 246,137 | 366,744,419 | 235,100 | 350,299,000 | 1.72 |
| 21 | 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券 | 2,141 | 148,971 | 318,948,023 | 152,000 | 325,432,000 | 1.59 |
| 22 | 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 投資証券 | 2,218 | 151,167 | 335,290,215 | 144,200 | 319,835,600 | 1.57 |
| 23 | 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 投資証券 | 597 | 550,248 | 328,498,485 | 523,000 | 312,231,000 | 1.53 |
| 24 | 日本 | 投資証券 | プレミアム投資法人 投資証券 | 2,230 | 131,702 | 293,695,910 | 139,100 | 310,193,000 | 1.52 |
| 25 | 日本 | 投資証券 | 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 1,266 | 263,514 | 333,609,579 | 234,800 | 297,256,800 | 1.46 |
| 26 | 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 1,607 | 175,196 | 281,540,516 | 183,000 | 294,081,000 | 1.44 |
| 27 | 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 594 | 517,541 | 307,419,555 | 493,500 | 293,139,000 | 1.44 |
| 28 | 日本 | 投資証券 | 福岡リート投資法人 投資証券 | 1,265 | 210,011 | 265,664,364 | 203,500 | 257,427,500 | 1.26 |
| 29 | 日本 | 投資証券 | 東急リアル・エステート投資法人 投資証券 | 1,656 | 153,746 | 254,603,658 | 154,500 | 255,852,000 | 1.25 |
| 30 | 日本 | 投資証券 | 日本賃貸住宅投資法人 投資証券 | 2,778 | 82,888 | 230,263,237 | 83,100 | 230,851,800 | 1.13 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 投資証券 | 98.04 |
| 合計 | 98.04 |

(参考) 海外REITインデックス 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) | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|-------------------------------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 47,850 | 20,001.82 | 957,087,413 | 23,181.65 | 1,109,242,259 | 5.91 |
| 2 | アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 22,800 | 22,054.85 | 502,850,726 | 30,785.30 | 701,904,904 | 3.74 |
| 3 | アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL | 56,500 | 8,069.01 | 455,899,336 | 8,434.09 | 476,526,537 | 2.54 |
| 4 | フランス | 投資証券 | UNIBAIL RODAMCO-NA | 15,140 | 29,031.31 | 439,534,155 | 31,286.50 | 473,677,610 | 2.52 |
| 5 | アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 21,200 | 18,465.99 | 391,479,166 | 21,277.36 | 451,080,125 | 2.40 |
| 6 | アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 54,900 | 7,572.09 | 415,708,070 | 7,761.39 | 426,100,772 | 2.27 |
| 7 | アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 81,100 | 4,430.57 | 359,319,843 | 4,920.73 | 399,071,657 | 2.12 |
| 8 | アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 52,000 | 6,221.06 | 323,495,266 | 7,094.33 | 368,905,306 | 1.96 |
| 9 | アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES | 23,750 | 13,982.46 | 332,083,453 | 14,278.80 | 339,121,728 | 1.80 |
| 10 | オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP | 836,000 | 337.54 | 282,185,056 | 378.63 | 316,540,950 | 1.68 |
| 11 | アメリカ | 投資証券 | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 90,000 | 2,992.78 | 269,350,272 | 3,325.18 | 299,266,812 | 1.59 |
| 12 | アメリカ | 投資証券 | VORNADO REALTY TRUST | 27,400 | 10,865.73 | 297,721,068 | 10,588.53 | 290,125,985 | 1.54 |
| 13 | アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 38,700 | 5,263.28 | 203,689,044 | 7,009.82 | 271,280,142 | 1.44 |
| 14 | アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 10,100 | 24,065.06 | 243,057,183 | 26,181.19 | 264,430,100 | 1.41 |
| 15 | アメリカ | 投資証券 | HCP INC | 71,900 | 4,140.98 | 297,737,180 | 3,655.33 | 262,818,888 | 1.40 |
| 16 | オーストラリア | 投資証券 | WESTFIELD CORP | 300,100 | 788.28 | 236,563,818 | 865.08 | 259,612,759 | 1.38 |
| 17 | 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 353,500 | 657.84 | 232,548,799 | 674.19 | 238,326,872 | 1.27 |
| 18 | アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 22,600 | 7,513.50 | 169,805,154 | 9,953.02 | 224,938,351 | 1.19 |
| 19 | イギリス | 投資証券 | LAND SECURITIES GROUP PLC | 123,300 | 1,998.09 | 246,364,842 | 1,763.30 | 217,415,975 | 1.15 |
| 20 | アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC | 116,100 | 2,110.49 | 245,028,632 | 1,854.71 | 215,332,156 | 1.14 |
| 21 | アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 63,900 | 2,661.50 | 170,069,952 | 3,229.40 | 206,359,222 | 1.10 |
| 22 | アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 19,300 | 7,918.02 | 152,817,855 | 10,424.02 | 201,183,717 | 1.07 |
| 23 | アメリカ | 投資証券 | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 10,750 | 14,940.24 | 160,607,592 | 17,571.31 | 188,891,681 | 1.00 |
| 24 | イギリス | 投資証券 | BRITISH LAND | 159,200 | 1,314.13 | 209,210,380 | 1,148.01 | 182,763,638 | 0.97 |
| 25 | アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 41,200 | 3,651.95 | 150,460,703 | 4,310.01 | 177,572,412 | 0.94 |
| 26 | アメリカ | 投資証券 | MACERICH CO /THE | 19,600 | 8,951.29 | 175,445,464 | 8,906.22 | 174,562,053 | 0.93 |
| 27 | アメリカ | 投資証券 | SL GREEN REALTY CORP | 15,500 | 12,690.02 | 196,695,334 | 10,801.50 | 167,423,324 | 0.89 |
| 28 | フランス | 投資証券 | KLEPIERRE | 29,416 | 5,016.73 | 147,572,326 | 5,370.42 | 157,976,378 | 0.84 |
| 29 | オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 245,000 | 526.01 | 128,873,709 | 575.28 | 140,945,437 | 0.75 |
| 30 | アメリカ | 投資証券 | VEREIT INC | 139,500 | 956.65 | 133,453,121 | 996.09 | 138,954,722 | 0.74 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|----|----------|
|----|----------|

| | |
|------|-------|
| 投資証券 | 97.75 |
| 合計 | 97.75 |

(参考) 野村マネー 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 | 社債券 | みずほコーポレート銀行 第26回特定社債間限定同順位特約付 | 600,000,000 | 100.14 | 600,875,839 | 100.14 | 600,875,839 | 0.54 | 2016/7/20 | 2.85 |
| 2 | 日本 | 社債券 | 三菱UFJリース 第13回社債間限定同順位特約付 | 500,000,000 | 100.04 | 500,226,693 | 100.04 | 500,226,693 | 0.796 | 2016/4/22 | 2.37 |
| 3 | 日本 | 社債券 | 三菱UFJリース 第15回社債間限定同順位特約付 | 400,000,000 | 100.39 | 401,577,249 | 100.39 | 401,577,249 | 0.66 | 2016/12/14 | 1.90 |
| 4 | 日本 | 社債券 | みずほコーポレート銀行 第27回特定社債間限定同順位特約付 | 400,000,000 | 100.27 | 401,086,157 | 100.27 | 401,086,157 | 0.515 | 2016/10/20 | 1.90 |
| 5 | 日本 | 特殊債券 | 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第46回 | 390,000,000 | 100.04 | 390,178,993 | 100.04 | 390,178,993 | 0.255 | 2016/6/20 | 1.85 |
| 6 | 日本 | 特殊債券 | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第12回 | 300,000,000 | 100.31 | 300,956,526 | 100.31 | 300,956,526 | 2 | 2016/5/31 | 1.42 |
| 7 | 日本 | 特殊債券 | 商工債券 利付第736回い号 | 300,000,000 | 100.18 | 300,552,403 | 100.18 | 300,552,403 | 0.45 | 2016/9/27 | 1.42 |
| 8 | 日本 | 特殊債券 | しんきん中金債券 利付第261回 | 300,000,000 | 100.17 | 300,529,160 | 100.17 | 300,529,160 | 0.45 | 2016/8/26 | 1.42 |
| 9 | 日本 | 特殊債券 | 商工債券 利付第733回い号 | 300,000,000 | 100.11 | 300,341,411 | 100.11 | 300,341,411 | 0.55 | 2016/6/27 | 1.42 |
| 10 | 日本 | 特殊債券 | しんきん中金債券 利付第258回 | 300,000,000 | 100.07 | 300,223,447 | 100.07 | 300,223,447 | 0.55 | 2016/5/27 | 1.42 |
| 11 | 日本 | 社債券 | みずほコーポレート銀行 第25回特定社債間限定同順位特約付 | 300,000,000 | 100.03 | 300,115,294 | 100.03 | 300,115,294 | 0.755 | 2016/4/20 | 1.42 |
| 12 | 日本 | 特殊債券 | 商工債券 利付(3年)第164回 | 200,000,000 | 100.06 | 200,120,174 | 100.06 | 200,120,174 | 0.2 | 2016/9/27 | 0.94 |
| 13 | 日本 | 特殊債券 | 農林債券 利付第731回い号 | 200,000,000 | 100.05 | 200,105,940 | 100.05 | 200,105,940 | 0.75 | 2016/4/27 | 0.94 |
| 14 | 日本 | 特殊債券 | 商工債券 利付(3年)第161回 | 200,000,000 | 100.04 | 200,083,844 | 100.04 | 200,083,844 | 0.25 | 2016/6/27 | 0.94 |
| 15 | 日本 | 特殊債券 | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第34回 | 200,000,000 | 100.04 | 200,081,672 | 100.04 | 200,081,672 | 0.243 | 2016/6/20 | 0.94 |
| 16 | 日本 | コマーシャルペーパー | 三井住友F&L | 200,000,000 | | 199,994,246 | | 199,994,246 | | | 0.94 |
| 17 | 日本 | コマーシャルペーパー | 三井住友F&L | 200,000,000 | | 199,991,205 | | 199,991,205 | | | 0.94 |
| 18 | 日本 | コマーシャルペーパー | 三井住友F&L | 200,000,000 | | 199,969,319 | | 199,969,319 | | | 0.94 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|------------|-----------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-------|-----------|------|
| 19 | 日本 | コマーシャルペーパー | 三井住友信託銀行 | 200,000,000 | | 199,957,625 | | 199,957,625 | | | 0.94 |
| 20 | 日本 | コマーシャルペーパー | 三井住友F&L | 200,000,000 | | 199,943,287 | | 199,943,287 | | | 0.94 |
| 21 | 日本 | 特殊債券 | 農林債券 利付第733回い号 | 180,000,000 | 100.11 | 180,206,973 | 100.11 | 180,206,973 | 0.55 | 2016/6/27 | 0.85 |
| 22 | 日本 | 特殊債券 | 商工債券 利付第734回い号 | 170,000,000 | 100.15 | 170,259,795 | 100.15 | 170,259,795 | 0.55 | 2016/7/27 | 0.80 |
| 23 | 日本 | 特殊債券 | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第11回 | 170,000,000 | 100.12 | 170,208,318 | 100.12 | 170,208,318 | 1.8 | 2016/4/26 | 0.80 |
| 24 | 日本 | 特殊債券 | 農林債券 利付第736回い号 | 150,000,000 | 100.21 | 150,316,524 | 100.21 | 150,316,524 | 0.5 | 2016/9/27 | 0.71 |
| 25 | 日本 | 特殊債券 | 農林債券 利付第735回い号 | 150,000,000 | 100.15 | 150,228,048 | 100.15 | 150,228,048 | 0.45 | 2016/8/26 | 0.71 |
| 26 | 日本 | 特殊債券 | 首都高速道路第8回 | 140,000,000 | 100.16 | 140,231,864 | 100.16 | 140,231,864 | 0.439 | 2016/9/20 | 0.66 |
| 27 | 日本 | 特殊債券 | 公営企業債券 政府保証第862回 | 117,000,000 | 100.09 | 117,116,740 | 100.09 | 117,116,740 | 1.8 | 2016/4/20 | 0.55 |
| 28 | 日本 | 地方債証券 | 大阪府 公募(5年)第73回 | 102,000,000 | 100.07 | 102,072,341 | 100.07 | 102,072,341 | 0.51 | 2016/5/30 | 0.48 |
| 29 | 日本 | 地方債証券 | 東京都 公募第636回 | 101,500,000 | 100.43 | 101,937,847 | 100.43 | 101,937,847 | 2.04 | 2016/6/20 | 0.48 |
| 30 | 日本 | 地方債証券 | 神奈川県 公募(5年)第49回 | 101,700,000 | 100.14 | 101,849,799 | 100.14 | 101,849,799 | 0.37 | 2016/9/20 | 0.48 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------------|---------|
| 地方債証券 | 3.91 |
| 特殊債券 | 24.54 |
| 社債券 | 12.35 |
| コマーシャルペーパー | 8.06 |
| 合計 | 48.88 |

【投資不動産物件】

野村DC運用戦略ファンド

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村マネー 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】

野村DC運用戦略ファンド

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

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

| 種類 | 取引所 | 名称 | 買建/ 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------|-------|--------------------|-----------|-----|-----|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物 取引 | 大阪取引所 | TOPIX先物(2016年06月限) | 買建 | 350 | 日本円 | 4,736,052,120 | 4,716,250,000 | 1.66 |

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式M S C I - K O K U S A Iマザーファンド

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

| 種類 | 国/地域 | 取引所 | 名称 | 買建/ 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 | 帳簿価額 (円) | 評価額 | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------------|----------|--|--|-----------|-----|----------------|--------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| 株価指 数先物 取引 | アメリカ | シカゴ マーカ ンタイ ル取引 所 | E-mini S&P500株 価指数先物(2016 年06月限) | 買建 | 483 | 米ドル | 48,668,367.5 | 5,483,951,650 | 49,634,287.5 | 5,592,791,515 | 1.71 |
| | カナダ | モント リオー ル取引 所 | S&P TSX60株価指 数先物(2016年06 月限) | 買建 | 24 | カナダ ドル | 3,776,140 | 327,731,191 | 3,786,720 | 328,649,428 | 0.10 |
| | ドイツ | ユーレ ック ス・ド イツ 金融 先物 取引 所 | ユーロ50株価指 数先物(2016年06 月限) | 買建 | 287 | ユーロ | 8,583,220 | 1,096,077,194 | 8,518,160 | 1,087,769,032 | 0.33 |
| | イギリ ス | ロンド ン国 際金 融先 物オ プシ ョン 取引 所 | FT100株価指 数先物(2016年06 月限) | 買建 | 68 | 英ポ ンド | 4,140,070 | 670,360,138 | 4,180,300 | 676,874,176 | 0.20 |
| | スイス | ユーレ ック ス・チ ュー リッ ヒ取 引所 | SMI株価指 数先物 (2016年06月限) | 買建 | 36 | スイ スフ ラン | 2,809,250 | 327,951,845 | 2,777,040 | 324,191,646 | 0.09 |

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国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 | 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 | インター コン チネ ンタ ル取 引所 | E-mini MSCIエ マー ジ ン グ マ ー ケ ット 株 価 指 数 先 物 (2016年06月限) | 買建 | 69 | 米ドル | 2,798,885 | 315,378,360 | 2,879,370 | 324,447,407 | 2.33 |

(参考) 新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) J-REITインデックス 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 (%) |
|----------------|-------|---------------------|-----------|-----|-----|-------------|-------------|-----------------|
| REIT指数先物 取引 | 大阪取引所 | REIT指数先物(2016年06月限) | 買建 | 210 | 日本円 | 391,462,680 | 396,480,000 | 1.94 |

(参考) 海外REITインデックス 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 ボード オブ トレー ド | ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2016年06月限) | 買建 | 39 | 米ドル | 1,149,330 | 129,506,504 | 1,187,160 | 133,769,188 | 0.71 |
| | フラン ス | Euronext | FTSE EPRA/NAREIT 欧州指数先物(2016 年06月限) | 買建 | 6 | ユーロ | 125,430 | 16,017,411 | 127,620 | 16,297,074 | 0.08 |

(参考) 野村マネー 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】

野村DC運用戦略ファンド

平成28年3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 | (2013年 2月18日) | 49 | 49 | 1.0455 | 1.0460 |
| 第2計算期間 | (2014年 2月17日) | 1,930 | 1,931 | 1.0180 | 1.0185 |
| 第3計算期間 | (2015年 2月17日) | 2,707 | 2,708 | 1.0970 | 1.0975 |
| 第4計算期間 | (2016年 2月17日) | 3,631 | 3,633 | 1.0481 | 1.0486 |
| | 2015年 3月末日 | 2,815 | | 1.1028 | |

| | | | |
|------------|-------|--|--------|
| 4月末日 | 2,867 | | 1.0986 |
| 5月末日 | 2,875 | | 1.0863 |
| 6月末日 | 2,860 | | 1.0605 |
| 7月末日 | 2,977 | | 1.0690 |
| 8月末日 | 2,958 | | 1.0548 |
| 9月末日 | 3,017 | | 1.0501 |
| 10月末日 | 3,166 | | 1.0617 |
| 11月末日 | 3,261 | | 1.0608 |
| 12月末日 | 3,603 | | 1.0535 |
| 2016年 1月末日 | 3,644 | | 1.0506 |
| 2月末日 | 3,688 | | 1.0576 |
| 3月末日 | 4,874 | | 1.0716 |

【分配の推移】

野村DC運用戦略ファンド

| | 計算期間 | 1口当たりの分配金 |
|--------|-------------------------|-----------|
| 第1計算期間 | 2012年 2月28日～2013年 2月18日 | 0.0005円 |
| 第2計算期間 | 2013年 2月19日～2014年 2月17日 | 0.0005円 |
| 第3計算期間 | 2014年 2月18日～2015年 2月17日 | 0.0005円 |
| 第4計算期間 | 2015年 2月18日～2016年 2月17日 | 0.0005円 |

【収益率の推移】

野村DC運用戦略ファンド

| | 計算期間 | 収益率 |
|--------|-------------------------|------|
| 第1計算期間 | 2012年 2月28日～2013年 2月18日 | 4.6% |
| 第2計算期間 | 2013年 2月19日～2014年 2月17日 | 2.6% |
| 第3計算期間 | 2014年 2月18日～2015年 2月17日 | 7.8% |
| 第4計算期間 | 2015年 2月18日～2016年 2月17日 | 4.4% |

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】

野村DC運用戦略ファンド

| | 計算期間 | 設定口数 | 解約口数 | 発行済み口数 |
|--|------|------|------|--------|
|--|------|------|------|--------|

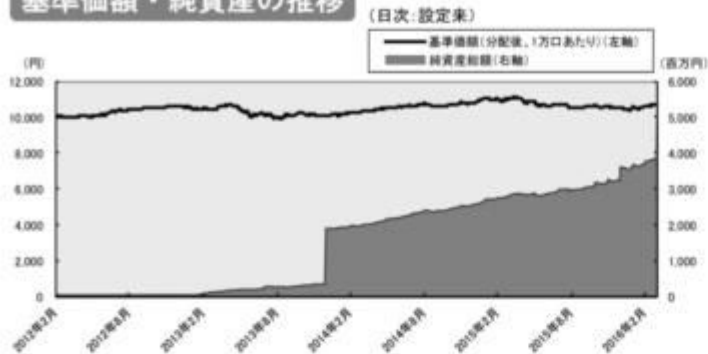
| | | | | |
|--------|---------------------------|---------------|-------------|---------------|
| 第1計算期間 | 2012年 2月28日 ~ 2013年 2月18日 | 47,323,294 | | 47,323,294 |
| 第2計算期間 | 2013年 2月19日 ~ 2014年 2月17日 | 2,003,508,647 | 154,192,604 | 1,896,639,337 |
| 第3計算期間 | 2014年 2月18日 ~ 2015年 2月17日 | 999,136,243 | 427,656,828 | 2,468,118,752 |
| 第4計算期間 | 2015年 2月18日 ~ 2016年 2月17日 | 1,637,926,200 | 641,423,568 | 3,464,621,384 |

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

運用実績 (2016年3月31日現在)

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万口あたり、課税前)

| | |
|---------|------|
| 2016年2月 | 5 円 |
| 2015年2月 | 5 円 |
| 2014年2月 | 5 円 |
| 2013年2月 | 5 円 |
| — | — |
| 設定来累計 | 20 円 |

主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

| 銘柄 | 投資比率 (%) |
|-------------------------|----------|
| 国内株式マザーファンド | 1.2 |
| 国内債券マザーファンド | 3.0 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 5.9 |
| 外国債券マザーファンド | 33.2 |
| 新興国株式マザーファンド | 0.0 |
| 新興国債券マザーファンド | 8.2 |
| 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | 2.4 |
| J-REITインデックス マザーファンド | 10.3 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 6.4 |
| 野村マネー マザーファンド | 7.9 |

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 | 0.0 |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 0.0 |
| 3 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 0.0 |
| 4 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 0.0 |
| 5 | KDDI | 情報・通信業 | 0.0 |

・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|-------------------|------|----------|
| 1 | 国庫債券 利付(10年)第338回 | 国債証券 | 0.1 |
| 2 | 国庫債券 利付(20年)第99回 | 国債証券 | 0.1 |
| 3 | 国庫債券 利付(5年)第123回 | 国債証券 | 0.1 |
| 4 | 国庫債券 利付(2年)第360回 | 国債証券 | 0.0 |
| 5 | 国庫債券 利付(10年)第320回 | 国債証券 | 0.0 |

・「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 | 0.1 |
| 2 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア | 0.1 |
| 3 | EXXON MOBIL CORP | 石油・ガス・消耗燃料 | 0.1 |
| 4 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品 | 0.1 |
| 5 | GENERAL ELEC CO | コングロマリット | 0.1 |

・「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 N/B | 国債証券 | 0.3 |
| 2 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.3 |
| 3 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.3 |
| 4 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.3 |
| 5 | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.3 |

・「新興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 | RUSSIA | 国債証券 | 0.3 |
| 2 | PHILIPPINES GLOBAL | 国債証券 | 0.2 |
| 3 | RUSSIA | 国債証券 | 0.1 |
| 4 | BRAZIL GLOBAL | 国債証券 | 0.1 |
| 5 | TURKEY GLOBAL | 国債証券 | 0.1 |

・「新興国債券(現地通貨建て)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 | RUSSIA FOREIGN BOND | 国債証券 | 0.1 |
| 2 | REPUBLIC OF COLOMBIA | 国債証券 | 0.1 |
| 3 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.1 |
| 4 | LETRA TESOURO NACIONAL | 国債証券 | 0.1 |
| 5 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 国債証券 | 0.1 |

・「J-REITインデックス 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 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.8 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.7 |
| 3 | 日本リートファンド投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.6 |
| 4 | 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.5 |
| 5 | ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.4 |

・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

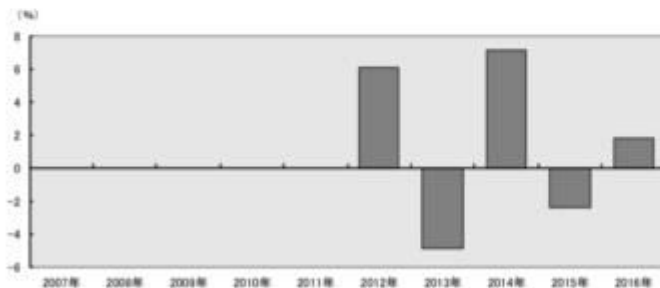
| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|---------------------------|------|-------------|
| 1 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 投資証券 | 0.4 |
| 2 | PUBLIC STORAGE | 投資証券 | 0.2 |
| 3 | EQUITY RESIDENTIAL | 投資証券 | 0.2 |
| 4 | UNIBAIL RODAMCO-NA | 投資証券 | 0.2 |
| 5 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 投資証券 | 0.2 |

・「野村マネー 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 | みずほコーポレート銀行 第26回特定社債間限定同順位特約付 | 社債券 | 0.2 |
| 2 | 三菱UFJリース 第13回社債間限定同順位特約付 | 社債券 | 0.2 |
| 3 | 三菱UFJリース 第15回社債間限定同順位特約付 | 社債券 | 0.2 |
| 4 | みずほコーポレート銀行 第27回特定社債間限定同順位特約付 | 社債券 | 0.2 |
| 5 | 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第46回 | 特殊債券 | 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。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2012年は設定日(2012年2月28日)から年末までの収益率。
- ・2016年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

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

取得申込みの受付については、午後3時までに取得申込みが行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き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)手続き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。

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

＜申込手数料＞

ありません。

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

2【換金（解約）手続等】

受益者は、委託者に1口単位で一部解約の実行を請求することができます。

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

一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分とします。

換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

当ファンドは、買取りは行いません。

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/>

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6営業日目から販売会社において支払います。

ただし、金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、信託約款の規定に従い、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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すで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。

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、当該受益権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て信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

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および借入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従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せん。

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 |
| REIT (不動産投資信託) | 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。 |
| 外貨建資産 | 原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。 |

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

無期限とします(平成24年2月28日設定)。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年2月18日から翌年2月17日までとします。

また、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。なお、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、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、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」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- () 上記()の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- () 上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- () 上記()から()までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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()から()までに規定するこの信託契約の解約の手続を行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投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更等()」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(c) 運用報告書

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、知っている受益者に対して交付します。

(d) 信託約款の変更等

- () 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- () 委託者は、上記()の事項（上記()の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- () 上記()の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、

議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- () 上記()の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- () 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- () 上記()から()までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- () 上記()から()の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(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) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- () 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d)信託約款の変更等」に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。
- () 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。

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行なう場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示請求を行うことはできません。

- 1.他の受益者の氏名または名称および住所
- 2.他の受益者が有する受益権の内容

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

収益分配金は、原則、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。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）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、6営業日目から受益者にお支払いします。

ただし、金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、信託約款の規定に従い、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

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4期計算期間(平成27年2月18日から平成28年2月17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】

【野村DC運用戦略ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第3期 (平成27年 2月17日現在) | 第4期 (平成28年 2月17日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | - | 275,765,467 |
| コール・ローン | 77,491,098 | 412,186,646 |
| 親投資信託受益証券 | 2,657,147,379 | 2,888,052,611 |
| 派生商品評価勘定 | 14,850,245 | 90,804,431 |
| 未収利息 | 137 | 12 |
| 流動資産合計 | 2,749,488,859 | 3,666,809,167 |
| 資産合計 | 2,749,488,859 | 3,666,809,167 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 15,025,180 | - |
| 未払収益分配金 | 1,234,059 | 1,732,310 |
| 未払解約金 | 9,494,040 | 12,674,487 |
| 未払受託者報酬 | 672,662 | 877,614 |
| 未払委託者報酬 | 15,471,142 | 20,185,001 |
| その他未払費用 | 40,302 | 52,593 |
| 流動負債合計 | 41,937,385 | 35,522,005 |
| 負債合計 | 41,937,385 | 35,522,005 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 2,468,118,752 | 3,464,621,384 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 239,432,722 | 166,665,778 |
| (分配準備積立金) | 161,469,868 | 167,318,382 |
| 元本等合計 | 2,707,551,474 | 3,631,287,162 |
| 純資産合計 | 2,707,551,474 | 3,631,287,162 |
| 負債純資産合計 | 2,749,488,859 | 3,666,809,167 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第3期 | | 第4期 | |
|---|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
| | 自 | 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日 | 自 | 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 116,531 | | 401,380 |
| 有価証券売買等損益 | | 351,440,274 | | 147,008,742 |
| 為替差損益 | | 152,458,401 | | 51,263,174 |
| その他収益 | | 687 | | - |
| 営業収益合計 | | 199,099,091 | | 95,344,188 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 1,235,933 | | 1,637,765 |
| 委託者報酬 | | 28,426,256 | | 37,668,422 |
| その他費用 | | 95,636 | | 108,942 |
| 営業費用合計 | | 29,757,825 | | 39,415,129 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 169,341,266 | | 134,759,317 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 169,341,266 | | 134,759,317 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 169,341,266 | | 134,759,317 |
| 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（ ） | | 16,378,298 | | 15,950,280 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 34,187,219 | | 239,432,722 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 64,500,919 | | 107,198,905 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 64,500,919 | | 107,198,905 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 10,984,325 | | 59,424,502 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 10,984,325 | | 59,424,502 |
| 分配金 | | 1,234,059 | | 1,732,310 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 239,432,722 | | 166,665,778 |

(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。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。 |
| 2. 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。 為替差損益 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。 |
| 4. その他 | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成27年 2月18日から平成28年 2月17日までとなっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 第3期 平成27年 2月17日現在 | 第4期 平成28年 2月17日現在 |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,468,118,752口 | 1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,464,621,384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 1.0970円 (10,000口当たり純資産額) (10,970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 1.0481円 (10,000口当たり純資産額) (10,481円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第3期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日 | 第4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17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>66,346,388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>84,496,929円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>99,205,249円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>11,860,610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>261,909,176円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,468,118,752口</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 66,346,388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 | 84,496,929円 | 収益調整金額 | C | 99,205,249円 | 分配準備積立金額 | D | 11,860,610円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 261,909,176円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,468,118,752口 | <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>40,478,887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>240,632,590円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>128,571,805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>409,683,282円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,464,621,384口</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 40,478,887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 | 240,632,590円 | 分配準備積立金額 | D | 128,571,805円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 409,683,282円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 3,464,621,384口 |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 66,346,388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 | 84,496,929円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 99,205,249円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 11,860,610円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 261,909,176円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 2,468,118,752口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 40,478,887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 | 240,632,590円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 128,571,805円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 409,683,282円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 3,464,621,384口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | | | | | |
|-------------------|-----------------------|------------|-------------------|-----------------------|------------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 1,061円 | 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 1,182円 |
| 10,000口当たり分配金額 | H | 5円 | 10,000口当たり分配金額 | H | 5円 |
| 収益分配金金額 | $I=F \times H/10,000$ | 1,234,059円 | 収益分配金金額 | $I=F \times H/10,000$ | 1,732,310円 |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 第3期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日 | 第4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17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、(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>当ファンドは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされておりますが、主要投資対象である親投資信託受益証券の保有状況によっては、市場リスクの内容は変動する場合があります。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</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なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> | <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 第3期 平成27年 2月17日現在 | 第4期 平成28年 2月17日現在 |
|---|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 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。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p> |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第3期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日 | 第4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17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3期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日 | 第4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日 |
|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 期首元本額 1,896,639,337円 | 期首元本額 2,468,118,752円 |
| 期中追加設定元本額 999,136,243円 | 期中追加設定元本額 1,637,926,200円 |
| 期中一部解約元本額 427,656,828円 | 期中一部解約元本額 641,423,568円 |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類 | 第3期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日 | 第4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17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 | 267,232,241 | 104,410,862 |

| | | |
|----|-------------|-------------|
| 合計 | 267,232,241 | 104,410,862 |
|----|-------------|-------------|

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

| 種類 | 第3期(平成27年 2月17日現在) | | | | 第4期(平成28年 2月17日現在) | | | |
|-----------|--------------------|-------|---------------|------------|--------------------|-------|---------------|------------|
| | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | うち1年超 | | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売建 | 2,577,391,865 | - | 2,577,566,800 | 174,935 | 1,929,822,531 | - | 1,839,018,100 | 90,804,431 |
| 米ドル | 1,425,892,880 | - | 1,438,802,800 | 12,909,920 | 1,012,275,830 | - | 955,018,600 | 57,257,230 |
| カナダドル | 55,065,000 | - | 52,201,500 | 2,863,500 | 48,187,705 | - | 45,314,500 | 2,873,205 |
| ユーロ | 852,825,485 | - | 845,145,000 | 7,680,485 | 673,958,771 | - | 655,265,500 | 18,693,271 |
| 英ポンド | 191,336,000 | - | 190,828,500 | 507,500 | 147,581,935 | - | 138,748,500 | 8,833,435 |
| 豪ドル | 52,272,500 | - | 50,589,000 | 1,683,500 | 47,818,290 | - | 44,671,000 | 3,147,290 |
| 合計 | 2,577,391,865 | - | 2,577,566,800 | 174,935 | 1,929,822,531 | - | 1,839,018,100 | 90,804,431 |

(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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17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 | | 79,327,970 | |
| | | 国内債券マザーファンド | | 233,351,998 | |
| | | 外国債券マザーファンド | | 1,462,129,358 | |
| | | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | | 189,930,825 | |
| | | 野村マネー マザーファンド | | 387,065,601 | |
| | | J-REITインデックス マザーファンド | | 233,813,435 | |
| | | 海外REITインデックス マザーファンド | | 109,666,467 | |
| | | 新興国債券マザーファンド | | 154,795,562 | |
| | | 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | | 37,971,395 | |
| | 小計 | 銘柄数:9 組入時価比率:79.5% | | 2,888,052,611 100.0% | |
| 合計 | | | 2,888,052,611 | | |

(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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

(参考)

当ファンドは、当該計算期間末現在、主要投資対象である親投資信託受益証券のうち、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」受益証券に投資しており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

| | |
|-----------------|------------------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 10,888,901,692 |
| コール・ローン | 16,275,641,465 |
| 株式 | 257,290,312,740 |
| 派生商品評価勘定 | 476,046 |
| 未収入金 | 33,614,000 |
| 未収配当金 | 369,926,713 |
| 未収利息 | 499 |
| その他未収収益 | 3,152,429 |
| 差入委託証拠金 | 446,750,000 |
| 流動資産合計 | 285,308,775,584 |
| 資産合計 | 285,308,775,584 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 252,949,762 |
| 未払金 | 4,452,755,560 |
| 未払解約金 | 318,734,899 |
| 未払利息 | 262,666 |
| 有価証券貸借取引受入金 | 19,069,860,179 |
| 流動負債合計 | 24,094,563,066 |
| 負債合計 | 24,094,563,066 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 220,768,182,636 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 40,446,029,882 |
| 元本等合計 | 261,214,212,518 |
| 純資産合計 | 261,214,212,518 |
| 負債純資産合計 | 285,308,775,584 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|--------------------|--|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 |

| | |
|------------------------|---|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |
|------------------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年 2月17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 | 1.1832円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (11,832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 | 18,114,434,310円 |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日 | |
|--------------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。 |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年 2月17日現在 | |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |

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

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 平成28年 2月17日現在 | |
|----------------------------------|------------------|
| 期首 | 平成27年 2月18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 | 180,721,457,487円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 76,345,372,635円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 36,298,647,486円 |
| 期末元本額 | 220,768,182,636円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 192,863,772円 |
| バランスセレクト50 | 453,435,803円 |
| バランスセレクト70 | 507,658,647円 |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース） | 1,403,521,952円 |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース） | 5,225,817,000円 |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース） | 8,896,568,001円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 97,628,538円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 113,274,122円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 126,558,441円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 122,255,431円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 88,159,440円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 302,008,341円 |
| 野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け） | 78,673,809,835円 |
| のむらっぴ・ファンド（保守型） | 1,267,694,159円 |
| のむらっぴ・ファンド（普通型） | 3,296,559,570円 |
| のむらっぴ・ファンド（積極型） | 1,044,087,924円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 29,687,720円 |
| 野村インデックスファンド・TOPIX | 1,509,769,945円 |
| マイ・ロード | 2,456,721,023円 |
| ネクストコア | 55,213,757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 | 285,373,152円 |
| 野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け） | 1,317,037,453円 |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース） | 391,388,063円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 8,521,348円 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用） | 1,028,729,673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） | 702,694,818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） | 4,904,998,527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) | 1,180,678,773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) | 13,520,591円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | 47,847,458円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用) | 19,316,640円 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 7,216,244,487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) | 500,285,730円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 3,275,426,785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) | 1,354,706,663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) | 2,430,844,075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) | 476,779,123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) | 75,904,893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) | 403,649,004円 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 6,368,900,750円 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 967,495,938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) | 591,885,045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) | 495,229,009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) | 50,606,128円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 10,795,522円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 37,407,817円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 37,919,368円 |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け) | 95,860,097円 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 4,041,488,983円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 12,724,110,038円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 16,079,210,340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) | 31,721,826,410円 |
| マイバランスDC30 | 2,150,345,304円 |
| マイバランスDC50 | 2,893,563,035円 |
| マイバランスDC70 | 2,537,267,720円 |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX | 8,332,035,278円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 67,045,276円 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 394,384円 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 867,645円 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 65,493,197円 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 343,976円 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 850,699円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式(平成28年 2月17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 | 64,000 | 257.00 | 16,448,000 | 貸付有価証券 19,000株(19,000株) |
| | | 日本水産 | 175,200 | 536.00 | 93,907,200 | |
| | | マルハニチロ | 31,100 | 2,116.00 | 65,807,600 | 貸付有価証券 100株 |
| | | サカタのタネ | 22,400 | 2,737.00 | 61,308,800 | |
| | | ホクト | 15,500 | 2,027.00 | 31,418,500 | |
| | | 住石ホールディングス | 44,700 | 94.00 | 4,201,800 | 貸付有価証券 16,800株(12,600株) |
| | | 日鉄鉱業 | 42,000 | 415.00 | 17,430,000 | |
| | | 三井松島産業 | 99,000 | 115.00 | 11,385,000 | |
| | | 国際石油開発帝石 | 800,800 | 901.70 | 722,081,360 | |
| | | 日本海洋掘削 | 4,500 | 2,075.00 | 9,337,500 | 貸付有価証券 2,100株(300株) |
| | | 石油資源開発 | 24,100 | 2,581.00 | 62,202,100 | 貸付有価証券 10,700株 |
| | | K & Oエナジーグループ | 10,200 | 1,217.00 | 12,413,400 | |
| | | ショーボンドホールディングス | 15,900 | 3,800.00 | 60,420,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| | | ミライト・ホールディングス | 46,800 | 782.00 | 36,597,600 | |
| | | タマホーム | 11,400 | 381.00 | 4,343,400 | 貸付有価証券 5,200株(1,500株) |
| | | サンヨーホームズ | 3,200 | 473.00 | 1,513,600 | 貸付有価証券 1,300株 |
| | | ダイセキ環境ソリューション | 3,500 | 1,004.00 | 3,514,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| | | 安藤・間 | 101,400 | 523.00 | 53,032,200 | |
| | | 東急建設 | 49,500 | 798.00 | 39,501,000 | 貸付有価証券 19,000株 |
| | | コムシスホールディングス | 65,300 | 1,572.00 | 102,651,600 | 貸付有価証券 400株 |
| | | ミサワホーム | 18,000 | 623.00 | 11,214,000 | 貸付有価証券 8,200株 |
| | | 高松コンストラクショングループ | 11,500 | 2,125.00 | 24,437,500 | 貸付有価証券 2,900株 |
| | | 東建コーポレーション | 6,200 | 8,100.00 | 50,220,000 | 貸付有価証券 900株 |
| ヤマウラ | 7,100 | 447.00 | 3,173,700 | | | |
| 大成建設 | 789,000 | 711.00 | 560,979,000 | | | |
| 大林組 | 455,900 | 1,001.00 | 456,355,900 | | | |

| | | | | |
|-------------|---------|----------|-------------|------------------------------|
| 清水建設 | 465,000 | 856.00 | 398,040,000 | 貸付有価証券 58,000株 |
| 飛鳥建設 | 115,300 | 142.00 | 16,372,600 | 貸付有価証券 53,200株（1,300株） |
| 長谷工コーポレーション | 177,400 | 990.00 | 175,626,000 | |
| 松井建設 | 16,700 | 655.00 | 10,938,500 | |
| 銭高組 | 22,000 | 431.00 | 9,482,000 | 貸付有価証券 9,000株（1,000株） |
| 鹿島建設 | 713,000 | 658.00 | 469,154,000 | |
| 不動テトラ | 107,400 | 110.00 | 11,814,000 | 貸付有価証券 49,500株 |
| 大末建設 | 5,800 | 734.00 | 4,257,200 | |
| 鉄建建設 | 92,000 | 235.00 | 21,620,000 | 貸付有価証券 42,000株（1,000株） |
| 西松建設 | 176,000 | 421.00 | 74,096,000 | 貸付有価証券 52,000株 |
| 三井住友建設 | 582,500 | 90.00 | 52,425,000 | 貸付有価証券 233,000株（134,100株） |
| 大豊建設 | 59,000 | 443.00 | 26,137,000 | 貸付有価証券 14,000株 |
| 前田建設工業 | 94,000 | 758.00 | 71,252,000 | 貸付有価証券 38,000株 |
| 佐田建設 | 10,500 | 392.00 | 4,116,000 | 貸付有価証券 400株 |
| ナカノフドー建設 | 11,600 | 532.00 | 6,171,200 | |
| 奥村組 | 144,000 | 559.00 | 80,496,000 | |
| 東鉄工業 | 18,200 | 3,085.00 | 56,147,000 | |
| イチケン | 17,000 | 278.00 | 4,726,000 | 貸付有価証券 3,000株 |
| 浅沼組 | 49,000 | 227.00 | 11,123,000 | 貸付有価証券 22,000株 |
| 戸田建設 | 177,000 | 490.00 | 86,730,000 | |
| 熊谷組 | 223,000 | 316.00 | 70,468,000 | |
| 青木あすなろ建設 | 10,000 | 668.00 | 6,680,000 | |
| 北野建設 | 32,000 | 268.00 | 8,576,000 | |
| 植木組 | 19,000 | 220.00 | 4,180,000 | |
| 三井ホーム | 20,000 | 505.00 | 10,100,000 | |
| 矢作建設工業 | 20,700 | 717.00 | 14,841,900 | 貸付有価証券 400株 |

| | | | | |
|---------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| ピーエス三菱 | 18,000 | 417.00 | 7,506,000 | 貸付有価証券 5,600株(1,100株) |
| 日本ハウスホールディングス | 31,000 | 395.00 | 12,245,000 | 貸付有価証券 10,900株 |
| 大東建託 | 56,800 | 14,725.00 | 836,380,000 | |
| 新日本建設 | 18,100 | 512.00 | 9,267,200 | |
| N I P P O | 35,000 | 1,696.00 | 59,360,000 | |
| 東亜道路工業 | 29,000 | 350.00 | 10,150,000 | |
| 前田道路 | 48,000 | 1,706.00 | 81,888,000 | |
| 日本道路 | 45,000 | 541.00 | 24,345,000 | |
| 東亜建設工業 | 133,000 | 242.00 | 32,186,000 | |
| 若築建設 | 87,000 | 112.00 | 9,744,000 | 貸付有価証券 34,000株(2,000株) |
| 東洋建設 | 47,700 | 429.00 | 20,463,300 | 貸付有価証券 9,300株 |
| 五洋建設 | 168,700 | 474.00 | 79,963,800 | 貸付有価証券 56,000株 |
| 大林道路 | 17,800 | 748.00 | 13,314,400 | 貸付有価証券 7,900株(7,900株) |
| 世紀東急工業 | 23,800 | 460.00 | 10,948,000 | |
| 福田組 | 25,000 | 940.00 | 23,500,000 | 貸付有価証券 10,000株(10,000株) |
| 住友林業 | 104,600 | 1,266.00 | 132,423,600 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 日本基礎技術 | 16,900 | 404.00 | 6,827,600 | |
| 日成ビルド工業 | 42,000 | 363.00 | 15,246,000 | 貸付有価証券 19,000株 |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 77,000 | 65.00 | 5,005,000 | 貸付有価証券 35,000株 |
| 巴コーポレーション | 18,900 | 357.00 | 6,747,300 | 貸付有価証券 100株 |
| パナホーム | 57,000 | 823.00 | 46,911,000 | |
| 大和ハウス工業 | 449,100 | 2,953.50 | 1,326,416,850 | 貸付有価証券 5,500株 |
| ライト工業 | 29,200 | 1,069.00 | 31,214,800 | |
| 積水ハウス | 508,200 | 1,742.50 | 885,538,500 | |
| 日特建設 | 16,700 | 408.00 | 6,813,600 | |
| 北陸電気工事 | 5,500 | 771.00 | 4,240,500 | |
| ユアテック | 24,000 | 783.00 | 18,792,000 | |
| 西部電気工業 | 13,000 | 412.00 | 5,356,000 | |

| | | | | |
|--------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 四電工 | 12,000 | 377.00 | 4,524,000 | |
| 中電工 | 22,000 | 2,343.00 | 51,546,000 | 貸付有価証券 3,300株 |
| 関電工 | 61,000 | 829.00 | 50,569,000 | |
| きんでん | 91,900 | 1,438.00 | 132,152,200 | |
| 東京エネシス | 17,000 | 891.00 | 15,147,000 | |
| トーエネック | 21,000 | 676.00 | 14,196,000 | |
| 住友電設 | 12,000 | 1,414.00 | 16,968,000 | |
| 日本電設工業 | 24,800 | 2,094.00 | 51,931,200 | |
| 協和エクシオ | 59,600 | 1,188.00 | 70,804,800 | 貸付有価証券 16,600株 |
| 新日本空調 | 12,800 | 922.00 | 11,801,600 | 貸付有価証券 800株 |
| N D S | 24,000 | 284.00 | 6,816,000 | |
| 九電工 | 28,000 | 2,318.00 | 64,904,000 | 貸付有価証券 12,000株（11,000株） |
| 三機工業 | 33,700 | 904.00 | 30,464,800 | |
| 日揮 | 153,000 | 1,697.00 | 259,641,000 | |
| 中外炉工業 | 46,000 | 181.00 | 8,326,000 | 貸付有価証券 13,000株 |
| ヤマト | 13,600 | 425.00 | 5,780,000 | |
| 太平電業 | 22,000 | 944.00 | 20,768,000 | 貸付有価証券 9,000株 |
| 高砂熱学工業 | 45,300 | 1,490.00 | 67,497,000 | 貸付有価証券 20,900株 |
| 三晃金属工業 | 15,000 | 258.00 | 3,870,000 | |
| 朝日工業社 | 17,000 | 420.00 | 7,140,000 | |
| 明星工業 | 27,500 | 406.00 | 11,165,000 | |
| 大気社 | 18,600 | 2,578.00 | 47,950,800 | 貸付有価証券 8,000株（8,000株） |
| ダイダン | 20,000 | 740.00 | 14,800,000 | |
| 日比谷総合設備 | 18,300 | 1,626.00 | 29,755,800 | |
| 東芝プラントシステム | 24,700 | 1,283.00 | 31,690,100 | 貸付有価証券 10,600株 |
| OSJBホールディングス | 31,000 | 216.00 | 6,696,000 | |
| 東洋エンジニアリング | 81,000 | 255.00 | 20,655,000 | 貸付有価証券 30,000株（2,000株） |
| 千代田化工建設 | 110,000 | 774.00 | 85,140,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| | | | | 12,000株 |
| 新興プランテック | 31,200 | 868.00 | 27,081,600 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 日本製粉 | 100,000 | 791.00 | 79,100,000 | |
| 日清製粉グループ本社 | 166,700 | 1,817.00 | 302,893,900 | |
| 日東富士製粉 | 12,000 | 339.00 | 4,068,000 | |
| 昭和産業 | 63,000 | 446.00 | 28,098,000 | |
| 鳥越製粉 | 12,100 | 633.00 | 7,659,300 | |
| 中部飼料 | 14,100 | 787.00 | 11,096,700 | |
| フィード・ワン | 91,500 | 116.00 | 10,614,000 | 貸付有価証券 25,900株 |
| 東洋精糖 | 23,000 | 99.00 | 2,277,000 | |
| 日本甜菜製糖 | 77,000 | 188.00 | 14,476,000 | |
| 三井製糖 | 60,000 | 479.00 | 28,740,000 | |
| 塩水港精糖 | 16,200 | 222.00 | 3,596,400 | 貸付有価証券 500株 |
| 日新製糖 | 2,100 | 4,175.00 | 8,767,500 | |
| 森永製菓 | 137,000 | 605.00 | 82,885,000 | |
| 中村屋 | 35,000 | 453.00 | 15,855,000 | |
| 江崎グリコ | 35,100 | 5,560.00 | 195,156,000 | |
| 名糖産業 | 6,700 | 1,281.00 | 8,582,700 | |
| 不二家 | 87,000 | 186.00 | 16,182,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 山崎製パン | 111,000 | 2,129.00 | 236,319,000 | |
| 第一屋製パン | 23,000 | 102.00 | 2,346,000 | |
| モロゾフ | 23,000 | 414.00 | 9,522,000 | |
| 亀田製菓 | 8,500 | 4,365.00 | 37,102,500 | |
| 寿スピリッツ | 3,600 | 5,670.00 | 20,412,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| カルビー | 56,300 | 4,450.00 | 250,535,000 | 貸付有価証券 25,100株 |
| 森永乳業 | 136,000 | 529.00 | 71,944,000 | |
| 六甲バター | 6,800 | 1,712.00 | 11,641,600 | 貸付有価証券 3,000株 |
| ヤクルト本社 | 81,500 | 5,420.00 | 441,730,000 | 貸付有価証券 32,100株(15,500株) |
| 明治ホールディングス | 90,000 | 9,020.00 | 811,800,000 | |
| 雪印メグミルク | 35,800 | 2,643.00 | 94,619,400 | 貸付有価証券 2,500株 |

| | | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| プリマハム | 96,000 | 276.00 | 26,496,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 日本ハム | 112,000 | 2,456.00 | 275,072,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 伊藤ハム | 73,000 | 711.00 | 51,903,000 | 貸付有価証券 33,000株（26,000株） |
| 林兼産業 | 49,000 | 92.00 | 4,508,000 | 貸付有価証券 22,000株 |
| 丸大食品 | 78,000 | 421.00 | 32,838,000 | |
| 米久 | 4,900 | 2,570.00 | 12,593,000 | |
| S Foods | 9,500 | 2,202.00 | 20,919,000 | 貸付有価証券 4,300株（3,300株） |
| サッポロホールディングス | 232,000 | 507.00 | 117,624,000 | 貸付有価証券 19,000株 |
| アサヒグループホールディングス | 285,200 | 3,328.00 | 949,145,600 | |
| キリンホールディングス | 616,000 | 1,462.50 | 900,900,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 宝ホールディングス | 110,000 | 788.00 | 86,680,000 | |
| オエノンホールディングス | 41,000 | 204.00 | 8,364,000 | |
| 養命酒製造 | 4,700 | 1,904.00 | 8,948,800 | |
| コカ・コーラウエスト | 51,500 | 2,513.00 | 129,419,500 | 貸付有価証券 22,600株（22,600株） |
| コカ・コーライースト ジャパン | 53,800 | 1,953.00 | 105,071,400 | 貸付有価証券 4,200株 |
| サントリー食品インター ナショナル | 104,100 | 4,595.00 | 478,339,500 | |
| ダイドードリンコ | 7,700 | 5,050.00 | 38,885,000 | 貸付有価証券 100株（100株） |
| 伊藤園 | 45,100 | 3,100.00 | 139,810,000 | 貸付有価証券 18,000株（2,500株） |
| キーコーヒー | 13,400 | 1,809.00 | 24,240,600 | 貸付有価証券 100株 |
| ユニカフェ | 4,100 | 918.00 | 3,763,800 | |
| ジャパンフーズ | 1,900 | 1,084.00 | 2,059,600 | 貸付有価証券 800株 |
| 日清オイリオグループ | 80,000 | 453.00 | 36,240,000 | |
| 不二製油グループ本社 | 40,600 | 1,882.00 | 76,409,200 | |
| かどや製油 | 1,500 | 2,712.00 | 4,068,000 | 貸付有価証券 400株 |

| | | | | |
|--------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| J - オイルミルズ | 64,000 | 335.00 | 21,440,000 | |
| キッコーマン | 115,000 | 3,725.00 | 428,375,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 味の素 | 326,000 | 2,754.50 | 897,967,000 | |
| キューピー | 77,300 | 2,448.00 | 189,230,400 | 貸付有価証券 11,200株(4,400株) |
| ハウス食品グループ本社 | 51,900 | 2,124.00 | 110,235,600 | 貸付有価証券 1,800株(1,800株) |
| カゴメ | 54,600 | 2,066.00 | 112,803,600 | 貸付有価証券 25,100株(11,600株) |
| 焼津水産化学工業 | 7,200 | 1,003.00 | 7,221,600 | |
| アリアケジャパン | 12,400 | 6,430.00 | 79,732,000 | |
| ピエトロ | 1,400 | 1,843.00 | 2,580,200 | 貸付有価証券 600株(600株) |
| エバラ食品工業 | 3,600 | 1,940.00 | 6,984,000 | |
| ニチレイ | 162,000 | 868.00 | 140,616,000 | |
| 東洋水産 | 74,700 | 4,065.00 | 303,655,500 | |
| イトアンド | 1,700 | 2,214.00 | 3,763,800 | 貸付有価証券 700株 |
| 日清食品ホールディングス | 64,300 | 5,330.00 | 342,719,000 | 貸付有価証券 21,300株 |
| 永谷園ホールディングス | 15,000 | 1,037.00 | 15,555,000 | |
| 一正蒲鉾 | 5,300 | 861.00 | 4,563,300 | 貸付有価証券 1,300株 |
| フジッコ | 14,700 | 2,194.00 | 32,251,800 | 貸付有価証券 4,300株(4,300株) |
| ロック・フィールド | 7,900 | 2,930.00 | 23,147,000 | |
| 日本たばこ産業 | 898,700 | 4,359.00 | 3,917,433,300 | 貸付有価証券 7,600株 |
| ケンコーマヨネーズ | 4,900 | 2,197.00 | 10,765,300 | |
| わらべや日洋 | 8,200 | 2,211.00 | 18,130,200 | 貸付有価証券 3,600株 |
| なとり | 7,600 | 1,623.00 | 12,334,800 | |
| 北の達人コーポレーション | 2,100 | 510.00 | 1,071,000 | 貸付有価証券 900株 |
| ユーグレナ | 51,300 | 1,492.00 | 76,539,600 | 貸付有価証券 23,600株 |
| ミヨシ油脂 | 52,000 | 119.00 | 6,188,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 理研ビタミン | 4,500 | 3,635.00 | 16,357,500 | |

| | | | | |
|--------------|-----------|----------|-------------|----------------------------|
| 片倉工業 | 17,800 | 1,151.00 | 20,487,800 | 貸付有価証券 800株 |
| グンゼ | 115,000 | 280.00 | 32,200,000 | |
| 東洋紡 | 563,000 | 152.00 | 85,576,000 | 貸付有価証券 40,000株 |
| ユニチカ | 414,000 | 49.00 | 20,286,000 | 貸付有価証券 190,000株 |
| 富士紡ホールディングス | 69,000 | 205.00 | 14,145,000 | 貸付有価証券 11,000株(11,000株) |
| 倉敷紡績 | 146,000 | 177.00 | 25,842,000 | |
| シキボウ | 87,000 | 103.00 | 8,961,000 | |
| 日本毛織 | 44,000 | 744.00 | 32,736,000 | |
| 大東紡織 | 20,000 | 57.00 | 1,140,000 | |
| トーア紡コーポレーション | 6,000 | 435.00 | 2,610,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| ダイドーリミテッド | 15,900 | 455.00 | 7,234,500 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 帝国繊維 | 14,900 | 1,423.00 | 21,202,700 | 貸付有価証券 400株 |
| 帝人 | 581,000 | 375.00 | 217,875,000 | |
| 東レ | 1,031,000 | 908.10 | 936,251,100 | 貸付有価証券 15,000株 |
| サカイオーベックス | 37,000 | 164.00 | 6,068,000 | |
| 住江織物 | 36,000 | 280.00 | 10,080,000 | |
| 日本フェルト | 7,500 | 452.00 | 3,390,000 | |
| イチカワ | 9,000 | 260.00 | 2,340,000 | |
| 日東製網 | 15,000 | 119.00 | 1,785,000 | |
| 芦森工業 | 31,000 | 142.00 | 4,402,000 | 貸付有価証券 14,000株 |
| アツギ | 109,000 | 110.00 | 11,990,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| ダイニック | 27,000 | 150.00 | 4,050,000 | |
| セーレン | 35,400 | 1,075.00 | 38,055,000 | |
| 東海染工 | 20,000 | 117.00 | 2,340,000 | |
| 小松精練 | 21,800 | 565.00 | 12,317,000 | 貸付有価証券 9,200株 |
| ワコールホールディングス | 85,000 | 1,314.00 | 111,690,000 | |
| ホギメディカル | 8,900 | 5,520.00 | 49,128,000 | 貸付有価証券 3,900株(2,400株) |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| レナウン | 38,400 | 102.00 | 3,916,800 | 貸付有価証券 17,700株（7,000株） |
| クラウディア | 3,700 | 468.00 | 1,731,600 | 貸付有価証券 1,200株 |
| T S Iホールディングス | 63,400 | 725.00 | 45,965,000 | 貸付有価証券 27,500株 |
| 三陽商会 | 80,000 | 257.00 | 20,560,000 | 貸付有価証券 36,000株 |
| ナイガイ | 52,000 | 40.00 | 2,080,000 | 貸付有価証券 23,000株 |
| オンワードホールディングス | 95,000 | 695.00 | 66,025,000 | 貸付有価証券 32,000株（2,000株） |
| ルック | 26,000 | 144.00 | 3,744,000 | 貸付有価証券 5,000株 |
| キムラタン | 599,000 | 7.00 | 4,193,000 | 貸付有価証券 63,000株 |
| ゴールドウイン | 6,000 | 4,540.00 | 27,240,000 | 貸付有価証券 2,700株 |
| デサント | 32,400 | 1,643.00 | 53,233,200 | |
| キング | 7,000 | 388.00 | 2,716,000 | |
| ヤマトインターナショナル | 8,700 | 382.00 | 3,323,400 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 特種東海製紙 | 83,000 | 350.00 | 29,050,000 | |
| 王子ホールディングス | 583,000 | 426.00 | 248,358,000 | 貸付有価証券 36,000株 |
| 日本製紙 | 73,500 | 1,767.00 | 129,874,500 | 貸付有価証券 32,700株 |
| 三菱製紙 | 216,000 | 77.00 | 16,632,000 | 貸付有価証券 31,000株 |
| 北越紀州製紙 | 88,200 | 611.00 | 53,890,200 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 中越パルプ工業 | 56,000 | 160.00 | 8,960,000 | 貸付有価証券 25,000株（17,000株） |
| 巴川製紙所 | 22,000 | 178.00 | 3,916,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 大王製紙 | 62,900 | 919.00 | 57,805,100 | 貸付有価証券 29,000株（8,200株） |
| レンゴー | 126,000 | 533.00 | 67,158,000 | 貸付有価証券 12,000株 |
| トーモク | 45,000 | 247.00 | 11,115,000 | |
| ザ・パック | 10,100 | 2,659.00 | 26,855,900 | |

