

## 【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29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29年5月12日から平成30年5月10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29年 5月12日から平成30年 5月10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。)の指定する口座を経由して、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ないます。

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号ロ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、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
<b>追加型</b>	<b>内外</b>	その他資産 ( )
		<b>資産複合</b>

## 《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。

## &lt;属性区分表定義&gt;

## 〔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。

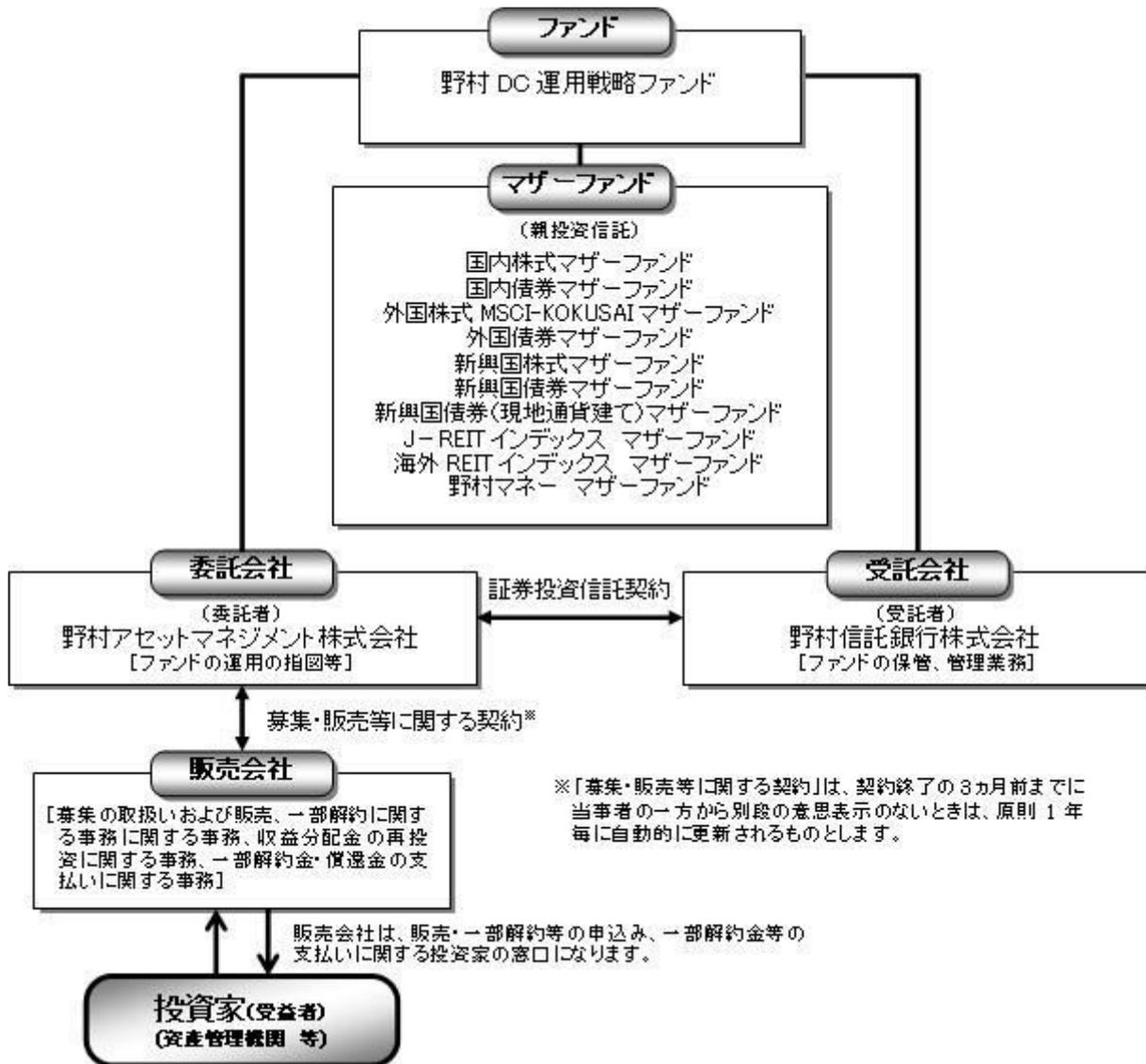
## 〔特殊型〕

- (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】

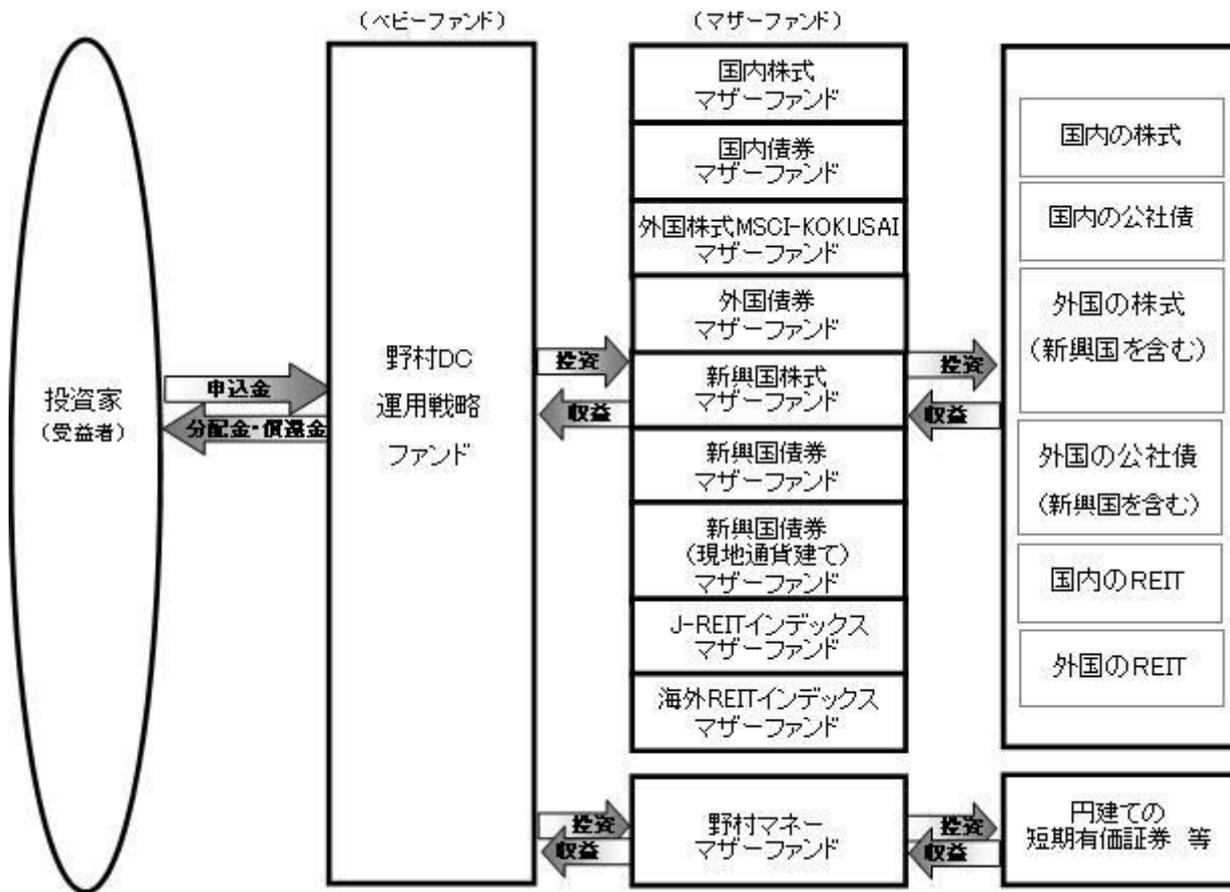
平成24年2月28日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (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29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商号を変更  
 平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

##### ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

[1] 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<sup>1</sup>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<sup>2</sup>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。

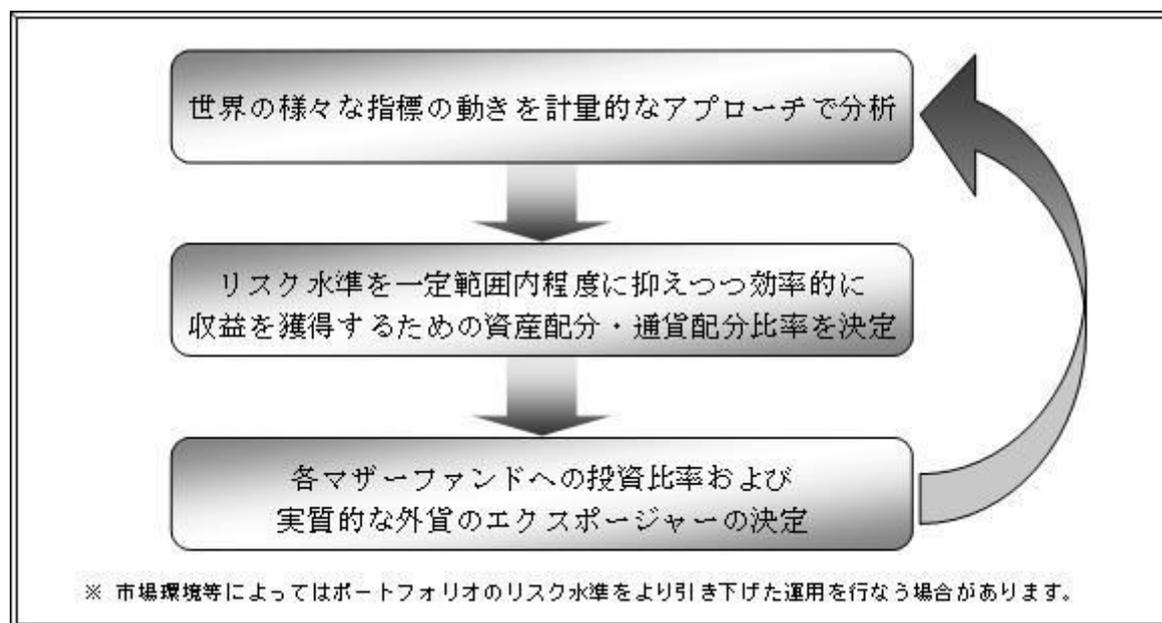
実質的な内外の株式 およびREITへの投資比率	実質的な外貨の エクスポージャー
純資産総額の50%以内	純資産総額の50%以内

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いません。

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。

- 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。）
  - 有価証券
  - 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
  - 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<sup>1</sup>
4. 為替先渡取引<sup>2</sup>
5. 直物為替先渡取引<sup>3</sup>

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。

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（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。

## (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

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、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。

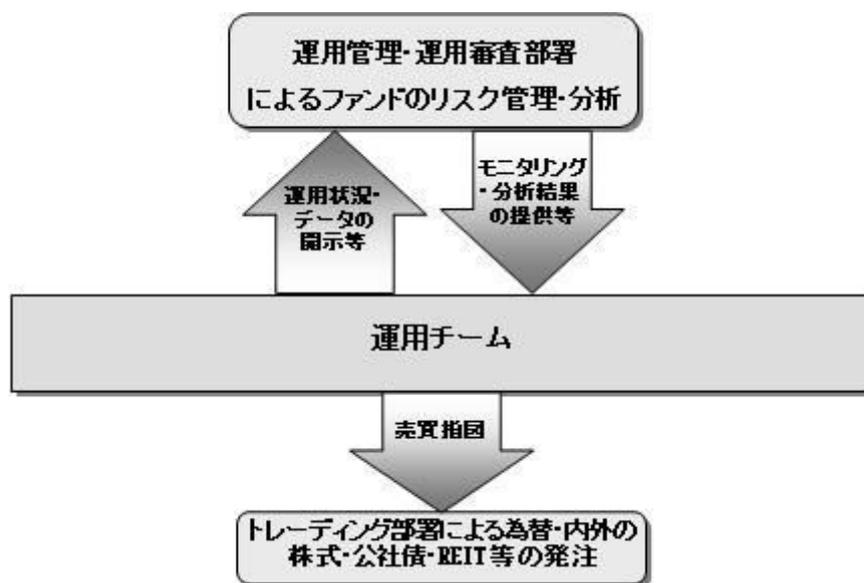
スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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】

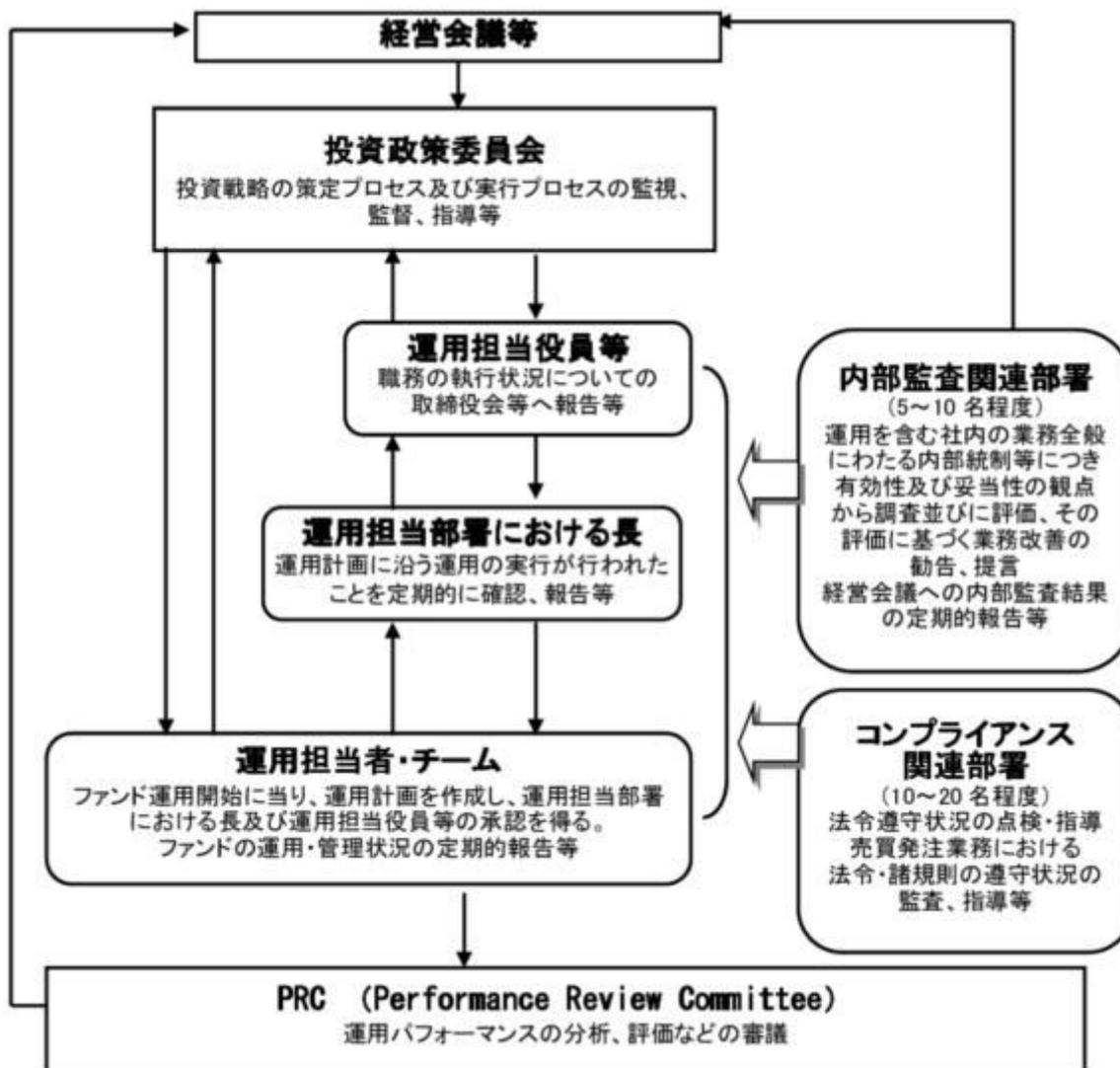
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

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提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

- ( ) 委託者は、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提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( ) 委託者は、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( )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、野村証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証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、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](mailto: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](http://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&amp;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、参加もしておりません。

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

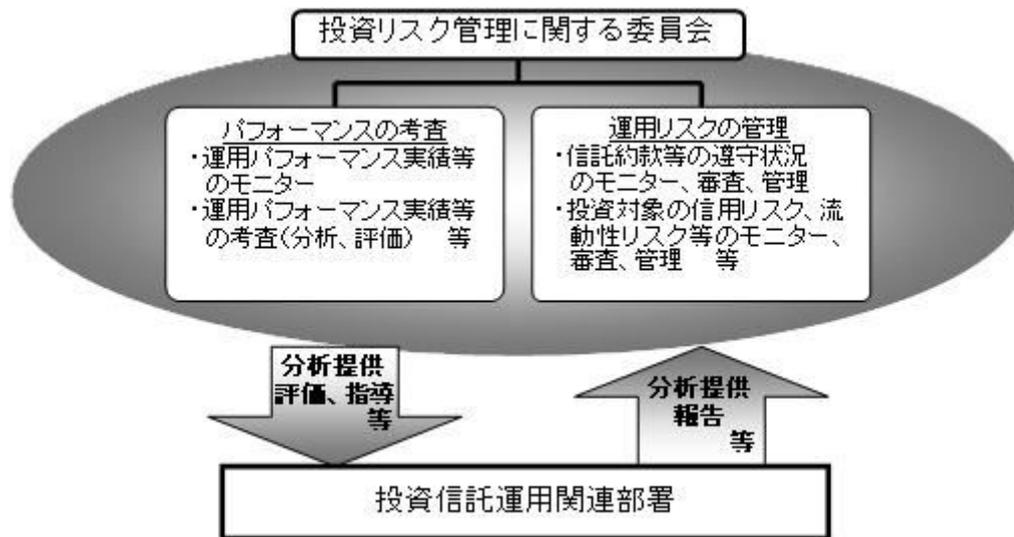
## パフォーマンスの考査

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、審議を行ないます。

## 運用リスクの管理

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

## リスク管理体制図

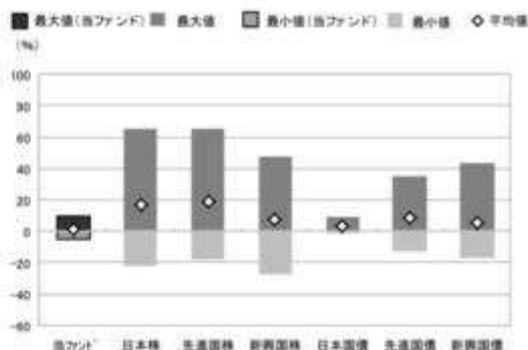
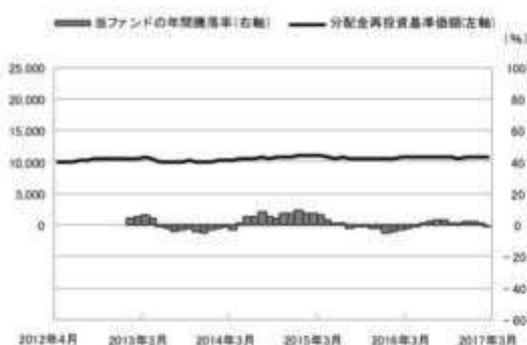


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

## リスクの定量的比較

(2012年4月末～2017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	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	△4.9	△22.0	△17.5	△27.4	△1.3	△12.3	△17.4
平均値(%)	1.1	16.5	18.8	7.7	3.0	8.9	5.4

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2012年4月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2012年2月から2017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。
- \* 2012年4月から2017年3月の5年間(当ファンドは2013年2月から2017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・ディバースファイド(円ベース)

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村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・ディバースファイド(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・ディバースファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格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、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、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J.P. Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)(「指数スポンサー」)は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての運動、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または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義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPJS, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.864%（税抜年0.80%）以内（平成29年 5月11日現在年0.864%（税抜年0.80%））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0.40%	年0.35%	年0.05%

上記配分は、平成29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。

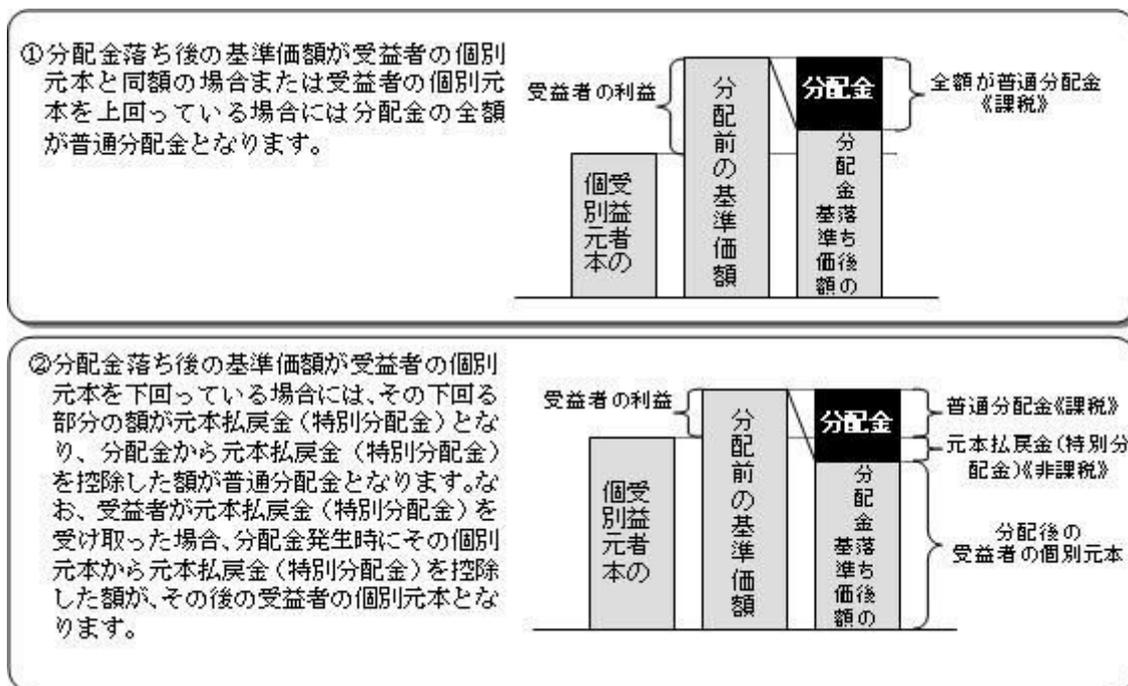
#### 換金(解約)時および償還時の課税について

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29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29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	6,761,181,973	93.20
現金・預金・その他資産(負債控除後)		492,771,826	6.79
合計(純資産総額)		7,253,953,799	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	312,032,406,096	97.76
現金・預金・その他資産(負債控除後)		7,137,651,498	2.23
合計(純資産総額)		319,170,057,594	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	7,123,875,000	2.23

#### (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	16,183,348,470	99.55
現金・預金・その他資産(負債控除後)		71,978,463	0.44
合計(純資産総額)		16,255,326,933	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	227,171,661,690	62.34

	カナダ	13,617,347,749	3.73
	ドイツ	13,376,446,860	3.67
	イタリア	3,063,254,005	0.84
	フランス	13,684,273,794	3.75
	オランダ	4,568,326,486	1.25
	スペイン	4,743,167,042	1.30
	ベルギー	1,646,392,922	0.45
	オーストリア	293,487,716	0.08
	ルクセンブルグ	85,178,716	0.02
	フィンランド	1,360,761,213	0.37
	アイルランド	646,966,025	0.17
	ポルトガル	218,915,626	0.06
	イギリス	92,396,183	0.02
	イギリス	25,166,797,732	6.90
	スイス	12,445,526,027	3.41
	スウェーデン	4,084,242,005	1.12
	ノルウェー	901,175,159	0.24
	デンマーク	2,312,055,891	0.63
	オーストラリア	9,988,031,830	2.74
	ニュージーランド	238,652,748	0.06
	香港	4,397,225,183	1.20
	シンガポール	1,712,196,232	0.46
	イスラエル	351,046,310	0.09
	小計	346,165,525,144	95.00
投資信託受益証券	アメリカ	23,698,454	0.00
投資証券	アメリカ	7,115,344,931	1.95
	カナダ	82,051,038	0.02
	フランス	452,409,874	0.12
	イギリス	337,507,883	0.09
	オーストラリア	926,223,687	0.25
	香港	195,381,142	0.05
	シンガポール	146,619,094	0.04
	小計	9,255,537,649	2.54
現金・預金・その他資産（負債控除後）		8,907,719,071	2.44
合計（純資産総額）		364,352,480,318	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	5,928,857,244	1.62
	買建	カナダ	353,031,853	0.09

買建	ドイツ	1,119,574,105	0.30
買建	イギリス	644,227,920	0.17
買建	スイス	316,797,231	0.08
買建	オーストラリア	277,606,560	0.07

## (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	288,234,414,017	44.20
	カナダ	13,810,768,558	2.11
	メキシコ	5,763,586,637	0.88
	ドイツ	40,804,950,765	6.25
	イタリア	62,073,902,788	9.52
	フランス	62,512,704,305	9.58
	オランダ	14,328,600,226	2.19
	スペイン	38,209,401,074	5.86
	ベルギー	16,593,326,288	2.54
	オーストリア	9,264,714,985	1.42
	フィンランド	3,858,315,284	0.59
	アイルランド	5,676,879,785	0.87
	イギリス	47,642,589,609	7.30
	スイス	1,196,397,681	0.18
	スウェーデン	2,908,840,403	0.44
	ノルウェー	1,764,413,692	0.27
	デンマーク	3,803,596,744	0.58
	ポーランド	4,248,740,238	0.65
	オーストラリア	13,725,984,568	2.10
	シンガポール	2,618,396,101	0.40
マレーシア	2,719,740,742	0.41	
南アフリカ	3,582,010,620	0.54	
	小計	645,342,275,110	98.97
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,658,771,902	1.02
合計(純資産総額)		652,001,047,012	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	2,281,386,298	11.09
	メキシコ	718,668,805	3.49
	ブラジル	1,525,144,672	7.41

	チリ	114,686,484	0.55
	コロンビア	54,654,815	0.26
	ギリシャ	64,747,743	0.31
	トルコ	198,923,721	0.96
	チェコ	36,198,672	0.17
	ハンガリー	55,743,384	0.27
	ポーランド	245,754,732	1.19
	香港	4,141,052,080	20.13
	マレーシア	486,892,749	2.36
	タイ	451,212,785	2.19
	フィリピン	231,568,341	1.12
	インドネシア	499,907,911	2.43
	韓国	3,003,138,638	14.60
	台湾	2,447,097,035	11.90
	インド	1,723,154,534	8.38
	カタール	157,837,232	0.76
	エジプト	23,526,584	0.11
	南アフリカ	1,258,952,383	6.12
	アラブ首長国連邦	137,429,064	0.66
	小計	19,857,678,662	96.57
投資証券	メキシコ	21,966,372	0.10
	トルコ	7,182,694	0.03
	南アフリカ	75,657,632	0.36
	小計	104,806,698	0.50
現金・預金・その他資産（負債控除後）		599,216,124	2.91
合計（純資産総額）		20,561,701,484	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	570,444,076	2.77

## （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	8,586,099,044	97.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		183,922,857	2.09
合計（純資産総額）		8,770,021,901	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	アルゼンチン	63,827,400	1.39
	メキシコ	456,918,041	9.99
	ブラジル	451,214,453	9.87
	コロンビア	336,537,164	7.36
	ペルー	98,743,729	2.16
	トルコ	376,788,913	8.24
	ハンガリー	221,983,642	4.85
	ポーランド	443,310,183	9.70
	ロシア	267,375,600	5.85
	ルーマニア	127,665,942	2.79
	マレーシア	353,889,334	7.74
	タイ	330,527,517	7.23
	フィリピン	11,437,328	0.25
	インドネシア	441,028,832	9.65
	南アフリカ	412,012,458	9.01
	小計	4,393,260,536	96.13
特殊債券	ロシア	10,828,600	0.23
現金・預金・その他資産（負債控除後）		165,799,467	3.62
合計（純資産総額）		4,569,888,603	100.00

（参考）J - R E I T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	28,315,635,600	98.10
現金・預金・その他資産（負債控除後）		546,314,948	1.89
合計（純資産総額）		28,861,950,548	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	527,884,500	1.82

（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	13,518,608,209	71.75
	カナダ	359,098,918	1.90
	ドイツ	35,927,608	0.19
	イタリア	14,928,740	0.07
	フランス	771,087,541	4.09
	オランダ	80,633,296	0.42
	スペイン	140,242,812	0.74
	ベルギー	133,208,732	0.70
	アイルランド	38,878,688	0.20
	イギリス	973,044,083	5.16
	オーストラリア	1,578,660,349	8.37
	ニュージーランド	88,595,842	0.47
	香港	350,374,759	1.85
	シンガポール	565,546,560	3.00
	イスラエル	8,354,729	0.04
	小計	18,657,190,866	99.02
現金・預金・その他資産（負債控除後）		182,833,982	0.97
合計（純資産総額）		18,840,024,848	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	145,694,421	0.77
	買建	フランス	7,138,885	0.03

## （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	40,055,092	0.20
特殊債券	日本	2,892,025,337	15.02
社債券	日本	2,695,271,199	13.99
コマーシャルペーパー	日本	899,993,325	4.67
現金・預金・その他資産（負債控除後）		12,725,348,478	66.09

合計(純資産総額)	19,252,693,431	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	1,128,432,310	2.1539	2,430,619,366	2.1467	2,422,405,639	33.39
2	日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	733,133,671	1.3313	976,032,064	1.3352	978,880,077	13.49
3	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	384,077,520	1.9743	758,300,700	1.9679	755,826,151	10.41
4	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	229,748,994	2.2977	527,896,888	2.3082	530,306,627	7.31
5	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	362,758,159	1.4601	529,685,889	1.4405	522,553,128	7.20
6	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	247,146,705	1.8065	446,486,261	1.8138	448,274,693	6.17
7	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	200,194,087	2.1466	429,749,087	2.1238	425,172,201	5.86
8	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	1.0209	386,989,788	1.0209	386,989,788	5.33
9	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	225,405,945	1.2755	287,522,201	1.2900	290,773,669	4.00

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	93.20
合計	93.20

## (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	1,720,900	5,664.54	9,748,120,372	6,042.00	10,397,677,800	3.25
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,586,100	509.27	5,391,281,300	699.70	7,407,094,170	2.32
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,121,400	5,000.02	5,607,027,783	4,752.00	5,328,892,800	1.66
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	628,900	6,007.02	3,777,818,270	7,862.00	4,944,411,800	1.54
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,118,600	3,356.87	3,755,004,572	4,045.00	4,524,737,000	1.41
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,273,800	3,032.22	3,862,446,852	3,351.00	4,268,503,800	1.33

7	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,382,000	3,261.91	4,507,970,605	2,922.00	4,038,204,000	1.26
8	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,967,100	165.69	3,142,684,285	204.00	3,869,288,400	1.21
9	日本	株式	ソニー	電気機器	999,600	2,713.51	2,712,434,466	3,766.00	3,764,493,600	1.17
10	日本	株式	ファナック	電気機器	143,500	16,316.12	2,341,363,856	22,820.00	3,274,670,000	1.02
11	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	879,000	4,556.83	4,005,455,476	3,618.00	3,180,222,000	0.99
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	555,800	5,248.74	2,917,252,442	5,229.00	2,906,278,200	0.91
13	日本	株式	キーエンス	電気機器	64,100	33,361.96	2,138,502,070	44,580.00	2,857,578,000	0.89
14	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,043,900	2,793.84	2,916,492,559	2,592.50	2,706,310,750	0.84
15	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	566,000	3,718.18	2,104,493,327	4,696.00	2,657,936,000	0.83
16	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	273,800	9,791.93	2,681,032,085	9,694.00	2,654,217,200	0.83
17	日本	株式	キヤノン	電気機器	762,000	3,068.30	2,338,050,210	3,471.00	2,644,902,000	0.82
18	日本	株式	信越化学工業	化学	265,900	6,275.21	1,668,579,556	9,644.00	2,564,339,600	0.80
19	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	584,700	4,736.70	2,769,552,292	4,362.00	2,550,461,400	0.79
20	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,048,200	1,815.14	1,902,637,136	2,405.50	2,521,445,100	0.79
21	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,509,900	1,244.82	1,879,561,530	1,597.00	2,411,310,300	0.75
22	日本	株式	村田製作所	電気機器	148,500	12,865.78	1,910,568,910	15,835.00	2,351,497,500	0.73
23	日本	株式	花王	化学	376,600	6,078.18	2,289,045,540	6,104.00	2,298,766,400	0.72
24	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	500,300	4,104.87	2,053,667,316	4,503.00	2,252,850,900	0.70
25	日本	株式	任天堂	その他製品	87,200	15,458.67	1,347,996,656	25,835.00	2,252,812,000	0.70
26	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,514,500	1,483.64	2,246,983,126	1,466.00	2,220,257,000	0.69
27	日本	株式	ダイキン工業	機械	193,200	8,834.70	1,706,864,958	11,185.00	2,160,942,000	0.67
28	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	117,700	19,379.74	2,280,996,212	18,140.00	2,135,078,000	0.66
29	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,039,000	2,137.71	2,221,083,460	2,030.00	2,109,170,000	0.66
30	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,399,000	479.96	1,631,410,020	602.50	2,047,897,500	0.64

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.33
		建設業	2.88
		食料品	4.44
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.70
		医薬品	4.64
		石油・石炭製品	0.56
		ゴム製品	0.96
		ガラス・土石製品	0.98
		鉄鋼	1.23
		非鉄金属	0.95
		金属製品	0.70
機械	5.07		

電気機器	12.68
輸送用機器	8.92
精密機器	1.55
その他製品	1.78
電気・ガス業	1.78
陸運業	4.02
海運業	0.24
空運業	0.56
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.60
卸売業	4.38
小売業	4.54
銀行業	7.95
証券、商品先物取引業	1.17
保険業	2.57
その他金融業	1.19
不動産業	2.32
サービス業	3.67
合計	97.76

## (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 (5年)第12 9回	290,000,000	101.39	294,037,000	101.07	293,123,300	0.1	2021/9/20	1.80
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	290,000,000	101.30	293,780,000	101.03	293,010,200	0.1	2021/6/20	1.80
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	290,000,000	101.21	293,524,100	100.51	291,502,200	0.1	2026/9/20	1.79
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 37回	270,000,000	103.01	278,149,700	102.47	276,671,700	0.3	2024/12/20	1.70
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	250,000,000	101.69	254,226,700	100.67	251,675,000	0.1	2026/3/20	1.54
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	240,000,000	101.18	242,853,000	100.95	242,284,800	0.1	2020/12/20	1.49
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	240,000,000	101.23	242,965,600	100.87	242,090,400	0.1	2020/6/20	1.48
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	230,000,000	101.33	233,074,500	100.83	231,913,600	0.1	2020/3/20	1.42
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	210,000,000	101.18	212,498,800	100.96	212,026,500	0.2	2019/9/20	1.30
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	210,000,000	101.79	213,760,900	100.59	211,251,600	0.1	2026/6/20	1.29

11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	200,000,000	100.97	201,947,800	100.99	201,990,000	0.1	2021/3/20	1.24
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	200,000,000	101.09	202,185,400	100.77	201,552,000	0.1	2019/12/20	1.23
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	190,000,000	104.10	197,796,800	103.28	196,239,600	0.4	2025/6/20	1.20
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	180,000,000	101.36	182,456,400	100.90	181,629,000	0.1	2020/9/20	1.11
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	180,000,000	101.16	182,093,400	100.81	181,468,800	0.2	2019/3/20	1.11
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	170,000,000	101.01	171,728,400	101.13	171,934,600	0.1	2021/12/20	1.05
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第37 4回	170,000,000	100.72	171,230,800	100.63	171,077,800	0.1	2019/3/15	1.05
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第36 8回	170,000,000	100.71	171,214,500	100.49	170,839,800	0.1	2018/9/15	1.05
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 31回	160,000,000	105.65	169,052,400	104.38	167,012,800	0.6	2023/9/20	1.02
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	160,000,000	104.84	167,745,600	103.26	165,224,000	0.4	2025/3/20	1.01
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 1回	160,000,000	101.04	161,666,000	100.71	161,147,200	0.1	2019/9/20	0.99
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	160,000,000	100.46	160,740,500	100.43	160,694,400	0.1	2026/12/20	0.98
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第9 9回	130,000,000	124.95	162,435,000	121.39	157,807,000	2.1	2027/12/20	0.97
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	150,000,000	105.36	158,041,800	104.61	156,918,000	0.6	2024/3/20	0.96
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	150,000,000	105.70	158,563,500	104.16	156,247,500	0.6	2023/3/20	0.96
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 56回	160,000,000	101.17	161,872,200	96.76	154,816,000	0.4	2036/3/20	0.95
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	150,000,000	103.79	155,685,100	102.43	153,652,500	0.3	2025/12/20	0.94
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	150,000,000	101.05	151,584,000	100.75	151,134,000	0.2	2018/12/20	0.92
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年)第9 回	130,000,000	117.19	152,357,000	115.55	150,216,300	1.4	2032/12/20	0.92
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 57回	160,000,000	96.72	154,761,300	92.79	148,464,000	0.2	2036/6/20	0.91

## 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	518,900	12,305.47	6,385,309,132	16,147.50	8,378,941,227	2.29
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	718,900	6,181.34	4,443,771,697	7,372.00	5,299,734,323	1.45
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	39,320	68,313.18	2,686,074,567	98,316.58	3,865,808,106	1.06
4	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	403,700	9,497.13	3,833,992,565	9,390.30	3,790,865,321	1.04
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	264,800	12,282.43	3,252,389,224	13,985.60	3,703,388,310	1.01
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	227,900	12,957.40	2,952,993,172	15,976.97	3,641,153,263	0.99
7	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	348,400	6,748.28	2,351,102,594	9,988.27	3,479,915,254	0.95
8	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	464,600	5,460.36	2,536,887,604	6,309.56	2,931,424,178	0.80
9	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コングロマリット	861,400	3,563.49	3,069,594,025	3,351.11	2,886,650,719	0.79
10	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	30,240	84,251.82	2,547,775,254	93,285.98	2,820,968,186	0.77
11	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	598,000	4,427.60	2,647,705,945	4,685.05	2,801,662,531	0.76
12	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	28,830	86,254.10	2,486,705,920	95,303.16	2,747,590,137	0.75
13	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	984,100	1,528.01	1,503,724,325	2,677.97	2,635,395,493	0.72
14	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	303,000	8,116.35	2,459,255,130	8,663.01	2,624,892,333	0.72
15	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	249,000	9,310.38	2,318,285,582	10,119.53	2,519,764,962	0.69
16	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	591,000	3,393.17	2,005,367,024	3,853.72	2,277,552,362	0.62
17	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	119,270	16,052.63	1,914,597,526	18,776.11	2,239,427,642	0.61
18	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	183,900	10,735.07	1,974,179,650	12,091.83	2,223,689,045	0.61
19	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	397,100	6,052.00	2,403,253,115	5,504.04	2,185,654,840	0.59
20	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	68,420	26,611.77	1,820,777,593	28,902.85	1,977,533,202	0.54
21	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	118,700	14,969.24	1,776,848,905	16,486.32	1,956,926,243	0.53
22	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	464,400	3,425.69	1,590,892,682	4,208.24	1,954,309,860	0.53
23	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	151,100	11,090.53	1,675,779,741	12,735.80	1,924,380,710	0.52
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	268,600	6,005.69	1,613,129,956	7,118.45	1,912,017,147	0.52
25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	399,200	5,207.68	2,078,906,004	4,779.29	1,907,894,165	0.52
26	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	277,600	4,730.16	1,313,093,712	6,788.61	1,884,520,051	0.51
27	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	メディア	147,300	11,105.44	1,635,832,530	12,697.66	1,870,365,937	0.51
28	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	461,700	3,680.81	1,699,431,951	4,010.79	1,851,782,897	0.50
29	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	489,000	3,205.24	1,567,363,505	3,785.29	1,851,007,103	0.50

30	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	217,500	7,883.57	1,714,676,962	8,410.85	1,829,360,636	0.50
----	-----	----	--------------	-----	---------	----------	---------------	----------	---------------	------

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	不動産管理・開発	0.54
		エネルギー設備・サービス	0.70
		石油・ガス・消耗燃料	6.22
		化学	2.63
		建設資材	0.35
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.43
		紙製品・林産品	0.09
		航空宇宙・防衛	1.89
		建設関連製品	0.38
		建設・土木	0.32
		電気設備	0.74
		コングロマリット	2.14
		機械	1.47
		商社・流通業	0.30
		商業サービス・用品	0.35
		航空貨物・物流サービス	0.55
		旅客航空輸送業	0.13
		海運業	0.07
		陸運・鉄道	0.88
		運送インフラ	0.23
		自動車部品	0.46
		自動車	0.98
		家庭用耐久財	0.42
		レジャー用品	0.07
		繊維・アパレル・贅沢品	1.16
		ホテル・レストラン・レジャー	1.72
		メディア	2.62
		販売	0.07
		インターネット販売・通信販売	1.61
		複合小売り	0.36
		専門小売り	1.74
食品・生活必需品小売り	1.84		
飲料	2.01		
食品	2.12		
タバコ	1.63		
家庭用品	1.45		
パーソナル用品	0.70		

	ヘルスケア機器・用品	1.90
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.87
	バイオテクノロジー	2.27
	医薬品	5.75
	銀行	9.42
	各種金融サービス	0.90
	保険	4.05
	インターネットソフトウェア・サービス	2.92
	情報技術サービス	2.63
	ソフトウェア	3.49
	通信機器	0.82
	コンピュータ・周辺機器	2.68
	電子装置・機器・部品	0.39
	半導体・半導体製造装置	2.46
	各種電気通信サービス	2.48
	無線通信サービス	0.35
	電力	1.84
	ガス	0.14
	総合公益事業	1.08
	水道	0.08
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.02
	消費者金融	0.53
	資本市場	2.74
	各種消費者サービス	0.01
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.04
	ヘルスケア・テクノロジー	0.05
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.48
	専門サービス	0.59
投資信託受益証券		0.00
投資証券		2.54
合 計		97.55

## (参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	43,200,000	15,542.87	6,714,523,935	14,484.78	6,257,425,055	6	2026/2/15	0.95
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,800,000	12,304.08	6,373,517,115	11,890.82	6,159,447,419	3.625	2020/2/15	0.94
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	11,939.46	6,280,160,286	11,575.29	6,088,602,939	2.625	2020/11/15	0.93
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	12,148.07	5,989,000,204	11,781.26	5,808,163,026	3.375	2019/11/15	0.89
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	51,200,000	11,821.75	6,052,740,252	11,287.36	5,779,130,993	2.375	2024/8/15	0.88

6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,700,000	12,282.44	5,858,724,434	11,873.73	5,663,770,635	3.5	2020/5/15	0.86
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	12,478.63	5,715,213,284	11,999.94	5,495,975,605	3.625	2021/2/15	0.84
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,500,000	11,921.93	5,066,824,461	11,573.97	4,918,939,754	2.625	2020/8/15	0.75
9	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	15,621.48	5,170,711,392	14,786.87	4,894,456,485	3.5	2026/4/25	0.75
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	32,000,000	15,721.26	5,030,803,380	15,001.30	4,800,416,544	4.25	2023/10/25	0.73
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,200,000	11,393.11	4,807,895,438	10,958.68	4,624,564,352	1.75	2023/5/15	0.70
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,400,000	12,255.23	4,706,011,142	11,790.02	4,527,371,193	3.125	2021/5/15	0.69
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000	19,036.93	4,664,050,004	17,865.48	4,377,042,747	5.5	2029/4/25	0.67
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,500,000	11,745.85	4,404,695,264	11,531.46	4,324,299,742	2.75	2019/2/15	0.66
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,600,000	11,652.27	4,381,255,917	11,387.28	4,281,619,160	2.125	2020/8/31	0.65
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,700,000	12,044.41	4,299,854,994	11,679.15	4,169,457,984	3.75	2018/11/15	0.63
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	12,158.54	4,486,501,578	11,155.89	4,116,524,563	3	2044/11/15	0.63
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,300,000	11,563.66	4,197,609,343	11,103.30	4,030,499,374	2.25	2025/11/15	0.61
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	13,822.66	4,036,216,838	13,331.42	3,892,777,297	4.25	2020/3/1	0.59
20	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	21,050,000	16,787.18	3,533,702,906	18,413.51	3,876,045,118	3.25	2044/1/22	0.59
21	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,000,000	17,703.36	3,540,672,026	19,343.64	3,868,729,440	3.5	2045/1/22	0.59
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	11,746.07	3,993,665,574	11,341.70	3,856,180,656	2.125	2021/6/30	0.59
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	11,630.94	3,919,629,171	11,252.74	3,792,174,899	2	2022/2/15	0.58
24	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000	20,829.84	4,082,650,436	19,320.73	3,786,864,537	5.75	2032/10/25	0.58
25	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000	20,401.43	3,957,878,370	19,457.72	3,774,799,480	6.5	2027/7/4	0.57
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,600,000	13,155.45	3,894,013,290	12,712.47	3,762,892,354	4.5	2018/8/1	0.57
27	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	27,500,000	13,743.49	3,779,459,790	13,464.32	3,702,689,134	4	2020/4/30	0.56
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,300,000	13,426.92	3,665,550,641	13,139.16	3,586,992,359	2.5	2020/10/25	0.55
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	23,700,000	16,153.01	3,828,264,851	15,075.53	3,572,900,906	6.125	2027/11/15	0.54
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,200,000	11,609.38	3,622,127,528	11,390.35	3,553,789,910	2.375	2018/6/30	0.54

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.97
合計	98.97

## (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	3,980	137,304.86	546,473,362	210,739.60	838,743,608	4.07
2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インターネットソフトウェア・サービス	229,700	2,366.27	543,533,184	3,251.88	746,958,674	3.63
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	995,000	567.49	564,656,367	708.55	705,007,250	3.42
4	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	45,440	9,537.73	433,394,696	12,211.88	554,907,895	2.69
5	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	17,750	16,694.84	296,333,533	19,294.88	342,484,120	1.66
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,411,000	71.13	242,642,119	91.40	311,783,137	1.51
7	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	249,000	1,245.99	310,252,385	1,237.50	308,139,492	1.49
8	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,997,000	59.31	177,760,151	73.93	221,576,602	1.07
9	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	633,812	257.05	162,922,426	338.17	214,342,542	1.04
10	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	11,040	19,506.71	215,354,148	19,337.06	213,481,235	1.03
11	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,234,000	44.95	145,377,125	56.31	182,125,944	0.88
12	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	131,494	1,034.56	136,038,541	1,371.63	180,362,246	0.87
13	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	61,360	2,130.98	130,757,066	2,629.51	161,346,948	0.78
14	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	435,600	218.61	95,230,227	326.78	142,345,988	0.69
15	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	213,000	512.23	109,105,786	636.08	135,485,466	0.65
16	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	75,060	2,028.64	152,270,281	1,774.11	133,165,072	0.64
17	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	113,441	935.99	106,180,348	1,161.65	131,779,600	0.64
18	ブラジル	株式	AMBEV SA	飲料	188,556	671.87	126,686,387	650.22	122,604,636	0.59
19	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	23,320	2,840.89	66,249,786	5,110.35	119,173,595	0.57
20	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	710	113,155.50	80,340,406	163,049.60	115,765,216	0.56
21	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	51,930	1,740.87	90,403,407	2,198.22	114,153,798	0.55
22	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	218,200	524.02	114,341,882	506.70	110,563,279	0.53
23	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	1,359,000	70.46	95,758,431	81.04	110,139,747	0.53
24	香港	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	298,000	254.43	75,823,073	345.83	103,059,724	0.50
25	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	17,050	4,610.75	78,613,419	5,996.55	102,241,271	0.49
26	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	インターネットソフトウェア・サービス	3,200	19,037.16	60,918,925	31,676.84	101,365,909	0.49
27	韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO LTD	自動車	6,320	13,767.50	87,010,626	15,913.40	100,572,688	0.48

28	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガス・消耗燃料	733,000	130.96	95,996,230	134.86	98,859,417	0.48
29	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	27,800	2,722.79	75,693,710	3,540.71	98,431,916	0.47
30	韓国	株式	NAVER CORP	インターネットソフトウェア・サービス	1,120	71,764.68	80,376,450	86,444.40	96,817,728	0.47

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	不動産管理・開発	1.95
		エネルギー設備・サービス	0.07
		石油・ガス・消耗燃料	7.02
		化学	2.40
		建設資材	1.22
		容器・包装	0.05
		金属・鉱業	3.19
		紙製品・林産品	0.33
		航空宇宙・防衛	0.21
		建設関連製品	0.04
		建設・土木	0.89
		電気設備	0.21
		コングロマリット	1.89
		機械	0.63
		商社・流通業	0.05
		商業サービス・用品	0.13
		航空貨物・物流サービス	0.07
		旅客航空輸送業	0.26
		海運業	0.05
		陸運・鉄道	0.15
		運送インフラ	1.07
		自動車部品	0.71
		自動車	2.54
		家庭用耐久財	0.73
		レジャー用品	0.05
		繊維・アパレル・贅沢品	0.53
		ホテル・レストラン・レジャー	0.66
メディア	2.24		
販売	0.03		
インターネット販売・通信販売	1.02		
複合小売り	0.66		
専門小売り	0.37		

	食品・生活必需品小売り	1.79
	飲料	1.37
	食品	1.68
	タバコ	0.70
	家庭用品	0.38
	パーソナル用品	0.76
	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	0.51
	バイオテクノロジー	0.19
	医薬品	1.39
	銀行	16.47
	各種金融サービス	1.29
	保険	3.36
	インターネットソフトウェア・サービス	8.59
	情報技術サービス	1.73
	ソフトウェア	0.14
	通信機器	0.02
	コンピュータ・周辺機器	5.78
	電子装置・機器・部品	2.61
	半導体・半導体製造装置	4.95
	各種電気通信サービス	1.80
	無線通信サービス	3.76
	電力	1.23
	ガス	0.46
	総合公益事業	0.07
	水道	0.25
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.94
	消費者金融	0.20
	資本市場	1.22
	各種消費者サービス	0.40
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.68
	ヘルスケア・テクノロジー	0.02
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.06
投資証券		0.50
合 計		97.08

## (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	1,658,500	13,701.76	227,243,767	13,519.24	224,216,641	7.5	2030/3/31	2.55

2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	1,800,000	12,274.20	220,935,767	11,965.06	215,371,143	7.5	2026/4/22	2.45
3	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	1,450,000	13,050.85	189,237,380	12,764.64	185,087,304	7.375	2025/2/5	2.11
4	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,000,000	12,029.57	120,295,727	12,040.79	120,407,917	4.875	2023/9/16	1.37
5	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	920,000	12,281.56	112,990,363	12,873.80	118,438,983	6.125	2041/1/18	1.35
6	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	650,000	18,688.52	121,475,405	17,799.59	115,697,362	9.5	2030/2/2	1.31
7	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	12,663.44	113,971,016	12,228.71	110,058,390	5.55	2045/1/21	1.25
8	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	930,000	11,663.23	108,468,097	11,807.99	109,814,377	4.875	2021/1/22	1.25
9	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000	12,189.44	109,704,991	12,026.20	108,235,863	6.875	2021/4/22	1.23
10	アメリカ	国債証券	ARGENT-GLOBAL	640,000	16,397.96	104,946,985	16,909.17	108,218,711	11.6088746	2033/12/31	1.23
11	アメリカ	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND	900,000	11,953.47	107,581,235	11,992.50	107,932,547	5	2020/4/29	1.23
12	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	850,000	11,919.52	101,315,984	11,583.61	98,460,749	4	2023/10/2	1.12
13	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	800,000	12,345.35	98,762,876	12,012.14	96,097,197	7	2019/3/11	1.09
14	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	800,000	11,832.11	94,656,947	11,918.14	95,345,165	4.5	2022/4/4	1.08
15	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	800,000	11,941.22	95,529,785	11,886.53	95,092,244	6.25	2019/4/22	1.08
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	600,000	14,805.71	88,834,286	15,598.80	93,592,847	7.75	2038/1/17	1.06
17	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	710,000	13,513.15	95,943,430	12,901.85	91,603,135	6.05	2040/1/11	1.04
18	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	800,000	11,650.37	93,202,964	11,247.04	89,976,380	3.6	2025/1/30	1.02
19	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	800,000	11,555.57	92,444,560	11,230.21	89,841,752	5.75	2110/10/12	1.02
20	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000	16,067.96	96,407,762	14,968.49	89,810,945	6.375	2034/10/23	1.02
21	アメリカ	国債証券	BRAZIL GLOBAL	700,000	11,695.80	81,870,653	12,761.61	89,331,288	7.125	2037/1/20	1.01
22	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	800,000	11,429.07	91,432,606	10,980.59	87,844,770	4.75	2044/3/8	1.00
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	600,000	13,749.09	82,494,586	14,493.37	86,960,264	6.75	2044/1/15	0.99
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000	11,303.14	79,121,997	12,284.80	85,993,635	5.625	2044/2/26	0.98
25	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	750,000	12,097.07	90,728,053	11,448.98	85,867,421	7.625	2046/4/22	0.97
26	アメリカ	国債証券	UKRAINE GOVERNMENT REGS	765,000	10,841.29	82,935,897	11,151.68	85,310,398	7.75	2020/9/1	0.97
27	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	700,000	12,901.34	90,309,416	11,995.57	83,969,054	6.625	2045/2/17	0.95
28	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	700,000	11,650.93	81,556,521	11,555.57	80,888,990	3.625	2022/3/15	0.92
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	700,000	11,489.32	80,425,241	11,466.73	80,267,166	3.75	2022/4/25	0.91
30	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	650,000	12,440.40	80,862,637	12,277.06	79,800,916	7	2020/6/5	0.90

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.90
合計	97.90

## （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	135,000,000	198.05	267,370,000	198.05	267,375,600	7.85	2018/3/10	5.85
2	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,650,000,000	4.82	176,059,616	4.89	178,830,107	9.85	2027/6/28	3.91
3	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,820,000,000	4.14	158,280,943	4.12	157,707,057	7.75	2021/4/14	3.45
4	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	281,000	3,550.53	99,771,151	3,654.98	102,705,213	10	2025/1/1	2.24
5	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	226,000	3,594.23	81,229,691	3,669.05	82,920,642	10	2021/1/1	1.81
6	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,430,000	2,979.91	72,412,024	3,002.29	72,955,655		2019/1/1	1.59
7	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	6,880,000,000	1.01	69,835,448	1.04	72,200,181	11	2025/9/15	1.57
8	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,950,000	616.59	67,517,221	618.64	67,741,212	8	2020/6/11	1.48
9	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000	935.06	66,389,710	945.22	67,110,796	10.5	2026/12/21	1.46
10	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,310,000	2,838.78	65,575,886	2,862.75	66,129,751		2019/7/1	1.44
11	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	180,000	3,594.49	64,703,303	3,658.75	65,857,594	10	2023/1/1	1.44
12	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,100,000	2,786.14	58,508,940	2,833.30	59,499,413	3.25	2025/7/25	1.30
13	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	6,650,000,000	0.81	54,069,825	0.84	56,056,740	7	2027/5/15	1.22
14	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,120,000	2,621.80	55,582,350	2,624.85	55,646,820	8	2025/3/12	1.21
15	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000	349.23	52,385,396	349.31	52,397,083	3.65	2021/12/17	1.14
16	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,450,000	605.89	51,197,761	613.12	51,809,238	6.5	2041/2/28	1.13
17	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,700,000	581.21	50,565,578	589.24	51,264,079	6.5	2022/6/9	1.12
18	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,160,000	696.24	49,851,449	707.08	50,627,558	7	2031/2/28	1.10
19	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,540,000	3,123.59	48,103,315	3,140.37	48,361,837		2018/7/1	1.05
20	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,650,000	2,928.78	48,324,870	2,910.36	48,020,940	9.5	2022/1/12	1.05
21	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,730,000	2,756.00	47,678,872	2,772.49	47,964,139	1.5	2020/4/25	1.04
22	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	5,330,000,000	0.88	46,925,532	0.89	47,910,606	8.375	2024/3/15	1.04
23	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,700,000	2,785.85	47,359,546	2,772.20	47,127,558	2	2021/4/25	1.03
24	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000	768.62	46,117,731	779.66	46,779,883	8	2030/1/31	1.02
25	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000	774.50	45,695,800	785.35	46,335,784	8.75	2048/2/28	1.01
26	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000	3,058.64	45,879,615	3,046.97	45,704,625	10.6	2026/2/11	1.00
27	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,760,000	2,592.04	45,620,002	2,579.22	45,394,424	4.378	2019/11/29	0.99

28	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,650,000	583.75	44,657,234	587.08	44,912,070	4.75	2018/6/14	0.98
29	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,650,000	2,573.62	42,464,825	2,647.82	43,689,163	2.5	2026/7/25	0.95
30	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,410,000	3,045.44	42,940,704	3,050.81	43,016,456	10.5	2020/1/15	0.94

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.13
特殊債券	0.23
合計	96.37

## (参考) J-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	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,429	628,879	2,156,429,371	609,000	2,088,261,000	7.23
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	3,278	618,412	2,027,155,845	590,000	1,934,020,000	6.70
3	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	10,158	167,831	1,704,831,744	172,800	1,755,302,400	6.08
4	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	6,671	245,148	1,635,383,994	218,400	1,456,946,400	5.04
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	7,648	180,178	1,378,003,690	171,000	1,307,808,000	4.53
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	6,690	180,639	1,208,479,062	176,400	1,180,116,000	4.08
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	3,818	279,464	1,066,993,704	289,400	1,104,929,200	3.82
8	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	4,343	237,790	1,032,724,315	241,300	1,047,965,900	3.63
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	3,278	290,183	951,221,407	304,500	998,151,000	3.45
10	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	2,235	454,857	1,016,606,719	431,000	963,285,000	3.33
11	日本	投資証券	GLP投資法人 投資証券	6,499	127,707	829,972,537	128,700	836,421,300	2.89
12	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	1,565	553,218	865,787,257	531,000	831,015,000	2.87
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	9,417	89,525	843,058,995	76,900	724,167,300	2.50
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,014	641,410	650,390,098	656,000	665,184,000	2.30
15	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,204	516,764	622,184,455	506,000	609,224,000	2.11
16	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,988	160,130	638,601,271	149,200	595,009,600	2.06
17	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	1,177	463,196	545,182,491	483,500	569,079,500	1.97
18	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	947	638,600	604,754,730	569,000	538,843,000	1.86
19	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	2,203	242,925	535,164,414	239,600	527,838,800	1.82
20	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,809	197,437	554,601,544	172,200	483,709,800	1.67

21	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	962	549,302	528,429,194	501,000	481,962,000	1.66
22	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,381	184,173	438,516,889	184,600	439,532,600	1.52
23	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,171	149,078	472,727,469	136,700	433,475,700	1.50
24	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	3,448	132,463	456,732,768	123,600	426,172,800	1.47
25	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,198	137,901	441,009,299	125,900	402,628,200	1.39
26	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	8,505	67,760	576,301,011	44,800	381,024,000	1.32
27	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,321	241,943	319,607,512	252,900	334,080,900	1.15
28	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,374	149,558	355,052,204	140,000	332,360,000	1.15
29	日本	投資証券	積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 投資証券	2,684	120,410	323,182,743	123,400	331,205,600	1.14
30	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	3,982	83,836	333,838,624	81,700	325,329,400	1.12

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.10
合計	98.10

## (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	48,740	22,357.22	1,089,690,913	19,076.78	929,802,628	4.93
2	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	22,700	27,071.08	614,513,691	24,614.48	558,748,832	2.96
3	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	80,510	5,618.92	452,379,665	5,741.88	462,279,097	2.45
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	55,150	8,049.49	443,929,715	7,940.80	437,935,572	2.32
5	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,890	19,210.99	401,317,755	20,566.67	429,637,753	2.28
6	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	53,960	7,630.55	411,744,929	7,236.25	390,468,320	2.07
7	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	55,860	7,201.21	402,260,139	6,977.09	389,740,588	2.06
8	フランス	投資証券	UNIBAIL RODAMCO-NA	15,110	28,550.11	431,392,232	25,754.85	389,155,784	2.06
9	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	23,420	14,505.23	339,712,509	14,739.52	345,199,610	1.83
10	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	811,000	397.69	322,531,760	375.97	304,919,131	1.61
11	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	26,220	10,995.75	288,308,824	11,260.51	295,250,580	1.56
12	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	24,260	11,384.79	276,195,187	11,829.31	286,979,148	1.52
13	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	41,300	7,111.41	293,701,349	6,611.35	273,049,032	1.44
14	香港	投資証券	LINK REIT	337,000	725.00	244,325,123	783.37	263,995,690	1.40
15	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,990	23,787.28	237,634,946	26,092.02	260,659,363	1.38
16	アメリカ	投資証券	HCP INC	71,400	3,528.11	251,907,162	3,476.76	248,241,242	1.31
17	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	112,700	1,785.14	201,185,503	2,080.00	234,416,293	1.24
18	アメリカ	投資証券	GGP INC	89,100	3,059.04	272,561,117	2,573.63	229,311,199	1.21
19	オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	291,500	898.38	261,878,964	763.97	222,699,004	1.18
20	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,330	10,468.46	181,418,534	11,418.69	197,886,040	1.05
21	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	15,350	11,520.31	176,836,885	11,797.90	181,097,771	0.96

22	イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	120,700	1,591.45	192,088,220	1,438.62	173,641,627	0.92
23	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,480	11,455.72	154,423,118	12,320.70	166,083,114	0.88
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	40,800	3,819.53	155,836,959	4,055.66	165,471,275	0.87
25	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	22,085	8,495.90	187,632,166	7,460.63	164,768,124	0.87
26	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,010	17,344.82	190,966,576	14,959.41	164,703,155	0.87
27	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	240,300	622.34	149,548,302	680.71	163,574,901	0.86
28	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	65,200	3,229.17	210,542,261	2,463.69	160,632,744	0.85
29	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	19,070	9,842.42	187,695,115	8,302.05	158,320,284	0.84
30	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	53,700	2,798.01	150,253,599	2,912.45	156,398,694	0.83