| | | | | |
|-----------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| クラレ | 224,200 | 1,223.00 | 274,196,600 | 貸付有価証券 5,800株 |
| 旭化成 | 886,000 | 685.20 | 607,087,200 | |
| 共和レザー | 9,300 | 831.00 | 7,728,300 | |
| 昭和電工 | 946,000 | 114.00 | 107,844,000 | 貸付有価証券 435,000株 |
| 住友化学 | 1,046,000 | 477.00 | 498,942,000 | |
| 日本化成 | 27,000 | 111.00 | 2,997,000 | |
| 住友精化 | 29,000 | 570.00 | 16,530,000 | 貸付有価証券 13,000株 |
| 日産化学工業 | 85,400 | 2,573.00 | 219,734,200 | 貸付有価証券 900株 |
| ラサ工業 | 54,000 | 97.00 | 5,238,000 | 貸付有価証券 10,000株（5,000株） |
| クレハ | 107,000 | 366.00 | 39,162,000 | 貸付有価証券 49,000株（23,000株） |
| 多木化学 | 9,000 | 622.00 | 5,598,000 | 貸付有価証券 1,000株（1,000株） |
| テイカ | 24,000 | 524.00 | 12,576,000 | |
| 石原産業 | 255,000 | 72.00 | 18,360,000 | |
| 片倉コープアグリ | 17,000 | 210.00 | 3,570,000 | |
| 日東エフシー | 8,300 | 809.00 | 6,714,700 | 貸付有価証券 200株 |
| 日本曹達 | 92,000 | 501.00 | 46,092,000 | |
| 東ソー | 383,000 | 422.00 | 161,626,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| トクヤマ | 236,000 | 146.00 | 34,456,000 | 貸付有価証券 106,000株 |
| セントラル硝子 | 154,000 | 545.00 | 83,930,000 | |
| 東亜合成 | 89,000 | 886.00 | 78,854,000 | |
| 大阪ソーダ | 61,000 | 412.00 | 25,132,000 | 貸付有価証券 26,000株 |
| 関東電化工業 | 34,000 | 812.00 | 27,608,000 | 貸付有価証券 7,000株 |
| デンカ | 294,000 | 387.00 | 113,778,000 | |
| 信越化学工業 | 254,800 | 5,560.00 | 1,416,688,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 日本カーバイド工業 | 48,000 | 114.00 | 5,472,000 | 貸付有価証券 6,000株 |
| 堺化学工業 | 57,000 | 308.00 | 17,556,000 | |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| エア・ウォーター | 117,000 | 1,560.00 | 182,520,000 | |
| 大陽日酸 | 109,500 | 1,022.00 | 111,909,000 | 貸付有価証券 22,100株(7,200株) |
| 日本化学工業 | 53,000 | 193.00 | 10,229,000 | |
| 日本パーカライジング | 72,600 | 967.00 | 70,204,200 | |
| 高圧ガス工業 | 21,000 | 586.00 | 12,306,000 | |
| チタン工業 | 17,000 | 163.00 | 2,771,000 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 四国化成工業 | 20,000 | 882.00 | 17,640,000 | |
| 戸田工業 | 28,000 | 298.00 | 8,344,000 | 貸付有価証券 13,000株 |
| ステラ ケミファ | 7,300 | 1,956.00 | 14,278,800 | 貸付有価証券 1,600株(1,000株) |
| 保土谷化学工業 | 43,000 | 173.00 | 7,439,000 | 貸付有価証券 19,000株 |
| 日本触媒 | 20,600 | 6,940.00 | 142,964,000 | |
| 大日精化工業 | 55,000 | 443.00 | 24,365,000 | |
| カネカ | 192,000 | 879.00 | 168,768,000 | |
| 三菱瓦斯化学 | 244,000 | 569.00 | 138,836,000 | 貸付有価証券 14,000株 |
| 三井化学 | 603,000 | 388.00 | 233,964,000 | |
| J S R | 133,300 | 1,550.00 | 206,615,000 | |
| 東京応化工業 | 28,500 | 2,849.00 | 81,196,500 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 大阪有機化学工業 | 10,100 | 611.00 | 6,171,100 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 951,800 | 601.80 | 572,793,240 | |
| 日本合成化学工業 | 33,000 | 675.00 | 22,275,000 | |
| ダイセル | 199,900 | 1,524.00 | 304,647,600 | |
| 住友ベークライト | 133,000 | 456.00 | 60,648,000 | 貸付有価証券 55,000株 |
| 積水化学工業 | 322,600 | 1,265.00 | 408,089,000 | |
| 日本ゼオン | 122,000 | 697.00 | 85,034,000 | 貸付有価証券 11,000株 |
| アイカ工業 | 42,700 | 2,077.00 | 88,687,900 | |
| 宇部興産 | 761,000 | 195.00 | 148,395,000 | |
| 積水樹脂 | 21,900 | 1,345.00 | 29,455,500 | |
| タキロン | 33,000 | 534.00 | 17,622,000 | 貸付有価証券 8,000株(2,000株) |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| 旭有機材工業 | 46,000 | 197.00 | 9,062,000 | |
| 日立化成 | 70,200 | 1,842.00 | 129,308,400 | |
| ニチバン | 14,000 | 608.00 | 8,512,000 | |
| リケンテクノス | 23,000 | 346.00 | 7,958,000 | 貸付有価証券 5,700株（500株） |
| 大倉工業 | 34,000 | 267.00 | 9,078,000 | |
| 積水化成工業 | 36,000 | 345.00 | 12,420,000 | |
| 群栄化学工業 | 38,000 | 272.00 | 10,336,000 | |
| タイガースポリマー | 7,000 | 639.00 | 4,473,000 | |
| ミライアル | 5,100 | 824.00 | 4,202,400 | |
| ダイキアクシス | 2,600 | 809.00 | 2,103,400 | |
| ダイキョーニシカワ | 18,300 | 1,581.00 | 28,932,300 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 日本化薬 | 92,000 | 1,138.00 | 104,696,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| カーリットホールディングス | 13,200 | 475.00 | 6,270,000 | |
| 日本精化 | 11,800 | 711.00 | 8,389,800 | |
| 扶桑化学工業 | 9,000 | 1,315.00 | 11,835,000 | 貸付有価証券 600株 |
| A D E K A | 69,900 | 1,471.00 | 102,822,900 | |
| 日油 | 108,000 | 784.00 | 84,672,000 | |
| 新日本理化 | 22,400 | 138.00 | 3,091,200 | 貸付有価証券 10,300株 |
| ハリマ化成グループ | 12,100 | 509.00 | 6,158,900 | 貸付有価証券 200株 |
| 花王 | 382,200 | 5,591.00 | 2,136,880,200 | |
| 第一工業製薬 | 32,000 | 305.00 | 9,760,000 | 貸付有価証券 14,000株 |
| ニイタカ | 2,100 | 1,290.00 | 2,709,000 | |
| 三洋化成工業 | 45,000 | 776.00 | 34,920,000 | |
| 大日本塗料 | 81,000 | 198.00 | 16,038,000 | |
| 日本ペイントホールディングス | 109,700 | 2,274.00 | 249,457,800 | 貸付有価証券 37,400株 |
| 関西ペイント | 160,800 | 1,646.00 | 264,676,800 | 貸付有価証券 62,300株 |
| 神東塗料 | 10,000 | 173.00 | 1,730,000 | |
| 中国塗料 | 41,000 | 687.00 | 28,167,000 | |
| 日本特殊塗料 | 9,900 | 933.00 | 9,236,700 | |

| | | | | |
|------------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 藤倉化成 | 19,300 | 519.00 | 10,016,700 | |
| 太陽ホールディングス | 10,400 | 3,670.00 | 38,168,000 | 貸付有価証券 600株 |
| D I C | 569,000 | 244.00 | 138,836,000 | |
| サカタインクス | 29,000 | 1,076.00 | 31,204,000 | |
| 東洋インキ S C ホール ディングス | 140,000 | 447.00 | 62,580,000 | |
| T & K T O K A | 10,300 | 895.00 | 9,218,500 | |
| 富士フィルムホールディ ングス | 325,200 | 4,250.00 | 1,382,100,000 | |
| 資生堂 | 269,600 | 2,273.50 | 612,935,600 | 貸付有価証券 44,500株 |
| ライオン | 164,000 | 1,148.00 | 188,272,000 | 貸付有価証券 1,000株(1,000株) |
| 高砂香料工業 | 9,300 | 2,353.00 | 21,882,900 | |
| マンダム | 13,200 | 4,375.00 | 57,750,000 | |
| ミルボン | 8,400 | 4,060.00 | 34,104,000 | |
| ファンケル | 32,900 | 1,315.00 | 43,263,500 | 貸付有価証券 13,300株(13,300株) |
| コーセー | 23,000 | 8,770.00 | 201,710,000 | 貸付有価証券 5,600株 |
| コタ | 4,400 | 1,506.00 | 6,626,400 | |
| シーズ・ホールディング ス | 17,900 | 1,826.00 | 32,685,400 | 貸付有価証券 8,200株 |
| シーボン | 1,600 | 2,330.00 | 3,728,000 | |
| ポーラ・オルビスホール ディングス | 14,500 | 8,000.00 | 116,000,000 | 貸付有価証券 5,200株(5,200株) |
| ノエビアホールディング ス | 9,000 | 2,958.00 | 26,622,000 | |
| アジュバンコスメジャパ ン | 2,700 | 985.00 | 2,659,500 | |
| エステー | 9,700 | 1,095.00 | 10,621,500 | |
| アグロ カネショウ | 5,500 | 880.00 | 4,840,000 | 貸付有価証券 300株 |
| コニシ | 11,100 | 2,367.00 | 26,273,700 | |
| 長谷川香料 | 18,000 | 1,384.00 | 24,912,000 | |
| 星光 P M C | 7,800 | 905.00 | 7,059,000 | 貸付有価証券 3,400株(200株) |
| 小林製薬 | 21,500 | 9,280.00 | 199,520,000 | |
| 荒川化学工業 | 12,100 | 933.00 | 11,289,300 | |

| | | | | |
|------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| メック | 11,000 | 795.00 | 8,745,000 | 貸付有価証券 1,900株(1,300株) |
| 日本高純度化学 | 4,000 | 2,017.00 | 8,068,000 | |
| J C U | 4,200 | 3,340.00 | 14,028,000 | |
| 新田ゼラチン | 9,300 | 670.00 | 6,231,000 | 貸付有価証券 2,400株(2,000株) |
| O A T アグリオ | 1,200 | 1,224.00 | 1,468,800 | 貸付有価証券 500株 |
| デクセリアルズ | 31,800 | 996.00 | 31,672,800 | 貸付有価証券 14,200株(100株) |
| アース製薬 | 10,200 | 4,050.00 | 41,310,000 | 貸付有価証券 3,200株(2,900株) |
| イハラケミカル工業 | 21,800 | 1,165.00 | 25,397,000 | |
| 北興化学工業 | 15,000 | 288.00 | 4,320,000 | |
| 大成ラミック | 4,000 | 2,950.00 | 11,800,000 | |
| クミアイ化学工業 | 29,300 | 1,137.00 | 33,314,100 | 貸付有価証券 13,500株(10,600株) |
| 日本農薬 | 32,400 | 566.00 | 18,338,400 | 貸付有価証券 14,900株(500株) |
| アキレス | 116,000 | 140.00 | 16,240,000 | |
| 有沢製作所 | 21,000 | 559.00 | 11,739,000 | |
| 日東電工 | 109,800 | 5,722.00 | 628,275,600 | 貸付有価証券 1,400株 |
| レック | 4,400 | 1,251.00 | 5,504,400 | 貸付有価証券 300株 |
| きもと | 23,100 | 174.00 | 4,019,400 | 貸付有価証券 600株 |
| 藤森工業 | 12,200 | 2,438.00 | 29,743,600 | 貸付有価証券 100株 |
| 前澤化成工業 | 9,900 | 1,005.00 | 9,949,500 | |
| J S P | 9,300 | 2,195.00 | 20,413,500 | |
| エフピコ | 12,600 | 4,625.00 | 58,275,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 天馬 | 10,900 | 1,885.00 | 20,546,500 | |
| 信越ポリマー | 27,800 | 577.00 | 16,040,600 | |
| 東リ | 37,000 | 285.00 | 10,545,000 | |
| ニフコ | 27,200 | 5,160.00 | 140,352,000 | 貸付有価証券 11,700株(100株) |
| 日本バルカー工業 | 55,000 | 275.00 | 15,125,000 | |
| ユニ・チャーム | 287,700 | 2,259.00 | 649,914,300 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-----------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | | | 37,500株(31,500株) |
| 協和発酵キリン | 170,000 | 1,522.00 | 258,740,000 | |
| 武田薬品工業 | 565,900 | 5,298.00 | 2,998,138,200 | |
| アステラス製薬 | 1,591,100 | 1,549.00 | 2,464,613,900 | |
| 大日本住友製薬 | 100,600 | 1,189.00 | 119,613,400 | 貸付有価証券 46,300株 |
| 塩野義製薬 | 207,100 | 4,410.00 | 913,311,000 | |
| 田辺三菱製薬 | 165,600 | 1,941.00 | 321,429,600 | |
| わかもと製薬 | 16,000 | 267.00 | 4,272,000 | |
| あすか製薬 | 18,000 | 1,090.00 | 19,620,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 日本新薬 | 32,600 | 3,760.00 | 122,576,000 | 貸付有価証券 2,600株 |
| ビオフェルミン製薬 | 2,300 | 3,395.00 | 7,808,500 | |
| 中外製薬 | 141,500 | 3,200.00 | 452,800,000 | |
| 科研製薬 | 24,500 | 6,660.00 | 163,170,000 | 貸付有価証券 500株 |
| エーザイ | 174,900 | 6,775.00 | 1,184,947,500 | |
| ロート製薬 | 69,600 | 1,961.00 | 136,485,600 | |
| 小野薬品工業 | 64,500 | 18,625.00 | 1,201,312,500 | |
| 久光製薬 | 44,100 | 4,675.00 | 206,167,500 | 貸付有価証券 1,400株(1,400株) |
| 有機合成薬品工業 | 9,000 | 231.00 | 2,079,000 | |
| 持田製薬 | 9,800 | 8,490.00 | 83,202,000 | |
| 参天製薬 | 261,500 | 1,649.00 | 431,213,500 | |
| 扶桑薬品工業 | 48,000 | 242.00 | 11,616,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 日本ケミファ | 20,000 | 483.00 | 9,660,000 | |
| ツムラ | 44,700 | 2,678.00 | 119,706,600 | 貸付有価証券 11,800株 |
| 日医工 | 33,200 | 2,630.00 | 87,316,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 25,200 | 2,627.00 | 66,200,400 | |
| 生化学工業 | 27,100 | 1,303.00 | 35,311,300 | 貸付有価証券 7,200株 |
| 栄研化学 | 11,900 | 2,068.00 | 24,609,200 | |
| 日水製薬 | 5,700 | 1,255.00 | 7,153,500 | |
| 鳥居薬品 | 9,700 | 2,335.00 | 22,649,500 | 貸付有価証券 300株 |
| JCRファーマ | 10,900 | 1,885.00 | 20,546,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| | | | | 100株 |
| 東和薬品 | 6,500 | 4,985.00 | 32,402,500 | |
| 富士製薬工業 | 3,900 | 1,973.00 | 7,694,700 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 沢井製薬 | 24,100 | 7,170.00 | 172,797,000 | 貸付有価証券 8,600株 |
| ゼリア新薬工業 | 29,100 | 1,359.00 | 39,546,900 | 貸付有価証券 100株 |
| 第一三共 | 477,900 | 2,158.00 | 1,031,308,200 | 貸付有価証券 115,500株 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 37,900 | 2,075.00 | 78,642,500 | |
| 大幸薬品 | 7,000 | 1,279.00 | 8,953,000 | 貸付有価証券 3,100株 |
| ダイト | 5,900 | 2,524.00 | 14,891,600 | |
| 大塚ホールディングス | 305,500 | 3,938.00 | 1,203,059,000 | |
| 大正製薬ホールディングス | 34,200 | 8,560.00 | 292,752,000 | 貸付有価証券 15,700株 |
| ペプチドリーム | 17,500 | 3,575.00 | 62,562,500 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 日本コークス工業 | 114,600 | 76.00 | 8,709,600 | |
| 昭和シェル石油 | 142,900 | 917.00 | 131,039,300 | 貸付有価証券 20,500株 |
| ニチレキ | 17,400 | 764.00 | 13,293,600 | |
| 東燃ゼネラル石油 | 214,000 | 929.00 | 198,806,000 | |
| ユシロ化学工業 | 7,600 | 1,226.00 | 9,317,600 | |
| ビーピー・カストロール | 5,800 | 1,203.00 | 6,977,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 富士石油 | 32,900 | 267.00 | 8,784,300 | |
| MORESCO | 4,500 | 1,434.00 | 6,453,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 出光興産 | 74,100 | 1,764.00 | 130,712,400 | 貸付有価証券 6,600株（6,600株） |
| JXホールディングス | 1,682,000 | 434.50 | 730,829,000 | 貸付有価証券 73,300株 |
| コスモエネルギーホールディングス | 42,900 | 1,151.00 | 49,377,900 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 横浜ゴム | 85,700 | 1,793.00 | 153,660,100 | 貸付有価証券 36,700株 |
| 東洋ゴム工業 | 64,300 | 1,798.00 | 115,611,400 | |
| ブリヂストン | 479,500 | 3,992.00 | 1,914,164,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| | | | | 500株 |
| 住友ゴム工業 | 133,000 | 1,567.00 | 208,411,000 | 貸付有価証券 59,100株 |
| 藤倉ゴム工業 | 11,900 | 438.00 | 5,212,200 | 貸付有価証券 400株 |
| オカモト | 44,000 | 848.00 | 37,312,000 | 貸付有価証券 20,000株 |
| フコク | 5,200 | 859.00 | 4,466,800 | |
| ニッタ | 15,300 | 3,070.00 | 46,971,000 | |
| 住友理工 | 30,700 | 953.00 | 29,257,100 | 貸付有価証券 600株 |
| 三ツ星ベルト | 34,000 | 851.00 | 28,934,000 | |
| バンドー化学 | 52,000 | 433.00 | 22,516,000 | |
| 日東紡績 | 94,000 | 345.00 | 32,430,000 | |
| 旭硝子 | 750,000 | 550.00 | 412,500,000 | |
| 日本板硝子 | 685,000 | 70.00 | 47,950,000 | 貸付有価証券 316,000株 |
| 石塚硝子 | 20,000 | 195.00 | 3,900,000 | |
| 日本山村硝子 | 56,000 | 163.00 | 9,128,000 | |
| 日本電気硝子 | 293,000 | 527.00 | 154,411,000 | |
| オハラ | 5,400 | 512.00 | 2,764,800 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 住友大阪セメント | 281,000 | 414.00 | 116,334,000 | 貸付有価証券 10,000株 |
| 太平洋セメント | 886,000 | 229.00 | 202,894,000 | |
| デイ・シイ | 13,100 | 309.00 | 4,047,900 | 貸付有価証券 900株 |
| 日本ヒューム | 13,600 | 538.00 | 7,316,800 | |
| 日本コンクリート工業 | 29,200 | 249.00 | 7,270,800 | 貸付有価証券 13,400株 |
| 三谷セキサン | 7,100 | 1,398.00 | 9,925,800 | 貸付有価証券 100株 |
| アジアパイルホールディングス | 17,500 | 354.00 | 6,195,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 東海カーボン | 123,000 | 271.00 | 33,333,000 | |
| 日本カーボン | 70,000 | 186.00 | 13,020,000 | 貸付有価証券 32,000株(7,000株) |
| 東洋炭素 | 7,900 | 1,399.00 | 11,052,100 | 貸付有価証券 2,300株 |
| ノリタケカンパニーリミ | 80,000 | 242.00 | 19,360,000 | |

| テド | | | | |
|-----------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| TOTO | 104,400 | 3,150.00 | 328,860,000 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 日本碍子 | 179,000 | 2,103.00 | 376,437,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 日本特殊陶業 | 122,400 | 2,247.00 | 275,032,800 | 貸付有価証券 23,400株 |
| ダントーホールディングス | 16,000 | 174.00 | 2,784,000 | 貸付有価証券 7,000株（4,000株） |
| MARUWA | 5,200 | 2,430.00 | 12,636,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 品川リフラクトリーズ | 36,000 | 197.00 | 7,092,000 | |
| 黒崎播磨 | 31,000 | 235.00 | 7,285,000 | |
| ヨータイ | 8,000 | 308.00 | 2,464,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| イソライト工業 | 7,000 | 176.00 | 1,232,000 | |
| 東京窯業 | 17,000 | 164.00 | 2,788,000 | |
| ニッカトー | 5,000 | 364.00 | 1,820,000 | |
| フジミインコーポレーテッド | 12,500 | 1,150.00 | 14,375,000 | 貸付有価証券 200株 |
| エーアンドエーマテリアル | 29,000 | 70.00 | 2,030,000 | 貸付有価証券 7,000株 |
| ニチアス | 72,000 | 652.00 | 46,944,000 | 貸付有価証券 23,000株 |
| ニチハ | 18,900 | 1,532.00 | 28,954,800 | |
| 新日鐵住金 | 640,500 | 1,906.00 | 1,220,793,000 | 貸付有価証券 57,100株 |
| 神戸製鋼所 | 2,609,000 | 86.00 | 224,374,000 | 貸付有価証券 58,000株 |
| 中山製鋼所 | 159,000 | 65.00 | 10,335,000 | 貸付有価証券 53,000株 |
| 合同製鐵 | 79,000 | 189.00 | 14,931,000 | |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 388,300 | 1,349.50 | 524,010,850 | 貸付有価証券 173,300株 |
| 日新製鋼 | 64,800 | 1,170.00 | 75,816,000 | 貸付有価証券 17,800株 |
| 東京製鐵 | 78,400 | 743.00 | 58,251,200 | 貸付有価証券 9,800株（9,700株） |
| 共英製鋼 | 15,100 | 1,741.00 | 26,289,100 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 大和工業 | 31,400 | 2,262.00 | 71,026,800 | |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| 東京鐵鋼 | 30,000 | 394.00 | 11,820,000 | |
| 大阪製鐵 | 8,900 | 1,768.00 | 15,735,200 | |
| 淀川製鋼所 | 21,100 | 2,384.00 | 50,302,400 | |
| 東洋鋼鈹 | 34,000 | 304.00 | 10,336,000 | |
| 丸一鋼管 | 47,500 | 3,095.00 | 147,012,500 | 貸付有価証券 300株（300株） |
| モリ工業 | 23,000 | 304.00 | 6,992,000 | |
| 大同特殊鋼 | 238,000 | 423.00 | 100,674,000 | 貸付有価証券 33,000株（2,000株） |
| 日本高周波鋼業 | 56,000 | 70.00 | 3,920,000 | 貸付有価証券 24,000株 |
| 日本冶金工業 | 104,500 | 108.00 | 11,286,000 | 貸付有価証券 48,200株 |
| 山陽特殊製鋼 | 84,000 | 523.00 | 43,932,000 | |
| 愛知製鋼 | 84,000 | 418.00 | 35,112,000 | |
| 日立金属 | 162,600 | 1,184.00 | 192,518,400 | |
| 日本金属 | 37,000 | 95.00 | 3,515,000 | 貸付有価証券 16,000株 |
| 大平洋金属 | 99,000 | 294.00 | 29,106,000 | 貸付有価証券 45,000株（7,000株） |
| 新日本電工 | 80,400 | 162.00 | 13,024,800 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 栗本鐵工所 | 68,000 | 161.00 | 10,948,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 虹技 | 20,000 | 157.00 | 3,140,000 | |
| 日本鑄鉄管 | 15,000 | 131.00 | 1,965,000 | |
| 三菱製鋼 | 99,000 | 184.00 | 18,216,000 | |
| 日亜鋼業 | 19,600 | 242.00 | 4,743,200 | |
| 日本精線 | 10,000 | 461.00 | 4,610,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| シンニッタン | 12,700 | 585.00 | 7,429,500 | 貸付有価証券 300株 |
| 新家工業 | 28,000 | 127.00 | 3,556,000 | 貸付有価証券 6,000株 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 22,000 | 255.00 | 5,610,000 | |
| 日本輕金属ホールディングス | 321,500 | 169.00 | 54,333,500 | 貸付有価証券 141,400株（68,300株） |
| 三井金属鉱業 | 362,000 | 160.00 | 57,920,000 | 貸付有価証券 95,000株（14,000株） |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 東邦亜鉛 | 74,000 | 280.00 | 20,720,000 | 貸付有価証券 34,000株 |
| 三菱マテリアル | 886,000 | 303.00 | 268,458,000 | 貸付有価証券 278,000株 |
| 住友金属鉱山 | 392,000 | 1,093.00 | 428,456,000 | 貸付有価証券 12,000株 |
| DOWAホールディングス | 183,000 | 600.00 | 109,800,000 | |
| 古河機械金属 | 221,000 | 160.00 | 35,360,000 | 貸付有価証券 20,000株 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 14,000 | 1,600.00 | 22,400,000 | 貸付有価証券 6,400株 |
| 東邦チタニウム | 24,000 | 875.00 | 21,000,000 | 貸付有価証券 11,000株 |
| UACJ | 198,000 | 212.00 | 41,976,000 | 貸付有価証券 91,000株 |
| 古河電気工業 | 447,000 | 242.00 | 108,174,000 | |
| 住友電気工業 | 568,600 | 1,347.00 | 765,904,200 | |
| フジクラ | 198,000 | 493.00 | 97,614,000 | |
| 昭和電線ホールディングス | 169,000 | 53.00 | 8,957,000 | 貸付有価証券 75,000株 |
| 東京特殊電線 | 2,000 | 859.00 | 1,718,000 | |
| タツタ電線 | 29,600 | 350.00 | 10,360,000 | |
| 沖電線 | 16,000 | 192.00 | 3,072,000 | 貸付有価証券 5,000株(1,000株) |
| カナレ電気 | 2,200 | 1,624.00 | 3,572,800 | 貸付有価証券 400株 |
| 平河ヒューテック | 6,700 | 957.00 | 6,411,900 | |
| リョービ | 87,000 | 402.00 | 34,974,000 | |
| アーレスティ | 16,400 | 655.00 | 10,742,000 | |
| アサヒホールディングス | 21,400 | 1,539.00 | 32,934,600 | |
| 稲葉製作所 | 7,500 | 1,119.00 | 8,392,500 | 貸付有価証券 200株 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 44,000 | 128.00 | 5,632,000 | 貸付有価証券 20,000株 |
| トーカロ | 10,000 | 1,907.00 | 19,070,000 | |
| アルファC o | 4,700 | 1,045.00 | 4,911,500 | |
| SUMCO | 111,200 | 708.00 | 78,729,600 | 貸付有価証券 20,100株 |
| 川田テクノロジーズ | 2,700 | 3,045.00 | 8,221,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| | | | | 1,200株 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 100,900 | 1,945.00 | 196,250,500 | 貸付有価証券 5,200株(500株) |
| ホッカホールディングス | 37,000 | 290.00 | 10,730,000 | |
| コロナ | 7,400 | 957.00 | 7,081,800 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 26,900 | 1,017.00 | 27,357,300 | 貸付有価証券 12,400株 |
| 駒井ハルテック | 25,000 | 213.00 | 5,325,000 | |
| 高田機工 | 12,000 | 181.00 | 2,172,000 | |
| 三和ホールディングス | 143,900 | 710.00 | 102,169,000 | |
| 文化シャッター | 39,500 | 900.00 | 35,550,000 | |
| 三協立山 | 18,600 | 1,268.00 | 23,584,800 | 貸付有価証券 8,600株 |
| アルインコ | 8,000 | 978.00 | 7,824,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 東洋シャッター | 3,500 | 545.00 | 1,907,500 | |
| L I X I Lグループ | 197,800 | 2,399.00 | 474,522,200 | 貸付有価証券 16,900株 |
| 日本ファイルコン | 10,300 | 422.00 | 4,346,600 | 貸付有価証券 300株(300株) |
| ノーリツ | 27,800 | 1,900.00 | 52,820,000 | 貸付有価証券 8,500株(3,900株) |
| 長府製作所 | 15,200 | 2,447.00 | 37,194,400 | 貸付有価証券 1,600株 |
| リンナイ | 26,400 | 9,650.00 | 254,760,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| ダイニチ工業 | 7,200 | 598.00 | 4,305,600 | |
| 日東精工 | 20,000 | 290.00 | 5,800,000 | |
| 三洋工業 | 18,000 | 150.00 | 2,700,000 | |
| 岡部 | 29,500 | 682.00 | 20,119,000 | 貸付有価証券 8,400株(100株) |
| ジーテクト | 14,800 | 1,163.00 | 17,212,400 | |
| 中国工業 | 2,200 | 640.00 | 1,408,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 東プレ | 27,300 | 2,076.00 | 56,674,800 | 貸付有価証券 12,300株(11,800株) |
| 高周波熱錬 | 26,400 | 804.00 | 21,225,600 | 貸付有価証券 4,300株 |
| 東京製綱 | 96,000 | 140.00 | 13,440,000 | 貸付有価証券 44,000株 |

| | | | | |
|-------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| サンコール | 7,500 | 471.00 | 3,532,500 | |
| モリテック スチール | 7,100 | 244.00 | 1,732,400 | |
| パイオラックス | 7,200 | 5,260.00 | 37,872,000 | |
| 日本発條 | 133,700 | 1,011.00 | 135,170,700 | 貸付有価証券 7,700株(7,700株) |
| 中央発條 | 18,000 | 260.00 | 4,680,000 | |
| アドバネクス | 2,600 | 1,242.00 | 3,229,200 | |
| 立川ブラインド工業 | 5,900 | 685.00 | 4,041,500 | 貸付有価証券 900株 |
| 三益半導体工業 | 10,500 | 972.00 | 10,206,000 | |
| 日本ドライケミカル | 1,800 | 2,094.00 | 3,769,200 | 貸付有価証券 200株 |
| 日本製鋼所 | 235,000 | 378.00 | 88,830,000 | |
| 三浦工業 | 63,300 | 1,839.00 | 116,408,700 | |
| タクマ | 52,000 | 875.00 | 45,500,000 | |
| ツガミ | 41,000 | 401.00 | 16,441,000 | |
| オークマ | 92,000 | 848.00 | 78,016,000 | 貸付有価証券 42,000株(4,000株) |
| 東芝機械 | 77,000 | 372.00 | 28,644,000 | 貸付有価証券 20,000株 |
| アマダホールディングス | 207,100 | 1,082.00 | 224,082,200 | |
| アイダエンジニアリング | 37,200 | 862.00 | 32,066,400 | |
| 滝澤鉄工所 | 44,000 | 122.00 | 5,368,000 | |
| 富士機械製造 | 46,400 | 1,033.00 | 47,931,200 | |
| 牧野フライス製作所 | 71,000 | 722.00 | 51,262,000 | 貸付有価証券 6,000株(6,000株) |
| オーエスジー | 64,700 | 1,914.00 | 123,835,800 | 貸付有価証券 29,800株(27,600株) |
| ダイジェット工業 | 16,000 | 126.00 | 2,016,000 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 38,900 | 954.00 | 37,110,600 | |
| D M G 森精機 | 78,400 | 931.00 | 72,990,400 | 貸付有価証券 36,100株 |
| ソディック | 27,000 | 678.00 | 18,306,000 | |
| ディスコ | 18,100 | 10,350.00 | 187,335,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 日東工器 | 8,300 | 2,108.00 | 17,496,400 | |
| パンチ工業 | 5,600 | 683.00 | 3,824,800 | 貸付有価証券 100株 |
| 豊和工業 | 7,900 | 535.00 | 4,226,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | | | 3,600株 |
| OKK | 55,000 | 106.00 | 5,830,000 | |
| 東洋機械金属 | 10,500 | 320.00 | 3,360,000 | |
| 津田駒工業 | 34,000 | 95.00 | 3,230,000 | 貸付有価証券 15,000株 |
| エンシュウ | 35,000 | 77.00 | 2,695,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 島精機製作所 | 20,000 | 1,706.00 | 34,120,000 | 貸付有価証券 9,200株(300株) |
| フリー | 2,100 | 3,140.00 | 6,594,000 | |
| 日阪製作所 | 17,900 | 763.00 | 13,657,700 | |
| やまびこ | 26,000 | 762.00 | 19,812,000 | |
| ペガサスマシン製造 | 14,600 | 485.00 | 7,081,000 | 貸付有価証券 400株(400株) |
| ナプテスコ | 73,800 | 2,313.00 | 170,699,400 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 三井海洋開発 | 16,600 | 1,444.00 | 23,970,400 | 貸付有価証券 7,600株(400株) |
| レオン自動機 | 12,000 | 586.00 | 7,032,000 | 貸付有価証券 700株 |
| S M C | 42,600 | 26,555.00 | 1,131,243,000 | 貸付有価証券 600株(600株) |
| 新川 | 12,700 | 380.00 | 4,826,000 | 貸付有価証券 5,800株(4,200株) |
| ホソカワミクロン | 24,000 | 537.00 | 12,888,000 | |
| ユニオンツール | 6,100 | 2,320.00 | 14,152,000 | 貸付有価証券 2,800株(1,400株) |
| オイレス工業 | 18,400 | 1,757.00 | 32,328,800 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 日精エー・エス・ビー機 械 | 5,200 | 1,869.00 | 9,718,800 | 貸付有価証券 2,300株 |
| サトーホールディングス | 19,100 | 2,435.00 | 46,508,500 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 日本エアテック | 5,000 | 678.00 | 3,390,000 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 日精樹脂工業 | 10,300 | 662.00 | 6,818,600 | |
| ワイエイシイ | 5,700 | 564.00 | 3,214,800 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 小松製作所 | 696,100 | 1,729.50 | 1,203,904,950 | |
| 住友重機械工業 | 414,000 | 466.00 | 192,924,000 | |
| 日立建機 | 63,400 | 1,606.00 | 101,820,400 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|---------------------------------|
| | | | | 28,800株(400株) |
| 日工 | 21,000 | 319.00 | 6,699,000 | |
| 巴工業 | 5,800 | 1,410.00 | 8,178,000 | |
| 井関農機 | 145,000 | 162.00 | 23,490,000 | 貸付有価証券 67,000株(2,000株) |
| TOWA | 13,700 | 627.00 | 8,589,900 | 貸付有価証券 6,300株(1,800株) |
| 丸山製作所 | 30,000 | 159.00 | 4,770,000 | |
| 北川鉄工所 | 65,000 | 199.00 | 12,935,000 | |
| タカキタ | 3,500 | 505.00 | 1,767,500 | 貸付有価証券 400株(200株) |
| クボタ | 681,800 | 1,485.50 | 1,012,813,900 | 貸付有価証券 23,500株 |
| 荏原実業 | 4,200 | 1,203.00 | 5,052,600 | |
| 三菱化工機 | 47,000 | 224.00 | 10,528,000 | 貸付有価証券 21,000株 |
| 月島機械 | 26,900 | 997.00 | 26,819,300 | 貸付有価証券 8,800株(8,800株) |
| 帝国電機製作所 | 10,300 | 667.00 | 6,870,100 | |
| 東京機械製作所 | 53,000 | 36.00 | 1,908,000 | 貸付有価証券 21,000株 |
| 新東工業 | 32,200 | 888.00 | 28,593,600 | |
| 澁谷工業 | 11,900 | 1,263.00 | 15,029,700 | 貸付有価証券 4,100株(500株) |
| アイチ コーポレーショ ン | 20,100 | 733.00 | 14,733,300 | |
| 小森コーポレーション | 34,500 | 1,217.00 | 41,986,500 | |
| 鶴見製作所 | 10,600 | 1,712.00 | 18,147,200 | |
| 住友精密工業 | 22,000 | 342.00 | 7,524,000 | |
| 酒井重工業 | 27,000 | 176.00 | 4,752,000 | |
| 荏原製作所 | 314,000 | 435.00 | 136,590,000 | 貸付有価証券 111,000株(57,000 株) |
| 石井鐵工所 | 21,000 | 142.00 | 2,982,000 | |
| 西島製作所 | 15,100 | 905.00 | 13,665,500 | 貸付有価証券 6,900株(1,300株) |
| 北越工業 | 15,200 | 632.00 | 9,606,400 | |
| ダイキン工業 | 197,600 | 7,588.00 | 1,499,388,800 | 貸付有価証券 17,000株 |
| オルガノ | 24,000 | 412.00 | 9,888,000 | |

| | | | | |
|-------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| トーヨーカネツ | 76,000 | 233.00 | 17,708,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 栗田工業 | 85,300 | 2,498.00 | 213,079,400 | |
| 椿本チエイン | 81,000 | 629.00 | 50,949,000 | |
| 大同工業 | 28,000 | 174.00 | 4,872,000 | |
| 日本コンベヤ | 47,000 | 113.00 | 5,311,000 | 貸付有価証券 21,000株 |
| 木村化工機 | 12,100 | 357.00 | 4,319,700 | 貸付有価証券 1,100株 |
| アネスト岩田 | 22,900 | 878.00 | 20,106,200 | |
| ダイフク | 72,900 | 1,800.00 | 131,220,000 | 貸付有価証券 16,700株(16,700株) |
| サムコ | 2,300 | 777.00 | 1,787,100 | 貸付有価証券 800株 |
| 加藤製作所 | 32,000 | 365.00 | 11,680,000 | 貸付有価証券 15,000株(2,000株) |
| 油研工業 | 27,000 | 188.00 | 5,076,000 | |
| タダノ | 65,000 | 955.00 | 62,075,000 | 貸付有価証券 8,000株(8,000株) |
| フジテック | 39,500 | 1,160.00 | 45,820,000 | 貸付有価証券 18,200株(13,100株) |
| C K D | 37,700 | 766.00 | 28,878,200 | |
| キトー | 17,100 | 728.00 | 12,448,800 | 貸付有価証券 5,200株 |
| 平和 | 42,000 | 2,317.00 | 97,314,000 | |
| 理想科学工業 | 15,000 | 1,682.00 | 25,230,000 | |
| SANKYO | 37,700 | 4,105.00 | 154,758,500 | |
| 日本金銭機械 | 12,500 | 929.00 | 11,612,500 | 貸付有価証券 5,700株(1,200株) |
| マースエンジニアリング | 7,700 | 1,952.00 | 15,030,400 | |
| 福島工業 | 8,400 | 2,248.00 | 18,883,200 | |
| オーイズミ | 5,700 | 439.00 | 2,502,300 | 貸付有価証券 2,500株 |
| ダイコク電機 | 5,600 | 1,199.00 | 6,714,400 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 竹内製作所 | 20,100 | 1,453.00 | 29,205,300 | 貸付有価証券 2,800株 |
| アマノ | 42,000 | 1,526.00 | 64,092,000 | |
| JUKI | 20,100 | 888.00 | 17,848,800 | 貸付有価証券 9,300株 |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| サンデンホールディングス | 83,000 | 291.00 | 24,153,000 | 貸付有価証券 38,000株 |
| 蛇の目ミシン工業 | 13,200 | 532.00 | 7,022,400 | 貸付有価証券 5,800株 |
| マックス | 21,000 | 1,159.00 | 24,339,000 | |
| グローリー | 46,300 | 3,670.00 | 169,921,000 | |
| 新晃工業 | 9,500 | 1,611.00 | 15,304,500 | |
| 大和冷機工業 | 21,800 | 936.00 | 20,404,800 | |
| セガサミーホールディングス | 145,800 | 1,135.00 | 165,483,000 | 貸付有価証券 45,500株 |
| 日本ピストンリング | 5,600 | 1,530.00 | 8,568,000 | |
| リケン | 63,000 | 368.00 | 23,184,000 | |
| T P R | 16,700 | 2,584.00 | 43,152,800 | 貸付有価証券 400株 |
| ツバキ・ナカシマ | 12,600 | 1,392.00 | 17,539,200 | 貸付有価証券 5,700株 |
| ホシザキ電機 | 29,700 | 8,050.00 | 239,085,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 大豊工業 | 10,900 | 1,097.00 | 11,957,300 | |
| 日本精工 | 278,700 | 1,022.00 | 284,831,400 | 貸付有価証券 5,100株 |
| N T N | 336,000 | 355.00 | 119,280,000 | |
| ジェイテクト | 144,600 | 1,549.00 | 223,985,400 | |
| 不二越 | 126,000 | 367.00 | 46,242,000 | 貸付有価証券 57,000株 |
| 日本トムソン | 46,000 | 394.00 | 18,124,000 | |
| T H K | 90,200 | 1,967.00 | 177,423,400 | 貸付有価証券 41,600株（39,100株） |
| ユーシン精機 | 5,300 | 1,662.00 | 8,808,600 | |
| 前澤給装工業 | 5,500 | 1,385.00 | 7,617,500 | |
| イーグル工業 | 16,800 | 1,423.00 | 23,906,400 | |
| 前澤工業 | 9,900 | 275.00 | 2,722,500 | |
| 日本ピラー工業 | 13,700 | 900.00 | 12,330,000 | |
| キット | 65,900 | 474.00 | 31,236,600 | 貸付有価証券 23,100株（4,700株） |
| 日立工機 | 36,300 | 746.00 | 27,079,800 | 貸付有価証券 100株 |
| マキタ | 88,500 | 6,550.00 | 579,675,000 | 貸付有価証券 12,100株 |
| 日立造船 | 107,600 | 525.00 | 56,490,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------------|
| | | | | 2,600株 |
| 三菱重工業 | 2,416,000 | 403.60 | 975,097,600 | 貸付有価証券 9,000株(9,000株) |
| I H I | 1,043,000 | 184.00 | 191,912,000 | 貸付有価証券 393,000株(97,000 株) |
| 日清紡ホールディングス | 75,300 | 1,124.00 | 84,637,200 | |
| イビデン | 83,100 | 1,329.00 | 110,439,900 | 貸付有価証券 38,300株(31,400株) |
| コニカミノルタ | 338,800 | 927.00 | 314,067,600 | |
| ブラザー工業 | 175,400 | 1,184.00 | 207,673,600 | 貸付有価証券 75,900株 |
| ミネベア | 219,000 | 765.00 | 167,535,000 | 貸付有価証券 24,000株(18,000株) |
| 日立製作所 | 3,461,000 | 471.00 | 1,630,131,000 | |
| 東芝 | 2,856,000 | 166.60 | 475,809,600 | 貸付有価証券 1,285,000株 |
| 三菱電機 | 1,447,000 | 1,081.50 | 1,564,930,500 | |
| 富士電機 | 409,000 | 368.00 | 150,512,000 | |
| 東洋電機製造 | 27,000 | 310.00 | 8,370,000 | 貸付有価証券 3,000株 |
| 安川電機 | 168,500 | 1,240.00 | 208,940,000 | 貸付有価証券 46,100株 |
| シンフォニアテクノロ ジー | 88,000 | 144.00 | 12,672,000 | |
| 明電舎 | 125,000 | 461.00 | 57,625,000 | |
| オリジン電気 | 20,000 | 255.00 | 5,100,000 | |
| 山洋電気 | 36,000 | 498.00 | 17,928,000 | |
| デンヨー | 12,500 | 1,181.00 | 14,762,500 | 貸付有価証券 4,500株 |
| 東芝テック | 97,000 | 353.00 | 34,241,000 | |
| 芝浦メカトロニクス | 22,000 | 182.00 | 4,004,000 | 貸付有価証券 9,000株 |
| マブチモーター | 38,800 | 4,895.00 | 189,926,000 | |
| 日本電産 | 163,300 | 7,336.00 | 1,197,968,800 | 貸付有価証券 74,100株 |
| 東光高岳 | 7,500 | 1,330.00 | 9,975,000 | 貸付有価証券 700株 |
| ダブル・スコープ | 4,000 | 3,650.00 | 14,600,000 | 貸付有価証券 1,800株 |
| ダイヘン | 80,000 | 455.00 | 36,400,000 | |

| | | | | |
|----------------------|-----------|----------|-------------|----------------------------|
| 田淵電機 | 15,400 | 405.00 | 6,237,000 | 貸付有価証券 6,500株 |
| ヤーマン | 1,700 | 1,917.00 | 3,258,900 | |
| JVCケンウッド | 99,500 | 280.00 | 27,860,000 | 貸付有価証券 43,700株 |
| ミマキエンジニアリング | 9,100 | 424.00 | 3,858,400 | 貸付有価証券 4,200株(200株) |
| 第一精工 | 5,600 | 1,279.00 | 7,162,400 | 貸付有価証券 400株(400株) |
| 日新電機 | 31,800 | 905.00 | 28,779,000 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 大崎電気工業 | 25,000 | 680.00 | 17,000,000 | 貸付有価証券 10,000株 |
| オムロン | 155,700 | 3,025.00 | 470,992,500 | 貸付有価証券 21,300株 |
| 日東工業 | 21,700 | 1,827.00 | 39,645,900 | |
| I D E C | 17,700 | 971.00 | 17,186,700 | |
| 不二電機工業 | 1,300 | 1,313.00 | 1,706,900 | 貸付有価証券 200株 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 261,000 | 442.00 | 115,362,000 | 貸付有価証券 102,000株 |
| サクサホールディングス | 34,000 | 177.00 | 6,018,000 | 貸付有価証券 12,000株(12,000株) |
| メルコホールディングス | 7,500 | 2,001.00 | 15,007,500 | 貸付有価証券 3,200株(3,200株) |
| テクノメディカ | 3,000 | 2,069.00 | 6,207,000 | |
| 日本電気 | 1,865,000 | 275.00 | 512,875,000 | 貸付有価証券 33,000株 |
| 富士通 | 1,308,000 | 391.00 | 511,428,000 | |
| 沖電気工業 | 588,000 | 142.00 | 83,496,000 | 貸付有価証券 217,000株 |
| 岩崎通信機 | 64,000 | 67.00 | 4,288,000 | 貸付有価証券 28,000株 |
| 電気興業 | 36,000 | 508.00 | 18,288,000 | |
| サンケン電気 | 74,000 | 286.00 | 21,164,000 | 貸付有価証券 34,000株 |
| ナカヨ | 13,000 | 322.00 | 4,186,000 | 貸付有価証券 5,000株 |
| アイホン | 7,700 | 1,780.00 | 13,706,000 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 70,200 | 663.00 | 46,542,600 | 貸付有価証券 32,400株(900株) |

| | | | | |
|------------|-----------|----------|---------------|-----------------------------|
| セイコーエプソン | 202,000 | 1,765.00 | 356,530,000 | 貸付有価証券 59,000株(1,100株) |
| ワコム | 106,800 | 451.00 | 48,166,800 | 貸付有価証券 42,800株 |
| アルバック | 24,900 | 3,020.00 | 75,198,000 | |
| アクセル | 6,100 | 863.00 | 5,264,300 | 貸付有価証券 800株 |
| E I Z O | 13,400 | 2,905.00 | 38,927,000 | 貸付有価証券 1,900株 |
| ジャパンディスプレイ | 253,400 | 215.00 | 54,481,000 | 貸付有価証券 116,900株(59,600株) |
| 日本信号 | 37,400 | 807.00 | 30,181,800 | |
| 京三製作所 | 32,000 | 316.00 | 10,112,000 | |
| 能美防災 | 15,400 | 1,341.00 | 20,651,400 | |
| ホーチキ | 9,800 | 1,087.00 | 10,652,600 | |
| エレコム | 11,700 | 1,414.00 | 16,543,800 | |
| 日本無線 | 35,000 | 266.00 | 9,310,000 | 貸付有価証券 14,000株 |
| パナソニック | 1,550,100 | 877.00 | 1,359,437,700 | |
| シャープ | 1,147,000 | 156.00 | 178,932,000 | 貸付有価証券 529,000株(53,000株) |
| アンリツ | 81,500 | 625.00 | 50,937,500 | 貸付有価証券 37,600株 |
| 富士通ゼネラル | 41,000 | 1,490.00 | 61,090,000 | |
| 日立国際電気 | 31,000 | 1,274.00 | 39,494,000 | |
| ソニー | 957,200 | 2,481.00 | 2,374,813,200 | |
| T D K | 81,900 | 5,810.00 | 475,839,000 | |
| 帝国通信工業 | 32,000 | 163.00 | 5,216,000 | |
| ミツミ電機 | 51,600 | 474.00 | 24,458,400 | 貸付有価証券 22,700株(9,000株) |
| タムラ製作所 | 52,000 | 270.00 | 14,040,000 | |
| アルプス電気 | 115,100 | 1,829.00 | 210,517,900 | |
| 池上通信機 | 43,000 | 122.00 | 5,246,000 | 貸付有価証券 19,000株 |
| パイオニア | 219,500 | 230.00 | 50,485,000 | 貸付有価証券 93,400株(12,300株) |
| 日本電波工業 | 12,200 | 666.00 | 8,125,200 | 貸付有価証券 4,700株 |

| | | | | |
|---------------------|---------|-----------|-------------|---------------------------|
| 鈴木 | 3,900 | 459.00 | 1,790,100 | 貸付有価証券 1,200株（1,200株） |
| 日本トリム | 3,600 | 4,085.00 | 14,706,000 | 貸付有価証券 1,600株（100株） |
| ローランド ディー . ジー . | 6,700 | 2,279.00 | 15,269,300 | 貸付有価証券 2,500株 |
| フォスター電機 | 17,000 | 2,207.00 | 37,519,000 | |
| クラリオン | 71,000 | 338.00 | 23,998,000 | 貸付有価証券 31,000株（1,000株） |
| S M K | 40,000 | 497.00 | 19,880,000 | |
| ヨコオ | 9,700 | 513.00 | 4,976,100 | |
| 東光 | 27,000 | 361.00 | 9,747,000 | 貸付有価証券 12,000株 |
| ティアック | 98,000 | 40.00 | 3,920,000 | 貸付有価証券 45,000株 |
| ホシデン | 41,100 | 628.00 | 25,810,800 | 貸付有価証券 12,300株 |
| ヒロセ電機 | 21,900 | 12,680.00 | 277,692,000 | |
| 日本航空電子工業 | 39,000 | 1,170.00 | 45,630,000 | |
| T O A | 16,000 | 993.00 | 15,888,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 日立マクセル | 22,500 | 1,576.00 | 35,460,000 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 古野電気 | 16,100 | 684.00 | 11,012,400 | 貸付有価証券 1,000株 |
| ユニデンホールディング ス | 43,000 | 108.00 | 4,644,000 | 貸付有価証券 19,000株 |
| アルパイン | 32,300 | 1,238.00 | 39,987,400 | 貸付有価証券 6,800株 |
| スミダコーポレーション | 11,100 | 661.00 | 7,337,100 | 貸付有価証券 5,100株（1,000株） |
| アイコム | 7,500 | 2,191.00 | 16,432,500 | |
| リオン | 5,200 | 1,452.00 | 7,550,400 | |
| 船井電機 | 13,700 | 911.00 | 12,480,700 | 貸付有価証券 6,300株 |
| 横河電機 | 135,800 | 1,195.00 | 162,281,000 | 貸付有価証券 8,400株（5,300株） |
| 新電元工業 | 48,000 | 354.00 | 16,992,000 | |
| アズビル | 44,300 | 2,867.00 | 127,008,100 | |
| 東亜ディーケーケー | 5,700 | 501.00 | 2,855,700 | |
| 日本光電工業 | 56,700 | 2,721.00 | 154,280,700 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| | | | | 25,300株（10,800株） |
| チノー | 4,800 | 1,007.00 | 4,833,600 | |
| 共和電業 | 16,500 | 354.00 | 5,841,000 | |
| 日本電子材料 | 5,400 | 377.00 | 2,035,800 | 貸付有価証券 100株 |
| 堀場製作所 | 25,100 | 3,555.00 | 89,230,500 | |
| アドバンテスト | 92,500 | 1,009.00 | 93,332,500 | 貸付有価証券 36,800株（5,400株） |
| 小野測器 | 6,600 | 683.00 | 4,507,800 | 貸付有価証券 200株 |
| エスペック | 14,000 | 1,360.00 | 19,040,000 | |
| パナソニック デバイス SUNX | 11,900 | 538.00 | 6,402,200 | |
| キーエンス | 30,700 | 55,940.00 | 1,717,358,000 | 貸付有価証券 13,700株 |
| 日置電機 | 7,100 | 2,161.00 | 15,343,100 | |
| シスメックス | 105,300 | 6,310.00 | 664,443,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 日本マイクロニクス | 17,700 | 877.00 | 15,522,900 | 貸付有価証券 8,100株（5,200株） |
| メガチップス | 14,200 | 1,005.00 | 14,271,000 | 貸付有価証券 6,500株 |
| OBARA GROUP | 8,800 | 4,325.00 | 38,060,000 | 貸付有価証券 3,100株（300株） |
| 澤藤電機 | 7,000 | 177.00 | 1,239,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| コーセル | 18,800 | 948.00 | 17,822,400 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 新日本無線 | 9,900 | 360.00 | 3,564,000 | 貸付有価証券 4,500株（3,000株） |
| オブテックス | 10,000 | 2,641.00 | 26,410,000 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 千代田インテグレ | 7,100 | 2,552.00 | 18,119,200 | |
| レーザーテック | 15,900 | 1,300.00 | 20,670,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| スタンレー電気 | 97,400 | 2,517.00 | 245,155,800 | 貸付有価証券 25,100株（9,100株） |
| 岩崎電気 | 46,000 | 180.00 | 8,280,000 | 貸付有価証券 3,000株 |
| ウシオ電機 | 82,300 | 1,594.00 | 131,186,200 | |
| 岡谷電機産業 | 7,200 | 367.00 | 2,642,400 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | | | 100株(100株) |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 11,500 | 378.00 | 4,347,000 | 貸付有価証券 5,300株 |
| 日本セラミック | 7,800 | 1,852.00 | 14,445,600 | 貸付有価証券 3,500株(1,300株) |
| 遠藤照明 | 6,800 | 1,010.00 | 6,868,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 日本デジタル研究所 | 11,400 | 1,556.00 | 17,738,400 | |
| 古河電池 | 10,000 | 610.00 | 6,100,000 | 貸付有価証券 4,000株(3,000株) |
| 双信電機 | 6,600 | 252.00 | 1,663,200 | 貸付有価証券 500株 |
| 山一電機 | 11,800 | 537.00 | 6,336,600 | 貸付有価証券 5,200株(3,900株) |
| 図研 | 9,800 | 1,176.00 | 11,524,800 | 貸付有価証券 300株(300株) |
| 日本電子 | 54,000 | 548.00 | 29,592,000 | |
| カシオ計算機 | 136,000 | 2,070.00 | 281,520,000 | 貸付有価証券 62,700株 |
| ファナック | 138,800 | 16,120.00 | 2,237,456,000 | |
| 日本シイエムケイ | 29,200 | 340.00 | 9,928,000 | 貸付有価証券 13,400株 |
| エンプラス | 6,900 | 3,720.00 | 25,668,000 | 貸付有価証券 600株(600株) |
| 大真空 | 25,000 | 200.00 | 5,000,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| ローム | 66,900 | 4,780.00 | 319,782,000 | |
| 浜松ホトニクス | 105,900 | 2,724.00 | 288,471,600 | 貸付有価証券 48,600株 |
| 三井ハイテック | 19,700 | 538.00 | 10,598,600 | 貸付有価証券 200株 |
| 新光電気工業 | 51,200 | 631.00 | 32,307,200 | 貸付有価証券 17,600株 |
| 京セラ | 222,700 | 4,893.00 | 1,089,671,100 | |
| 太陽誘電 | 66,000 | 1,125.00 | 74,250,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 村田製作所 | 142,300 | 13,595.00 | 1,934,568,500 | 貸付有価証券 400株 |
| ユーシン | 17,900 | 651.00 | 11,652,900 | 貸付有価証券 6,700株(5,200株) |
| 双葉電子工業 | 23,200 | 1,439.00 | 33,384,800 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|---------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| | | | | 200株 |
| 北陸電気工業 | 55,000 | 122.00 | 6,710,000 | 貸付有価証券 25,000株 |
| ニチコン | 42,700 | 729.00 | 31,128,300 | |
| 日本ケミコン | 110,000 | 147.00 | 16,170,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| K O A | 18,800 | 874.00 | 16,431,200 | |
| 市光工業 | 32,000 | 175.00 | 5,600,000 | 貸付有価証券 14,000株 |
| 小糸製作所 | 81,300 | 4,910.00 | 399,183,000 | |
| ミツバ | 23,000 | 1,475.00 | 33,925,000 | |
| スター精密 | 25,800 | 1,255.00 | 32,379,000 | 貸付有価証券 11,800株 |
| S C R E E Nホールディングス | 139,000 | 825.00 | 114,675,000 | 貸付有価証券 18,000株 |
| キヤノン電子 | 12,400 | 1,635.00 | 20,274,000 | |
| キヤノン | 730,400 | 3,206.00 | 2,341,662,400 | 貸付有価証券 23,300株 |
| リコー | 439,300 | 1,150.00 | 505,195,000 | 貸付有価証券 49,900株 |
| M U T O Hホールディングス | 16,000 | 201.00 | 3,216,000 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 東京エレクトロン | 121,700 | 6,677.00 | 812,590,900 | 貸付有価証券 400株 |
| トヨタ紡織 | 47,400 | 1,773.00 | 84,040,200 | |
| 鬼怒川ゴム工業 | 31,000 | 513.00 | 15,903,000 | 貸付有価証券 8,000株(8,000株) |
| ユニプレス | 28,100 | 1,770.00 | 49,737,000 | |
| 豊田自動織機 | 123,500 | 4,825.00 | 595,887,500 | 貸付有価証券 10,900株 |
| モリタホールディングス | 23,700 | 1,199.00 | 28,416,300 | 貸付有価証券 5,500株 |
| 三櫻工業 | 17,200 | 572.00 | 9,838,400 | |
| デンソー | 335,200 | 4,251.00 | 1,424,935,200 | 貸付有価証券 8,200株 |
| 東海理化電機製作所 | 39,700 | 2,449.00 | 97,225,300 | |
| 三井造船 | 525,000 | 138.00 | 72,450,000 | 貸付有価証券 122,000株 |
| 川崎重工業 | 1,056,000 | 303.00 | 319,968,000 | 貸付有価証券 235,000株(7,000株) |
| 名村造船所 | 40,700 | 664.00 | 27,024,800 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|--------------|-----------|----------|----------------|---------------------------|
| | | | | 14,800株(200株) |
| サノヤスホールディングス | 16,500 | 199.00 | 3,283,500 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 日本車輛製造 | 56,000 | 231.00 | 12,936,000 | 貸付有価証券 25,000株(8,000株) |
| ニチュ三菱フォークリフト | 15,600 | 454.00 | 7,082,400 | |
| 近畿車輛 | 20,000 | 277.00 | 5,540,000 | 貸付有価証券 9,000株 |
| 日産自動車 | 1,904,400 | 979.70 | 1,865,740,680 | 貸付有価証券 44,900株 |
| いすゞ自動車 | 393,100 | 1,123.50 | 441,647,850 | |
| トヨタ自動車 | 1,687,400 | 6,076.00 | 10,252,642,400 | 貸付有価証券 35,600株(7,500株) |
| 日野自動車 | 193,600 | 1,147.00 | 222,059,200 | 貸付有価証券 25,100株 |
| 三菱自動車工業 | 538,700 | 812.00 | 437,424,400 | |
| エフテック | 7,100 | 1,030.00 | 7,313,000 | 貸付有価証券 3,100株(1,700株) |
| レシップホールディングス | 4,400 | 710.00 | 3,124,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| GMB | 2,200 | 808.00 | 1,777,600 | |
| ファルテック | 2,400 | 1,286.00 | 3,086,400 | |
| 武蔵精密工業 | 14,500 | 2,102.00 | 30,479,000 | 貸付有価証券 5,000株(5,000株) |
| 日産車体 | 66,200 | 1,158.00 | 76,659,600 | 貸付有価証券 8,100株 |
| 新明和工業 | 59,000 | 774.00 | 45,666,000 | |
| 極東開発工業 | 27,000 | 1,057.00 | 28,539,000 | 貸付有価証券 11,800株 |
| 日信工業 | 30,300 | 1,407.00 | 42,632,100 | 貸付有価証券 14,000株 |
| トピー工業 | 112,000 | 209.00 | 23,408,000 | |
| ティラド | 53,000 | 161.00 | 8,533,000 | |
| 曙ブレーキ工業 | 68,700 | 234.00 | 16,075,800 | 貸付有価証券 31,700株(900株) |
| タチエス | 21,500 | 1,435.00 | 30,852,500 | |
| NOK | 65,600 | 1,888.00 | 123,852,800 | |
| フタバ産業 | 41,300 | 488.00 | 20,154,400 | 貸付有価証券 2,700株 |
| KYB | 152,000 | 294.00 | 44,688,000 | |