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.02
合計	99.02

## (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	特殊債券	商工債券 利付(3年)第173回	500,000,000	100.05	500,267,638	100.05	500,267,638	0.2	2017/6/27	2.59
2	日本	特殊債券	商工債券 利付(3年)第179回	400,000,000	100.11	400,472,976	100.11	400,472,976	0.14	2017/12/27	2.08
3	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第271回	300,000,000	100.08	300,268,447	100.08	300,268,447	0.35	2017/6/27	1.55
4	日本	社債券	三菱UFJリース 第19回社債間限定同順位特約付	300,000,000	100.07	300,234,822	100.07	300,234,822	0.487	2017/5/29	1.55
5	日本	特殊債券	商工債券 利付第743回い号	300,000,000	100.03	300,105,380	100.03	300,105,380	0.4	2017/4/27	1.55
6	日本	社債券	みずほコーポレート銀行 第29回特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	100.03	300,092,149	100.03	300,092,149	0.46	2017/4/21	1.55
7	日本	特殊債券	日本政策金融公庫社債 第24回財投機関債	280,000,000	100.04	280,126,102	100.04	280,126,102	0.368	2017/5/10	1.45
8	日本	社債券	みずほコーポレート銀行 第7回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.66	201,337,444	100.66	201,337,444	2.08	2017/7/27	1.04
9	日本	社債券	三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	200,000,000	100.66	201,320,000	100.66	201,320,000	2.08	2017/7/28	1.04
10	日本	社債券	みずほコーポレート銀行 第30回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.11	200,239,550	100.11	200,239,550	0.34	2017/7/25	1.04

11	日本	社債券	ホンダファイナンス 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.08	200,176,718	100.08	200,176,718	0.372	2017/6/20	1.03
12	日本	特殊債券	商工債券 利付第745回い号	200,000,000	100.08	200,174,812	100.08	200,174,812	0.35	2017/6/27	1.03
13	日本	社債券	ポヨラ・バンク・ピーエルシー 第3回円貨社債(2014)	200,000,000	100.06	200,124,338	100.06	200,124,338	0.303	2017/6/16	1.03
14	日本	特殊債券	商工債券 利付(3年)第174回	200,000,000	100.05	200,115,914	100.05	200,115,914	0.15	2017/7/27	1.03
15	日本	特殊債券	商工債券 利付(3年)第171回	200,000,000	100.02	200,043,179	100.02	200,043,179	0.2	2017/4/27	1.03
16	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,998,504		199,998,504			1.03
17	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,998,504		199,998,504			1.03
18	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,998,504		199,998,504			1.03
19	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,998,504		199,998,504			1.03
20	日本	社債券	関西電力 第486回	196,000,000	100.25	196,491,272	100.25	196,491,272	0.821	2017/7/25	1.02
21	日本	社債券	東北電力 第463回	194,000,000	100.15	194,310,038	100.15	194,310,038	0.72	2017/6/23	1.00
22	日本	特殊債券	東日本高速道路 第18回	130,000,000	100.19	130,257,463	100.19	130,257,463	0.387	2017/9/20	0.67
23	日本	社債券	中部電力 第411回	100,000,000	100.21	100,210,273	100.21	100,210,273	3.125	2017/4/25	0.52
24	日本	社債券	ラボバンク・ネダーランド 第16回円貨社債(2012)(コー)	100,000,000	100.16	100,161,145	100.16	100,161,145	1.142	2017/5/25	0.52
25	日本	社債券	三井住友ファイナンス&リース 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.12	100,129,000	100.12	100,129,000	0.381	2017/7/31	0.52
26	日本	社債券	中国電力 第371回	100,000,000	100.12	100,127,802	100.12	100,127,802	0.575	2017/6/23	0.52
27	日本	社債券	日立キャピタル 第43回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.12	100,127,258	100.12	100,127,258	0.57	2017/6/20	0.52
28	日本	社債券	トヨタファイナンス 第49回社債間限定同等特約付	100,000,000	100.09	100,096,390	100.09	100,096,390	0.415	2017/6/20	0.51
29	日本	社債券	西日本鉄道 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.09	100,093,000	100.09	100,093,000	2	2017/4/17	0.51
30	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第270回	100,000,000	100.05	100,055,905	100.05	100,055,905	0.35	2017/5/26	0.51

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	0.20
特殊債券	15.02
社債券	13.99

コマーシャルペーパー	4.67
合 計	33.90

**【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-KOKUSAI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-REIT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REIT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(2017年06月限)	買建	471	日本円	7,240,115,914	7,123,875,000	2.23

(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 - KOKUSAIマザーファンド

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2017 年06月限)	買建	447	米ドル	52,816,775	5,925,513,987	52,846,575	5,928,857,244	1.62
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2017年06 月限)	買建	23	カナダ ドル	4,186,884	351,907,601	4,200,260	353,031,853	0.09
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指数 先物(2017年06月 限)	買建	274	ユーロ	9,166,030	1,097,998,732	9,346,140	1,119,574,105	0.30
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200株価指数先 物(2017年06月限)	買建	22	豪ドル	3,173,150	272,383,196	3,234,000	277,606,560	0.07
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2017年06月限)	買建	63	英ポンド	4,590,630	643,055,455	4,599,000	644,227,920	0.17
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取 引所	SMI株価指数先物 (2017年06月限)	買建	33	スイス フラン	2,802,970	314,128,849	2,826,780	316,797,231	0.08

(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エマーシングマーケット株価指数先物(2017年06月限)	買建	105	米ドル	4,989,075	559,724,326	5,084,625	570,444,076	2.77
----------	------	----------------	---	----	-----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

## (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(2017年06月限)	買建	299	日本円	535,182,492	527,884,500	1.82

## (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(2017年06月限)	買建	42	米ドル	1,262,850	141,679,142	1,298,640	145,694,421	0.77
	フランス	Euronext	FTSE EPRA/NAREIT 欧州指数先物(2017 年06月限)	買建	3	ユーロ	58,890	7,054,434	59,595	7,138,885	0.03

## (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29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
第5計算期間 (2017年 2月17日)	6,788	6,791	1.0678	1.0683
2016年 3月末日	4,874		1.0716	
4月末日	5,020		1.0720	
5月末日	5,141		1.0716	
6月末日	5,333		1.0759	
7月末日	5,576		1.0861	
8月末日	5,749		1.0846	
9月末日	5,994		1.0816	
10月末日	6,100		1.0681	
11月末日	6,226		1.0616	
12月末日	6,596		1.0715	
2017年 1月末日	6,743		1.0666	
2月末日	6,879		1.0727	
3月末日	7,253		1.0692	

#### 【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
第5計算期間	2016年 2月18日～2017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%
第5計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	1.9%

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

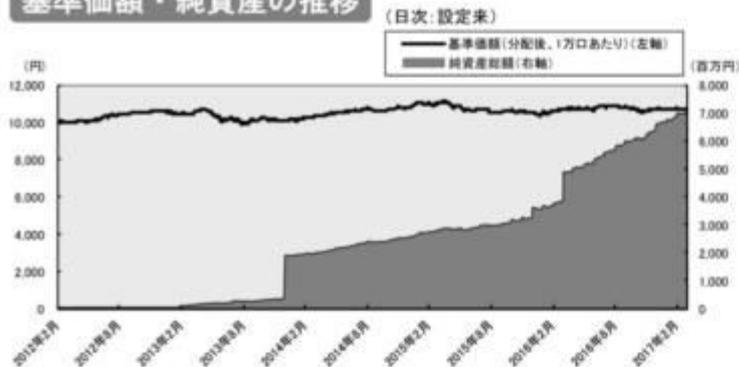
	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2012年 2月28日～2013年 2月18日	47,323,294		47,323,294
第2計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月17日	2,003,508,647	154,192,604	1,896,639,337
第3計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日	999,136,243	427,656,828	2,468,118,752
第4計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日	1,637,926,200	641,423,568	3,464,621,384
第5計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	3,774,359,201	881,664,759	6,357,315,826

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

## 参考情報

## 運用実績 (2017年3月31日現在)

### 基準価額・純資産の推移



### 分配の推移

(1万円あたり、課税前)

2017年2月	5 円
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	25 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	7.2
国内債券マザーファンド	13.5
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7.3
外国債券マザーファンド	33.4
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	6.2
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	4.0
J-REITインデックス マザーファンド	10.4
海外REITインデックス マザーファンド	5.9
野村マネー マザーファンド	5.3

#### 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	0.2
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.2
3	日本電信電話	情報・通信業	0.1
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.1

##### ・「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(5年)第129回	国債証券	0.2
2	国庫債券 利付(5年)第128回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付(10年)第344回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付(10年)第337回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付(10年)第342回	国債証券	0.2

##### ・「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	0.2
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.1
4	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.1
5	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	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 BOND	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	0.2
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.2
3	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.1
4	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.1
5	REPUBLIC OF COLOMBIA	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	0.2
2	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.2
3	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1
4	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL	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	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	0.6
4	日本リテールファンド投資法人 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	0.5

## ・「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

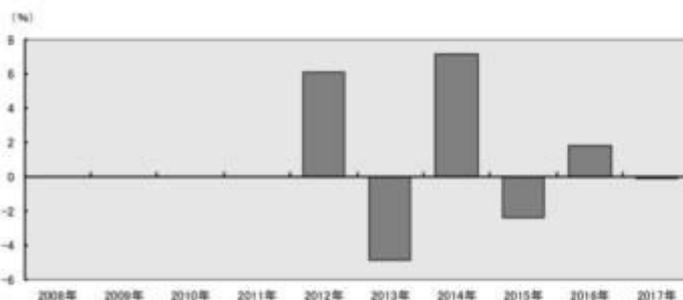
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.3
2	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.2
3	PROLOGIS INC	投資証券	0.1
4	WELLTOWER INC	投資証券	0.1
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	0.1

## ・「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	商工債券 利付(3年)第173回	特殊債券	0.1
2	商工債券 利付(3年)第179回	特殊債券	0.1
3	しんさん中金債券 利付第271回	特殊債券	0.1
4	三菱UFJリース 第19回社債間限定同順位特約付	社債券	0.1
5	商工債券 利付第743回い号	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。
- ・2017年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

受益者は、委託者に1口単位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

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

す。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> の金融商品取引所の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 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup> 日本証券業協会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 <sup>1</sup> 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發します。
- ( ) 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發します。

- ( ) 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5期計算期間(平成28年2月18日から平成29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4期 (平成28年 2月17日現在)	第5期 (平成29年 2月17日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	275,765,467	-
コール・ローン	412,186,646	1,989,359,211
親投資信託受益証券	2,888,052,611	4,813,282,244
派生商品評価勘定	90,804,431	43,513,242
未収利息	12	-
流動資産合計	3,666,809,167	6,846,154,697
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,395,824
未払収益分配金	1,732,310	3,178,657
未払解約金	12,674,487	18,405,737
未払受託者報酬	877,614	1,680,401
未払委託者報酬	20,185,001	31,048,284
未払利息	-	2,626
その他未払費用	52,593	100,758
流動負債合計	35,522,005	57,812,287
負債合計	35,522,005	57,812,287
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,464,621,384	6,357,315,826
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	166,665,778	431,026,584
(分配準備積立金)	167,318,382	197,298,461
元本等合計	3,631,287,162	6,788,342,410
純資産合計	3,631,287,162	6,788,342,410
負債純資産合計	3,666,809,167	6,846,154,697

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日	自	平成28年 2月18日 至 平成29年 2月17日
営業収益				
受取利息		401,380		356
有価証券売買等損益		147,008,742		126,779,633
為替差損益		51,263,174		453,740
営業収益合計		95,344,188		127,233,729
営業費用				
支払利息		-		648,924
受託者報酬		1,637,765		2,984,266
委託者報酬		37,668,422		61,037,047
その他費用		108,942		189,725
営業費用合計		39,415,129		64,859,962
営業利益又は営業損失（ ）		134,759,317		62,373,767
経常利益又は経常損失（ ）		134,759,317		62,373,767
当期純利益又は当期純損失（ ）		134,759,317		62,373,767
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		15,950,280		10,014,743
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		239,432,722		166,665,778
剰余金増加額又は欠損金減少額		107,198,905		266,068,627
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		107,198,905		266,068,627
剰余金減少額又は欠損金増加額		59,424,502		50,888,188
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		59,424,502		50,888,188
分配金		1,732,310		3,178,657
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		166,665,778		431,026,584

## （ 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28年 2月18日から平成29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4期 平成28年 2月17日現在	第5期 平成29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 3,464,621,384口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,357,315,826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 1.0481円 (10,000口当たり純資産額) (10,481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 1.0678円 (10,000口当たり純資産額) (10,678円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日	第5期 自 平成28年 2月18日 至 平成29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>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	<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>57,858,096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>612,081,155円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>142,619,022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>812,558,273円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>6,357,315,826口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	57,858,096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	612,081,155円	分配準備積立金額	D	142,619,022円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	812,558,273円	当ファンドの期末残存口数	F	6,357,315,826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																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	57,858,096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	612,081,155円																																									
分配準備積立金額	D	142,619,022円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	812,558,273円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	6,357,315,826口																																									

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
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	1,732,310円

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,278円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	3,178,657円

## 2. 追加情報

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

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日	第5期 自 平成28年 2月18日 至 平成29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>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>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><b>市場リスクの管理</b> 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p><b>信用リスクの管理</b> 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p><b>流動性リスクの管理</b> 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
--	----

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 平成28年 2月17日現在	第5期 平成29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ぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 <b>親投資信託受益証券</b> （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><b>派生商品評価勘定</b> 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><b>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</b> 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4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日	第5期 自 平成28年 2月18日 至 平成29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4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日		第5期 自 平成28年 2月18日 至 平成29年 2月17日	
期首元本額	2,468,118,752円	期首元本額	3,464,621,384円
期中追加設定元本額	1,637,926,200円	期中追加設定元本額	3,774,359,201円
期中一部解約元本額	641,423,568円	期中一部解約元本額	881,664,759円

## 2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第4期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日	第5期 自 平成28年 2月18日 至 平成29年 2月17日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	104,410,862	109,948,038
合計	104,410,862	109,948,038

## 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4期(平成28年 2月17日現在)				第5期(平成29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	1,929,822,531	-	1,839,018,100	90,804,431	2,508,452,018	-	2,468,334,600	40,117,418
米ドル	1,012,275,830	-	955,018,600	57,257,230	1,380,843,555	-	1,352,568,900	28,274,655
カナダドル	48,187,705	-	45,314,500	2,873,205	60,706,137	-	59,843,700	862,437
ユーロ	673,958,771	-	655,265,500	18,693,271	780,805,023	-	773,256,800	7,548,223
英ポンド	147,581,935	-	138,748,500	8,833,435	205,076,848	-	199,825,200	5,251,648
豪ドル	47,818,290	-	44,671,000	3,147,290	81,020,455	-	82,840,000	1,819,545
合計	1,929,822,531	-	1,839,018,100	90,804,431	2,508,452,018	-	2,468,334,600	40,117,418

#### （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29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29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	260,522,773	379,685,889	
		国内債券マザーファンド	461,273,186	613,032,064	
		外国債券マザーファンド	818,249,776	1,765,619,366	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	159,217,131	365,896,888	
		野村マネー マザーファンド	379,067,282	386,989,788	
		J-REITインデックス マザーファンド	333,570,155	658,300,700	
		海外REITインデックス マザーファンド	85,452,862	184,749,087	
		新興国債券マザーファンド	155,680,693	281,486,261	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	139,276,794	177,522,201	
	小計	銘柄数: 9 組入時価比率: 70.9%	2,792,310,652	4,813,282,244 100.0%	
合計			4,813,282,244		

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

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

##### 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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-KOKUSA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29年 2月17日現在）	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	25,589,882,766
株式	315,771,079,280
派生商品評価勘定	82,192,449
未収入金	634,028
未収配当金	500,259,987
未収利息	990,761
その他未収収益	33,247,074
差入委託証拠金	115,420,021
<b>流動資産合計</b>	<b>342,093,706,366</b>
<b>資産合計</b>	<b>342,093,706,366</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	563,402
未払解約金	213,432,745
未払利息	33,785
有価証券貸借取引受入金	20,450,861,706
<b>流動負債合計</b>	<b>20,664,891,638</b>
<b>負債合計</b>	<b>20,664,891,638</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	220,544,896,545
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	100,883,918,183
<b>元本等合計</b>	<b>321,428,814,728</b>
<b>純資産合計</b>	<b>321,428,814,728</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>342,093,706,366</b>

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
-------------------	----

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成29年 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	1,4574円
(10,000口当たり純資産額)	(14,574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	19,377,593,300円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年 2月18日 至 平成29年 2月17日	
1.金融商品に対する取組方針	<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>
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 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29年 2月17日現在	
期首	平成28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	220,768,182,636円
同期中における追加設定元本額	36,297,794,453円
同期中における一部解約元本額	36,521,080,544円
期末元本額	220,544,896,545円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	182,940,795円
バランスセレクト50	425,138,108円
バランスセレクト70	494,689,378円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,380,532,168円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	4,295,554,352円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	8,063,765,265円
野村資産設計ファンド2015	73,890,979円
野村資産設計ファンド2020	85,293,778円
野村資産設計ファンド2025	113,903,783円
野村資産設計ファンド2030	108,606,556円
野村資産設計ファンド2035	83,538,382円
野村資産設計ファンド2040	254,586,294円

野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	77,144,400,323円
のむらップ・ファンド（保守型）	2,241,336,021円
のむらップ・ファンド（普通型）	5,002,876,502円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,579,787,222円
野村資産設計ファンド2045	26,234,105円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,170,226,788円
マイ・ロード	3,516,924,665円
ネクストコア	165,031,641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	409,950,559円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,435,976,290円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,048,686,918円
野村資産設計ファンド2050	26,448,425円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	9,558,388円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,873,679円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,232,837円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,037,288円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	163,850,774円
のむらップ・ファンド（やや積極型）	40,115,125円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	92,022円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	81,047円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	129,245円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	113,061円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	247,541円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	3,554,429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）	715,269,982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）	612,835,316円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	2,831,489,452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）	1,040,994,361円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	4,524,104円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	26,800,718円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	8,063,075円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	6,547,607,131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）	428,518,708円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	2,832,174,292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）	1,117,919,342円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,879,862,453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）	399,726,997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）	124,743,409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）	361,637,748円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	5,738,361,680円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	808,569,579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）	683,929,866円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用）	1,021,394,163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）	1,297,527,492円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	6,960,790円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	32,620,842円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	37,740,848円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	97,907,164円

マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,135,013,334円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,593,136,903円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,752,336,248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)	31,338,434,271円
マイバランスDC30	2,358,834,527円
マイバランスDC50	3,211,799,843円
マイバランスDC70	2,880,643,438円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,640,109,008円
野村DC運用戦略ファンド	260,522,773円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	787,570円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	155,265,848円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	3,110,604円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	5,517,933円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年 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	6,200	2,826.00	17,521,200	
		日本水産	204,000	569.00	116,076,000	
		マルハニチロ	29,800	3,290.00	98,042,000	貸付有価証券 100株
		カネコ種苗	5,400	1,425.00	7,695,000	
		サカタのタネ	23,200	3,175.00	73,660,000	貸付有価証券 9,800株(1,000株)
		ホクト	16,000	2,167.00	34,672,000	
		ホクリヨウ	1,700	768.00	1,305,600	貸付有価証券 500株(500株)
		住石ホールディングス	43,600	99.00	4,316,400	貸付有価証券 14,200株(12,600株)
		日鉄鉱業	4,400	6,180.00	27,192,000	
		三井松島産業	9,700	1,510.00	14,647,000	
		国際石油開発帝石	827,700	1,127.00	932,817,900	貸付有価証券 6,700株
		日本海洋掘削	5,500	2,411.00	13,260,500	貸付有価証券 2,500株(300株)

石油資源開発	24,900	2,709.00	67,454,100	貸付有価証券 8,700株
K & Oエナジーグループ	10,600	1,766.00	18,719,600	貸付有価証券 600株
ショーボンドホールディングス	15,200	5,000.00	76,000,000	貸付有価証券 7,200株
ミライト・ホールディングス	48,300	1,049.00	50,666,700	貸付有価証券 7,400株（4,400株）
タマホーム	11,800	551.00	6,501,800	貸付有価証券 4,200株（1,300株）
サンヨーホームズ	3,300	658.00	2,171,400	
ファーストコーポレーション	2,600	918.00	2,386,800	貸付有価証券 1,200株
インベスターズクラウド	1,500	4,530.00	6,795,000	貸付有価証券 700株（700株）
ダイセキ環境ソリューション	3,700	1,596.00	5,905,200	貸付有価証券 1,500株
安藤・間	112,900	856.00	96,642,400	貸付有価証券 41,900株（10,400株）
東急建設	55,800	836.00	46,648,800	貸付有価証券 24,400株（300株）
コムシスホールディングス	61,400	2,023.00	124,212,200	貸付有価証券 1,200株
ミサワホーム	18,600	1,051.00	19,548,600	貸付有価証券 7,200株（4,500株）
ビーアールホールディングス	15,600	300.00	4,680,000	
高松コンストラクショングループ	11,800	2,648.00	31,246,400	
東建コーポレーション	5,900	8,100.00	47,790,000	
ソネック	2,000	637.00	1,274,000	
ヤマウラ	7,400	605.00	4,477,000	
大成建設	799,000	805.00	643,195,000	
大林組	471,200	1,064.00	501,356,800	
清水建設	481,000	1,038.00	499,278,000	貸付有価証券 34,000株
飛島建設	151,300	174.00	26,326,200	貸付有価証券 33,800株
長谷工コーポレーション	183,300	1,282.00	234,990,600	
松井建設	17,300	1,054.00	18,234,200	
銭高組	22,000	425.00	9,350,000	貸付有価証券

				9,000株
鹿島建設	690,000	745.00	514,050,000	
不動テトラ	126,800	204.00	25,867,200	
大末建設	5,500	999.00	5,494,500	
鉄建建設	96,000	338.00	32,448,000	貸付有価証券 45,000株(1,000株)
西松建設	182,000	586.00	106,652,000	
三井住友建設	602,000	123.00	74,046,000	
大豊建設	57,000	522.00	29,754,000	
前田建設工業	99,000	1,008.00	99,792,000	
佐田建設	10,800	422.00	4,557,600	
ナカノフドー建設	12,000	566.00	6,792,000	
奥村組	129,000	705.00	90,945,000	
東鉄工業	18,900	3,135.00	59,251,500	貸付有価証券 8,800株
イチケン	14,000	486.00	6,804,000	貸付有価証券 3,000株
浅沼組	51,000	360.00	18,360,000	
戸田建設	183,000	668.00	122,244,000	貸付有価証券 18,000株
熊谷組	247,000	318.00	78,546,000	貸付有価証券 7,000株
青木あすなろ建設	10,300	813.00	8,373,900	
北野建設	33,000	320.00	10,560,000	
植木組	19,000	266.00	5,054,000	
三井ホーム	20,000	581.00	11,620,000	
矢作建設工業	21,400	1,078.00	23,069,200	
ピーエス三菱	16,500	401.00	6,616,500	貸付有価証券 4,200株(1,100株)
日本ハウスホールディングス	32,000	516.00	16,512,000	貸付有価証券 600株
大東建託	57,800	15,855.00	916,419,000	
新日本建設	18,700	900.00	16,830,000	
N I P P O	36,000	2,156.00	77,616,000	
東亜道路工業	30,000	342.00	10,260,000	貸付有価証券 1,000株
前田道路	49,000	1,996.00	97,804,000	
日本道路	47,000	474.00	22,278,000	
東亜建設工業	12,700	1,950.00	24,765,000	貸付有価証券

				6,000株
若築建設	90,000	152.00	13,680,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
東洋建設	45,200	423.00	19,119,600	貸付有価証券 5,800株(100株)
五洋建設	174,300	519.00	90,461,700	
大林道路	16,300	689.00	11,230,700	貸付有価証券 1,400株
世紀東急工業	22,900	514.00	11,770,600	
福田組	25,000	1,041.00	26,025,000	
住友林業	108,100	1,607.00	173,716,700	
日本基礎技術	17,500	359.00	6,282,500	
日成ビルド工業	46,000	550.00	25,300,000	
ヤマダ・エスバイエル ホーム	80,000	79.00	6,320,000	
巴コーポレーション	19,500	359.00	7,000,500	
パナホーム	59,000	1,050.00	61,950,000	貸付有価証券 13,000株(4,000株)
大和ハウス工業	464,100	3,082.00	1,430,356,200	
ライト工業	30,200	1,165.00	35,183,000	貸付有価証券 900株
積水ハウス	494,400	1,802.50	891,156,000	
日特建設	13,400	446.00	5,976,400	貸付有価証券 5,900株
北陸電気工事	7,600	881.00	6,695,600	
ユアテック	25,000	803.00	20,075,000	
西部電気工業	2,600	2,279.00	5,925,400	貸付有価証券 300株(300株)
四電工	12,000	423.00	5,076,000	
中電工	19,900	2,356.00	46,884,400	貸付有価証券 100株
関電工	63,000	913.00	57,519,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
きんでん	104,500	1,477.00	154,346,500	
東京エネシス	16,000	981.00	15,696,000	
トーエネック	22,000	559.00	12,298,000	貸付有価証券 1,000株
住友電設	10,900	1,269.00	13,832,100	
日本電設工業	25,600	2,003.00	51,276,800	貸付有価証券 4,200株

協和エクシオ	61,600	1,593.00	98,128,800	貸付有価証券 1,200株
新日本空調	12,100	1,363.00	16,492,300	貸付有価証券 800株
N D S	2,500	2,915.00	7,287,500	
九電工	30,500	2,930.00	89,365,000	貸付有価証券 9,500株（4,000株）
三機工業	34,800	1,007.00	35,043,600	
日揮	146,600	2,016.00	295,545,600	貸付有価証券 10,800株
中外炉工業	48,000	234.00	11,232,000	貸付有価証券 6,000株
ヤマト	14,100	533.00	7,515,300	
太平電業	21,000	1,087.00	22,827,000	
高砂熱学工業	43,200	1,632.00	70,502,400	貸付有価証券 9,800株
三晃金属工業	1,400	3,195.00	4,473,000	
朝日工業社	3,600	3,045.00	10,962,000	
明星工業	28,400	615.00	17,466,000	
大気社	20,800	2,844.00	59,155,200	貸付有価証券 6,300株
ダイダン	21,000	963.00	20,223,000	
日比谷総合設備	17,500	1,705.00	29,837,500	
東芝プラントシステム	25,500	1,626.00	41,463,000	貸付有価証券 4,400株（4,400株）
OSJBホールディングス	48,000	252.00	12,096,000	貸付有価証券 22,900株
東洋エンジニアリング	92,000	272.00	25,024,000	貸付有価証券 43,000株
千代田化工建設	113,000	721.00	81,473,000	貸付有価証券 2,000株
新興プランテック	32,300	935.00	30,200,500	
日本製粉	46,700	1,693.00	79,063,100	
日清製粉グループ本社	172,300	1,678.00	289,119,400	
日東富士製粉	1,000	3,970.00	3,970,000	
昭和産業	65,000	605.00	39,325,000	貸付有価証券 26,000株（26,000株）
鳥越製粉	12,500	807.00	10,087,500	貸付有価証券 400株
中部飼料	17,200	1,146.00	19,711,200	貸付有価証券

				400株
フィード・ワン	94,500	180.00	17,010,000	
東洋精糖	24,000	119.00	2,856,000	
日本甜菜製糖	8,000	2,490.00	19,920,000	
三井製糖	11,100	2,631.00	29,204,100	
塩水港精糖	16,800	254.00	4,267,200	
日新製糖	6,700	1,823.00	12,214,100	
森永製菓	30,700	4,705.00	144,443,500	
中村屋	3,600	5,130.00	18,468,000	
江崎グリコ	39,300	5,300.00	208,290,000	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
名糖産業	6,800	1,395.00	9,486,000	
不二家	90,000	225.00	20,250,000	
山崎製パン	115,100	2,215.00	254,946,500	貸付有価証券 54,300株
第一屋製パン	24,000	127.00	3,048,000	
モロゾフ	24,000	509.00	12,216,000	
亀田製菓	8,700	4,955.00	43,108,500	貸付有価証券 1,900株(1,400株)
寿スピリッツ	11,200	2,595.00	29,064,000	貸付有価証券 1,600株
カルビー	64,100	3,695.00	236,849,500	貸付有価証券 29,200株(4,400株)
森永乳業	141,000	723.00	101,943,000	貸付有価証券 32,000株
六甲バター	7,000	2,459.00	17,213,000	貸付有価証券 200株
ヤクルト本社	84,200	6,230.00	524,566,000	貸付有価証券 37,700株(36,500株)
明治ホールディングス	93,100	8,690.00	809,039,000	
雪印メグミルク	33,900	2,949.00	99,971,100	
プリマハム	99,000	441.00	43,659,000	
日本ハム	107,000	3,090.00	330,630,000	
林兼産業	5,000	875.00	4,375,000	
丸大食品	75,000	498.00	37,350,000	
S Foods	8,400	3,205.00	26,922,000	貸付有価証券 4,000株(2,600株)
伊藤ハム米久ホールディングス	90,600	1,082.00	98,029,200	

サッポロホールディングス	51,500	2,859.00	147,238,500	貸付有価証券 19,300株
アサヒグループホールディングス	294,800	4,128.00	1,216,934,400	
キリンホールディングス	676,500	1,893.50	1,280,952,750	
宝ホールディングス	113,700	1,103.00	125,411,100	
オエノンホールディングス	40,000	265.00	10,600,000	
養命酒製造	4,800	1,875.00	9,000,000	
コカ・コーラウエスト	53,200	3,130.00	166,516,000	貸付有価証券 6,400株
コカ・コーライースト ジャパン	61,100	2,324.00	141,996,400	
サントリー食品インター ナショナル	107,600	4,620.00	497,112,000	
ダイドーグループホール ディングス	7,200	5,700.00	41,040,000	貸付有価証券 200株（200株）
伊藤園	46,600	3,705.00	172,653,000	貸付有価証券 12,000株（2,100株）
キーコーヒー	13,800	2,168.00	29,918,400	貸付有価証券 300株
ユニカフェ	4,200	985.00	4,137,000	
ジャパンフーズ	2,000	1,363.00	2,726,000	貸付有価証券 800株
日清オイリオグループ	91,000	575.00	52,325,000	
不二製油グループ本社	41,900	2,385.00	99,931,500	貸付有価証券 11,700株
かどや製油	1,500	4,810.00	7,215,000	貸付有価証券 300株
J - オイルミルズ	7,300	4,080.00	29,784,000	
キッコーマン	110,000	3,400.00	374,000,000	
味の素	323,700	2,337.50	756,648,750	
キューピー	79,900	2,913.00	232,748,700	
ハウス食品グループ本社	58,200	2,379.00	138,457,800	
カゴメ	56,400	2,877.00	162,262,800	貸付有価証券 4,200株
焼津水産化学工業	7,400	1,227.00	9,079,800	
アリアケジャパン	12,900	6,190.00	79,851,000	貸付有価証券 5,100株
ピエトロ	1,800	1,652.00	2,973,600	貸付有価証券