| | | | | |
|------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| シロキ工業 | 34,000 | 329.00 | 11,186,000 | |
| 大同メタル工業 | 18,900 | 774.00 | 14,628,600 | 貸付有価証券 4,900株 |
| プレス工業 | 72,000 | 386.00 | 27,792,000 | 貸付有価証券 21,200株 |
| ミクニ | 12,900 | 322.00 | 4,153,800 | 貸付有価証券 400株 |
| カルソニックカンセイ | 104,000 | 741.00 | 77,064,000 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 太平洋工業 | 30,100 | 1,002.00 | 30,160,200 | 貸付有価証券 13,600株(12,000株) |
| ケーヒン | 31,200 | 1,550.00 | 48,360,000 | |
| 河西工業 | 16,600 | 1,233.00 | 20,467,800 | |
| アイシン精機 | 136,500 | 4,485.00 | 612,202,500 | 貸付有価証券 21,400株 |
| 富士機工 | 15,700 | 419.00 | 6,578,300 | |
| マツダ | 429,600 | 1,642.50 | 705,618,000 | |
| ダイハツ工業 | 161,900 | 1,608.00 | 260,335,200 | 貸付有価証券 74,700株(26,900株) |
| 今仙電機製作所 | 12,400 | 1,031.00 | 12,784,400 | 貸付有価証券 4,100株(3,900株) |
| 本田技研工業 | 1,220,900 | 2,958.00 | 3,611,422,200 | |
| スズキ | 283,600 | 2,796.00 | 792,945,600 | |
| 富士重工業 | 428,700 | 3,676.00 | 1,575,901,200 | |
| 安永 | 4,500 | 498.00 | 2,241,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| ヤマハ発動機 | 191,600 | 1,794.00 | 343,730,400 | |
| ショーワ | 35,200 | 895.00 | 31,504,000 | |
| T B K | 16,100 | 360.00 | 5,796,000 | |
| エクセディ | 18,400 | 2,266.00 | 41,694,400 | 貸付有価証券 8,500株 |
| 豊田合成 | 49,300 | 2,218.00 | 109,347,400 | 貸付有価証券 2,800株(2,800株) |
| 愛三工業 | 23,800 | 910.00 | 21,658,000 | |
| 盟和産業 | 1,700 | 838.00 | 1,424,600 | |
| ヨロズ | 12,700 | 2,169.00 | 27,546,300 | |
| エフ・シー・シー | 22,200 | 1,900.00 | 42,180,000 | |
| シマノ | 54,700 | 17,320.00 | 947,404,000 | 貸付有価証券 8,700株 |
| タカタ | 24,500 | 495.00 | 12,127,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| | | | | 11,300株(1,800株) |
| テイ・エス テック | 31,500 | 2,510.00 | 79,065,000 | 貸付有価証券 3,800株(3,600株) |
| ジャムコ | 5,900 | 2,522.00 | 14,879,800 | 貸付有価証券 2,700株 |
| テルモ | 208,000 | 3,750.00 | 780,000,000 | 貸付有価証券 700株 |
| クリエートメディック | 4,500 | 817.00 | 3,676,500 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 日機装 | 50,700 | 793.00 | 40,205,100 | 貸付有価証券 900株 |
| 島津製作所 | 175,000 | 1,766.00 | 309,050,000 | |
| J M S | 25,000 | 286.00 | 7,150,000 | |
| クボテック | 2,900 | 417.00 | 1,209,300 | 貸付有価証券 1,300株(1,000株) |
| モリテックス | 2,900 | 289.00 | 838,100 | 貸付有価証券 100株 |
| 長野計器 | 8,700 | 587.00 | 5,106,900 | 貸付有価証券 3,100株(2,500株) |
| ブイ・テクノロジー | 3,200 | 3,525.00 | 11,280,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 東京計器 | 43,000 | 161.00 | 6,923,000 | |
| 愛知時計電機 | 18,000 | 302.00 | 5,436,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| オーバル | 13,200 | 210.00 | 2,772,000 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 東京精密 | 26,200 | 2,118.00 | 55,491,600 | |
| マニー | 12,400 | 1,638.00 | 20,311,200 | 貸付有価証券 5,700株 |
| ニコン | 253,300 | 1,695.00 | 429,343,500 | 貸付有価証券 103,300株(6,600株) |
| トプコン | 45,500 | 1,091.00 | 49,640,500 | 貸付有価証券 21,000株 |
| オリンパス | 202,100 | 4,010.00 | 810,421,000 | 貸付有価証券 4,800株 |
| 理研計器 | 11,000 | 1,050.00 | 11,550,000 | |
| タムロン | 10,900 | 1,692.00 | 18,442,800 | |
| H O Y A | 315,700 | 4,078.00 | 1,287,424,600 | |
| ノーリツ鋼機 | 12,200 | 409.00 | 4,989,800 | |
| エー・アンド・デイ | 12,300 | 371.00 | 4,563,300 | |
| シチズンホールディング | 167,000 | 636.00 | 106,212,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| ス | | | | 1,400株(1,400株) |
| リズム時計工業 | 59,000 | 134.00 | 7,906,000 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 大研医器 | 10,700 | 866.00 | 9,266,200 | 貸付有価証券 4,900株(200株) |
| メニコン | 6,800 | 3,035.00 | 20,638,000 | |
| 松風 | 6,600 | 1,256.00 | 8,289,600 | 貸付有価証券 2,200株 |
| セイコーホールディングス | 87,000 | 406.00 | 35,322,000 | 貸付有価証券 8,000株(8,000株) |
| ニプロ | 101,100 | 1,069.00 | 108,075,900 | 貸付有価証券 43,000株 |
| スノーピーク | 1,100 | 3,495.00 | 3,844,500 | 貸付有価証券 500株(400株) |
| パラマウントベッドホールディングス | 14,300 | 3,710.00 | 53,053,000 | |
| トランザクション | 2,000 | 558.00 | 1,116,000 | 貸付有価証券 900株 |
| S H O - B I | 4,500 | 372.00 | 1,674,000 | 貸付有価証券 200株 |
| ニホンフラッシュ | 4,000 | 968.00 | 3,872,000 | 貸付有価証券 1,800株(100株) |
| 前田工織 | 14,900 | 944.00 | 14,065,600 | 貸付有価証券 6,900株 |
| 永大産業 | 19,000 | 391.00 | 7,429,000 | |
| アートネイチャー | 10,900 | 902.00 | 9,831,800 | |
| ダンロップスポーツ | 8,600 | 906.00 | 7,791,600 | 貸付有価証券 3,900株(100株) |
| バンダイナムコホールディングス | 140,300 | 2,278.00 | 319,603,400 | 貸付有価証券 100株 |
| アイフィスジャパン | 2,300 | 379.00 | 871,700 | |
| 共立印刷 | 22,500 | 281.00 | 6,322,500 | |
| S H O E I | 6,500 | 1,839.00 | 11,953,500 | |
| フランスベッドホールディングス | 18,900 | 950.00 | 17,955,000 | |
| パイロットコーポレーション | 23,700 | 3,630.00 | 86,031,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 萩原工業 | 2,800 | 2,027.00 | 5,675,600 | |
| トッパン・フォームズ | 24,200 | 1,356.00 | 32,815,200 | |
| フジシールインターナショナル | 16,500 | 3,725.00 | 61,462,500 | 貸付有価証券 1,100株 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|------------------------------|
| タカラトミー | 44,600 | 780.00 | 34,788,000 | 貸付有価証券 19,500株(4,600株) |
| 廣済堂 | 12,600 | 326.00 | 4,107,600 | 貸付有価証券 5,600株 |
| A s - m e エステール | 3,600 | 584.00 | 2,102,400 | |
| アーク | 57,100 | 79.00 | 4,510,900 | 貸付有価証券 26,300株 |
| タカノ | 6,000 | 599.00 | 3,594,000 | |
| プロネクサス | 12,700 | 1,083.00 | 13,754,100 | |
| ホクシン | 10,800 | 105.00 | 1,134,000 | 貸付有価証券 200株 |
| ウッドワン | 25,000 | 229.00 | 5,725,000 | |
| 大建工業 | 53,000 | 245.00 | 12,985,000 | |
| 凸版印刷 | 383,000 | 976.00 | 373,808,000 | 貸付有価証券 11,000株(6,000株) |
| 大日本印刷 | 401,000 | 972.00 | 389,772,000 | 貸付有価証券 120,000株(120,000株) |
| 図書印刷 | 25,000 | 444.00 | 11,100,000 | 貸付有価証券 11,000株 |
| 共同印刷 | 46,000 | 332.00 | 15,272,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 日本写真印刷 | 22,800 | 2,044.00 | 46,603,200 | |
| 光村印刷 | 13,000 | 204.00 | 2,652,000 | |
| 宝印刷 | 6,500 | 1,234.00 | 8,021,000 | |
| アシックス | 126,400 | 1,862.00 | 235,356,800 | 貸付有価証券 58,300株(9,300株) |
| ツツミ | 6,800 | 2,366.00 | 16,088,800 | |
| 小松ウオール工業 | 4,600 | 1,668.00 | 7,672,800 | |
| ヤマハ | 99,700 | 2,960.00 | 295,112,000 | |
| 河合楽器製作所 | 5,000 | 1,874.00 | 9,370,000 | 貸付有価証券 1,400株(300株) |
| クリナップ | 15,900 | 698.00 | 11,098,200 | |
| ピジョン | 76,900 | 2,370.00 | 182,253,000 | 貸付有価証券 35,400株 |
| 兼松日産農林 | 14,000 | 128.00 | 1,792,000 | |
| キングジム | 11,300 | 735.00 | 8,305,500 | |
| リンテック | 32,300 | 2,087.00 | 67,410,100 | |
| T A S A K I | 2,500 | 1,286.00 | 3,215,000 | 貸付有価証券 1,100株(100株) |

| | | | | |
|-----------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| イトーキ | 28,600 | 720.00 | 20,592,000 | 貸付有価証券 11,400株(11,100株) |
| 任天堂 | 83,600 | 15,610.00 | 1,304,996,000 | |
| 三菱鉛筆 | 10,200 | 4,305.00 | 43,911,000 | 貸付有価証券 4,700株(4,700株) |
| タカラスタンダード | 56,000 | 939.00 | 52,584,000 | |
| コクヨ | 70,500 | 1,118.00 | 78,819,000 | |
| ナカバヤシ | 28,000 | 250.00 | 7,000,000 | |
| グロープライド | 6,600 | 1,429.00 | 9,431,400 | |
| 岡村製作所 | 47,300 | 998.00 | 47,205,400 | |
| 美津濃 | 73,000 | 479.00 | 34,967,000 | |
| アデランス | 23,500 | 522.00 | 12,267,000 | 貸付有価証券 10,800株(5,700株) |
| 東京電力 | 1,150,900 | 544.00 | 626,089,600 | 貸付有価証券 52,000株 |
| 中部電力 | 415,100 | 1,442.00 | 598,574,200 | |
| 関西電力 | 553,600 | 1,263.00 | 699,196,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 中国電力 | 187,600 | 1,546.00 | 290,029,600 | 貸付有価証券 24,200株 |
| 北陸電力 | 132,900 | 1,663.00 | 221,012,700 | |
| 東北電力 | 339,000 | 1,464.00 | 496,296,000 | |
| 四国電力 | 122,200 | 1,626.00 | 198,697,200 | 貸付有価証券 47,700株 |
| 九州電力 | 299,600 | 1,110.00 | 332,556,000 | 貸付有価証券 138,300株 |
| 北海道電力 | 127,000 | 1,000.00 | 127,000,000 | |
| 沖縄電力 | 14,400 | 2,873.00 | 41,371,200 | |
| 電源開発 | 115,700 | 3,395.00 | 392,801,500 | 貸付有価証券 12,400株 |
| イーレックス | 2,600 | 1,644.00 | 4,274,400 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 東京瓦斯 | 1,514,000 | 532.50 | 806,205,000 | |
| 大阪瓦斯 | 1,404,000 | 427.60 | 600,350,400 | |
| 東邦瓦斯 | 342,000 | 757.00 | 258,894,000 | |
| 北海道瓦斯 | 32,000 | 274.00 | 8,768,000 | 貸付有価証券 14,000株 |
| 広島ガス | 23,600 | 406.00 | 9,581,600 | |
| 西部瓦斯 | 153,000 | 244.00 | 37,332,000 | |

| | | | | |
|----------------|-----------|-----------|---------------|---------------------------------|
| 静岡ガス | 38,500 | 727.00 | 27,989,500 | |
| メタウォーター | 8,700 | 2,438.00 | 21,210,600 | 貸付有価証券 4,000株 |
| SBSホールディングス | 13,400 | 674.00 | 9,031,600 | |
| 東武鉄道 | 725,000 | 578.00 | 419,050,000 | 貸付有価証券 124,000株（27,000 株） |
| 相鉄ホールディングス | 233,000 | 689.00 | 160,537,000 | |
| 東京急行電鉄 | 790,000 | 890.00 | 703,100,000 | 貸付有価証券 18,000株（13,000株） |
| 京浜急行電鉄 | 372,000 | 1,006.00 | 374,232,000 | 貸付有価証券 13,000株 |
| 小田急電鉄 | 435,000 | 1,299.00 | 565,065,000 | 貸付有価証券 98,000株 |
| 京王電鉄 | 379,000 | 1,053.00 | 399,087,000 | 貸付有価証券 17,000株（2,000株） |
| 京成電鉄 | 203,000 | 1,585.00 | 321,755,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 富士急行 | 37,000 | 1,219.00 | 45,103,000 | 貸付有価証券 10,000株（4,000株） |
| 新京成電鉄 | 17,000 | 415.00 | 7,055,000 | |
| 東日本旅客鉄道 | 248,000 | 9,603.00 | 2,381,544,000 | 貸付有価証券 14,700株（14,700株） |
| 西日本旅客鉄道 | 130,600 | 6,493.00 | 847,985,800 | |
| 東海旅客鉄道 | 121,500 | 20,325.00 | 2,469,487,500 | 貸付有価証券 500株（500株） |
| 西武ホールディングス | 108,100 | 2,217.00 | 239,657,700 | 貸付有価証券 29,000株 |
| 鴻池運輸 | 19,200 | 1,245.00 | 23,904,000 | |
| 西日本鉄道 | 176,000 | 821.00 | 144,496,000 | 貸付有価証券 1,000株（1,000株） |
| ハマキョウレックス | 10,400 | 1,748.00 | 18,179,200 | 貸付有価証券 900株 |
| サカイ引越センター | 5,300 | 2,601.00 | 13,785,300 | 貸付有価証券 2,400株（2,000株） |
| 近鉄グループホールディングス | 1,365,000 | 483.00 | 659,295,000 | 貸付有価証券 271,000株 |
| 阪急阪神ホールディングス | 911,000 | 705.00 | 642,255,000 | |
| 南海電気鉄道 | 305,000 | 659.00 | 200,995,000 | |
| 京阪電気鉄道 | 304,000 | 771.00 | 234,384,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------|-----------|----------|-------------|----------------------------|
| | | | | 80,000株 |
| 神戸電鉄 | 33,000 | 352.00 | 11,616,000 | 貸付有価証券 6,000株(6,000株) |
| 名古屋鉄道 | 494,000 | 550.00 | 271,700,000 | 貸付有価証券 162,000株 |
| 山陽電気鉄道 | 49,000 | 457.00 | 22,393,000 | |
| 日本通運 | 525,000 | 498.00 | 261,450,000 | |
| ヤマトホールディングス | 250,700 | 2,239.50 | 561,442,650 | 貸付有価証券 37,200株 |
| 山九 | 179,000 | 525.00 | 93,975,000 | |
| 丸運 | 7,300 | 237.00 | 1,730,100 | |
| 丸全昭和運輸 | 46,000 | 405.00 | 18,630,000 | 貸付有価証券 10,000株(10,000株) |
| センコー | 61,000 | 706.00 | 43,066,000 | 貸付有価証券 17,000株 |
| トナミホールディングス | 28,000 | 257.00 | 7,196,000 | |
| ニッコンホールディングス | 44,400 | 1,937.00 | 86,002,800 | |
| 日本石油輸送 | 15,000 | 238.00 | 3,570,000 | |
| 福山通運 | 82,000 | 527.00 | 43,214,000 | 貸付有価証券 38,000株(29,000株) |
| セイノーホールディングス | 96,200 | 1,201.00 | 115,536,200 | |
| 神奈川中央交通 | 16,000 | 668.00 | 10,688,000 | 貸付有価証券 5,000株(5,000株) |
| 日立物流 | 28,300 | 1,675.00 | 47,402,500 | |
| 丸和運輸機関 | 3,000 | 1,974.00 | 5,922,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| C & F ロジホールディングス | 13,000 | 829.00 | 10,777,000 | |
| 日本郵船 | 1,218,000 | 206.00 | 250,908,000 | |
| 商船三井 | 661,000 | 203.00 | 134,183,000 | 貸付有価証券 296,000株 |
| 川崎汽船 | 594,000 | 184.00 | 109,296,000 | 貸付有価証券 274,000株 |
| N S ユナイテッド海運 | 61,000 | 153.00 | 9,333,000 | 貸付有価証券 25,000株 |
| 明治海運 | 12,100 | 343.00 | 4,150,300 | 貸付有価証券 3,000株(3,000株) |
| 飯野海運 | 70,200 | 436.00 | 30,607,200 | |
| 共栄タンカー | 11,000 | 135.00 | 1,485,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|---------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| | | | | 5,000株 |
| 乾汽船 | 10,700 | 747.00 | 7,992,900 | 貸付有価証券 4,300株 |
| 日本航空 | 259,700 | 4,007.00 | 1,040,617,900 | |
| A N Aホールディングス | 2,518,000 | 309.00 | 778,062,000 | 貸付有価証券 142,000株 |
| パスコ | 12,000 | 381.00 | 4,572,000 | 貸付有価証券 5,000株 |
| トランコム | 3,900 | 6,440.00 | 25,116,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 日新 | 56,000 | 292.00 | 16,352,000 | |
| 三菱倉庫 | 96,000 | 1,428.00 | 137,088,000 | 貸付有価証券 15,000株 |
| 三井倉庫ホールディングス | 79,000 | 266.00 | 21,014,000 | 貸付有価証券 26,000株(9,000株) |
| 住友倉庫 | 99,000 | 544.00 | 53,856,000 | |
| 澁澤倉庫 | 35,000 | 270.00 | 9,450,000 | |
| 東陽倉庫 | 23,000 | 223.00 | 5,129,000 | |
| 日本トランスシティ | 31,000 | 345.00 | 10,695,000 | |
| ケイヒン | 25,000 | 142.00 | 3,550,000 | |
| 中央倉庫 | 7,800 | 896.00 | 6,988,800 | |
| 安田倉庫 | 10,600 | 684.00 | 7,250,400 | |
| 東洋埠頭 | 39,000 | 141.00 | 5,499,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 宇徳 | 11,000 | 314.00 | 3,454,000 | |
| 上組 | 162,000 | 1,003.00 | 162,486,000 | 貸付有価証券 10,000株(10,000株) |
| サンリツ | 3,300 | 489.00 | 1,613,700 | |
| キムラユニティー | 3,400 | 1,076.00 | 3,658,400 | |
| キューソー流通システム | 3,700 | 2,079.00 | 7,692,300 | |
| 郵船ロジスティクス | 12,500 | 1,212.00 | 15,150,000 | 貸付有価証券 3,700株(400株) |
| 近鉄エクスプレス | 24,300 | 1,572.00 | 38,199,600 | 貸付有価証券 8,900株(8,600株) |
| 東海運 | 7,300 | 270.00 | 1,971,000 | 貸付有価証券 2,500株(2,500株) |
| エーアイティー | 6,200 | 991.00 | 6,144,200 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 内外トランスライン | 3,400 | 845.00 | 2,873,000 | 貸付有価証券 1,400株(1,400株) |

| | | | | |
|---------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| NEC ネットエスアイ | 16,800 | 1,734.00 | 29,131,200 | |
| システナ | 13,100 | 1,491.00 | 19,532,100 | |
| デジタルアーツ | 6,500 | 1,975.00 | 12,837,500 | 貸付有価証券 2,900株（2,600株） |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 22,300 | 1,917.00 | 42,749,100 | |
| キューブシステム | 5,800 | 498.00 | 2,888,400 | |
| コア | 5,600 | 1,135.00 | 6,356,000 | 貸付有価証券 2,500株 |
| ソフトクリエイティブホールディングス | 4,800 | 756.00 | 3,628,800 | 貸付有価証券 1,900株（1,900株） |
| ITホールディングス | 44,400 | 2,459.00 | 109,179,600 | |
| ネオス | 4,000 | 407.00 | 1,628,000 | 貸付有価証券 1,800株（800株） |
| 電算システム | 4,600 | 1,438.00 | 6,614,800 | 貸付有価証券 2,000株 |
| グリー | 81,200 | 544.00 | 44,172,800 | 貸付有価証券 21,400株 |
| コーエーテックモホールディングス | 31,800 | 1,593.00 | 50,657,400 | 貸付有価証券 100株（100株） |
| 三菱総合研究所 | 5,200 | 3,150.00 | 16,380,000 | |
| ボルテージ | 2,600 | 1,153.00 | 2,997,800 | 貸付有価証券 200株 |
| 電算 | 1,500 | 2,296.00 | 3,444,000 | 貸付有価証券 200株 |
| AGS | 2,200 | 803.00 | 1,766,600 | 貸付有価証券 800株 |
| ファインデックス | 8,800 | 843.00 | 7,418,400 | 貸付有価証券 4,000株（2,800株） |
| ヒト・コミュニケーションズ | 3,000 | 1,671.00 | 5,013,000 | 貸付有価証券 1,400株（400株） |
| ブレインパッド | 2,000 | 599.00 | 1,198,000 | 貸付有価証券 900株 |
| KLab | 20,700 | 495.00 | 10,246,500 | 貸付有価証券 9,500株（200株） |
| ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ | 8,800 | 922.00 | 8,113,600 | 貸付有価証券 3,900株 |
| イーブックイニシアティブジャパン | 2,900 | 496.00 | 1,438,400 | 貸付有価証券 1,300株 |
| ネクソン | 128,000 | 1,573.00 | 201,344,000 | |
| アイスタイル | 20,400 | 774.00 | 15,789,600 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------------|---------|----------|------------|--------------------------|
| | | | | 4,400株(200株) |
| エムアップ | 3,500 | 456.00 | 1,596,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| エイチーム | 4,900 | 1,390.00 | 6,811,000 | 貸付有価証券 1,300株(200株) |
| テクノスジャパン | 1,500 | 2,570.00 | 3,855,000 | 貸付有価証券 600株 |
| e n i s h | 3,900 | 480.00 | 1,872,000 | 貸付有価証券 1,800株 |
| コロプラ | 37,000 | 1,970.00 | 72,890,000 | |
| モバイルクリエイト | 8,800 | 364.00 | 3,203,200 | 貸付有価証券 4,000株(300株) |
| オルトプラス | 4,900 | 367.00 | 1,798,300 | 貸付有価証券 2,200株(300株) |
| ブロードリーフ | 13,800 | 1,228.00 | 16,946,400 | 貸付有価証券 1,000株(1,000株) |
| ハーツユナイテッドグループ | 4,000 | 1,858.00 | 7,432,000 | 貸付有価証券 1,800株(1,100株) |
| ブイキューブ | 6,600 | 1,065.00 | 7,029,000 | 貸付有価証券 3,000株(200株) |
| サイバーリンクス | 1,500 | 782.00 | 1,173,000 | |
| VOYAGE GROUP | 3,000 | 1,043.00 | 3,129,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| オブティム | 800 | 4,030.00 | 3,224,000 | 貸付有価証券 300株(100株) |
| ベリサーブ | 1,500 | 1,959.00 | 2,938,500 | 貸付有価証券 700株(400株) |
| ティーガイア | 13,300 | 1,159.00 | 15,414,700 | |
| 日本アジアグループ | 11,400 | 468.00 | 5,335,200 | |
| 豆腐ホールディングス | 10,500 | 618.00 | 6,489,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| テクマトリックス | 5,700 | 1,394.00 | 7,945,800 | 貸付有価証券 2,600株 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 234,000 | 269.00 | 62,946,000 | 貸付有価証券 108,500株 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 11,600 | 5,520.00 | 64,032,000 | 貸付有価証券 5,300株(1,100株) |
| ザッパラス | 7,500 | 377.00 | 2,827,500 | 貸付有価証券 2,600株 |
| インターネットイニシアティブ | 21,600 | 2,083.00 | 44,992,800 | 貸付有価証券 800株 |
| さくらインターネット | 6,600 | 1,798.00 | 11,866,800 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| | | | | 3,000株(2,100株) |
| GMOクラウド | 3,000 | 659.00 | 1,977,000 | 貸付有価証券 700株 |
| SRAホールディングス | 7,700 | 2,243.00 | 17,271,100 | |
| Minorityソリューションズ | 1,900 | 836.00 | 1,588,400 | |
| システムインテグレータ | 1,900 | 693.00 | 1,316,700 | 貸付有価証券 800株 |
| 朝日ネット | 12,100 | 476.00 | 5,759,600 | |
| コムチュア | 2,300 | 1,878.00 | 4,319,400 | |
| gumi | 13,800 | 507.00 | 6,996,600 | 貸付有価証券 6,200株 |
| パイプドHD | 1,700 | 1,024.00 | 1,740,800 | 貸付有価証券 600株 |
| フェイス | 3,500 | 1,148.00 | 4,018,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| ハイマックス | 1,800 | 1,063.00 | 1,913,400 | |
| 野村総合研究所 | 93,800 | 3,780.00 | 354,564,000 | 貸付有価証券 1,900株(100株) |
| サイバネットシステム | 10,900 | 562.00 | 6,125,800 | 貸付有価証券 5,000株(4,700株) |
| CEホールディングス | 2,000 | 902.00 | 1,804,000 | |
| インテージホールディングス | 7,000 | 1,418.00 | 9,926,000 | |
| 東邦システムサイエンス | 3,900 | 560.00 | 2,184,000 | |
| ソースネクスト | 6,700 | 433.00 | 2,901,100 | 貸付有価証券 1,200株(1,200株) |
| ティー・ワイ・オー | 18,400 | 149.00 | 2,741,600 | 貸付有価証券 8,200株(600株) |
| クレスコ | 3,000 | 1,750.00 | 5,250,000 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 139,400 | 1,286.00 | 179,268,400 | 貸付有価証券 11,800株 |
| オービック | 46,200 | 5,380.00 | 248,556,000 | |
| ジャストシステム | 24,300 | 825.00 | 20,047,500 | 貸付有価証券 2,200株 |
| TDCソフトウェアエンジニアリング | 2,900 | 1,069.00 | 3,100,100 | |
| ヤフー | 959,700 | 436.00 | 418,429,200 | 貸付有価証券 434,800株 |
| トレンドマイクロ | 65,000 | 4,110.00 | 267,150,000 | |
| インフォメーション・ | 2,500 | 865.00 | 2,162,500 | |

| | | | | |
|-----------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| ディベロプメント | | | | |
| 日本オラクル | 21,500 | 4,980.00 | 107,070,000 | |
| アルファシステムズ | 4,400 | 1,630.00 | 7,172,000 | |
| フューチャーアーキテクト | 16,100 | 754.00 | 12,139,400 | |
| C A C H o l d i n g s | 10,000 | 714.00 | 7,140,000 | 貸付有価証券 1,800株 |
| ソフトバンク・テクノロジー | 3,600 | 1,218.00 | 4,384,800 | |
| トーセ | 3,600 | 669.00 | 2,408,400 | 貸付有価証券 100株 |
| オーピックビジネスコンサルティング | 6,800 | 4,495.00 | 30,566,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 30,300 | 2,105.00 | 63,781,500 | 貸付有価証券 5,300株 |
| アイティフォー | 17,400 | 449.00 | 7,812,600 | |
| 東計電算 | 2,400 | 1,891.00 | 4,538,400 | |
| エックスネット | 1,200 | 1,476.00 | 1,771,200 | |
| 大塚商会 | 36,000 | 5,370.00 | 193,320,000 | |
| サイボウズ | 17,800 | 294.00 | 5,233,200 | 貸付有価証券 1,300株 |
| ソフトブレイン | 19,600 | 137.00 | 2,685,200 | 貸付有価証券 5,600株 |
| 電通国際情報サービス | 8,200 | 2,087.00 | 17,113,400 | |
| E M システムズ | 2,200 | 2,582.00 | 5,680,400 | 貸付有価証券 500株（100株） |
| ウェザーニューズ | 4,500 | 3,555.00 | 15,997,500 | |
| C I J | 12,100 | 423.00 | 5,118,300 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 1,300 | 1,288.00 | 1,674,400 | 貸付有価証券 500株 |
| 日本エンタープライズ | 13,700 | 177.00 | 2,424,900 | 貸付有価証券 6,000株 |
| WOWOW | 6,400 | 2,471.00 | 15,814,400 | 貸付有価証券 1,200株（1,200株） |
| フュージョンパートナー | 7,600 | 487.00 | 3,701,200 | 貸付有価証券 900株 |
| 日本コロムビア | 4,600 | 459.00 | 2,111,400 | 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 | 11,300 | 365.00 | 4,124,500 | 貸付有価証券 5,200株 |

| | | | | |
|----------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| ネットワンシステムズ | 58,000 | 576.00 | 33,408,000 | 貸付有価証券 26,700株 |
| アルゴグラフィックス | 6,100 | 1,715.00 | 10,461,500 | |
| マーベラス | 22,600 | 811.00 | 18,328,600 | 貸付有価証券 10,400株（600株） |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 24,600 | 1,241.00 | 30,528,600 | 貸付有価証券 400株 |
| 日本ユニシス | 37,000 | 1,350.00 | 49,950,000 | 貸付有価証券 17,000株（10,700株） |
| 兼松エレクトロニクス | 8,400 | 1,827.00 | 15,346,800 | |
| 東京放送ホールディングス | 80,200 | 1,701.00 | 136,420,200 | 貸付有価証券 34,600株（11,200株） |
| 日本テレビホールディングス | 122,300 | 1,921.00 | 234,938,300 | |
| 朝日放送 | 13,200 | 674.00 | 8,896,800 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 36,600 | 1,975.00 | 72,285,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 101,600 | 643.00 | 65,328,800 | 貸付有価証券 6,500株 |
| テレビ東京ホールディングス | 12,100 | 1,803.00 | 21,816,300 | 貸付有価証券 5,500株 |
| 日本BS放送 | 2,200 | 1,012.00 | 2,226,400 | 貸付有価証券 700株（700株） |
| U - N E X T | 3,100 | 882.00 | 2,734,200 | 貸付有価証券 400株 |
| コネクシオ | 11,800 | 1,081.00 | 12,755,800 | 貸付有価証券 3,500株（3,500株） |
| 日本通信 | 71,100 | 164.00 | 11,660,400 | 貸付有価証券 32,800株（17,100株） |
| クロップス | 2,400 | 514.00 | 1,233,600 | |
| 日本電信電話 | 1,035,000 | 4,871.00 | 5,041,485,000 | |
| K D D I | 1,360,300 | 3,001.00 | 4,082,260,300 | 貸付有価証券 10,400株 |
| 光通信 | 16,100 | 7,740.00 | 124,614,000 | 貸付有価証券 700株 |
| N T T ドコモ | 1,032,700 | 2,641.00 | 2,727,360,700 | |
| エムティーアイ | 17,100 | 663.00 | 11,337,300 | 貸付有価証券 7,800株 |
| G M O インターネット | 49,600 | 1,169.00 | 57,982,400 | 貸付有価証券 22,900株（7,200株） |
| カドカワ | 41,800 | 1,630.00 | 68,134,000 | |

| | | | | |
|----------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| 学研ホールディングス | 45,000 | 230.00 | 10,350,000 | |
| ゼンリン | 17,700 | 1,789.00 | 31,665,300 | |
| 昭文社 | 7,300 | 623.00 | 4,547,900 | 貸付有価証券 700株 |
| インプレスホールディングス | 11,000 | 120.00 | 1,320,000 | 貸付有価証券 5,000株（100株） |
| アイネット | 7,500 | 1,062.00 | 7,965,000 | 貸付有価証券 1,900株（1,900株） |
| 松竹 | 88,000 | 1,019.00 | 89,672,000 | 貸付有価証券 40,000株 |
| 東宝 | 95,500 | 2,789.00 | 266,349,500 | |
| 東映 | 50,000 | 887.00 | 44,350,000 | |
| AOI Pro. | 6,700 | 978.00 | 6,552,600 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 82,700 | 5,580.00 | 461,466,000 | |
| ピー・シー・エー | 1,700 | 1,417.00 | 2,408,900 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 2,000 | 905.00 | 1,810,000 | |
| D T S | 14,900 | 2,041.00 | 30,410,900 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 56,700 | 2,751.00 | 155,981,700 | 貸付有価証券 22,500株（20,200株） |
| シーイーシー | 8,700 | 1,067.00 | 9,282,900 | |
| カプコン | 34,200 | 2,238.00 | 76,539,600 | |
| アイ・エス・ビー | 1,600 | 688.00 | 1,100,800 | 貸付有価証券 700株 |
| ジャステック | 8,500 | 865.00 | 7,352,500 | 貸付有価証券 3,900株 |
| S C S K | 31,800 | 4,315.00 | 137,217,000 | |
| 日本システムウエア | 5,000 | 860.00 | 4,300,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| アイネス | 18,900 | 1,017.00 | 19,221,300 | |
| T K C | 12,400 | 3,150.00 | 39,060,000 | |
| 富士ソフト | 19,900 | 2,279.00 | 45,352,100 | |
| N S D | 28,400 | 1,583.00 | 44,957,200 | |
| コナミホールディングス | 60,500 | 2,718.00 | 164,439,000 | 貸付有価証券 14,800株 |
| 福井コンピュータホールディングス | 2,900 | 941.00 | 2,728,900 | |
| J B C Cホールディングス | 11,200 | 649.00 | 7,268,800 | |

| | | | | |
|--------------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| ミロク情報サービス | 9,900 | 913.00 | 9,038,700 | |
| ソフトバンクグループ | 758,700 | 5,398.00 | 4,095,462,600 | |
| ハウスイ | 11,000 | 108.00 | 1,188,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 高千穂交易 | 5,100 | 863.00 | 4,401,300 | |
| 伊藤忠食品 | 3,300 | 4,135.00 | 13,645,500 | 貸付有価証券 800株(800株) |
| エレマテック | 6,200 | 2,095.00 | 12,989,000 | |
| JALUX | 4,300 | 2,029.00 | 8,724,700 | 貸付有価証券 1,500株(900株) |
| あらた | 6,000 | 2,138.00 | 12,828,000 | |
| トーメンデバイス | 2,000 | 1,713.00 | 3,426,000 | |
| 東京エレクトロン デバ イス | 4,800 | 1,486.00 | 7,132,800 | |
| フィールズ | 8,800 | 1,639.00 | 14,423,200 | 貸付有価証券 4,000株(3,700株) |
| 双日 | 843,500 | 216.00 | 182,196,000 | |
| アルフレッサ ホール ディングス | 168,300 | 1,914.00 | 322,126,200 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 横浜冷凍 | 33,100 | 1,012.00 | 33,497,200 | 貸付有価証券 15,300株(10,500株) |
| 神栄 | 18,000 | 105.00 | 1,890,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 山下医科器械 | 1,100 | 1,585.00 | 1,743,500 | 貸付有価証券 400株 |
| ラサ商事 | 6,300 | 603.00 | 3,798,900 | |
| アルコニックス | 7,600 | 1,237.00 | 9,401,200 | |
| 神戸物産 | 8,600 | 2,307.00 | 19,840,200 | 貸付有価証券 3,900株(200株) |
| あい ホールディングス | 23,800 | 2,563.00 | 60,999,400 | 貸付有価証券 3,100株 |
| ディー・ブイエックス | 3,600 | 1,023.00 | 3,682,800 | |
| ダイワボウホールディン グス | 122,000 | 198.00 | 24,156,000 | |
| マクニカ・富士エレホー ルディングス | 24,100 | 1,311.00 | 31,595,100 | |
| パイタルケー・エスケー・ ホールディングス | 23,200 | 955.00 | 22,156,000 | 貸付有価証券 8,800株(8,800株) |
| 八洲電機 | 10,300 | 522.00 | 5,376,600 | |
| U K C ホールディングス | 8,600 | 2,063.00 | 17,741,800 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| OCHIホールディングス | 3,900 | 965.00 | 3,763,500 | |
| TOKAIホールディングス | 58,800 | 570.00 | 33,516,000 | 貸付有価証券 27,100株（13,100株） |
| 三洋貿易 | 7,300 | 1,272.00 | 9,285,600 | |
| ウイン・パートナーズ | 4,800 | 1,421.00 | 6,820,800 | 貸付有価証券 300株 |
| ミタチ産業 | 3,400 | 629.00 | 2,138,600 | 貸付有価証券 500株 |
| シップヘルスケアホールディングス | 27,200 | 2,624.00 | 71,372,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 明治電機工業 | 4,200 | 1,043.00 | 4,380,600 | 貸付有価証券 1,900株 |
| デリカフーズ | 2,800 | 874.00 | 2,447,200 | 貸付有価証券 1,200株 |
| スターティア | 2,600 | 476.00 | 1,237,600 | 貸付有価証券 1,100株（1,100株） |
| 富士興産 | 5,200 | 421.00 | 2,189,200 | |
| 協栄産業 | 17,000 | 123.00 | 2,091,000 | |
| 小野建 | 11,600 | 961.00 | 11,147,600 | |
| 佐鳥電機 | 10,600 | 679.00 | 7,197,400 | 貸付有価証券 4,800株 |
| エコトレーディング | 3,100 | 609.00 | 1,887,900 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 伯東 | 10,200 | 959.00 | 9,781,800 | |
| コンドーテック | 10,600 | 751.00 | 7,960,600 | |
| 中山福 | 8,300 | 737.00 | 6,117,100 | 貸付有価証券 600株 |
| ナガイレーベン | 19,300 | 1,878.00 | 36,245,400 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 三菱食品 | 14,700 | 2,931.00 | 43,085,700 | |
| 松田産業 | 9,700 | 1,223.00 | 11,863,100 | |
| 第一興商 | 23,700 | 4,475.00 | 106,057,500 | |
| メディカルホールディングス | 133,900 | 1,620.00 | 216,918,000 | |
| アドヴァン | 13,600 | 979.00 | 13,314,400 | 貸付有価証券 700株 |
| S P K | 3,100 | 1,923.00 | 5,961,300 | |
| 萩原電気 | 3,400 | 1,831.00 | 6,225,400 | |
| アズワン | 10,500 | 3,935.00 | 41,317,500 | |

| | | | | |
|---------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| スズデン | 4,300 | 1,020.00 | 4,386,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 尾家産業 | 4,300 | 837.00 | 3,599,100 | |
| シモジマ | 9,200 | 1,069.00 | 9,834,800 | |
| ドウシシャ | 15,700 | 2,126.00 | 33,378,200 | |
| 小津産業 | 2,900 | 2,066.00 | 5,991,400 | |
| 高速 | 8,000 | 872.00 | 6,976,000 | |
| たけびし | 4,700 | 948.00 | 4,455,600 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 黒田電気 | 24,900 | 1,540.00 | 38,346,000 | |
| 丸文 | 11,800 | 676.00 | 7,976,800 | |
| ハピネット | 12,200 | 899.00 | 10,967,800 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 橋本総業 | 2,800 | 1,433.00 | 4,012,400 | |
| エクセル | 6,500 | 1,241.00 | 8,066,500 | 貸付有価証券 2,900株 |
| マルカキカイ | 4,300 | 1,290.00 | 5,547,000 | 貸付有価証券 500株 |
| ガリバーインターナショナル | 36,000 | 1,108.00 | 39,888,000 | 貸付有価証券 16,600株（14,000株） |
| 日本エム・ディ・エム | 11,200 | 555.00 | 6,216,000 | 貸付有価証券 5,100株 |
| 進和 | 7,900 | 1,361.00 | 10,751,900 | |
| エスケイジャパン | 3,200 | 460.00 | 1,472,000 | 貸付有価証券 1,400株（1,100株） |
| ダイトエレクトロン | 6,100 | 693.00 | 4,227,300 | 貸付有価証券 300株 |
| シークス | 8,500 | 2,792.00 | 23,732,000 | 貸付有価証券 3,900株 |
| 田中商事 | 4,100 | 617.00 | 2,529,700 | |
| オーハシテクニカ | 7,500 | 1,280.00 | 9,600,000 | 貸付有価証券 2,300株（2,300株） |
| 白銅 | 3,800 | 997.00 | 3,788,600 | |
| 伊藤忠商事 | 1,050,800 | 1,363.00 | 1,432,240,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 丸紅 | 1,317,800 | 560.50 | 738,626,900 | 貸付有価証券 354,600株 |
| 高島 | 25,000 | 156.00 | 3,900,000 | |
| 長瀬産業 | 80,500 | 1,173.00 | 94,426,500 | |
| 蝶理 | 8,500 | 1,386.00 | 11,781,000 | |

| | | | | |
|---------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 豊田通商 | 149,100 | 2,286.00 | 340,842,600 | 貸付有価証券 300株 |
| 三共生興 | 20,200 | 389.00 | 7,857,800 | 貸付有価証券 100株 |
| 兼松 | 285,000 | 153.00 | 43,605,000 | 貸付有価証券 23,000株 |
| ツカモトコーポレーシ ョン | 24,000 | 100.00 | 2,400,000 | 貸付有価証券 6,000株 |
| 三井物産 | 1,210,900 | 1,294.00 | 1,566,904,600 | 貸付有価証券 242,600株 |
| 日本紙パルプ商事 | 70,000 | 306.00 | 21,420,000 | |
| 日立ハイテクノロジーズ | 46,400 | 2,928.00 | 135,859,200 | |
| カメイ | 17,400 | 938.00 | 16,321,200 | |
| 東都水産 | 22,000 | 175.00 | 3,850,000 | |
| OUGホールディングス | 19,000 | 215.00 | 4,085,000 | |
| スターゼン | 4,800 | 3,095.00 | 14,856,000 | |
| 山善 | 51,400 | 895.00 | 46,003,000 | |
| 椿本興業 | 15,000 | 285.00 | 4,275,000 | |
| 住友商事 | 842,900 | 1,094.50 | 922,554,050 | 貸付有価証券 10,700株 |
| 内田洋行 | 33,000 | 394.00 | 13,002,000 | |
| 三菱商事 | 1,004,800 | 1,736.50 | 1,744,835,200 | 貸付有価証券 24,700株 |
| 第一実業 | 30,000 | 455.00 | 13,650,000 | |
| キャノンマーケティング ジャパン | 38,200 | 1,913.00 | 73,076,600 | |
| 西華産業 | 44,000 | 214.00 | 9,416,000 | |
| 佐藤商事 | 11,900 | 619.00 | 7,366,100 | |
| 菱洋エレクトロ | 15,400 | 1,072.00 | 16,508,800 | 貸付有価証券 7,100株 |
| 東京産業 | 13,300 | 392.00 | 5,213,600 | |
| ユアサ商事 | 12,700 | 2,315.00 | 29,400,500 | |
| 神鋼商事 | 30,000 | 195.00 | 5,850,000 | |
| 小林産業 | 8,800 | 194.00 | 1,707,200 | |
| 阪和興業 | 134,000 | 442.00 | 59,228,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| カナデン | 12,800 | 837.00 | 10,713,600 | |
| 菱電商事 | 21,000 | 604.00 | 12,684,000 | |
| フルサト工業 | 7,400 | 1,568.00 | 11,603,200 | |

| | | | | |
|-------------------|---------|----------|------------|----------------------------|
| 岩谷産業 | 159,000 | 598.00 | 95,082,000 | 貸付有価証券 38,000株(21,000株) |
| すてきナイスグループ | 57,000 | 131.00 | 7,467,000 | |
| 昭光通商 | 47,000 | 75.00 | 3,525,000 | 貸付有価証券 22,000株 |
| ニチモウ | 21,000 | 169.00 | 3,549,000 | 貸付有価証券 9,000株 |
| 極東貿易 | 19,000 | 217.00 | 4,123,000 | |
| イワキ | 20,000 | 180.00 | 3,600,000 | |
| 三愛石油 | 34,000 | 942.00 | 32,028,000 | |
| 稲畑産業 | 32,100 | 1,209.00 | 38,808,900 | |
| G S Iクレオス | 35,000 | 115.00 | 4,025,000 | 貸付有価証券 16,000株(14,000株) |
| 明和産業 | 12,300 | 353.00 | 4,341,900 | 貸付有価証券 2,000株 |
| ワキタ | 28,500 | 801.00 | 22,828,500 | |
| 東邦ホールディングス | 42,900 | 2,290.00 | 98,241,000 | 貸付有価証券 19,100株(17,300株) |
| サンゲツ | 48,300 | 1,906.00 | 92,059,800 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 21,500 | 542.00 | 11,653,000 | |
| シナネンホールディングス | 29,000 | 434.00 | 12,586,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 34,500 | 846.00 | 29,187,000 | |
| サンリオ | 41,300 | 2,049.00 | 84,623,700 | 貸付有価証券 19,000株 |
| サンワテクノス | 8,500 | 679.00 | 5,771,500 | |
| リョーサン | 21,200 | 2,806.00 | 59,487,200 | |
| 新光商事 | 15,700 | 1,016.00 | 15,951,200 | |
| トーヨー | 6,000 | 2,199.00 | 13,194,000 | |
| 三信電気 | 18,500 | 810.00 | 14,985,000 | |
| 東陽テクニカ | 19,600 | 1,049.00 | 20,560,400 | 貸付有価証券 8,700株 |
| モスフードサービス | 17,500 | 3,100.00 | 54,250,000 | 貸付有価証券 100株(100株) |
| 加賀電子 | 12,100 | 1,268.00 | 15,342,800 | |
| ソーダニッカ | 13,800 | 446.00 | 6,154,800 | |
| 立花エレテック | 9,900 | 1,074.00 | 10,632,600 | |
| フォーバル | 5,300 | 641.00 | 3,397,300 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| | | | | 400株 |
| PALTA C | 21,400 | 1,781.00 | 38,113,400 | |
| 三谷産業 | 14,200 | 299.00 | 4,245,800 | 貸付有価証券 6,500株（100株） |
| 太平洋興発 | 56,000 | 73.00 | 4,088,000 | 貸付有価証券 18,000株 |
| ヤマタネ | 62,000 | 159.00 | 9,858,000 | |
| 丸紅建材リース | 12,000 | 180.00 | 2,160,000 | |
| 日鉄住金物産 | 88,000 | 325.00 | 28,600,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| トラスコ中山 | 15,300 | 3,930.00 | 60,129,000 | 貸付有価証券 1,800株 |
| オートバックスセブン | 51,300 | 1,845.00 | 94,648,500 | 貸付有価証券 23,600株 |
| 加藤産業 | 20,900 | 2,700.00 | 56,430,000 | |
| イノテック | 12,300 | 431.00 | 5,301,300 | 貸付有価証券 4,100株 |
| イエローハット | 12,600 | 1,861.00 | 23,448,600 | |
| J Kホールディングス | 13,400 | 450.00 | 6,030,000 | |
| 日伝 | 5,500 | 2,673.00 | 14,701,500 | |
| 北沢産業 | 11,000 | 149.00 | 1,639,000 | |
| 杉本商事 | 7,700 | 1,123.00 | 8,647,100 | |
| 因幡電機産業 | 18,700 | 3,420.00 | 63,954,000 | |
| バイテックホールディングス | 4,100 | 944.00 | 3,870,400 | 貸付有価証券 1,800株 |
| ミスミグループ本社 | 150,300 | 1,513.00 | 227,403,900 | 貸付有価証券 62,700株 |
| アルテック | 11,400 | 139.00 | 1,584,600 | 貸付有価証券 4,000株 |
| タキヒヨー | 22,000 | 449.00 | 9,878,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 蔵王産業 | 2,200 | 1,253.00 | 2,756,600 | 貸付有価証券 200株 |
| スズケン | 60,900 | 3,555.00 | 216,499,500 | 貸付有価証券 6,400株（6,400株） |
| ジェコス | 9,200 | 895.00 | 8,234,000 | 貸付有価証券 200株 |
| ルネサスイーストン | 8,300 | 390.00 | 3,237,000 | |
| ローソン | 50,700 | 9,210.00 | 466,947,000 | |
| サンエー | 9,100 | 4,690.00 | 42,679,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|---------------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
| | | | | 400株 |
| ダイユーエイト | 3,500 | 721.00 | 2,523,500 | 貸付有価証券 1,500株 |
| カワチ薬品 | 10,400 | 1,893.00 | 19,687,200 | |
| エービーシー・マート | 17,100 | 6,480.00 | 110,808,000 | 貸付有価証券 3,700株(3,700株) |
| ハードオフコーポレーション | 6,500 | 1,617.00 | 10,510,500 | |
| アスクル | 16,300 | 3,340.00 | 54,442,000 | 貸付有価証券 7,200株 |
| ゲオホールディングス | 25,400 | 1,666.00 | 42,316,400 | 貸付有価証券 11,300株(300株) |
| アダストリア | 12,300 | 5,880.00 | 72,324,000 | |
| ジーフット | 8,100 | 838.00 | 6,787,800 | |
| シー・ヴィ・エス・ベイ エリア | 19,000 | 78.00 | 1,482,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| くらコーポレーション | 7,800 | 5,050.00 | 39,390,000 | |
| キャンドウ | 7,100 | 1,423.00 | 10,103,300 | 貸付有価証券 2,700株(1,800株) |
| パル | 7,800 | 2,431.00 | 18,961,800 | |
| エディオン | 56,600 | 878.00 | 49,694,800 | 貸付有価証券 26,200株(9,800株) |
| サーラコーポレーション | 11,500 | 588.00 | 6,762,000 | |
| ワッツ | 5,300 | 778.00 | 4,123,400 | 貸付有価証券 1,300株 |
| ハローズ | 4,000 | 2,584.00 | 10,336,000 | |
| あみやき亭 | 2,600 | 4,365.00 | 11,349,000 | |
| ひらまつ | 18,400 | 600.00 | 11,040,000 | 貸付有価証券 7,700株 |
| ゲンキー | 2,700 | 2,494.00 | 6,733,800 | 貸付有価証券 1,200株(800株) |
| サッポロドラッグストア | 1,300 | 1,990.00 | 2,587,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 大黒天物産 | 3,200 | 4,580.00 | 14,656,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| ハニーズ | 11,800 | 1,185.00 | 13,983,000 | 貸付有価証券 4,600株(2,400株) |
| ファーマライズホール ディングス | 3,000 | 483.00 | 1,449,000 | |
| アルペン | 11,900 | 1,725.00 | 20,527,500 | 貸付有価証券 5,000株 |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| クオール | 13,600 | 1,429.00 | 19,434,400 | 貸付有価証券 3,200株 |
| ジェイアイエヌ | 9,100 | 4,960.00 | 45,136,000 | 貸付有価証券 4,100株(3,400株) |
| ビックカメラ | 69,200 | 909.00 | 62,902,800 | 貸付有価証券 31,900株(10,500株) |
| DCMホールディングス | 65,800 | 841.00 | 55,337,800 | 貸付有価証券 23,700株 |
| MonotaRO | 47,200 | 2,366.00 | 111,675,200 | 貸付有価証券 21,300株(4,400株) |
| 東京一番フーズ | 2,200 | 494.00 | 1,086,800 | 貸付有価証券 800株(800株) |
| ダイヤモンドダイニング | 2,100 | 1,061.00 | 2,228,100 | 貸付有価証券 900株 |
| きちり | 3,600 | 637.00 | 2,293,200 | 貸付有価証券 1,600株(600株) |
| アークランドサービス | 4,200 | 2,619.00 | 10,999,800 | |
| J.フロントリテイリング | 169,400 | 1,342.00 | 227,334,800 | |
| ドトール・日レスホールディングス | 23,500 | 1,742.00 | 40,937,000 | 貸付有価証券 4,400株 |
| マツモトキヨシホールディングス | 27,600 | 5,220.00 | 144,072,000 | |
| ブロンコビリー | 5,200 | 2,560.00 | 13,312,000 | 貸付有価証券 800株(700株) |
| スタートトゥデイ | 40,700 | 3,385.00 | 137,769,500 | |
| トレジャー・ファクトリー | 3,800 | 1,164.00 | 4,423,200 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 物語コーポレーション | 3,500 | 4,770.00 | 16,695,000 | |
| ココカラファイン | 13,900 | 4,205.00 | 58,449,500 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 266,300 | 1,292.00 | 344,059,600 | |
| ウエルシアホールディングス | 11,600 | 5,570.00 | 64,612,000 | |
| クリエイトSDホールディングス | 19,700 | 2,311.00 | 45,526,700 | |
| 丸善CHIホールディングス | 15,600 | 318.00 | 4,960,800 | 貸付有価証券 3,700株 |
| ミサワ | 1,600 | 461.00 | 737,600 | 貸付有価証券 700株 |
| エー・ピーカンパニー | 2,200 | 1,200.00 | 2,640,000 | 貸付有価証券 1,000株 |

| | | | | |
|--------------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| チムニー | 3,300 | 2,601.00 | 8,583,300 | |
| シュッピン | 3,800 | 979.00 | 3,720,200 | 貸付有価証券 1,700株 |
| ネクステージ | 2,200 | 517.00 | 1,137,400 | 貸付有価証券 900株 |
| ジョイフル本田 | 21,700 | 2,198.00 | 47,696,600 | |
| キリン堂ホールディングス | 4,300 | 914.00 | 3,930,200 | 貸付有価証券 200株 |
| ホットランド | 3,500 | 1,020.00 | 3,570,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| すかいらーく | 40,900 | 1,518.00 | 62,086,200 | |
| 綿半ホールディングス | 3,700 | 1,325.00 | 4,902,500 | 貸付有価証券 1,700株 |
| ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール | 44,400 | 977.00 | 43,378,800 | 貸付有価証券 9,300株 |
| ブックオフコーポレー ション | 7,600 | 881.00 | 6,695,600 | 貸付有価証券 1,100株 |
| ゴルフダイジェスト・オ ンライン | 2,800 | 688.00 | 1,926,400 | 貸付有価証券 1,200株 |
| あさひ | 9,900 | 1,261.00 | 12,483,900 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 日本調剤 | 3,400 | 3,415.00 | 11,611,000 | 貸付有価証券 1,500株（400株） |
| コスモス薬品 | 6,700 | 17,030.00 | 114,101,000 | 貸付有価証券 3,100株（2,300株） |
| トーエル | 6,500 | 699.00 | 4,543,500 | 貸付有価証券 800株（800株） |
| 一六堂 | 3,200 | 347.00 | 1,110,400 | |
| セブン & アイ・ホール ディングス | 560,100 | 4,604.00 | 2,578,700,400 | 貸付有価証券 31,900株 |
| 薬王堂 | 1,900 | 2,535.00 | 4,816,500 | 貸付有価証券 100株 |
| クリエイト・レストラン ツ・ホールディング | 12,000 | 2,810.00 | 33,720,000 | 貸付有価証券 300株 |
| ツルハホールディングス | 30,700 | 9,180.00 | 281,826,000 | |
| サンマルクホールディン グス | 10,600 | 2,775.00 | 29,415,000 | |
| フェリシモ | 3,800 | 948.00 | 3,602,400 | |
| トリドール | 16,400 | 2,239.00 | 36,719,600 | |
| クスリのアオキ | 11,900 | 4,800.00 | 57,120,000 | |
| メディカルシステムネッ | 15,100 | 432.00 | 6,523,200 | |

| | | | | |
|----------------|--------|-----------|-------------|--------------------------|
| トワーク | | | | |
| 総合メディカル | 6,500 | 3,440.00 | 22,360,000 | 貸付有価証券 1,900株 |
| はるやま商事 | 5,600 | 765.00 | 4,284,000 | |
| カップ・クリエイト | 18,700 | 1,135.00 | 21,224,500 | 貸付有価証券 8,600株 |
| ライトオン | 10,000 | 1,445.00 | 14,450,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| ジーンズメイト | 4,300 | 164.00 | 705,200 | 貸付有価証券 1,900株（1,000株） |
| 良品計画 | 15,400 | 22,720.00 | 349,888,000 | |
| 三城ホールディングス | 16,500 | 436.00 | 7,194,000 | |
| アルビス | 3,500 | 1,875.00 | 6,562,500 | |
| コナカ | 15,700 | 537.00 | 8,430,900 | |
| ハウス オブ ローゼ | 1,600 | 1,447.00 | 2,315,200 | 貸付有価証券 100株（100株） |
| G - 7ホールディングス | 3,900 | 1,114.00 | 4,344,600 | |
| イオン北海道 | 8,900 | 515.00 | 4,583,500 | 貸付有価証券 4,100株 |
| コジマ | 19,700 | 225.00 | 4,432,500 | 貸付有価証券 900株 |
| ヒマラヤ | 4,200 | 998.00 | 4,191,600 | 貸付有価証券 300株 |
| コーナン商事 | 19,000 | 1,540.00 | 29,260,000 | 貸付有価証券 8,500株 |
| エコス | 4,900 | 1,144.00 | 5,605,600 | 貸付有価証券 2,200株（100株） |
| ワタミ | 15,800 | 1,015.00 | 16,037,000 | 貸付有価証券 7,100株（5,500株） |
| マルシェ | 3,200 | 838.00 | 2,681,600 | 貸付有価証券 1,500株 |
| ドンキホーテホールディングス | 86,600 | 3,620.00 | 313,492,000 | 貸付有価証券 16,300株 |
| 西松屋チェーン | 26,400 | 920.00 | 24,288,000 | 貸付有価証券 12,100株 |
| ゼンショーホールディングス | 68,900 | 1,373.00 | 94,599,700 | 貸付有価証券 2,900株（2,700株） |
| 幸楽苑ホールディングス | 8,400 | 1,549.00 | 13,011,600 | 貸付有価証券 3,900株（1,800株） |
| ハークスレイ | 3,700 | 1,062.00 | 3,929,400 | |
| サイゼリヤ | 22,000 | 2,235.00 | 49,170,000 | |