				700株
エバラ食品工業	3,800	2,094.00	7,957,200	
ニチレイ	77,300	2,563.00	198,119,900	
東洋水産	77,200	3,950.00	304,940,000	
イトアンド	1,700	2,273.00	3,864,100	貸付有価証券 600株
大冷	1,200	1,796.00	2,155,200	
日清食品ホールディングス	61,400	6,100.00	374,540,000	貸付有価証券 700株
永谷園ホールディングス	15,000	1,417.00	21,255,000	
一正蒲鉾	5,500	1,184.00	6,512,000	貸付有価証券 1,700株
フジッコ	15,200	2,441.00	37,103,200	
ロック・フィールド	15,200	1,684.00	25,596,800	
日本たばこ産業	870,800	3,768.00	3,281,174,400	貸付有価証券 166,000株
ケンコーマヨネーズ	6,400	2,691.00	17,222,400	貸付有価証券 1,400株
わらべや日洋ホールディングス	9,200	2,526.00	23,239,200	貸付有価証券 4,300株
なとり	7,900	1,841.00	14,543,900	貸付有価証券 2,000株
北の達人コーポレーション	3,400	630.00	2,142,000	貸付有価証券 1,500株
ユーグレナ	50,600	1,223.00	61,883,800	貸付有価証券 24,400株(2,700株)
ミヨシ油脂	54,000	143.00	7,722,000	
理研ビタミン	4,700	4,330.00	20,351,000	貸付有価証券 1,900株(100株)
片倉工業	18,400	1,506.00	27,710,400	貸付有価証券 100株
グンゼ	110,000	421.00	46,310,000	貸付有価証券 1,000株
東洋紡	582,000	198.00	115,236,000	
ユニチカ	402,000	90.00	36,180,000	
富士紡ホールディングス	7,100	3,465.00	24,601,500	貸付有価証券 300株
倉敷紡績	148,000	236.00	34,928,000	
シキボウ	79,000	154.00	12,166,000	
日本毛織	41,400	908.00	37,591,200	貸付有価証券

				300株
ダイトウボウ	20,000	75.00	1,500,000	貸付有価証券 3,000株
トーア紡コーポレーシ ョン	6,200	547.00	3,391,400	貸付有価証券 100株(100株)
ダイドーリミテッド	16,400	454.00	7,445,600	貸付有価証券 100株
帝国繊維	15,400	1,676.00	25,810,400	
帝人	120,000	2,150.00	258,000,000	貸付有価証券 9,800株(1,800株)
東レ	1,065,000	981.10	1,044,871,500	貸付有価証券 123,000株
サカイオーベックス	3,600	1,938.00	6,976,800	
住江織物	40,000	277.00	11,080,000	貸付有価証券 8,000株(6,000株)
日本フェルト	8,400	520.00	4,368,000	
イチカワ	10,000	298.00	2,980,000	
日東製網	1,600	1,952.00	3,123,200	貸付有価証券 400株
アツギ	121,000	127.00	15,367,000	
ダイニック	28,000	194.00	5,432,000	
セーレン	36,600	1,603.00	58,669,800	
ソトー	5,500	1,165.00	6,407,500	
東海染工	20,000	146.00	2,920,000	
小松精練	20,700	740.00	15,318,000	貸付有価証券 700株
ワコールホールディング ス	87,000	1,439.00	125,193,000	
ホギメディカル	9,200	6,890.00	63,388,000	貸付有価証券 2,600株(2,400株)
レナウン	39,700	114.00	4,525,800	貸付有価証券 8,100株(7,000株)
クラウディア	3,400	549.00	1,866,600	貸付有価証券 1,400株
T S Iホールディングス	60,500	825.00	49,912,500	
三陽商会	77,000	172.00	13,244,000	貸付有価証券 36,000株(2,000株)
ナイガイ	54,000	64.00	3,456,000	貸付有価証券 6,000株
オンワードホールディン グス	95,000	864.00	82,080,000	貸付有価証券 44,000株(2,000株)

ルック	27,000	197.00	5,319,000	貸付有価証券 12,000株(7,000株)
キムラタン	620,000	7.00	4,340,000	貸付有価証券 69,000株(6,000株)
ゴールドウイン	6,200	5,720.00	35,464,000	貸付有価証券 100株
デサント	33,500	1,252.00	41,942,000	
キング	7,300	415.00	3,029,500	
ヤマトインターナショナル	9,000	412.00	3,708,000	
特種東海製紙	8,500	4,205.00	35,742,500	
王子ホールディングス	574,000	520.00	298,480,000	
日本製紙	65,800	1,984.00	130,547,200	貸付有価証券 20,500株(1,700株)
三菱製紙	20,900	764.00	15,967,600	
北越紀州製紙	82,000	750.00	61,500,000	貸付有価証券 5,600株
中越パルプ工業	58,000	244.00	14,152,000	貸付有価証券 19,000株(19,000株)
巴川製紙所	23,000	250.00	5,750,000	
大王製紙	58,500	1,300.00	76,050,000	貸付有価証券 28,000株(8,000株)
阿波製紙	2,700	604.00	1,630,800	
レンゴー	141,600	653.00	92,464,800	
トーモク	46,000	337.00	15,502,000	
ザ・パック	10,400	3,065.00	31,876,000	
クラレ	247,200	1,719.00	424,936,800	貸付有価証券 97,700株
旭化成	916,000	1,089.50	997,982,000	貸付有価証券 41,000株
共和レザー	8,500	926.00	7,871,000	
昭和電工	97,800	1,975.00	193,155,000	貸付有価証券 13,300株(6,200株)
住友化学	1,081,000	638.00	689,678,000	
住友精化	6,100	4,840.00	29,524,000	貸付有価証券 700株
日産化学工業	80,500	3,950.00	317,975,000	
ラサ工業	55,000	145.00	7,975,000	
クレハ	11,100	4,925.00	54,667,500	貸付有価証券 1,800株(100株)

多木化学	10,000	948.00	9,480,000	
テイカ	22,000	724.00	15,928,000	
石原産業	26,400	1,105.00	29,172,000	貸付有価証券 1,100株
片倉コープアグリ	20,000	240.00	4,800,000	
日東エフシー	8,600	948.00	8,152,800	貸付有価証券 800株
日本曹達	88,000	661.00	58,168,000	貸付有価証券 1,000株
東ソー	425,000	994.00	422,450,000	
トクヤマ	228,000	581.00	132,468,000	貸付有価証券 24,000株
セントラル硝子	150,000	546.00	81,900,000	
東亜合成	91,900	1,275.00	117,172,500	
大阪ソーダ	63,000	498.00	31,374,000	貸付有価証券 30,000株（26,000株）
関東電化工業	30,000	1,194.00	35,820,000	貸付有価証券 14,000株
デンカ	304,000	611.00	185,744,000	貸付有価証券 1,000株
信越化学工業	263,400	9,893.00	2,605,816,200	貸付有価証券 3,800株
日本カーバイド工業	50,000	161.00	8,050,000	
堺化学工業	55,000	413.00	22,715,000	
エア・ウォーター	121,100	2,183.00	264,361,300	貸付有価証券 1,900株
大陽日酸	113,100	1,434.00	162,185,400	貸付有価証券 32,000株
日本化学工業	54,000	241.00	13,014,000	
日本パーカライジング	75,100	1,404.00	105,440,400	
高圧ガス工業	21,800	764.00	16,655,200	
チタン工業	17,000	192.00	3,264,000	
四国化成工業	21,000	1,184.00	24,864,000	
戸田工業	29,000	285.00	8,265,000	貸付有価証券 1,000株
ステラ ケミファ	7,000	3,520.00	24,640,000	貸付有価証券 3,300株
保土谷化学工業	5,100	3,610.00	18,411,000	貸付有価証券 200株
日本触媒	23,100	7,430.00	171,633,000	貸付有価証券

				6,900株
大日精化工業	61,000	734.00	44,774,000	
カネカ	198,000	902.00	178,596,000	
三菱瓦斯化学	136,800	2,363.00	323,258,400	
三井化学	667,000	547.00	364,849,000	
J S R	147,600	2,085.00	307,746,000	
東京応化工業	27,500	3,795.00	104,362,500	貸付有価証券 100株
大阪有機化学工業	9,500	947.00	8,996,500	
三菱ケミカルホールディングス	989,500	855.80	846,814,100	
K Hネオケム	18,000	1,357.00	24,426,000	貸付有価証券 300株
ダイセル	198,100	1,383.00	273,972,300	
住友ベークライト	130,000	668.00	86,840,000	
積水化学工業	333,400	1,882.00	627,458,800	
日本ゼオン	124,000	1,334.00	165,416,000	
アイカ工業	47,100	2,924.00	137,720,400	
宇部興産	740,000	284.00	210,160,000	
積水樹脂	22,700	1,875.00	42,562,500	
タキロン	31,000	541.00	16,771,000	
旭有機材	47,000	242.00	11,374,000	
日立化成	81,600	3,285.00	268,056,000	
ニチバン	14,000	939.00	13,146,000	
リケンテクノス	31,700	557.00	17,656,900	貸付有価証券 8,300株(800株)
大倉工業	35,000	572.00	20,020,000	
積水化成成品工業	20,900	836.00	17,472,400	
群栄化学工業	3,500	3,765.00	13,177,500	
タイガースポリマー	7,200	802.00	5,774,400	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
ミライアル	5,300	924.00	4,897,200	
ダイキアクシス	2,400	1,277.00	3,064,800	
ダイキョーニシカワ	25,700	1,462.00	37,573,400	貸付有価証券 8,800株
日本化薬	95,000	1,558.00	148,010,000	
カーリットホールディングス	13,600	594.00	8,078,400	貸付有価証券 6,300株

日本精化	12,200	945.00	11,529,000	貸付有価証券 100株(100株)
扶桑化学工業	10,400	3,205.00	33,332,000	貸付有価証券 800株
A D E K A	63,200	1,573.00	99,413,600	
日油	118,000	1,266.00	149,388,000	
新日本理化	23,200	152.00	3,526,400	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
ハリマ化成グループ	12,500	797.00	9,962,500	
花王	373,000	5,696.00	2,124,608,000	貸付有価証券 39,800株
第一工業製薬	33,000	448.00	14,784,000	
日華化学	4,600	1,282.00	5,897,200	貸付有価証券 2,100株
ニイタカ	2,100	1,500.00	3,150,000	
三洋化成工業	9,200	4,750.00	43,700,000	貸付有価証券 1,300株
有機合成薬品工業	9,600	272.00	2,611,200	貸付有価証券 100株
大日本塗料	84,000	234.00	19,656,000	
日本ペイントホールディングス	113,300	3,585.00	406,180,500	貸付有価証券 28,900株
関西ペイント	154,300	2,222.00	342,854,600	貸付有価証券 70,000株(33,200株)
神東塗料	11,000	222.00	2,442,000	貸付有価証券 5,000株
中国塗料	42,100	856.00	36,037,600	
日本特殊塗料	10,300	1,775.00	18,282,500	
藤倉化成	19,900	677.00	13,472,300	
太陽ホールディングス	12,000	4,805.00	57,660,000	
D I C	58,000	3,905.00	226,490,000	
サカタインクス	30,000	1,613.00	48,390,000	貸付有価証券 3,200株
東洋インキ S C ホールディングス	145,000	559.00	81,055,000	
T & K T O K A	10,600	1,092.00	11,575,200	
富士フイルムホールディングス	291,300	4,400.00	1,281,720,000	
資生堂	278,600	2,837.50	790,527,500	
ライオン	182,000	1,900.00	345,800,000	貸付有価証券

				85,000株(39,000株)
高砂香料工業	9,700	3,660.00	35,502,000	
マンダム	14,700	5,200.00	76,440,000	
ミルボン	7,900	5,320.00	42,028,000	
ファンケル	31,200	1,614.00	50,356,800	貸付有価証券 1,800株(1,100株)
コーセー	23,700	9,090.00	215,433,000	
コタ	5,500	1,321.00	7,265,500	
シーズ・ホールディングス	19,100	3,075.00	58,732,500	
シーボン	1,700	2,555.00	4,343,500	貸付有価証券 700株
ポーラ・オルビスホールディングス	15,000	11,170.00	167,550,000	貸付有価証券 7,100株
ノエビアホールディングス	9,300	4,245.00	39,478,500	貸付有価証券 100株(100株)
アジュバンコスメジャパン	2,800	974.00	2,727,200	
エステー	10,000	1,753.00	17,530,000	
アグロ カネショウ	5,700	1,297.00	7,392,900	
コニシ	23,000	1,332.00	30,636,000	
長谷川香料	18,600	1,990.00	37,014,000	
星光PMC	8,000	1,144.00	9,152,000	貸付有価証券 3,400株(800株)
小林製薬	40,700	5,200.00	211,640,000	
荒川化学工業	12,600	1,990.00	25,074,000	
メック	11,400	1,226.00	13,976,400	貸付有価証券 5,300株(2,500株)
日本高純度化学	4,100	2,497.00	10,237,700	
タカラバイオ	31,500	1,547.00	48,730,500	貸付有価証券 5,600株
JCU	4,600	7,050.00	32,430,000	
新田ゼラチン	8,800	755.00	6,644,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
OATアグリオ	1,700	1,438.00	2,444,600	
デクセリアルズ	38,500	1,292.00	49,742,000	貸付有価証券 100株(100株)
アース製薬	10,600	5,130.00	54,378,000	
イハラケミカル工業	20,300	1,071.00	21,741,300	貸付有価証券 600株

北興化学工業	14,000	485.00	6,790,000	
大成ラミック	4,100	3,140.00	12,874,000	
クマイ化学工業	30,300	686.00	20,785,800	貸付有価証券 14,200株（10,300株）
日本農薬	33,500	693.00	23,215,500	貸付有価証券 12,700株（500株）
アキレス	12,000	1,802.00	21,624,000	
有沢製作所	24,800	775.00	19,220,000	
日東電工	105,900	9,585.00	1,015,051,500	
レック	4,600	4,505.00	20,723,000	
きもと	26,200	248.00	6,497,600	貸付有価証券 3,300株
藤森工業	10,900	3,070.00	33,463,000	
前澤化成工業	9,600	1,205.00	11,568,000	
J S P	6,800	2,601.00	17,686,800	
エフピコ	13,000	5,180.00	67,340,000	貸付有価証券 6,100株
天馬	9,700	2,129.00	20,651,300	
信越ポリマー	28,800	845.00	24,336,000	
東リ	34,900	409.00	14,274,100	
ニフコ	25,700	5,660.00	145,462,000	貸付有価証券 500株（500株）
日本バルカー工業	11,400	1,841.00	20,987,400	
ユニ・チャーム	297,300	2,504.50	744,587,850	貸付有価証券 32,500株（32,500株）
協和発酵キリン	175,700	1,641.00	288,323,700	
武田薬品工業	550,600	5,222.00	2,875,233,200	貸付有価証券 7,600株
アステラス製薬	1,500,400	1,543.00	2,315,117,200	
大日本住友製薬	103,900	1,991.00	206,864,900	貸付有価証券 47,200株
塩野義製薬	198,700	5,470.00	1,086,889,000	
田辺三菱製薬	171,100	2,311.00	395,412,100	
わかもと製薬	17,000	254.00	4,318,000	
あすか製薬	16,000	1,730.00	27,680,000	
日本新薬	33,600	6,140.00	206,304,000	
バイオフェルミン製薬	2,400	3,080.00	7,392,000	
中外製薬	146,200	3,855.00	563,601,000	貸付有価証券 700株

科研製薬	27,400	5,900.00	161,660,000	
エーザイ	180,800	6,155.00	1,112,824,000	
ロート製薬	71,900	2,189.00	157,389,100	貸付有価証券 34,400株（1,300株）
小野薬品工業	333,500	2,515.50	838,919,250	
久光製薬	41,400	6,130.00	253,782,000	貸付有価証券 17,500株（100株）
持田製薬	10,000	8,410.00	84,100,000	
参天製薬	265,100	1,625.00	430,787,500	貸付有価証券 22,700株
扶桑薬品工業	4,900	2,830.00	13,867,000	
日本ケミファ	2,000	5,520.00	11,040,000	
ツムラ	49,300	3,340.00	164,662,000	貸付有価証券 7,600株
日医工	34,300	1,695.00	58,138,500	貸付有価証券 16,400株
キッセイ薬品工業	26,000	2,876.00	74,776,000	
生化学工業	27,200	1,743.00	47,409,600	貸付有価証券 1,300株
栄研化学	12,300	3,025.00	37,207,500	
日水製薬	5,900	1,353.00	7,982,700	
鳥居薬品	10,000	2,916.00	29,160,000	
JCRファーマ	11,300	2,825.00	31,922,500	貸付有価証券 2,900株（2,400株）
東和薬品	6,700	5,120.00	34,304,000	貸付有価証券 1,600株（1,000株）
富士製薬工業	4,800	3,105.00	14,904,000	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	24,900	6,090.00	151,641,000	貸付有価証券 10,300株
ゼリア新薬工業	30,100	1,692.00	50,929,200	
第一三共	432,200	2,570.00	1,110,754,000	
キョーリン製薬ホールディングス	35,900	2,364.00	84,867,600	
大幸薬品	7,300	1,766.00	12,891,800	貸付有価証券 2,200株
ダイト	8,700	2,290.00	19,923,000	
大塚ホールディングス	315,700	5,208.00	1,644,165,600	貸付有価証券 60,100株
大正製薬ホールディング	31,400	9,330.00	292,962,000	貸付有価証券

ス				9,200株
ペプチドリーム	27,400	5,400.00	147,960,000	貸付有価証券 11,500株(100株)
日本コークス工業	118,500	104.00	12,324,000	貸付有価証券 400株
昭和シェル石油	131,300	1,081.00	141,935,300	
ニチレキ	17,900	908.00	16,253,200	
東燃ゼネラル石油	239,000	1,336.00	319,304,000	
ユシロ化学工業	7,900	1,445.00	11,415,500	
ピーピー・カストロール	6,000	1,718.00	10,308,000	貸付有価証券 400株(400株)
富士石油	34,000	397.00	13,498,000	貸付有価証券 10,900株(10,900株)
MORESCO	5,100	1,742.00	8,884,200	貸付有価証券 200株
出光興産	69,700	3,655.00	254,753,500	貸付有価証券 26,600株
JXホールディングス	1,629,700	533.40	869,281,980	
コスモエネルギーホール ディングス	44,300	1,972.00	87,359,600	貸付有価証券 2,500株
横浜ゴム	88,600	2,112.00	187,123,200	貸付有価証券 300株
東洋ゴム工業	77,500	1,672.00	129,580,000	貸付有価証券 4,500株
ブリヂストン	495,600	4,315.00	2,138,514,000	
住友ゴム工業	137,400	1,812.00	248,968,800	貸付有価証券 65,200株
藤倉ゴム工業	12,200	689.00	8,405,800	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
オカモト	44,000	1,022.00	44,968,000	貸付有価証券 12,000株
フコク	6,100	939.00	5,727,900	
ニッタ	13,200	3,020.00	39,864,000	
住友理工	27,200	1,156.00	31,443,200	
三ツ星ベルト	36,000	1,012.00	36,432,000	
バンドー化学	26,700	1,059.00	28,275,300	
日東紡績	119,000	503.00	59,857,000	
旭硝子	723,000	917.00	662,991,000	
日本板硝子	66,900	853.00	57,065,700	貸付有価証券 26,300株(23,100株)

石塚硝子	21,000	248.00	5,208,000	
日本山村硝子	58,000	208.00	12,064,000	
日本電気硝子	303,000	698.00	211,494,000	
オハラ	5,500	1,155.00	6,352,500	貸付有価証券 2,600株（800株）
住友大阪セメント	273,000	460.00	125,580,000	貸付有価証券 8,000株
太平洋セメント	886,000	413.00	365,918,000	
日本ヒューム	14,100	712.00	10,039,200	
日本コンクリート工業	32,700	345.00	11,281,500	貸付有価証券 6,900株
三谷セキサン	7,300	2,546.00	18,585,800	
アジアパイルホールディングス	18,000	579.00	10,422,000	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	137,100	469.00	64,299,900	貸付有価証券 500株
日本カーボン	72,000	298.00	21,456,000	貸付有価証券 34,000株（7,000株）
東洋炭素	8,100	1,978.00	16,021,800	貸付有価証券 1,300株
ノリタケカンパニーリミテド	8,300	2,941.00	24,410,300	
TOTO	107,900	4,220.00	455,338,000	貸付有価証券 8,500株
日本碍子	185,400	2,457.00	455,527,800	
日本特殊陶業	126,500	2,577.00	325,990,500	貸付有価証券 31,500株
ダントーホールディングス	12,000	191.00	2,292,000	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
MARUWA	5,400	3,700.00	19,980,000	
品川リフラクトリーズ	37,000	292.00	10,804,000	
黒崎播磨	32,000	447.00	14,304,000	
ヨータイ	8,000	385.00	3,080,000	貸付有価証券 1,000株
イソライト工業	7,200	421.00	3,031,200	
東京窯業	17,800	208.00	3,702,400	
ニッカトー	4,800	423.00	2,030,400	
フジインコーポレーテッド	12,500	2,614.00	32,675,000	貸付有価証券 4,700株
エーアンドエーマテリア	30,000	133.00	3,990,000	

ル				
ニチアス	77,000	1,099.00	84,623,000	
ニチハ	19,500	3,165.00	61,717,500	貸付有価証券 1,600株
新日鐵住金	662,000	2,818.50	1,865,847,000	
神戸製鋼所	253,800	1,109.00	281,464,200	貸付有価証券 116,400株(6,700株)
中山製鋼所	16,500	787.00	12,985,500	貸付有価証券 1,000株
合同製鐵	8,200	1,902.00	15,596,400	
ジェイ エフ イー ホールディングス	401,300	2,147.50	861,791,750	貸付有価証券 106,500株
日新製鋼	67,000	1,570.00	105,190,000	貸付有価証券 32,200株(32,200株)
東京製鐵	74,300	1,064.00	79,055,200	貸付有価証券 1,000株
共英製鋼	15,600	2,152.00	33,571,200	貸付有価証券 400株
大和工業	29,500	3,360.00	99,120,000	
東京鐵鋼	31,000	471.00	14,601,000	
大阪製鐵	9,200	2,178.00	20,037,600	
淀川製鋼所	20,300	3,380.00	68,614,000	貸付有価証券 100株
東洋鋼鈹	35,100	465.00	16,321,500	
丸一鋼管	49,100	3,625.00	177,987,500	貸付有価証券 3,000株
モリ工業	4,700	2,319.00	10,899,300	
大同特殊鋼	246,000	574.00	141,204,000	
日本高周波鋼業	51,000	88.00	4,488,000	
日本冶金工業	121,400	232.00	28,164,800	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
山陽特殊製鋼	87,000	612.00	53,244,000	
愛知製鋼	8,700	4,860.00	42,282,000	
日立金属	149,400	1,677.00	250,543,800	貸付有価証券 1,000株
日本金属	3,500	1,312.00	4,592,000	貸付有価証券 1,600株
大平洋金属	94,000	395.00	37,130,000	貸付有価証券 39,000株(7,000株)
新日本電工	83,100	344.00	28,586,400	

栗本鐵工所	7,000	2,418.00	16,926,000	
虹技	20,000	257.00	5,140,000	貸付有価証券 2,000株
日本鋳鉄管	14,000	202.00	2,828,000	
三菱製鋼	102,000	264.00	26,928,000	
日亜鋼業	20,300	285.00	5,785,500	
日本精線	10,000	615.00	6,150,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	12,000	698.00	8,376,000	貸付有価証券 500株(100株)
新家工業	32,000	179.00	5,728,000	
大紀アルミニウム工業所	25,000	524.00	13,100,000	
日本軽金属ホールディング グス	357,800	287.00	102,688,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
三井金属鉱業	399,000	389.00	155,211,000	
東邦亜鉛	83,000	636.00	52,788,000	
三菱マテリアル	91,600	3,830.00	350,828,000	
住友金属鉱山	380,000	1,639.00	622,820,000	
DOWAホールディング ス	162,000	956.00	154,872,000	貸付有価証券 3,000株
古河機械金属	229,000	240.00	54,960,000	貸付有価証券 1,000株
大阪チタニウムテクノ ロジーズ	16,000	1,991.00	31,856,000	貸付有価証券 7,500株
東邦チタニウム	24,800	995.00	24,676,000	貸付有価証券 11,700株
UACJ	186,000	315.00	58,590,000	貸付有価証券 36,000株
古河電気工業	49,200	4,110.00	202,212,000	
住友電気工業	553,100	1,872.50	1,035,679,750	
フジクラ	193,200	853.00	164,799,600	貸付有価証券 5,300株
昭和電線ホールディング ス	174,000	91.00	15,834,000	貸付有価証券 22,000株
東京特殊電線	2,100	1,580.00	3,318,000	
タツタ電線	27,500	462.00	12,705,000	
沖電線	15,000	248.00	3,720,000	貸付有価証券 5,000株(1,000株)
カナレ電気	2,100	2,263.00	4,752,300	
平河ヒューテック	6,900	1,120.00	7,728,000	

リヨービ	89,000	505.00	44,945,000	
アーレスティ	17,000	1,199.00	20,383,000	貸付有価証券 3,100株
アサヒホールディングス	22,100	1,992.00	44,023,200	
稲葉製作所	7,800	1,323.00	10,319,400	貸付有価証券 3,400株
宮地エンジニアリンググループ	42,000	234.00	9,828,000	貸付有価証券 1,000株
トーカロ	9,600	2,758.00	26,476,800	
アルファC o	4,900	1,364.00	6,683,600	
SUMCO	153,200	1,762.00	269,938,400	貸付有価証券 52,300株（1,100株）
川田テクノロジーズ	2,800	7,950.00	22,260,000	貸付有価証券 100株
RS Technologies	500	5,700.00	2,850,000	貸付有価証券 200株
東洋製罐グループホールディングス	104,300	2,079.00	216,839,700	
ホッカンホールディングス	38,000	541.00	20,558,000	
コロナ	7,700	1,165.00	8,970,500	
横河ブリッジホールディングス	25,800	1,408.00	36,326,400	貸付有価証券 3,600株
駒井ハルテック	2,800	2,100.00	5,880,000	
高田機工	13,000	241.00	3,133,000	
三和ホールディングス	145,700	1,082.00	157,647,400	
文化シャッター	40,900	868.00	35,501,200	
三協立山	19,200	1,763.00	33,849,600	貸付有価証券 8,300株（700株）
アルインコ	10,100	1,041.00	10,514,100	
東洋シャッター	3,600	654.00	2,354,400	
LIXILグループ	204,400	2,727.00	557,398,800	貸付有価証券 10,700株
日本ファイルコン	10,600	561.00	5,946,600	貸付有価証券 300株（300株）
ノーリツ	28,800	2,169.00	62,467,200	貸付有価証券 600株
長府製作所	15,700	2,707.00	42,499,900	貸付有価証券 900株
リンナイ	25,000	8,740.00	218,500,000	貸付有価証券

				3,400株(2,000株)
ダイニチ工業	7,500	731.00	5,482,500	
日東精工	20,900	426.00	8,903,400	
三洋工業	18,000	198.00	3,564,000	
岡部	30,400	989.00	30,065,600	
ジーテクト	15,300	2,166.00	33,139,800	
中国工業	2,100	695.00	1,459,500	貸付有価証券 900株
東プレ	28,200	2,959.00	83,443,800	貸付有価証券 12,800株(8,900株)
高周波熱錬	27,300	931.00	25,416,300	
東京製綱	9,900	1,826.00	18,077,400	貸付有価証券 3,900株(800株)
サンコール	7,800	551.00	4,297,800	
モリテック スチール	7,400	297.00	2,197,800	
パイオラックス	7,400	7,880.00	58,312,000	
日本発條	138,100	1,296.00	178,977,600	
中央発條	17,000	342.00	5,814,000	
アドバネクス	2,500	1,901.00	4,752,500	
立川ブラインド工業	6,100	920.00	5,612,000	
三益半導体工業	12,400	1,797.00	22,282,800	
日本ドライケミカル	1,900	2,305.00	4,379,500	
日本製鋼所	48,500	2,052.00	99,522,000	貸付有価証券 400株
三浦工業	60,000	1,735.00	104,100,000	
タクマ	47,000	1,005.00	47,235,000	
ツガミ	40,000	690.00	27,600,000	
オークマ	96,000	1,222.00	117,312,000	貸付有価証券 9,000株(4,000株)
東芝機械	87,000	501.00	43,587,000	
アマダホールディングス	197,500	1,290.00	254,775,000	貸付有価証券 100株
アイダエンジニアリング	41,700	1,002.00	41,783,400	貸付有価証券 9,300株
滝澤鉄工所	43,000	184.00	7,912,000	
富士機械製造	44,700	1,530.00	68,391,000	貸付有価証券 9,500株(9,400株)
牧野フライス製作所	73,000	1,070.00	78,110,000	貸付有価証券 7,000株(6,000株)

オーエスジー	66,800	2,396.00	160,052,800	貸付有価証券 32,000株(29,100株)
ダイジェット工業	17,000	183.00	3,111,000	
旭ダイヤモンド工業	42,000	924.00	38,808,000	貸付有価証券 5,800株(5,000株)
D M G 森精機	86,800	1,697.00	147,299,600	貸付有価証券 15,500株(3,300株)
ソディック	37,200	1,094.00	40,696,800	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
ディスコ	17,200	16,890.00	290,508,000	
日東工器	8,500	2,534.00	21,539,000	
パンチ工業	5,300	1,027.00	5,443,100	
豊和工業	8,200	669.00	5,485,800	貸付有価証券 400株
O K K	53,000	127.00	6,731,000	貸付有価証券 3,000株
東洋機械金属	9,900	579.00	5,732,100	貸付有価証券 900株
津田駒工業	33,000	179.00	5,907,000	貸付有価証券 15,000株
エンシュウ	36,000	96.00	3,456,000	貸付有価証券 17,000株(14,000株)
島精機製作所	19,100	3,865.00	73,821,500	貸付有価証券 8,100株(100株)
N C ホールディングス	4,700	941.00	4,422,700	
フリュー	2,900	4,600.00	13,340,000	
ヤマシンフィルタ	2,800	1,722.00	4,821,600	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
日阪製作所	20,000	918.00	18,360,000	
やまびこ	26,900	1,496.00	40,242,400	
ペガサスミシン製造	14,100	820.00	11,562,000	貸付有価証券 400株(400株)
ナプテスコ	76,300	3,245.00	247,593,500	
三井海洋開発	14,700	2,461.00	36,176,700	貸付有価証券 5,000株
レオン自動機	12,400	1,088.00	13,491,200	貸付有価証券 1,100株
S M C	44,000	31,840.00	1,400,960,000	貸付有価証券 21,000株(12,100株)
新川	12,200	822.00	10,028,400	貸付有価証券 200株(200株)

ホソカワミクロン	24,000	837.00	20,088,000	
ユニオンツール	6,300	3,615.00	22,774,500	貸付有価証券 500株（100株）
オイレス工業	19,000	2,077.00	39,463,000	
日精イー・エス・ビー機 械	4,700	2,410.00	11,327,000	貸付有価証券 2,200株
サトーホールディングス	18,200	2,504.00	45,572,800	貸付有価証券 600株
日本エアーテック	4,700	653.00	3,069,100	
日精樹脂工業	11,600	1,136.00	13,177,600	貸付有価証券 400株
オカダアイヨン	3,100	1,175.00	3,642,500	
ワイエイシイ	5,500	1,364.00	7,502,000	貸付有価証券 2,600株
小松製作所	677,100	2,824.00	1,912,130,400	貸付有価証券 117,200株
住友重機械工業	428,000	827.00	353,956,000	貸付有価証券 1,000株
日立建機	65,600	2,683.00	176,004,800	貸付有価証券 8,900株（3,600株）
日工	4,400	2,109.00	9,279,600	
巴工業	6,000	1,926.00	11,556,000	
井関農機	150,000	254.00	38,100,000	貸付有価証券 6,000株（2,000株）
T O W A	12,000	2,046.00	24,552,000	
丸山製作所	31,000	194.00	6,014,000	
北川鉄工所	6,700	2,499.00	16,743,300	
ローツェ	5,200	2,513.00	13,067,600	貸付有価証券 2,400株（600株）
タカキタ	4,900	579.00	2,837,100	
クボタ	702,500	1,856.50	1,304,191,250	貸付有価証券 51,800株（21,300株）
荏原実業	4,100	1,369.00	5,612,900	
三菱化工機	48,000	224.00	10,752,000	貸付有価証券 9,000株
月島機械	27,800	1,285.00	35,723,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
帝国電機製作所	10,700	1,056.00	11,299,200	貸付有価証券 600株
東京機械製作所	55,000	76.00	4,180,000	貸付有価証券

				2,000株
新東工業	33,300	1,055.00	35,131,500	
澁谷工業	12,300	2,930.00	36,039,000	貸付有価証券 500株(500株)
アイチ コーポレーショ ン	20,800	904.00	18,803,200	
小森コーポレーション	35,300	1,534.00	54,150,200	貸付有価証券 100株
鶴見製作所	10,900	1,562.00	17,025,800	
住友精密工業	23,000	369.00	8,487,000	
酒井重工業	28,000	342.00	9,576,000	貸付有価証券 5,000株(4,000株)
荏原製作所	66,400	3,410.00	226,424,000	
石井鐵工所	2,100	1,792.00	3,763,200	
西島製作所	14,300	1,145.00	16,373,500	
北越工業	15,800	968.00	15,294,400	
ダイキン工業	191,400	10,690.00	2,046,066,000	
オルガノ	28,000	499.00	13,972,000	
トーヨーカネツ	67,000	319.00	21,373,000	
栗田工業	83,000	2,759.00	228,997,000	
椿本チエイン	83,000	989.00	82,087,000	
大同工業	29,000	280.00	8,120,000	
木村化工機	12,600	343.00	4,321,800	貸付有価証券 700株(100株)
アネスト岩田	25,400	1,094.00	27,787,600	貸付有価証券 2,700株
ダイフク	70,000	2,733.00	191,310,000	
サムコ	3,500	1,131.00	3,958,500	貸付有価証券 500株
加藤製作所	7,700	3,015.00	23,215,500	貸付有価証券 3,500株
油研工業	27,000	221.00	5,967,000	
タダノ	73,300	1,478.00	108,337,400	貸付有価証券 4,900株
フジテック	40,800	1,304.00	53,203,200	貸付有価証券 9,000株(3,600株)
C K D	42,000	1,489.00	62,538,000	
キトー	17,700	1,276.00	22,585,200	
平和	43,500	2,920.00	127,020,000	

理想科学工業	13,900	2,126.00	29,551,400	
SANKYO	39,000	3,930.00	153,270,000	
日本金銭機械	12,900	1,510.00	19,479,000	貸付有価証券 6,000株(1,200株)
マースエンジニアリング	7,900	2,296.00	18,138,400	
福島工業	8,600	3,705.00	31,863,000	
オーイズミ	5,900	687.00	4,053,300	貸付有価証券 2,900株(200株)
ダイコク電機	5,800	1,870.00	10,846,000	貸付有価証券 2,500株(800株)
竹内製作所	25,600	2,355.00	60,288,000	
アマノ	43,400	2,292.00	99,472,800	
JUKI	22,100	1,315.00	29,061,500	
サンデンホールディングス	86,000	391.00	33,626,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
蛇の目ミシン工業	13,600	799.00	10,866,400	貸付有価証券 1,400株
マックス	22,000	1,553.00	34,166,000	
グローリー	44,800	3,800.00	170,240,000	
新晃工業	9,800	1,429.00	14,004,200	
大和冷機工業	22,500	1,021.00	22,972,500	
セガサミーホールディングス	139,100	1,699.00	236,330,900	
日本ピストンリング	5,500	2,366.00	13,013,000	
リケン	6,500	4,305.00	27,982,500	
T P R	15,700	3,500.00	54,950,000	
ツバキ・ナカシマ	15,700	1,931.00	30,316,700	貸付有価証券 100株
ホシザキ	30,700	8,610.00	264,327,000	貸付有価証券 12,400株
大豊工業	11,400	1,555.00	17,727,000	
日本精工	288,000	1,631.00	469,728,000	
NTN	325,000	550.00	178,750,000	
ジェイテクト	149,500	1,877.00	280,611,500	
不二越	141,000	617.00	86,997,000	貸付有価証券 68,000株
日本トムソン	44,800	575.00	25,760,000	
THK	99,100	2,997.00	297,002,700	貸付有価証券 1,400株

ユーシン精機	6,200	3,015.00	18,693,000	貸付有価証券 2,900株
前澤給装工業	5,300	1,526.00	8,087,800	
イーグル工業	15,200	1,579.00	24,000,800	
前澤工業	9,300	334.00	3,106,200	
日本ピラー工業	14,200	1,575.00	22,365,000	
キッツ	67,300	742.00	49,936,600	
日立工機	37,500	867.00	32,512,500	貸付有価証券 9,800株
マキタ	91,400	7,770.00	710,178,000	
日立造船	111,200	645.00	71,724,000	貸付有価証券 300株
三菱重工業	2,350,000	446.50	1,049,275,000	
I H I	1,078,000	334.00	360,052,000	貸付有価証券 161,000株
スター精密	24,600	1,679.00	41,303,400	貸付有価証券 6,300株(6,300株)
日清紡ホールディングス	77,800	1,142.00	88,847,600	
イビデン	98,100	1,929.00	189,234,900	貸付有価証券 15,000株(15,000株)
コニカミノルタ	328,300	1,112.00	365,069,600	
ブラザー工業	181,200	2,062.00	373,634,400	
ミネベアミツミ	255,100	1,404.00	358,160,400	
日立製作所	3,367,000	631.10	2,124,913,700	
東芝	3,136,000	184.00	577,024,000	貸付有価証券 1,473,000株
三菱電機	1,495,700	1,679.00	2,511,280,300	貸付有価証券 29,600株
富士電機	423,000	626.00	264,798,000	
東洋電機製造	5,900	1,740.00	10,266,000	貸付有価証券 600株(500株)
安川電機	162,600	2,150.00	349,590,000	貸付有価証券 18,900株(500株)
シンフォニアテクノロ ジー	91,000	308.00	28,028,000	貸付有価証券 42,000株(42,000株)
明電舎	129,000	380.00	49,020,000	
オリジン電気	20,000	311.00	6,220,000	
山洋電気	37,000	892.00	33,004,000	
デンヨー	12,900	1,828.00	23,581,200	

東芝テック	88,000	594.00	52,272,000	貸付有価証券 33,000株
芝浦メカトロニクス	23,000	278.00	6,394,000	貸付有価証券 4,000株
マブチモーター	39,600	6,270.00	248,292,000	
日本電産	181,700	10,640.00	1,933,288,000	貸付有価証券 57,300株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	1,600	2,945.00	4,712,000	
東光高岳	7,100	2,214.00	15,719,400	
ダブル・スコープ	13,500	1,860.00	25,110,000	貸付有価証券 6,400株(100株)
ダイヘン	77,000	735.00	56,595,000	
田淵電機	21,200	347.00	7,356,400	貸付有価証券 10,100株
ヤーマン	1,800	6,020.00	10,836,000	貸付有価証券 800株(800株)
JVCケンウッド	102,900	307.00	31,590,300	貸付有価証券 49,200株(200株)
ミマキエンジニアリング	12,600	784.00	9,878,400	貸付有価証券 3,000株
第一精工	6,600	1,734.00	11,444,400	貸付有価証券 900株
日新電機	28,200	1,393.00	39,282,600	
大崎電気工業	28,000	1,077.00	30,156,000	貸付有価証券 1,000株
オムロン	149,000	4,845.00	721,905,000	貸付有価証券 19,400株
日東工業	20,600	1,577.00	32,486,200	
I D E C	18,300	1,196.00	21,886,800	
不二電機工業	1,500	1,385.00	2,077,500	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	270,000	504.00	136,080,000	貸付有価証券 53,000株(1,000株)
サクサホールディングス	35,000	232.00	8,120,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
メルコホールディングス	7,700	3,400.00	26,180,000	
テクノメディカ	3,100	2,163.00	6,705,300	
日本電気	1,928,000	272.00	524,416,000	
富士通	1,352,000	651.40	880,692,800	
沖電気工業	60,800	1,590.00	96,672,000	貸付有価証券

				16,100株
岩崎通信機	61,000	89.00	5,429,000	
電気興業	40,000	556.00	22,240,000	
サンケン電気	82,000	505.00	41,410,000	貸付有価証券 2,000株
ナカヨ	15,000	417.00	6,255,000	
アイホン	7,900	1,856.00	14,662,400	
ルネサスエレクトロニクス	72,600	1,035.00	75,141,000	貸付有価証券 35,000株
セイコーエプソン	208,800	2,576.00	537,868,800	貸付有価証券 16,400株
ワコム	108,800	407.00	44,281,600	貸付有価証券 42,400株
アルバック	23,600	5,030.00	118,708,000	
アクセル	5,800	831.00	4,819,800	貸付有価証券 800株
E I Z O	13,900	3,355.00	46,634,500	貸付有価証券 300株
ジャパンディスプレイ	261,800	286.00	74,874,800	貸付有価証券 123,000株（16,500 株）
日本信号	38,700	1,059.00	40,983,300	貸付有価証券 17,600株
京三製作所	33,000	407.00	13,431,000	
能美防災	15,900	1,504.00	23,913,600	
ホーチキ	10,200	1,418.00	14,463,600	
エレコム	12,100	2,014.00	24,369,400	貸付有価証券 3,800株
日本無線	8,600	1,397.00	12,014,200	貸付有価証券 800株
パナソニック	1,602,000	1,252.00	2,005,704,000	貸付有価証券 84,600株
アンリツ	102,200	859.00	87,789,800	
富士通ゼネラル	48,000	2,155.00	103,440,000	
日立国際電気	36,600	2,416.00	88,425,600	貸付有価証券 1,000株
ソニー	990,100	3,547.00	3,511,884,700	
T D K	79,000	7,900.00	624,100,000	
帝国通信工業	31,000	189.00	5,859,000	
タムラ製作所	54,000	456.00	24,624,000	

アルプス電気	129,400	3,395.00	439,313,000	貸付有価証券 9,100株
池上通信機	44,000	155.00	6,820,000	貸付有価証券 14,000株
パイオニア	210,700	232.00	48,882,400	貸付有価証券 82,700株（12,400株）
日本電波工業	13,600	848.00	11,532,800	
鈴木	5,400	570.00	3,078,000	
日本トリム	3,400	4,040.00	13,736,000	貸付有価証券 1,600株（600株）
ローランド ディー ジー	7,200	3,635.00	26,172,000	
フォスター電機	16,400	1,910.00	31,324,000	貸付有価証券 700株
クラリオン	74,000	438.00	32,412,000	
S M K	36,000	423.00	15,228,000	
ヨコオ	10,000	1,390.00	13,900,000	
ティアック	101,000	46.00	4,646,000	貸付有価証券 48,000株（3,000株）
ホシデン	42,500	1,010.00	42,925,000	貸付有価証券 900株
ヒロセ電機	22,700	14,750.00	334,825,000	
日本航空電子工業	40,000	1,489.00	59,560,000	貸付有価証券 6,000株
T O A	16,500	1,010.00	16,665,000	貸付有価証券 1,400株
日立マクセル	20,900	2,289.00	47,840,100	
古野電気	18,100	771.00	13,955,100	
ユニデンホールディング ス	41,000	170.00	6,970,000	
アルパイン	33,400	1,675.00	55,945,000	貸付有価証券 8,200株
スミダコーポレーション	11,500	1,312.00	15,088,000	貸付有価証券 900株（900株）
アイコム	7,800	2,369.00	18,478,200	
リオン	5,400	1,588.00	8,575,200	
本多通信工業	4,500	1,297.00	5,836,500	貸付有価証券 100株（100株）
船井電機	15,700	937.00	14,710,900	貸付有価証券 7,500株
横河電機	152,000	1,732.00	263,264,000	

新電元工業	54,000	473.00	25,542,000	
アズビル	42,500	3,540.00	150,450,000	
東亜ディーケーケー	6,900	555.00	3,829,500	貸付有価証券 100株（100株）
日本光電工業	58,600	2,538.00	148,726,800	
チノー	5,000	1,218.00	6,090,000	
共和電業	15,900	450.00	7,155,000	
日本電子材料	5,500	633.00	3,481,500	
堀場製作所	27,800	6,290.00	174,862,000	貸付有価証券 13,300株（2,000株）
アドバンテスト	95,600	1,995.00	190,722,000	貸付有価証券 2,200株（1,600株）
小野測器	6,800	876.00	5,956,800	
エスペック	12,400	1,288.00	15,971,200	
パナソニック デバイス SUNX	12,300	846.00	10,405,800	
キーエンス	63,500	44,350.00	2,816,225,000	
日置電機	7,300	2,194.00	16,016,200	
シスメックス	109,000	6,390.00	696,510,000	貸付有価証券 300株
日本マイクロニクス	26,100	917.00	23,933,700	貸付有価証券 12,200株
メガチップス	13,000	2,758.00	35,854,000	貸付有価証券 6,200株
OBARA GROUP	8,200	5,070.00	41,574,000	
澤藤電機	8,000	251.00	2,008,000	
コーセル	19,400	1,408.00	27,315,200	
イリソ電子工業	4,400	7,160.00	31,504,000	
新日本無線	11,900	440.00	5,236,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
オブテックスグループ	10,600	3,125.00	33,125,000	貸付有価証券 4,600株
千代田インテグレ	7,400	2,409.00	17,826,600	
アイ・オー・データ機器	4,400	1,237.00	5,442,800	貸付有価証券 800株
レーザーテック	15,400	2,855.00	43,967,000	貸付有価証券 100株
スタンレー電気	100,000	3,165.00	316,500,000	貸付有価証券 3,400株
岩崎電気	51,000	176.00	8,976,000	

ウシオ電機	85,100	1,454.00	123,735,400	貸付有価証券 38,500株
岡谷電機産業	7,500	418.00	3,135,000	貸付有価証券 400株（100株）
ヘリオス テクノ ホールディング	12,900	608.00	7,843,200	貸付有価証券 200株
日本セラミック	11,500	2,283.00	26,254,500	貸付有価証券 3,100株（1,300株）
遠藤照明	7,100	937.00	6,652,700	貸付有価証券 500株
古河電池	10,000	746.00	7,460,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
双信電機	6,800	298.00	2,026,400	
山一電機	13,200	1,504.00	19,852,800	貸付有価証券 5,600株
図研	9,100	1,286.00	11,702,600	貸付有価証券 300株（300株）
日本電子	51,000	533.00	27,183,000	
カシオ計算機	112,800	1,549.00	174,727,200	貸付有価証券 16,000株
ファナック	142,200	22,455.00	3,193,101,000	
日本シイエムケイ	30,200	667.00	20,143,400	
エンプラス	6,400	3,515.00	22,496,000	貸付有価証券 200株（200株）
大真空	5,100	1,498.00	7,639,800	貸付有価証券 1,600株
ローム	67,800	7,470.00	506,466,000	
浜松ホトニクス	109,400	3,380.00	369,772,000	貸付有価証券 48,300株
三井ハイテック	18,500	893.00	16,520,500	
新光電気工業	53,000	783.00	41,499,000	
京セラ	230,200	6,229.00	1,433,915,800	
太陽誘電	68,200	1,523.00	103,868,600	
村田製作所	147,100	16,265.00	2,392,581,500	貸付有価証券 8,800株
ユーシン	18,600	815.00	15,159,000	貸付有価証券 8,800株（5,200株）
双葉電子工業	22,900	2,013.00	46,097,700	
北陸電気工業	56,000	140.00	7,840,000	
ニチコン	44,100	1,043.00	45,996,300	貸付有価証券

				200株
日本ケミコン	121,000	316.00	38,236,000	貸付有価証券 4,000株
K O A	19,400	1,351.00	26,209,400	貸付有価証券 800株
市光工業	29,000	540.00	15,660,000	貸付有価証券 7,000株(2,000株)
小糸製作所	84,000	5,760.00	483,840,000	貸付有価証券 21,300株
ミツバ	25,800	2,267.00	58,488,600	
S C R E E Nホールディングス	28,700	7,660.00	219,842,000	貸付有価証券 1,600株
キャノン電子	12,900	1,791.00	23,103,900	
キャノン	754,900	3,299.00	2,490,415,100	貸付有価証券 45,100株
リコー	421,600	992.00	418,227,200	貸付有価証券 101,400株
M U T O Hホールディングス	19,000	267.00	5,073,000	
東京エレクトロン	93,500	11,225.00	1,049,537,500	
トヨタ紡織	49,000	2,433.00	119,217,000	
芦森工業	32,000	169.00	5,408,000	貸付有価証券 4,000株
ユニプレス	27,000	2,378.00	64,206,000	
豊田自動織機	127,700	5,510.00	703,627,000	貸付有価証券 6,900株
モリタホールディングス	24,500	1,573.00	38,538,500	
三櫻工業	17,800	866.00	15,414,800	貸付有価証券 600株
デンソー	345,700	5,076.00	1,754,773,200	
東海理化電機製作所	36,900	2,225.00	82,102,500	貸付有価証券 200株
三井造船	507,000	176.00	89,232,000	貸付有価証券 3,000株
川崎重工業	1,091,000	360.00	392,760,000	貸付有価証券 116,000株
名村造船所	42,100	798.00	33,595,800	貸付有価証券 200株(200株)
サノヤスホールディングス	17,000	296.00	5,032,000	貸付有価証券 8,100株
日本車輛製造	51,000	304.00	15,504,000	貸付有価証券

				24,000株(5,000株)
ニチュ三菱フォークリフト	16,200	722.00	11,696,400	貸付有価証券 7,600株
近畿車輛	2,100	2,705.00	5,680,500	貸付有価証券 400株
日産自動車	1,653,800	1,116.50	1,846,467,700	貸付有価証券 2,400株
いすゞ自動車	406,300	1,544.00	627,327,200	貸付有価証券 4,400株
トヨタ自動車	1,704,800	6,400.00	10,910,720,000	
日野自動車	200,100	1,333.00	266,733,300	貸付有価証券 3,700株
三菱自動車工業	513,900	673.00	345,854,700	貸付有価証券 65,700株
エフテック	7,400	1,336.00	9,886,400	貸付有価証券 3,500株(2,100株)
レシップホールディングス	4,600	858.00	3,946,800	貸付有価証券 1,900株
G M B	2,300	1,420.00	3,266,000	
ファルテック	2,400	1,419.00	3,405,600	貸付有価証券 1,000株
武蔵精密工業	16,300	2,880.00	46,944,000	貸付有価証券 7,400株(5,300株)
日産車体	61,600	1,088.00	67,020,800	
新明和工業	57,000	1,190.00	67,830,000	
極東開発工業	27,900	1,811.00	50,526,900	
日信工業	31,300	1,981.00	62,005,300	貸付有価証券 1,200株(700株)
トピー工業	11,500	3,300.00	37,950,000	貸付有価証券 700株
ティラド	54,000	308.00	16,632,000	
曙ブレーキ工業	65,100	285.00	18,553,500	貸付有価証券 22,400株
タチエス	23,800	2,097.00	49,908,600	
N O K	67,800	2,548.00	172,754,400	貸付有価証券 15,300株
フタバ産業	42,700	775.00	33,092,500	
K Y B	157,000	630.00	98,910,000	
大同メタル工業	17,600	1,037.00	18,251,200	貸付有価証券 2,600株
プレス工業	74,500	566.00	42,167,000	

ミクニ	17,800	434.00	7,725,200	
カルソニックカンセイ	95,000	1,285.00	122,075,000	
太平洋工業	28,800	1,435.00	41,328,000	貸付有価証券 12,000株（12,000株）
ケーヒン	32,200	1,978.00	63,691,600	
河西工業	18,900	1,366.00	25,817,400	
アイシン精機	128,300	5,630.00	722,329,000	
富士機工	13,900	534.00	7,422,600	
マツダ	444,000	1,591.50	706,626,000	
今仙電機製作所	12,800	1,008.00	12,902,400	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,261,800	3,586.00	4,524,814,800	
スズキ	277,900	4,420.00	1,228,318,000	貸付有価証券 28,600株（1,500株）
富士重工業	435,300	4,275.00	1,860,907,500	
安永	5,100	1,668.00	8,506,800	貸付有価証券 2,400株（1,000株）
ヤマハ発動機	198,000	2,578.00	510,444,000	貸付有価証券 78,000株
ショーワ	36,400	987.00	35,926,800	
T B K	17,900	530.00	9,487,000	
エクセディ	19,000	3,195.00	60,705,000	
豊田合成	45,300	2,845.00	128,878,500	
愛三工業	24,600	981.00	24,132,600	
盟和産業	2,100	1,215.00	2,551,500	
ヨロズ	13,100	1,739.00	22,780,900	
エフ・シー・シー	22,900	2,278.00	52,166,200	
シマノ	56,500	16,750.00	946,375,000	
タカタ	25,300	554.00	14,016,200	貸付有価証券 12,200株（3,000株）
テイ・エス テック	32,600	2,937.00	95,746,200	
ジャムコ	8,200	2,646.00	21,697,200	貸付有価証券 3,900株（100株）
テルモ	214,900	3,885.00	834,886,500	貸付有価証券 5,000株
クリエートメディック	4,600	947.00	4,356,200	
日機装	48,500	1,224.00	59,364,000	
島津製作所	180,500	1,889.00	340,964,500	

JMS	26,000	330.00	8,580,000	
クボテック	3,000	558.00	1,674,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
長野計器	11,000	708.00	7,788,000	
ブイ・テクノロジー	2,800	17,170.00	48,076,000	貸付有価証券 1,300株
東京計器	48,000	245.00	11,760,000	貸付有価証券 2,000株
愛知時計電機	1,800	3,710.00	6,678,000	
オーバル	13,700	272.00	3,726,400	貸付有価証券 6,100株
東京精密	27,100	3,850.00	104,335,000	
マニー	18,600	2,734.00	50,852,400	
ニコン	244,300	1,683.00	411,156,900	貸付有価証券 15,800株
トプコン	70,600	2,019.00	142,541,400	貸付有価証券 13,600株
オリンパス	223,800	3,910.00	875,058,000	貸付有価証券 23,000株（3,000株）
理研計器	12,400	1,646.00	20,410,400	
タムロン	12,400	2,146.00	26,610,400	貸付有価証券 6,000株（5,300株）
HOYA	288,500	5,091.00	1,468,753,500	
ノーリツ鋼機	14,200	984.00	13,972,800	
エー・アンド・デイ	12,800	477.00	6,105,600	
シチズン時計	153,400	738.00	113,209,200	
リズム時計工業	56,000	186.00	10,416,000	
大研医器	12,500	800.00	10,000,000	貸付有価証券 4,000株（400株）
メニコン	9,600	3,495.00	33,552,000	貸付有価証券 3,000株
松風	7,400	1,366.00	10,108,400	貸付有価証券 2,200株
セイコーホールディングス	99,000	470.00	46,530,000	貸付有価証券 43,000株（13,000株）
ニプロ	97,000	1,375.00	133,375,000	
スノーピーク	2,100	2,842.00	5,968,200	貸付有価証券 1,000株（500株）
パラマウントベッドホールディングス	13,400	4,190.00	56,146,000	貸付有価証券 6,300株（200株）

トランザクション	3,100	2,093.00	6,488,300	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
S H O - B I	4,700	441.00	2,072,700	
ニホンフラッシュ	6,500	1,273.00	8,274,500	貸付有価証券 1,600株（100株）
前田工織	14,000	1,328.00	18,592,000	貸付有価証券 800株
永大産業	18,000	533.00	9,594,000	
アートネイチャー	15,000	745.00	11,175,000	
ダンロップスポーツ	8,800	1,036.00	9,116,800	
バンダイナムコホールディングス	154,600	3,130.00	483,898,000	
アイフィスジャパン	3,100	419.00	1,298,900	
共立印刷	23,300	333.00	7,758,900	
S H O E I	6,300	2,511.00	15,819,300	
フランスベッドホールディングス	17,600	936.00	16,473,600	貸付有価証券 300株
パイロットコーポレーション	24,500	4,580.00	112,210,000	
萩原工業	3,900	2,604.00	10,155,600	
トッパン・フォームズ	25,000	1,080.00	27,000,000	
フジシールインターナショナル	31,400	2,337.00	73,381,800	
タカラトミー	54,500	1,221.00	66,544,500	
廣済堂	14,100	402.00	5,668,200	貸付有価証券 6,700株
A s - m e エステール	3,700	691.00	2,556,700	貸付有価証券 100株
アーク	59,000	110.00	6,490,000	貸付有価証券 28,200株
タカノ	6,200	1,004.00	6,224,800	
プロネクサス	13,100	1,250.00	16,375,000	
ホクシン	9,900	220.00	2,178,000	貸付有価証券 4,700株（4,100株）
ウッドワン	24,000	294.00	7,056,000	
大建工業	9,900	2,204.00	21,819,600	
凸版印刷	396,000	1,121.00	443,916,000	
大日本印刷	404,000	1,197.00	483,588,000	
図書印刷	19,000	480.00	9,120,000	貸付有価証券 7,000株

共同印刷	43,000	394.00	16,942,000	
日本写真印刷	23,500	3,295.00	77,432,500	貸付有価証券 11,100株
光村印刷	12,000	266.00	3,192,000	
宝印刷	7,300	1,571.00	11,468,300	貸付有価証券 3,200株（100株）
アシックス	139,300	1,950.00	271,635,000	貸付有価証券 38,600株
ツツミ	5,200	2,087.00	10,852,400	
小松ウオール工業	4,700	1,941.00	9,122,700	
ヤマハ	94,500	2,939.00	277,735,500	貸付有価証券 100株
河合楽器製作所	5,500	2,270.00	12,485,000	
クリナップ	16,400	835.00	13,694,000	
ピジョン	84,700	3,115.00	263,840,500	貸付有価証券 5,500株
兼松サステック	14,000	237.00	3,318,000	
キングジム	11,700	855.00	10,003,500	貸付有価証券 2,600株
リンテック	33,300	2,473.00	82,350,900	貸付有価証券 4,800株
T A S A K I	3,900	1,507.00	5,877,300	貸付有価証券 1,800株（400株）
イトーキ	29,500	722.00	21,299,000	貸付有価証券 12,600株（11,000株）
任天堂	86,400	23,355.00	2,017,872,000	貸付有価証券 8,400株
三菱鉛筆	11,500	5,570.00	64,055,000	貸付有価証券 2,900株（900株）
タカラスタンダード	29,000	1,896.00	54,984,000	貸付有価証券 500株
コクヨ	72,900	1,528.00	111,391,200	
ナカバヤシ	25,000	274.00	6,850,000	
グローブライド	6,800	1,812.00	12,321,600	
岡村製作所	48,900	1,023.00	50,024,700	
美津濃	75,000	602.00	45,150,000	貸付有価証券 1,000株
東京電力ホールディングス	1,189,400	423.00	503,116,200	貸付有価証券 8,300株
中部電力	462,000	1,472.50	680,295,000	貸付有価証券

				8,000株
関西電力	572,200	1,238.50	708,669,700	
中国電力	193,900	1,215.00	235,588,500	貸付有価証券 92,800株
北陸電力	137,400	1,113.00	152,926,200	貸付有価証券 64,500株
東北電力	350,300	1,420.00	497,426,000	貸付有価証券 8,200株
四国電力	126,300	1,087.00	137,288,100	貸付有価証券 60,400株(4,300株)
九州電力	309,700	1,238.00	383,408,600	貸付有価証券 131,600株
北海道電力	131,200	804.00	105,484,800	貸付有価証券 41,900株
沖縄電力	20,600	2,615.00	53,869,000	
電源開発	111,600	2,686.00	299,757,600	貸付有価証券 6,800株
エフオン	5,200	1,005.00	5,226,000	貸付有価証券 2,400株(100株)
イーレックス	5,800	3,840.00	22,272,000	貸付有価証券 2,800株(100株)
東京瓦斯	1,504,000	516.80	777,267,200	
大阪瓦斯	1,361,000	430.00	585,230,000	貸付有価証券 461,000株
東邦瓦斯	353,000	789.00	278,517,000	
北海道瓦斯	34,000	277.00	9,418,000	貸付有価証券 16,000株(6,000株)
広島ガス	28,900	370.00	10,693,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
西部瓦斯	158,000	263.00	41,554,000	
静岡ガス	43,100	716.00	30,859,600	
メタウォーター	7,900	2,953.00	23,328,700	貸付有価証券 3,800株
S B Sホールディングス	13,800	814.00	11,233,200	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
東武鉄道	749,000	570.00	426,930,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
相鉄ホールディングス	224,000	559.00	125,216,000	
東京急行電鉄	762,000	826.00	629,412,000	
京浜急行電鉄	384,000	1,225.00	470,400,000	貸付有価証券 147,000株

小田急電鉄	224,600	2,230.00	500,858,000	貸付有価証券 20,100株
京王電鉄	392,000	885.00	346,920,000	貸付有価証券 16,000株
京成電鉄	105,100	2,638.00	277,253,800	
富士急行	38,000	1,011.00	38,418,000	貸付有価証券 4,000株(3,000株)
新京成電鉄	18,000	420.00	7,560,000	
東日本旅客鉄道	271,300	10,275.00	2,787,607,500	貸付有価証券 14,700株(14,700株)
西日本旅客鉄道	135,000	7,314.00	987,390,000	貸付有価証券 100株
東海旅客鉄道	116,600	18,585.00	2,167,011,000	
西武ホールディングス	193,600	1,931.00	373,841,600	貸付有価証券 40,000株
鴻池運輸	19,800	1,426.00	28,234,800	
西日本鉄道	168,000	489.00	82,152,000	
ハマキョウレックス	9,100	2,044.00	18,600,400	
サカイ引越センター	4,800	3,090.00	14,832,000	貸付有価証券 2,300株
近鉄グループホールディングス	1,411,000	418.00	589,798,000	貸付有価証券 250,000株
阪急阪神ホールディングス	177,100	3,760.00	665,896,000	
南海電気鉄道	296,000	541.00	160,136,000	
京阪ホールディングス	314,000	719.00	225,766,000	貸付有価証券 1,000株
神戸電鉄	34,000	384.00	13,056,000	貸付有価証券 15,000株
名古屋鉄道	511,000	521.00	266,231,000	貸付有価証券 244,000株
山陽電気鉄道	51,000	604.00	30,804,000	
日本通運	542,000	572.00	310,024,000	
ヤマトホールディングス	250,700	2,246.50	563,197,550	貸付有価証券 17,000株
山九	185,000	717.00	132,645,000	
丸運	7,600	252.00	1,915,200	
丸全昭和運輸	47,000	448.00	21,056,000	貸付有価証券 14,000株(11,000株)
センコー	64,000	730.00	46,720,000	