| | | | | |
|----------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| V Tホールディングス | 45,300 | 538.00 | 24,371,400 | 貸付有価証券 500株 |
| 魚力 | 4,200 | 1,286.00 | 5,401,200 | |
| ポブラ | 3,300 | 490.00 | 1,617,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| ユナイテッドアローズ | 19,100 | 4,835.00 | 92,348,500 | 貸付有価証券 800株 |
| ハイデイ日高 | 10,100 | 3,450.00 | 34,845,000 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 京都きもの友禅 | 9,100 | 829.00 | 7,543,900 | 貸付有価証券 3,800株 |
| コロワイド | 44,400 | 1,678.00 | 74,503,200 | 貸付有価証券 20,000株（100株） |
| ピーシーデポコーポレーション | 11,100 | 1,048.00 | 11,632,800 | 貸付有価証券 5,100株（100株） |
| 壱番屋 | 6,100 | 5,700.00 | 34,770,000 | 貸付有価証券 2,100株 |
| トップカルチャー | 4,800 | 453.00 | 2,174,400 | |
| P L A N T | 3,000 | 1,128.00 | 3,384,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| スギホールディングス | 24,000 | 5,400.00 | 129,600,000 | |
| スクロール | 20,200 | 392.00 | 7,918,400 | 貸付有価証券 8,800株（600株） |
| ヨンドシーホールディングス | 10,200 | 2,332.00 | 23,786,400 | 貸付有価証券 4,700株（1,800株） |
| ファミリーマート | 41,100 | 5,730.00 | 235,503,000 | 貸付有価証券 3,100株（1,300株） |
| 木曽路 | 16,400 | 2,186.00 | 35,850,400 | 貸付有価証券 6,800株（5,500株） |
| サトレストランシステムズ | 15,700 | 785.00 | 12,324,500 | 貸付有価証券 200株 |
| 千趣会 | 26,400 | 706.00 | 18,638,400 | 貸付有価証券 3,700株（300株） |
| タカキュー | 10,300 | 176.00 | 1,812,800 | 貸付有価証券 1,700株 |
| ケーヨー | 22,500 | 501.00 | 11,272,500 | 貸付有価証券 10,000株 |
| 上新電機 | 32,000 | 857.00 | 27,424,000 | |
| 日本瓦斯 | 15,300 | 2,158.00 | 33,017,400 | 貸付有価証券 6,600株 |
| ベスト電器 | 43,100 | 113.00 | 4,870,300 | 貸付有価証券 15,100株（14,100株） |

| | | | | |
|--------------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| ロイヤルホールディングス | 22,200 | 2,035.00 | 45,177,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 東天紅 | 10,000 | 129.00 | 1,290,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| いなげや | 14,900 | 1,216.00 | 18,118,400 | |
| 島忠 | 34,600 | 2,499.00 | 86,465,400 | |
| チヨダ | 15,800 | 2,811.00 | 44,413,800 | 貸付有価証券 3,200株 |
| ライフコーポレーション | 8,400 | 2,367.00 | 19,882,800 | 貸付有価証券 3,600株（100株） |
| リンガーハット | 12,100 | 2,345.00 | 28,374,500 | 貸付有価証券 5,500株 |
| さが美 | 10,000 | 91.00 | 910,000 | 貸付有価証券 4,000株（2,000株） |
| MrMax | 11,700 | 278.00 | 3,252,600 | 貸付有価証券 5,000株 |
| テンアライド | 12,300 | 373.00 | 4,587,900 | |
| AOKIホールディングス | 30,500 | 1,220.00 | 37,210,000 | |
| オークワ | 21,000 | 977.00 | 20,517,000 | |
| コメリ | 20,600 | 2,209.00 | 45,505,400 | |
| 青山商事 | 25,700 | 4,085.00 | 104,984,500 | 貸付有価証券 100株 |
| しまむら | 15,600 | 12,100.00 | 188,760,000 | 貸付有価証券 200株 |
| はせがわ | 4,700 | 404.00 | 1,898,800 | 貸付有価証券 900株（900株） |
| 高島屋 | 195,000 | 891.00 | 173,745,000 | |
| 松屋 | 26,900 | 861.00 | 23,160,900 | 貸付有価証券 12,400株（300株） |
| エイチ・ツー・オー テイリング | 68,600 | 1,840.00 | 126,224,000 | |
| 近鉄百貨店 | 51,000 | 297.00 | 15,147,000 | 貸付有価証券 23,000株 |
| 丸栄 | 27,000 | 83.00 | 2,241,000 | 貸付有価証券 12,000株 |
| ニッセンホールディングス | 19,700 | 139.00 | 2,738,300 | 貸付有価証券 9,000株（3,300株） |
| パルコ | 12,800 | 883.00 | 11,302,400 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 丸井グループ | 164,300 | 1,482.00 | 243,492,600 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| | | | | 26,100株 |
| アクシアル リテイリング | 10,300 | 3,375.00 | 34,762,500 | |
| 井筒屋 | 73,000 | 49.00 | 3,577,000 | 貸付有価証券 33,000株 |
| イオン | 551,000 | 1,401.00 | 771,951,000 | 貸付有価証券 38,600株(38,600株) |
| ユニグループ・ホールディングス | 128,200 | 771.00 | 98,842,200 | |
| イズミ | 26,600 | 4,265.00 | 113,449,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 東武ストア | 16,000 | 299.00 | 4,784,000 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 平和堂 | 27,100 | 2,080.00 | 56,368,000 | 貸付有価証券 12,100株 |
| フジ | 14,900 | 2,035.00 | 30,321,500 | |
| ヤオコー | 15,200 | 4,340.00 | 65,968,000 | 貸付有価証券 400株 |
| ゼビオホールディングス | 18,200 | 1,725.00 | 31,395,000 | |
| ケーズホールディングス | 28,300 | 3,565.00 | 100,889,500 | 貸付有価証券 13,000株 |
| Olympicグループ | 7,900 | 565.00 | 4,463,500 | |
| 日産東京販売ホールディングス | 22,500 | 279.00 | 6,277,500 | |
| アインホールディングス | 16,100 | 4,820.00 | 77,602,000 | |
| 元気寿司 | 3,700 | 2,172.00 | 8,036,400 | |
| ヤマダ電機 | 407,100 | 513.00 | 208,842,300 | 貸付有価証券 166,200株(48,300株) |
| アークランドサカモト | 22,600 | 988.00 | 22,328,800 | |
| ニトリホールディングス | 57,900 | 8,190.00 | 474,201,000 | 貸付有価証券 10,200株(7,200株) |
| グルメ杵屋 | 10,000 | 991.00 | 9,910,000 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 愛眼 | 10,700 | 203.00 | 2,172,100 | 貸付有価証券 4,500株(3,500株) |
| ケーユーホールディングス | 7,000 | 696.00 | 4,872,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 吉野家ホールディングス | 49,400 | 1,402.00 | 69,258,800 | 貸付有価証券 22,700株 |
| 松屋フーズ | 6,400 | 2,797.00 | 17,900,800 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-----------------|------------|-----------|---------------|-----------------------------|
| | | | | 2,900株 |
| サガミチェーン | 17,900 | 1,206.00 | 21,587,400 | 貸付有価証券 7,400株(6,000株) |
| 関西スーパーマーケット | 10,900 | 781.00 | 8,512,900 | |
| 王将フードサービス | 9,800 | 3,855.00 | 37,779,000 | 貸付有価証券 100株 |
| プレナス | 15,000 | 1,893.00 | 28,395,000 | 貸付有価証券 6,900株 |
| ミニストップ | 9,900 | 1,967.00 | 19,473,300 | 貸付有価証券 4,400株(100株) |
| アークス | 25,100 | 2,090.00 | 52,459,000 | |
| パローホールディングス | 28,800 | 2,392.00 | 68,889,600 | |
| 藤久 | 1,100 | 1,669.00 | 1,835,900 | 貸付有価証券 400株 |
| ベルク | 6,600 | 3,780.00 | 24,948,000 | |
| 大庄 | 6,300 | 1,452.00 | 9,147,600 | 貸付有価証券 2,800株 |
| ファーストリテイリング | 26,800 | 31,240.00 | 837,232,000 | 貸付有価証券 2,900株(300株) |
| サンドラッグ | 28,300 | 7,580.00 | 214,514,000 | |
| サックスパーホールディングス | 12,600 | 1,472.00 | 18,547,200 | 貸付有価証券 2,100株 |
| ヤマザワ | 2,800 | 1,645.00 | 4,606,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| やまや | 2,700 | 1,862.00 | 5,027,400 | |
| ベルーナ | 33,400 | 507.00 | 16,933,800 | |
| 島根銀行 | 2,800 | 1,189.00 | 3,329,200 | |
| じもとホールディングス | 96,100 | 147.00 | 14,126,700 | |
| 足利ホールディングス | 98,300 | 325.00 | 31,947,500 | |
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ | 18,500 | 2,681.00 | 49,598,500 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 205,000 | 637.00 | 130,585,000 | |
| ゆうちょ銀行 | 257,400 | 1,277.00 | 328,699,800 | 貸付有価証券 94,300株 |
| 新生銀行 | 1,159,000 | 141.00 | 163,419,000 | 貸付有価証券 495,000株 |
| あおぞら銀行 | 847,000 | 360.00 | 304,920,000 | 貸付有価証券 115,000株(69,000株) |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル | 10,743,800 | 489.00 | 5,253,718,200 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|------------------------------|
| ル・グループ | | | | 222,800株(222,800株) |
| りそなホールディングス | 1,566,500 | 405.00 | 634,432,500 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 2,795,000 | 328.30 | 917,598,500 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 1,072,200 | 3,139.00 | 3,365,635,800 | |
| 第四銀行 | 169,000 | 369.00 | 62,361,000 | |
| 北越銀行 | 145,000 | 187.00 | 27,115,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 西日本シティ銀行 | 436,000 | 198.00 | 86,328,000 | |
| 千葉銀行 | 516,000 | 536.00 | 276,576,000 | 貸付有価証券 18,000株(18,000株) |
| 横浜銀行 | 898,000 | 491.20 | 441,097,600 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 常陽銀行 | 484,000 | 396.00 | 191,664,000 | 貸付有価証券 193,000株(193,000株) |
| 群馬銀行 | 298,000 | 498.00 | 148,404,000 | 貸付有価証券 6,000株(6,000株) |
| 武蔵野銀行 | 21,400 | 2,937.00 | 62,851,800 | |
| 千葉興業銀行 | 36,700 | 462.00 | 16,955,400 | |
| 筑波銀行 | 55,600 | 287.00 | 15,957,200 | 貸付有価証券 200株(200株) |
| 七十七銀行 | 210,000 | 411.00 | 86,310,000 | |
| 青森銀行 | 98,000 | 293.00 | 28,714,000 | 貸付有価証券 43,000株(39,000株) |
| 秋田銀行 | 87,000 | 277.00 | 24,099,000 | |
| 山形銀行 | 75,000 | 389.00 | 29,175,000 | 貸付有価証券 34,000株(8,000株) |
| 岩手銀行 | 9,400 | 3,750.00 | 35,250,000 | 貸付有価証券 2,200株(2,200株) |
| 東邦銀行 | 120,000 | 331.00 | 39,720,000 | |
| 東北銀行 | 68,000 | 139.00 | 9,452,000 | |
| みちのく銀行 | 67,000 | 169.00 | 11,323,000 | 貸付有価証券 31,000株(18,000株) |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 579,000 | 368.00 | 213,072,000 | 貸付有価証券 23,000株(23,000株) |
| 静岡銀行 | 392,000 | 839.00 | 328,888,000 | 貸付有価証券 17,000株(4,000株) |
| 十六銀行 | 168,000 | 366.00 | 61,488,000 | |

| | | | | |
|---------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| スルガ銀行 | 127,100 | 1,883.00 | 239,329,300 | |
| 八十二銀行 | 242,000 | 513.00 | 124,146,000 | |
| 山梨中央銀行 | 83,000 | 405.00 | 33,615,000 | |
| 大垣共立銀行 | 179,000 | 349.00 | 62,471,000 | 貸付有価証券 13,000株 |
| 福井銀行 | 114,000 | 181.00 | 20,634,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 北國銀行 | 149,000 | 279.00 | 41,571,000 | |
| 清水銀行 | 4,500 | 2,098.00 | 9,441,000 | |
| 富山銀行 | 2,600 | 2,853.00 | 7,417,800 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 滋賀銀行 | 126,000 | 464.00 | 58,464,000 | 貸付有価証券 58,000株（5,000株） |
| 南都銀行 | 129,000 | 313.00 | 40,377,000 | 貸付有価証券 7,000株 |
| 百五銀行 | 120,000 | 410.00 | 49,200,000 | |
| 京都銀行 | 256,000 | 748.00 | 191,488,000 | |
| 紀陽銀行 | 52,600 | 1,216.00 | 63,961,600 | 貸付有価証券 200株 |
| 三重銀行 | 60,000 | 192.00 | 11,520,000 | |
| ほくほくフィナンシャル グループ | 911,000 | 168.00 | 153,048,000 | |
| 広島銀行 | 395,000 | 420.00 | 165,900,000 | |
| 山陰合同銀行 | 81,100 | 655.00 | 53,120,500 | |
| 中国銀行 | 94,900 | 1,202.00 | 114,069,800 | |
| 鳥取銀行 | 43,000 | 162.00 | 6,966,000 | |
| 伊予銀行 | 143,200 | 796.00 | 113,987,200 | |
| 百十四銀行 | 147,000 | 329.00 | 48,363,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| 四国銀行 | 104,000 | 212.00 | 22,048,000 | 貸付有価証券 15,000株 |
| 阿波銀行 | 110,000 | 518.00 | 56,980,000 | |
| 大分銀行 | 77,000 | 343.00 | 26,411,000 | 貸付有価証券 35,000株 |
| 宮崎銀行 | 89,000 | 275.00 | 24,475,000 | |
| 佐賀銀行 | 81,000 | 199.00 | 16,119,000 | |
| 十八銀行 | 82,000 | 224.00 | 18,368,000 | 貸付有価証券 17,000株 |
| 沖縄銀行 | 10,600 | 3,495.00 | 37,047,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------|------------|----------|---------------|------------------------------|
| | | | | 3,600株 |
| 琉球銀行 | 27,600 | 1,182.00 | 32,623,200 | 貸付有価証券 1,400株 |
| セブン銀行 | 501,700 | 468.00 | 234,795,600 | 貸付有価証券 215,500株 |
| みずほフィナンシャルグループ | 18,863,800 | 168.70 | 3,182,323,060 | 貸付有価証券 598,400株(136,000株) |
| 高知銀行 | 52,000 | 108.00 | 5,616,000 | 貸付有価証券 3,000株 |
| 山口フィナンシャルグループ | 125,000 | 1,063.00 | 132,875,000 | 貸付有価証券 57,000株(24,000株) |
| 長野銀行 | 44,000 | 174.00 | 7,656,000 | 貸付有価証券 20,000株(2,000株) |
| 名古屋銀行 | 112,000 | 365.00 | 40,880,000 | 貸付有価証券 51,000株(4,000株) |
| 北洋銀行 | 201,700 | 288.00 | 58,089,600 | |
| 愛知銀行 | 4,500 | 4,390.00 | 19,755,000 | |
| 第三銀行 | 76,000 | 141.00 | 10,716,000 | 貸付有価証券 26,000株(2,000株) |
| 中京銀行 | 55,000 | 193.00 | 10,615,000 | |
| 東日本銀行 | 64,000 | 263.00 | 16,832,000 | |
| 大光銀行 | 47,000 | 186.00 | 8,742,000 | |
| 愛媛銀行 | 79,000 | 221.00 | 17,459,000 | 貸付有価証券 36,000株(28,000株) |
| トマト銀行 | 52,000 | 145.00 | 7,540,000 | |
| みなと銀行 | 121,000 | 154.00 | 18,634,000 | |
| 京葉銀行 | 110,000 | 425.00 | 46,750,000 | |
| 関西アーバン銀行 | 18,700 | 1,050.00 | 19,635,000 | |
| 栃木銀行 | 72,000 | 428.00 | 30,816,000 | |
| 北日本銀行 | 4,200 | 2,542.00 | 10,676,400 | |
| 東和銀行 | 188,000 | 81.00 | 15,228,000 | |
| 福島銀行 | 165,000 | 71.00 | 11,715,000 | 貸付有価証券 10,000株 |
| 大東銀行 | 80,000 | 176.00 | 14,080,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| トモニホールディングス | 102,700 | 338.00 | 34,712,600 | |
| フィデアホールディングス | 81,900 | 177.00 | 14,496,300 | 貸付有価証券 1,300株(1,300株) |
| 池田泉州ホールディング | 142,100 | 391.00 | 55,561,100 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| ス | | | | 300株 |
| F P G | 39,700 | 901.00 | 35,769,700 | 貸付有価証券 18,300株(12,200株) |
| S B Iホールディングス | 160,800 | 1,010.00 | 162,408,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 日本アジア投資 | 9,100 | 259.00 | 2,356,900 | 貸付有価証券 2,100株 |
| ジャフコ | 22,400 | 3,160.00 | 70,784,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 大和証券グループ本社 | 1,253,000 | 662.30 | 829,861,900 | |
| 野村ホールディングス | 2,576,500 | 500.00 | 1,288,250,000 | |
| 岡三証券グループ | 114,000 | 543.00 | 61,902,000 | |
| 丸三証券 | 39,700 | 1,174.00 | 46,607,800 | 貸付有価証券 7,200株 |
| 東洋証券 | 52,000 | 286.00 | 14,872,000 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 153,700 | 518.00 | 79,616,600 | 貸付有価証券 53,000株 |
| 光世証券 | 32,000 | 136.00 | 4,352,000 | 貸付有価証券 14,000株(9,000株) |
| 水戸証券 | 41,500 | 320.00 | 13,280,000 | 貸付有価証券 2,500株 |
| いちよし証券 | 29,900 | 1,088.00 | 32,531,200 | 貸付有価証券 11,900株 |
| 松井証券 | 68,100 | 944.00 | 64,286,400 | 貸付有価証券 8,400株 |
| だいこう証券ビジネス | 6,500 | 748.00 | 4,862,000 | |
| マネックスグループ | 157,500 | 268.00 | 42,210,000 | 貸付有価証券 69,600株(39,600株) |
| カブドットコム証券 | 118,700 | 327.00 | 38,814,900 | 貸付有価証券 54,800株 |
| 極東証券 | 18,000 | 1,289.00 | 23,202,000 | 貸付有価証券 8,200株 |
| 岩井コスモホールディングス | 12,600 | 1,035.00 | 13,041,000 | 貸付有価証券 200株(200株) |
| 藍澤證券 | 18,800 | 557.00 | 10,471,600 | 貸付有価証券 3,800株 |
| マネースクウェアHD | 4,600 | 941.00 | 4,328,600 | |
| マネーパートナーズグループ | 12,400 | 300.00 | 3,720,000 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 小林洋行 | 3,800 | 234.00 | 889,200 | 貸付有価証券 400株 |

| | | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|---------------------------------|
| かんぽ生命保険 | 40,900 | 2,392.00 | 97,832,800 | 貸付有価証券 18,800株 |
| 損保ジャパン日本興亜 ホールディングス | 297,500 | 2,946.00 | 876,435,000 | |
| アニコム ホールディン グス | 9,100 | 2,436.00 | 22,167,600 | 貸付有価証券 4,100株 |
| M S & A Dインシュアラ ンスグループホール | 400,200 | 2,870.50 | 1,148,774,100 | |
| ソニーフィナンシャル ホールディングス | 128,300 | 1,485.00 | 190,525,500 | |
| 第一生命保険 | 858,000 | 1,323.50 | 1,135,563,000 | |
| 東京海上ホールディン グス | 542,500 | 3,677.00 | 1,994,772,500 | |
| T & Dホールディングス | 488,000 | 1,130.00 | 551,440,000 | |
| 全国保証 | 34,800 | 3,295.00 | 114,666,000 | |
| クレディセゾン | 101,600 | 1,901.00 | 193,141,600 | 貸付有価証券 2,200株 |
| アクリーティブ | 11,000 | 347.00 | 3,817,000 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 芙蓉総合リース | 15,300 | 4,735.00 | 72,445,500 | |
| 興銀リース | 25,200 | 1,855.00 | 46,746,000 | |
| 東京センチュリーリース | 31,400 | 3,785.00 | 118,849,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 日本証券金融 | 59,000 | 468.00 | 27,612,000 | |
| アイフル | 224,200 | 284.00 | 63,672,800 | 貸付有価証券 103,400株（2,500株） |
| ポケットカード | 13,400 | 446.00 | 5,976,400 | 貸付有価証券 5,400株 |
| リコーリース | 10,500 | 3,160.00 | 33,180,000 | 貸付有価証券 3,700株 |
| イオンフィナンシャル サービス | 87,800 | 2,427.00 | 213,090,600 | 貸付有価証券 39,100株 |
| アコム | 269,000 | 446.00 | 119,974,000 | 貸付有価証券 118,900株（10,400 株） |
| ジャックス | 74,000 | 374.00 | 27,676,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| オリエントコーポレー ション | 579,000 | 184.00 | 106,536,000 | 貸付有価証券 54,300株（27,500株） |
| 日立キャピタル | 31,600 | 2,366.00 | 74,765,600 | |
| アプラスフィナンシャル | 64,200 | 85.00 | 5,457,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| | | | | 29,600株 |
| オリックス | 948,200 | 1,388.50 | 1,316,575,700 | |
| 三菱UFJリース | 339,600 | 481.00 | 163,347,600 | |
| 日本取引所グループ | 393,200 | 1,650.00 | 648,780,000 | |
| イー・ギャランティ | 4,400 | 2,187.00 | 9,622,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| アサックス | 2,300 | 1,321.00 | 3,038,300 | |
| NECキャピタルソ リューション | 5,400 | 1,533.00 | 8,278,200 | |
| いちごグループホール ディングス | 111,100 | 336.00 | 37,329,600 | 貸付有価証券 51,200株(600株) |
| 日本駐車場開発 | 146,400 | 111.00 | 16,250,400 | 貸付有価証券 67,500株 |
| ヒューリック | 279,100 | 951.00 | 265,424,100 | 貸付有価証券 67,400株(10,000株) |
| 三栄建築設計 | 5,400 | 1,139.00 | 6,150,600 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 野村不動産ホールディ ングス | 88,800 | 1,897.00 | 168,453,600 | |
| 三重交通グループホール ディングス | 23,700 | 440.00 | 10,428,000 | |
| サムティ | 7,100 | 975.00 | 6,922,500 | 貸付有価証券 3,200株(3,000株) |
| ディア・ライフ | 6,700 | 308.00 | 2,063,600 | 貸付有価証券 100株(100株) |
| エー・ディー・ワークス | 92,000 | 41.00 | 3,772,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 日本商業開発 | 4,400 | 1,707.00 | 7,510,800 | 貸付有価証券 2,000株 |
| プレサンスコーポレー ション | 4,500 | 3,395.00 | 15,277,500 | 貸付有価証券 100株 |
| ユニゾホールディングス | 8,400 | 3,695.00 | 31,038,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 日本管理センター | 8,700 | 1,591.00 | 13,841,700 | 貸付有価証券 600株 |
| サンセイランディック | 3,100 | 854.00 | 2,647,400 | 貸付有価証券 1,400株 |
| エストラスト | 2,300 | 595.00 | 1,368,500 | 貸付有価証券 1,000株(1,000株) |
| フージャースホールディ ングス | 18,600 | 426.00 | 7,923,600 | 貸付有価証券 7,700株 |
| オープンハウス | 19,300 | 1,923.00 | 37,113,900 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| | | | | 8,700株 |
| 東急不動産ホールディングス | 323,900 | 676.00 | 218,956,400 | |
| 飯田グループホールディングス | 124,000 | 1,965.00 | 243,660,000 | 貸付有価証券 10,800株 |
| パーク24 | 67,500 | 2,930.00 | 197,775,000 | 貸付有価証券 18,400株 |
| パラカ | 4,600 | 1,320.00 | 6,072,000 | |
| 三井不動産 | 710,000 | 2,568.50 | 1,823,635,000 | |
| 三菱地所 | 996,000 | 2,132.00 | 2,123,472,000 | 貸付有価証券 152,000株 |
| 平和不動産 | 25,300 | 1,138.00 | 28,791,400 | 貸付有価証券 4,900株(4,900株) |
| 東京建物 | 146,200 | 1,183.00 | 172,954,600 | |
| ダイビル | 34,500 | 898.00 | 30,981,000 | |
| 京阪神ビルディング | 22,200 | 580.00 | 12,876,000 | |
| 住友不動産 | 321,000 | 2,934.00 | 941,814,000 | |
| 大京 | 249,000 | 173.00 | 43,077,000 | 貸付有価証券 20,000株 |
| テーオーシー | 51,900 | 854.00 | 44,322,600 | |
| 東京楽天地 | 22,000 | 469.00 | 10,318,000 | |
| レオパレス21 | 157,700 | 616.00 | 97,143,200 | 貸付有価証券 2,500株 |
| スターツコーポレーション | 15,400 | 2,206.00 | 33,972,400 | 貸付有価証券 1,200株 |
| フジ住宅 | 17,100 | 665.00 | 11,371,500 | 貸付有価証券 7,500株 |
| 空港施設 | 16,200 | 507.00 | 8,213,400 | |
| 明和地所 | 7,300 | 595.00 | 4,343,500 | |
| 住友不動産販売 | 9,600 | 2,038.00 | 19,564,800 | |
| ゴールドクレスト | 10,600 | 1,641.00 | 17,394,600 | 貸付有価証券 300株 |
| 日本エスリード | 5,200 | 1,027.00 | 5,340,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 日神不動産 | 17,800 | 362.00 | 6,443,600 | |
| タカラレーベン | 59,300 | 557.00 | 33,030,100 | 貸付有価証券 11,100株(1,700株) |
| サンヨーハウジング名古屋 | 7,500 | 994.00 | 7,455,000 | |
| イオンモール | 86,400 | 1,564.00 | 135,129,600 | |

| | | | | |
|----------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| ファースト住建 | 5,000 | 1,265.00 | 6,325,000 | |
| トーセイ | 20,300 | 611.00 | 12,403,300 | 貸付有価証券 9,400株(500株) |
| 穴吹興産 | 15,000 | 245.00 | 3,675,000 | |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 83,200 | 1,052.00 | 87,526,400 | 貸付有価証券 15,500株 |
| サンフロンティア不動産 | 16,200 | 950.00 | 15,390,000 | 貸付有価証券 7,400株(5,800株) |
| エフ・ジェー・ネクスト | 11,700 | 485.00 | 5,674,500 | |
| ランドビジネス | 9,000 | 262.00 | 2,358,000 | |
| グランディハウス | 11,700 | 366.00 | 4,282,200 | |
| 日本空港ビルデング | 42,700 | 3,895.00 | 166,316,500 | 貸付有価証券 19,700株(300株) |
| 日本工営 | 47,000 | 361.00 | 16,967,000 | 貸付有価証券 12,000株 |
| ネクスト | 40,000 | 1,021.00 | 40,840,000 | 貸付有価証券 18,400株 |
| ジェイエシーリクルートメント | 6,500 | 1,006.00 | 6,539,000 | 貸付有価証券 2,900株(2,900株) |
| 日本M&Aセンター | 21,900 | 4,845.00 | 106,105,500 | 貸付有価証券 4,500株 |
| ノバレーゼ | 3,600 | 812.00 | 2,923,200 | 貸付有価証券 1,300株(1,000株) |
| アコーディア・ゴルフ | 39,300 | 1,068.00 | 41,972,400 | 貸付有価証券 500株 |
| 中広 | 1,300 | 607.00 | 789,100 | |
| タケエイ | 12,200 | 709.00 | 8,649,800 | 貸付有価証券 5,600株 |
| トラスト・テック | 2,800 | 2,356.00 | 6,596,800 | |
| パソナグループ | 12,300 | 590.00 | 7,257,000 | 貸付有価証券 5,600株(4,500株) |
| CDS | 3,200 | 834.00 | 2,668,800 | 貸付有価証券 1,100株 |
| リンクアンドモチベーション | 28,600 | 103.00 | 2,945,800 | 貸付有価証券 13,200株 |
| GCAサヴィアン | 12,600 | 874.00 | 11,012,400 | 貸付有価証券 2,000株 |
| エス・エム・エス | 17,600 | 1,751.00 | 30,817,600 | 貸付有価証券 8,100株 |
| テンプホールディングス | 99,300 | 1,507.00 | 149,645,100 | |
| リニカル | 8,300 | 1,528.00 | 12,682,400 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| | | | | 3,800株 |
| クックパッド | 31,500 | 1,869.00 | 58,873,500 | 貸付有価証券 14,500株 |
| エスクリ | 6,000 | 573.00 | 3,438,000 | 貸付有価証券 2,700株（1,900株） |
| アイ・ケイ・ケイ | 7,600 | 608.00 | 4,620,800 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 学情 | 5,200 | 958.00 | 4,981,600 | 貸付有価証券 2,400株（500株） |
| スタジオアリス | 6,500 | 2,148.00 | 13,962,000 | |
| シミックホールディングス | 6,400 | 1,443.00 | 9,235,200 | 貸付有価証券 2,900株（1,900株） |
| N J S | 2,900 | 1,161.00 | 3,366,900 | |
| 総合警備保障 | 47,300 | 5,600.00 | 264,880,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| カカココム | 102,800 | 2,029.00 | 208,581,200 | 貸付有価証券 46,600株（33,700株） |
| ルネサンス | 7,200 | 1,171.00 | 8,431,200 | 貸付有価証券 3,100株 |
| ディップ | 15,700 | 2,022.00 | 31,745,400 | 貸付有価証券 7,200株 |
| オプトホールディング | 8,800 | 526.00 | 4,628,800 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 新日本科学 | 13,400 | 342.00 | 4,582,800 | 貸付有価証券 6,200株 |
| ツクイ | 16,800 | 1,333.00 | 22,394,400 | 貸付有価証券 7,200株（1,500株） |
| キャリアデザインセンター | 3,900 | 818.00 | 3,190,200 | 貸付有価証券 1,700株（1,000株） |
| エムスリー | 122,700 | 2,552.00 | 313,130,400 | 貸付有価証券 50,200株 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 10,300 | 639.00 | 6,581,700 | 貸付有価証券 2,800株 |
| アウトソーシング | 6,600 | 2,743.00 | 18,103,800 | 貸付有価証券 3,000株（1,600株） |
| ウェルネット | 5,300 | 2,840.00 | 15,052,000 | 貸付有価証券 2,400株 |
| ディー・エヌ・エー | 63,500 | 1,637.00 | 103,949,500 | |
| 博報堂D Yホールディングス | 196,400 | 1,232.00 | 241,964,800 | |
| ぐるなび | 16,400 | 2,302.00 | 37,752,800 | 貸付有価証券 5,800株（5,800株） |

| | | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| エスアールジータカミヤ | 11,400 | 316.00 | 3,602,400 | 貸付有価証券 5,200株 |
| ジャパンベストレス キューシステム | 16,100 | 235.00 | 3,783,500 | 貸付有価証券 6,900株(1,100株) |
| ファンコミュニケーションズ | 32,700 | 614.00 | 20,077,800 | 貸付有価証券 15,000株(6,300株) |
| ジェイコムホールディングス | 2,900 | 2,028.00 | 5,881,200 | 貸付有価証券 1,300株 |
| WDBホールディングス | 5,100 | 829.00 | 4,227,900 | 貸付有価証券 2,300株(1,800株) |
| ティア | 5,900 | 585.00 | 3,451,500 | 貸付有価証券 2,700株(500株) |
| バリューコマース | 13,100 | 328.00 | 4,296,800 | 貸付有価証券 1,300株 |
| インフォマート | 20,500 | 968.00 | 19,844,000 | 貸付有価証券 9,400株 |
| J Pホールディングス | 35,200 | 251.00 | 8,835,200 | 貸付有価証券 16,200株(1,200株) |
| E P Sホールディングス | 15,800 | 1,313.00 | 20,745,400 | |
| レグス | 2,100 | 598.00 | 1,255,800 | 貸付有価証券 700株 |
| プレステージ・インター ナショナル | 11,900 | 1,110.00 | 13,209,000 | |
| アミューズ | 3,900 | 4,065.00 | 15,853,500 | 貸付有価証券 1,600株(1,600株) |
| ドリームインキュベータ | 4,700 | 2,018.00 | 9,484,600 | 貸付有価証券 2,100株 |
| クイック | 7,200 | 676.00 | 4,867,200 | |
| T A C | 7,800 | 179.00 | 1,396,200 | 貸付有価証券 3,300株 |
| ケネディクス | 190,200 | 418.00 | 79,503,600 | 貸付有価証券 40,400株(40,400株) |
| 電通 | 157,900 | 5,420.00 | 855,818,000 | 貸付有価証券 2,800株 |
| テイクアンドグヴ・ニー ズ | 6,600 | 429.00 | 2,831,400 | |
| ぴあ | 4,200 | 2,155.00 | 9,051,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| イオンファンタジー | 5,000 | 2,017.00 | 10,085,000 | 貸付有価証券 2,300株(200株) |
| シーティーエス | 3,200 | 688.00 | 2,201,600 | |
| ネクシィーズ | 5,100 | 655.00 | 3,340,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| | | | | 2,300株(1,900株) |
| みらかホールディングス | 36,200 | 4,525.00 | 163,805,000 | |
| アルプス技研 | 5,200 | 2,046.00 | 10,639,200 | 貸付有価証券 2,200株 |
| ダイオーズ | 2,500 | 1,003.00 | 2,507,500 | |
| 日本空調サービス | 6,900 | 1,070.00 | 7,383,000 | |
| オリエンタルランド | 153,200 | 7,935.00 | 1,215,642,000 | 貸付有価証券 62,300株 |
| ダスキン | 40,100 | 2,107.00 | 84,490,700 | |
| 明光ネットワークジャパン | 16,400 | 1,100.00 | 18,040,000 | 貸付有価証券 5,100株(4,300株) |
| ファルコホールディングス | 6,200 | 1,269.00 | 7,867,800 | |
| 秀英予備校 | 2,500 | 526.00 | 1,315,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 田谷 | 2,400 | 676.00 | 1,622,400 | 貸付有価証券 1,000株 |
| ラウンドワン | 44,200 | 640.00 | 28,288,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| リゾートトラスト | 59,400 | 2,560.00 | 152,064,000 | 貸付有価証券 24,800株 |
| ビー・エム・エル | 8,300 | 3,830.00 | 31,789,000 | |
| ワタベウェディング | 4,200 | 414.00 | 1,738,800 | |
| りらいあコミュニケーションズ | 23,400 | 927.00 | 21,691,800 | |
| リソー教育 | 26,300 | 295.00 | 7,758,500 | 貸付有価証券 12,100株(1,600株) |
| 早稲田アカデミー | 1,800 | 894.00 | 1,609,200 | |
| ユー・エス・エス | 171,500 | 1,513.00 | 259,479,500 | |
| 東京個別指導学院 | 6,900 | 672.00 | 4,636,800 | 貸付有価証券 3,100株 |
| サイバーエージェント | 34,600 | 5,090.00 | 176,114,000 | 貸付有価証券 14,400株(14,400株) |
| 楽天 | 662,800 | 1,009.00 | 668,765,200 | |
| テー・オー・ダブリュー | 8,500 | 570.00 | 4,845,000 | 貸付有価証券 3,600株 |
| セントラルスポーツ | 4,800 | 2,226.00 | 10,684,800 | 貸付有価証券 2,200株 |
| フルキャストホールディングス | 13,000 | 634.00 | 8,242,000 | 貸付有価証券 5,900株 |
| リゾートソリューション | 14,000 | 296.00 | 4,144,000 | |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|----------------------------|
| テクノプロ・ホールディングス | 23,000 | 2,863.00 | 65,849,000 | 貸付有価証券 100株(100株) |
| インターワークス | 1,800 | 605.00 | 1,089,000 | |
| リブセンス | 9,500 | 386.00 | 3,667,000 | 貸付有価証券 4,400株(2,400株) |
| ジャパンマテリアル | 5,900 | 2,124.00 | 12,531,600 | 貸付有価証券 2,700株 |
| ベクトル | 4,400 | 2,155.00 | 9,482,000 | 貸付有価証券 1,600株(1,500株) |
| ウチヤマホールディングス | 7,300 | 469.00 | 3,423,700 | 貸付有価証券 3,300株 |
| サクセスホールディングス | 1,300 | 1,058.00 | 1,375,400 | |
| キャリアリンク | 1,900 | 1,493.00 | 2,836,700 | 貸付有価証券 800株 |
| I B J | 8,300 | 365.00 | 3,029,500 | 貸付有価証券 3,800株 |
| アサンテ | 5,200 | 1,541.00 | 8,013,200 | |
| N・フィールド | 5,000 | 807.00 | 4,035,000 | 貸付有価証券 2,300株 |
| M & Aキャピタルパートナーズ | 1,200 | 1,595.00 | 1,914,000 | 貸付有価証券 500株 |
| ライドオン・エクスプレス | 2,200 | 1,741.00 | 3,830,200 | 貸付有価証券 700株(700株) |
| E R Iホールディングス | 3,600 | 782.00 | 2,815,200 | 貸付有価証券 1,500株(500株) |
| アピスト | 1,500 | 1,947.00 | 2,920,500 | |
| ウィルグループ | 3,200 | 833.00 | 2,665,600 | |
| 日本ビューホテル | 1,500 | 1,449.00 | 2,173,500 | 貸付有価証券 700株 |
| リクルートホールディングス | 285,800 | 3,355.00 | 958,859,000 | 貸付有価証券 16,900株(16,900株) |
| エラン | 1,200 | 982.00 | 1,178,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 日本郵政 | 312,500 | 1,393.00 | 435,312,500 | 貸付有価証券 53,100株 |
| ベルシステム24ホールディングス | 20,800 | 983.00 | 20,446,400 | 貸付有価証券 9,500株 |
| リロ・ホールディング | 5,300 | 12,670.00 | 67,151,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 東祥 | 4,200 | 3,730.00 | 15,666,000 | 貸付有価証券 100株 |

| | | | | |
|--------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| エイチ・アイ・エス | 23,100 | 3,355.00 | 77,500,500 | 貸付有価証券 10,600株 |
| ラックランド | 2,000 | 1,393.00 | 2,786,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 共立メンテナンス | 10,600 | 7,860.00 | 83,316,000 | 貸付有価証券 4,900株 |
| イチネンホールディングス | 14,800 | 894.00 | 13,231,200 | 貸付有価証券 300株 |
| 建設技術研究所 | 8,400 | 903.00 | 7,585,200 | |
| スペース | 7,600 | 1,209.00 | 9,188,400 | |
| 燦ホールディングス | 2,800 | 1,411.00 | 3,950,800 | |
| スバル興業 | 10,000 | 374.00 | 3,740,000 | |
| 東京テアトル | 54,000 | 115.00 | 6,210,000 | 貸付有価証券 22,000株 |
| ナガワ | 2,600 | 2,800.00 | 7,280,000 | 貸付有価証券 1,100株（1,100株） |
| よみうりランド | 28,000 | 397.00 | 11,116,000 | 貸付有価証券 11,000株 |
| 東京都競馬 | 97,000 | 203.00 | 19,691,000 | 貸付有価証券 19,000株 |
| 常磐興産 | 52,000 | 147.00 | 7,644,000 | 貸付有価証券 23,000株（1,000株） |
| カナモト | 19,800 | 2,449.00 | 48,490,200 | 貸付有価証券 8,900株（100株） |
| 東京ドーム | 113,000 | 509.00 | 57,517,000 | |
| 西尾レントオール | 11,400 | 2,614.00 | 29,799,600 | |
| トランス・コスモス | 16,400 | 2,420.00 | 39,688,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 乃村工藝社 | 30,300 | 1,343.00 | 40,692,900 | 貸付有価証券 14,000株 |
| 藤田観光 | 51,000 | 500.00 | 25,500,000 | 貸付有価証券 23,000株 |
| 日本管財 | 12,100 | 1,727.00 | 20,896,700 | |
| トーカイ | 6,300 | 2,978.00 | 18,761,400 | |
| 白洋舎 | 15,000 | 250.00 | 3,750,000 | 貸付有価証券 1,000株（1,000株） |
| セコム | 147,400 | 7,997.00 | 1,178,757,800 | |
| セントラル警備保障 | 6,200 | 1,933.00 | 11,984,600 | |
| 丹青社 | 26,500 | 632.00 | 16,748,000 | 貸付有価証券 9,400株（9,400株） |
| メイテック | 17,600 | 3,885.00 | 68,376,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | | |
|--|--------------|--------|----------|-----------------|---------------------------|
| | | | | | 1,900株 |
| | アサツー ディ・ケイ | 24,900 | 2,770.00 | 68,973,000 | 貸付有価証券 6,800株 |
| | 応用地質 | 14,900 | 1,278.00 | 19,042,200 | |
| | 船井総研ホールディングス | 19,700 | 1,321.00 | 26,023,700 | |
| | 進学会 | 6,800 | 601.00 | 4,086,800 | |
| | オオバ | 7,700 | 344.00 | 2,648,800 | |
| | 学究社 | 2,000 | 1,288.00 | 2,576,000 | 貸付有価証券 800株（300株） |
| | ベネッセホールディングス | 47,500 | 3,410.00 | 161,975,000 | 貸付有価証券 19,600株 |
| | イオンディライト | 13,700 | 3,510.00 | 48,087,000 | 貸付有価証券 6,300株 |
| | ナック | 8,700 | 826.00 | 7,186,200 | 貸付有価証券 3,600株 |
| | ニチイ学館 | 24,600 | 799.00 | 19,655,400 | 貸付有価証券 11,300株（9,100株） |
| | ダイセキ | 26,600 | 1,665.00 | 44,289,000 | 貸付有価証券 8,100株 |
| | ステップ | 4,700 | 992.00 | 4,662,400 | |
| | 小計 銘柄数：1,924 | | | 257,290,312,740 | |
| | 組入時価比率：98.5% | | | 100.0% | |
| | 合計 | | | 257,290,312,740 | |

(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証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2)株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 平成28年 2月17日現在 | | |
|----------|---------------|-------|-------|
| | 契約額等（円） | | 時価（円） |
| | | うち1年超 | |
| 市場取引 | | | |
| 株価指数先物取引 | | | |

| | | | | |
|----|---------------|---|---------------|-------------|
| 買建 | 4,153,825,000 | - | 3,901,500,000 | 252,473,716 |
| 合計 | 4,153,825,000 | - | 3,901,500,000 | 252,473,716 |

(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。

国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

| | |
|-----------------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 19,279,085 |
| コール・ローン | 28,816,448 |
| 国債証券 | 9,641,615,370 |
| 未収利息 | 30,780,093 |
| 前払費用 | 1,777,024 |
| 流動資産合計 | 9,722,268,020 |
| 資産合計 | 9,722,268,020 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 17,413,000 |
| 流動負債合計 | 17,413,000 |
| 負債合計 | 17,413,000 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 7,337,217,934 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 2,367,637,086 |
| 元本等合計 | 9,704,855,020 |
| 純資産合計 | 9,704,855,020 |
| 負債純資産合計 | 9,722,268,020 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|--------------------|--|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 |

| | |
|-----------------------|---|
| 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
|-----------------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|----------------------------|-----------|
| 平成28年 2月17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 | 1.3227円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (13,227円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| |
|--|
| 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日 |
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| | |
|--|--|
| 平成28年 2月17日現在 | |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ | |
| ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |
| 国債証券 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており | |
| ます。 | |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 平成28年 2月17日現在 | |
|----------------------------------|----------------|
| 期首 | 平成27年 2月18日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 5,345,138,795円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,746,485,906円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 754,406,767円 |
| 期末元本額 | 7,337,217,934円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 531,076,817円 |
| バランスセレクト50 | 601,190,866円 |
| バランスセレクト70 | 225,975,580円 |
| ネクストコア | 146,506,099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） | 1,626,936,020円 |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け） | 28,501,367円 |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け） | 48,900,805円 |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け） | 16,717,231円 |
| 野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け） | 3,842,659,548円 |
| 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け） | 84,528,370円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 176,420,956円 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 6,346,884円 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 1,457,391円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17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350回 | 40,000,000 | 40,104,400 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第355回 | 60,000,000 | 60,218,400 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第357回 | 100,000,000 | 100,405,000 | |
| | | 国庫債券 利付(2年)第360回 | 130,000,000 | 130,607,100 | |

| | | | |
|------|--------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 | 利付（5年）第103回 | 40,000,000 | 40,192,400 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第104回 | 50,000,000 | 50,186,000 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第105回 | 50,000,000 | 50,230,000 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第106回 | 40,000,000 | 40,218,800 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第107回 | 40,000,000 | 40,257,200 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第108回 | 60,000,000 | 60,275,400 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第110回 | 20,000,000 | 20,194,000 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第111回 | 40,000,000 | 40,471,200 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第112回 | 100,000,000 | 101,322,000 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第113回 | 50,000,000 | 50,538,000 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第114回 | 20,000,000 | 20,238,600 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第115回 | 60,000,000 | 60,559,800 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第116回 | 160,000,000 | 161,638,400 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第117回 | 190,000,000 | 192,086,200 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第118回 | 50,000,000 | 50,594,000 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第119回 | 40,000,000 | 40,341,200 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第120回 | 20,000,000 | 20,252,200 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第121回 | 40,000,000 | 40,360,000 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第122回 | 130,000,000 | 131,227,200 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第123回 | 240,000,000 | 242,361,600 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第125回 | 130,000,000 | 131,378,000 |
| 国庫債券 | 利付（5年）第126回 | 70,000,000 | 70,765,800 |
| 国庫債券 | 利付（40年）第1回 | 10,000,000 | 13,515,200 |
| 国庫債券 | 利付（40年）第2回 | 10,000,000 | 12,998,900 |
| 国庫債券 | 利付（40年）第3回 | 20,000,000 | 26,067,000 |
| 国庫債券 | 利付（40年）第4回 | 15,000,000 | 19,623,450 |
| 国庫債券 | 利付（40年）第5回 | 28,000,000 | 35,051,800 |
| 国庫債券 | 利付（40年）第6回 | 20,000,000 | 24,439,200 |
| 国庫債券 | 利付（40年）第7回 | 30,000,000 | 34,784,100 |
| 国庫債券 | 利付（40年）第8回 | 10,000,000 | 10,631,000 |
| 国庫債券 | 利付（10年）第285回 | 68,000,000 | 69,352,520 |
| 国庫債券 | 利付（10年）第286回 | 30,000,000 | 30,776,100 |
| 国庫債券 | 利付（10年）第287回 | 50,000,000 | 51,360,500 |
| 国庫債券 | 利付（10年）第288回 | 65,000,000 | 66,892,800 |

| | | | |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 回 | | | |
| 国庫債券 利付(10年)第289回 | 100,000,000 | 103,023,000 | |
| 国庫債券 利付(10年)第290回 | 50,000,000 | 51,627,000 | |
| 国庫債券 利付(10年)第291回 | 20,000,000 | 20,609,200 | |
| 国庫債券 利付(10年)第292回 | 45,000,000 | 46,746,000 | |
| 国庫債券 利付(10年)第293回 | 30,000,000 | 31,379,700 | |
| 国庫債券 利付(10年)第294回 | 40,000,000 | 41,746,000 | |
| 国庫債券 利付(10年)第295回 | 25,000,000 | 25,974,000 | |
| 国庫債券 利付(10年)第296回 | 65,000,000 | 67,798,900 | |
| 国庫債券 利付(10年)第297回 | 40,000,000 | 41,769,600 | |
| 国庫債券 利付(10年)第298回 | 20,000,000 | 20,828,000 | |
| 国庫債券 利付(10年)第299回 | 45,000,000 | 47,025,900 | |
| 国庫債券 利付(10年)第300回 | 35,000,000 | 36,792,000 | |
| 国庫債券 利付(10年)第301回 | 45,000,000 | 47,493,900 | |
| 国庫債券 利付(10年)第302回 | 40,000,000 | 42,082,800 | |
| 国庫債券 利付(10年)第303回 | 45,000,000 | 47,512,800 | |
| 国庫債券 利付(10年)第304回 | 30,000,000 | 31,567,200 | |
| 国庫債券 利付(10年)第305回 | 70,000,000 | 73,912,300 | |
| 国庫債券 利付(10年)第306回 | 45,000,000 | 47,843,100 | |
| 国庫債券 利付(10年)第307回 | 30,000,000 | 31,772,400 | |
| 国庫債券 利付(10年)第308回 | 30,000,000 | 31,868,700 | |
| 国庫債券 利付(10年)第309回 | 40,000,000 | 42,142,800 | |

| | | |
|-------------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 利付(10年)第310回 | 30,000,000 | 31,555,800 |
| 国庫債券 利付(10年)第311回 | 20,000,000 | 20,852,800 |
| 国庫債券 利付(10年)第312回 | 70,000,000 | 74,509,400 |
| 国庫債券 利付(10年)第313回 | 60,000,000 | 64,370,400 |
| 国庫債券 利付(10年)第314回 | 30,000,000 | 31,878,600 |
| 国庫債券 利付(10年)第315回 | 50,000,000 | 53,555,500 |
| 国庫債券 利付(10年)第316回 | 10,000,000 | 10,657,400 |
| 国庫債券 利付(10年)第317回 | 30,000,000 | 32,066,100 |
| 国庫債券 利付(10年)第318回 | 140,000,000 | 148,855,000 |
| 国庫債券 利付(10年)第319回 | 30,000,000 | 32,159,100 |
| 国庫債券 利付(10年)第320回 | 190,000,000 | 202,559,000 |
| 国庫債券 利付(10年)第321回 | 40,000,000 | 42,756,400 |
| 国庫債券 利付(10年)第322回 | 30,000,000 | 31,883,700 |
| 国庫債券 利付(10年)第323回 | 20,000,000 | 21,308,200 |
| 国庫債券 利付(10年)第324回 | 70,000,000 | 74,132,100 |
| 国庫債券 利付(10年)第325回 | 90,000,000 | 95,526,000 |
| 国庫債券 利付(10年)第326回 | 40,000,000 | 42,259,600 |
| 国庫債券 利付(10年)第327回 | 50,000,000 | 53,169,000 |
| 国庫債券 利付(10年)第328回 | 130,000,000 | 136,633,900 |
| 国庫債券 利付(10年)第329回 | 70,000,000 | 74,680,200 |
| 国庫債券 利付(10年)第330回 | 50,000,000 | 53,418,000 |
| 国庫債券 利付(10年)第331回 | 30,000,000 | 31,592,400 |

| | | | |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 回 | | | |
| 国庫債券 利付(10年)第332回 | 60,000,000 | 63,240,600 | |
| 国庫債券 利付(10年)第333回 | 20,000,000 | 21,088,800 | |
| 国庫債券 利付(10年)第334回 | 40,000,000 | 42,192,800 | |
| 国庫債券 利付(10年)第335回 | 50,000,000 | 52,325,500 | |
| 国庫債券 利付(10年)第336回 | 40,000,000 | 41,858,800 | |
| 国庫債券 利付(10年)第337回 | 10,000,000 | 10,287,700 | |
| 国庫債券 利付(10年)第338回 | 210,000,000 | 217,723,800 | |
| 国庫債券 利付(10年)第339回 | 50,000,000 | 51,793,500 | |
| 国庫債券 利付(10年)第340回 | 25,000,000 | 25,883,750 | |
| 国庫債券 利付(10年)第341回 | 70,000,000 | 71,747,200 | |
| 国庫債券 利付(30年)第3回 | 10,000,000 | 12,749,900 | |
| 国庫債券 利付(30年)第5回 | 10,000,000 | 12,668,500 | |
| 国庫債券 利付(30年)第6回 | 10,000,000 | 12,992,300 | |
| 国庫債券 利付(30年)第7回 | 15,000,000 | 19,303,500 | |
| 国庫債券 利付(30年)第8回 | 20,000,000 | 24,150,400 | |
| 国庫債券 利付(30年)第9回 | 20,000,000 | 22,847,800 | |
| 国庫債券 利付(30年)第10回 | 10,000,000 | 10,926,900 | |
| 国庫債券 利付(30年)第11回 | 10,000,000 | 11,904,400 | |
| 国庫債券 利付(30年)第12回 | 10,000,000 | 12,565,700 | |
| 国庫債券 利付(30年)第13回 | 10,000,000 | 12,384,900 | |
| 国庫債券 利付(30年)第14回 | 30,000,000 | 39,158,700 | |
| 国庫債券 利付(30年)第15回 | 10,000,000 | 13,225,200 | |
| 国庫債券 利付(30年)第16回 | 10,000,000 | 13,231,900 | |
| 国庫債券 利付(30年)第17回 | 10,000,000 | 13,045,700 | |
| 国庫債券 利付(30年)第18回 | 20,000,000 | 25,732,400 | |
| 国庫債券 利付(30年)第19回 | 10,000,000 | 12,866,700 | |
| 国庫債券 利付(30年)第20回 | 10,000,000 | 13,225,300 | |
| 国庫債券 利付(30年)第21回 | 10,000,000 | 12,853,500 | |

| | | | |
|------|-------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 | 利付(30年)第22回 | 10,000,000 | 13,227,100 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第23回 | 10,000,000 | 13,227,200 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第24回 | 10,000,000 | 13,226,500 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第25回 | 20,000,000 | 25,701,200 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第26回 | 20,000,000 | 26,077,600 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第27回 | 20,000,000 | 26,501,600 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第28回 | 30,000,000 | 39,831,600 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第29回 | 20,000,000 | 26,170,800 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第30回 | 30,000,000 | 38,691,600 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第31回 | 30,000,000 | 38,106,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第32回 | 40,000,000 | 51,800,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第33回 | 60,000,000 | 73,880,400 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第34回 | 30,000,000 | 38,293,200 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第35回 | 32,000,000 | 39,442,880 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第36回 | 30,000,000 | 36,970,200 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第37回 | 30,000,000 | 36,318,300 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第38回 | 20,000,000 | 23,738,200 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第39回 | 20,000,000 | 24,201,200 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第40回 | 20,000,000 | 23,715,400 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第41回 | 20,000,000 | 23,225,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第42回 | 20,000,000 | 23,222,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第43回 | 10,000,000 | 11,609,400 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第44回 | 20,000,000 | 23,215,200 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第45回 | 140,000,000 | 155,491,000 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第46回 | 10,000,000 | 11,101,400 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第47回 | 20,000,000 | 22,695,600 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第48回 | 20,000,000 | 21,677,800 |
| 国庫債券 | 利付(30年)第49回 | 40,000,000 | 43,328,000 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第37回 | 30,000,000 | 31,545,000 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第40回 | 70,000,000 | 74,466,700 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第41回 | 30,000,000 | 31,541,100 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第42回 | 10,000,000 | 10,854,100 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第43回 | 10,000,000 | 11,096,800 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第44回 | 10,000,000 | 11,080,800 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第45回 | 10,000,000 | 11,039,800 |
| 国庫債券 | 利付(20年)第46回 | 5,000,000 | 5,506,900 |

| | | | |
|------|-------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 | 利付（20年）第47回 | 15,000,000 | 16,612,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第49回 | 60,000,000 | 66,865,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第52回 | 25,000,000 | 28,121,250 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第53回 | 10,000,000 | 11,307,300 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第54回 | 10,000,000 | 11,366,100 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第55回 | 10,000,000 | 11,302,300 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第56回 | 10,000,000 | 11,352,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第57回 | 10,000,000 | 11,288,700 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第58回 | 10,000,000 | 11,340,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第59回 | 110,000,000 | 123,791,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第60回 | 10,000,000 | 11,047,100 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第61回 | 10,000,000 | 10,795,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第62回 | 10,000,000 | 10,668,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第63回 | 10,000,000 | 11,407,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第64回 | 10,000,000 | 11,519,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第65回 | 10,000,000 | 11,560,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第66回 | 20,000,000 | 22,963,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第67回 | 10,000,000 | 11,595,900 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第68回 | 10,000,000 | 11,839,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第69回 | 30,000,000 | 35,275,200 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第70回 | 10,000,000 | 12,049,700 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第71回 | 10,000,000 | 11,882,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第72回 | 20,000,000 | 23,676,200 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第73回 | 30,000,000 | 35,377,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第74回 | 10,000,000 | 11,881,100 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第75回 | 40,000,000 | 47,648,000 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第76回 | 17,000,000 | 19,941,680 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第77回 | 15,000,000 | 17,731,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第78回 | 10,000,000 | 11,762,000 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第79回 | 10,000,000 | 11,855,200 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第80回 | 10,000,000 | 11,948,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第81回 | 10,000,000 | 11,888,200 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第82回 | 15,000,000 | 17,975,700 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第83回 | 15,000,000 | 18,017,550 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第84回 | 10,000,000 | 11,913,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第85回 | 13,000,000 | 15,656,940 |

| | | |
|-------------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 利付(20年)第86回 | 10,000,000 | 12,244,200 |
| 国庫債券 利付(20年)第87回 | 30,000,000 | 36,432,000 |
| 国庫債券 利付(20年)第88回 | 20,000,000 | 24,562,000 |
| 国庫債券 利付(20年)第89回 | 20,000,000 | 24,357,000 |
| 国庫債券 利付(20年)第90回 | 20,000,000 | 24,424,000 |
| 国庫債券 利付(20年)第91回 | 10,000,000 | 12,316,800 |
| 国庫債券 利付(20年)第92回 | 30,000,000 | 36,410,400 |
| 国庫債券 利付(20年)第93回 | 20,000,000 | 24,111,200 |
| 国庫債券 利付(20年)第94回 | 20,000,000 | 24,343,200 |
| 国庫債券 利付(20年)第95回 | 10,000,000 | 12,423,200 |
| 国庫債券 利付(20年)第96回 | 15,000,000 | 18,299,850 |
| 国庫債券 利付(20年)第97回 | 10,000,000 | 12,341,100 |
| 国庫債券 利付(20年)第99回 | 150,000,000 | 183,793,500 |
| 国庫債券 利付(20年)第100回 | 20,000,000 | 24,805,400 |
| 国庫債券 利付(20年)第101回 | 20,000,000 | 25,279,000 |
| 国庫債券 利付(20年)第102回 | 20,000,000 | 25,356,200 |
| 国庫債券 利付(20年)第103回 | 15,000,000 | 18,836,250 |
| 国庫債券 利付(20年)第104回 | 10,000,000 | 12,308,800 |
| 国庫債券 利付(20年)第105回 | 20,000,000 | 24,664,200 |
| 国庫債券 利付(20年)第106回 | 10,000,000 | 12,454,900 |
| 国庫債券 利付(20年)第107回 | 20,000,000 | 24,708,000 |
| 国庫債券 利付(20年)第108回 | 40,000,000 | 48,386,800 |
| 国庫債券 利付(20年)第109回 | 10,000,000 | 12,112,700 |
| 国庫債券 利付(20年)第110回 | 20,000,000 | 24,748,800 |
| 国庫債券 利付(20年)第111回 | 10,000,000 | 12,531,900 |
| 国庫債券 利付(20年)第112回 | 35,000,000 | 43,409,450 |
| 国庫債券 利付(20年)第113回 | 40,000,000 | 49,688,800 |

| | | | |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 回 | | | |
| 国庫債券 利付(20年)第114回 | 30,000,000 | 37,345,500 | |
| 国庫債券 利付(20年)第115回 | 10,000,000 | 12,582,000 | |
| 国庫債券 利付(20年)第116回 | 70,000,000 | 88,144,700 | |
| 国庫債券 利付(20年)第118回 | 10,000,000 | 12,335,900 | |
| 国庫債券 利付(20年)第119回 | 10,000,000 | 12,052,800 | |
| 国庫債券 利付(20年)第120回 | 25,000,000 | 29,445,500 | |
| 国庫債券 利付(20年)第121回 | 100,000,000 | 122,099,000 | |
| 国庫債券 利付(20年)第122回 | 20,000,000 | 24,124,200 | |
| 国庫債券 利付(20年)第123回 | 10,000,000 | 12,502,900 | |
| 国庫債券 利付(20年)第124回 | 20,000,000 | 24,722,800 | |
| 国庫債券 利付(20年)第125回 | 10,000,000 | 12,667,900 | |
| 国庫債券 利付(20年)第126回 | 30,000,000 | 37,116,600 | |
| 国庫債券 利付(20年)第127回 | 20,000,000 | 24,440,200 | |
| 国庫債券 利付(20年)第128回 | 20,000,000 | 24,457,200 | |
| 国庫債券 利付(20年)第129回 | 20,000,000 | 24,166,800 | |
| 国庫債券 利付(20年)第130回 | 20,000,000 | 24,160,400 | |
| 国庫債券 利付(20年)第131回 | 15,000,000 | 17,899,800 | |
| 国庫債券 利付(20年)第132回 | 10,000,000 | 11,935,600 | |
| 国庫債券 利付(20年)第134回 | 10,000,000 | 12,087,600 | |
| 国庫債券 利付(20年)第135回 | 15,000,000 | 17,905,350 | |
| 国庫債券 利付(20年)第136回 | 15,000,000 | 17,665,950 | |

| | | | | |
|----|-------------------|---------------|---------------|--|
| | 国庫債券 利付(20年)第137回 | 10,000,000 | 11,928,900 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第138回 | 10,000,000 | 11,615,000 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第139回 | 10,000,000 | 11,767,400 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第140回 | 70,000,000 | 83,437,900 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第141回 | 30,000,000 | 35,755,800 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第142回 | 20,000,000 | 24,149,200 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第143回 | 10,000,000 | 11,740,100 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第144回 | 10,000,000 | 11,573,500 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第145回 | 20,000,000 | 23,789,800 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第146回 | 70,000,000 | 83,172,600 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第147回 | 20,000,000 | 23,410,400 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第148回 | 10,000,000 | 11,514,800 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第149回 | 20,000,000 | 22,991,600 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第150回 | 20,000,000 | 22,599,400 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第151回 | 40,000,000 | 43,728,000 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第152回 | 190,000,000 | 207,210,200 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第153回 | 70,000,000 | 77,415,100 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第154回 | 50,000,000 | 54,258,500 | |
| | 国庫債券 利付(20年)第155回 | 20,000,000 | 20,917,400 | |
| 小計 | 銘柄数: 248 | 8,753,000,000 | 9,641,615,370 | |
| | 組入時価比率: 99.3% | | 100.0% | |
| 合計 | | | 9,641,615,370 | |

(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。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

| (単位：円) | |
|-----------------|-----------------|
| (平成28年 2月17日現在) | |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 4,863,255,524 |
| コール・ローン | 273,217,728 |
| 株式 | 282,595,761,993 |
| 投資信託受益証券 | 25,014,652 |
| 投資証券 | 7,621,398,768 |
| 派生商品評価勘定 | 13,984,488 |
| 未収入金 | 221,125,970 |
| 未収配当金 | 415,561,082 |
| 未収利息 | 8 |
| 差入委託証拠金 | 1,114,247,704 |
| 流動資産合計 | 297,143,567,917 |
| 資産合計 | 297,143,567,917 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 103,075,543 |
| 未払金 | 288,435,744 |
| 未払解約金 | 462,012,438 |
| その他未払費用 | 4,336,700 |
| 流動負債合計 | 857,860,425 |
| 負債合計 | 857,860,425 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 158,571,624,202 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 137,714,083,290 |
| 元本等合計 | 296,285,707,492 |
| 純資産合計 | 296,285,707,492 |
| 負債純資産合計 | 297,143,567,917 |

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> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年 2月17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 | 1.8685円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (18,685円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 2月18日

至 平成28年 2月17日

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年 2月17日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在

期首

平成27年 2月18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

149,633,076,503円

| | |
|-------------------------------------|------------------|
| 同期中における追加設定元本額 | 37,101,159,185円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 28,162,611,486円 |
| 期末元本額 | 158,571,624,202円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 63,877,730円 |
| バランスセレクト50 | 200,963,442円 |
| バランスセレクト70 | 187,017,799円 |
| 野村外国株式インデックスファンド | 561,444,665円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 2,800,256,860円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 10,426,362,943円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 5,916,704,859円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 39,606,261円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 45,701,967円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 50,921,323円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 49,143,520円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 35,647,310円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 121,849,940円 |
| 野村外国株インデックス(野村投資一任口座向け) | 15,911,200,658円 |
| のむらップ・ファンド(保守型) | 882,903,824円 |
| のむらップ・ファンド(普通型) | 5,435,253,524円 |
| のむらップ・ファンド(積極型) | 4,380,798,620円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 11,967,855円 |
| 野村インデックスファンド・外国株式 | 2,296,007,677円 |
| マイ・ロード | 1,666,895,775円 |
| ネクストコア | 84,049,170円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 88,722,635円 |
| 野村外国株インデックス(野村SMA・EW向け) | 452,067,224円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 214,711,057円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 3,432,627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) | 684,160,749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) | 467,317,320円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 9,786,547,797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) | 3,926,189,341円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用) | 8,991,689円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | 38,896,581円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用) | 28,261,719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) | 133,083,317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) | 1,452,118,533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) | 587,441,892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) | 237,794,913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) | 33,654,861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) | 268,441,094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) | 4,840,763,033円 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 636,100,640円 |
| 野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用) | 1,099,869,564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) | 102,805,798円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 3,583,074円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 16,281,431円 |

| | |
|---|-----------------|
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 13,786,973円 |
| 野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け) | 54,634,433,083円 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 1,259,363,786円 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 5,170,700,092円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 5,829,623,049円 |
| マイバランスDC30 | 679,792,400円 |
| マイバランスDC50 | 1,173,093,499円 |
| マイバランスDC70 | 917,696,389円 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI | 12,485,049,884円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 101,648,823円 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 545,648円 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 1,387,585円 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 24,198,099円 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 152,505円 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 339,776円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17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 | 41,100 | 41.20 | 1,693,320.00 | |
| | | CAMERON INTERNATIONAL CORP | 17,700 | 65.61 | 1,161,297.00 | |
| | | CORE LABORATORIES N.V. | 3,830 | 101.67 | 389,396.10 | |
| | | ENSCO PLC-CL A | 23,000 | 8.53 | 196,190.00 | |
| | | FMC TECHNOLOGIES INC | 22,500 | 23.48 | 528,300.00 | |
| | | HALLIBURTON CO | 80,300 | 29.94 | 2,404,182.00 | |
| | | HELMERICH & PAYNE | 10,600 | 48.64 | 515,584.00 | |
| | | NATIONAL OILWELL VARCO INC | 36,600 | 28.06 | 1,026,996.00 | |
| | | OCEANEERING INTL INC | 9,500 | 26.55 | 252,225.00 | |
| | | SCHLUMBERGER LTD | 119,700 | 71.75 | 8,588,475.00 | |
| | | WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC | 76,000 | 6.62 | 503,120.00 | |
| | | ANADARKO PETE | 48,200 | 39.09 | 1,884,138.00 | |
| | | ANTERO RESOURCES CORP | 7,400 | 24.64 | 182,336.00 | |
| | | APACHE CORPORATION | 35,900 | 37.47 | 1,345,173.00 | |
| CABOT OIL & GAS CORP | 39,600 | 19.26 | 762,696.00 | | | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| CHENIERE ENERGY INC | 20,600 | 26.58 | 547,548.00 |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP | 51,600 | 1.86 | 95,976.00 |
| CHEVRON CORP | 177,700 | 84.81 | 15,070,737.00 |
| CIMAREX ENERGY CO | 9,000 | 84.28 | 758,520.00 |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP | 35,300 | 16.82 | 593,746.00 |
| CONCHO RESOURCES INC | 11,800 | 88.14 | 1,040,052.00 |
| CONOCOPHILLIPS | 116,200 | 32.76 | 3,806,712.00 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 8,000 | 18.46 | 147,680.00 |
| DEVON ENERGY CORP | 37,400 | 21.26 | 795,124.00 |
| ENERGEN CORP | 6,800 | 22.90 | 155,720.00 |
| EOG RESOURCES INC | 51,500 | 67.89 | 3,496,335.00 |
| EQT CORP | 14,100 | 60.32 | 850,512.00 |
| EXXON MOBIL CORP | 393,800 | 81.22 | 31,984,436.00 |
| HESS CORP | 26,400 | 40.84 | 1,078,176.00 |
| HOLLYFRONTIER CORP | 16,600 | 30.87 | 512,442.00 |
| KINDER MORGAN INC | 176,000 | 15.62 | 2,749,120.00 |
| MARATHON OIL CORP | 62,400 | 7.40 | 461,760.00 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 49,900 | 32.54 | 1,623,746.00 |
| MURPHY OIL CORP | 15,000 | 16.80 | 252,000.00 |
| NOBLE ENERGY INC | 41,100 | 28.64 | 1,177,104.00 |
| OCCIDENTAL PETE CORP | 72,400 | 68.01 | 4,923,924.00 |
| ONEOK INC | 19,800 | 21.03 | 416,394.00 |
| PHILLIPS 66 | 51,000 | 78.25 | 3,990,750.00 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 15,200 | 115.45 | 1,754,840.00 |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | 19,000 | 6.65 | 126,350.00 |
| RANGE RESOURCES CORP | 16,700 | 26.04 | 434,868.00 |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 33,600 | 8.00 | 268,800.00 |
| SPECTRA ENERGY CORP | 63,300 | 28.40 | 1,797,720.00 |
| TESORO CORP | 11,300 | 70.43 | 795,859.00 |
| VALERO ENERGY CORP | 46,700 | 57.35 | 2,678,245.00 |
| WHITING PETROLEUM CORP | 17,800 | 4.76 | 84,728.00 |
| WILLIAMS COS | 66,200 | 15.01 | 993,662.00 |
| AIR PRODUCTS | 19,430 | 131.35 | 2,552,130.50 |
| AIRGAS INC | 6,450 | 140.48 | 906,096.00 |
| ALBEMARLE CORP | 10,200 | 52.32 | 533,664.00 |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|--------|--------------|
| ASHLAND INC | 5,900 | 95.54 | 563,686.00 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 12,500 | 24.55 | 306,875.00 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 14,600 | 58.69 | 856,874.00 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 21,450 | 31.14 | 667,953.00 |
| DOW CHEM CO | 106,600 | 46.83 | 4,992,078.00 |
| DU PONT E I DE NEMOURS | 85,300 | 58.86 | 5,020,758.00 |
| EASTMAN CHEMICAL CO. | 14,200 | 62.36 | 885,512.00 |
| ECOLAB INC | 25,100 | 108.65 | 2,727,115.00 |
| FMC CORP | 13,200 | 36.79 | 485,628.00 |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 7,700 | 106.54 | 820,358.00 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 37,400 | 77.93 | 2,914,582.00 |
| MONSANTO CO | 44,100 | 87.94 | 3,878,154.00 |
| MOSAIC CO/THE | 29,300 | 23.54 | 689,722.00 |
| PPG INDUSTRIES | 25,800 | 93.62 | 2,415,396.00 |
| PRAXAIR INC | 27,100 | 104.00 | 2,818,400.00 |
| SHERWIN-WILLIAMS | 7,470 | 258.94 | 1,934,281.80 |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 4,100 | 43.58 | 178,678.00 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 5,500 | 135.41 | 744,755.00 |
| VULCAN MATERIALS CO | 12,800 | 93.26 | 1,193,728.00 |
| AVERY DENNISON CORP | 8,300 | 64.83 | 538,089.00 |
| BALL CORP | 12,400 | 66.26 | 821,624.00 |
| CROWN HOLDINGS INC | 12,600 | 45.60 | 574,560.00 |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO) | 37,600 | 35.10 | 1,319,760.00 |
| PACKAGING CORP OP AMERICA | 8,900 | 47.39 | 421,771.00 |
| SEALED AIR CORP | 19,900 | 43.43 | 864,257.00 |
| WESTROCK CO | 24,300 | 31.51 | 765,693.00 |
| ALCOA INC | 121,000 | 8.12 | 982,520.00 |
| FREEMONT-MCMORAN INC | 97,000 | 6.37 | 617,890.00 |
| NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO | 49,700 | 24.56 | 1,220,632.00 |
| NUCOR CORP | 30,700 | 40.18 | 1,233,526.00 |
| B/E AEROSPACE INC | 10,100 | 40.67 | 410,767.00 |
| BOEING CO | 61,100 | 112.60 | 6,879,860.00 |
| GENERAL DYNAMICS | 25,730 | 131.51 | 3,383,752.30 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL | 69,900 | 104.95 | 7,336,005.00 |
| L-3 COMMUNICATIONS HLDGS | 7,700 | 116.20 | 894,740.00 |

| | | | |
|---------------------------------------|---------|--------|---------------|
| LOCKHEED MARTIN | 26,470 | 209.00 | 5,532,230.00 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 16,810 | 184.22 | 3,096,738.20 |
| RAYTHEON COMPANY | 28,600 | 120.81 | 3,455,166.00 |
| ROCKWELL COLLINS INC | 12,200 | 82.80 | 1,010,160.00 |
| TEXTRON INC | 26,400 | 32.84 | 866,976.00 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 4,980 | 205.24 | 1,022,095.20 |
| UNITED TECHNOLOGIES | 80,100 | 86.48 | 6,927,048.00 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 14,800 | 47.75 | 706,700.00 |
| MASCO CORP | 32,900 | 26.43 | 869,547.00 |
| CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR | 8,400 | 32.99 | 277,116.00 |
| FLUOR CORP | 14,200 | 44.99 | 638,858.00 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 11,000 | 37.21 | 409,310.00 |
| QUANTA SERVICES INC | 18,600 | 18.04 | 335,544.00 |
| ACUITY BRANDS INC | 4,020 | 185.89 | 747,277.80 |
| AMETEK INC | 23,300 | 45.98 | 1,071,334.00 |
| EATON CORP PLC | 44,500 | 54.82 | 2,439,490.00 |
| EMERSON ELEC | 62,100 | 46.62 | 2,895,102.00 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 12,400 | 100.26 | 1,243,224.00 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 15,400 | 33.03 | 508,662.00 |
| 3M CORP | 59,100 | 155.53 | 9,191,823.00 |
| DANAHER CORP | 58,300 | 86.49 | 5,042,367.00 |
| GENERAL ELEC CO | 891,400 | 28.86 | 25,725,804.00 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 9,410 | 167.29 | 1,574,198.90 |
| AGCO CORP | 6,300 | 47.34 | 298,242.00 |
| CATERPILLAR INC DEL | 53,700 | 65.21 | 3,501,777.00 |
| CUMMINS INC | 16,100 | 99.14 | 1,596,154.00 |
| DEERE & COMPANY | 29,700 | 79.81 | 2,370,357.00 |
| DOVER CORP | 14,500 | 60.29 | 874,205.00 |
| FLOWSERVE CORP | 12,300 | 41.93 | 515,739.00 |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 31,100 | 93.54 | 2,909,094.00 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 25,100 | 51.74 | 1,298,674.00 |
| PACCAR | 33,500 | 51.36 | 1,720,560.00 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 13,200 | 99.65 | 1,315,380.00 |
| PENTAIR PLC | 17,400 | 45.74 | 795,876.00 |
| SNAP-ON INC | 5,460 | 141.88 | 774,664.80 |

| | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|--------------|
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 14,700 | 92.97 | 1,366,659.00 |
| WABCO HOLDINGS INC | 5,200 | 92.52 | 481,104.00 |
| WABTEC CORP | 9,400 | 67.49 | 634,406.00 |
| XYLEM INC | 17,000 | 37.00 | 629,000.00 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 8,700 | 29.15 | 253,605.00 |
| FASTENAL CO | 26,200 | 43.68 | 1,144,416.00 |
| GRAINGER(W.W.) INC | 5,590 | 213.97 | 1,196,092.30 |
| UNITED RENTALS INC | 8,600 | 47.56 | 409,016.00 |
| ADT CORP/THE | 15,800 | 39.64 | 626,312.00 |
| CINTAS CORP | 9,100 | 83.98 | 764,218.00 |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A | 22,900 | 45.43 | 1,040,347.00 |
| STERICYCLE INC | 8,100 | 109.47 | 886,707.00 |
| TYCO INTERNATIONAL PLC | 39,100 | 34.20 | 1,337,220.00 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 42,800 | 54.79 | 2,345,012.00 |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC | 13,700 | 71.21 | 975,577.00 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC | 18,300 | 46.58 | 852,414.00 |
| FEDEX CORPORATION | 25,170 | 132.11 | 3,325,208.70 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 66,100 | 98.56 | 6,514,816.00 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 15,400 | 38.61 | 594,594.00 |
| DELTA AIR LINES INC | 19,100 | 44.58 | 851,478.00 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 15,300 | 37.08 | 567,324.00 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 9,300 | 48.87 | 454,491.00 |
| AMERCO | 680 | 342.09 | 232,621.20 |
| CSX CORP | 93,200 | 24.76 | 2,307,632.00 |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC | 34,600 | 8.13 | 281,298.00 |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC | 8,700 | 75.55 | 657,285.00 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 10,200 | 80.63 | 822,426.00 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 28,700 | 73.99 | 2,123,513.00 |
| UNION PAC CORP | 82,200 | 79.37 | 6,524,214.00 |
| AUTOLIV INC | 8,500 | 105.46 | 896,410.00 |
| BORGWARNER INC | 21,300 | 32.40 | 690,120.00 |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 26,500 | 63.12 | 1,672,680.00 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 25,200 | 30.35 | 764,820.00 |
| JOHNSON CONTROLS INC | 61,900 | 35.48 | 2,196,212.00 |
| LEAR CORP | 7,400 | 103.90 | 768,860.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| FORD MOTOR COMPANY | 349,000 | 11.87 | 4,142,630.00 |
| GENERAL MOTORS CO | 134,400 | 28.58 | 3,841,152.00 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 19,000 | 39.70 | 754,300.00 |
| TESLA MOTORS INC | 9,080 | 155.17 | 1,408,943.60 |
| DR HORTON INC | 31,700 | 24.78 | 785,526.00 |
| GARMIN LTD | 10,200 | 35.23 | 359,346.00 |
| HARMAN INTERNATIONAL | 7,000 | 73.06 | 511,420.00 |
| JARDEN CORP | 19,300 | 50.83 | 981,019.00 |
| LEGGETT & PLATT INC | 13,400 | 42.98 | 575,932.00 |
| LENNAR CORP-A | 16,800 | 40.30 | 677,040.00 |
| MOHAWK INDUSTRIES | 6,020 | 159.52 | 960,310.40 |
| NEWELL RUBBERMAID INC | 25,500 | 36.00 | 918,000.00 |
| PULTEGROUP INC | 29,500 | 16.67 | 491,765.00 |
| TOLL BROTHERS INC | 16,400 | 25.71 | 421,644.00 |
| WHIRLPOOL CORP | 7,340 | 135.45 | 994,203.00 |
| HASBRO INC | 10,800 | 71.04 | 767,232.00 |
| MATTEL INC | 31,800 | 30.35 | 965,130.00 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 6,200 | 83.51 | 517,762.00 |
| COACH INC | 26,500 | 35.58 | 942,870.00 |
| HANESBRANDS INC | 37,700 | 27.47 | 1,035,619.00 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 10,600 | 59.80 | 633,880.00 |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 18,700 | 50.76 | 949,212.00 |
| NIKE INC-B | 128,300 | 57.79 | 7,414,457.00 |
| PVH CORP | 7,600 | 73.92 | 561,792.00 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 5,800 | 88.33 | 512,314.00 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 17,100 | 79.94 | 1,366,974.00 |
| V F CORP | 32,300 | 59.60 | 1,925,080.00 |
| ARAMARK | 21,600 | 30.18 | 651,888.00 |
| CARNIVAL CORP | 39,200 | 45.02 | 1,764,784.00 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 2,950 | 492.94 | 1,454,173.00 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 10,900 | 59.54 | 648,986.00 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 46,300 | 18.99 | 879,237.00 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 37,100 | 45.82 | 1,699,922.00 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA | 20,200 | 65.06 | 1,314,212.00 |
| MCDONALD'S CORP | 89,000 | 119.18 | 10,607,020.00 |

| | | | |
|---|---------|--------|---------------|
| MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR | 7,500 | 15.16 | 113,700.00 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 42,300 | 19.15 | 810,045.00 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 15,000 | 40.56 | 608,400.00 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 16,900 | 72.51 | 1,225,419.00 |
| STARBUCKS CORP | 140,400 | 56.41 | 7,919,964.00 |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 16,200 | 65.04 | 1,053,648.00 |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 10,900 | 67.08 | 731,172.00 |
| WYNN RESORTS LTD | 7,700 | 74.65 | 574,805.00 |
| YUM BRANDS INC | 40,700 | 69.52 | 2,829,464.00 |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 19,300 | 32.69 | 630,917.00 |
| CBS CORP-CL B | 41,400 | 44.92 | 1,859,688.00 |
| CHARTER COMMUNICATION-A | 7,950 | 168.93 | 1,342,993.50 |
| COMCAST CORP-CL A | 234,700 | 57.48 | 13,490,556.00 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC | 14,300 | 25.56 | 365,508.00 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 26,500 | 25.03 | 663,295.00 |
| DISH NETWORK CORP-A | 20,900 | 44.15 | 922,735.00 |
| DISNEY (WALT) CO | 151,500 | 92.91 | 14,075,865.00 |
| INTERPUBRIC GROUP | 39,200 | 20.70 | 811,440.00 |
| LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C | 58,300 | 33.96 | 1,979,868.00 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 23,700 | 35.28 | 836,136.00 |
| LIBERTY MEDIA CORP-A | 8,170 | 32.68 | 266,995.60 |
| LIBERTY MEDIA CORP-C | 19,300 | 32.27 | 622,811.00 |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I | 37,400 | 10.94 | 409,156.00 |
| OMNICOM GROUP | 23,100 | 75.75 | 1,749,825.00 |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A | 7,100 | 53.81 | 382,051.00 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 222,000 | 3.49 | 774,780.00 |
| TEGNA INC | 20,600 | 23.21 | 478,126.00 |
| TIME WARNER CABLE-A | 26,660 | 186.09 | 4,961,159.40 |
| TIME WARNER INC | 77,300 | 63.33 | 4,895,409.00 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC | 115,300 | 25.61 | 2,952,833.00 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B | 40,900 | 25.63 | 1,048,267.00 |
| VIACOM INC-CLASS B | 32,800 | 34.29 | 1,124,712.00 |
| GENUINE PARTS CO | 14,200 | 89.61 | 1,272,462.00 |
| LKQ CORP | 28,100 | 25.67 | 721,327.00 |
| AMAZON.COM INC | 37,560 | 521.10 | 19,572,516.00 |

| | | | |
|---|---------|----------|---------------|
| EXPEDIA INC | 11,700 | 105.44 | 1,233,648.00 |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A | 41,400 | 24.24 | 1,003,536.00 |
| NETFLIX INC | 38,400 | 89.05 | 3,419,520.00 |
| PRICELINE GROUP INC/THE | 4,800 | 1,110.68 | 5,331,264.00 |
| TRIPADVISOR INC | 11,500 | 63.32 | 728,180.00 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 27,500 | 73.04 | 2,008,600.00 |
| DOLLAR TREE INC | 21,300 | 78.55 | 1,673,115.00 |
| KOHL'S CORP | 19,100 | 42.62 | 814,042.00 |
| MACYS INC | 30,700 | 40.47 | 1,242,429.00 |
| NORDSTROM INC | 13,700 | 50.90 | 697,330.00 |
| TARGET CORP | 56,600 | 71.50 | 4,046,900.00 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 6,800 | 146.00 | 992,800.00 |
| AUTONATION INC | 7,100 | 49.23 | 349,533.00 |
| AUTOZONE | 2,940 | 757.69 | 2,227,608.60 |
| BED BATH & BEYOND | 15,600 | 44.61 | 695,916.00 |
| BEST BUY COMPANY INC | 30,500 | 29.50 | 899,750.00 |
| CARMAX INC | 19,300 | 46.04 | 888,572.00 |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 8,300 | 39.04 | 324,032.00 |
| FOOT LOCKER INC | 13,400 | 67.68 | 906,912.00 |
| GAMESTOP CORP-CLASS A | 10,000 | 28.00 | 280,000.00 |
| GAP INC | 22,900 | 24.52 | 561,508.00 |
| HOME DEPOT | 121,400 | 119.43 | 14,498,802.00 |
| L BRANDS, INC | 23,300 | 83.31 | 1,941,123.00 |
| LOWE'S COS INC | 87,600 | 67.43 | 5,906,868.00 |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC, | 9,400 | 255.76 | 2,404,144.00 |
| ROSS STORES INC | 39,400 | 55.00 | 2,167,000.00 |
| SIGNET JEWELERS LTD | 7,100 | 104.15 | 739,465.00 |
| STAPLES INC | 62,000 | 8.85 | 548,700.00 |
| TIFFANY & CO | 11,900 | 63.24 | 752,556.00 |
| TJX COS INC | 63,600 | 71.37 | 4,539,132.00 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 12,600 | 85.54 | 1,077,804.00 |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 5,630 | 159.02 | 895,282.60 |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 41,620 | 149.11 | 6,205,958.20 |
| CVS HEALTH CORP | 105,400 | 96.94 | 10,217,476.00 |
| | 87,400 | 38.49 | 3,364,026.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| KROGER CO | | | |
| RITE AID CORP | 93,000 | 7.83 | 728,190.00 |
| SYSCO CORP | 56,300 | 43.76 | 2,463,688.00 |
| WAL-MART STORES INC | 152,300 | 65.90 | 10,036,570.00 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 82,700 | 76.55 | 6,330,685.00 |
| WHOLE FOODS MARKET INC | 34,100 | 30.90 | 1,053,690.00 |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B | 11,000 | 98.22 | 1,080,420.00 |
| COCA COLA CO | 390,500 | 43.36 | 16,932,080.00 |
| COCA COLA ENTERPRISES | 20,700 | 48.77 | 1,009,539.00 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 16,370 | 139.29 | 2,280,177.30 |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 18,100 | 92.01 | 1,665,381.00 |
| MOLSON COORS BREWING CO-B | 17,400 | 84.66 | 1,473,084.00 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 13,730 | 124.31 | 1,706,776.30 |
| PEPSICO INC | 138,800 | 98.60 | 13,685,680.00 |
| ARCHER DANIELS MIDLAND | 56,800 | 33.62 | 1,909,616.00 |
| BUNGE LIMITED | 13,800 | 52.16 | 719,808.00 |
| CAMPBELL SOUP CO | 17,500 | 59.44 | 1,040,200.00 |
| CONAGRA INC | 40,400 | 41.77 | 1,687,508.00 |
| GENERAL MILLS | 56,300 | 57.66 | 3,246,258.00 |
| HERSHEY CO/THE | 14,500 | 90.39 | 1,310,655.00 |
| HORMEL FOODS CORP | 27,600 | 44.44 | 1,226,544.00 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 10,800 | 127.70 | 1,379,160.00 |
| KELLOGG CO | 25,000 | 75.19 | 1,879,750.00 |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC | 10,600 | 90.46 | 958,876.00 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 57,200 | 72.31 | 4,136,132.00 |
| MCCORMICK & CO INC. | 10,800 | 90.38 | 976,104.00 |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO | 19,200 | 72.53 | 1,392,576.00 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 152,600 | 39.12 | 5,969,712.00 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 28,900 | 61.81 | 1,786,309.00 |
| WHITEWAVE FOODS CO - CL A | 16,200 | 37.30 | 604,260.00 |
| ALTRIA GROUP INC | 185,400 | 60.30 | 11,179,620.00 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 146,400 | 90.12 | 13,193,568.00 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 81,400 | 48.28 | 3,929,992.00 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 12,300 | 89.64 | 1,102,572.00 |
| CLOROX CO | 12,200 | 128.12 | 1,563,064.00 |

| | | | |
|------------------------------------|---------|--------|---------------|
| COLGATE PALMOLIVE CO. | 81,000 | 65.81 | 5,330,610.00 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 34,300 | 128.71 | 4,414,753.00 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 256,300 | 81.47 | 20,880,761.00 |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO | 6,100 | 76.36 | 465,796.00 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 21,100 | 88.62 | 1,869,882.00 |
| ABBOTT LABORATORIES | 141,200 | 37.99 | 5,364,188.00 |
| BARD (C R) | 7,030 | 187.44 | 1,317,703.20 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC. | 51,400 | 37.41 | 1,922,874.00 |
| BECTON,DICKINSON | 19,740 | 142.12 | 2,805,448.80 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 127,300 | 17.16 | 2,184,468.00 |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 13,200 | 55.70 | 735,240.00 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 20,500 | 84.45 | 1,731,225.00 |
| HOLOGIC INC | 23,100 | 33.83 | 781,473.00 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 3,490 | 535.16 | 1,867,708.40 |
| MEDTRONIC PLC | 133,900 | 74.74 | 10,007,686.00 |
| RESMED INC | 13,200 | 59.03 | 779,196.00 |
| ST JUDE MEDICAL INC | 27,000 | 51.94 | 1,402,380.00 |
| STRYKER CORP | 31,800 | 97.40 | 3,097,320.00 |
| THE COOPER COMPANIES, INC. | 4,700 | 137.89 | 648,083.00 |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 9,500 | 78.03 | 741,285.00 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 17,900 | 93.62 | 1,675,798.00 |
| AETNA INC | 32,700 | 102.18 | 3,341,286.00 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 19,100 | 85.61 | 1,635,151.00 |
| ANTHEM INC | 24,500 | 124.83 | 3,058,335.00 |
| CARDINAL HEALTH INC | 31,000 | 79.77 | 2,472,870.00 |
| CENTENE CORP | 10,600 | 55.15 | 584,590.00 |
| CIGNA CORP | 24,160 | 134.18 | 3,241,788.80 |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC | 16,000 | 62.64 | 1,002,240.00 |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | 16,500 | 19.88 | 328,020.00 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON | 64,100 | 68.65 | 4,400,465.00 |
| HCA HOLDINGS INC | 31,300 | 65.60 | 2,053,280.00 |
| HENRY SCHEIN INC | 7,740 | 161.86 | 1,252,796.40 |
| HUMANA INC | 14,030 | 166.64 | 2,337,959.20 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 9,400 | 104.50 | 982,300.00 |
| MCKESSON CORP | 21,790 | 152.59 | 3,324,936.10 |

| | | | |
|------------------------------------|---------|--------|---------------|
| MEDNAX INC | 9,100 | 64.97 | 591,227.00 |
| PATTERSON COS INC | 8,700 | 43.57 | 379,059.00 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 13,300 | 63.22 | 840,826.00 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 90,200 | 115.15 | 10,386,530.00 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 8,700 | 106.10 | 923,070.00 |
| ABBVIE INC | 156,600 | 53.51 | 8,379,666.00 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 21,220 | 142.39 | 3,021,515.80 |
| ALKERMES PLC | 13,800 | 33.31 | 459,678.00 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 7,200 | 63.90 | 460,080.00 |
| AMGEN INC | 71,700 | 147.15 | 10,550,655.00 |
| BAXALTA INC | 57,500 | 39.00 | 2,242,500.00 |
| BIOGEN INC | 22,270 | 256.52 | 5,712,700.40 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 15,300 | 74.26 | 1,136,178.00 |
| CELGENE CORP | 74,800 | 104.49 | 7,815,852.00 |
| GILEAD SCIENCES INC | 138,700 | 91.15 | 12,642,505.00 |
| INCYTE CORP | 15,500 | 71.67 | 1,110,885.00 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 10,900 | 36.04 | 392,836.00 |
| MEDIVATION INC | 15,400 | 31.58 | 486,332.00 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 7,160 | 391.76 | 2,805,001.60 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 4,340 | 129.83 | 563,462.20 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS | 23,000 | 85.37 | 1,963,510.00 |
| ALLERGAN PLC | 37,220 | 284.45 | 10,587,229.00 |
| BRISTOL MYERS SQUIBB | 157,700 | 62.18 | 9,805,786.00 |
| ELI LILLY & CO. | 94,400 | 73.33 | 6,922,352.00 |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 20,500 | 51.58 | 1,057,390.00 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 5,800 | 119.00 | 690,200.00 |
| JOHNSON & JOHNSON | 261,500 | 102.32 | 26,756,680.00 |
| MALLINCKRODT PLC | 11,100 | 64.22 | 712,842.00 |
| MERCK & CO INC | 266,200 | 49.78 | 13,251,436.00 |
| MYLAN NV | 39,300 | 43.15 | 1,695,795.00 |
| PERRIGO CO PLC | 13,650 | 141.21 | 1,927,516.50 |
| PFIZER INC | 582,700 | 29.81 | 17,370,287.00 |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | 800 | 134.92 | 107,936.00 |
| ZOETIS INC | 44,700 | 40.43 | 1,807,221.00 |
| BANK OF AMERICA CORP | 986,700 | 12.25 | 12,087,075.00 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|
| BB&T CORPORATION | 74,200 | 32.58 | 2,417,436.00 |
| CIT GROUP INC | 15,500 | 27.30 | 423,150.00 |
| CITIGROUP | 284,600 | 38.89 | 11,068,094.00 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 50,100 | 19.36 | 969,936.00 |
| COMERICA INC | 17,300 | 34.25 | 592,525.00 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 76,700 | 15.58 | 1,194,986.00 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 13,700 | 59.81 | 819,397.00 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 75,000 | 8.74 | 655,500.00 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 349,400 | 58.35 | 20,387,490.00 |
| KEYCORP | 81,000 | 10.91 | 883,710.00 |
| M & T BANK CORP | 13,600 | 108.88 | 1,480,768.00 |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC | 30,500 | 14.83 | 452,315.00 |
| PNC FINANCIAL | 48,700 | 83.27 | 4,055,249.00 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 126,000 | 7.84 | 987,840.00 |
| SIGNATURE BANK | 4,890 | 131.12 | 641,176.80 |
| SUNTRUST BKS INC. | 48,000 | 34.29 | 1,645,920.00 |
| US BANCORP | 166,700 | 40.19 | 6,699,673.00 |
| WELLS FARGO CO | 460,700 | 48.24 | 22,224,168.00 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 112,000 | 128.56 | 14,398,720.00 |
| CME GROUP INC | 30,100 | 90.71 | 2,730,371.00 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 11,220 | 237.89 | 2,669,125.80 |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 32,200 | 14.79 | 476,238.00 |
| MCGRAW HILL FINANCIAL INC | 25,800 | 87.32 | 2,252,856.00 |
| MOODYS CORP | 16,900 | 83.72 | 1,414,868.00 |
| NASDAQ INC | 11,100 | 61.66 | 684,426.00 |
| VOYA FINANCIAL INC | 21,100 | 28.17 | 594,387.00 |
| AFLAC INC | 40,800 | 58.13 | 2,371,704.00 |
| ALLEGHANY CORP | 1,510 | 462.90 | 698,979.00 |
| ALLSTATE CORP | 37,900 | 64.57 | 2,447,203.00 |
| AMERICAN INTL GROUP | 122,500 | 52.06 | 6,377,350.00 |
| AON PLC | 26,300 | 94.15 | 2,476,145.00 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 11,400 | 68.61 | 782,154.00 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 15,900 | 39.00 | 620,100.00 |
| ASSURANT INC | 6,200 | 67.25 | 416,950.00 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 9,900 | 52.81 | 522,819.00 |

| | | | |
|-----------------------------|---------|--------|---------------|
| CHUBB LTD | 43,700 | 115.67 | 5,054,779.00 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 14,700 | 62.11 | 913,017.00 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 4,020 | 184.69 | 742,453.80 |
| FNF GROUP | 24,400 | 32.50 | 793,000.00 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES | 39,400 | 41.17 | 1,622,098.00 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 23,900 | 33.92 | 810,688.00 |
| LOEWS CORP | 26,900 | 36.53 | 982,657.00 |
| MARKEL CORP | 1,300 | 833.88 | 1,084,044.00 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 50,100 | 56.50 | 2,830,650.00 |
| METLIFE INC | 89,000 | 38.02 | 3,383,780.00 |
| PARTNERRE LTD | 4,480 | 140.50 | 629,440.00 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 28,000 | 36.46 | 1,020,880.00 |
| PROGRESSIVE CO | 55,300 | 31.65 | 1,750,245.00 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 42,600 | 63.44 | 2,702,544.00 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 4,400 | 113.23 | 498,212.00 |
| TORCHMARK CORP | 12,200 | 51.09 | 623,298.00 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 29,400 | 107.37 | 3,156,678.00 |
| UNUM GROUP | 22,700 | 26.58 | 603,366.00 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 12,400 | 110.77 | 1,373,548.00 |
| WR BERKLEY CORP | 8,900 | 51.81 | 461,109.00 |
| XL GROUP PLC | 28,800 | 34.65 | 997,920.00 |
| CBRE GROUP INC | 27,600 | 24.32 | 671,232.00 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 56,000 | 5.78 | 323,680.00 |
| JONES LANG LASALLE INC | 4,210 | 103.17 | 434,345.70 |
| REALOGY HOLDINGS CORP | 13,000 | 29.60 | 384,800.00 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 16,700 | 52.55 | 877,585.00 |
| ALPHABET INC-CL A | 27,390 | 717.64 | 19,656,159.60 |
| ALPHABET INC-CL C | 29,240 | 691.00 | 20,204,840.00 |
| EBAY INC | 104,100 | 22.95 | 2,389,095.00 |
| FACEBOOK INC-A | 202,800 | 101.61 | 20,606,508.00 |
| LINKEDIN CORP - A | 10,870 | 106.00 | 1,152,220.00 |
| TWITTER INC | 53,700 | 16.36 | 878,532.00 |
| VERISIGN INC | 9,900 | 79.68 | 788,832.00 |
| YAHOO! INC | 84,100 | 29.28 | 2,462,448.00 |
| ZILLOW GROUP INC - C | 8,600 | 18.83 | 161,938.00 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|--------|---------------|
| ACCENTURE PLC-CL A | 59,100 | 96.91 | 5,727,381.00 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 5,870 | 187.49 | 1,100,566.30 |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 43,700 | 83.78 | 3,661,186.00 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 57,100 | 55.01 | 3,141,071.00 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 26,300 | 58.65 | 1,542,495.00 |
| FISERV INC | 21,900 | 94.35 | 2,066,265.00 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 7,400 | 124.61 | 922,114.00 |
| GARTNER INC | 8,100 | 81.50 | 660,150.00 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 12,400 | 58.10 | 720,440.00 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 88,000 | 122.74 | 10,801,120.00 |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 94,500 | 86.18 | 8,144,010.00 |
| PAYCHEX INC | 30,700 | 49.99 | 1,534,693.00 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 104,200 | 35.46 | 3,694,932.00 |
| SABRE CORP | 17,600 | 26.17 | 460,592.00 |
| TERADATA CORP | 13,200 | 23.64 | 312,048.00 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 15,200 | 40.83 | 620,616.00 |
| VANTIV INC - CL A | 15,100 | 48.81 | 737,031.00 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 184,400 | 71.10 | 13,110,840.00 |
| WESTERN UNION CO | 49,100 | 18.40 | 903,440.00 |
| XEROX CORP | 97,000 | 9.02 | 874,940.00 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 47,700 | 29.42 | 1,403,334.00 |
| ADOBE SYSTEMS INC. | 47,200 | 78.88 | 3,723,136.00 |
| ANSYS INC | 8,400 | 84.05 | 706,020.00 |
| AUTODESK INC. | 21,000 | 44.89 | 942,690.00 |
| CA INC | 30,900 | 28.36 | 876,324.00 |
| CDK GLOBAL INC | 12,800 | 42.89 | 548,992.00 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 6,700 | 80.40 | 538,680.00 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 14,900 | 65.67 | 978,483.00 |
| ELECTRONIC ARTS | 29,100 | 59.36 | 1,727,376.00 |
| FIREEYE INC | 12,400 | 13.21 | 163,804.00 |
| FORTINET INC | 12,800 | 25.42 | 325,376.00 |
| INTUIT INC | 24,900 | 95.36 | 2,374,464.00 |
| MICROSOFT CORP | 717,500 | 51.09 | 36,657,075.00 |
| MOBILEYE NV | 7,100 | 27.47 | 195,037.00 |
| NETSUITE INC | 3,900 | 53.74 | 209,586.00 |

| | | | |
|----------------------------|---------|--------|---------------|
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 22,500 | 17.65 | 397,125.00 |
| ORACLE CORPORATION | 328,000 | 35.70 | 11,709,600.00 |
| RED HAT INC | 17,000 | 63.84 | 1,085,280.00 |
| SALESFORCE.COM INC | 58,700 | 59.72 | 3,505,564.00 |
| SERVICENOW INC | 14,300 | 52.04 | 744,172.00 |
| SPLUNK INC | 11,600 | 32.24 | 373,984.00 |
| SYMANTEC CORP | 65,200 | 19.55 | 1,274,660.00 |
| SYNOPSYS INC | 14,900 | 42.96 | 640,104.00 |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A | 4,900 | 40.17 | 196,833.00 |
| VMWARE INC - CLASS A | 7,400 | 46.13 | 341,362.00 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 10,100 | 50.53 | 510,353.00 |
| CISCO SYSTEMS | 480,900 | 25.84 | 12,426,456.00 |
| F5 NETWORKS INC | 6,500 | 89.51 | 581,815.00 |
| HARRIS CORP | 11,400 | 73.46 | 837,444.00 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 33,500 | 23.21 | 777,535.00 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 15,100 | 63.42 | 957,642.00 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 6,810 | 127.74 | 869,909.40 |
| QUALCOMM INC | 148,700 | 46.73 | 6,948,751.00 |
| APPLE INC | 538,400 | 96.64 | 52,030,976.00 |
| EMC CORP | 181,400 | 24.60 | 4,462,440.00 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 171,000 | 12.33 | 2,108,430.00 |
| HP INC | 168,700 | 9.81 | 1,654,947.00 |
| NETAPP INC | 27,900 | 23.09 | 644,211.00 |
| SAN DISK CORPORATION | 19,600 | 68.17 | 1,336,132.00 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 29,000 | 31.33 | 908,570.00 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 22,000 | 42.78 | 941,160.00 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 29,600 | 50.73 | 1,501,608.00 |
| ARROW ELECTRS INC | 9,300 | 55.69 | 517,917.00 |
| AVNET | 12,200 | 40.02 | 488,244.00 |
| CDW CORPORATION | 14,100 | 36.26 | 511,266.00 |
| CORNING INC | 116,800 | 18.64 | 2,177,152.00 |
| FLEXTRONICS INTL LTD | 51,000 | 10.50 | 535,755.00 |
| FLIR SYSTEMS INC | 12,600 | 30.26 | 381,276.00 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 38,400 | 55.50 | 2,131,200.00 |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD | 23,200 | 22.37 | 518,984.00 |

| | | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| ANALOG DEVICES INC | 29,400 | 52.07 | 1,530,858.00 | |
| APPLIED MATERIALS | 114,500 | 16.72 | 1,914,440.00 | |
| BROADCOM LTD | 36,653 | 126.24 | 4,627,074.72 | |
| INTEL CORP | 449,500 | 28.78 | 12,936,610.00 | |
| KLA TENCOR CORP | 15,000 | 64.74 | 971,100.00 | |
| LAM RESEARCH | 14,700 | 67.58 | 993,426.00 | |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP | 22,500 | 42.73 | 961,425.00 | |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 41,000 | 9.12 | 373,920.00 | |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 27,100 | 33.42 | 905,682.00 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY | 19,800 | 41.63 | 824,274.00 | |
| MICRON TECHNOLOGY | 103,100 | 10.81 | 1,114,511.00 | |
| NVIDIA CORP | 51,000 | 26.99 | 1,376,490.00 | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 12,574 | 69.44 | 873,138.56 | |
| QORVO INC | 14,600 | 40.78 | 595,388.00 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 17,600 | 61.44 | 1,081,344.00 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 97,300 | 52.54 | 5,112,142.00 | |
| XILINX INC | 24,000 | 48.08 | 1,153,920.00 | |
| AT & T INC | 581,100 | 36.65 | 21,297,315.00 | |
| CENTURYLINK INC | 53,900 | 28.92 | 1,558,788.00 | |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CO | 114,000 | 4.25 | 484,500.00 | |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 29,000 | 47.97 | 1,391,130.00 | |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 12,100 | 90.53 | 1,095,413.00 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 384,100 | 50.24 | 19,297,184.00 | |
| SPRINT CORP | 71,000 | 2.79 | 198,090.00 | |
| T-MOBILE US INC | 27,100 | 36.45 | 987,795.00 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 46,600 | 61.09 | 2,846,794.00 | |
| DUKE ENERGY CORP | 65,200 | 76.29 | 4,974,108.00 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 30,400 | 62.38 | 1,896,352.00 | |
| ENTERGY CORP | 16,700 | 70.77 | 1,181,859.00 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 29,900 | 53.86 | 1,610,414.00 | |
| EXELON CORPORATION | 81,500 | 31.02 | 2,528,130.00 | |
| FIRSTENERGY CORP | 39,200 | 33.46 | 1,311,632.00 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 42,600 | 112.35 | 4,786,110.00 | |
| OGE ENERGY CORP | 19,600 | 26.21 | 513,716.00 | |
| PEPCO HOLDINGS INC | 24,600 | 26.64 | 655,344.00 | |

| | | | | |
|-----------------------------|---------|--------|--------------|--|
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 10,500 | 67.25 | 706,125.00 | |
| PPL CORPORATION | 63,000 | 36.03 | 2,269,890.00 | |
| SOUTHERN CO. | 86,100 | 48.09 | 4,140,549.00 | |
| XCEL ENERGY INC | 47,400 | 38.83 | 1,840,542.00 | |
| AGL RESOURCES INC | 11,500 | 64.61 | 743,015.00 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 10,800 | 66.97 | 723,276.00 | |
| AMEREN CORPORATION | 23,100 | 45.58 | 1,052,898.00 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 38,900 | 18.10 | 704,090.00 | |
| CMS ENERGY CORP | 25,900 | 39.18 | 1,014,762.00 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 27,800 | 70.97 | 1,972,966.00 | |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 56,400 | 69.15 | 3,900,060.00 | |
| DTE ENERGY COMPANY | 17,000 | 84.54 | 1,437,180.00 | |
| PG&E CORP | 46,300 | 55.75 | 2,581,225.00 | |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE | 47,200 | 42.07 | 1,985,704.00 | |
| SCANA CORP | 13,100 | 64.78 | 848,618.00 | |
| SEMPRA ENERGY | 22,400 | 94.44 | 2,115,456.00 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 30,200 | 55.73 | 1,683,046.00 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 17,100 | 65.15 | 1,114,065.00 | |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 47,100 | 15.55 | 732,405.00 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 42,100 | 17.01 | 716,121.00 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 84,900 | 53.18 | 4,514,982.00 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 50,900 | 64.21 | 3,268,289.00 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 40,600 | 45.67 | 1,854,202.00 | |
| NAVIENT CORP | 33,900 | 9.66 | 327,474.00 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 78,400 | 26.14 | 2,049,376.00 | |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 5,200 | 126.62 | 658,424.00 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 16,800 | 82.92 | 1,393,056.00 | |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP | 105,100 | 34.55 | 3,631,205.00 | |
| BLACKROCK INC | 11,510 | 314.47 | 3,619,549.70 | |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 27,100 | 21.86 | 592,406.00 | |
| EATON VANCE CORP | 11,700 | 29.47 | 344,799.00 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 38,300 | 33.85 | 1,296,455.00 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP | 36,900 | 149.02 | 5,498,838.00 | |
| INVESCO LTD | 41,200 | 26.70 | 1,100,040.00 | |
| LEGG MASON INC | 9,200 | 27.22 | 250,424.00 | |

| | | | | | |
|-------|--------------------------------|---------|--------|-------------------|--|
| | MORGAN STANLEY | 137,400 | 23.72 | 3,259,128.00 | |
| | NORTHERN TRUST CORP | 20,500 | 58.25 | 1,194,125.00 | |
| | RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 12,000 | 42.22 | 506,640.00 | |
| | SCHWAB(CHARLES)CORP | 111,200 | 23.58 | 2,622,096.00 | |
| | SEI INVESTMENTS COMPANY | 12,900 | 36.67 | 473,043.00 | |
| | STATE STREET CORP | 38,400 | 56.64 | 2,174,976.00 | |
| | T ROWE PRICE GROUP INC | 24,000 | 68.47 | 1,643,280.00 | |
| | TD AMERITRADE HOLDING CORP | 25,400 | 27.07 | 687,578.00 | |
| | H & R BLOCK INC | 22,400 | 34.59 | 774,816.00 | |
| | AES CORP | 65,000 | 9.38 | 609,700.00 | |
| | CALPINE CORP | 31,000 | 12.99 | 402,690.00 | |
| | NRG ENERGY INC | 29,400 | 9.70 | 285,180.00 | |
| | CERNER CORP | 29,300 | 55.46 | 1,624,978.00 | |
| | IMS HEALTH HOLDINGS INC | 16,300 | 24.74 | 403,262.00 | |
| | AGILENT TECHNOLOGIES INC | 31,100 | 37.08 | 1,153,188.00 | |
| | ILLUMINA INC | 13,710 | 149.11 | 2,044,298.10 | |
| | METTLER-TOLEDO INTL | 2,540 | 312.69 | 794,232.60 | |
| | QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD | 8,800 | 61.79 | 543,752.00 | |
| | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 37,800 | 127.42 | 4,816,476.00 | |
| | WATERS CORP | 7,600 | 120.02 | 912,152.00 | |
| | DUN & BRADSTREET CORP | 3,600 | 93.78 | 337,608.00 | |
| | EQUIFAX INC | 11,000 | 99.17 | 1,090,870.00 | |
| | IHS INC-CLASS A | 6,600 | 98.16 | 647,856.00 | |
| | MANPOWERGROUP INC | 7,000 | 75.07 | 525,490.00 | |
| | NIELSEN HOLDINGS PLC | 33,400 | 47.99 | 1,602,866.00 | |
| | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 12,100 | 38.07 | 460,647.00 | |
| | VERISK ANALYTICS INC | 15,200 | 68.22 | 1,036,944.00 | |
| 小計 | 銘柄数：601 | | | 1,600,379,115.78 | |
| | | | | (182,907,329,142) | |
| | 組入時価比率：61.7% | | | 64.8% | |
| カナダドル | ALTAGAS LTD | 14,100 | 31.57 | 445,137.00 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 33,500 | 18.23 | 610,705.00 | |
| | CAMECO CORP | 38,600 | 15.99 | 617,214.00 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 103,600 | 27.85 | 2,885,260.00 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 79,000 | 14.55 | 1,149,450.00 | |

| | | | |
|---------------------------------|---------|--------|--------------|
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 44,800 | 14.94 | 669,312.00 |
| ENBRIDGE INC | 80,800 | 45.27 | 3,657,816.00 |
| ENCANA CORP | 79,000 | 4.99 | 394,210.00 |
| HUSKY ENERGY INC | 30,745 | 12.55 | 385,849.75 |
| IMPERIAL OIL | 28,300 | 41.17 | 1,165,111.00 |
| INTER PIPELINE LTD | 30,400 | 21.19 | 644,176.00 |
| KEYERA CORP | 16,100 | 35.56 | 572,516.00 |
| MEG ENERGY CORP | 13,600 | 3.81 | 51,816.00 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 32,300 | 31.27 | 1,010,021.00 |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 15,100 | 29.90 | 451,490.00 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 12,600 | 19.59 | 246,834.00 |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 17,000 | 15.33 | 260,610.00 |
| SUNCOR ENERGY INC | 147,360 | 31.01 | 4,569,633.60 |
| TOURMALINE OIL CORP | 17,300 | 25.35 | 438,555.00 |
| TRANSCANADA CORP | 67,100 | 48.96 | 3,285,216.00 |
| VERESEN INC | 24,800 | 7.25 | 179,800.00 |
| VERMILION ENERGY INC | 10,500 | 33.73 | 354,165.00 |
| AGRIUM INC | 12,600 | 115.28 | 1,452,528.00 |
| METHANEX CORP | 8,200 | 38.11 | 312,502.00 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC | 79,100 | 21.74 | 1,719,634.00 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 2,660 | 190.63 | 507,075.80 |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 20,600 | 47.41 | 976,646.00 |
| BARRICK GOLD | 109,000 | 16.11 | 1,755,990.00 |
| ELDORADO GOLD CORPORATION | 62,800 | 3.92 | 246,176.00 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 59,400 | 3.91 | 232,254.00 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 14,700 | 72.78 | 1,069,866.00 |
| GOLDCORP INC | 80,000 | 20.55 | 1,644,000.00 |
| KINROSS GOLD CORP | 104,600 | 3.77 | 394,342.00 |
| SILVER WHEATON CORP | 39,200 | 20.45 | 801,640.00 |
| TECK RESOURCES LTD | 49,200 | 7.10 | 349,320.00 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 87,000 | 2.77 | 240,990.00 |
| YAMANA GOLD INC | 97,000 | 3.46 | 335,620.00 |
| WEST FRASER TIMBER | 6,800 | 40.35 | 274,380.00 |
| BOMBARDIER B SHEARS | 167,000 | 0.90 | 150,300.00 |
| CAE INC | 26,000 | 13.96 | 362,960.00 |

| | | | |
|--|---------|--------|--------------|
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 14,500 | 41.27 | 598,415.00 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 14,900 | 18.19 | 271,031.00 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 75,800 | 77.13 | 5,846,454.00 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 14,600 | 173.98 | 2,540,108.00 |
| LINAMAR CORP | 4,800 | 53.65 | 257,520.00 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 38,800 | 46.88 | 1,818,944.00 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 21,200 | 33.15 | 702,780.00 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 18,400 | 46.91 | 863,144.00 |
| SHAW COMMUNICATIONS-B | 37,500 | 23.41 | 877,875.00 |
| THOMSON REUTERS CORP | 33,000 | 49.72 | 1,640,760.00 |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A | 7,000 | 114.14 | 798,980.00 |
| DOLLARAMA INC | 11,500 | 74.60 | 857,900.00 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B | 40,100 | 56.69 | 2,273,269.00 |
| EMPIRE CO LTD A | 16,200 | 24.81 | 401,922.00 |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A | 9,400 | 19.53 | 183,582.00 |
| LOBLAW COMPANIES | 21,400 | 64.33 | 1,376,662.00 |
| METRO INC | 23,200 | 40.45 | 938,440.00 |
| WESTON(GEORGE)LTD | 4,800 | 104.06 | 499,488.00 |
| SAPUTO INC | 23,900 | 37.80 | 903,420.00 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 30,600 | 127.00 | 3,886,200.00 |
| BANK OF MONTREAL | 60,700 | 73.18 | 4,442,026.00 |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX | 114,500 | 55.07 | 6,305,515.00 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 37,600 | 89.01 | 3,346,776.00 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 31,500 | 37.60 | 1,184,400.00 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 140,500 | 69.41 | 9,752,105.00 |
| TORONTO DOMINION BANK | 175,500 | 51.88 | 9,104,940.00 |
| ELEMENT FINANCIAL CORP | 36,000 | 13.28 | 478,080.00 |
| ONEX CORP | 8,000 | 79.71 | 637,680.00 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 2,070 | 778.83 | 1,612,178.10 |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 28,000 | 34.15 | 956,200.00 |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 9,900 | 37.33 | 369,567.00 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 12,700 | 85.06 | 1,080,262.00 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 187,600 | 16.63 | 3,119,788.00 |
| | 35,000 | 28.31 | 990,850.00 |

| | | | | |
|-----|------------------------------|---------|--------|------------------------------------|
| | POWER CORPORATION OF CANADA | | | |
| | POWER FINANCIAL CORP | 24,300 | 30.80 | 748,440.00 |
| | SUN LIFE FINANCIAL INC | 57,100 | 39.60 | 2,261,160.00 |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 81,200 | 41.25 | 3,349,500.00 |
| | FIRST CAPITAL REALTY INC | 11,300 | 19.27 | 217,751.00 |
| | CGI GROUP INC - CLASS A | 21,400 | 56.58 | 1,210,812.00 |
| | CONSTELLATION SOFTWARE | 1,790 | 505.00 | 903,950.00 |
| | OPEN TEXT CORP | 11,100 | 67.16 | 745,476.00 |
| | BLACKBERRY LTD | 43,900 | 9.67 | 424,513.00 |
| | BCE INC | 14,100 | 58.12 | 819,492.00 |
| | TELUS CORP | 19,300 | 38.80 | 748,840.00 |
| | ROGERS COMMUNICATIONS-CL B | 34,800 | 48.31 | 1,681,188.00 |
| | FORTIS INC | 25,500 | 36.50 | 930,750.00 |
| | ATCO LTD CL1 | 6,800 | 37.90 | 257,720.00 |
| | CANADIAN UTILITIES LTD A | 12,400 | 34.25 | 424,700.00 |
| | CI FINANCIAL CORP | 22,600 | 28.60 | 646,360.00 |
| | IGM FINANCIAL INC | 8,500 | 33.61 | 285,685.00 |
| 小計 | 銘柄数：90 | | | 123,444,719.25 (10,173,079,313) |
| | 組入時価比率：3.4% | | | 3.6% |
| ユ-ロ | SAIPEM | 549,700 | 0.30 | 169,857.30 |
| | TECHNIP SA | 9,800 | 39.71 | 389,207.00 |
| | TENARIS SA | 46,000 | 9.24 | 425,270.00 |
| | ENI SPA | 241,600 | 11.85 | 2,862,960.00 |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 36,500 | 10.50 | 383,432.50 |
| | NESTE OYJ | 12,500 | 26.85 | 335,625.00 |
| | OMV AG | 14,000 | 23.80 | 333,200.00 |
| | REPSOL SA | 104,318 | 8.77 | 914,868.86 |
| | TOTAL SA | 205,600 | 38.77 | 7,972,140.00 |
| | VOPAK | 7,100 | 40.01 | 284,106.50 |
| | AIR LIQUIDE | 32,300 | 91.83 | 2,966,109.00 |
| | AKZO NOBEL | 23,200 | 52.15 | 1,209,880.00 |
| | ARKEMA | 5,900 | 50.37 | 297,183.00 |
| | BASF SE | 87,000 | 58.36 | 5,077,320.00 |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 13,800 | 26.42 | 364,665.00 |
| | FUCHS PETROLUB SE -PFD | 6,400 | 35.17 | 225,120.00 |