トナミホールディングス	29,000	352.00	10,208,000	
ニッコンホールディングス	47,500	2,368.00	112,480,000	
日本石油輸送	1,600	2,499.00	3,998,400	
福山通運	85,000	648.00	55,080,000	貸付有価証券 39,000株（36,000株）
セイノーホールディングス	99,500	1,241.00	123,479,500	
神奈川中央交通	16,000	723.00	11,568,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
日立物流	29,200	2,249.00	65,670,800	
丸和運輸機関	3,500	2,554.00	8,939,000	
C & F ロジホールディングス	14,500	1,530.00	22,185,000	
九州旅客鉄道	104,500	3,340.00	349,030,000	
日本郵船	1,185,000	245.00	290,325,000	貸付有価証券 138,000株
商船三井	735,000	362.00	266,070,000	貸付有価証券 43,000株（3,000株）
川崎汽船	532,000	294.00	156,408,000	貸付有価証券 254,000株（6,000株）
N S ユナイテッド海運	63,000	230.00	14,490,000	貸付有価証券 8,000株
明治海運	12,500	439.00	5,487,500	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
飯野海運	72,500	505.00	36,612,500	
共栄タンカー	12,000	229.00	2,748,000	貸付有価証券 2,000株
乾汽船	10,200	990.00	10,098,000	貸付有価証券 3,200株
日本航空	252,700	3,617.00	914,015,900	
A N A ホールディングス	2,603,000	325.80	848,057,400	
パスコ	13,000	414.00	5,382,000	貸付有価証券 6,000株
トランコム	4,000	5,480.00	21,920,000	
日新	57,000	365.00	20,805,000	
三菱倉庫	92,000	1,584.00	145,728,000	貸付有価証券 4,000株
三井倉庫ホールディングス	81,000	333.00	26,973,000	貸付有価証券 9,000株（9,000株）
住友倉庫	102,000	634.00	64,668,000	貸付有価証券

				5,000株
澁澤倉庫	36,000	352.00	12,672,000	
東陽倉庫	24,000	297.00	7,128,000	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	32,000	455.00	14,560,000	
ケイヒン	26,000	155.00	4,030,000	
中央倉庫	8,100	1,087.00	8,804,700	
安田倉庫	10,900	774.00	8,436,600	
東洋埠頭	40,000	188.00	7,520,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	11,300	425.00	4,802,500	
上組	167,000	1,056.00	176,352,000	
サンリツ	3,400	520.00	1,768,000	
キムラユニティー	3,500	1,198.00	4,193,000	
キューソー流通システム	4,400	2,583.00	11,365,200	
郵船ロジスティクス	12,900	1,165.00	15,028,500	
近鉄エクスプレス	25,100	1,681.00	42,193,100	貸付有価証券 500株(500株)
東海運	7,600	449.00	3,412,400	貸付有価証券 3,600株(2,500株)
エーアイティー	8,600	1,099.00	9,451,400	貸付有価証券 4,000株
内外トランスライン	4,200	1,094.00	4,594,800	
N E C ネットスアイ	15,200	2,132.00	32,406,400	
システナ	11,000	1,635.00	17,985,000	
デジタルアーツ	6,200	3,370.00	20,894,000	貸付有価証券 2,800株(2,600株)
新日鉄住金ソリューションズ	23,100	2,298.00	53,083,800	
キューブシステム	6,000	695.00	4,170,000	
コア	5,800	1,356.00	7,864,800	貸付有価証券 500株
ソフトクリエイトホールディングス	6,600	1,330.00	8,778,000	貸付有価証券 2,000株(1,900株)
T I S	45,900	2,688.00	123,379,200	貸付有価証券 7,200株
ネオス	4,100	452.00	1,853,200	貸付有価証券 1,900株(800株)
電算システム	4,800	1,698.00	8,150,400	貸付有価証券 2,200株

グリー	84,200	665.00	55,993,000	
コーエーテクモホールディングス	32,800	2,168.00	71,110,400	貸付有価証券 5,300株（100株）
三菱総合研究所	5,400	3,195.00	17,253,000	
ボルテージ	2,500	1,007.00	2,517,500	貸付有価証券 200株
電算	1,500	2,424.00	3,636,000	
A G S	3,500	1,929.00	6,751,500	
ファインデックス	10,200	975.00	9,945,000	貸付有価証券 4,900株（2,800株）
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	1,630.00	5,053,000	貸付有価証券 1,300株（500株）
ブレインパッド	2,900	1,156.00	3,352,400	貸付有価証券 1,400株（500株）
K L a b	26,400	793.00	20,935,200	貸付有価証券 12,600株（500株）
ポルトウウィン・ピットクルーホールディ	10,000	1,069.00	10,690,000	
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	946.00	2,081,200	
ネクソン	151,500	1,947.00	294,970,500	
アイスタイル	29,100	932.00	27,121,200	貸付有価証券 13,600株（100株）
エムアップ	3,900	894.00	3,486,600	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
エイチーム	7,600	2,173.00	16,514,800	貸付有価証券 3,600株（200株）
テクノスジャパン	10,700	1,239.00	13,257,300	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
e n i s h	4,100	564.00	2,312,400	貸付有価証券 1,600株
コロプラ	38,600	1,054.00	40,684,400	貸付有価証券 18,600株
モバイルクリエイト	10,100	407.00	4,110,700	貸付有価証券 4,800株（1,000株）
オルトプラス	5,700	789.00	4,497,300	貸付有価証券 2,700株（2,600株）
ブロードリーフ	34,100	634.00	21,619,400	貸付有価証券 4,100株（4,100株）
ハーツユナイテッドグループ	7,300	1,477.00	10,782,100	貸付有価証券 3,500株（1,900株）

メディアドゥ	2,900	1,679.00	4,869,100	貸付有価証券 1,400株
ブイキューブ	7,600	640.00	4,864,000	貸付有価証券 3,600株(400株)
サイバーリンクス	2,100	1,031.00	2,165,100	
ディー・エル・イー	4,600	622.00	2,861,200	貸付有価証券 2,100株(100株)
フィックスターズ	2,000	3,610.00	7,220,000	貸付有価証券 900株
VOYAGE GROUP	4,700	1,673.00	7,863,100	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
オブティム	1,500	5,140.00	7,710,000	貸付有価証券 700株
セレス	2,500	1,684.00	4,210,000	貸付有価証券 300株
ベリサーブ	1,600	2,957.00	4,731,200	貸付有価証券 700株(400株)
ティーガイア	13,800	1,846.00	25,474,800	
日本アジアグループ	15,700	407.00	6,389,900	貸付有価証券 2,100株
豆蔵ホールディングス	10,100	891.00	8,999,100	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	4,300	2,564.00	11,025,200	貸付有価証券 2,000株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	290,200	253.00	73,420,600	貸付有価証券 62,400株
GMOペイメントゲートウェイ	11,300	6,630.00	74,919,000	貸付有価証券 5,400株
ザッパラス	7,100	455.00	3,230,500	
システムリサーチ	1,400	2,157.00	3,019,800	貸付有価証券 600株(600株)
インターネットイニシアティブ	20,300	2,018.00	40,965,400	貸付有価証券 1,200株
さくらインターネット	10,600	1,138.00	12,062,800	貸付有価証券 4,000株(2,100株)
GMOクラウド	3,100	1,879.00	5,824,900	貸付有価証券 200株
SRAホールディングス	7,300	2,765.00	20,184,500	
Minorityソリューションズ	3,100	1,222.00	3,788,200	
システムインテグレータ	1,900	677.00	1,286,300	貸付有価証券 300株(100株)

朝日ネット	12,500	523.00	6,537,500	
アドソル日進	2,700	1,312.00	3,542,400	貸付有価証券 1,300株
フリービット	7,600	959.00	7,288,400	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
コムチュア	2,300	3,550.00	8,165,000	貸付有価証券 1,100株
サイバーコム	1,800	983.00	1,769,400	貸付有価証券 800株
メディカル・データ・ビ ジョン	2,300	2,712.00	6,237,600	貸付有価証券 1,000株(900株)
g u m i	15,700	1,292.00	20,284,400	貸付有価証券 6,300株(1,300株)
ショーケース・ティー ビー	1,500	1,307.00	1,960,500	貸付有価証券 500株
P C Iホールディングス	1,600	2,803.00	4,484,800	貸付有価証券 700株
パイプドHD	2,500	1,116.00	2,790,000	貸付有価証券 400株
アイビーシー	1,100	1,007.00	1,107,700	貸付有価証券 500株
オープンドア	1,400	3,210.00	4,494,000	貸付有価証券 600株
L I N E	23,100	3,575.00	82,582,500	貸付有価証券 11,100株(4,700株)
A O I T Y O H o l d i n g s	11,300	842.00	9,514,600	
ソルクシーズ	3,900	552.00	2,152,800	
フェイス	3,600	1,371.00	4,935,600	
ハイマックス	1,800	1,487.00	2,676,600	
野村総合研究所	103,400	3,915.00	404,811,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
サイバネットシステム	11,300	789.00	8,915,700	貸付有価証券 5,400株(1,100株)
C Eホールディングス	2,100	1,148.00	2,410,800	貸付有価証券 900株
インテージホールディ ングス	7,900	2,202.00	17,395,800	
東邦システムサイエンス	4,500	646.00	2,907,000	
ソースネクスト	8,300	651.00	5,403,300	貸付有価証券 3,600株(2,600株)

フォーカスシステムズ	5,300	586.00	3,105,800	
クレスコ	3,100	2,518.00	7,805,800	
フジ・メディア・ホールディングス	144,100	1,538.00	221,625,800	
オービック	47,700	5,370.00	256,149,000	
ジャストシステム	22,400	1,231.00	27,574,400	
TDCソフトウェアエンジニアリング	6,000	1,257.00	7,542,000	
ヤフー	991,900	527.00	522,731,300	貸付有価証券 385,800株
トレンドマイクロ	73,300	4,805.00	352,206,500	
インフォメーション・ディベロプメント	3,900	1,138.00	4,438,200	貸付有価証券 1,800株
日本オラクル	22,200	6,610.00	146,742,000	
アルファシステムズ	4,500	1,975.00	8,887,500	
フューチャー	18,700	857.00	16,025,900	
CAC Holdings	10,300	1,095.00	11,278,500	
ソフトバンク・テクノロジー	3,300	4,010.00	13,233,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
トーセ	3,700	829.00	3,067,300	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルタント	7,000	5,560.00	38,920,000	貸付有価証券 3,200株
伊藤忠テクノソリューションズ	31,300	3,155.00	98,751,500	
アイティフォー	17,900	646.00	11,563,400	
東計電算	2,400	2,199.00	5,277,600	
エックスネット	1,300	2,049.00	2,663,700	
大塚商会	37,200	5,930.00	220,596,000	
サイボウズ	18,400	443.00	8,151,200	貸付有価証券 300株
ソフトブレーン	18,900	454.00	8,580,600	貸付有価証券 7,500株(7,400株)
電通国際情報サービス	8,500	2,269.00	19,286,500	
デジタルガレージ	20,100	2,027.00	40,742,700	
EMシステムズ	4,700	1,618.00	7,604,600	貸付有価証券 800株
ウェザーニューズ	4,600	3,530.00	16,238,000	貸付有価証券 2,200株(200株)

C I J	11,600	528.00	6,124,800	貸付有価証券 100株
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,538.00	2,153,200	
日本エンタープライズ	14,100	280.00	3,948,000	貸付有価証券 6,200株
WOWOW	6,600	3,660.00	24,156,000	貸付有価証券 1,900株
スカラ	9,500	848.00	8,056,000	貸付有価証券 4,500株
日本コロムビア	4,100	671.00	2,751,100	貸付有価証券 1,500株
イマジカ・ロボットホールディングス	11,600	774.00	8,978,400	貸付有価証券 1,700株
ネットワンシステムズ	59,900	873.00	52,292,700	
システムソフト	24,400	152.00	3,708,800	貸付有価証券 11,800株
アルゴグラフィックス	6,300	2,438.00	15,359,400	
マーベラス	23,300	961.00	22,391,300	貸付有価証券 11,000株(800株)
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,500	1,596.00	40,698,000	
日本ユニシス	38,200	1,532.00	58,522,400	貸付有価証券 10,300株(10,300株)
兼松エレクトロニクス	8,700	2,554.00	22,219,800	
東京放送ホールディングス	91,200	2,019.00	184,132,800	貸付有価証券 4,700株
日本テレビホールディングス	126,300	1,989.00	251,210,700	貸付有価証券 1,600株
朝日放送	13,700	778.00	10,658,600	
テレビ朝日ホールディングス	37,800	2,293.00	86,675,400	
スカパーJ S A Tホールディングス	90,000	499.00	44,910,000	
テレビ東京ホールディングス	11,300	2,572.00	29,063,600	
日本BS放送	3,100	1,050.00	3,255,000	貸付有価証券 1,500株(700株)
ビジョン	1,600	3,670.00	5,872,000	貸付有価証券 700株(700株)
U - N E X T	3,600	1,197.00	4,309,200	貸付有価証券 1,600株

ワイヤレスゲート	4,800	1,555.00	7,464,000	貸付有価証券 2,300株
コネクシオ	12,200	1,556.00	18,983,200	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
日本通信	115,700	179.00	20,710,300	貸付有価証券 48,700株
クロップス	2,900	601.00	1,742,900	
日本電信電話	1,110,900	4,711.00	5,233,449,900	貸付有価証券 9,300株
KDDI	1,369,100	2,930.50	4,012,147,550	
光通信	16,600	10,960.00	181,936,000	
NTTドコモ	1,034,100	2,680.50	2,771,905,050	
エムティーアイ	21,100	692.00	14,601,200	貸付有価証券 4,000株
GMOインターネット	50,500	1,527.00	77,113,500	
カドカワ	40,100	1,627.00	65,242,700	
学研ホールディングス	46,000	309.00	14,214,000	
ゼンリン	18,300	2,187.00	40,022,100	
昭文社	7,500	711.00	5,332,500	
インプレスホールディングス	11,400	146.00	1,664,400	貸付有価証券 1,000株(100株)
アイネット	7,800	1,223.00	9,539,400	
松竹	91,000	1,316.00	119,756,000	貸付有価証券 43,000株
東宝	90,500	3,225.00	291,862,500	貸付有価証券 43,800株(43,800株)
東映	51,000	1,009.00	51,459,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	85,500	5,410.00	462,555,000	
ピー・シー・エー	2,000	1,566.00	3,132,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	1,051.00	2,522,400	
DTS	14,300	2,587.00	36,994,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	53,300	3,435.00	183,085,500	
シーイーシー	8,200	1,833.00	15,030,600	
カプコン	32,400	2,394.00	77,565,600	貸付有価証券 15,200株
アイ・エス・ピー	2,700	885.00	2,389,500	
ジャステック	8,800	1,068.00	9,398,400	貸付有価証券

				1,400株
S C S K	37,600	4,170.00	156,792,000	
日本システムウエア	4,500	1,642.00	7,389,000	貸付有価証券 1,800株（500株）
アイネス	17,400	1,161.00	20,201,400	
T K C	12,800	3,470.00	44,416,000	
富士ソフト	20,500	2,852.00	58,466,000	
N S D	29,400	1,757.00	51,655,800	
コナミホールディングス	62,500	4,680.00	292,500,000	
福井コンピュータホールディングス	4,000	2,872.00	11,488,000	貸付有価証券 1,500株（400株）
J B C Cホールディングス	11,600	803.00	9,314,800	
ミロク情報サービス	10,200	1,807.00	18,431,400	
ソフトバンクグループ	623,000	8,518.00	5,306,714,000	
ハウスイ	11,000	127.00	1,397,000	
高千穂交易	5,300	1,048.00	5,554,400	
伊藤忠食品	3,400	4,495.00	15,283,000	
エレマテック	5,500	1,957.00	10,763,500	
J A L U X	4,400	2,203.00	9,693,200	貸付有価証券 1,600株（900株）
あらた	6,200	2,805.00	17,391,000	貸付有価証券 2,900株（1,400株）
トーメンデバイス	2,100	2,153.00	4,521,300	
東京エレクトロン デバイス	5,000	1,602.00	8,010,000	
フィールズ	10,600	1,253.00	13,281,800	貸付有価証券 5,000株（800株）
双日	817,300	290.00	237,017,000	
アルフレッサ ホールディングス	163,700	2,005.00	328,218,500	
横浜冷凍	34,300	1,055.00	36,186,500	貸付有価証券 16,500株（13,000株）
神栄	19,000	179.00	3,401,000	貸付有価証券 8,000株
山下医科器械	1,100	1,788.00	1,966,800	貸付有価証券 100株（100株）
ラサ商事	5,900	688.00	4,059,200	貸付有価証券 200株
ラクーン	6,600	501.00	3,306,600	貸付有価証券

				2,500株
アルコニックス	7,900	1,770.00	13,983,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
神戸物産	7,400	3,760.00	27,824,000	貸付有価証券 3,400株
あい ホールディングス	19,700	2,197.00	43,280,900	貸付有価証券 2,600株(2,200株)
ディーブイエックス	4,900	1,254.00	6,144,600	貸付有価証券 2,300株
ダイワボウホールディングス	117,000	298.00	34,866,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,600	1,689.00	43,238,400	貸付有価証券 3,600株
パイタルケーエスケー・ホールディングス	26,000	1,025.00	26,650,000	貸付有価証券 9,000株(8,800株)
八洲電機	10,700	644.00	6,890,800	
U K C ホールディングス	8,900	2,247.00	19,998,300	
O C H I ホールディングス	4,000	1,345.00	5,380,000	
T O K A I ホールディングス	60,800	840.00	51,072,000	貸付有価証券 29,300株
大阪工機	1,600	728.00	1,164,800	
三洋貿易	7,600	1,782.00	13,543,200	
ビューティガレージ	1,400	1,130.00	1,582,000	貸付有価証券 500株(500株)
ウイン・パートナーズ	10,000	975.00	9,750,000	貸付有価証券 600株
ミタチ産業	3,200	642.00	2,054,400	
シップヘルスケアホールディングス	26,600	2,949.00	78,443,400	
明治電機工業	4,700	1,223.00	5,748,100	貸付有価証券 600株
デリカフーズ	2,900	1,054.00	3,056,600	貸付有価証券 600株
スターティア	3,100	548.00	1,698,800	
コメダホールディングス	18,700	1,903.00	35,586,100	貸付有価証券 8,700株(100株)
富士興産	4,900	495.00	2,425,500	
協栄産業	17,000	171.00	2,907,000	
小野建	12,000	1,414.00	16,968,000	貸付有価証券 300株

佐鳥電機	10,200	796.00	8,119,200	
エコートレーディング	3,200	701.00	2,243,200	貸付有価証券 1,300株
伯東	9,500	1,076.00	10,222,000	
コンドーテック	11,000	872.00	9,592,000	
中山福	7,900	852.00	6,730,800	貸付有価証券 100株
ナガイレーベン	20,000	2,512.00	50,240,000	
三菱食品	15,200	3,450.00	52,440,000	貸付有価証券 200株
松田産業	10,100	1,589.00	16,048,900	
第一興商	22,500	4,725.00	106,312,500	
メディバルホールディング グス	138,400	1,842.00	254,932,800	
S P K	3,000	2,541.00	7,623,000	貸付有価証券 800株
萩原電気	4,700	2,180.00	10,246,000	
アズワン	10,800	4,980.00	53,784,000	
スズデン	4,900	1,061.00	5,198,900	
尾家産業	4,400	1,160.00	5,104,000	
シモジマ	8,400	1,189.00	9,987,600	
ドウシシャ	16,300	2,128.00	34,686,400	貸付有価証券 4,300株（400株）
小津産業	3,000	2,171.00	6,513,000	
高速	8,200	1,105.00	9,061,000	
たけびし	4,800	1,398.00	6,710,400	貸付有価証券 1,200株
黒田電気	18,900	2,367.00	44,736,300	
リックス	3,100	1,670.00	5,177,000	
丸文	12,200	731.00	8,918,200	
ハビネット	11,500	1,428.00	16,422,000	貸付有価証券 200株
橋本総業ホールディング ス	2,800	1,515.00	4,242,000	
日本ライフライン	11,800	2,092.00	24,685,600	貸付有価証券 1,600株
エクセル	5,900	1,508.00	8,897,200	貸付有価証券 2,200株
マルカキカイ	4,500	1,912.00	8,604,000	

I D O M	37,200	752.00	27,974,400	貸付有価証券 17,700株(14,000株)
日本エム・ディ・エム	10,400	786.00	8,174,400	
進和	8,200	1,785.00	14,637,000	
エスケイジャパン	2,600	309.00	803,400	
ダイترون	6,300	973.00	6,129,900	
シークス	9,900	4,245.00	42,025,500	貸付有価証券 2,200株
田中商事	4,200	720.00	3,024,000	
オーハシテクニカ	7,800	1,425.00	11,115,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
白銅	3,500	1,863.00	6,520,500	
伊藤忠商事	1,013,600	1,620.00	1,642,032,000	
丸紅	1,362,000	728.60	992,353,200	
高島	24,000	212.00	5,088,000	
長瀬産業	83,200	1,641.00	136,531,200	
蝶理	8,800	1,989.00	17,503,200	
豊田通商	154,100	3,355.00	517,005,500	
三共生興	20,900	414.00	8,652,600	貸付有価証券 100株
兼松	294,000	194.00	57,036,000	
ツカモトコーポレーション	25,000	127.00	3,175,000	貸付有価証券 11,000株
三井物産	1,251,500	1,694.50	2,120,666,750	
日本紙パルプ商事	72,000	373.00	26,856,000	
日立ハイテクノロジーズ	48,000	4,860.00	233,280,000	
カメイ	18,000	1,337.00	24,066,000	
東都水産	2,100	1,962.00	4,120,200	
O U Gホールディングス	22,000	265.00	5,830,000	
スターゼン	5,800	4,865.00	28,217,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
山善	53,100	1,064.00	56,498,400	貸付有価証券 600株
椿本興業	16,000	395.00	6,320,000	
住友商事	871,200	1,499.00	1,305,928,800	
内田洋行	6,800	2,554.00	17,367,200	
三菱商事	1,038,400	2,612.50	2,712,820,000	
第一実業	31,000	772.00	23,932,000	

キヤノンマーケティング ジャパン	39,500	2,270.00	89,665,000	
西華産業	44,000	373.00	16,412,000	
佐藤商事	12,300	874.00	10,750,200	
菱洋エレクトロ	13,200	1,587.00	20,948,400	
東京産業	13,700	471.00	6,452,700	貸付有価証券 1,500株
ユアサ商事	13,100	3,305.00	43,295,500	
神鋼商事	3,500	2,465.00	8,627,500	
小林産業	10,100	275.00	2,777,500	貸付有価証券 300株
阪和興業	138,000	775.00	106,950,000	
カナデン	13,200	1,048.00	13,833,600	
菱電商事	22,000	742.00	16,324,000	
フルサト工業	7,600	1,726.00	13,117,600	
岩谷産業	153,000	663.00	101,439,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
すてきナイスグループ	59,000	152.00	8,968,000	
昭光通商	49,000	100.00	4,900,000	貸付有価証券 1,000株
ニチモウ	20,000	189.00	3,780,000	貸付有価証券 6,000株（1,000株）
極東貿易	21,000	241.00	5,061,000	
イワキ	21,000	313.00	6,573,000	
三愛石油	37,100	895.00	33,204,500	
稲畑産業	33,200	1,495.00	49,634,000	
G S Iクレオス	34,000	151.00	5,134,000	
明和産業	12,700	423.00	5,372,100	貸付有価証券 100株
ワキタ	29,400	1,076.00	31,634,400	
東邦ホールディングス	44,300	2,479.00	109,819,700	貸付有価証券 20,800株（17,300株）
サンゲツ	47,400	1,932.00	91,576,800	
ミツウロコグループホー ルディングス	22,200	742.00	16,472,400	貸付有価証券 2,400株
シナネンホールディング ス	5,900	2,300.00	13,570,000	
伊藤忠エネクス	30,500	941.00	28,700,500	
サンリオ	42,700	2,241.00	95,690,700	貸付有価証券

				20,300株
サンワテクノス	8,200	1,083.00	8,880,600	
リョーサン	20,600	3,660.00	75,396,000	
新光商事	15,200	1,324.00	20,124,800	
トーホー	6,200	2,532.00	15,698,400	
三信電気	15,300	1,352.00	20,685,600	貸付有価証券 1,400株
東陽テクニカ	18,300	1,020.00	18,666,000	貸付有価証券 2,500株
モスフードサービス	18,100	3,330.00	60,273,000	貸付有価証券 100株（100株）
加賀電子	12,500	2,067.00	25,837,500	
ソーダニッカ	14,200	522.00	7,412,400	
立花エレテック	9,300	1,329.00	12,359,700	
フォーバル	6,000	694.00	4,164,000	
PALTA C	22,100	3,140.00	69,394,000	貸付有価証券 400株
三谷産業	14,700	379.00	5,571,300	貸付有価証券 5,400株
太平洋興発	58,000	108.00	6,264,000	貸付有価証券 27,000株
ヤマタネ	6,900	1,602.00	11,053,800	
丸紅建材リース	13,000	240.00	3,120,000	
日鉄住金物産	12,100	4,925.00	59,592,500	
トラスコ中山	31,600	2,554.00	80,706,400	貸付有価証券 13,700株（100株）
オートボックスセブン	51,200	1,788.00	91,545,600	
モリト	11,100	1,012.00	11,233,200	貸付有価証券 700株
加藤産業	21,600	2,946.00	63,633,600	
イノテック	11,900	673.00	8,008,700	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	13,000	2,767.00	35,971,000	
J Kホールディングス	13,900	673.00	9,354,700	
日伝	5,700	3,440.00	19,608,000	
北沢産業	11,400	217.00	2,473,800	
杉本商事	7,900	1,538.00	12,150,200	
因幡電機産業	19,400	4,000.00	77,600,000	
バイテックホールディング	5,600	1,355.00	7,588,000	貸付有価証券

グス				1,600株
ミスミグループ本社	155,500	2,063.00	320,796,500	貸付有価証券 12,800株(12,800株)
アルテック	11,800	216.00	2,548,800	貸付有価証券 5,800株
タキヒヨー	21,000	484.00	10,164,000	貸付有価証券 9,000株
蔵王産業	2,300	1,507.00	3,466,100	
スズケン	63,000	3,800.00	239,400,000	
ジェコス	9,500	1,128.00	10,716,000	
ルネサスイーストン	12,700	616.00	7,823,200	貸付有価証券 200株(200株)
ローソン	48,000	7,990.00	383,520,000	貸付有価証券 16,400株
サンエー	10,400	5,210.00	54,184,000	
カワチ薬品	10,700	2,976.00	31,843,200	
エービーシー・マート	25,200	6,640.00	167,328,000	
ハードオフコーポレーション	6,100	1,171.00	7,143,100	
アスクル	14,400	3,320.00	47,808,000	貸付有価証券 4,600株
ゲオホールディングス	23,100	1,390.00	32,109,000	貸付有価証券 10,800株(1,100株)
アダストリア	21,200	3,045.00	64,554,000	貸付有価証券 10,100株
ジーフット	8,300	819.00	6,797,700	貸付有価証券 3,900株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	1,800	732.00	1,317,600	
くらコーポレーション	9,000	4,615.00	41,535,000	貸付有価証券 400株
キャンドゥ	7,300	1,821.00	13,293,300	貸付有価証券 2,100株(1,700株)
パルグループホールディングス	7,100	2,776.00	19,709,600	貸付有価証券 2,500株
エディオン	53,600	1,027.00	55,047,200	貸付有価証券 18,000株(8,900株)
サーラコーポレーション	17,300	619.00	10,708,700	貸付有価証券 1,600株(1,500株)
ワッツ	5,900	1,215.00	7,168,500	貸付有価証券 1,300株

ハローズ	4,500	2,375.00	10,687,500	貸付有価証券 2,100株
あみやき亭	2,700	4,070.00	10,989,000	貸付有価証券 1,200株
ひらまつ	19,000	655.00	12,445,000	貸付有価証券 7,700株(600株)
ゲンキー	2,800	6,160.00	17,248,000	貸付有価証券 1,300株(900株)
大黒天物産	3,300	5,040.00	16,632,000	貸付有価証券 1,500株
ハニーズ	13,400	1,096.00	14,686,400	貸付有価証券 5,900株
ファーマライズホールディングス	3,100	512.00	1,587,200	貸付有価証券 100株(100株)
アルペン	10,600	1,953.00	20,701,800	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
クオール	15,600	1,517.00	23,665,200	貸付有価証券 6,600株
ジェイアイエヌ	9,400	5,900.00	55,460,000	貸付有価証券 4,000株(3,400株)
ビックカメラ	79,400	1,066.00	84,640,400	貸付有価証券 37,300株
DCMホールディングス	84,000	999.00	83,916,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
Monotaro	49,000	3,240.00	158,760,000	貸付有価証券 23,700株(15,000株)
東京一番フーズ	3,400	585.00	1,989,000	貸付有価証券 1,600株(800株)
ダイヤモンドダイニング	3,000	1,763.00	5,289,000	貸付有価証券 1,400株
きちり	3,700	664.00	2,456,800	貸付有価証券 1,700株(1,200株)
アークランドサービスホールディングス	4,300	3,190.00	13,717,000	貸付有価証券 2,000株
J.フロントリテイリング	175,100	1,685.00	295,043,500	貸付有価証券 300株
ドトール・日レスホールディングス	24,200	2,224.00	53,820,800	貸付有価証券 11,500株
マツモトキヨシホールディングス	26,200	5,190.00	135,978,000	
ブロンコビリー	7,200	2,779.00	20,008,800	貸付有価証券 3,400株