| | | | |
|-----------------------------|--------|--------|--------------|
| K+S AG | 17,300 | 18.16 | 314,168.00 |
| KONINKLIJKE DSM NV | 17,500 | 43.66 | 764,137.50 |
| LANXESS | 8,300 | 34.74 | 288,342.00 |
| LINDE AG | 17,580 | 118.35 | 2,080,593.00 |
| OCI | 8,000 | 14.03 | 112,240.00 |
| SOLVAY SA | 6,800 | 76.25 | 518,500.00 |
| SYMRISE AG | 11,500 | 56.28 | 647,220.00 |
| UMICORE | 8,800 | 37.69 | 331,672.00 |
| CRH PLC | 80,900 | 22.22 | 1,797,598.00 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 13,100 | 64.03 | 838,793.00 |
| IMERYS | 3,000 | 54.27 | 162,810.00 |
| ARCELORMITTAL | 96,000 | 2.96 | 284,640.00 |
| THYSSENKRUPP AG | 33,300 | 13.57 | 451,881.00 |
| VOESTALPINE AG | 11,000 | 26.10 | 287,155.00 |
| STORA ENSO OYJ-R | 54,000 | 7.15 | 386,100.00 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 50,500 | 14.59 | 736,795.00 |
| AIRBUS GROUP SE | 55,400 | 53.78 | 2,979,412.00 |
| FINMECCANICA SPA | 37,000 | 9.19 | 340,030.00 |
| SAFRAN SA | 29,200 | 52.30 | 1,527,160.00 |
| THALES (EX THOMSON-CSF) | 9,900 | 63.98 | 633,402.00 |
| ZODIAC AEROSPACE | 19,500 | 19.16 | 373,620.00 |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD) | 45,500 | 33.86 | 1,540,630.00 |
| ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV | 18,525 | 20.50 | 379,762.50 |
| BOSKALIS WESTMINSTER-CVA | 8,100 | 33.28 | 269,568.00 |
| BOUYGUES | 18,700 | 33.71 | 630,470.50 |
| FERROVIAL SA | 42,892 | 18.19 | 780,419.94 |
| VINCI | 44,900 | 61.39 | 2,756,411.00 |
| LEGRAND SA | 25,300 | 43.80 | 1,108,140.00 |
| OSRAM LICHT AG | 8,850 | 38.51 | 340,813.50 |
| PRYSMIAN SPA | 19,400 | 17.02 | 330,188.00 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 52,800 | 48.03 | 2,535,984.00 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 89,600 | 21.61 | 1,936,256.00 |
| SIEMENS AG | 74,600 | 82.15 | 6,128,390.00 |
| ALSTOM | 20,300 | 20.78 | 421,935.50 |
| ANDRITZ AG | 7,300 | 40.77 | 297,657.50 |

| | | | |
|--|--------|--------|--------------|
| CNH INDUSTRIAL NV | 92,000 | 5.69 | 523,480.00 |
| GEA GROUP AG | 17,500 | 39.41 | 689,675.00 |
| KONE OYJ | 31,900 | 38.30 | 1,221,770.00 |
| MAN SE | 3,200 | 94.03 | 300,896.00 |
| METSO OYJ | 10,400 | 19.34 | 201,136.00 |
| WARTSILA OYJ | 13,600 | 37.26 | 506,736.00 |
| ZARDOYA OTIS S.A | 16,872 | 8.67 | 146,280.24 |
| BRENNTAG AG | 14,290 | 42.20 | 603,038.00 |
| REXEL SA | 28,600 | 9.17 | 262,347.80 |
| BIC | 2,810 | 140.25 | 394,102.50 |
| EDENRED | 18,700 | 14.71 | 275,077.00 |
| BOLLORE | 87,000 | 3.58 | 311,982.00 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 91,800 | 21.16 | 1,942,947.00 |
| TNT EXPRESS NV | 43,000 | 7.91 | 340,345.00 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD) | 22,600 | 12.54 | 283,517.00 |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP | 74,000 | 6.65 | 492,544.00 |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA | 50,200 | 12.98 | 651,847.00 |
| ADP | 2,800 | 105.00 | 294,000.00 |
| AENA SA | 6,500 | 98.45 | 639,925.00 |
| ATLANTIA SPA | 39,300 | 23.19 | 911,367.00 |
| FRAPORT AG | 3,800 | 51.41 | 195,358.00 |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR | 45,000 | 9.64 | 433,935.00 |
| CONTINENTAL AG | 10,350 | 182.75 | 1,891,462.50 |
| MICHELIN B | 17,800 | 84.43 | 1,502,854.00 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 11,300 | 32.65 | 368,945.00 |
| VALEO | 7,630 | 112.85 | 861,045.50 |
| BAYER MOTOREN WERK | 31,100 | 72.82 | 2,264,702.00 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 5,300 | 61.63 | 326,639.00 |
| DAIMLER AG | 91,200 | 62.33 | 5,684,496.00 |
| FERRARI NV | 11,540 | 31.21 | 360,163.40 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 82,400 | 5.58 | 460,204.00 |
| PEUGEOT CITROEN | 40,200 | 12.79 | 514,158.00 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 14,200 | 39.73 | 564,237.00 |
| RENAULT | 18,200 | 74.06 | 1,347,892.00 |
| VOLKSWAGEN AG | 3,450 | 117.75 | 406,237.50 |

| | | | | |
|--|---------|--------|--------------|--|
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 17,430 | 100.15 | 1,745,614.50 | |
| ADIDAS AG | 19,700 | 91.14 | 1,795,458.00 | |
| CHRISTIAN DIOR SE | 5,100 | 157.85 | 805,035.00 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 2,470 | 309.65 | 764,835.50 | |
| HUGO BOSS AG | 6,300 | 66.57 | 419,391.00 | |
| KERING | 7,230 | 154.10 | 1,114,143.00 | |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 15,700 | 51.10 | 802,270.00 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 26,490 | 149.35 | 3,956,281.50 | |
| ACCOR SA | 19,200 | 32.68 | 627,456.00 | |
| PADDY POWER PLC | 8,100 | 117.00 | 947,700.00 | |
| SODEXO | 9,000 | 88.63 | 797,670.00 | |
| ALTICE NV - A | 33,630 | 12.61 | 424,242.45 | |
| ALTICE NV - B | 10,010 | 12.83 | 128,428.30 | |
| AXEL SPRINGER SE | 4,400 | 44.65 | 196,482.00 | |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 16,300 | 28.59 | 466,017.00 | |
| JC DECAUX SA | 6,800 | 33.70 | 229,194.00 | |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG | 2,080 | 115.00 | 239,200.00 | |
| LAGARDERE S.C.A | 11,600 | 25.76 | 298,874.00 | |
| NUMERICABLE-SFR | 9,600 | 31.68 | 304,128.00 | |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE | 20,900 | 44.20 | 923,780.00 | |
| PUBLICIS GROUPE | 17,600 | 57.67 | 1,014,992.00 | |
| RELX NV | 94,000 | 14.34 | 1,348,430.00 | |
| RTL GROUP | 3,900 | 73.35 | 286,065.00 | |
| SES FDR | 31,600 | 22.82 | 721,112.00 | |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 5,200 | 46.62 | 242,424.00 | |
| VIVENDI SA | 110,700 | 17.87 | 1,978,762.50 | |
| WOLTERS KLUWER | 28,900 | 29.93 | 864,977.00 | |
| ZALANDO SE | 8,100 | 27.71 | 224,451.00 | |
| INDITEX SA | 103,600 | 27.22 | 2,819,992.00 | |
| CARREFOUR SUPERMARCHE | 51,900 | 23.29 | 1,208,751.00 | |
| CASINO GUICHARD | 4,900 | 41.21 | 201,953.50 | |
| COLRUYT SA | 7,000 | 48.58 | 340,095.00 | |
| DELHAIZE GROUP | 9,800 | 90.91 | 890,918.00 | |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL | 57,000 | 4.90 | 279,699.00 | |
| JERONIMO MARTINS | 25,200 | 12.47 | 314,244.00 | |

| | | | | |
|---------------------------------|-----------|--------|--------------|--|
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 78,700 | 19.69 | 1,549,996.50 | |
| METRO AG | 16,600 | 23.52 | 390,515.00 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV | 76,000 | 104.40 | 7,934,400.00 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 9,700 | 64.98 | 630,306.00 | |
| HEINEKEN NV | 22,000 | 73.32 | 1,613,040.00 | |
| PERNOD-RICARD | 20,000 | 93.98 | 1,879,600.00 | |
| REMY COINTREAU | 2,300 | 60.71 | 139,633.00 | |
| DANONE | 55,900 | 59.96 | 3,351,764.00 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 15,700 | 72.69 | 1,141,233.00 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 10,000 | 81.86 | 818,600.00 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 16,900 | 95.40 | 1,612,260.00 | |
| BEIERSDORF AG | 9,400 | 81.51 | 766,194.00 | |
| LOREAL-ORD | 23,890 | 154.35 | 3,687,421.50 | |
| UNILEVER NV-CVA | 154,200 | 38.26 | 5,899,692.00 | |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 19,400 | 108.60 | 2,106,840.00 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE | 20,900 | 75.55 | 1,578,995.00 | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 36,300 | 55.09 | 1,999,767.00 | |
| GRIFOLS SA | 28,800 | 18.60 | 535,824.00 | |
| BAYER AG | 78,200 | 95.30 | 7,452,460.00 | |
| MERCK KGAA | 11,900 | 74.85 | 890,715.00 | |
| ORION OYJ | 9,600 | 29.10 | 279,360.00 | |
| SANOFI | 111,700 | 69.45 | 7,757,565.00 | |
| U.C.B. SA | 11,700 | 74.85 | 875,745.00 | |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 226,000 | 0.56 | 127,012.00 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA | 600,242 | 5.61 | 3,368,558.10 | |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD | 3,400,000 | 0.03 | 112,200.00 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 484,505 | 1.45 | 703,501.26 | |
| BANCO POPOLARE SPA | 33,900 | 7.97 | 270,352.50 | |
| BANCO SANTANDER SA | 1,368,815 | 3.60 | 4,931,840.44 | |
| BANK OF IRELAND | 2,740,000 | 0.26 | 720,620.00 | |
| BANKIA SA | 430,000 | 0.76 | 328,520.00 | |
| BANKINTER S.A. | 65,000 | 5.98 | 389,025.00 | |
| BCO POPULAR ESPANOL | 160,916 | 2.11 | 340,337.34 | |
| BNP PARIBAS | 99,800 | 40.30 | 4,021,940.00 | |
| CAIXABANK | 244,409 | 2.57 | 630,330.81 | |

| | | | |
|---------------------------------------|-----------|--------|--------------|
| COMMERZBANK AG | 102,000 | 7.35 | 750,108.00 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 98,000 | 8.38 | 821,632.00 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 26,800 | 24.81 | 664,908.00 |
| ING GROEP NV | 365,000 | 10.20 | 3,724,825.00 |
| INTESA SANPAOLO | 1,197,000 | 2.44 | 2,920,680.00 |
| INTESA SANPAOLO-RSP | 92,000 | 2.29 | 211,232.00 |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD | 139,810 | 0.00 | 0.00 |
| KBC GROUPE NV | 24,000 | 48.35 | 1,160,400.00 |
| NATIXIS | 87,000 | 4.70 | 409,683.00 |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 11,000 | 11.42 | 125,620.00 |
| SOCIETE GENERALE | 68,200 | 29.50 | 2,011,900.00 |
| UNICREDIT SPA | 453,000 | 3.42 | 1,549,260.00 |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA | 90,000 | 3.49 | 314,820.00 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 18,200 | 72.38 | 1,317,316.00 |
| EURAZEO | 3,876 | 50.93 | 197,404.68 |
| EXOR SPA | 9,800 | 27.00 | 264,600.00 |
| GROUPE BRUXELLES LAM | 7,800 | 67.92 | 529,776.00 |
| WENDEL | 2,900 | 83.43 | 241,947.00 |
| AEGON NV | 171,000 | 4.23 | 724,014.00 |
| AGEAS | 18,800 | 33.49 | 629,612.00 |
| ALLIANZ SE | 43,260 | 130.45 | 5,643,267.00 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 110,200 | 11.64 | 1,282,728.00 |
| AXA | 185,500 | 20.02 | 3,713,710.00 |
| CNP ASSURANCES | 16,500 | 11.12 | 183,480.00 |
| HANNOVER RUECK SE | 5,700 | 88.24 | 502,968.00 |
| MAPFRE SA | 93,000 | 1.72 | 160,332.00 |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG) | 15,760 | 168.85 | 2,661,076.00 |
| NN GROUP NV | 23,200 | 27.76 | 644,032.00 |
| SAMPO OYJ-A | 42,100 | 39.41 | 1,659,161.00 |
| SCOR SE | 14,000 | 30.45 | 426,370.00 |
| UNIPOLSAI SPA | 107,000 | 1.80 | 192,814.00 |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR | 31,100 | 24.20 | 752,620.00 |
| IMMOEAST AG-RIGHTS | 50,000 | 0.00 | 0.00 |
| VONOVIA SE | 43,700 | 26.74 | 1,168,538.00 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 11,600 | 42.53 | 493,406.00 |

| | | | |
|--------------------------------------|-----------|--------|--------------|
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS | 41,900 | 35.24 | 1,476,556.00 |
| ATOS SE | 7,900 | 63.23 | 499,517.00 |
| CAP GEMINI SA | 15,300 | 71.32 | 1,091,196.00 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 12,100 | 67.80 | 820,380.00 |
| GEMALTO | 7,600 | 53.42 | 405,992.00 |
| SAP SE | 93,000 | 67.16 | 6,245,880.00 |
| NOKIA OYJ | 401,000 | 5.30 | 2,125,300.00 |
| NOKIA OYJ | 143,000 | 5.31 | 760,188.00 |
| INGENICO GROUP | 5,000 | 100.95 | 504,750.00 |
| ASML HOLDING NV | 32,700 | 74.44 | 2,434,188.00 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 105,000 | 10.79 | 1,132,950.00 |
| STMICROELECTRONICS NV | 57,700 | 4.79 | 276,844.60 |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG | 305,500 | 14.58 | 4,454,190.00 |
| ELISA CORPORATION | 13,700 | 31.33 | 429,221.00 |
| ILIAD SA | 2,440 | 218.60 | 533,384.00 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 298,000 | 3.34 | 995,916.00 |
| ORANGE | 186,400 | 15.38 | 2,866,832.00 |
| PROXIMUS | 13,700 | 30.24 | 414,356.50 |
| TELECOM ITALIA SPA | 1,070,000 | 0.82 | 877,400.00 |
| TELECOM ITALIA-RNC | 570,000 | 0.65 | 370,785.00 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 56,600 | 4.39 | 248,813.60 |
| TELEFONICA SA | 424,617 | 9.14 | 3,880,999.38 |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 22,800 | 11.28 | 257,184.00 |
| ENDESA S.A. | 29,400 | 16.03 | 471,429.00 |
| ENEL SPA | 662,000 | 3.63 | 2,405,708.00 |
| ENERGIAS DE PORTUGAL | 220,000 | 2.78 | 613,140.00 |
| FORTUM OYJ | 40,500 | 11.78 | 477,090.00 |
| IBERDROLA SA | 520,709 | 5.97 | 3,109,153.43 |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 10,200 | 70.97 | 723,894.00 |
| TERNA SPA | 142,000 | 4.66 | 662,856.00 |
| ENAGAS | 19,700 | 25.39 | 500,281.50 |
| GAS NATURAL SDG | 32,800 | 15.66 | 513,812.00 |
| SNAM SPA | 197,000 | 4.87 | 959,390.00 |
| E.ON SE | 188,000 | 8.83 | 1,660,040.00 |
| ENGIE | 137,500 | 13.91 | 1,912,625.00 |

| | | | | | |
|------|-----------------------------|-----------|-------|------------------|--|
| | RWE AG | 46,200 | 11.80 | 545,160.00 | |
| | SUEZ ENVIRONNEMENT SA | 27,000 | 16.52 | 446,175.00 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 41,700 | 20.77 | 866,317.50 | |
| | DEUTSCHE BANK AG-REG | 130,600 | 15.21 | 1,987,079.00 | |
| | MEDIOBANCA SPA-ORD | 53,000 | 6.09 | 322,770.00 | |
| | ENEL GREEN POWER SPA | 160,000 | 1.75 | 280,320.00 | |
| | QIAGEN NV | 20,100 | 18.54 | 372,754.50 | |
| | BUREAU VERITAS SA | 25,500 | 17.11 | 436,432.50 | |
| | RANDSTAD HOLDING NV | 11,800 | 43.20 | 509,760.00 | |
| 小計 | 銘柄数：235 | | | 279,191,660.43 | |
| | | | | (35,524,346,873) | |
| | 組入時価比率：12.0% | | | 12.6% | |
| 英ポンド | AMEC FOSTER WHEELER PLC PLC | 33,200 | 3.51 | 116,830.80 | |
| | PETROFAC LTD | 22,700 | 7.30 | 165,710.00 | |
| | BP PLC | 1,730,000 | 3.37 | 5,837,020.00 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 370,800 | 15.67 | 5,810,436.00 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B | 374,120 | 15.64 | 5,853,107.40 | |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 12,700 | 27.80 | 353,060.00 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 17,850 | 23.51 | 419,653.50 | |
| | REXAM PLC | 65,555 | 5.97 | 391,691.12 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 129,000 | 3.97 | 513,355.50 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 34,900 | 4.40 | 153,769.40 | |
| | BHP BILLITON PLC | 199,300 | 6.93 | 1,381,149.00 | |
| | FRESNILLO PLC | 20,900 | 8.78 | 183,502.00 | |
| | GLENCORE PLC | 1,160,000 | 1.02 | 1,194,220.00 | |
| | RANDGOLD RESOURCES LTD | 9,000 | 60.05 | 540,450.00 | |
| | RIO TINTO PLC-REG | 117,700 | 18.52 | 2,179,804.00 | |
| | MONDI PLC | 34,200 | 12.67 | 433,314.00 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 298,000 | 4.88 | 1,454,240.00 | |
| | COBHAM PLC | 113,000 | 2.44 | 275,720.00 | |
| | MEGGITT PLC | 70,600 | 3.79 | 268,209.40 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 171,000 | 6.31 | 1,079,865.00 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 37,500 | 9.45 | 354,562.50 | |
| | IMI PLC | 25,900 | 8.03 | 207,977.00 | |
| | WEIR GROUP PLC | 18,200 | 9.14 | 166,439.00 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|-------|--------------|--|
| ASSTEAD GROUP PLC | 46,800 | 8.36 | 391,248.00 | |
| BUNZLE | 31,400 | 18.52 | 581,528.00 | |
| TRAVIS PERKINS PLC | 22,600 | 17.50 | 395,500.00 | |
| WOLSELEY PLC | 24,200 | 34.97 | 846,274.00 | |
| AGGREKO PLC | 23,033 | 8.41 | 193,822.69 | |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 21,900 | 8.93 | 195,567.00 | |
| G4S PLC | 152,000 | 1.97 | 300,656.00 | |
| ROYAL MAIL PLC | 88,000 | 4.41 | 388,168.00 | |
| EASYJET PLC | 14,200 | 15.38 | 218,396.00 | |
| GKN PLC | 156,000 | 2.67 | 417,144.00 | |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 91,000 | 5.54 | 504,595.00 | |
| PERSIMMON PLC | 29,500 | 19.52 | 575,840.00 | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 300,000 | 1.73 | 520,200.00 | |
| BURBERRY GROUP PLC | 42,300 | 12.12 | 512,676.00 | |
| CARNIVAL PLC | 17,700 | 31.94 | 565,338.00 | |
| COMPASS GROUP PLC | 155,800 | 12.15 | 1,892,970.00 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 22,900 | 23.06 | 528,074.00 | |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI | 69,000 | 4.15 | 286,350.00 | |
| TUI AG-DI | 46,652 | 10.28 | 479,582.56 | |
| WHITBREAD PLC | 17,500 | 37.78 | 661,150.00 | |
| WILLIAM HILL PLC | 85,000 | 3.80 | 323,000.00 | |
| ITV PLC | 365,000 | 2.44 | 893,885.00 | |
| PEARSON | 79,000 | 7.78 | 615,015.00 | |
| RELX PLC | 106,600 | 11.83 | 1,261,078.00 | |
| SKY PLC | 96,100 | 10.06 | 966,766.00 | |
| WPP PLC | 121,700 | 14.42 | 1,754,914.00 | |
| MARKS & SPENCER PLC | 155,000 | 4.28 | 664,795.00 | |
| NEXT PLC | 13,500 | 68.95 | 930,825.00 | |
| DIXONS CARPHONE PLC | 92,000 | 4.30 | 396,152.00 | |
| KINGFISHER PLC | 217,000 | 3.33 | 724,346.00 | |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL | 25,300 | 3.94 | 99,707.30 | |
| MORRISON SUPERMARKETS | 213,000 | 1.78 | 379,566.00 | |
| SAINSBURY | 123,800 | 2.49 | 309,004.80 | |
| TESCO PLC | 767,000 | 1.80 | 1,384,818.50 | |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 19,800 | 13.44 | 266,112.00 | |

| | | | |
|-------------------------------|-----------|-------|--------------|
| DIAGEO PLC | 238,200 | 18.11 | 4,314,993.00 |
| SABMILLER PLC | 91,900 | 41.75 | 3,836,825.00 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 33,100 | 31.53 | 1,043,643.00 |
| TATE & LYLE ORD. | 42,500 | 5.47 | 232,475.00 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 176,300 | 38.44 | 6,776,972.00 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 90,700 | 36.94 | 3,350,458.00 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 60,600 | 64.10 | 3,884,460.00 |
| UNILEVER PLC | 121,600 | 30.15 | 3,666,240.00 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 85,800 | 11.12 | 954,096.00 |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 37,500 | 8.91 | 334,125.00 |
| ASTRAZENECA PLC | 119,700 | 41.84 | 5,008,248.00 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 460,300 | 14.17 | 6,524,752.50 |
| SHIRE PLC | 55,900 | 37.40 | 2,090,660.00 |
| BARCLAYS PLC | 1,582,000 | 1.61 | 2,554,139.00 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 1,849,000 | 4.48 | 8,287,218.00 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 5,410,000 | 0.60 | 3,275,755.00 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 325,000 | 2.50 | 812,500.00 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 307,428 | 4.28 | 1,318,404.97 |
| LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC | 30,200 | 23.40 | 706,680.00 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 19,800 | 17.00 | 336,600.00 |
| AVIVA PLC | 380,000 | 4.29 | 1,631,340.00 |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 128,083 | 3.65 | 468,527.61 |
| LEGAL & GENERAL | 560,000 | 2.11 | 1,185,520.00 |
| OLD MUTUAL PLC | 468,000 | 1.66 | 779,220.00 |
| PRUDENTIAL PLC | 242,300 | 11.83 | 2,867,620.50 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 98,750 | 4.00 | 395,098.75 |
| ST JAMES S PLACE PLC | 49,900 | 8.60 | 429,140.00 |
| STANDARD LIFE PLC | 186,000 | 3.41 | 635,376.00 |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 74,000 | 3.61 | 267,362.00 |
| SAGE GROUP PLC (THE) | 100,000 | 5.64 | 564,000.00 |
| ARM HOLDINGS PLC | 134,000 | 8.98 | 1,203,320.00 |
| BT GROUP PLC | 793,000 | 4.56 | 3,616,080.00 |
| INMARSAT PLC | 42,500 | 9.71 | 412,887.50 |
| VODAFONE GROUP PLC | 2,513,000 | 2.11 | 5,302,430.00 |
| SSE PLC | 92,600 | 13.58 | 1,257,508.00 |

| | | | | | |
|--------|-------------------------------|---------|----------|------------------|--|
| | CENTRICA PLC | 470,000 | 1.91 | 900,990.00 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 354,800 | 9.55 | 3,390,114.00 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 22,100 | 21.24 | 469,404.00 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 63,800 | 9.18 | 585,684.00 | |
| | PROVIDENT FINANCIAL PLC | 14,300 | 30.92 | 442,156.00 | |
| | 3I GROUP PLC | 90,000 | 4.09 | 368,460.00 | |
| | ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC | 83,000 | 2.26 | 187,995.00 | |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 25,000 | 11.82 | 295,500.00 | |
| | ICAP PLC | 54,000 | 4.04 | 218,538.00 | |
| | INVESTEC PLC | 55,000 | 4.51 | 248,545.00 | |
| | SCHRODERS PLC | 11,800 | 23.89 | 281,902.00 | |
| | CAPITA PLC | 64,000 | 10.99 | 703,360.00 | |
| | EXPERIAN PLC | 91,900 | 11.26 | 1,034,794.00 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 15,100 | 27.67 | 417,817.00 | |
| 小計 | 銘柄数：107 | | | 140,629,083.30 | |
| | | | | (22,970,354,466) | |
| | 組入時価比率：7.8% | | | 8.1% | |
| スイスフラン | TRANSOCEAN LTD | 35,500 | 8.56 | 304,057.50 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 730 | 452.50 | 330,325.00 | |
| | GIVAUDAN-REG | 864 | 1,824.00 | 1,575,936.00 | |
| | SIKA AG-BR | 209 | 3,679.00 | 768,911.00 | |
| | SYNGENTA AG | 8,720 | 398.50 | 3,474,920.00 | |
| | LAFARGEHOLCIM LTD | 43,100 | 36.24 | 1,561,944.00 | |
| | GEBERIT AG-REG | 3,520 | 358.10 | 1,260,512.00 | |
| | ABB LTD | 206,200 | 17.19 | 3,544,578.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 1,930 | 160.00 | 308,800.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 4,310 | 160.60 | 692,186.00 | |
| | SULZER AG-REG | 1,300 | 90.05 | 117,065.00 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 5,250 | 130.00 | 682,500.00 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A | 49,000 | 64.70 | 3,170,300.00 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 2,950 | 340.50 | 1,004,475.00 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 4,600 | 66.55 | 306,130.00 | |
| | DUFREY AG-REG | 3,560 | 97.55 | 347,278.00 | |
| | ARYZTA AG | 8,500 | 44.51 | 378,335.00 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG | 190 | 1,059.00 | 201,210.00 | |

| | | | | |
|---------------|----------------------------------|---------|-----------|-----------------------------------|
| | LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 95 | 5,570.00 | 529,150.00 |
| | LINDT&SPRUENGLI AG-REG | 10 | 67,200.00 | 672,000.00 |
| | NESTLE SA-REG | 301,200 | 73.05 | 22,002,660.00 |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 5,030 | 116.20 | 584,486.00 |
| | ACTELION LTD | 9,770 | 133.70 | 1,306,249.00 |
| | GALENICA AG-REG | 368 | 1,329.00 | 489,072.00 |
| | NOVARTIS-REG | 215,000 | 72.30 | 15,544,500.00 |
| | ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE) | 66,390 | 248.50 | 16,497,915.00 |
| | PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES | 3,200 | 57.40 | 183,680.00 |
| | BALOISE HOLDING AG | 4,600 | 118.30 | 544,180.00 |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 2,980 | 230.60 | 687,188.00 |
| | SWISS RE LTD | 33,200 | 89.15 | 2,959,780.00 |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 14,110 | 209.30 | 2,953,223.00 |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 6,300 | 81.20 | 511,560.00 |
| | SWISSCOM AG-REG | 2,460 | 479.00 | 1,178,340.00 |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 169,600 | 13.26 | 2,248,896.00 |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 20,700 | 39.69 | 821,583.00 |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,530 | 345.25 | 528,232.50 |
| | UBS GROUP AG | 346,400 | 14.67 | 5,081,688.00 |
| | LONZA AG-REG | 5,020 | 140.50 | 705,310.00 |
| | ADECCO SA-REG | 15,500 | 55.50 | 860,250.00 |
| | SGS SA-REG | 523 | 1,932.00 | 1,010,436.00 |
| 小計 | 銘柄数：40 | | | 97,929,841.00 (11,318,731,022) |
| | 組入時価比率：3.8% | | | 4.0% |
| スウェーデン ローナ | LUNDIN PETROLEUM AB | 20,100 | 127.90 | 2,570,790.00 |
| | BOLIDEN AB | 26,000 | 116.90 | 3,039,400.00 |
| | ASSA ABLOY AB-B | 94,400 | 155.70 | 14,698,080.00 |
| | SKANSKA AB-B SHS | 35,500 | 169.00 | 5,999,500.00 |
| | ALFA LAVAL AB | 27,700 | 132.70 | 3,675,790.00 |
| | ATLAS COPCO AB-A | 62,800 | 185.00 | 11,618,000.00 |
| | ATLAS COPCO AB-B | 36,200 | 172.90 | 6,258,980.00 |
| | SANDVIK AB | 103,000 | 77.20 | 7,951,600.00 |
| | SKF AB-B SHARES | 38,800 | 143.60 | 5,571,680.00 |
| | VOLVO AB-B SHS | 146,000 | 82.70 | 12,074,200.00 |

| | | | | | |
|---------------|---|---------|--------|-----------------|--|
| | SECURITAS AB-B SHS | 29,400 | 118.40 | 3,480,960.00 | |
| | ELECTROLUX AB-B | 23,300 | 187.50 | 4,368,750.00 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 38,000 | 52.85 | 2,008,300.00 | |
| | HENNES&MAURITZ AB-B | 89,100 | 275.50 | 24,547,050.00 | |
| | ICA GRUPPEN AB | 7,800 | 247.50 | 1,930,500.00 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 18,900 | 287.70 | 5,437,530.00 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB-B | 56,300 | 246.40 | 13,872,320.00 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 19,100 | 181.10 | 3,459,010.00 | |
| | NORDEA BANK AB | 287,000 | 83.20 | 23,878,400.00 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 142,000 | 82.25 | 11,679,500.00 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A | 142,000 | 109.20 | 15,506,400.00 | |
| | SWEDBANK AB | 86,500 | 165.20 | 14,289,800.00 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 16,800 | 130.60 | 2,194,080.00 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 43,100 | 271.00 | 11,680,100.00 | |
| | KINNEVIK INVESTMENT AB-B | 21,900 | 200.20 | 4,384,380.00 | |
| | ERICSSON LM-B | 287,000 | 76.35 | 21,912,450.00 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 24,400 | 276.40 | 6,744,160.00 | |
| | TELIA AB | 241,000 | 38.90 | 9,374,900.00 | |
| | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR- SDR | 6,100 | 364.40 | 2,222,840.00 | |
| | TELE 2 AB-B SHS | 28,400 | 69.00 | 1,959,600.00 | |
| 小計 | 銘柄数：30 | | | 258,389,050.00 | |
| | | | | (3,470,164,941) | |
| | 組入時価比率：1.2% | | | 1.2% | |
| ノルウェーク ローネ | STATOIL ASA | 105,500 | 117.00 | 12,343,500.00 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 16,800 | 319.00 | 5,359,200.00 | |
| | NORSK HYDRO | 130,000 | 28.71 | 3,732,300.00 | |
| | SCHIBSTED ASA | 6,400 | 235.30 | 1,505,920.00 | |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 9,100 | 222.00 | 2,020,200.00 | |
| | ORKLA ASA | 74,800 | 69.90 | 5,228,520.00 | |
| | DNB ASA | 91,600 | 96.15 | 8,807,340.00 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 19,700 | 132.20 | 2,604,340.00 | |
| | TELENOR ASA | 71,900 | 119.80 | 8,613,620.00 | |
| 小計 | 銘柄数：9 | | | 50,214,940.00 | |
| | | | | (665,347,955) | |

| | 組入時価比率：0.2% | | | 0.2% |
|---------------|-----------------------------|---------|--------------|-----------------------------------|
| デンマーク ローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 9,300 | 399.60 | 3,716,280.00 |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 22,500 | 284.50 | 6,401,250.00 |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 20,700 | 429.00 | 8,880,300.00 |
| | ISS A/S | 14,100 | 232.80 | 3,282,480.00 |
| | A P MOLLER - MAERSK A/S-A | 375 | 8,050.00 | 3,018,750.00 |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S | 660 | 8,225.00 | 5,428,500.00 |
| | DSV A/S | 18,200 | 264.90 | 4,821,180.00 |
| | PANDORA A/S | 10,420 | 816.50 | 8,507,930.00 |
| | CARLSBERG B | 10,000 | 604.50 | 6,045,000.00 |
| | COLOPLAST-B | 10,500 | 510.00 | 5,355,000.00 |
| | WILLIAM DEMANT HOLDING | 2,100 | 566.00 | 1,188,600.00 |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 185,300 | 331.50 | 61,426,950.00 |
| | DANSKE BANK AS | 67,000 | 187.00 | 12,529,000.00 |
| | TRYG A/S | 11,800 | 120.80 | 1,425,440.00 |
| | TDC A/S | 76,800 | 29.26 | 2,247,168.00 |
| 小計 | 銘柄数：15 | | | 134,273,828.00 (2,289,368,767) |
| | 組入時価比率：0.8% | | | 0.8% |
| 豪ドル | CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 25,500 | 35.40 | 902,700.00 |
| | OIL SEARCH LTD | 130,000 | 7.33 | 952,900.00 |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 160,000 | 3.96 | 633,600.00 |
| | SANTOS LTD. | 147,000 | 3.41 | 501,270.00 |
| | WOODSIDE PETROLEUM | 71,100 | 29.54 | 2,100,294.00 |
| | INCITEC PIVOT LTD | 161,000 | 2.86 | 460,460.00 |
| | ORICA LTD | 32,600 | 13.37 | 435,862.00 |
| | BORAL LTD | 67,000 | 5.80 | 388,600.00 |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 44,000 | 16.50 | 726,000.00 |
| | AMCOR | 113,000 | 13.58 | 1,534,540.00 |
| | ALUMINA LTD | 233,000 | 1.21 | 281,930.00 |
| | BHP BILLITON LIMITED | 304,400 | 16.59 | 5,049,996.00 |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 142,000 | 1.87 | 266,250.00 |
| | ILUKA RESOURCES LTD | 37,800 | 6.73 | 254,394.00 |
| | NEWCREST MINING | 72,000 | 15.30 | 1,101,600.00 |
| RIO TINTO LTD | 39,300 | 43.20 | 1,697,760.00 | |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|
| SOUTH32 LTD | 500,000 | 1.21 | 607,500.00 |
| CIMIC GROUP LTD | 8,938 | 27.96 | 249,906.48 |
| BRAMBLES LTD | 149,000 | 10.82 | 1,612,180.00 |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 44,133 | 3.92 | 173,001.36 |
| ASCIANO LTD | 61,000 | 8.90 | 542,900.00 |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 193,000 | 3.67 | 708,310.00 |
| SYDNEY AIRPORT | 107,900 | 6.47 | 698,113.00 |
| TRANSURBAN GROUP | 189,004 | 10.91 | 2,062,033.64 |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 52,000 | 9.66 | 502,320.00 |
| CROWN RESORTS LTD | 36,000 | 11.68 | 420,480.00 |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 5,200 | 39.19 | 203,788.00 |
| TABCORP HOLDINGS | 78,000 | 4.21 | 328,380.00 |
| TATTS GROUP LTD | 131,000 | 3.96 | 518,760.00 |
| REA GROUP LTD | 5,400 | 51.08 | 275,832.00 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 53,000 | 4.43 | 234,790.00 |
| WESFARMERS LIMITED | 106,100 | 43.13 | 4,576,093.00 |
| WOOLWORTHS LIMITED | 120,000 | 22.83 | 2,739,600.00 |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 52,000 | 8.45 | 439,400.00 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 72,000 | 8.72 | 627,840.00 |
| COCHLEAR LTD | 5,200 | 106.67 | 554,684.00 |
| HEALTHSCOPE LTD | 176,000 | 2.17 | 381,920.00 |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 13,100 | 58.61 | 767,791.00 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 37,300 | 18.13 | 676,249.00 |
| CSL LIMITED | 43,600 | 106.00 | 4,621,600.00 |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK | 272,600 | 23.27 | 6,343,402.00 |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 35,115 | 11.04 | 387,669.60 |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 44,300 | 8.80 | 389,840.00 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 160,700 | 72.60 | 11,666,820.00 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK | 249,000 | 24.98 | 6,220,020.00 |
| WESTPAC BANKING CORP | 314,500 | 28.97 | 9,111,065.00 |
| ASX LTD | 18,200 | 41.00 | 746,200.00 |
| CHALLENGER LIMITED | 56,000 | 7.18 | 402,080.00 |
| AMP LIMITED | 285,000 | 5.21 | 1,484,850.00 |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | 232,000 | 5.25 | 1,218,000.00 |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | 261,000 | 2.51 | 655,110.00 |

| | | | | | |
|------------|------------------------------|---------|-------|-----------------|--|
| | QBE INSURANCE | 127,000 | 10.01 | 1,271,270.00 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 120,000 | 11.46 | 1,375,200.00 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 47,000 | 9.26 | 435,220.00 | |
| | TELSTRA CORP LTD | 404,000 | 5.42 | 2,189,680.00 | |
| | TPG TELECOM LTD | 27,000 | 9.96 | 268,920.00 | |
| | VOCUS COMMUNICATIONS LTD | 43,000 | 7.99 | 343,570.00 | |
| | AUSNET SERVICES | 163,400 | 1.47 | 241,015.00 | |
| | APA GROUP | 107,000 | 8.75 | 936,250.00 | |
| | AGL ENERGY LTD | 64,500 | 18.45 | 1,190,025.00 | |
| | DUET GROUP | 229,000 | 2.31 | 528,990.00 | |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 27,900 | 63.24 | 1,764,396.00 | |
| | PLATINUM ASSET MANAGEMENT | 25,000 | 6.14 | 153,500.00 | |
| | SEEK LTD | 28,800 | 12.83 | 369,504.00 | |
| 小計 | 銘柄数：64 | | | 91,504,224.08 | |
| | | | | (7,436,548,290) | |
| | 組入時価比率：2.5% | | | 2.6% | |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 69,000 | 6.85 | 472,650.00 | |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 88,110 | 5.80 | 511,038.00 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 35,000 | 8.03 | 281,050.00 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 170,000 | 3.25 | 552,500.00 | |
| | CONTACT ENERGY LTD | 76,000 | 4.45 | 338,200.00 | |
| | MIGHTY RIVER POWER | 60,000 | 2.73 | 163,800.00 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 120,000 | 2.29 | 275,400.00 | |
| 小計 | 銘柄数：7 | | | 2,594,638.00 | |
| | | | | (195,090,831) | |
| | 組入時価比率：0.1% | | | 0.1% | |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 253,540 | 94.90 | 24,060,946.00 | |
| | NWS HOLDINGS LTD | 135,500 | 11.00 | 1,490,500.00 | |
| | CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 107,000 | 11.90 | 1,273,300.00 | |
| | MTR CORP | 139,500 | 36.00 | 5,022,000.00 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 128,000 | 27.25 | 3,488,000.00 | |
| | LI & FUNG LTD | 563,600 | 4.49 | 2,530,564.00 | |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 75,000 | 26.70 | 2,002,500.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 223,000 | 24.65 | 5,496,950.00 | |
| | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 78,000 | 9.25 | 721,500.00 | |

| | | | | | |
|------------------------------------|----------------------------|---------|-----------------|------------|--|
| SANDS CHINA LTD | 234,800 | 25.60 | 6,010,880.00 | | |
| SHANGRI-LA ASIA LTD | 108,333 | 7.07 | 765,914.31 | | |
| SJM HOLDINGS LIMITED | 166,000 | 5.30 | 879,800.00 | | |
| WYNN MACAU LTD | 132,400 | 8.51 | 1,126,724.00 | | |
| WH GROUP LIMITED | 590,000 | 4.24 | 2,501,600.00 | | |
| BANK OF EAST ASIA | 107,860 | 22.25 | 2,399,885.00 | | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 345,500 | 19.74 | 6,820,170.00 | | |
| HANG SENG BANK | 73,000 | 126.10 | 9,205,300.00 | | |
| FIRST PACIFIC CO | 226,000 | 5.49 | 1,240,740.00 | | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 107,000 | 169.00 | 18,083,000.00 | | |
| AIA GROUP LTD | 1,141,400 | 38.55 | 44,000,970.00 | | |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 255,540 | 40.70 | 10,400,478.00 | | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 213,000 | 13.60 | 2,896,800.00 | | |
| HENDERSON LAND | 111,017 | 40.95 | 4,546,146.15 | | |
| HYSAN DEVELOPMENT | 65,000 | 30.15 | 1,959,750.00 | | |
| KERRY PROPERTIES | 57,000 | 18.34 | 1,045,380.00 | | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 516,666 | 6.14 | 3,172,329.24 | | |
| SINO LAND CO.LTD | 286,000 | 10.38 | 2,968,680.00 | | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 164,000 | 84.10 | 13,792,400.00 | | |
| SWIRE PACIFIC-A | 53,500 | 74.80 | 4,001,800.00 | | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 116,800 | 19.50 | 2,277,600.00 | | |
| WHARF(HOLDING) | 133,000 | 37.55 | 4,994,150.00 | | |
| WHEELLOCK & COMPANY LTD | 87,000 | 29.05 | 2,527,350.00 | | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 21,900 | 61.00 | 1,335,900.00 | | |
| HKT TRUST AND HKT LTD | 259,600 | 10.48 | 2,720,608.00 | | |
| PCCW LTD | 386,000 | 4.67 | 1,802,620.00 | | |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 60,000 | 75.00 | 4,500,000.00 | | |
| CLP HLDGS | 180,500 | 66.70 | 12,039,350.00 | | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 130,000 | 72.40 | 9,412,000.00 | | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 662,554 | 13.90 | 9,209,500.60 | | |
| 小計 銘柄数：39 | | | 234,724,085.30 | | |
| | | | (3,443,402,331) | | |
| | | | | 1.2% | |
| 組入時価比率：1.2% | | | | | |
| シンガポールド ル | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 141,000 | 2.74 | 386,340.00 | |

| | | | | | |
|------|--------------------------------------|---------|--------|-----------------|--|
| | KEPPEL CORP. | 142,700 | 5.20 | 742,040.00 | |
| | SEBNCORP INDUSTRIES | 99,040 | 2.51 | 248,590.40 | |
| | SEBNCORP MARINE | 72,600 | 1.57 | 113,982.00 | |
| | YANGZIJANG SHIPBUILDING | 163,000 | 0.95 | 155,665.00 | |
| | NOBLE GROUP LTD | 412,481 | 0.33 | 138,181.13 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 49,040 | 11.21 | 549,738.40 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 207,000 | 3.01 | 623,070.00 | |
| | GENTING SINGAPORE PLC | 614,600 | 0.69 | 424,074.00 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 151,000 | 3.76 | 567,760.00 | |
| | JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD | 11,800 | 40.32 | 475,776.00 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 615,320 | 0.37 | 230,745.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 184,000 | 3.10 | 570,400.00 | |
| | DBS GROUP HLDGS | 166,000 | 13.68 | 2,270,880.00 | |
| | OCBC-ORD | 289,500 | 7.77 | 2,249,415.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK | 121,500 | 17.81 | 2,163,915.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 77,000 | 7.18 | 552,860.00 | |
| | CAPITALAND LIMITED | 246,000 | 2.90 | 713,400.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 37,000 | 6.93 | 256,410.00 | |
| | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 294,000 | 1.65 | 485,100.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 48,700 | 5.63 | 274,181.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 751,000 | 3.80 | 2,853,800.00 | |
| | STARHUB LTD | 53,000 | 3.80 | 201,400.00 | |
| 小計 | 銘柄数：23 | | | 17,247,722.93 | |
| | | | | (1,401,205,010) | |
| | 組入時価比率：0.5% | | | 0.5% | |
| 新シケル | DELEK GROUP LTD | 470 | 642.00 | 301,740.00 | |
| | ISRAEL CHEMICALS LIMITED | 44,000 | 15.34 | 674,960.00 | |
| | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 86,100 | 220.90 | 19,019,490.00 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 102,000 | 18.20 | 1,856,400.00 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 138,000 | 12.43 | 1,715,340.00 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 13,000 | 42.99 | 558,870.00 | |
| | AZRIELI GROUP | 3,100 | 142.50 | 441,750.00 | |
| | NICE SYSTEMS LTD | 5,300 | 225.80 | 1,196,740.00 | |
| | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP | 186,000 | 8.46 | 1,574,862.00 | |
| 小計 | 銘柄数：9 | | | 27,340,152.00 | |

| | | | | | |
|--|----|-------------|--|-------------------|--|
| | | | | (800,793,052) | |
| | | 組入時価比率：0.3% | | 0.3% | |
| | 合計 | | | 282,595,761,993 | |
| | | | | (282,595,761,993) | |

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額/口数 | 評価額 | 備考 |
|-------------------|--------|-------------------------------|---------|--------------|--------------|
| 投資信託受益証券 | 米ドル | HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | | 218,870.00 | |
| | 小計 | 銘柄数：1 | | 218,870.00 | |
| | | 組入時価比率：0.0% | | (25,014,652) | 0.3% |
| | 合計 | | | 25,014,652 | (25,014,652) |
| 投資証券 | 米ドル | AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | 34,100 | 605,275.00 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 39,900 | 3,449,355.00 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 91,000 | 894,530.00 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 12,660 | 2,093,584.20 | |
| | | BOSTON PROPERTIES | 14,300 | 1,577,147.00 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 17,300 | 401,706.00 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 8,300 | 610,714.00 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 31,600 | 2,654,400.00 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 12,600 | 1,013,040.00 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 31,600 | 625,048.00 | |
| | | EQUINIX INC | 6,320 | 1,841,016.00 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 34,400 | 2,482,992.00 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 6,300 | 1,251,369.00 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 11,000 | 912,780.00 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 6,520 | 970,893.20 | |
| | | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 54,400 | 1,396,992.00 | |
| | | HCP INC | 44,000 | 1,184,480.00 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 70,800 | 1,050,672.00 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 19,000 | 543,970.00 | | | |

| | | | | |
|-------|------------------------------------|-----------|-----------------|--|
| | KIMCO REALTY CORP | 38,700 | 1,026,324.00 | |
| | LIBERTY PROPERTY TRUST | 13,300 | 381,045.00 | |
| | MACERICH CO /THE | 12,600 | 951,300.00 | |
| | PLUM CREEK TIMBER CO | 17,000 | 645,490.00 | |
| | PROLOGIS INC | 49,400 | 1,835,704.00 | |
| | PUBLIC STORAGE | 13,790 | 3,284,502.20 | |
| | REALTY INCOME CORP | 22,300 | 1,333,986.00 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 8,800 | 621,896.00 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 29,310 | 5,461,918.50 | |
| | SL GREEN REALTY CORP | 9,300 | 769,389.00 | |
| | UDR INC | 24,100 | 816,026.00 | |
| | VENTAS INC | 30,900 | 1,536,348.00 | |
| | VEREIT INC | 88,000 | 659,120.00 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 16,000 | 1,318,720.00 | |
| | WELLTOWER INC | 32,800 | 1,835,488.00 | |
| | WEYERHAEUSER CO | 48,800 | 1,159,976.00 | |
| 小計 | 銘柄数：35 | 1,001,200 | 49,197,196.10 | |
| | | | (5,622,747,542) | |
| | 組入時価比率：1.9% | | 73.5% | |
| カナダドル | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 13,600 | 255,544.00 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 14,400 | 358,128.00 | |
| | SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 6,900 | 206,862.00 | |
| 小計 | 銘柄数：3 | 34,900 | 820,534.00 | |
| | | | (67,620,206) | |
| | 組入時価比率：0.0% | | 0.9% | |
| ユーロ | FONCIERE DES REGIONS | 3,100 | 224,657.00 | |
| | GECINA SA | 3,400 | 372,810.00 | |
| | ICADE | 3,000 | 183,390.00 | |
| | KLEPIERRE | 21,200 | 789,594.00 | |
| | UNIBAIL RODAMCO-NA | 9,390 | 2,067,208.50 | |
| 小計 | 銘柄数：5 | 40,090 | 3,637,659.50 | |
| | | | (462,855,794) | |
| | 組入時価比率：0.2% | | 6.1% | |
| 英ポンド | BRITISH LAND | 94,000 | 635,440.00 | |
| | HAMMERSON PLC | 73,000 | 404,055.00 | |

| | | | | |
|----------|------------------------------|---------|---------------|-----------------|
| 小計 | INTU PROPERTIES PLC | 88,000 | 249,040.00 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 73,800 | 750,546.00 | |
| | SEGRO PLC | 70,000 | 293,160.00 | |
| | 銘柄数：5 | 398,800 | 2,332,241.00 | (380,948,244) |
| | 組入時価比率：0.1% | | | 5.0% |
| 豪ドル | DEXUS PROPERTY GROUP | 92,000 | 694,600.00 | |
| | GOODMAN GROUP | 163,000 | 1,051,350.00 | |
| | GPT GROUP | 165,000 | 826,650.00 | |
| | LENDLEASE GROUP | 53,000 | 650,310.00 | |
| | MIRVAC GROUP | 350,000 | 649,250.00 | |
| | SCENTRE GROUP | 496,000 | 2,251,840.00 | |
| | STOCKLAND TRUST GROUP | 230,000 | 933,800.00 | |
| | VICINITY CENTRES | 306,704 | 929,313.12 | |
| | WESTFIELD CORP | 187,000 | 1,832,600.00 | |
| | 小計 | 銘柄数：9 | 2,042,704 | 9,819,713.12 |
| | 組入時価比率：0.3% | | | 10.4% |
| 香港ドル | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 260,000 | 1,677,000.00 | |
| | LINK REIT | 210,000 | 9,030,000.00 | |
| 小計 | 銘柄数：2 | 470,000 | 10,707,000.00 | (157,071,690) |
| | 組入時価比率：0.1% | | | 2.1% |
| シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 213,000 | 506,940.00 | |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 192,000 | 264,960.00 | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 219,900 | 461,790.00 | |
| | SUNTEC REIT | 243,000 | 392,445.00 | |
| | 小計 | 銘柄数：4 | 867,900 | 1,626,135.00 |
| | 組入時価比率：0.0% | | | 1.7% |
| 合計 | | | 7,621,398,768 | (7,621,398,768) |
| 合計 | | | 7,646,413,420 | (7,646,413,420) |

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 平成28年 2月17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 | 5,729,538,686 | - | 5,640,283,031 | 89,255,655 |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 売建 | 42,688,600 | - | 42,524,000 | 164,600 |
| 米ドル | 34,368,600 | - | 34,284,000 | 84,600 |
| カナダドル | 8,320,000 | - | 8,240,000 | 80,000 |
| 合計 | - | - | - | 89,091,055 |

(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。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 999,921,709 |
| コール・ローン | 42,247,444 |
| 国債証券 | 629,732,479,193 |
| 派生商品評価勘定 | 1,971,764 |
| 未収入金 | 888,690,121 |
| 未収利息 | 5,732,909,342 |
| 前払費用 | 467,800,011 |
| 流動資産合計 | 637,866,019,584 |
| 資産合計 | 637,866,019,584 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 593,950 |
| 未払金 | 1,349,456,853 |
| 未払解約金 | 619,679,750 |
| その他未払費用 | 9,216,200 |
| 流動負債合計 | 1,978,946,753 |
| 負債合計 | 1,978,946,753 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 284,045,302,199 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 351,841,770,632 |
| 元本等合計 | 635,887,072,831 |
| 純資産合計 | 635,887,072,831 |
| 負債純資産合計 | 637,866,019,584 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年 2月17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 | 2,2387円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (22,387円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17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>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年 2月17日現在 |
|--|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>国債証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており</p> <p>ます。</p> |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 平成28年 2月17日現在 | |
|------------------------------------|------------------|
| 期首 | 平成27年 2月18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 | 202,645,501,722円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 110,486,426,186円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 29,086,625,709円 |
| 期末元本額 | 284,045,302,199円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 82,177,177円 |
| バランスセレクト50 | 85,952,090円 |
| バランスセレクト70 | 64,533,575円 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 282,689,441円 |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース） | 1,589,877,995円 |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース） | 29,598,435,768円 |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース） | 1,439,690,199円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 44,789,624円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 51,762,498円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 43,372,729円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 37,239,090円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 24,168,464円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 68,992,687円 |
| 野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け） | 174,126,989,729円 |
| のむらっぴ・ファンド（保守型） | 3,321,571,166円 |
| のむらっぴ・ファンド（普通型） | 5,458,235,034円 |
| のむらっぴ・ファンド（積極型） | 1,311,682,202円 |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA向け） | 2,323,951,101円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 5,225,503円 |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 537,772,480円 |
| マイ・ロード | 7,506,929,580円 |
| ネクストコア | 541,686,561円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 75,579,184円 |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA・EW向け） | 1,982,471,670円 |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース） | 741,430,370円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 1,116,992円 |
| 野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用） | 43,588,415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） | 2,796,766,749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） | 637,179,373円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 9,723,472,747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） | 1,671,807,984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） | 7,662,479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） | 36,140,409円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用） | 4,378,940円 |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 6,811,997,808円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用） | 510,345,700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） | 1,855,423,699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） | 202,558,692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） | 100,357,066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） | 228,759,372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） | 2,061,299,103円 |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用） | 1,086,098,829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） | 1,137,169,359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） | 118,503,718円 |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け） | 4,486,822円 |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け） | 6,893,621円 |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け） | 4,731,916円 |
| 野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け） | 518,164,100円 |
| マイバランス30（確定拠出年金向け） | 1,738,915,112円 |
| マイバランス50（確定拠出年金向け） | 2,342,752,600円 |
| マイバランス70（確定拠出年金向け） | 2,161,942,945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） | 12,074,223,183円 |
| マイバランスDC30 | 926,349,445円 |
| マイバランスDC50 | 531,496,969円 |
| マイバランスDC70 | 329,778,737円 |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 2,352,994,360円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 653,115,361円 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 5,427,640円 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 3,771,964円 |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け） | 8,243,251円 |
| マイターゲット2030（確定拠出年金向け） | 58,791円 |
| マイターゲット2040（確定拠出年金向け） | 122,031円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|-----|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY BOND | 4,000,000.00 | 4,404,843.60 | |
| | | US TREASURY BOND | 10,500,000.00 | 12,987,187.50 | |
| | | US TREASURY BOND | 9,300,000.00 | 11,581,406.25 | |
| | | US TREASURY BOND | 12,700,000.00 | 16,907,866.87 | |
| | | US TREASURY BOND | 18,500,000.00 | 25,307,420.95 | |

| | | | |
|------------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY BOND | 19,400,000.00 | 25,856,562.50 | |
| US TREASURY BOND | 31,200,000.00 | 32,896,500.00 | |
| US TREASURY BOND | 34,500,000.00 | 47,801,364.60 | |
| US TREASURY BOND | 8,800,000.00 | 12,799,187.28 | |
| US TREASURY BOND | 17,700,000.00 | 25,575,115.86 | |
| US TREASURY BOND | 3,500,000.00 | 4,875,117.10 | |
| US TREASURY BOND | 7,000,000.00 | 9,588,359.20 | |
| US TREASURY BOND | 2,800,000.00 | 3,845,406.04 | |
| US TREASURY BOND | 2,200,000.00 | 2,981,859.32 | |
| US TREASURY BOND | 21,700,000.00 | 22,913,843.75 | |
| US TREASURY BOND | 16,600,000.00 | 20,687,750.00 | |
| US TREASURY N/B | 8,500,000.00 | 8,505,644.00 | |
| US TREASURY N/B | 12,500,000.00 | 12,811,035.00 | |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,030,078.00 | |
| US TREASURY N/B | 7,100,000.00 | 7,111,370.65 | |
| US TREASURY N/B | 14,500,000.00 | 14,924,238.10 | |
| US TREASURY N/B | 11,500,000.00 | 11,549,862.85 | |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,030,078.00 | |
| US TREASURY N/B | 18,300,000.00 | 18,844,710.48 | |
| US TREASURY N/B | 24,000,000.00 | 25,137,187.20 | |
| US TREASURY N/B | 7,200,000.00 | 7,219,968.48 | |
| US TREASURY N/B | 24,600,000.00 | 25,242,866.88 | |
| US TREASURY N/B | 8,500,000.00 | 8,495,682.85 | |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,012,695.00 | |
| US TREASURY N/B | 9,000,000.00 | 9,219,726.00 | |
| US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 8,007,500.00 | |
| US TREASURY N/B | 16,900,000.00 | 16,941,589.21 | |
| US TREASURY N/B | 22,300,000.00 | 22,833,980.19 | |
| US TREASURY N/B | 3,400,000.00 | 3,390,039.02 | |
| US TREASURY N/B | 29,800,000.00 | 31,607,787.20 | |
| US TREASURY N/B | 21,900,000.00 | 22,283,250.00 | |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 9,984,765.00 | |
| US TREASURY N/B | 21,100,000.00 | 21,484,908.31 | |
| US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 7,986,562.40 | |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,002,460.90 | |

| | | | |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 18,500,000.00 | 18,851,209.55 | |
| US TREASURY N/B | 49,600,000.00 | 52,597,308.16 | |
| US TREASURY N/B | 18,600,000.00 | 19,096,240.56 | |
| US TREASURY N/B | 17,000,000.00 | 17,638,163.00 | |
| US TREASURY N/B | 6,000,000.00 | 6,002,343.60 | |
| US TREASURY N/B | 16,900,000.00 | 17,523,846.60 | |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,009,687.20 | |
| US TREASURY N/B | 39,900,000.00 | 42,078,911.07 | |
| US TREASURY N/B | 7,100,000.00 | 7,383,722.39 | |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,000,703.00 | |
| US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 8,319,062.40 | |
| US TREASURY N/B | 11,300,000.00 | 12,088,791.98 | |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,178,320.00 | |
| US TREASURY N/B | 13,500,000.00 | 13,564,335.60 | |
| US TREASURY N/B | 29,300,000.00 | 30,395,316.04 | |
| US TREASURY N/B | 8,500,000.00 | 8,618,535.05 | |
| US TREASURY N/B | 8,600,000.00 | 8,903,687.50 | |
| US TREASURY N/B | 3,400,000.00 | 3,446,750.00 | |
| US TREASURY N/B | 4,800,000.00 | 5,184,374.88 | |
| US TREASURY N/B | 20,600,000.00 | 20,950,842.72 | |
| US TREASURY N/B | 21,400,000.00 | 21,692,576.52 | |
| US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 7,167,617.10 | |
| US TREASURY N/B | 30,600,000.00 | 33,013,333.26 | |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,050,781.00 | |
| US TREASURY N/B | 6,500,000.00 | 6,588,866.70 | |
| US TREASURY N/B | 5,500,000.00 | 5,594,101.15 | |
| US TREASURY N/B | 5,100,000.00 | 5,152,194.93 | |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,034,375.00 | |
| US TREASURY N/B | 27,500,000.00 | 28,986,718.75 | |
| US TREASURY N/B | 4,500,000.00 | 4,559,589.45 | |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,068,437.20 | |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 4,067,812.40 | |
| US TREASURY N/B | 25,500,000.00 | 26,027,929.05 | |
| US TREASURY N/B | 9,500,000.00 | 9,698,163.35 | |
| US TREASURY N/B | 26,400,000.00 | 28,221,185.52 | |

| | | | |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 10,600,000.00 | 10,778,875.00 | |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,001,015.60 | |
| US TREASURY N/B | 7,900,000.00 | 8,064,788.47 | |
| US TREASURY N/B | 14,500,000.00 | 14,800,194.95 | |
| US TREASURY N/B | 37,000,000.00 | 40,318,437.50 | |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 2,997,421.80 | |
| US TREASURY N/B | 8,800,000.00 | 8,982,187.28 | |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00 | 2,994,960.90 | |
| US TREASURY N/B | 8,700,000.00 | 8,916,819.66 | |
| US TREASURY N/B | 47,500,000.00 | 51,526,366.00 | |
| US TREASURY N/B | 8,800,000.00 | 8,774,561.84 | |
| US TREASURY N/B | 1,800,000.00 | 1,828,406.16 | |
| US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 12,015,937.20 | |
| US TREASURY N/B | 3,800,000.00 | 3,875,406.06 | |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,021,093.60 | |
| US TREASURY N/B | 51,100,000.00 | 56,106,200.57 | |
| US TREASURY N/B | 2,700,000.00 | 2,713,500.00 | |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00 | 3,999,374.80 | |
| US TREASURY N/B | 14,000,000.00 | 14,134,530.20 | |
| US TREASURY N/B | 40,100,000.00 | 43,972,156.25 | |
| US TREASURY N/B | 14,500,000.00 | 14,935,000.00 | |
| US TREASURY N/B | 11,000,000.00 | 11,389,296.60 | |
| US TREASURY N/B | 31,500,000.00 | 33,468,750.00 | |
| US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 7,284,921.70 | |
| US TREASURY N/B | 6,000,000.00 | 6,213,750.00 | |
| US TREASURY N/B | 1,600,000.00 | 1,638,249.92 | |
| US TREASURY N/B | 41,300,000.00 | 43,939,326.06 | |
| US TREASURY N/B | 6,800,000.00 | 7,162,843.24 | |
| US TREASURY N/B | 5,300,000.00 | 5,521,109.11 | |
| US TREASURY N/B | 33,300,000.00 | 37,082,670.21 | |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,178,125.00 | |
| US TREASURY N/B | 5,500,000.00 | 5,762,109.10 | |
| US TREASURY N/B | 2,900,000.00 | 3,039,109.23 | |
| US TREASURY N/B | 36,400,000.00 | 39,732,875.00 | |
| US TREASURY N/B | 6,000,000.00 | 6,210,937.20 | |

| | | | |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 8,700,000.00 | 9,062,952.69 | |
| US TREASURY N/B | 9,700,000.00 | 10,168,327.64 | |
| US TREASURY N/B | 26,800,000.00 | 27,909,686.16 | |
| US TREASURY N/B | 7,300,000.00 | 7,549,796.51 | |
| US TREASURY N/B | 16,000,000.00 | 16,651,249.60 | |
| US TREASURY N/B | 11,000,000.00 | 11,371,250.00 | |
| US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 8,215,000.00 | |
| US TREASURY N/B | 12,400,000.00 | 12,900,843.44 | |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,023,828.00 | |
| US TREASURY N/B | 33,700,000.00 | 34,857,119.83 | |
| US TREASURY N/B | 7,300,000.00 | 7,432,882.63 | |
| US TREASURY N/B | 5,900,000.00 | 6,007,859.08 | |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 5,086,328.00 | |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,173,437.00 | |
| US TREASURY N/B | 9,700,000.00 | 9,940,226.32 | |
| US TREASURY N/B | 27,000,000.00 | 28,063,125.00 | |
| US TREASURY N/B | 18,500,000.00 | 18,697,284.00 | |
| US TREASURY N/B | 12,800,000.00 | 12,910,999.04 | |
| US TREASURY N/B | 17,000,000.00 | 17,563,125.00 | |
| US TREASURY N/B | 28,600,000.00 | 29,020,062.50 | |
| US TREASURY N/B | 16,300,000.00 | 17,400,250.00 | |
| US TREASURY N/B | 16,800,000.00 | 18,241,124.16 | |
| US TREASURY N/B | 27,300,000.00 | 29,614,100.88 | |
| US TREASURY N/B | 30,400,000.00 | 32,373,622.72 | |
| US TREASURY N/B | 23,000,000.00 | 23,984,687.50 | |
| US TREASURY N/B | 3,600,000.00 | 5,487,750.00 | |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 715,937.50 | |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 2,751,406.20 | |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,469,062.50 | |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 689,375.00 | |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,790,859.30 | |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00 | 6,641,406.00 | |
| US TREASURY N/B | 5,500,000.00 | 7,561,210.80 | |
| US TREASURY N/B | 7,700,000.00 | 10,404,022.86 | |
| US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 11,185,000.00 | |

| | | | | |
|-------|---------------------|------------------|-------------------|--|
| | US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 10,813,124.80 | |
| | US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 10,065,000.00 | |
| | US TREASURY N/B | 7,800,000.00 | 10,366,077.54 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 9,987,577.60 | |
| | US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 9,492,655.90 | |
| | US TREASURY N/B | 6,500,000.00 | 7,254,101.40 | |
| | US TREASURY N/B | 3,500,000.00 | 3,905,234.20 | |
| | US TREASURY N/B | 4,500,000.00 | 4,897,616.85 | |
| | US TREASURY N/B | 9,300,000.00 | 9,624,772.74 | |
| | US TREASURY N/B | 9,600,000.00 | 9,912,749.76 | |
| | US TREASURY N/B | 18,200,000.00 | 20,182,092.84 | |
| | US TREASURY N/B | 15,700,000.00 | 19,134,375.00 | |
| | US TREASURY N/B | 23,200,000.00 | 28,236,935.76 | |
| | US TREASURY N/B | 15,900,000.00 | 18,437,787.87 | |
| | US TREASURY N/B | 18,600,000.00 | 20,541,375.00 | |
| | US TREASURY N/B | 32,000,000.00 | 34,450,000.00 | |
| | US TREASURY N/B | 9,200,000.00 | 8,933,343.52 | |
| | US TREASURY N/B | 5,500,000.00 | 5,909,921.60 | |
| | US TREASURY NOTE | 26,400,000.00 | 27,458,061.84 | |
| | US TREASURY NOTE | 25,100,000.00 | 26,204,987.34 | |
| 小計 | 銘柄数：165 | 2,198,500,000.00 | 2,380,527,904.85 | |
| | | | (272,070,534,245) | |
| | 組入時価比率：42.8% | | 43.1% | |
| カナダドル | CANADA GOVERNMENT | 4,600,000.00 | 5,147,906.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 7,400,000.00 | 7,472,594.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,200,000.00 | 3,233,984.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,600,000.00 | 3,762,972.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 6,600,000.00 | 6,675,900.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4,300,000.00 | 4,368,585.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 8,600,000.00 | 8,733,300.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,200,000.00 | 3,251,808.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,700,000.00 | 4,019,088.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 7,500,000.00 | 7,651,575.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,800,000.00 | 3,948,162.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4,600,000.00 | 5,089,624.00 | |

| | | | | |
|--------|--------------------------|----------------|------------------------------------|--|
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4,000,000.00 | 4,178,480.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,600,000.00 | 3,741,876.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 7,500,000.00 | 8,446,050.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 2,019,400.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 7,700,000.00 | 8,738,961.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,900,000.00 | 4,052,178.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5,700,000.00 | 6,351,624.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5,400,000.00 | 5,916,510.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2,200,000.00 | 3,721,014.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5,180,000.00 | 7,775,387.20 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3,000,000.00 | 4,764,690.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 7,000,000.00 | 10,726,310.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 6,400,000.00 | 8,977,536.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 6,800,000.00 | 9,154,568.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1,800,000.00 | 2,125,818.00 | |
| 小計 | 銘柄数：27 | 133,280,000.00 | 154,045,900.20 (12,694,922,635) | |
| | 組入時価比率：2.0% | | 2.0% | |
| メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6,400,000.00 | 6,519,379.20 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 60,800,000.00 | 65,158,083.20 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 108,800,000.00 | 109,699,232.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 89,500,000.00 | 98,775,869.50 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 29,000,000.00 | 28,992,460.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 60,700,000.00 | 67,529,539.10 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 61,800,000.00 | 65,449,475.40 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 27,400,000.00 | 28,851,241.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 30,700,000.00 | 39,536,503.80 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 68,200,000.00 | 75,672,674.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 34,600,000.00 | 41,332,398.80 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 41,000,000.00 | 45,865,388.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10,000,000.00 | 11,178,250.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 46,000,000.00 | 62,631,576.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 30,500,000.00 | 36,501,729.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 48,200,000.00 | 53,537,186.00 | |
| | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 83,000,000.00 | 94,668,223.00 | |

| | | | |
|-----|---------------------------|----------------|---|
| 小計 | 銘柄数：17 組入時価比率：0.9% | 836,600,000.00 | 931,899,208.00 (5,647,309,200) 0.9% |
| ユーロ | BELGIUM KINGDOM | 1,700,000.00 | 1,791,060.50 |
| | BELGIUM KINGDOM | 4,000,000.00 | 4,157,304.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3,100,000.00 | 3,469,210.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 7,000,000.00 | 8,283,205.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 7,200,000.00 | 8,937,360.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 5,000,000.00 | 6,215,085.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 6,400,000.00 | 8,145,920.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3,000,000.00 | 3,439,398.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 7,300,000.00 | 8,581,150.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 6,400,000.00 | 8,795,564.80 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3,500,000.00 | 4,905,481.00 |
| | BELGIUM KINGDOM | 6,800,000.00 | 10,605,715.20 |
| | BELGIUM KINGDOM | 2,800,000.00 | 4,149,748.40 |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 2,000,000.00 | 2,191,680.00 |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 2,500,000.00 | 2,733,000.00 |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5,200,000.00 | 5,907,876.00 |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 7,600,000.00 | 11,596,619.60 |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 9,500,000.00 | 15,300,548.00 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 16,500,000.00 | 16,909,414.50 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 18,600,000.00 | 18,726,480.00 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 20,700,000.00 | 22,462,874.10 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,300,000.00 | 1,301,950.00 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 16,100,000.00 | 17,635,698.50 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 17,100,000.00 | 18,725,885.10 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,900,000.00 | 8,504,373.70 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 9,100,000.00 | 10,408,425.30 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 20,800,000.00 | 23,706,800.00 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 19,000,000.00 | 21,652,761.00 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 11,600,000.00 | 13,804,348.00 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,500,000.00 | 9,277,230.00 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 9,200,000.00 | 11,771,252.80 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 12,800,000.00 | 16,330,841.60 |

| | | |
|--------------------------|---------------|---------------|
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,700,000.00 | 5,720,299.50 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,100,000.00 | 8,871,506.80 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 8,300,000.00 | 9,757,480.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 11,200,000.00 | 14,034,160.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 18,400,000.00 | 25,397,520.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,800,000.00 | 6,433,920.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,700,000.00 | 6,388,945.00 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,400,000.00 | 5,846,332.80 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,900,000.00 | 5,555,179.50 |
| BUNDES OBLIGATION | 1,700,000.00 | 1,743,690.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,500,000.00 | 6,239,750.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 8,700,000.00 | 9,952,365.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,000,000.00 | 8,048,950.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,100,000.00 | 3,474,790.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,300,000.00 | 8,322,000.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,000,000.00 | 8,344,350.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,500,000.00 | 3,995,425.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 14,000,000.00 | 15,857,800.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,600,000.00 | 10,799,040.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,000,000.00 | 5,552,750.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,200,000.00 | 5,796,960.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,200,000.00 | 4,692,660.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,400,000.00 | 6,246,450.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 11,100,000.00 | 16,630,020.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,700,000.00 | 6,507,405.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,500,000.00 | 1,683,975.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,700,000.00 | 6,157,710.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 18,900,000.00 | 31,969,350.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,000,000.00 | 9,678,300.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,400,000.00 | 5,189,080.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,500,000.00 | 6,218,275.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,300,000.00 | 9,014,505.00 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,600,000.00 | 11,175,476.40 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,400,000.00 | 15,086,642.80 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,400,000.00 | 9,249,098.40 |

| | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,900,000.00 | 9,043,734.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,500,000.00 | 8,517,899.50 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,700,000.00 | 6,536,374.60 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,000,000.00 | 9,802,450.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 13,000,000.00 | 13,496,080.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 18,300,000.00 | 19,344,381.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,500,000.00 | 4,563,045.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 18,500,000.00 | 19,624,245.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,300,000.00 | 11,083,315.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 18,900,000.00 | 20,014,722.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,500,000.00 | 10,637,550.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 18,300,000.00 | 19,882,584.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 9,900,000.00 | 10,668,467.70 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 16,800,000.00 | 18,592,560.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,000,000.00 | 8,738,400.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 17,000,000.00 | 19,028,100.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,000,000.00 | 7,903,700.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 17,400,000.00 | 18,638,880.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00 | 520,300.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 25,900,000.00 | 29,448,300.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,500,000.00 | 9,864,250.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 13,800,000.00 | 15,910,020.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,600,000.00 | 14,556,780.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 11,000,000.00 | 12,676,334.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,000,000.00 | 8,087,100.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,800,000.00 | 9,041,760.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,400,000.00 | 12,624,560.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,700,000.00 | 15,735,300.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 9,600,000.00 | 12,307,200.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 13,900,000.00 | 17,857,330.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,600,000.00 | 5,654,398.20 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,200,000.00 | 9,012,240.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,500,000.00 | 16,420,950.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 11,700,000.00 | 14,471,730.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,300,000.00 | 2,719,290.00 | |

| | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 14,900,000.00 | 19,225,470.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,500,000.00 | 6,944,850.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,300,000.00 | 12,738,840.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 16,200,000.00 | 23,984,100.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,300,000.00 | 9,575,410.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,100,000.00 | 16,737,930.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,700,000.00 | 18,981,420.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,400,000.00 | 9,543,680.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,400,000.00 | 11,712,960.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,700,000.00 | 3,356,370.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,000,000.00 | 11,388,000.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,400,000.00 | 17,580,720.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,000,000.00 | 9,807,000.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 600,000.00 | 662,100.00 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 2,137,626.00 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 1,500,000.00 | 1,559,485.50 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 1,300,000.00 | 1,507,252.50 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 2,299,200.00 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 2,372,770.00 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 3,200,000.00 | 3,524,572.80 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 2,200,000.00 | 2,403,500.00 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 2,400,000.00 | 3,164,880.00 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 3,500,000.00 | 4,279,485.00 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 700,000.00 | 668,742.20 | |
| FINNISH GOVERNMENT | 1,400,000.00 | 1,838,592.00 | |
| FRANCE (GOVT OF) | 8,000,000.00 | 8,336,984.00 | |
| FRANCE (GOVT OF) | 8,500,000.00 | 8,740,006.00 | |
| FRANCE (GOVT OF) | 3,500,000.00 | 4,140,080.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,700,000.00 | 10,466,785.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6,000,000.00 | 6,576,942.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4,500,000.00 | 4,640,310.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 10,800,000.00 | 12,138,681.60 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6,600,000.00 | 6,842,715.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 11,500,000.00 | 13,171,479.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4,000,000.00 | 5,294,800.00 | |

| | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 10,800,000.00 | 12,403,335.60 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 14,800,000.00 | 17,107,038.80 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 17,300,000.00 | 19,443,470.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 11,800,000.00 | 14,144,660.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 15,100,000.00 | 17,899,087.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 14,800,000.00 | 17,487,680.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 16,700,000.00 | 19,042,325.30 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8,200,000.00 | 13,094,112.60 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 22,500,000.00 | 29,299,500.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8,000,000.00 | 8,877,240.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 19,800,000.00 | 30,006,900.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 20,500,000.00 | 26,151,850.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 7,200,000.00 | 8,674,560.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 20,100,000.00 | 31,311,599.10 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 16,600,000.00 | 27,965,057.20 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 7,400,000.00 | 11,637,476.80 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,800,000.00 | 14,496,708.80 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 7,400,000.00 | 11,947,729.20 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,100,000.00 | 12,423,684.00 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4,700,000.00 | 7,607,025.20 | |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3,800,000.00 | 6,238,095.20 | |
| FRENCH TREASURY NOTE | 1,000,000.00 | 1,020,320.00 | |
| IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4 | 3,600,000.00 | 4,130,452.80 | |
| IRISH GOVERNMENT | 7,500,000.00 | 8,222,070.00 | |
| IRISH GOVERNMENT | 5,600,000.00 | 6,289,348.80 | |
| IRISH GOVERNMENT | 3,400,000.00 | 4,134,250.40 | |
| IRISH GOVERNMENT | 5,300,000.00 | 6,285,916.60 | |
| IRISH GOVERNMENT | 3,500,000.00 | 4,301,398.50 | |
| IRISH GOVERNMENT | 6,000,000.00 | 8,339,124.00 | |
| IRISH TSY 2.4% 2030 | 1,500,000.00 | 1,695,883.50 | |
| IRISH TSY 2% 2045 | 1,500,000.00 | 1,520,550.00 | |
| IRISH TSY 3.4% 2024 | 1,300,000.00 | 1,573,089.70 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,000,000.00 | 4,279,600.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,500,000.00 | 4,646,637.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 6,500,000.00 | 7,197,950.50 | |

| | | | |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2,500,000.00 | 2,620,377.50 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 7,100,000.00 | 8,161,095.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 2,045,400.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 5,800,000.00 | 6,774,400.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 5,900,000.00 | 6,992,373.20 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 1,500,000.00 | 1,720,689.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 5,900,000.00 | 7,417,480.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,300,000.00 | 6,524,820.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 1,400,000.00 | 1,568,879.20 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 13,500,000.00 | 15,466,464.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 6,300,000.00 | 9,838,080.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 3,700,000.00 | 4,631,704.40 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 5,000,000.00 | 7,857,130.00 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 5,200,000.00 | 8,398,686.40 | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 3,500,000.00 | 4,976,436.50 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,000,000.00 | 1,036,562.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,500,000.00 | 1,612,800.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,000,000.00 | 3,294,762.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,300,000.00 | 2,395,910.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,400,000.00 | 5,034,920.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,700,000.00 | 1,828,180.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,400,000.00 | 2,446,800.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,600,000.00 | 5,436,280.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 5,200,000.00 | 6,244,160.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,300,000.00 | 4,040,850.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 5,000,000.00 | 6,106,500.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,600,000.00 | 1,780,990.40 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,000,000.00 | 3,314,400.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 5,400,000.00 | 7,616,700.00 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 3,800,000.00 | 6,088,025.60 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 5,600,000.00 | 8,569,019.20 | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,500,000.00 | 6,340,950.00 | |
| REPUBLIC OF IRELAND | 3,400,000.00 | 4,209,978.60 | |
| SPANISH GOVERNMENT | 18,400,000.00 | 19,847,951.20 | |
| SPANISH GOVERNMENT | 9,800,000.00 | 14,043,331.40 | |

| | | | | |
|-------------|--------------------|------------------|-------------------|-------|
| 小計 | SPANISH GOVERNMENT | 7,300,000.00 | 10,624,420.00 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 5,200,000.00 | 6,432,764.00 | |
| | 銘柄数：209 | 1,612,300,000.00 | 2,011,660,486.10 | |
| | 組入時価比率：40.3% | | (255,963,680,251) | 40.6% |
| 英ポンド | UK TREASURY | 5,900,000.00 | 5,959,590.00 | |
| | UK TREASURY | 6,000,000.00 | 6,581,400.00 | |
| | UK TREASURY | 18,000,000.00 | 18,349,200.00 | |
| | UK TREASURY | 4,600,000.00 | 5,166,260.00 | |
| | UK TREASURY | 13,900,000.00 | 14,433,760.00 | |
| | UK TREASURY | 3,000,000.00 | 3,338,700.00 | |
| | UK TREASURY | 6,400,000.00 | 7,456,000.00 | |
| | UK TREASURY | 13,300,000.00 | 14,008,890.00 | |
| | UK TREASURY | 7,200,000.00 | 8,184,240.00 | |
| | UK TREASURY | 5,100,000.00 | 6,998,730.00 | |
| | UK TREASURY | 7,300,000.00 | 8,435,880.00 | |
| | UK TREASURY | 4,650,000.00 | 5,496,300.00 | |
| | UK TREASURY | 8,300,000.00 | 8,662,710.00 | |
| | UK TREASURY | 7,200,000.00 | 7,741,440.00 | |
| | UK TREASURY | 8,600,000.00 | 9,583,840.00 | |
| | UK TREASURY | 12,100,000.00 | 15,904,240.00 | |
| | UK TREASURY | 6,700,000.00 | 8,614,860.00 | |
| | UK TREASURY | 3,750,000.00 | 5,658,750.00 | |
| | UK TREASURY | 6,700,000.00 | 9,243,990.00 | |
| | UK TREASURY | 7,250,000.00 | 9,579,425.00 | |
| | UK TREASURY | 6,700,000.00 | 9,216,520.00 | |
| | UK TREASURY | 6,900,000.00 | 9,282,570.00 | |
| | UK TREASURY | 4,900,000.00 | 7,133,910.00 | |
| | UK TREASURY | 4,200,000.00 | 5,742,240.00 | |
| | UK TREASURY | 5,700,000.00 | 7,871,700.00 | |
| | UK TREASURY | 6,100,000.00 | 8,843,780.00 | |
| | UK TREASURY | 14,000,000.00 | 17,554,600.00 | |
| | UK TREASURY | 5,950,000.00 | 8,584,660.00 | |
| UK TREASURY | 4,250,000.00 | 6,295,950.00 | | |
| UK TREASURY | 7,250,000.00 | 10,057,925.00 | | |
| | | | | |

| | | | | |
|----------------------|----------------------------|----------------|----------------|------------------|
| 小計 | UK TREASURY | 5,000,000.00 | 7,123,000.00 | |
| | UK TSY 3 1/4% 2044 | 18,000,000.00 | 21,537,000.00 | |
| | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 6,400,000.00 | 9,992,320.00 | |
| | 銘柄数：33 | 251,300,000.00 | 308,634,380.00 | (50,412,339,629) |
| | 組入時価比率：7.9% | | | 8.0% |
| スイスフラン 小計 | SWITZERLAND GOVERNMENT | 8,800,000.00 | 10,094,480.00 | |
| | SWITZERLAND GOVERNMENT | 3,600,000.00 | 5,466,600.00 | |
| | 銘柄数：2 | 12,400,000.00 | 15,561,080.00 | (1,798,549,626) |
| | 組入時価比率：0.3% | | | 0.3% |
| スウェーデンク ローナ 小計 | SWEDISH GOVERNMENT | 7,000,000.00 | 7,457,625.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 16,200,000.00 | 18,554,281.20 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 49,400,000.00 | 61,579,718.20 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 48,700,000.00 | 58,883,170.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 17,900,000.00 | 19,500,832.80 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 31,300,000.00 | 36,827,580.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 16,300,000.00 | 22,213,493.30 | |
| | 銘柄数：7 | 186,800,000.00 | 225,016,700.50 | (3,021,974,287) |
| | 組入時価比率：0.5% | | | 0.5% |
| ノルウェークロ ネ 小計 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 21,900,000.00 | 22,898,640.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 24,100,000.00 | 27,134,190.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 27,600,000.00 | 31,644,504.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 14,300,000.00 | 15,173,730.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 31,600,000.00 | 35,884,960.00 | |
| | 銘柄数：5 | 119,500,000.00 | 132,736,024.00 | (1,758,752,318) |
| | 組入時価比率：0.3% | | | 0.3% |
| デンマーククロ ネ 小計 | KINGDOM OF DENMARK | 25,100,000.00 | 29,116,000.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 52,100,000.00 | 60,831,960.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 31,100,000.00 | 34,001,630.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 14,500,000.00 | 22,902,750.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 18,600,000.00 | 20,601,360.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 39,300,000.00 | 67,393,565.70 | |
| | 銘柄数：6 | 180,700,000.00 | 234,847,265.70 | |

| | | | | |
|-------------|------------------------|---------------|-----------------|----------------|
| | | | (4,004,145,880) | |
| | 組入時価比率：0.6% | | 0.6% | |
| ズロチ | POLAND GOVERNMENT BOND | 6,300,000.00 | 6,550,740.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 8,500,000.00 | 9,031,250.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 8,100,000.00 | 8,503,380.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 9,500,000.00 | 9,690,000.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 5,800,000.00 | 6,086,143.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 11,100,000.00 | 12,504,150.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 5,200,000.00 | 5,097,040.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 16,800,000.00 | 19,168,800.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 4,000,000.00 | 4,730,000.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 9,400,000.00 | 11,265,054.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 9,600,000.00 | 10,466,400.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 13,100,000.00 | 13,514,523.30 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 3,700,000.00 | 4,662,000.00 | |
| | 小計 | 銘柄数：13 | 111,100,000.00 | 121,269,480.30 |
| 組入時価比率：0.6% | | | (3,501,049,896) | 0.6% |
| 豪ドル | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 6,300,000.00 | 6,536,124.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5,900,000.00 | 6,091,891.60 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 7,800,000.00 | 8,329,393.80 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4,700,000.00 | 4,871,785.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 10,400,000.00 | 11,449,016.80 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2,900,000.00 | 2,987,078.30 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 12,700,000.00 | 13,994,650.70 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 900,000.00 | 888,346.80 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 9,400,000.00 | 11,099,266.20 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 7,900,000.00 | 9,528,585.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 7,300,000.00 | 8,827,320.60 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 8,200,000.00 | 8,395,160.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 12,700,000.00 | 13,508,139.10 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 7,700,000.00 | 8,881,950.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4,800,000.00 | 5,799,643.20 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4,800,000.00 | 5,056,492.80 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3,600,000.00 | 4,351,388.40 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1,800,000.00 | 1,712,149.20 | |

| | | | | | |
|----------|-----------------------|----------------|----------------|------------------|-----------------|
| 小計 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4,500,000.00 | 4,936,698.00 | | |
| | 銘柄数：19 | 124,300,000.00 | 137,245,079.50 | (11,153,907,610) | |
| | 組入時価比率：1.8% | | | 1.8% | |
| シンガポールドル | SINGAPORE GOVERNMENT | 300,000.00 | 304,890.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,200,000.00 | 1,185,360.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,200,000.00 | 2,357,300.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3,200,000.00 | 3,321,280.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 4,000,000.00 | 4,278,000.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,580,000.00 | 2,632,322.40 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,200,000.00 | 1,281,600.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,200,000.00 | 2,291,300.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,500,000.00 | 1,592,250.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3,300,000.00 | 3,654,750.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,400,000.00 | 2,479,848.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 500,000.00 | 550,835.00 | | |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,800,000.00 | 1,802,034.00 | | |
| | 小計 | 銘柄数：13 | 26,380,000.00 | 27,731,769.40 | (2,252,928,946) |
| | | 組入時価比率：0.4% | | | 0.4% |
| リンギ | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,300,000.00 | 2,327,600.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,900,000.00 | 2,923,200.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,300,000.00 | 4,391,332.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 8,200,000.00 | 8,372,200.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3,700,000.00 | 3,707,400.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3,000,000.00 | 3,027,126.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 11,900,000.00 | 12,298,650.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 10,000,000.00 | 10,005,000.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,400,000.00 | 2,438,611.20 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 6,000,000.00 | 6,143,634.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 8,700,000.00 | 8,852,250.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,600,000.00 | 4,503,400.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5,400,000.00 | 5,276,070.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5,800,000.00 | 5,885,637.00 | | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 8,800,000.00 | 9,023,581.60 | | |

| | | | | |
|-----|--------------------------|----------------|-------------------|--|
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,000,000.00 | 3,740,000.00 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 1,800,000.00 | 1,718,037.00 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,700,000.00 | 2,967,343.20 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,500,000.00 | 2,581,475.00 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,700,000.00 | 4,557,613.50 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 400,000.00 | 371,562.80 | |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 1,600,000.00 | 1,653,969.60 | |
| 小計 | 銘柄数：22 | 105,700,000.00 | 106,765,692.90 | |
| | | | (2,899,756,219) | |
| | 組入時価比率：0.5% | | 0.5% | |
| ランド | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10,300,000.00 | 10,338,026.57 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 23,800,000.00 | 23,564,820.30 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 23,800,000.00 | 22,739,676.68 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 26,100,000.00 | 23,944,609.80 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 25,200,000.00 | 23,580,295.20 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 61,900,000.00 | 67,594,670.01 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 24,300,000.00 | 21,410,839.35 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 30,000,000.00 | 23,538,000.00 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 28,000,000.00 | 24,737,652.80 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 47,100,000.00 | 32,784,652.08 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 16,700,000.00 | 14,711,030.00 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 24,600,000.00 | 17,022,132.36 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 12,300,000.00 | 10,913,846.58 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 40,300,000.00 | 35,692,738.77 | |
| 小計 | 銘柄数：14 | 394,400,000.00 | 352,572,990.50 | |
| | | | (2,552,628,451) | |
| | 組入時価比率：0.4% | | 0.4% | |
| 合計 | | | 629,732,479,193 | |
| | | | (629,732,479,193) | |

(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28年 2月17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 | | | | |
| 売建 | 569,985,614 | - | 568,607,800 | 1,377,814 |
| 米ドル | 284,186,952 | - | 284,557,200 | 370,248 |
| ユーロ | 249,383,523 | - | 248,118,000 | 1,265,523 |
| 英ポンド | 36,415,139 | - | 35,932,600 | 482,539 |
| 合計 | 569,985,614 | - | 568,607,800 | 1,377,814 |

(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。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

| | |
|----------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 84,477,396 |
| コール・ローン | 39,702,634 |
| 国債証券 | 6,139,403,079 |
| 派生商品評価勘定 | 191,204 |
| 未収入金 | 9,657,685 |
| 未収利息 | 99,832,676 |
| 前払費用 | 5,076,628 |
| 流動資産合計 | 6,378,341,302 |
| 資産合計 | 6,378,341,302 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 83,573,420 |
| 未払解約金 | 4,132,874 |
| その他未払費用 | 140,900 |
| 流動負債合計 | 87,847,194 |

(平成28年 2月17日現在)

| | |
|-----------------|---------------|
| 負債合計 | 87,847,194 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 3,866,356,460 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2,424,137,648 |
| 元本等合計 | 6,290,494,108 |
| 純資産合計 | 6,290,494,108 |
| 負債純資産合計 | 6,378,341,302 |

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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|----------------------------|-----------|
| 平成28年 2月17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 | 1.6270円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (16,270円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| |
|--------------------------------|
| 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日 |
| 1.金融商品に対する取組方針 |

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年 2月17日現在 | |
|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ | |
| ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |
| 国債証券 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| 派生商品評価勘定 | |
| デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており | |
| ます。 | |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 平成28年 2月17日現在 | |
|----------------------------------|----------------|
| 期首 | 平成27年 2月18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 | 3,732,589,536円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 806,308,856円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 672,541,932円 |
| 期末元本額 | 3,866,356,460円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型 | 1,185,961,557円 |
| ネクストコア | 78,678,870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 | 153,560,830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） | 91,173,873円 |
| ノムラ新興国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用） | 3,591,778円 |
| 野村新興国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け） | 2,256,373,778円 |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド | 95,141,710円 |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンドＭ | 605,341円 |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンドＡ | 1,268,723円 |

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17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 | BOLIVARIAN REP OF VZLA | 400,000.00 | 121,920.00 | |
| | | BOLIVARIAN REP OF VZLA | 500,000.00 | 172,725.00 | |
| | | BOLIVARIAN REP OF VZLA | 350,000.00 | 103,250.00 | |
| | | BOLIVARIAN REP OF VZLA | 400,000.00 | 115,400.00 | |
| | | BOLIVARIAN REP OF VZLA | 300,000.00 | 87,000.00 | |
| | | BRAZIL GLOBAL | 150,000.00 | 171,750.00 | |
| | | BRAZIL GLOBAL | 250,000.00 | 274,375.00 | |
| | | BRAZIL GLOBAL | 150,000.00 | 166,875.00 | |
| | | BRAZIL GLOBAL | 300,000.00 | 369,000.00 | |
| | | BRAZIL GLOBAL | 600,000.00 | 591,000.00 | |
| | | BRAZIL GLOBAL | 1,000,000.00 | 880,000.00 | |
| | | COLOMBIA GLOBAL | 350,000.00 | 389,375.00 | |
| | | COLOMBIA GLOBAL | 150,000.00 | 192,000.00 | |
| | | COLOMBIA GLOBAL | 300,000.00 | 351,450.00 | |
| | | COLOMBIA GLOBAL | 300,000.00 | 313,500.00 | |
| | | CROATIA | 300,000.00 | 312,939.00 | |
| | | CROATIA | 200,000.00 | 217,744.00 | |
| | | CROATIA | 400,000.00 | 431,400.00 | |
| | | CROATIA | 200,000.00 | 208,960.00 | |

| | | | |
|------------------------|------------|--------------|--|
| CROATIA | 200,000.00 | 215,140.00 | |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 400,000.00 | 418,000.00 | |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 430,000.00 | 410,650.00 | |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 600,000.00 | 469,500.00 | |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 600,000.00 | 491,250.00 | |
| FED REPUBLIC OF BRAZIL | 300,000.00 | 217,500.00 | |
| HUNGARY | 200,000.00 | 207,823.80 | |
| HUNGARY | 200,000.00 | 207,956.40 | |
| HUNGARY | 400,000.00 | 438,760.00 | |
| HUNGARY | 300,000.00 | 338,049.00 | |
| HUNGARY | 300,000.00 | 331,125.00 | |
| INDONESIA GLOBAL | 200,000.00 | 219,030.40 | |
| INDONESIA GLOBAL | 700,000.00 | 878,150.00 | |
| INDONESIA GLOBAL | 200,000.00 | 212,193.60 | |
| MEXICO GLOBAL | 200,000.00 | 291,500.00 | |
| MEXICO GLOBAL | 499,000.00 | 643,710.00 | |
| MEXICO GLOBAL | 150,000.00 | 179,625.00 | |
| PANAMA GLOBAL | 200,000.00 | 248,500.00 | |
| PANAMA GLOBAL | 600,000.00 | 834,000.00 | |
| PANAMA GLOBAL | 150,000.00 | 215,625.00 | |
| PANAMA GLOBAL | 250,000.00 | 301,250.00 | |
| PERU GLOBAL | 400,000.00 | 501,400.00 | |
| PERU GLOBAL | 220,000.00 | 254,100.00 | |
| PHILIPPINES GLOBAL | 150,000.00 | 185,738.55 | |
| PHILIPPINES GLOBAL | 700,000.00 | 1,124,711.70 | |
| PHILIPPINES GLOBAL | 400,000.00 | 662,181.60 | |
| PHILIPPINES GLOBAL | 300,000.00 | 444,340.20 | |
| PHILIPPINES GLOBAL | 600,000.00 | 801,606.60 | |
| REPUBLIC OF COLOMBIA | 400,000.00 | 398,000.00 | |
| REPUBLIC OF COLOMBIA | 200,000.00 | 174,000.00 | |
| REPUBLIC OF COLOMBIA | 400,000.00 | 373,000.00 | |
| REPUBLIC OF COLOMBIA | 700,000.00 | 642,250.00 | |
| REPUBLIC OF COLOMBIA | 700,000.00 | 607,250.00 | |
| REPUBLIC OF CROATIA | 400,000.00 | 435,080.00 | |
| REPUBLIC OF HUNGARY | 320,000.00 | 356,054.40 | |

| | | | |
|--------------------------|------------|------------|--|
| REPUBLIC OF HUNGARY | 500,000.00 | 567,250.00 | |
| REPUBLIC OF HUNGARY | 250,000.00 | 343,276.00 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 400,000.00 | 432,000.00 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 350,000.00 | 440,720.35 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 350,000.00 | 386,990.45 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 300,000.00 | 316,720.80 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 300,000.00 | 296,042.70 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 200,000.00 | 191,526.00 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 250,000.00 | 266,727.00 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 700,000.00 | 826,513.80 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 400,000.00 | 372,941.60 | |
| REPUBLIC OF INDONESIA | 600,000.00 | 649,580.40 | |
| REPUBLIC OF PANAMA | 150,000.00 | 162,562.50 | |
| REPUBLIC OF PERU | 300,000.00 | 341,250.00 | |
| REPUBLIC OF PERU | 550,000.00 | 759,000.00 | |
| REPUBLIC OF PERU | 400,000.00 | 409,000.00 | |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES | 500,000.00 | 590,550.50 | |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES | 200,000.00 | 219,902.00 | |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES | 200,000.00 | 223,693.40 | |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES | 400,000.00 | 549,587.20 | |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES | 200,000.00 | 242,778.80 | |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 200,000.00 | 218,000.00 | |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 400,000.00 | 420,466.00 | |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 150,000.00 | 159,744.00 | |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 200,000.00 | 196,110.00 | |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 350,000.00 | 367,857.00 | |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 200,000.00 | 186,500.00 | |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 150,000.00 | 156,162.00 | |
| REPUBLIC OF TURKEY | 300,000.00 | 321,713.10 | |
| REPUBLIC OF TURKEY | 400,000.00 | 423,256.00 | |
| REPUBLIC OF TURKEY | 200,000.00 | 206,303.00 | |
| REPUBLIC OF TURKEY | 400,000.00 | 435,260.00 | |
| REPUBLIC OF TURKEY | 500,000.00 | 550,555.00 | |
| REPUBLIC OF TURKEY | 600,000.00 | 604,464.60 | |
| REPUBLIC OF TURKEY | 200,000.00 | 174,357.00 | |

| | | | |
|-------------------------|--------------|--------------|--|
| REPUBLIC OF TURKEY | 500,000.00 | 555,875.00 | |
| REPUBLIC OF VENEZUELA | 450,000.00 | 151,200.00 | |
| REPUBLIC OF VENEZUELA | 700,000.00 | 234,500.00 | |
| REPUBLIC OF VENEZUELA | 200,000.00 | 62,800.00 | |
| ROMANIA | 400,000.00 | 478,300.40 | |
| ROMANIA | 200,000.00 | 213,150.00 | |
| ROMANIA | 300,000.00 | 329,745.00 | |
| ROMANIA | 150,000.00 | 180,401.25 | |
| RUSSIA | 400,000.00 | 470,000.00 | |
| RUSSIA | 420,000.00 | 666,750.00 | |
| RUSSIA | 1,844,500.00 | 2,232,121.67 | |
| RUSSIA FOREIGN BOND | 600,000.00 | 623,280.00 | |
| RUSSIAN FEDERATION | 400,000.00 | 399,410.40 | |
| RUSSIAN FEDERATION | 400,000.00 | 403,203.20 | |
| RUSSIAN FEDERATION | 600,000.00 | 610,719.60 | |
| RUSSIAN FEDERATION | 400,000.00 | 376,349.20 | |
| RUSSIAN FEDERATION | 400,000.00 | 384,000.00 | |
| TURKEY GLOBAL | 350,000.00 | 376,117.70 | |
| TURKEY GLOBAL | 400,000.00 | 437,707.20 | |
| TURKEY GLOBAL | 300,000.00 | 334,410.00 | |
| TURKEY GLOBAL | 400,000.00 | 422,000.00 | |
| TURKEY GLOBAL | 850,000.00 | 991,101.70 | |
| TURKEY GLOBAL | 350,000.00 | 573,421.10 | |
| TURKEY GLOBAL | 400,000.00 | 496,580.00 | |
| TURKEY GLOBAL | 320,000.00 | 355,489.60 | |
| TURKEY GLOBAL | 150,000.00 | 174,386.25 | |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 465,000.00 | 417,918.75 | |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 209,000.00 | 185,349.56 | |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 209,000.00 | 183,606.50 | |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 200,000.00 | 173,760.00 | |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 500,000.00 | 430,000.00 | |
| UKRAINE GOVERNMENT REGS | 500,000.00 | 418,750.00 | |
| UNITED MEXICAN STATES | 900,000.00 | 821,250.00 | |
| UNITED MEXICAN STATES | 350,000.00 | 386,662.50 | |
| UNITED MEXICAN STATES | 500,000.00 | 543,250.00 | |

| | | | | |
|----|-----------------------|---------------|-----------------|--|
| | UNITED MEXICAN STATES | 700,000.00 | 705,250.00 | |
| | UNITED MEXICAN STATES | 600,000.00 | 605,100.00 | |
| | UNITED MEXICAN STATES | 600,000.00 | 581,250.00 | |
| | UNITED MEXICAN STATES | 550,000.00 | 586,437.50 | |
| | UNITED MEXICAN STATES | 800,000.00 | 714,000.00 | |
| | UNITED MEXICAN STATES | 800,000.00 | 802,000.00 | |
| | VENEZUELA GLOBAL | 150,000.00 | 51,975.00 | |
| | VENEZUELA GLOBAL | 200,000.00 | 59,548.00 | |
| | VENEZUELA GLOBAL | 100,000.00 | 29,960.00 | |
| | VENEZUELA GLOBAL | 600,000.00 | 214,200.00 | |
| | VENEZUELA GLOBAL | 200,000.00 | 65,400.00 | |
| 小計 | 銘柄数：135 | 52,336,500.00 | 53,717,762.53 | |
| | | | (6,139,403,079) | |
| | 組入時価比率：97.6% | | 100.0% | |
| 合計 | | | 6,139,403,079 | |
| | | | (6,139,403,079) | |

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 平成28年 2月17日現在 | | | |
|-----------|---------------|-------|------------|---------|
| | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 買建 | 62,667,330 | - | 62,854,000 | 186,670 |
| 米ドル | 62,667,330 | - | 62,854,000 | 186,670 |
| 売建 | 1,718,734 | - | 1,714,200 | 4,534 |
| 米ドル | 1,718,734 | - | 1,714,200 | 4,534 |
| 合計 | - | - | - | 191,204 |

(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。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

| （単位：円） | |
|-----------------|----------------------|
| （平成28年 2月17日現在） | |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 29,623,395 |
| コール・ローン | 1,173,233 |
| 国債証券 | 1,550,842,457 |
| 未収利息 | 25,294,116 |
| 前払費用 | 4,148,203 |
| 流動資産合計 | 1,611,081,404 |
| 資産合計 | 1,611,081,404 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 21,445,563 |
| 未払解約金 | 52,806 |
| その他未払費用 | 344,900 |
| 流動負債合計 | 21,843,269 |
| 負債合計 | 21,843,269 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 1,395,188,317 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 194,049,818 |
| 元本等合計 | 1,589,238,135 |
| 純資産合計 | 1,589,238,135 |
| 負債純資産合計 | 1,611,081,404 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|------------------------|---|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |

| | |
|-----------------------|---|
| 3.費用・収益の計上基準 | 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。 |
| 4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年 2月17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 | 1.1391円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (11,391円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日 |
|--|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> |
| <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> |
| <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年 2月17日現在 | |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | |

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 平成28年 2月17日現在 | |
|-------------------------------------|----------------|
| 期首 | 平成27年 2月18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 | 1,498,838,630円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,010,944,496円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,114,594,809円 |
| 期末元本額 | 1,395,188,317円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村資産設計ファンド2015 | 20,679,027円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 24,417,177円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 20,458,223円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 17,554,869円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 11,404,734円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 32,558,526円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 2,445,131円 |
| 野村インデックスファンド・新興国債券 | 393,821,813円 |
| ネクストコア | 28,090,118円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 148,632,730円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 515,849円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用） | 445,838,471円 |
| 野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド | 212,943,060円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 33,334,558円 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 402,827円 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 2,091,204円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 | |
|--------------------------|-------------|--------------------------|------------------------|------------------|---------------|---------------|
| 国債証券 | メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT | 1,050,000.00 | 1,125,262.95 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5,350,000.00 | 5,394,217.75 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 2,350,000.00 | 2,614,405.55 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 1,600,000.00 | 1,694,484.80 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 1,400,000.00 | 1,474,151.00 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 1,700,000.00 | 2,189,317.80 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 2,250,000.00 | 2,496,532.50 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 1,700,000.00 | 1,901,735.60 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 200,000.00 | 272,311.20 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 2,500,000.00 | 2,991,945.00 | | |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 1,200,000.00 | 1,332,876.00 | | |
| | | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 1,200,000.00 | 1,368,697.20 | | |
| | | 小計 | 銘柄数：12 | 22,500,000.00 | 24,855,937.35 | (150,626,980) |
| | | | 組入時価比率：9.5% | | | 9.7% |
| | レアル | レアル | LETRA TESOURO NACIONAL | 480,000.00 | 398,946.72 | |
| LETRA TESOURO NACIONAL | | | 2,100,000.00 | 1,625,053.50 | | |
| LETRA TESOURO NACIONAL | | | 300,000.00 | 215,291.40 | | |
| LETRA TESOURO NACIONAL | | | 820,000.00 | 544,593.98 | | |
| LETRA TESOURO NACIONAL | | | 1,310,000.00 | 806,412.42 | | |
| NOTA DO TESOURO NACIONAL | | | 85,000.00 | 711,332.70 | | |
| NOTA DO TESOURO NACIONAL | | | 50,000.00 | 394,612.50 | | |
| NOTA DO TESOURO NACIONAL | | | 112,000.00 | 839,330.24 | | |
| 小計 | | | 銘柄数：8 | 5,257,000.00 | 5,535,573.46 | (155,549,614) |
| | | 組入時価比率：9.8% | | | 10.0% | |
| コロンビアペソ | コロンビアペソ | REPUBLIC OF COLOMBIA | 1,720,000,000.00 | 1,692,136,000.00 | | |
| | | REPUBLIC OF COLOMBIA | 810,000,000.00 | 872,856,000.00 | | |
| | 小計 | 銘柄数：2 | 2,530,000,000.00 | 2,564,992,000.00 | (85,927,232) | |
| | 組入時価比率：5.4% | | | 5.5% | | |
| ヌエボソル | ヌエボソル | BONOS DE TESORERIA | 200,000.00 | 181,376.80 | | |
| | | PERU BONO SOBERANO | 130,000.00 | 137,180.29 | | |
| | | PERU BONO SOBERANO | 500,000.00 | 446,637.00 | | |
| | 小計 | 銘柄数：3 | 830,000.00 | 765,194.09 | | |

| | | | | |
|-------|-------------------------|----------------|----------------|------|
| | | | (24,914,719) | |
| | 組入時価比率：1.6% | | 1.6% | |
| トルコリラ | TURKEY GOVERNMENT BOND | 300,000.00 | 277,200.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 300,000.00 | 286,050.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 800,000.00 | 766,800.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 610,000.00 | 611,220.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 330,000.00 | 315,150.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 550,000.00 | 498,300.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 570,000.00 | 473,955.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 220,000.00 | 218,130.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 210,000.00 | 193,620.00 | |
| | TURKEY GOVERNMENT BOND | 340,000.00 | 291,805.00 | |
| 小計 | 銘柄数：10 | 4,230,000.00 | 3,932,230.00 | |
| | 組入時価比率：9.5% | | (150,997,632) | 9.7% |
| フォロント | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 38,000,000.00 | 41,408,600.00 | |
| | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 44,000,000.00 | 50,527,400.00 | |
| | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 33,000,000.00 | 40,597,260.00 | |
| | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 24,000,000.00 | 30,061,440.00 | |
| | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 18,000,000.00 | 21,841,650.00 | |
| | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 27,000,000.00 | 32,214,780.00 | |
| 小計 | 銘柄数：6 | 184,000,000.00 | 216,651,130.00 | |
| | 組入時価比率：5.6% | | (88,675,307) | 5.7% |
| ズロチ | POLAND GOVERNMENT BOND | 580,000.00 | 616,250.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 620,000.00 | 650,876.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 280,000.00 | 315,420.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 1,030,000.00 | 1,009,606.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 670,000.00 | 764,470.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 500,000.00 | 591,250.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 280,000.00 | 335,554.80 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 310,000.00 | 337,977.50 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 700,000.00 | 722,150.10 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 260,000.00 | 247,973.96 | |
| 小計 | 銘柄数：10 | 5,230,000.00 | 5,591,528.36 | |
| | | | (161,427,423) | |

| | | | | |
|---------|--------------------------|--------------|---------------|---------------|
| | | 組入時価比率：10.2% | | 10.5% |
| ルーブル | RUSSIA FOREIGN BOND | | 50,000,000.00 | 48,142,100.00 |
| 小計 | 銘柄数：1 | | 50,000,000.00 | 48,142,100.00 |
| | | | | (70,768,887) |
| | | 組入時価比率：4.5% | | 4.6% |
| レイ | ROMANIA | | 620,000.00 | 666,159.00 |
| | ROMANIA | | 870,000.00 | 1,034,803.23 |
| 小計 | 銘柄数：2 | | 1,490,000.00 | 1,700,962.23 |
| | | | | (48,511,442) |
| | | 組入時価比率：3.1% | | 3.1% |
| リング | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 200,000.00 | 202,133.80 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 600,000.00 | 612,600.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 750,000.00 | 756,781.50 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 1,080,000.00 | 1,116,180.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 620,000.00 | 634,842.18 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 750,000.00 | 734,250.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 550,000.00 | 537,377.50 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 160,000.00 | 164,065.12 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 570,000.00 | 544,045.05 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 350,000.00 | 339,396.75 |
| 小計 | 銘柄数：10 | | 5,630,000.00 | 5,641,671.90 |
| | | | | (153,227,808) |
| | | 組入時価比率：9.6% | | 9.9% |
| パーツ | THAILAND GOVERNMENT BOND | | 1,000,000.00 | 1,021,599.00 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | | 5,100,000.00 | 5,483,535.29 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | | 5,200,000.00 | 5,502,593.20 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | | 8,700,000.00 | 9,363,488.10 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | | 10,800,000.00 | 11,938,968.00 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | | 1,200,000.00 | 1,461,327.60 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | | 6,700,000.00 | 7,543,597.00 |
| | THAILAND GOVERNMENT BOND | | 3,000,000.00 | 3,891,519.00 |
| 小計 | 銘柄数：8 | | 41,700,000.00 | 46,206,627.19 |
| | | | | (147,861,207) |
| | | 組入時価比率：9.3% | | 9.5% |
| フィリピンペソ | REPUBLIC OF PHILIPPINES | | 5,000,000.00 | 5,149,000.00 |
| 小計 | 銘柄数：1 | | 5,000,000.00 | 5,149,000.00 |

| | | | | |
|-----|--------------------------|-------------------|-------------------|---------------|
| | | | (12,409,090) | |
| | 組入時価比率：0.8% | | 0.8% | |
| ルピア | INDONESIA GOVERNMENT | 650,000,000.00 | 671,221,850.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 1,900,000,000.00 | 2,126,936,000.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 1,000,000,000.00 | 1,199,138,000.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 1,050,000,000.00 | 992,250,000.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 2,800,000,000.00 | 2,862,524,000.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 2,390,000,000.00 | 2,821,514,500.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 1,450,000,000.00 | 1,322,357,950.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 830,000,000.00 | 870,769,600.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 780,000,000.00 | 917,361,900.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 500,000,000.00 | 544,520,000.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 2,300,000,000.00 | 2,251,159,500.00 | |
| | INDONESIA GOVERNMENT | 2,000,000,000.00 | 1,990,898,000.00 | |
| 小計 | 銘柄数：12 | 17,650,000,000.00 | 18,570,651,300.00 | |
| | | | (159,707,601) | |
| | 組入時価比率：10.0% | | 10.4% | |
| ランド | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1,300,000.00 | 1,287,154.05 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 2,380,000.00 | 2,273,967.66 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1,640,000.00 | 1,504,565.52 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1,400,000.00 | 1,310,016.40 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 3,800,000.00 | 4,149,592.02 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 4,360,000.00 | 3,420,856.00 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 2,000,000.00 | 1,392,129.60 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1,100,000.00 | 968,990.00 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 2,250,000.00 | 1,556,902.35 | |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1,700,000.00 | 1,505,649.03 | |
| | 小計 | 銘柄数：10 | 21,930,000.00 | 19,369,822.63 |
| | | | (140,237,515) | |
| | 組入時価比率：8.8% | | 9.0% | |
| 合計 | | | 1,550,842,457 | |
| | | | (1,550,842,457) | |

(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

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

貸借対照表

| (単位：円) | |
|-----------------|----------------|
| (平成28年 2月17日現在) | |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 107,562,134 |
| コール・ローン | 160,773,123 |
| 投資証券 | 18,508,726,800 |
| 派生商品評価勘定 | 15,580,320 |
| 未収入金 | 25,045,600 |
| 未収配当金 | 121,508,324 |
| 未収利息 | 4 |
| 差入委託証拠金 | 2,142,000 |
| 流動資産合計 | 18,941,338,305 |
| 資産合計 | 18,941,338,305 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 12,632,100 |
| 未払解約金 | 41,405,486 |
| 流動負債合計 | 54,037,586 |
| 負債合計 | 54,037,586 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 9,858,123,946 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 9,029,176,773 |
| 元本等合計 | 18,887,300,719 |
| 純資産合計 | 18,887,300,719 |
| 負債純資産合計 | 18,941,338,305 |

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>投資証券 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 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p> |
| 2.費用・収益の計上基準 | <p>受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> |

| | |
|------------------------|---|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>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28年 2月17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 | 1.9159円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (19,159円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| |
|---|
| 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17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、REITの価格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、REIT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 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28年 2月17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

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 平成28年 2月17日現在 | |
|--------------------------------------|----------------|
| 期首 | 平成27年 2月18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 | 8,427,201,678円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 3,896,424,085円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,465,501,817円 |
| 期末元本額 | 9,858,123,946円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース） | 980,553,910円 |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース） | 3,650,954,794円 |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース） | 887,925,906円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 34,103,518円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 26,379,576円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 22,106,455円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 28,469,982円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 18,477,595円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 35,166,058円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 3,190,916円 |
| 野村インデックスファンド・J-REIT | 2,511,885,208円 |
| ネクストコア | 101,202,407円 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型 | 199,372,579円 |
| 野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け） | 262,512,745円 |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース） | 405,211,887円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 850,467円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用） | 481,497,215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） | 83,657,577円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 122,038,434円 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 470,162円 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 2,096,555円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

(単位:円)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|----------------------------|-----|-------------------------|-------|-------------|----|
| 投資証券 | 日本円 | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 816 | 344,352,000 | |
| | | MCUBS Mid City投資法人 投資証券 | 448 | 146,048,000 | |
| | | 森ヒルズリート投資法人 投資証券 | 2,936 | 471,521,600 | |
| | | 産業ファンド投資法人 投資証券 | 594 | 323,730,000 | |
| | | 大和ハウスリート投資法人 投資証券 | 591 | 277,474,500 | |
| | | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券 | 2,191 | 597,704,800 | |
| | | ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 588 | 180,516,000 | |
| | | アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 1,010 | 563,580,000 | |
| | | GLP投資法人 投資証券 | 4,371 | 529,328,100 | |
| | | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 862 | 196,536,000 | |
| | | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 2,917 | 683,161,400 | |
| | | 星野リゾート・リート投資法人 投資証券 | 131 | 166,239,000 | |
| | | SIA不動産投資法人 投資証券 | 127 | 54,229,000 | |
| | | イオンリート投資法人 投資証券 | 2,189 | 287,853,500 | |
| | | ヒューリックリート投資法人 投資証券 | 1,316 | 228,720,800 | |
| 日本リート投資法人 投資証券 | 660 | 183,084,000 | | | |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券 | 914 | 90,303,200 | | | |
| 日本ヘルスケア投資法人 投資証券 | 126 | 21,029,400 | | | |

| | | | |
|------------------------|-------|---------------|--|
| 積水ハウス・リート投資法人 投資証券 | 1,338 | 169,524,600 | |
| トーセイ・リート投資法人 投資証券 | 271 | 30,162,300 | |
| ケネディクス商業リート投資法人 投資証券 | 599 | 157,596,900 | |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券 | 203 | 20,503,000 | |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券 | 275 | 23,677,500 | |
| ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券 | 143 | 19,333,600 | |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 6,272 | 930,137,600 | |
| いちごホテルリート投資法人 投資証券 | 233 | 28,775,500 | |
| 日本ビルファンド投資法人 投資証券 | 2,379 | 1,508,286,000 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券 | 2,206 | 1,433,900,000 | |
| 日本リテールファンド投資法人 投資証券 | 4,301 | 1,110,948,300 | |
| オリックス不動産投資法人 投資証券 | 3,911 | 641,404,000 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券 | 1,471 | 632,530,000 | |
| プレミア投資法人 投資証券 | 2,219 | 288,691,900 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 投資証券 | 1,647 | 256,932,000 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券 | 327 | 146,659,500 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券 | 4,636 | 779,311,600 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 投資証券 | 2,224 | 434,792,000 | |
| インヴィンシブル投資法人 投資証券 | 5,382 | 373,510,800 | |
| フロンティア不動産投資法人 投資証券 | 836 | 428,868,000 | |
| 平和不動産リート投資法人 投資証券 | 1,710 | 152,019,000 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券 | 1,483 | 355,326,800 | |

| | | | | |
|----|-------------------------------|--------|----------------|--|
| | 福岡リート投資法人 投資証券 | 1,259 | 245,756,800 | |
| | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券 | 682 | 426,250,000 | |
| | 積水ハウス・S Iレジデンシャル投 資法人 投資証券 | 1,716 | 195,280,800 | |
| | いちごオフィスリート投資法人 投 資証券 | 2,387 | 196,211,400 | |
| | 大和証券オフィス投資法人 投資証 券 | 816 | 551,616,000 | |
| | 阪急リート投資法人 投資証券 | 1,007 | 130,507,200 | |
| | スタートプロシード投資法人 投資 証券 | 293 | 47,759,000 | |
| | トップリート投資法人 投資証券 | 297 | 124,740,000 | |
| | 大和ハウス・レジデンシャル投資法 人 投資証券 | 1,260 | 301,644,000 | |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券 | 5,585 | 494,272,500 | |
| | 日本賃貸住宅投資法人 投資証券 | 2,764 | 229,964,800 | |
| | ジャパンエクセレント投資法人 投 資証券 | 2,131 | 296,422,100 | |
| 小計 | 銘柄数：52 | 87,050 | 18,508,726,800 | |
| | 組入時価比率：98.0% | | 100.0% | |
| 合計 | | | 18,508,726,800 | |

(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

| 種類 | 平成28年 2月17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 | | | | |
| REIT指数先物取引 | | | | |
| 買建 | 361,557,000 | - | 377,160,000 | 15,580,320 |
| 合計 | 361,557,000 | - | 377,160,000 | 15,580,320 |

(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。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成28年 2月17日現在）

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 78,774,877 |
| コール・ローン | 5,158,729 |
| 投資証券 | 16,041,880,731 |
| 派生商品評価勘定 | 9,306 |
| 未収入金 | 1,067,298 |
| 未収配当金 | 54,070,162 |
| 差入委託証拠金 | 32,860,166 |
| 流動資産合計 | 16,213,821,269 |
| 資産合計 | 16,213,821,269 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 7,866,636 |
| 未払金 | 14,630,183 |
| 未払解約金 | 6,559,074 |
| その他未払費用 | 783,500 |
| 流動負債合計 | 29,839,393 |
| 負債合計 | 29,839,393 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 8,567,191,100 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 7,616,790,776 |
| 元本等合計 | 16,183,981,876 |
| 純資産合計 | 16,183,981,876 |
| 負債純資産合計 | 16,213,821,269 |

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>投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>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>受取配当金</p> |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年 2月17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 | 1.8891円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (18,891円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日 |
|---|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、REITの価格変動リスク、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、REIT指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> |