スタートトゥデイ	126,300	2,452.00	309,687,600	
トレジャー・ファクトリー	3,900	830.00	3,237,000	貸付有価証券 1,800株
物語コーポレーション	3,900	4,580.00	17,862,000	
ココカラファイン	14,400	4,680.00	67,392,000	
三越伊勢丹ホールディングス	275,300	1,369.00	376,885,700	貸付有価証券 2,900株（600株）
H a m e e	3,100	922.00	2,858,200	貸付有価証券 1,400株（100株）
ウエルシアホールディングス	13,700	6,280.00	86,036,000	貸付有価証券 400株
クリエイティブSDホールディングス	20,400	2,545.00	51,918,000	
丸善CHIホールディングス	16,100	364.00	5,860,400	貸付有価証券 300株
ミサワ	2,500	462.00	1,155,000	貸付有価証券 1,000株
ティーライフ	1,200	1,449.00	1,738,800	
エー・ピーカンパニー	2,300	812.00	1,867,600	貸付有価証券 1,000株
チムニー	4,200	2,837.00	11,915,400	
シュッピン	5,200	1,411.00	7,337,200	貸付有価証券 2,400株（100株）
ネクステージ	2,700	2,753.00	7,433,100	貸付有価証券 1,100株
ジョイフル本田	22,500	3,235.00	72,787,500	
鳥貴族	3,400	2,353.00	8,000,200	貸付有価証券 1,500株（800株）
キリン堂ホールディングス	4,400	858.00	3,775,200	
ホットランド	6,400	1,028.00	6,579,200	貸付有価証券 3,000株（1,600株）
すかいらーく	59,400	1,593.00	94,624,200	貸付有価証券 900株
綿半ホールディングス	5,600	1,603.00	8,976,800	貸付有価証券 1,700株
ヨシックス	1,300	1,292.00	1,679,600	貸付有価証券 500株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	45,900	1,004.00	46,083,600	貸付有価証券 21,700株
ブックオフコーポレー	7,900	856.00	6,762,400	貸付有価証券

シオン				3,700株(800株)
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,500	787.00	4,328,500	貸付有価証券 2,500株
B E E N O S	1,600	1,452.00	2,323,200	貸付有価証券 500株
あさひ	10,300	1,285.00	13,235,500	貸付有価証券 1,900株
日本調剤	4,900	3,750.00	18,375,000	貸付有価証券 2,300株
コスモス薬品	7,000	21,270.00	148,890,000	貸付有価証券 800株(400株)
トーエル	6,700	926.00	6,204,200	貸付有価証券 3,100株(800株)
一六堂	2,900	406.00	1,177,400	
オンリー	1,600	812.00	1,299,200	
セブン & アイ・ホールディングス	579,200	4,397.00	2,546,742,400	貸付有価証券 400株
薬王堂	6,900	2,324.00	16,035,600	貸付有価証券 3,200株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	37,100	1,030.00	38,213,000	貸付有価証券 17,700株
ツルハホールディングス	27,700	10,420.00	288,634,000	
サンマルクホールディングス	8,900	3,475.00	30,927,500	貸付有価証券 3,300株
フェリシモ	3,900	1,033.00	4,028,700	
トリドールホールディングス	17,000	2,327.00	39,559,000	貸付有価証券 6,200株
サツドラホールディングス	1,800	1,994.00	3,589,200	
ダイユー・リックホールディングス	4,500	791.00	3,559,500	貸付有価証券 2,100株
パロックジャパンリミテッド	8,100	1,414.00	11,453,400	貸付有価証券 2,100株
クスリのアオキホールディングス	11,000	4,640.00	51,040,000	貸付有価証券 400株
メディカルシステムネットワーク	15,600	440.00	6,864,000	貸付有価証券 7,400株
総合メディカル	6,700	3,950.00	26,465,000	貸付有価証券 500株
はるやまホールディングス	6,500	974.00	6,331,000	
ノジマ	16,100	1,431.00	23,039,100	貸付有価証券

				1,000株
カップ・クリエイト	19,400	1,273.00	24,696,200	貸付有価証券 9,300株（1,800株）
ライトオン	10,300	974.00	10,032,200	貸付有価証券 4,900株
ジーンズメイト	4,400	256.00	1,126,400	貸付有価証券 1,300株
良品計画	18,300	22,110.00	404,613,000	貸付有価証券 5,600株
三城ホールディングス	17,100	475.00	8,122,500	貸付有価証券 100株（100株）
アドヴァン	14,100	1,150.00	16,215,000	
アルビス	3,600	3,255.00	11,718,000	貸付有価証券 1,600株
コナカ	17,600	597.00	10,507,200	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,554.00	2,641,800	貸付有価証券 100株（100株）
G - 7ホールディングス	4,100	2,113.00	8,663,300	
イオン北海道	13,900	616.00	8,562,400	貸付有価証券 6,600株
コジマ	20,400	274.00	5,589,600	貸付有価証券 1,000株
ヒマラヤ	4,300	853.00	3,667,900	貸付有価証券 2,000株
コーナン商事	19,600	2,154.00	42,218,400	貸付有価証券 9,400株
エコス	5,400	1,218.00	6,577,200	貸付有価証券 2,500株（100株）
ワタミ	16,300	1,142.00	18,614,600	貸付有価証券 7,800株（5,400株）
マルシェ	3,100	835.00	2,588,500	貸付有価証券 1,300株（100株）
ドンキホーテホールディングス	89,500	3,930.00	351,735,000	貸付有価証券 1,100株
西松屋チェーン	24,200	1,300.00	31,460,000	貸付有価証券 11,600株
ゼンショーホールディングス	71,700	1,892.00	135,656,400	
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,674.00	14,731,200	貸付有価証券 4,100株（1,900株）
ハークスレイ	3,400	1,118.00	3,801,200	
サイゼリヤ	22,800	2,637.00	60,123,600	

V Tホールディングス	46,800	534.00	24,991,200	
魚力	4,300	1,303.00	5,602,900	
ポブラ	3,500	522.00	1,827,000	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
フジ・コーポレーション	2,100	2,294.00	4,817,400	
ユナイテッドアローズ	18,400	3,540.00	65,136,000	貸付有価証券 600株
ハイデイ日高	12,600	2,879.00	36,275,400	貸付有価証券 5,000株
京都きもの友禅	8,800	994.00	8,747,200	貸付有価証券 3,300株
コロワイド	45,900	1,831.00	84,042,900	貸付有価証券 20,100株
ピーシーデポコーポレーション	18,300	552.00	10,101,600	貸付有価証券 8,800株
壱番屋	9,700	3,760.00	36,472,000	貸付有価証券 4,500株
トップカルチャー	5,000	479.00	2,395,000	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
P L A N T	3,100	1,195.00	3,704,500	貸付有価証券 800株
スギホールディングス	30,300	5,370.00	162,711,000	
ヴィア・ホールディングス	10,500	1,168.00	12,264,000	貸付有価証券 4,900株
スクロール	20,900	353.00	7,377,700	貸付有価証券 2,100株
ヨンドシーホールディングス	10,500	2,543.00	26,701,500	貸付有価証券 4,900株（3,000株）
ユニー・ファミリーマートホールディングス	60,700	7,060.00	428,542,000	貸付有価証券 20,600株（900株）
木曽路	16,900	2,354.00	39,782,600	
サトレストランシステムズ	16,300	851.00	13,871,300	貸付有価証券 7,100株
千趣会	25,000	796.00	19,900,000	貸付有価証券 200株（200株）
タカキュー	10,700	212.00	2,268,400	貸付有価証券 5,000株
ケーヨー	23,300	585.00	13,630,500	貸付有価証券 11,000株
上新電機	33,000	1,077.00	35,541,000	
日本瓦斯	25,400	3,325.00	84,455,000	

ベスト電器	44,600	142.00	6,333,200	貸付有価証券 21,300株(14,100株)
ロイヤルホールディングス	22,800	2,012.00	45,873,600	貸付有価証券 2,400株
東天紅	11,000	166.00	1,826,000	
いなげや	15,400	1,566.00	24,116,400	貸付有価証券 5,300株(4,700株)
島忠	35,800	2,821.00	100,991,800	
チヨダ	16,300	2,721.00	44,352,300	貸付有価証券 500株
ライフコーポレーション	10,500	3,280.00	34,440,000	
リンガーハット	15,600	2,283.00	35,614,800	貸付有価証券 7,400株
さが美	12,000	120.00	1,440,000	貸付有価証券 5,000株
MrMax	17,200	419.00	7,206,800	
テンアライド	12,700	396.00	5,029,200	貸付有価証券 6,100株
AOKIホールディングス	27,600	1,391.00	38,391,600	
オークワ	20,000	1,126.00	22,520,000	貸付有価証券 9,000株
コメリ	21,300	2,718.00	57,893,400	貸付有価証券 4,400株(100株)
青山商事	28,900	4,105.00	118,634,500	貸付有価証券 8,500株
しまむら	16,100	14,370.00	231,357,000	
はせがわ	7,300	445.00	3,248,500	貸付有価証券 1,500株(1,000株)
高島屋	232,000	983.00	228,056,000	貸付有価証券 106,000株(73,000株)
松屋	30,200	1,003.00	30,290,600	貸付有価証券 14,100株(300株)
エイチ・ツー・オー テイリング	70,900	1,866.00	132,299,400	貸付有価証券 6,300株
近鉄百貨店	53,000	359.00	19,027,000	貸付有価証券 25,000株
丸栄	28,000	89.00	2,492,000	貸付有価証券 13,000株
パルコ	13,300	1,135.00	15,095,500	貸付有価証券 6,300株

丸井グループ	145,600	1,530.00	222,768,000	貸付有価証券 4,000株(1,600株)
アクシアル リテイリング	10,700	4,510.00	48,257,000	
井筒屋	7,500	395.00	2,962,500	貸付有価証券 3,500株
イオン	569,400	1,685.00	959,439,000	貸付有価証券 155,600株(65,200株)
イズミ	27,500	4,880.00	134,200,000	
東武ストア	1,700	2,997.00	5,094,900	貸付有価証券 700株
平和堂	28,000	2,672.00	74,816,000	貸付有価証券 13,100株
フジ	15,400	2,412.00	37,144,800	貸付有価証券 7,200株
ヤオコー	15,700	4,575.00	71,827,500	貸付有価証券 7,100株
ゼビオホールディングス	18,800	1,787.00	33,595,600	
ケーブホールディングス	63,800	2,081.00	132,767,800	貸付有価証券 29,900株(27,200株)
Olympicグループ	8,100	630.00	5,103,000	
日産東京販売ホールディングス	20,300	349.00	7,084,700	
アインホールディングス	18,000	8,610.00	154,980,000	貸付有価証券 6,600株(100株)
元気寿司	3,500	2,248.00	7,868,000	
ヤマダ電機	462,900	576.00	266,630,400	貸付有価証券 221,500株(203,900株)
アークランドサカモト	23,400	1,421.00	33,251,400	
ニトリホールディングス	59,800	12,330.00	737,334,000	
グルメ杵屋	10,000	1,037.00	10,370,000	貸付有価証券 4,000株
愛眼	10,100	197.00	1,989,700	貸付有価証券 4,500株(3,500株)
ケーユーホールディングス	7,200	904.00	6,508,800	貸付有価証券 100株
吉野家ホールディングス	48,200	1,668.00	80,397,600	貸付有価証券 22,900株(2,300株)
松屋フーズ	6,600	4,160.00	27,456,000	貸付有価証券 200株(200株)

サガミチェーン	17,300	1,375.00	23,787,500	貸付有価証券 1,400株
関西スーパーマーケット	11,300	1,538.00	17,379,400	貸付有価証券 5,400株（5,200株）
王将フードサービス	10,100	4,250.00	42,925,000	貸付有価証券 500株
ブレナス	15,500	2,484.00	38,502,000	貸付有価証券 7,400株（200株）
ミニストップ	10,200	2,166.00	22,093,200	貸付有価証券 4,800株
アークス	25,900	2,603.00	67,417,700	貸付有価証券 4,600株
パローホールディングス	29,800	2,750.00	81,950,000	貸付有価証券 100株
藤久	1,100	1,741.00	1,915,100	
ベルク	6,100	4,480.00	27,328,000	貸付有価証券 2,600株
大庄	7,400	1,603.00	11,862,200	貸付有価証券 3,000株
ファーストリテイリング	23,100	35,180.00	812,658,000	
サンドラッグ	26,300	7,460.00	196,198,000	貸付有価証券 1,000株
サックスパーホールディングス	13,000	1,231.00	16,003,000	貸付有価証券 4,000株
ヤマザワ	2,900	1,848.00	5,359,200	貸付有価証券 1,300株
やまや	2,800	1,727.00	4,835,600	
ベルーナ	34,500	840.00	28,980,000	
島根銀行	2,900	1,404.00	4,071,600	
じもとホールディングス	99,300	194.00	19,264,200	
めぶきフィナンシャルグループ	667,300	486.00	324,307,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	20,000	3,980.00	79,600,000	
九州フィナンシャルグループ	227,000	795.00	180,465,000	貸付有価証券 101,400株
ゆうちょ銀行	391,800	1,420.00	556,356,000	貸付有価証券 27,800株
富山第一銀行	35,200	545.00	19,184,000	貸付有価証券 16,400株
コンコルディア・フィナ	906,000	613.90	556,193,400	

ンシャルグループ				
西日本フィナンシャル ホールディングス	93,800	1,247.00	116,968,600	
新生銀行	1,317,000	208.00	273,936,000	貸付有価証券 566,000株（11,000 株）
あおぞら銀行	876,000	415.00	363,540,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,487,000	763.80	8,009,970,600	
りそなホールディングス	1,619,000	630.90	1,021,427,100	
三井住友トラスト・ホールディングス	288,900	4,200.00	1,213,380,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,108,200	4,535.00	5,025,687,000	
第四銀行	170,000	532.00	90,440,000	貸付有価証券 4,000株
北越銀行	14,900	2,729.00	40,662,100	貸付有価証券 700株
千葉銀行	534,000	782.00	417,588,000	貸付有価証券 2,000株
群馬銀行	307,500	669.00	205,717,500	
武蔵野銀行	22,100	3,695.00	81,659,500	貸付有価証券 1,500株
千葉興業銀行	37,900	621.00	23,535,900	
筑波銀行	57,500	348.00	20,010,000	
七十七銀行	217,000	532.00	115,444,000	
青森銀行	107,000	393.00	42,051,000	貸付有価証券 35,000株（34,000株）
秋田銀行	89,000	369.00	32,841,000	
山形銀行	78,000	495.00	38,610,000	貸付有価証券 37,000株（8,000株）
岩手銀行	9,100	4,740.00	43,134,000	貸付有価証券 1,700株
東邦銀行	124,000	439.00	54,436,000	貸付有価証券 2,000株
東北銀行	70,000	159.00	11,130,000	
みちのく銀行	83,000	193.00	16,019,000	貸付有価証券 39,000株（18,000株）
ふくおかフィナンシャルグループ	561,000	502.00	281,622,000	貸付有価証券 13,000株
静岡銀行	376,000	1,011.00	380,136,000	貸付有価証券

				30,000株(3,000株)
十六銀行	186,000	408.00	75,888,000	貸付有価証券 6,000株
スルガ銀行	141,500	2,535.00	358,702,500	貸付有価証券 60,000株
八十二銀行	267,000	718.00	191,706,000	
山梨中央銀行	86,000	554.00	47,644,000	
大垣共立銀行	185,000	452.00	83,620,000	貸付有価証券 30,000株
福井銀行	118,000	286.00	33,748,000	
北國銀行	147,000	476.00	69,972,000	貸付有価証券 22,000株
清水銀行	4,700	3,755.00	17,648,500	
富山銀行	2,700	4,150.00	11,205,000	
滋賀銀行	130,000	638.00	82,940,000	貸付有価証券 7,000株(5,000株)
南都銀行	13,400	4,740.00	63,516,000	
百五銀行	124,000	514.00	63,736,000	
京都銀行	248,000	951.00	235,848,000	貸付有価証券 116,000株
紀陽銀行	52,000	1,903.00	98,956,000	
三重銀行	6,200	2,536.00	15,723,200	
ほくほくフィナンシャル グループ	92,100	2,032.00	187,147,200	
広島銀行	408,000	548.00	223,584,000	
山陰合同銀行	83,200	1,035.00	86,112,000	貸付有価証券 1,700株
中国銀行	98,100	1,806.00	177,168,600	貸付有価証券 3,700株
鳥取銀行	4,400	1,920.00	8,448,000	
伊予銀行	148,000	836.00	123,728,000	貸付有価証券 22,900株
百十四銀行	152,000	400.00	60,800,000	
四国銀行	107,000	308.00	32,956,000	貸付有価証券 17,000株
阿波銀行	118,000	750.00	88,500,000	貸付有価証券 15,000株
大分銀行	80,000	448.00	35,840,000	貸付有価証券 38,000株
宮崎銀行	92,000	381.00	35,052,000	

佐賀銀行	84,000	310.00	26,040,000	
十八銀行	85,000	360.00	30,600,000	
沖縄銀行	13,500	4,185.00	56,497,500	貸付有価証券 800株
琉球銀行	28,500	1,641.00	46,768,500	貸付有価証券 3,900株
セブン銀行	518,800	330.00	171,204,000	貸付有価証券 205,700株（10,200 株）
みずほフィナンシャルグループ	18,789,500	209.70	3,940,158,150	
高知銀行	50,000	137.00	6,850,000	
山口フィナンシャルグループ	129,000	1,311.00	169,119,000	貸付有価証券 37,000株（24,000株）
長野銀行	4,500	2,031.00	9,139,500	貸付有価証券 2,100株（300株）
名古屋銀行	11,600	4,365.00	50,634,000	貸付有価証券 5,500株（1,000株）
北洋銀行	225,900	473.00	106,850,700	
愛知銀行	4,600	7,070.00	32,522,000	
第三銀行	7,800	1,751.00	13,657,800	貸付有価証券 200株（200株）
中京銀行	5,700	2,320.00	13,224,000	貸付有価証券 200株
大光銀行	49,000	249.00	12,201,000	
愛媛銀行	16,400	1,416.00	23,222,400	貸付有価証券 7,800株（5,600株）
トマト銀行	5,300	1,613.00	8,548,900	
みなと銀行	12,500	2,210.00	27,625,000	
京葉銀行	113,000	548.00	61,924,000	
関西アーバン銀行	19,300	1,506.00	29,065,800	
栃木銀行	76,400	595.00	45,458,000	
北日本銀行	4,300	3,185.00	13,695,500	
東和銀行	259,000	127.00	32,893,000	
福島銀行	150,000	96.00	14,400,000	貸付有価証券 44,000株
大東銀行	72,000	171.00	12,312,000	貸付有価証券 26,000株（11,000株）
トモニホールディングス	114,100	650.00	74,165,000	貸付有価証券 10,600株

フィデアホールディングス	134,300	216.00	29,008,800	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
池田泉州ホールディングス	146,800	519.00	76,189,200	
F P G	49,400	1,088.00	53,747,200	貸付有価証券 4,500株
S B Iホールディングス	156,400	1,550.00	242,420,000	
日本アジア投資	13,200	474.00	6,256,800	貸付有価証券 6,300株(300株)
ジャフコ	23,100	3,945.00	91,129,500	
大和証券グループ本社	1,295,000	708.70	917,766,500	貸付有価証券 130,000株
野村ホールディングス	2,829,200	748.50	2,117,656,200	
岡三証券グループ	118,000	750.00	88,500,000	貸付有価証券 3,000株
丸三証券	44,000	963.00	42,372,000	貸付有価証券 7,500株
東洋証券	49,000	269.00	13,181,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	158,800	646.00	102,584,800	貸付有価証券 51,500株
光世証券	33,000	190.00	6,270,000	
水戸証券	42,800	312.00	13,353,600	貸付有価証券 2,700株
いちよし証券	31,000	902.00	27,962,000	
松井証券	79,000	935.00	73,865,000	貸付有価証券 5,200株(1,000株)
だいこう証券ビジネス	6,700	623.00	4,174,100	
マネックスグループ	148,400	295.00	43,778,000	貸付有価証券 55,500株(17,400株)
カブドットコム証券	103,200	389.00	40,144,800	
極東証券	18,600	1,686.00	31,359,600	
岩井コスモホールディングス	13,100	1,092.00	14,305,200	貸付有価証券 200株
藍澤證券	25,900	645.00	16,705,500	
マネーパートナーズグループ	17,600	529.00	9,310,400	貸付有価証券 8,300株
小林洋行	4,000	295.00	1,180,000	貸付有価証券 1,800株(1,500株)
かんぽ生命保険	52,200	2,785.00	145,377,000	貸付有価証券 24,400株
S O M P Oホールディン	289,300	4,280.00	1,238,204,000	

グス				
アニコム ホールディングス	9,400	2,253.00	21,178,200	貸付有価証券 4,300株
MS & A Dインシュアランスグループホール	413,600	3,874.00	1,602,286,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	132,600	2,006.00	265,995,600	貸付有価証券 2,600株（500株）
第一生命ホールディングス	834,500	2,221.00	1,853,424,500	
東京海上ホールディングス	560,700	5,084.00	2,850,598,800	
T & Dホールディングス	504,400	1,808.50	912,207,400	
アドバンスクリエイト	3,200	2,074.00	6,636,800	貸付有価証券 1,100株
全国保証	39,000	3,620.00	141,180,000	貸付有価証券 18,300株
クレディセゾン	105,000	2,176.00	228,480,000	
アクリーティブ	11,300	399.00	4,508,700	貸付有価証券 4,100株
芙蓉総合リース	15,800	5,260.00	83,108,000	
興銀リース	26,000	2,444.00	63,544,000	
東京センチュリー	27,900	3,850.00	107,415,000	
日本証券金融	61,000	626.00	38,186,000	貸付有価証券 6,700株
アイフル	232,100	359.00	83,323,900	貸付有価証券 111,000株（3,200株）
ポケットカード	10,400	606.00	6,302,400	貸付有価証券 4,800株
リコーリース	10,900	3,540.00	38,586,000	貸付有価証券 5,200株（900株）
イオンフィナンシャルサービス	88,400	2,077.00	183,606,800	貸付有価証券 40,600株
アコム	278,000	493.00	137,054,000	貸付有価証券 98,500株
ジャックス	76,000	512.00	38,912,000	
オリエントコーポレーション	299,200	217.00	64,926,400	貸付有価証券 35,200株
日立キャピタル	32,600	2,935.00	95,681,000	貸付有価証券 14,400株
アプラスフィナンシャル	66,400	120.00	7,968,000	貸付有価証券 31,200株

オリックス	980,000	1,761.00	1,725,780,000	
三菱UFJリース	351,000	604.00	212,004,000	
日本取引所グループ	430,300	1,604.00	690,201,200	
イー・ギャランティ	4,100	2,623.00	10,754,300	貸付有価証券 1,900株（400株）
アサックス	2,400	1,635.00	3,924,000	
NECキャピタルソリューション	5,600	1,804.00	10,102,400	貸付有価証券 400株
いちご	131,500	363.00	47,734,500	貸付有価証券 22,800株（15,000株）
日本駐車場開発	166,900	151.00	25,201,900	貸付有価証券 41,400株
ヒューリック	288,600	1,087.00	313,708,200	貸付有価証券 15,600株
三栄建築設計	5,500	1,552.00	8,536,000	貸付有価証券 2,600株
野村不動産ホールディングス	91,900	1,891.00	173,782,900	
三重交通グループホールディングス	24,500	389.00	9,530,500	貸付有価証券 11,500株
サムティ	11,100	1,190.00	13,209,000	貸付有価証券 5,400株（3,000株）
ディア・ライフ	9,500	393.00	3,733,500	貸付有価証券 500株（100株）
エー・ディー・ワークス	126,800	43.00	5,452,400	貸付有価証券 10,200株
日本商業開発	7,600	1,951.00	14,827,600	貸付有価証券 1,900株
プレサンスコーポレーション	21,500	1,395.00	29,992,500	
ユニゾホールディングス	11,400	3,135.00	35,739,000	貸付有価証券 300株
THEグローバル社	4,800	453.00	2,174,400	
日本管理センター	9,900	1,397.00	13,830,300	貸付有価証券 4,700株
サンセイランディック	2,800	752.00	2,105,600	貸付有価証券 100株
エストラスト	2,400	771.00	1,850,400	貸付有価証券 1,100株（1,000株）
フージャースホールディングス	17,900	606.00	10,847,400	貸付有価証券 1,200株（1,200株）

オープンハウス	20,000	2,740.00	54,800,000	
東急不動産ホールディングス	334,800	650.00	217,620,000	
飯田グループホールディングス	115,400	1,819.00	209,912,600	
ムゲンエステート	4,800	712.00	3,417,600	貸付有価証券 2,300株
ファーストブラザーズ	1,400	1,687.00	2,361,800	
ハウズドゥ	1,700	1,467.00	2,493,900	貸付有価証券 700株（700株）
シーアールイー	2,000	1,691.00	3,382,000	
ケイアイスター不動産	2,800	1,580.00	4,424,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
パーク24	70,200	3,075.00	215,865,000	貸付有価証券 7,100株（2,200株）
パラカ	4,000	1,966.00	7,864,000	
三井不動産	734,000	2,630.00	1,930,420,000	
三菱地所	1,029,000	2,252.50	2,317,822,500	
平和不動産	26,200	1,612.00	42,234,400	貸付有価証券 1,800株
東京建物	160,600	1,582.00	254,069,200	
ダイビル	35,600	1,075.00	38,270,000	
京阪神ビルディング	22,900	648.00	14,839,200	
住友不動産	332,000	3,231.00	1,072,692,000	
大京	257,000	229.00	58,853,000	貸付有価証券 4,000株
テーオーシー	53,600	967.00	51,831,200	貸付有価証券 11,700株
東京楽天地	23,000	528.00	12,144,000	
レオパレス21	174,700	611.00	106,741,700	
スターツコーポレーション	14,100	2,429.00	34,248,900	
フジ住宅	17,600	746.00	13,129,600	
空港施設	16,700	594.00	9,919,800	
明和地所	7,600	704.00	5,350,400	
住友不動産販売	12,500	2,866.00	35,825,000	
ゴールドクレスト	12,500	2,117.00	26,462,500	
日本エスリード	5,400	1,491.00	8,051,400	
日神不動産	16,400	551.00	9,036,400	

日本エスコン	18,400	404.00	7,433,600	貸付有価証券 8,800株(4,700株)
タカラレーベン	60,300	594.00	35,818,200	貸付有価証券 11,300株
サンヨーハウジング名古屋	7,100	1,010.00	7,171,000	
イオンモール	89,100	1,697.00	151,202,700	貸付有価証券 42,300株
ファースト住建	5,200	1,429.00	7,430,800	
トーセイ	18,900	770.00	14,553,000	貸付有価証券 2,500株(300株)
穴吹興産	1,500	2,677.00	4,015,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	86,000	1,040.00	89,440,000	
サンフロンティア不動産	14,900	1,024.00	15,257,600	貸付有価証券 500株(100株)
エフ・ジェー・ネクスト	12,100	784.00	9,486,400	
インテリックス	3,200	816.00	2,611,200	貸付有価証券 1,400株
ランドビジネス	8,200	288.00	2,361,600	
グランディハウス	12,100	417.00	5,045,700	
日本空港ビルデング	44,100	3,920.00	172,872,000	貸付有価証券 20,400株
日本工営	9,800	2,656.00	26,028,800	
ネクスト	36,200	728.00	26,353,600	貸付有価証券 17,500株
ジェイエシーリクルートメント	9,000	1,505.00	13,545,000	貸付有価証券 3,200株(100株)
日本M&Aセンター	42,300	3,435.00	145,300,500	貸付有価証券 19,700株
アコーディア・ゴルフ	7,400	1,205.00	8,917,000	貸付有価証券 900株
中広	1,400	702.00	982,800	
タケエイ	12,800	1,042.00	13,337,600	貸付有価証券 5,000株
トラスト・テック	5,900	1,732.00	10,218,800	
コシダカホールディングス	5,000	2,482.00	12,410,000	
パソナグループ	10,900	813.00	8,861,700	貸付有価証券 4,800株(3,800株)
CDS	3,300	998.00	3,293,400	貸付有価証券

				300株
リンクアンドモチベーション	34,500	431.00	14,869,500	貸付有価証券 13,000株
G C A	13,000	924.00	12,012,000	貸付有価証券 4,900株(500株)
エス・エム・エス	20,800	2,585.00	53,768,000	貸付有価証券 8,300株
テンプホールディングス	113,300	2,030.00	229,999,000	貸付有価証券 54,200株(1,400株)
リニカル	8,600	1,438.00	12,366,800	貸付有価証券 4,100株
クックパッド	32,700	971.00	31,751,700	貸付有価証券 15,600株(1,000株)
エスクリ	5,200	740.00	3,848,000	貸付有価証券 2,400株(1,400株)
アイ・ケイ・ケイ	6,500	710.00	4,615,000	
学情	6,100	1,204.00	7,344,400	貸付有価証券 2,800株(600株)
スタジオアリス	6,000	2,242.00	13,452,000	
シミックホールディングス	7,400	1,482.00	10,966,800	貸付有価証券 1,700株(1,600株)
N J S	3,300	1,399.00	4,616,700	
総合警備保障	53,300	4,300.00	229,190,000	
カカクコム	104,500	1,628.00	170,126,000	貸付有価証券 49,100株
セントケア・ホールディング	1,900	1,663.00	3,159,700	貸付有価証券 800株(800株)
サイネックス	1,100	1,167.00	1,283,700	貸付有価証券 500株(500株)
ルネサンス	7,400	1,738.00	12,861,200	貸付有価証券 3,500株
ディップ	18,900	2,357.00	44,547,300	貸付有価証券 8,800株
オプトホールディング	10,500	941.00	9,880,500	貸付有価証券 100株
新日本科学	16,300	569.00	9,274,700	貸付有価証券 7,800株
ツクイ	34,700	675.00	23,422,500	
キャリアデザインセンター	3,100	1,165.00	3,611,500	
エムスリー	126,900	2,875.00	364,837,500	貸付有価証券

				13,200株
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	625.00	6,687,500	貸付有価証券 2,700株
アウトソーシング	8,400	3,735.00	31,374,000	貸付有価証券 3,900株(3,800株)
ウェルネット	11,000	1,272.00	13,992,000	貸付有価証券 4,100株
ワールドホールディングス	3,300	1,901.00	6,273,300	貸付有価証券 1,500株
ディー・エヌ・エー	65,700	2,430.00	159,651,000	貸付有価証券 27,500株
博報堂D Yホールディングス	203,000	1,320.00	267,960,000	
ぐるなび	21,200	2,219.00	47,042,800	
エスアールジータカミヤ	15,800	585.00	9,243,000	貸付有価証券 7,500株
ジャパンベストレスキューシステム	18,100	252.00	4,561,200	貸付有価証券 8,600株(4,600株)
ファンコミュニケーションズ	37,200	763.00	28,383,600	貸付有価証券 5,200株(4,700株)
ライク	2,600	2,474.00	6,432,400	貸付有価証券 1,200株
ビジネス・ブレークスルー	4,700	459.00	2,157,300	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
WDBホールディングス	5,200	1,358.00	7,061,600	
ティア	7,000	684.00	4,788,000	貸付有価証券 500株(500株)
パリュコマース	13,500	373.00	5,035,500	貸付有価証券 300株(300株)
インフォマート	62,100	588.00	36,514,800	貸付有価証券 29,700株(1,600株)
J Pホールディングス	42,100	257.00	10,819,700	貸付有価証券 19,100株(1,400株)
E P Sホールディングス	18,100	1,504.00	27,222,400	
レッグス	3,300	805.00	2,656,500	
プレステージ・インターナショナル	20,700	871.00	18,029,700	貸付有価証券 600株
アミューズ	8,100	1,952.00	15,811,200	
ドリームインキュベータ	4,500	2,074.00	9,333,000	貸付有価証券 1,800株
クイック	7,500	1,139.00	8,542,500	