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年 2月17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 | |
| 投資証券 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| 派生商品評価勘定 | |
| デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており | |
| ます。 | |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 平成28年 2月17日現在 | |
|----------------------------------|----------------|
| 期首 | 平成27年 2月18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 | 8,588,642,760円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,483,803,584円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,505,255,244円 |
| 期末元本額 | 8,567,191,100円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 912,993,849円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 3,399,404,359円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 826,747,902円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 31,753,677円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 24,559,768円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 20,579,627円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 26,508,140円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 17,204,037円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 32,742,185円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 2,971,062円 |
| 野村インデックスファンド・外国REIT | 1,609,846,064円 |
| ネクストコア | 48,509,370円 |

| | |
|--------------------------------------|--------------|
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 173,515,572円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 456,017,046円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 791,868円 |
| ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA(適格機関投資家専用) | 654,656,448円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT(適格機関投資家専用) | 269,147,173円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 58,052,230円 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 376,307円 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 814,416円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 口数 | 評価額 | 備考 |
|------|-----|-------------------------------------|--------|--------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | ACADIA REALTY TRUST | 10,500 | 349,125.00 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 2,900 | 107,967.00 | |
| | | ALEXANDERS INC | 580 | 217,500.00 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 10,900 | 806,600.00 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 5,900 | 207,975.00 | |
| | | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 19,200 | 835,584.00 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 23,800 | 325,584.00 | |
| | | AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC | 4,700 | 72,709.00 | |
| | | APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 23,500 | 860,570.00 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 23,800 | 459,578.00 | |
| | | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 4,100 | 44,116.00 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC | 3,595 | 36,489.25 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 12,100 | 61,831.00 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 20,700 | 3,423,159.00 | |
| | | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 2,700 | 25,272.00 | |
| | | BOSTON PROPERTIES | 23,200 | 2,558,728.00 | |

| | | | |
|---------------------------------------|--------|--------------|--|
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 26,600 | 311,486.00 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 25,600 | 594,432.00 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 13,100 | 963,898.00 | |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES INC | 10,100 | 70,195.00 | |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 12,800 | 313,984.00 | |
| CARETRUST REIT INC ACQUIRES | 7,200 | 74,592.00 | |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES | 22,600 | 229,616.00 | |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 10,900 | 75,428.00 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 5,900 | 117,705.00 | |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 8,900 | 219,652.00 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 1,700 | 19,363.00 | |
| COLONY STARWOOD HOMES | 5,900 | 127,145.00 | |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 18,800 | 378,068.00 | |
| CORESITE REALTY CORP | 4,700 | 282,940.00 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 14,100 | 303,150.00 | |
| CORRECTIONS CORP OF AMERICA | 17,700 | 520,734.00 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 30,500 | 252,540.00 | |
| CUBESMART | 26,000 | 742,040.00 | |
| CYRUSONE INC | 9,700 | 347,357.00 | |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 13,400 | 468,464.00 | |
| DDR CORP | 45,800 | 744,250.00 | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 30,800 | 257,796.00 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 22,100 | 1,776,840.00 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 21,000 | 532,770.00 | |
| DUKE REALTY CORP | 52,400 | 1,036,472.00 | |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 10,000 | 340,400.00 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 1,800 | 30,942.00 | |
| EASTGROUP PROPERTIES | 4,900 | 253,820.00 | |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 9,200 | 357,880.00 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN | 18,000 | 271,980.00 | |
| EPR PROPERTIES | 9,500 | 582,825.00 | |
| EQUITY COMMONWEALTH | 19,200 | 502,080.00 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 12,100 | 815,782.00 | |
| EQUITY ONE INC | 13,800 | 371,634.00 | |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------------|--|
| EQUITY RESIDENTIAL | 55,000 | 3,969,900.00 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 10,000 | 1,986,300.00 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 18,600 | 1,543,428.00 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 10,500 | 1,563,555.00 | |
| FELCOR LODGING TRUST INC | 20,100 | 141,102.00 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 16,900 | 337,662.00 | |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 8,400 | 70,224.00 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 5,800 | 93,206.00 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 13,000 | 116,740.00 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 14,000 | 364,140.00 | |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 88,000 | 2,259,840.00 | |
| GEO GROUP INC/THE | 11,000 | 304,150.00 | |
| GETTY REALTY CORP | 3,921 | 70,970.10 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 3,100 | 42,532.00 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 25,600 | 186,624.00 | |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 10,500 | 143,640.00 | |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST | 64,000 | 454,400.00 | |
| HCP INC | 70,300 | 1,892,476.00 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 15,200 | 436,696.00 | |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 19,200 | 513,216.00 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 6,900 | 130,548.00 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 14,400 | 609,552.00 | |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 23,100 | 533,841.00 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 113,700 | 1,687,308.00 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 11,000 | 258,500.00 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 4,285 | 27,681.10 | |
| INLAND REAL ESTATE CORP | 13,600 | 144,432.00 | |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 18,300 | 113,460.00 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 28,900 | 827,407.00 | |
| KILROY REALTY CORP | 13,900 | 692,359.00 | |
| KIMCO REALTY CORP | 62,500 | 1,657,500.00 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 12,700 | 335,788.00 | |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 17,200 | 409,876.00 | |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 31,700 | 219,998.00 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 22,300 | 638,895.00 | |

| | | | |
|--|--------|--------------|--|
| LTC PROPERTIES INC | 5,300 | 224,720.00 | |
| MACERICH CO /THE | 20,300 | 1,532,650.00 | |
| MACK-CALI REALTY CORP | 13,700 | 250,847.00 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 36,300 | 379,698.00 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 11,400 | 1,006,848.00 | |
| MONMOUTH REIT-CLASS A | 9,100 | 96,278.00 | |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC | 24,600 | 199,506.00 | |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 20,500 | 917,990.00 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 3,500 | 58,205.00 | |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 5,200 | 300,612.00 | |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 12,700 | 109,982.00 | |
| NEW YORK REIT INC | 25,000 | 233,750.00 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 3,000 | 33,870.00 | |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 9,500 | 82,555.00 | |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP | 28,890 | 271,277.10 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 24,800 | 716,968.00 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 2,100 | 42,735.00 | |
| PARKWAY PROPERTIES INC | 12,300 | 151,905.00 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 11,000 | 277,310.00 | |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 10,400 | 186,264.00 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 16,200 | 272,322.00 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 22,200 | 388,056.00 | |
| POST PROPERTIES INC | 8,200 | 448,458.00 | |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 3,500 | 39,690.00 | |
| PROLOGIS INC | 79,200 | 2,943,072.00 | |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 2,900 | 258,825.00 | |
| PUBLIC STORAGE | 22,250 | 5,299,505.00 | |
| QTS REALTY TRUST INC CL A | 5,900 | 245,912.00 | |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 12,200 | 205,570.00 | |
| REALTY INCOME CORP | 37,800 | 2,261,196.00 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 14,200 | 1,003,514.00 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 14,800 | 269,360.00 | |
| RETAIL PROPERTIES OF AME-A | 35,800 | 530,198.00 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 8,600 | 144,050.00 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------------|--|
| RLJ LODGING TRUST | 19,200 | 358,656.00 | |
| ROUSE PROPERTIES INC | 5,600 | 97,048.00 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 7,800 | 379,314.00 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 9,800 | 157,584.00 | |
| SAUL CENTERS INC | 1,700 | 82,756.00 | |
| SELECT INCOME REIT | 9,700 | 182,166.00 | |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 35,900 | 512,293.00 | |
| SERITAGE GROWTH PROP-A REIT | 2,300 | 91,356.00 | |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 5,100 | 65,484.00 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 46,750 | 8,711,862.50 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 15,100 | 1,249,223.00 | |
| SOVRAN SELF STORAGE INC | 5,800 | 597,052.00 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 66,500 | 710,220.00 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 10,100 | 159,580.00 | |
| STORE CAPITAL CORP | 12,300 | 313,896.00 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 13,500 | 133,245.00 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 8,700 | 572,982.00 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 33,547 | 402,564.00 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 14,400 | 447,552.00 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 9,100 | 610,337.00 | |
| TERRENO REALTY CORP | 6,700 | 141,839.00 | |
| UDR INC | 39,700 | 1,344,242.00 | |
| UMH PROPERTIES INC | 3,600 | 33,552.00 | |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1,800 | 90,180.00 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 14,100 | 334,593.00 | |
| URSTADT BIDDLE-CL A | 3,900 | 77,103.00 | |
| VENTAS INC | 50,300 | 2,500,916.00 | |
| VEREIT INC | 136,100 | 1,019,389.00 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 26,800 | 2,208,856.00 | |
| WASHINGTON REAL ESTATE INV | 10,200 | 253,776.00 | |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 17,200 | 598,904.00 | |
| WELLTOWER INC | 53,400 | 2,988,264.00 | |
| WHITESTONE REIT | 4,200 | 42,420.00 | |
| WINTHROP REALTY TRUST | 5,400 | 68,580.00 | |
| WP CAREY INC | 14,600 | 787,232.00 | |

| | | | | |
|-----------------------------|---|------------|---------------|------------------|
| 小計 | WP GLIMCHER INC | 28,400 | 221,236.00 | |
| | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 16,600 | 238,874.00 | |
| | 銘柄数：156 | 2,965,818 | 99,627,818.05 | (11,386,463,324) |
| | 組入時価比率：70.4% | | 71.0% | |
| カナダドル | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 5,700 | 176,814.00 | |
| | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 10,000 | 113,100.00 | |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 3,500 | 147,000.00 | |
| | BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES | 2,000 | 52,600.00 | |
| | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 9,600 | 275,808.00 | |
| | CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 5,600 | 223,440.00 | |
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 7,000 | 83,930.00 | |
| | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 12,200 | 178,486.00 | |
| | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT | 6,000 | 78,120.00 | |
| | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 4,900 | 69,482.00 | |
| | DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 8,400 | 65,940.00 | |
| | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 3,400 | 25,398.00 | |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 8,400 | 132,384.00 | |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3,400 | 127,806.00 | |
| | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 21,000 | 394,590.00 | |
| | INNVEST REAL ESTATE INVESTME | 10,400 | 52,832.00 | |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 5,200 | 33,748.00 | |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 4,600 | 48,576.00 | |
| | MILESTONE APARTMENTS REAL ES | 5,300 | 81,408.00 | |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 1,700 | 18,768.00 | |
| | MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS | 4,300 | 57,104.00 | |
| | NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST | 3,100 | 50,933.00 | |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 3,400 | 30,056.00 | |
| | ONEREIT | 6,570 | 20,498.40 | |
| PLAZA RETAIL REIT | 7,500 | 33,600.00 | | |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE | 13,600 | 58,616.00 | | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 23,400 | 581,958.00 | | |

| | | | |
|------------------------|------------------------------------|--------------|-------------------------------|
| 小計 | SLATE RETAIL REIT | 1,600 | 21,296.00 |
| | SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9,700 | 290,806.00 |
| | 銘柄数：29 | 211,470 | 3,525,097.40 (290,503,276) |
| | 組入時価比率：1.8% | | 1.8% |
| ユーロ | AEDIFICA | 2,078 | 116,388.78 |
| | AFFINE | 900 | 13,275.00 |
| | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 15,300 | 175,491.00 |
| | ALTAREA | 320 | 52,320.00 |
| | ANF IMMOBILIER | 1,300 | 24,856.00 |
| | AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | 8,860 | 98,346.00 |
| | BEFIMMO S.C.A. | 3,200 | 157,888.00 |
| | BENI STABILI SPA | 162,000 | 97,200.00 |
| | COFINIMMO | 3,110 | 300,021.70 |
| | EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA | 7,080 | 266,172.60 |
| | FONCIERE DES MURS | 1,300 | 33,150.00 |
| | FONCIERE DES REGIONS | 6,670 | 483,374.90 |
| | GECINA SA | 5,490 | 601,978.50 |
| | GREEN REIT PLC | 99,709 | 133,310.93 |
| | HAMBORNER REIT AG | 9,826 | 86,576.88 |
| | HIBERNIA REIT PLC | 108,000 | 132,300.00 |
| | ICADE | 5,330 | 325,822.90 |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 43,604 | 30,522.80 |
| | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | 1,140 | 26,442.30 |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 52,800 | 57,235.20 |
| | KLEPIERRE | 28,416 | 1,058,353.92 |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 8,630 | 69,989.30 |
| | MERCIALYS | 2,580 | 48,865.20 |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 46,555 | 424,255.71 |
| | NSI NV | 20,070 | 74,941.38 |
| | RETAIL ESTATES | 770 | 58,905.00 |
| UNIBAIL RODAMCO-NA | 14,830 | 3,264,824.50 | |
| VASTNED RETAIL NV | 2,850 | 108,513.75 | |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 2,070 | 147,342.60 | |
| WERELDHAVE BELGIUM | 290 | 29,493.00 | |

| | | | |
|------|---------------------------------------|-----------|---------------------------------|
| | WERELDHAVE NV | 6,160 | 275,352.00 |
| 小計 | 銘柄数：31 | 671,238 | 8,773,509.85 (1,116,341,393) |
| | 組入時価比率：6.9% | | 7.0% |
| 英ポンド | ASSURA PLC | 238,700 | 124,362.70 |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 23,200 | 176,784.00 |
| | BRITISH LAND | 154,000 | 1,041,040.00 |
| | DERWENT LONDON PLC | 16,900 | 508,690.00 |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 55,200 | 60,720.00 |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 52,200 | 366,705.00 |
| | HAMMERSON PLC | 118,500 | 655,897.50 |
| | HANSTEEN HOLDINGS PLC | 108,500 | 115,010.00 |
| | INTU PROPERTIES PLC | 125,400 | 354,882.00 |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 120,400 | 1,224,468.00 |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 92,000 | 142,876.00 |
| | MCKAY SECURITIES PLC-ORD | 14,200 | 33,458.75 |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 66,800 | 71,142.00 |
| | REDEFINE INTERNATIONAL PLC | 150,000 | 64,185.00 |
| | REGIONAL REIT LTD | 26,000 | 26,780.00 |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 32,540 | 104,941.50 |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST | 78,700 | 44,859.00 |
| | SEGRO PLC | 112,500 | 471,150.00 |
| | SHAFTESBURY PLC | 42,600 | 359,331.00 |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 97,600 | 123,756.80 |
| | WORKSPACE GROUP PLC | 17,800 | 131,809.00 |
| 小計 | 銘柄数：21 | 1,743,740 | 6,202,848.25 (1,013,173,233) |
| | 組入時価比率：6.3% | | 6.3% |
| 豪ドル | 360 CAPITAL GROUP LTD | 42,450 | 39,903.00 |
| | 360 CAPITAL OFFICE FUND | 11,100 | 22,200.00 |
| | ABACUS PROPERTY GROUP | 39,000 | 116,220.00 |
| | ALE PROPERTY GROUP | 26,000 | 98,280.00 |
| | ARENA REIT | 35,220 | 59,169.60 |
| | ASPEN GROUP | 13,000 | 14,950.00 |
| | ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 7,000 | 38,010.00 |

| | | | | |
|----------------|---------------------------------|-----------|-----------------|--|
| | BWP TRUST | 73,000 | 229,950.00 | |
| | CHARTER HALL GROUP | 46,000 | 201,020.00 | |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 49,000 | 208,740.00 | |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 183,000 | 181,170.00 | |
| | DEXUS PROPERTY GROUP | 146,000 | 1,102,300.00 | |
| | FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 33,250 | 72,485.00 | |
| | GALILEO JAPAN TRUST | 18,170 | 35,976.60 | |
| | GDI PROPERTY GROUP | 70,300 | 59,052.00 | |
| | GOODMAN GROUP | 240,000 | 1,548,000.00 | |
| | GPT GROUP | 273,000 | 1,367,730.00 | |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 26,550 | 82,836.00 | |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | 22,680 | 56,926.80 | |
| | INDUSTRIA REIT | 18,400 | 39,744.00 | |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 22,285 | 58,163.85 | |
| | INVESTA OFFICE FUND | 94,000 | 372,240.00 | |
| | MIRVAC GROUP | 552,000 | 1,023,960.00 | |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 44,860 | 67,514.30 | |
| | SCENTRE GROUP | 805,000 | 3,654,700.00 | |
| | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 109,100 | 245,475.00 | |
| | STOCKLAND TRUST GROUP | 358,000 | 1,453,480.00 | |
| | VICINITY CENTRES | 492,000 | 1,490,760.00 | |
| | WESTFIELD CORP | 289,400 | 2,836,120.00 | |
| 小計 | 銘柄数：29 | 4,139,765 | 16,777,076.15 | |
| | | | (1,363,472,978) | |
| | 組入時価比率：8.4% | | 8.5% | |
| ニュージーランド ドル | ARGOSY PROPERTY LTD | 119,000 | 135,065.00 | |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 150,000 | 188,250.00 | |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 190,000 | 257,450.00 | |
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND | 158,571 | 195,042.33 | |
| | PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 67,525 | 109,390.50 | |
| | STRIDE PROPERTY LTD | 58,000 | 123,540.00 | |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 39,300 | 73,491.00 | |
| 小計 | 銘柄数：7 | 782,396 | 1,082,228.83 | |
| | | | (81,372,785) | |
| | 組入時価比率：0.5% | | 0.5% | |
| 香港ドル | CHAMPION REIT | 339,000 | 1,159,380.00 | |

| | | | | |
|----------|-------------------------------------|-----------|---------------|--|
| | FORTUNE REIT | 210,000 | 1,659,000.00 | |
| | LINK REIT | 339,500 | 14,598,500.00 | |
| | NEW CENTURY REIT | 65,000 | 184,600.00 | |
| | PROSPERITY REIT | 180,000 | 477,000.00 | |
| | REGAL REAL ESTATE INVESTMENT | 120,000 | 213,600.00 | |
| | SPRING REAL ESTATE INVESTMEN | 105,000 | 309,750.00 | |
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | 150,000 | 558,000.00 | |
| | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 160,000 | 625,600.00 | |
| 小計 | 銘柄数：9 | 1,668,500 | 19,785,430.00 | |
| | | | (290,252,258) | |
| | 組入時価比率：1.8% | | 1.8% | |
| シンガポールドル | AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT | 77,700 | 101,787.00 | |
| | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 129,000 | 101,910.00 | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 322,800 | 768,264.00 | |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 124,000 | 137,640.00 | |
| | CACHE LOGISTICS TRUST | 127,000 | 104,775.00 | |
| | CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | 153,300 | 75,883.50 | |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 309,300 | 426,834.00 | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 406,200 | 853,020.00 | |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 100,800 | 138,096.00 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 99,000 | 125,730.00 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 118,000 | 75,520.00 | |
| | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 83,500 | 97,277.50 | |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 90,100 | 171,190.00 | |
| | FRASERS COMMERCIAL TRUST | 85,000 | 102,000.00 | |
| | FRASERS HOSPITALITY TRUST | 88,000 | 65,560.00 | |
| | KEPPEL DC REIT | 130,600 | 133,212.00 | |
| | KEPPEL REIT | 275,300 | 251,899.50 | |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 282,800 | 86,254.00 | |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 193,200 | 273,378.00 | |
| | MAPLETREE GREATER CHINA COMM | 271,900 | 227,036.50 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 174,300 | 268,422.00 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 230,900 | 217,046.00 | |
| | QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 62,350 | 41,151.00 | |

| | | | | |
|------|------------------------------|-----------|------------------|--|
| | QUE HOSPITALITY TRUST | 117,100 | 85,483.00 | |
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 59,000 | 131,570.00 | |
| | SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 94,200 | 59,346.00 | |
| | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 97,000 | 68,870.00 | |
| | SPH REIT | 120,500 | 111,462.50 | |
| | STARHILL GLOBAL REIT | 209,900 | 155,326.00 | |
| | SUNTEC REIT | 385,300 | 622,259.50 | |
| 小計 | 銘柄数：30 | 5,018,050 | 6,078,203.00 | |
| | | | (493,793,211) | |
| | 組入時価比率：3.1% | | 3.1% | |
| 新シケル | REIT 1 LTD | 22,490 | 222,201.20 | |
| 小計 | 銘柄数：1 | 22,490 | 222,201.20 | |
| | | | (6,508,273) | |
| | 組入時価比率：0.0% | | 0.0% | |
| 合計 | | | 16,041,880,731 | |
| | | | (16,041,880,731) | |

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 平成28年 2月17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 | | | | |
| REIT指数先物取引 | | | | |
| 買建 | 142,304,936 | - | 134,438,300 | 7,866,636 |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 売建 | 3,780,546 | - | 3,771,240 | 9,306 |
| 米ドル | 3,780,546 | - | 3,771,240 | 9,306 |
| 合計 | - | - | - | 7,857,330 |

(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。

野村マネー マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成28年 2月17日現在）

| | |
|-----------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 2,984,505,119 |
| コール・ローン | 4,460,939,831 |
| 地方債証券 | 3,346,981,884 |
| 特殊債券 | 6,761,067,014 |
| 社債券 | 2,405,624,145 |
| コマーシャル・ペーパー | 2,399,711,871 |
| 未収利息 | 24,191,998 |
| 前払費用 | 7,692,811 |
| 流動資産合計 | 22,390,714,673 |
| 資産合計 | 22,390,714,673 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 214,773,009 |
| 未払解約金 | 934,000 |
| 流動負債合計 | 215,707,009 |
| 負債合計 | 215,707,009 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 21,717,696,368 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 457,311,296 |
| 元本等合計 | 22,175,007,664 |
| 純資産合計 | 22,175,007,664 |
| 負債純資産合計 | 22,390,714,673 |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 平成28年 2月17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 | 1.0211円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (10,211円) |

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日 |
|--|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年 2月17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 |
| 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。 |
| コマーシャル・ペーパー （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。 |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 平成28年 2月17日現在 | |
|---------------------------------------|-----------------|
| 期首 | 平成27年 2月18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 | 14,738,082,536円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 13,056,517,064円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 6,076,903,232円 |
| 期末元本額 | 21,717,696,368円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バンクローンファンド（為替ヘッジあり）2014-09 | 98,039,216円 |
| バンクローンファンド（為替ヘッジあり）2015-06 | 146,986,772円 |
| 野村アフリカ株投資 マネープール・ファンド | 4,323,817円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型 | 54,908,910円 |
| 野村新中国株投資 マネープール・ファンド | 19,445,120円 |
| 野村日本ブランド株投資（マネープールファンド）年2回決算型 | 218,543,313円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型 | 9,867,582円 |
| 野村ピクテ・ジェネリック&ゲノム マネープール・ファンド | 38,481,729円 |
| 野村・グリーン・テクノロジー マネープール・ファンド | 1,511,406円 |
| 野村新興国消費関連株投信 マネープール・ファンド | 6,245,303円 |
| 野村世界業種別投資シリーズ（マネープール・ファンド） | 21,174,299円 |
| ノムラ・アジア・シリーズ（マネープール・ファンド） | 1,998,458,414円 |
| 野村新エマージング債券投信（マネープールファンド）年2回決算型 | 5,595,320円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型 | 8,788,959円 |
| 野村グローバルC B投信（マネープールファンド）年2回決算型 | 6,395,351円 |
| 野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（マネープールファンド）年2回決算型 | 146,989,156円 |
| 野村日本スマートシティ株投資 マネープールファンド | 17,294,315円 |
| ネクストコア | 343,183,624円 |
| 野村世界高金利通貨投信 | 151,953,753円 |
| 野村新世界高金利通貨投信 | 982,608円 |
| コインの未来（毎月分配型） | 3,965,894円 |
| コインの未来（年2回分配型） | 991,474円 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（欧州通貨コース） | 982,609円 |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円コース） | 982,609円 |

| | |
|-------------------------------------|----------|
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（豪ドルコース） | 982,609円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）年2回決算型 | 9,826円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村日本ブランド株投資（円コース）毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村日本ブランド株投資（円コース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース | 982,608円 |
| 野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース | 98,260円 |
| 野村新エマージング債券投信（円コース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信（米ドルコース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村新エマージング債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村新エマージング債券投信（中国元コース）毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村新エマージング債券投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信（円コース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信（米ドルコース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）年2回決算型 | 98,260円 |
| 野村新エマージング債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型 | 982,608円 |

| | |
|--------------------------------------|-------------|
| 野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型 | 9,826円 |
| 野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型 | 984,834円 |
| 野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型 | 984,834円 |
| 野村高金利国際機関債投信(毎月分配型) | 49,354,623円 |
| 野村アジアC B投信(毎月分配型) | 982,608円 |
| 野村グローバルC B投信(円コース)毎月分配型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)毎月分配型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(円コース)年2回決算型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)年2回決算型 | 984,543円 |
| 野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)年2回決算型 | 984,543円 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け) | 10,000円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型 | 984,252円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型 | 984,252円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型 | 984,252円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型 | 984,252円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 984,252円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型 | 984,252円 |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型 | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型 | 982,609円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型 | 982,607円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型 | 98,261円 |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型 | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型 | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型 | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型 | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型 | 983,768円 |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型 | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型 | 983,672円 |

| | |
|--------------------------------------|----------|
| 野村テンプレトン・トータル・リターン Aコース | 983,381円 |
| 野村テンプレトン・トータル・リターン Bコース | 98,261円 |
| 野村テンプレトン・トータル・リターン Cコース | 983,381円 |
| 野村テンプレトン・トータル・リターン Dコース | 983,381円 |
| 野村高金利国際機関債投信（年2回決算型） | 1,967円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 98,262円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,609円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 98,261円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型 | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型 | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 983,091円 |
| ノムラ・アジア・コレクション（短期アジア現地通貨建て債券 Aコース） | 982,995円 |
| ノムラ・アジア・コレクション（短期アジア現地通貨建て債券 Bコース） | 98,260円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,898円 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型 | 982,801円 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型 | 491,401円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（円コース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,608円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（円コース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,608円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型 | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型 | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,415円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）毎月分配型 | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型 | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）年2回決算型 | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,029円 |
| 野村カルミニャック・ファンド Aコース | 981,547円 |
| 野村カルミニャック・ファンド Bコース | 981,547円 |
| 野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）毎月分配型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）毎月分配型 | 1,963円 |
| 野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）毎月分配型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）毎月分配型 | 588,871円 |
| 野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）毎月分配型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（中国元コース）毎月分配型 | 196,291円 |
| 野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型 | 294,436円 |
| 野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）毎月分配型 | 48,092円 |
| 野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）年2回決算型 | 981,451円 |

| | |
|------------------------------------|------------|
| 野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型 | 4,908円 |
| 野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型 | 196,925円 |
| 野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型 | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型 | 98,146円 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型 | 196,291円 |
| 野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型 | 294,436円 |
| 野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型 | 13,741円 |
| 野村エマージング債券プレミアム毎月分配型 | 981,451円 |
| 野村エマージング債券プレミアム年2回決算型 | 981,451円 |
| ノムラ THE USA Aコース | 981,258円 |
| ノムラ THE USA Bコース | 981,258円 |
| ノムラ THE EUROPE Aコース | 98,117円 |
| ノムラ THE EUROPE Bコース | 98,117円 |
| 米国変動好金利ファンド Aコース | 8,829,589円 |
| 米国変動好金利ファンド Bコース | 981,066円 |
| 野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型 | 9,809円 |
| 野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型 | 9,809円 |
| 野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型 | 9,809円 |
| 野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型 | 9,809円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型 | 9,808円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型 | 9,808円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型 | 9,808円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型 | 9,808円 |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型 | 9,807円 |
| 野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型 | 9,807円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型 | 9,807円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型 | 9,807円 |
| 野村グローバルボンド投信 Aコース | 98,049円 |
| 野村グローバルボンド投信 Bコース | 980,489円 |
| 野村グローバルボンド投信 Cコース | 98,049円 |
| 野村グローバルボンド投信 Dコース | 980,489円 |
| 野村グローバルボンド投信 Eコース | 98,049円 |
| 野村グローバルボンド投信 Fコース | 980,489円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型 | 9,805円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型 | 9,805円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型 | 9,805円 |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型 | 9,805円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型 | 9,803円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型 | 980,297円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型 | 980,297円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型 | 9,803円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型 | 980,297円 |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型 | 9,803円 |
| 野村新興国高配当株トリプルウイング ブラジルリアル毎月分配型 | 9,803円 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース) | 9,803円 |
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース) | 9,803円 |

| | |
|--|----------------|
| ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース) | 9,803円 |
| ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け) | 9,801円 |
| 野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け) | 9,801円 |
| ノムラ THE ASIA Aコース | 97,992円 |
| ノムラ THE ASIA Bコース | 979,912円 |
| グローバル・ストック Aコース | 97,953円 |
| グローバル・ストック Bコース | 979,528円 |
| グローバル・ストック Cコース | 97,953円 |
| グローバル・ストック Dコース | 979,528円 |
| 第1回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第2回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第3回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第4回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第5回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第6回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第7回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第8回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第9回 野村短期公社債ファンド | 98,260円 |
| 第10回 野村短期公社債ファンド | 98,260円 |
| 第11回 野村短期公社債ファンド | 98,261円 |
| 第12回 野村短期公社債ファンド | 982,607円 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用) | 5,276,885,002円 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付) | 3,422,819,779円 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Zプライス(適格機関投資家専用) | 2,296,160,091円 |
| 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用) | 4,635,437,085円 |
| 野村日経225 ショート・ファンド2(適格機関投資家専用) | 636,818円 |
| 日本株インカムプラス(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家転売制限付) | 1,186,053,936円 |
| 日本株インカムプラス(公社債運用移行型)1308(適格機関投資家転売制限付) | 1,019,201,436円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 379,067,282円 |
| 野村DCテンプレトン・トータル・リターン Aコース | 9,818円 |
| 野村DCテンプレトン・トータル・リターン Bコース | 9,818円 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 4,553,821円 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 4,396,962円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

（単位：円）

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-------|-----|---------------------|-------------|-------------|----|
| 地方債証券 | 日本円 | 東京都 公募第634回 | 1,000,000 | 1,005,956 | |
| | | 東京都 公募第636回 | 101,500,000 | 102,167,940 | |
| | | 北海道 公募平成17年度第12回 | 50,000,000 | 50,015,977 | |
| | | 北海道 公募平成18年度第7回 | 1,500,000 | 1,519,712 | |
| | | 北海道 公募（5年）平成23年度第2回 | 7,200,000 | 7,208,480 | |
| | | 神奈川県 公募第138回 | 11,000,000 | 11,017,380 | |
| | | 神奈川県 公募第45回 | 200,000,000 | 200,087,234 | |
| | | 神奈川県 公募第46回 | 115,500,000 | 115,551,184 | |
| | | 神奈川県 公募第47回 | 450,000,000 | 450,153,960 | |
| | | 神奈川県 公募（5年）第49回 | 101,700,000 | 101,886,693 | |
| | | 大阪府 公募第287回 | 80,000,000 | 80,031,164 | |
| | | 大阪府 公募第288回 | 200,000,000 | 200,368,488 | |
| | | 大阪府 公募第294回 | 12,000,000 | 12,136,860 | |
| | | 大阪府 公募第295回 | 1,000,000 | 1,012,249 | |
| | | 大阪府 公募（5年）第71回 | 430,000,000 | 430,333,404 | |
| | | 大阪府 公募（5年）第72回 | 3,000,000 | 3,003,026 | |
| | | 大阪府 公募（5年）第73回 | 102,000,000 | 102,121,920 | |
| | | 大阪府 公募（5年）第77回 | 100,000,000 | 100,241,724 | |
| | | 京都府 公募平成23年度第1回 | 7,000,000 | 7,009,838 | |
| | | 兵庫県 公募平成18年度第7回 | 80,000,000 | 80,707,924 | |
| | | 静岡県 公募平成17年度第7回 | 14,100,000 | 14,121,009 | |
| | | 埼玉県 公募平成18年度第1回 | 13,500,000 | 13,543,684 | |
| | | 福岡県 公募平成18年度第3回 | 1,000,000 | 1,012,586 | |
| | | 千葉県 公募平成18年度第4回 | 8,600,000 | 8,700,010 | |
| | | 千葉県 公募平成22年度第13回 | 66,000,000 | 66,009,038 | |
| | | 新潟県 公募平成18年度第1回 | 6,500,000 | 6,555,219 | |
| | | 群馬県 公募第3回 | 9,000,000 | 9,121,997 | |
| | | 大分県 公募平成18年度第1回 | 23,000,000 | 23,274,075 | |
| | | 共同発行市場地方債 公募第35回 | 300,000,000 | 300,102,580 | |
| | | 共同発行市場地方債 公募第36回 | 2,000,000 | 2,003,092 | |
| | | 共同発行市場地方債 公募第38回 | 5,000,000 | 5,025,302 | |
| | | 共同発行市場地方債 公募第39回 | 2,000,000 | 2,012,516 | |

| | | | |
|------|-----------------------------|---------------|------------------------|
| | 共同発行市場地方債 公募第40回 | 8,000,000 | 8,068,236 |
| | 共同発行市場地方債 公募第41回 | 6,000,000 | 6,058,628 |
| | 共同発行市場地方債 公募第43回 | 4,000,000 | 4,045,760 |
| | 福島県 公募平成22年度第2回 | 400,000,000 | 400,031,236 |
| | 熊本県 公募平成18年度第2回 | 7,500,000 | 7,587,521 |
| | 大阪市 公募平成17年度第13回 | 200,000,000 | 200,307,125 |
| | 名古屋市 公募第455回 | 1,000,000 | 1,006,104 |
| | 名古屋市 公募第456回 | 16,000,000 | 16,160,340 |
| | 京都市 公募平成17年度第4回 | 1,000,000 | 1,001,886 |
| | 京都市 公募平成23年度第1回 | 90,000,000 | 90,181,320 |
| | 京都市 公募平成23年度第3回 | 4,000,000 | 4,006,596 |
| | 札幌市 公募(5年)平成23年度第5回 | 12,900,000 | 12,922,367 |
| | 川崎市 公募(5年)第29回 | 12,200,000 | 12,218,288 |
| | 北九州市 公募(5年)平成23年度第1回 | 7,000,000 | 7,011,706 |
| | 仙台市 公募平成23年度第1回 | 57,410,000 | 57,559,802 |
| | 鹿児島県 公募平成18年度第1回 | 3,200,000 | 3,240,131 |
| | 鹿児島県 公募(5年)平成23年度第1回 | 6,500,000 | 6,512,617 |
| 小計 | 銘柄数: 49 組入時価比率: 15.1% | 3,341,810,000 | 3,346,981,884 22.4% |
| 合計 | | | 3,346,981,884 |
| 特殊債券 | 日本円 | | |
| | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第34回 | 200,000,000 | 200,115,470 |
| | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第13回 | 100,000,000 | 100,624,075 |
| | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5回 | 558,000,000 | 558,226,076 |
| | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第11回 | 170,000,000 | 170,549,695 |
| | 公営企業債券 政府保証第861回 | 29,000,000 | 29,036,380 |
| | 公営企業債券 政府保証第862回 | 117,000,000 | 117,350,015 |
| | 地方公共団体金融機構債券 2年第1回 | 800,000,000 | 800,036,752 |
| | 公営企業債券 第19回財投機関債 | 100,000,000 | 100,189,395 |
| | 首都高速道路 第8回 | 140,000,000 | 140,287,721 |
| | 首都高速道路債券 政府保証第1回 | 400,000,000 | 400,678,724 |

| | | | | | |
|-----|-----|-----------------------------------|---------------|------------------------|--|
| | | 都市再生債券 財投機関債第75回 | 100,000,000 | 100,047,192 | |
| | | 関西国際空港社債 財投機関債第31回 | 70,000,000 | 70,169,490 | |
| | | 中部国際空港債券 政府保証第17回 | 300,000,000 | 300,000,000 | |
| | | 商工債券 利付第733回い号 | 300,000,000 | 300,502,790 | |
| | | 商工債券 利付第734回い号 | 170,000,000 | 170,351,600 | |
| | | 商工債券 利付第736回い号 | 300,000,000 | 300,680,199 | |
| | | 商工債券 利付第737回い号 | 100,000,000 | 100,253,197 | |
| | | 農林債券 利付第729回い号 | 200,000,000 | 200,037,953 | |
| | | 農林債券 利付第731回い号 | 100,000,000 | 100,127,648 | |
| | | 農林債券 利付第733回い号 | 180,000,000 | 180,303,250 | |
| | | 農林債券 利付第735回い号 | 100,000,000 | 100,188,870 | |
| | | 農林債券 利付第736回い号 | 100,000,000 | 100,252,245 | |
| | | 農林債券 利付第737回い号 | 30,000,000 | 30,072,846 | |
| | | しんきん中金債券 利付第258回 | 200,000,000 | 200,251,769 | |
| | | 商工債券 利付(3年)第158回 | 100,000,000 | 100,008,625 | |
| | | 商工債券 利付(3年)第160回 | 100,000,000 | 100,050,230 | |
| | | 商工債券 利付(3年)第161回 | 200,000,000 | 200,122,243 | |
| | | 商工債券 利付(3年)第164回 | 200,000,000 | 200,145,759 | |
| | | 商工債券 利付(10年)第2回 | 100,000,000 | 100,010,170 | |
| | | 中日本高速道路社債 財投機関債第37回 | 400,000,000 | 400,042,411 | |
| | | 中日本高速道路社債 第40回 | 400,000,000 | 400,095,380 | |
| | | 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第46回 | 390,000,000 | 390,258,844 | |
| | 小計 | 銘柄数: 32 組入時価比率: 30.5% | 6,754,000,000 | 6,761,067,014 45.4% | |
| | 合計 | | | 6,761,067,014 | |
| 社債券 | 日本円 | みずほコーポレート銀行 第25回 特定社債間限定同順位特約付 | 300,000,000 | 300,336,658 | |
| | | みずほコーポレート銀行 第26回 特定社債間限定同順位特約付 | 300,000,000 | 300,562,666 | |
| | | みずほコーポレート銀行 第27回 特定社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 200,652,000 | |
| | | 三菱東京UFJ銀行 第126回特 定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,198,048 | |
| | | 三菱東京UFJ銀行 第129回特 定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,288,872 | |

| | | | | | |
|-----------------|-----|------------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | | トヨタファイナンス 第19回社債 間限定同等特約付 | 200,000,000 | 200,320,640 | |
| | | 三菱UFJリース 第13回社債間 限定同順位特約付 | 500,000,000 | 500,629,818 | |
| | | 三菱UFJリース 第15回社債間 限定同順位特約付 | 400,000,000 | 401,838,388 | |
| | | 三菱UFJリース 第22回社債間 限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,003,250 | |
| | | 三井不動産 第25回社債間限定同 順位特約付 | 100,000,000 | 100,129,355 | |
| | | 東邦瓦斯 第30回社債間限定同順 位特約付 | 100,000,000 | 100,664,450 | |
| | 小計 | 銘柄数：11 組入時価比率：10.8% | 2,400,000,000 | 2,405,624,145 16.1% | |
| | 合計 | | | 2,405,624,145 | |
| コマーシャル・ ペーパー | 日本円 | フォレストコープ | 100,000,000 | 99,993,991 | |
| | | フォレストコープ | 100,000,000 | 99,978,739 | |
| | | フォレストコープ | 100,000,000 | 99,964,964 | |
| | | フォレストコープ | 100,000,000 | 99,948,727 | |
| | | みずほ証券 | 100,000,000 | 99,998,036 | |
| | | みずほ証券 | 100,000,000 | 99,991,535 | |
| | | みずほ証券 | 200,000,000 | 199,979,920 | |
| | | 三井住友F&L | 200,000,000 | 199,991,544 | |
| | | 三井住友F&L | 200,000,000 | 199,956,139 | |
| | | 三井住友F&L | 200,000,000 | 199,972,868 | |
| | | 三井住友F&L | 200,000,000 | 199,991,287 | |
| | | 三井住友信託銀行 | 100,000,000 | 99,996,259 | |
| | | 三井住友信託銀行 | 200,000,000 | 199,989,150 | |
| | | 三井住友信託銀行 | 200,000,000 | 199,986,451 | |
| | | 三井住友信託銀行 | 200,000,000 | 199,973,435 | |
| | | 三井住友信託銀行 | 100,000,000 | 99,998,826 | |
| | | 小計 | 銘柄数：16 組入時価比率：10.8% | 2,400,000,000 | 2,399,711,871 16.1% |
| 合計 | | | 2,399,711,871 | | |
| 合計 | | | 14,913,384,914 | | |

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村DC運用戦略ファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 7,423,224,792円 |
| 負債総額 | 2,548,675,103円 |
| 純資産総額（ - ） | 4,874,549,689円 |
| 発行済口数 | 4,548,672,065口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0716円 |

（参考）国内株式マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 327,212,150,530円 |
| 負債総額 | 43,390,615,613円 |
| 純資産総額（ - ） | 283,821,534,917円 |
| 発行済口数 | 226,101,018,220口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2553円 |

（参考）国内債券マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 8,466,921,988円 |
| 負債総額 | 69,995,589円 |
| 純資産総額（ - ） | 8,396,926,399円 |
| 発行済口数 | 6,203,831,215口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3535円 |

（参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 328,573,090,974円 |
| 負債総額 | 2,141,657,084円 |
| 純資産総額（ - ） | 326,431,433,890円 |
| 発行済口数 | 162,042,393,593口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.0145円 |

（参考）外国債券マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 651,156,466,523円 |
| 負債総額 | 2,462,524,654円 |
| 純資産総額（ - ） | 648,693,941,869円 |
| 発行済口数 | 288,024,418,427口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.2522円 |

（参考）新興国株式マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 14,427,968,615円 |
| 負債総額 | 558,148,932円 |
| 純資産総額（ - ） | 13,869,819,683円 |
| 発行済口数 | 14,626,243,220口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.9483円 |

（参考）新興国債券マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 7,150,451,527円 |
| 負債総額 | 122,101,553円 |
| 純資産総額（ - ） | 7,028,349,974円 |
| 発行済口数 | 4,144,399,017口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.6959円 |

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 2,045,343,107円 |
| 負債総額 | 113,622,919円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,931,720,188円 |
| 発行済口数 | 1,581,753,619口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2213円 |

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 21,292,307,458円 |
| 負債総額 | 942,395,845円 |
| 純資産総額（ - ） | 20,349,911,613円 |
| 発行済口数 | 10,040,902,301口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.0267円 |

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 18,938,514,782円 |
| 負債総額 | 193,549,595円 |
| 純資産総額（ - ） | 18,744,965,187円 |
| 発行済口数 | 8,894,795,502口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.1074円 |

（参考）野村マネー マザーファンド

平成28年 3月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 21,880,961,237円 |
| 負債総額 | 802,171,000円 |
| 純資産総額（ - ） | 21,078,790,237円 |
| 発行済口数 | 20,643,201,487口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0211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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、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、受託者と協議のうえ、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収益分配金の支払い、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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

平成28年3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年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

代表執行役・執行役

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

委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成28年2月29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 | 892 | 17,121,747 |
| 単位型株式投資信託 | 52 | 228,903 |
| 追加型公社債投資信託 | 18 | 6,407,538 |
| 単位型公社債投資信託 | 197 | 1,442,408 |
| 合計 | 1,159 | 25,200,596 |

3【委託会社等の経理状況】

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

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成26年4月1日から平成27年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(平成27年4月1日から平成27年9月30日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (平成26年3月31日) | 当事業年度 (平成27年3月31日) |
|---------|----------|-----------------------|-----------------------|
| | | 金額(百万円) | 金額(百万円) |
| (資産の部) | | | |
| 流動資産 | | | |
| 現金・預金 | | 247 | 411 |
| 金銭の信託 | | 51,758 | 56,824 |
| 有価証券 | | 11,800 | 17,100 |
| 前払金 | | 0 | 15 |
| 前払費用 | | 28 | 29 |
| 未収入金 | | 287 | 330 |
| 未収委託者報酬 | | 10,741 | 12,679 |
| 未収収益 | | 5,999 | 7,436 |
| 繰延税金資産 | | 2,010 | 2,594 |
| その他 | | 159 | 73 |
| 貸倒引当金 | | 8 | 9 |
| 流動資産計 | | 83,026 | 97,486 |
| 固定資産 | | | |

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

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (平成26年3月31日) | | 当事業年度 (平成27年3月31日) | |
|------------|----------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
| | | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| (負債の部) | | | | | |
| 流動負債 | | | | | |
| 預り金 | | | 106 | | 118 |
| 未払金 | 1 | | 9,720 | | 11,602 |
| 未払収益分配金 | | 2 | | 1 | |
| 未払償還金 | | 33 | | 32 | |
| 未払手数料 | | 4,493 | | 4,883 | |
| その他未払金 | | 5,191 | | 6,684 | |
| 未払費用 | 1 | | 8,420 | | 10,221 |
| 未払法人税等 | | | 1,960 | | 1,961 |
| 賞与引当金 | | | 3,984 | | 4,558 |
| 外国税支払損失引当金 | | | - | | 1,721 |
| 流動負債計 | | | 24,191 | | 30,182 |
| 固定負債 | | | | | |
| 退職給付引当金 | | | - | | 2,467 |
| 時効後支払損引当金 | | | 505 | | 521 |
| 繰延税金負債 | | | 3,211 | | 747 |
| 固定負債計 | | | 3,716 | | 3,735 |
| 負債合計 | | | 27,907 | | 33,918 |
| (純資産の部) | | | | | |
| 株主資本 | | | | | |
| 資本金 | | | 80,249 | | 90,092 |
| 資本剰余金 | | | 17,180 | | 17,180 |
| 資本剰余金 | | | 11,729 | | 11,729 |
| 資本準備金 | | 11,729 | | 11,729 | |
| 利益剰余金 | | | 51,339 | | 61,182 |
| 利益剰余金 | | | 685 | | 685 |
| その他利益剰余金 | | 50,654 | | 60,497 | |
| 別途積立金 | | 24,606 | | 24,606 | |

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

(2) 【損益計算書】

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

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日) | | 当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日) | |
|---------------|----------|---|--------|---|--------|
| | | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| 営業外収益 | | | | | |
| 受取配当金 | 1 | 3,680 | | 4,038 | |
| 収益分配金 | | 0 | | - | |
| 受取利息 | | 3 | | 5 | |
| 金銭の信託運用益 | | 379 | | 347 | |
| その他 | | 336 | | 366 | |
| 営業外収益計 | | | 4,400 | | 4,756 |
| 営業外費用 | | | | | |
| 支払利息 | 1 | 11 | | - | |
| 時効後支払損引当金繰入額 | | 24 | | 28 | |
| その他 | | 132 | | 137 | |
| 営業外費用計 | | | 169 | | 166 |
| 經常利益 | | | 22,151 | | 27,146 |
| 特別利益 | | | | | |
| 投資有価証券等売却益 | | - | | 794 | |
| 株式報酬受入益 | | 203 | | 142 | |
| 特別利益計 | | | 203 | | 936 |
| 特別損失 | | | | | |
| 投資有価証券償還損 | | 51 | | - | |
| 投資有価証券等評価損 | | 2 | | 91 | |
| 関係会社株式評価損 | | 2,491 | | - | |
| 固定資産除却損 | 3 | 17 | | 357 | |
| 外国税支払損失引当金繰入額 | | - | | 1,721 | |
| 特別損失計 | | | 2,562 | | 2,169 |
| 税引前当期純利益 | | | 19,792 | | 25,913 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | | 7,608 | | 8,433 |
| 法人税等調整額 | | | 90 | | 2,488 |
| 当期純利益 | | | 12,273 | | 19,967 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

(単位：百万円)

| | 株主資本 | | | | | | | |
|-------|--------|-----------------------|---------------------------------|-----------|-----------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益 準備金 | 利益剰余金 | | | 株 主 資 本 合 計 |
| | | 資 本 準 備 金 | 資 本 剰 余 金 合 計 | | その他利益剰余金 | | 利 益 剰 余 金 合 計 | |
| | | | | | 別 途 積 立 金 | 繰 越 利 益 剰 余 金 | | |
| 当期首残高 | 17,180 | 11,729 | 11,729 | 685 | 24,606 | 17,740 | 43,032 | 71,942 |

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

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

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

[会計方針の変更]

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

[注記事項]

貸借対照表関係

| 前事業年度末 (平成26年3月31日) | 当事業年度末 (平成27年3月31日) |
|--|--|
| 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 4,601百万円 未払費用 1,607 | 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 未払費用 1,411 |
| 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 565百万円 器具備品 2,849 合計 3,414 | 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 器具備品 3,052 合計 3,659 |

損益計算書関係

| 前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日) | 当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) |
|---|---|
| 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 3,568百万円 支払利息 5 | 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 支払利息 - |

| | |
|---|--|
| 2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されて おります。 | 2. 役員報酬の範囲額 (同左) |
| 3. 固定資産除却損 器具備品 6百万円 ソ フ ト ウ エ 11 ア 合計 17 | 3. 固定資産除却損 器具備品 15百万円 ソ フ ト ウ エ 342 ア 合計 357 |

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成25年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

| | |
|----------|------------|
| 配当金の総額 | 3,966百万円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 770円 |
| 基準日 | 平成25年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成25年6月21日 |

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

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

| | |
|--------|-----------|
| 配当金の総額 | 10,043百万円 |
|--------|-----------|

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

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

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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26年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,080百万円、関係会社株式6,545百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について2,494百万円減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|---------|--------|-------------|--------------|------|
| 預金 | 247 | - | - | - |
| 金銭の信託 | 51,758 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 10,741 | - | - | - |
| 有価証券 | 11,800 | - | - | - |
| 合計 | 74,547 | - | - | - |

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成26年3月31日)

| 区分 | 貸借対照表 計上額 (百万円) | 時価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|--------|-----------------------|-------------|-------------|
| 関連会社株式 | 3,064 | 141,441 | 138,377 |
| 合計 | 3,064 | 141,441 | 138,377 |

4．その他有価証券(平成26年3月31日)

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

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

| 区分 | 売却額(百万円) | 売却益の合計額(百万円) | 売却損の合計額(百万円) |
|------|----------|--------------|--------------|
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | 761 | - | 51 |
| 合計 | 761 | - | 51 |

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

当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

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

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

4．その他有価証券(平成27年3月31日)

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

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

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

退職給付関係

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

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

及び前払年金費用の調整表

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

| | |
|-----------|------|
| 割引率 | 1.6% |
| 長期期待運用収益率 | 2.5% |

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、170百万円でした。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

| | |
|-----------------------------|------|
| (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項 | |
| 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 | |
| 確定給付型企業年金制度の割引率 | 1.1% |
| 退職一時金制度の割引率 | 0.8% |
| 長期期待運用収益率 | 2.5% |
| 3. 確定拠出制度 | |
| 当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。 | |

税効果会計関係

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

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」が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について、前事業年度の38%から36%に変更されております。

この変更により、繰延税金負債の純額が111百万円増加し、法人税等調整額（貸方）は111百万円減少しております。

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。

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。

セグメント情報等

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|----------------|--------|------------------|-----------|-----------------------|----------------------|-----------|-----------|-------|-----------|
| 親会社 | 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区 | 594,492 (百万円) | 持株会社 | (被所有) 直接 100.0% | 資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任 | 資金の借入(*1) | 8,000 | 短期借入金 | - |
| | | | | | | | 資金の返済 | 10,000 | | |
| | | | | | | | 借入金利息の支払 | 5 | 未払費用 | - |

(イ) 子会社等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|------|-------------|---------|-----------------|-----------|---------------------|------------|-----------------------|-----------|------|-----------|
| 関連会社 | 株式会社野村総合研究所 | 東京都千代田区 | 18,600 (百万円) | 情報サービス業 | (所有) 直接 21.5% | サービス・製品の購入 | 自社利用のソフトウェア開発の委託等(*2) | 5,073 | 未払費用 | 716 |

(ウ) 兄弟会社等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|---------|------------|--------|-----------------|-----------|----------------|---|-----------------------|-----------|-------|-----------|
| 親会社の子会社 | 野村証券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000 (百万円) | 証券業 | | 当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3) | 36,867 | 未払手数料 | 3,854 |

| | | | | | | | | | | |
|---------|----------------------------|---------|-----------------|-------|--|----------------------|--------------------------------|-------|-------|-----|
| 親会社の子会社 | 野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社 | 東京都中央区 | 400 (百万円) | 投資顧問業 | | 当社投資信託の運用委託 役員の兼任 | 投資信託の運用に係る 投資顧問料の支払 (*4) | 1,959 | 未払費用 | 760 |
| 親会社の子会社 | 野村信託銀行株式会社 | 東京都千代田区 | 30,000 (百万円) | 信託銀行業 | | 資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任 | 資金の返済 | 3,000 | 短期借入金 | - |
| | | | | | | | 借入金利息の支払 | 6 | 未払費用 | - |

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

㈱野村総合研究所

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

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

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

| (百万円) | |
|------------|---------|
| (株)野村総合研究所 | |
| 流動資産合計 | 229,418 |
| 固定資産合計 | 273,220 |
| 流動負債合計 | 87,832 |
| 固定負債合計 | 65,965 |
| 純資産合計 | 348,841 |
| 売上高 | 358,952 |
| 税引前当期純利益 | 51,509 |
| 当期純利益 | 34,167 |

1株当たり情報

| 前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日) | | 当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日) | |
|---|------------|---|------------|
| 1株当たり純資産額 | 16,877円25銭 | 1株当たり純資産額 | 18,829円58銭 |
| 1株当たり当期純利益 | 2,382円87銭 | 1株当たり当期純利益 | 3,876円72銭 |
| 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | | 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | |
| 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 | | 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 | |
| 損益計算書上の当期純利益 | 12,273百万円 | 損益計算書上の当期純利益 | 19,967百万円 |
| 普通株式に係る当期純利益 | 12,273百万円 | 普通株式に係る当期純利益 | 19,967百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 | | 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 | |
| 該当事項はありません。 | | 該当事項はありません。 | |
| 普通株式の期中平均株式数 | 5,150,693株 | 普通株式の期中平均株式数 | 5,150,693株 |

中間財務諸表

中間貸借対照表

| | | 平成27年 9月30日現在 |
|---------|----------|---------------|
| 区分 | 注記 番号 | 金額(百万円) |
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | | 282 |
| 金銭の信託 | | 55,445 |
| 有価証券 | | 4,900 |
| 未収委託者報酬 | | 15,728 |
| 未収収益 | | 6,953 |
| 繰延税金資産 | | 1,750 |
| その他 | | 560 |
| 貸倒引当金 | | 11 |
| 流動資産計 | | 85,609 |
| 固定資産 | | |

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

| 平成27年9月30日現在 | | |
|--------------|----------|---------|
| 区分 | 注記 番号 | 金額(百万円) |
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | | 1 |
| 未払償還金 | | 32 |
| 未払手数料 | | 5,797 |
| その他未払金 | 2 | 3,270 |
| 未払費用 | | 8,217 |
| 未払法人税等 | | 1,452 |
| 賞与引当金 | | 2,436 |
| 外国税支払損失引当金 | | 1,704 |
| その他 | | 114 |
| 流動負債計 | | 23,026 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | | 2,580 |
| 時効後支払損失引当金 | | 515 |
| 繰延税金負債 | | 927 |
| 固定負債計 | | 4,023 |
| 負債合計 | | 27,050 |
| (純資産の部) | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | 84,911 |
| 資本剰余金 | | 17,180 |
| 資本剰余金 | | 11,729 |
| 資本準備金 | | 11,729 |
| 利益剰余金 | | 56,001 |
| 利益準備金 | | 685 |
| その他利益剰余金 | | 55,316 |
| 別途積立金 | | 24,606 |
| 繰越利益剰余金 | | 30,709 |
| 評価・換算差額等 | | 7,252 |
| その他有価証券評価差額金 | | 7,252 |
| 純資産合計 | | 92,164 |
| 負債・純資産合計 | | 119,214 |

中間損益計算書

| | | 自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日 |
|--------|----------|-----------------------------|
| 区分 | 注記 番号 | 金額(百万円) |
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | | 53,884 |
| 運用受託報酬 | | 14,970 |

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

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

| | |
|--------------------|---|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | (1) 子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの...中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの...移動平均法による原価法 |
| 2 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 3 固定資産の減価償却の方法 | (1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法によっております。 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間に基づく定額法によっております。 |
| 4 引当金の計上基準 | (1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。 |

| | |
|-------------|--|
| | <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 外国税支払損失引当金 将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p> |
| 5 消費税等の会計処理 | 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。 |
| 6 連結納税制度の適用 | 連結納税制度を適用しております。 |

[注記事項]

中間貸借対照表関係

| 平成27年9月30日現在 | |
|---|----------|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額 | 3,781百万円 |
| 2 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。 | |

中間損益計算書関係

| 自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日 | |
|--|--|
| 1 減価償却実施額 有形固定資産 151百万円 無形固定資産 1,125百万円 | |
| 2 営業外収益のうち主要なもの 受取配当金 5,586百万円 | |
| 3 営業外費用のうち主要なもの 金銭信託運用損 1,200百万円 時効後支払損引当金繰入 48百万円 | |

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

中間株主資本等変動計算書関係

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

金融商品関係

当中間会計期間（自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成27年 9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収収益

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

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

有価証券関係

当中間会計期間末（平成27年9月30日）

1．満期保有目的の債券(平成27年9月30日)

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式(平成27年9月30日)

| 区分 | 中間貸借対照表 計上額 (百万円) | 時価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|--------|-------------------------|-------------|-------------|
| 関連会社株式 | 3,064 | 198,495 | 195,431 |
| 合計 | 3,064 | 198,495 | 195,431 |

3. その他有価証券(平成27年9月30日)

| 区分 | 中間貸借対照表 計上額 (百万円) | 取得原価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|-------------------------------------|-------------------------|---------------|-------------|
| 中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの 株式 | 10,828 | 282 | 10,545 |
| 小計 | 10,828 | 282 | 10,545 |
| 中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの 譲渡性預金 | 4,900 | 4,900 | - |
| 小計 | 4,900 | 4,900 | - |
| 合計 | 15,728 | 5,182 | 10,545 |

企業結合等関係

会社分割について

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

1. 企業結合の概要

(1) 会社分割の目的

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

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

(2) 会社分割日程

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

(3) 会社分割の方法

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

2. 実施した会計処理の概要

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

セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

1 株当たり情報

| | 自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日 |
|---|-----------------------------|
| 1 株当たり純資産額 | 17,893円56銭 |
| 1 株当たり中間純利益 | 2,807円57銭 |
| (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。 | |
| 2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。 | |
| 中間純利益 | 14,460百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式に係る中間純利益 | 14,460百万円 |
| 期中平均株式数 | 5,150千株 |

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託者

| (a) 名称 | (b) 資本金の額 [*] | (c) 事業の内容 |
|------------|------------------------|--|
| 野村信託銀行株式会社 | 30,000百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。 |

* 平成28年2月末現在

(2) 販売会社

| (a) 名称 | (b) 資本金の額 [*] | (c) 事業の内容 |
|--------|------------------------|-----------|
|--------|------------------------|-----------|

| | | |
|--------------------|--------------|---------------------------------|
| 野村證券株式会社 | 10,000百万円 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社SBI証券 | 47,937百万円 | |
| 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 野村信託銀行株式会社 | 30,000百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社 西日本シティ銀行 | 85,745百万円 | |
| 株式会社 広島銀行 | 54,573百万円 | |
| 株式会社 北陸銀行 | 140,409百万円 | |
| 株式会社 みずほ銀行 | 1,404,065百万円 | |
| 株式会社 三井住友銀行 | 1,770,996百万円 | |
| 株式会社 八十二銀行 | 52,243百万円 | |
| 富国生命保険相互会社 | 86,000百万円 | 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。 |
| 三井住友海上火災保険株式会社 | 139,595百万円 | 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。 |

*平成28年2月末現在

富国生命保険相互会社の資本金の額の箇所には「基金」および「基金償却積立金」の合計額を記載しています。

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【その他】

(1)目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。

(2)目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。

(3)届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

す。

- (4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (6)目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含む）も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載する場合があります。
- (7)目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8)目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

独立監査人の監査報告書

平成27年6月12日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 岩部俊夫指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成28年4月1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」に掲げられている野村DC運用戦略ファンドの平成27年2月18日から平成28年2月17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、野村DC運用戦略ファンドの平成28年2月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月20日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監

査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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