T A C	8,100	229.00	1,854,900	
ケネディクス	185,700	443.00	82,265,100	貸付有価証券 67,100株
電通	163,200	5,940.00	969,408,000	貸付有価証券 29,100株
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,800	1,016.00	6,908,800	貸付有価証券 3,100株
ぴあ	4,400	2,925.00	12,870,000	貸付有価証券 2,000株
イオンファンタジー	4,300	3,105.00	13,351,500	貸付有価証券 1,800株
シーティーエス	3,900	1,544.00	6,021,600	貸付有価証券 100株
ネクシィーズグループ	5,300	1,554.00	8,236,200	貸付有価証券 2,500株（2,000株）
みらかホールディングス	37,400	5,090.00	190,366,000	
アルプス技研	5,900	3,010.00	17,759,000	
ダイオーズ	2,600	1,076.00	2,797,600	
日本空調サービス	14,000	667.00	9,338,000	貸付有価証券 400株
オリエンタルランド	158,300	6,271.00	992,699,300	貸付有価証券 25,900株（7,600株）
ダスキン	37,500	2,447.00	91,762,500	
明光ネットワークジャパン	18,200	1,211.00	22,040,200	貸付有価証券 4,800株（3,600株）
ファルコホールディングス	6,900	1,495.00	10,315,500	
秀英予備校	2,900	475.00	1,377,500	貸付有価証券 1,300株（1,200株）
田谷	2,400	670.00	1,608,000	
ラウンドワン	45,700	884.00	40,398,800	
リゾートトラスト	56,700	2,237.00	126,837,900	貸付有価証券 26,500株（4,100株）
ビー・エム・エル	19,200	2,530.00	48,576,000	
ワタベウェディング	2,200	575.00	1,265,000	貸付有価証券 1,000株（100株）
りらいあコミュニケーションズ	24,200	1,091.00	26,402,200	貸付有価証券 1,100株
リソー教育	24,900	623.00	15,512,700	貸付有価証券 1,300株
早稲田アカデミー	1,900	1,184.00	2,249,600	

ユー・エス・エス	177,300	1,962.00	347,862,600	貸付有価証券 4,100株
東京個別指導学院	4,700	1,022.00	4,803,400	貸付有価証券 2,200株
サイバーエージェント	77,100	2,995.00	230,914,500	貸付有価証券 27,400株（27,400株）
楽天	748,400	1,049.00	785,071,600	貸付有価証券 22,200株
クリーク・アンド・リ バー社	5,200	1,098.00	5,709,600	
テー・オー・ダブリュー	11,700	673.00	7,874,100	貸付有価証券 3,600株
セントラルスポーツ	5,000	3,485.00	17,425,000	
フルキャストホールディ ングス	15,100	1,087.00	16,413,700	貸付有価証券 7,200株
リソルホールディングス	15,000	349.00	5,235,000	
テクノプロ・ホールディ ングス	23,800	3,895.00	92,701,000	
アトラ	1,700	737.00	1,252,900	貸付有価証券 700株
インターワークス	3,000	1,174.00	3,522,000	
K e e P e r 技研	1,600	2,137.00	3,419,200	貸付有価証券 700株
ファーストロジック	800	2,455.00	1,964,000	
デザインワン・ジャパン	1,000	2,861.00	2,861,000	
イー・ガーディアン	4,700	1,802.00	8,469,400	貸付有価証券 2,300株
リブセンス	9,800	443.00	4,341,400	貸付有価証券 4,400株（2,400株）
ジャパンマテリアル	10,700	1,509.00	16,146,300	貸付有価証券 5,100株
ベクトル	11,800	1,232.00	14,537,600	貸付有価証券 5,600株（3,000株）
ウチヤマホールディング ス	6,600	435.00	2,871,000	貸付有価証券 700株
サクセスホールディング ス	1,400	1,326.00	1,856,400	
キャリアリンク	3,300	738.00	2,435,400	貸付有価証券 1,200株
I B J	11,400	587.00	6,691,800	貸付有価証券 5,400株

アサント	5,400	1,736.00	9,374,400	
N・フィールド	6,900	1,363.00	9,404,700	貸付有価証券 3,300株（100株）
バリューHR	1,100	2,540.00	2,794,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	4,010.00	7,619,000	貸付有価証券 800株
ライドオン・エクスプレス	3,600	921.00	3,315,600	貸付有価証券 1,600株（600株）
E R Iホールディングス	3,800	812.00	3,085,600	貸付有価証券 900株
アビスト	2,300	4,010.00	9,223,000	貸付有価証券 700株（700株）
ウィルグループ	5,800	702.00	4,071,600	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	2,400	1,663.00	3,991,200	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
日本ビューホテル	3,000	1,355.00	4,065,000	貸付有価証券 900株（400株）
リクルートホールディング ス	320,000	5,270.00	1,686,400,000	
エラン	1,900	1,371.00	2,604,900	
土木管理総合試験所	1,500	703.00	1,054,500	貸付有価証券 300株
日本郵政	382,200	1,476.00	564,127,200	
ベルシステム24ホール ディングス	22,300	997.00	22,233,100	貸付有価証券 10,100株
一蔵	1,100	1,315.00	1,446,500	
ソラスト	6,700	1,489.00	9,976,300	
リログループ	5,500	15,700.00	86,350,000	貸付有価証券 2,600株
東祥	3,100	5,060.00	15,686,000	
エイチ・アイ・エス	23,900	2,905.00	69,429,500	貸付有価証券 11,500株（2,500株）
ラックランド	2,600	1,987.00	5,166,200	貸付有価証券 1,200株
共立メンテナンス	11,900	6,930.00	82,467,000	貸付有価証券 4,900株（4,900株）
イチネンホールディング ス	15,300	1,189.00	18,191,700	貸付有価証券 900株
建設技術研究所	9,200	1,074.00	9,880,800	
スペース	7,900	1,269.00	10,025,100	

燦ホールディングス	2,900	1,587.00	4,602,300	
スバル興業	10,000	523.00	5,230,000	
東京テアトル	56,000	152.00	8,512,000	貸付有価証券 26,000株（26,000株）
タナベ経営	2,900	1,365.00	3,958,500	
ナガワ	2,700	4,530.00	12,231,000	
よみうりランド	29,000	460.00	13,340,000	
東京都競馬	100,000	258.00	25,800,000	
常磐興産	5,400	1,623.00	8,764,200	貸付有価証券 2,100株（100株）
カナモト	20,400	2,892.00	58,996,800	
東京ドーム	58,400	1,094.00	63,889,600	貸付有価証券 1,000株
西尾レントオール	11,800	3,305.00	38,999,000	
トランス・コスモス	17,000	2,590.00	44,030,000	貸付有価証券 4,800株
乃村工藝社	31,300	1,931.00	60,440,300	
藤田観光	48,000	372.00	17,856,000	貸付有価証券 23,000株
KNT-CTホールディングス	83,000	139.00	11,537,000	
日本管財	12,600	1,786.00	22,503,600	
トーカイ	6,500	4,085.00	26,552,500	
白洋舎	1,400	2,714.00	3,799,600	
セコム	152,400	8,250.00	1,257,300,000	貸付有価証券 1,500株
セントラル警備保障	6,500	1,927.00	12,525,500	貸付有価証券 3,000株
丹青社	25,300	858.00	21,707,400	貸付有価証券 11,400株（8,500株）
メイテック	17,700	4,390.00	77,703,000	貸付有価証券 1,700株
アサツー ディ・ケイ	23,900	2,905.00	69,429,500	貸付有価証券 300株
応用地質	13,800	1,474.00	20,341,200	貸付有価証券 200株
船井総研ホールディングス	18,800	1,958.00	36,810,400	貸付有価証券 2,500株
進学会	6,100	575.00	3,507,500	
オオバ	11,400	475.00	5,415,000	貸付有価証券

					100株
	学究社	3,800	1,612.00	6,125,600	貸付有価証券 600株（600株）
	ベネッセホールディングス	49,100	3,390.00	166,449,000	貸付有価証券 23,500株
	イオンディライト	16,500	3,475.00	57,337,500	貸付有価証券 7,800株（7,800株）
	ナック	9,000	989.00	8,901,000	貸付有価証券 3,600株
	ニチイ学館	25,400	872.00	22,148,800	貸付有価証券 11,000株（9,200株）
	ダイセキ	25,500	2,329.00	59,389,500	
	ステップ	4,900	1,403.00	6,874,700	
	小計 銘柄数：1,991			315,771,079,280	
	組入時価比率：98.2%			100.0%	
	合計			315,771,079,280	

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成29年 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29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	5,505,665,021	-	5,587,470,000	81,629,047
合計	5,505,665,021	-	5,587,470,000	81,629,047

(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29年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	33,362,295
国債証券	14,630,123,610
未収利息	33,654,734
前払費用	2,198,128
流動資産合計	14,699,338,767
資産合計	14,699,338,767
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,735,369
未払利息	44
流動負債合計	13,735,413
負債合計	13,735,413
純資産の部	
元本等	
元本	11,050,150,140
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,635,453,214
元本等合計	14,685,603,354
純資産合計	14,685,603,354
負債純資産合計	14,699,338,767

## 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29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	1.3290円
(10,000口当たり純資産額)	(13,290円)

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年 2月18日 至 平成29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29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>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年 2月17日現在	
期首	平成28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	7,337,217,934円
同期中における追加設定元本額	6,225,111,417円
同期中における一部解約元本額	2,512,179,211円
期末元本額	11,050,150,140円
期末元本額の内訳*	

バランスセレクト30	543,879,030円
バランスセレクト50	607,132,988円
バランスセレクト70	242,005,287円
ネクストコア	292,514,842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)	4,467,576,147円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	21,102,517円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	47,946,820円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	18,114,429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)	4,238,434,504円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	106,220,362円
野村DC運用戦略ファンド	461,273,186円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	3,950,028円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成29年 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29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362回	100,000,000	100,404,000	
		国庫債券 利付(2年)第363回	100,000,000	100,425,000	
		国庫債券 利付(2年)第365回	50,000,000	50,240,000	
		国庫債券 利付(2年)第366回	50,000,000	50,255,000	
		国庫債券 利付(2年)第367回	130,000,000	130,724,100	
		国庫債券 利付(2年)第368回	170,000,000	170,987,700	
		国庫債券 利付(2年)第369回	100,000,000	100,603,000	
		国庫債券 利付(2年)第371回	80,000,000	80,532,000	
		国庫債券 利付(5年)第110回	20,000,000	20,126,000	
		国庫債券 利付(5年)第111回	40,000,000	40,294,800	
		国庫債券 利付(5年)第112回	130,000,000	131,167,400	
		国庫債券 利付(5年)第113回	50,000,000	50,382,500	
		国庫債券 利付(5年)第114回	20,000,000	20,175,800	
		国庫債券 利付(5年)第115回	140,000,000	141,008,000	

国庫債券 利付(5年)第116回	150,000,000	151,252,500	
国庫債券 利付(5年)第117回	180,000,000	181,575,000	
国庫債券 利付(5年)第118回	110,000,000	111,040,600	
国庫債券 利付(5年)第119回	140,000,000	140,996,800	
国庫債券 利付(5年)第120回	120,000,000	121,212,000	
国庫債券 利付(5年)第121回	160,000,000	161,201,600	
国庫債券 利付(5年)第122回	200,000,000	201,562,000	
国庫債券 利付(5年)第123回	230,000,000	231,846,900	
国庫債券 利付(5年)第124回	240,000,000	242,004,000	
国庫債券 利付(5年)第125回	180,000,000	181,553,400	
国庫債券 利付(5年)第126回	140,000,000	141,265,600	
国庫債券 利付(5年)第127回	320,000,000	322,947,200	
国庫債券 利付(5年)第128回	290,000,000	292,772,400	
国庫債券 利付(5年)第129回	290,000,000	292,801,400	
国庫債券 利付(5年)第130回	120,000,000	121,192,800	
国庫債券 利付(40年)第1回	10,000,000	14,034,300	
国庫債券 利付(40年)第2回	30,000,000	40,668,300	
国庫債券 利付(40年)第3回	20,000,000	27,251,800	
国庫債券 利付(40年)第4回	35,000,000	47,927,250	
国庫債券 利付(40年)第5回	50,000,000	65,802,500	
国庫債券 利付(40年)第6回	40,000,000	51,595,200	
国庫債券 利付(40年)第7回	30,000,000	36,928,200	
国庫債券 利付(40年)第8回	40,000,000	45,542,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	30,000,000	24,427,800	
国庫債券 利付(10年)第290回	50,000,000	50,904,500	
国庫債券 利付(10年)第291回	20,000,000	20,340,200	
国庫債券 利付(10年)第292回	35,000,000	35,746,200	
国庫債券 利付(10年)第293回	30,000,000	30,828,300	
国庫債券 利付(10年)第294回	40,000,000	41,051,200	
国庫債券 利付(10年)第295回	25,000,000	25,590,500	
国庫債券 利付(10年)第296回	65,000,000	66,807,000	

国庫債券 利付(10年)第297回	40,000,000	41,207,600
国庫債券 利付(10年)第298回	20,000,000	20,567,200
国庫債券 利付(10年)第299回	45,000,000	46,424,700
国庫債券 利付(10年)第300回	35,000,000	36,254,050
国庫債券 利付(10年)第301回	45,000,000	46,787,400
国庫債券 利付(10年)第302回	40,000,000	41,495,600
国庫債券 利付(10年)第303回	45,000,000	46,853,550
国庫債券 利付(10年)第304回	30,000,000	31,158,000
国庫債券 利付(10年)第305回	110,000,000	114,593,600
国庫債券 利付(10年)第306回	45,000,000	47,175,750
国庫債券 利付(10年)第307回	30,000,000	31,357,800
国庫債券 利付(10年)第308回	30,000,000	31,448,700
国庫債券 利付(10年)第309回	40,000,000	41,664,000
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	31,224,000
国庫債券 利付(10年)第311回	20,000,000	20,672,200
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	73,580,500
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	31,498,200
国庫債券 利付(10年)第315回	70,000,000	74,001,900
国庫債券 利付(10年)第316回	10,000,000	10,528,200
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	31,662,900
国庫債券 利付(10年)第318回	80,000,000	84,066,400
国庫債券 利付(10年)第319回	30,000,000	31,738,500

回			
国庫債券 利付(10年)第320回	90,000,000	94,779,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	40,000,000	42,200,800	
国庫債券 利付(10年)第322回	90,000,000	94,492,800	
国庫債券 利付(10年)第323回	20,000,000	21,037,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	70,000,000	73,255,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	70,000,000	73,369,100	
国庫債券 利付(10年)第326回	60,000,000	62,647,800	
国庫債券 利付(10年)第327回	80,000,000	83,998,400	
国庫債券 利付(10年)第328回	150,000,000	155,940,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	130,000,000	136,968,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	110,000,000	116,055,500	
国庫債券 利付(10年)第331回	160,000,000	166,697,600	
国庫債券 利付(10年)第332回	110,000,000	114,701,400	
国庫債券 利付(10年)第333回	90,000,000	93,852,900	
国庫債券 利付(10年)第334回	130,000,000	135,565,300	
国庫債券 利付(10年)第335回	90,000,000	93,232,800	
国庫債券 利付(10年)第336回	40,000,000	41,451,600	
国庫債券 利付(10年)第337回	130,000,000	132,688,400	
国庫債券 利付(10年)第338回	160,000,000	164,568,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	220,000,000	226,384,400	
国庫債券 利付(10年)第340回	225,000,000	231,626,250	

国庫債券 利付(10年)第341回	150,000,000	153,093,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	250,000,000	250,675,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	210,000,000	210,485,100	
国庫債券 利付(10年)第344回	290,000,000	290,551,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	90,000,000	90,131,400	
国庫債券 利付(30年)第3回	40,000,000	50,509,600	
国庫債券 利付(30年)第5回	10,000,000	12,586,300	
国庫債券 利付(30年)第6回	10,000,000	12,910,600	
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	19,176,750	
国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	24,148,800	
国庫債券 利付(30年)第9回	70,000,000	80,180,800	
国庫債券 利付(30年)第10回	150,000,000	164,614,500	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	11,901,000	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	12,526,100	
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	12,385,800	
国庫債券 利付(30年)第14回	30,000,000	39,151,200	
国庫債券 利付(30年)第15回	10,000,000	13,231,100	
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	13,231,500	
国庫債券 利付(30年)第17回	10,000,000	13,067,200	
国庫債券 利付(30年)第18回	20,000,000	25,838,800	
国庫債券 利付(30年)第19回	10,000,000	12,924,100	
国庫債券 利付(30年)第20回	10,000,000	13,264,500	
国庫債券 利付(30年)第21回	10,000,000	12,919,500	
国庫債券 利付(30年)第22回	10,000,000	13,286,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	40,000,000	53,207,600	
国庫債券 利付(30年)第24回	10,000,000	13,305,400	
国庫債券 利付(30年)第25回	20,000,000	25,909,800	
国庫債券 利付(30年)第26回	20,000,000	26,284,800	
国庫債券 利付(30年)第27回	20,000,000	26,764,200	
国庫債券 利付(30年)第28回	30,000,000	40,286,700	
国庫債券 利付(30年)第29回	20,000,000	26,547,800	
国庫債券 利付(30年)第30回	60,000,000	78,730,800	

国庫債券	利付（30年）第31回	30,000,000	38,887,200
国庫債券	利付（30年）第32回	40,000,000	52,818,400
国庫債券	利付（30年）第33回	20,000,000	25,185,200
国庫債券	利付（30年）第34回	40,000,000	52,253,600
国庫債券	利付（30年）第35回	42,000,000	53,170,740
国庫債券	利付（30年）第36回	30,000,000	38,075,100
国庫債券	利付（30年）第37回	30,000,000	37,484,400
国庫債券	利付（30年）第38回	50,000,000	61,449,500
国庫債券	利付（30年）第39回	20,000,000	25,056,400
国庫債券	利付（30年）第40回	30,000,000	36,898,800
国庫債券	利付（30年）第41回	20,000,000	24,135,600
国庫債券	利付（30年）第42回	20,000,000	24,140,000
国庫債券	利付（30年）第43回	20,000,000	24,144,400
国庫債券	利付（30年）第44回	30,000,000	36,222,900
国庫債券	利付（30年）第45回	40,000,000	46,320,000
国庫債券	利付（30年）第46回	20,000,000	23,156,400
国庫債券	利付（30年）第47回	20,000,000	23,667,400
国庫債券	利付（30年）第48回	40,000,000	45,371,200
国庫債券	利付（30年）第49回	50,000,000	56,695,500
国庫債券	利付（30年）第50回	110,000,000	107,961,700
国庫債券	利付（30年）第51回	120,000,000	102,226,800
国庫債券	利付（30年）第52回	100,000,000	90,234,000
国庫債券	利付（30年）第53回	30,000,000	27,785,400
国庫債券	利付（20年）第41回	30,000,000	31,068,600
国庫債券	利付（20年）第42回	10,000,000	10,585,300
国庫債券	利付（20年）第43回	10,000,000	10,799,100
国庫債券	利付（20年）第44回	10,000,000	10,820,000
国庫債券	利付（20年）第45回	10,000,000	10,789,100
国庫債券	利付（20年）第46回	5,000,000	5,392,500
国庫債券	利付（20年）第47回	15,000,000	16,260,150
国庫債券	利付（20年）第49回	40,000,000	43,631,200
国庫債券	利付（20年）第52回	25,000,000	27,524,500
国庫債券	利付（20年）第53回	10,000,000	11,064,400
国庫債券	利付（20年）第54回	10,000,000	11,112,900
国庫債券	利付（20年）第55回	10,000,000	11,063,000
国庫債券	利付（20年）第56回	10,000,000	11,106,600

国庫債券	利付(20年)第57回	10,000,000	11,053,100
国庫債券	利付(20年)第58回	10,000,000	11,096,900
国庫債券	利付(20年)第59回	30,000,000	33,087,600
国庫債券	利付(20年)第60回	10,000,000	10,853,700
国庫債券	利付(20年)第61回	10,000,000	10,642,900
国庫債券	利付(20年)第62回	10,000,000	10,532,700
国庫債券	利付(20年)第63回	10,000,000	11,166,900
国庫債券	利付(20年)第64回	10,000,000	11,268,300
国庫債券	利付(20年)第65回	10,000,000	11,312,600
国庫債券	利付(20年)第66回	20,000,000	22,488,400
国庫債券	利付(20年)第67回	10,000,000	11,348,000
国庫債券	利付(20年)第68回	10,000,000	11,560,300
国庫債券	利付(20年)第69回	30,000,000	34,468,500
国庫債券	利付(20年)第70回	10,000,000	11,745,300
国庫債券	利付(20年)第71回	10,000,000	11,598,900
国庫債券	利付(20年)第72回	20,000,000	23,138,800
国庫債券	利付(20年)第73回	30,000,000	34,601,400
国庫債券	利付(20年)第74回	10,000,000	11,611,900
国庫債券	利付(20年)第75回	40,000,000	46,631,200
国庫債券	利付(20年)第76回	17,000,000	19,544,730
国庫債券	利付(20年)第77回	15,000,000	17,366,100
国庫債券	利付(20年)第78回	10,000,000	11,538,700
国庫債券	利付(20年)第79回	10,000,000	11,621,600
国庫債券	利付(20年)第80回	10,000,000	11,704,600
国庫債券	利付(20年)第81回	10,000,000	11,660,600
国庫債券	利付(20年)第82回	15,000,000	17,618,850
国庫債券	利付(20年)第83回	15,000,000	17,679,150
国庫債券	利付(20年)第84回	10,000,000	11,698,300
国庫債券	利付(20年)第85回	13,000,000	15,379,390
国庫債券	利付(20年)第86回	10,000,000	12,010,700
国庫債券	利付(20年)第88回	20,000,000	24,132,400
国庫債券	利付(20年)第90回	20,000,000	24,041,600
国庫債券	利付(20年)第91回	10,000,000	12,115,900
国庫債券	利付(20年)第92回	30,000,000	35,891,400
国庫債券	利付(20年)第93回	20,000,000	23,801,600
国庫債券	利付(20年)第94回	20,000,000	24,001,200

国庫債券 利付(20年)第95回	10,000,000	12,242,200	
国庫債券 利付(20年)第96回	15,000,000	18,056,850	
国庫債券 利付(20年)第97回	10,000,000	12,172,600	
国庫債券 利付(20年)第99回	130,000,000	157,259,700	
国庫債券 利付(20年)第100回	20,000,000	24,479,400	
国庫債券 利付(20年)第101回	20,000,000	24,915,400	
国庫債券 利付(20年)第102回	20,000,000	24,997,600	
国庫債券 利付(20年)第103回	25,000,000	30,968,750	
国庫債券 利付(20年)第104回	10,000,000	12,164,900	
国庫債券 利付(20年)第105回	20,000,000	24,382,800	
国庫債券 利付(20年)第106回	10,000,000	12,304,900	
国庫債券 利付(20年)第107回	20,000,000	24,447,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	10,000,000	11,991,900	
国庫債券 利付(20年)第109回	10,000,000	12,018,300	
国庫債券 利付(20年)第110回	20,000,000	24,508,800	
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	12,405,800	
国庫債券 利付(20年)第112回	35,000,000	42,999,600	
国庫債券 利付(20年)第113回	40,000,000	49,234,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	30,000,000	37,012,800	
国庫債券 利付(20年)第115回	10,000,000	12,462,300	
国庫債券 利付(20年)第116回	10,000,000	12,484,500	
国庫債券 利付(20年)第118回	40,000,000	48,995,600	
国庫債券 利付(20年)第119回	50,000,000	59,917,000	

国庫債券 利付(20年)第120回	25,000,000	29,314,500	
国庫債券 利付(20年)第122回	20,000,000	23,992,200	
国庫債券 利付(20年)第123回	10,000,000	12,414,500	
国庫債券 利付(20年)第124回	20,000,000	24,562,800	
国庫債券 利付(20年)第125回	10,000,000	12,565,700	
国庫債券 利付(20年)第126回	30,000,000	36,886,800	
国庫債券 利付(20年)第127回	20,000,000	24,321,200	
国庫債券 利付(20年)第128回	30,000,000	36,517,800	
国庫債券 利付(20年)第129回	20,000,000	24,054,600	
国庫債券 利付(20年)第130回	40,000,000	48,144,800	
国庫債券 利付(20年)第131回	85,000,000	101,126,200	
国庫債券 利付(20年)第132回	30,000,000	35,708,700	
国庫債券 利付(20年)第134回	30,000,000	36,150,900	
国庫債券 利付(20年)第135回	15,000,000	17,861,100	
国庫債券 利付(20年)第136回	90,000,000	105,804,900	
国庫債券 利付(20年)第137回	10,000,000	11,911,700	
国庫債券 利付(20年)第138回	110,000,000	127,749,600	
国庫債券 利付(20年)第139回	10,000,000	11,766,800	
国庫債券 利付(20年)第140回	120,000,000	142,980,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	30,000,000	35,751,900	
国庫債券 利付(20年)第142回	20,000,000	24,131,800	
国庫債券 利付(20年)第143回	10,000,000	11,759,000	

	回			
	国庫債券 利付（20年）第144回	10,000,000	11,608,700	
	国庫債券 利付（20年）第145回	10,000,000	11,910,100	
	国庫債券 利付（20年）第146回	60,000,000	71,460,000	
	国庫債券 利付（20年）第147回	20,000,000	23,487,600	
	国庫債券 利付（20年）第148回	60,000,000	69,493,200	
	国庫債券 利付（20年）第149回	70,000,000	81,032,000	
	国庫債券 利付（20年）第150回	30,000,000	34,196,700	
	国庫債券 利付（20年）第151回	70,000,000	77,324,100	
	国庫債券 利付（20年）第152回	50,000,000	55,161,500	
	国庫債券 利付（20年）第153回	60,000,000	67,156,200	
	国庫債券 利付（20年）第154回	90,000,000	99,025,200	
	国庫債券 利付（20年）第155回	120,000,000	127,579,200	
	国庫債券 利付（20年）第156回	160,000,000	152,563,200	
	国庫債券 利付（20年）第157回	160,000,000	146,256,000	
	国庫債券 利付（20年）第158回	150,000,000	144,834,000	
	国庫債券 利付（20年）第159回	40,000,000	39,269,200	
小計	銘柄数：253 組入時価比率：99.6%	13,687,000,000	14,630,123,610 100.0%	
合計			14,630,123,610	

(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29年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	4,019,243,025
コール・ローン	331,728,887
株式	342,309,613,146
投資信託受益証券	22,524,929
投資証券	9,169,836,066
派生商品評価勘定	169,351,940
未収入金	124,454
未収配当金	495,779,862
差入委託証拠金	2,275,553,429
流動資産合計	358,793,755,738
資産合計	358,793,755,738
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	366,761
未払解約金	283,925,394
未払利息	437
その他未払費用	1,096,900
流動負債合計	285,389,492
負債合計	285,389,492
純資産の部	
元本等	
元本	155,998,823,554
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	202,509,542,692
元本等合計	358,508,366,246
純資産合計	358,508,366,246
負債純資産合計	358,793,755,738

## 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>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 （株式、投資証券） 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 （投資信託受益証券） 受取配当金は、投資信託受益証券の収益分配金を、原則として収益分配金落の売買が行なわれる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成29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	2,2981円
(10,000口当たり純資産額)	(22,981円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

<p>自 平成28年 2月18日 至 平成29年 2月17日</p>	
1. 金融商品に対する取組方針	<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>
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。

### 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29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29年 2月17日現在

期首	平成28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	158,571,624,202円
同期中における追加設定元本額	26,377,928,734円
同期中における一部解約元本額	28,950,729,382円
期末元本額	155,998,823,554円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	58,852,222円
バランスセレクト50	180,892,160円
バランスセレクト70	175,870,456円

野村外国株式インデックスファンド	560,261,508円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,651,724,270円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	8,250,894,705円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	5,162,956,123円
野村資産設計ファンド2015	28,385,936円
野村資産設計ファンド2020	32,765,415円
野村資産設計ファンド2025	44,141,029円
野村資産設計ファンド2030	42,038,374円
野村資産設計ファンド2035	32,310,237円
野村資産設計ファンド2040	98,363,876円
野村外国株インデックス(野村投資一任口座向け)	15,133,845,553円
のむらップ・ファンド(保守型)	960,364,965円
のむらップ・ファンド(普通型)	5,146,297,725円
のむらップ・ファンド(積極型)	4,137,576,012円
野村資産設計ファンド2045	10,129,974円
野村インデックスファンド・外国株式	2,867,056,174円
マイ・ロード	1,515,725,284円
ネクストコア	101,516,922円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	86,839,076円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	528,575,852円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	995,359,543円
野村資産設計ファンド2050	10,209,404円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,692,166円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	721,822円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	475,696円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	401,050円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	117,646,252円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	69,917,918円
インデックス・ブレンド(タイプ)	39,808円
インデックス・ブレンド(タイプ)	40,643円
インデックス・ブレンド(タイプ)	79,912円
インデックス・ブレンド(タイプ)	69,482円
インデックス・ブレンド(タイプ)	163,323円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	31,488,489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)	457,963,165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)	392,369,930円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	5,463,094,882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)	3,347,502,926円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,896,324円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	20,970,423円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	11,356,325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)	109,733,815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)	1,208,793,080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)	478,683,250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)	191,948,978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)	53,239,882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)	231,521,080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)	4,198,728,864円

野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	519,909,650円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,215,368,276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)	302,606,120円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,279,770,275円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,213,355円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	13,830,138円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	13,436,167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)	57,300,956,164円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,334,631,045円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,406,107,775円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,962,036,962円
マイバランスDC30	753,890,939円
マイバランスDC50	1,375,514,286円
マイバランスDC70	1,026,713,156円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	14,066,554,208円
野村DC運用戦略ファンド	159,217,131円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	477,191円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	55,652,493円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,303,583円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	2,142,360円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1)株式(平成29年 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	39,600	61.20	2,423,520.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	4,300	115.38	496,134.00	
		HALLIBURTON CO	82,400	54.31	4,475,144.00	
		HELMERICH & PAYNE	10,600	68.49	725,994.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,500	40.24	1,468,760.00	
		SCHLUMBERGER LTD	133,400	81.13	10,822,742.00	
		TECHNIPFMC PLC	43,300	32.48	1,406,384.00	
		WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	85,000	5.96	506,600.00	
		ANADARKO PETE	53,600	66.60	3,569,760.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	14,700	25.19	370,293.00	

APACHE CORPORATION	36,600	55.25	2,022,150.00
CABOT OIL & GAS CORP	45,700	23.12	1,056,584.00
CHENIERE ENERGY INC	19,500	46.84	913,380.00
CHEVRON CORP	181,200	110.68	20,055,216.00
CIMAREX ENERGY CO	9,000	133.06	1,197,540.00
CONCHO RESOURCES INC	13,400	140.19	1,878,546.00
CONOCOPHILLIPS	118,600	48.34	5,733,124.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	9,400	46.01	432,494.00
DEVON ENERGY CORP	45,800	44.11	2,020,238.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,500	109.01	926,585.00
EOG RESOURCES INC	55,200	100.17	5,529,384.00
EQT CORP	16,500	62.25	1,027,125.00
EXXON MOBIL CORP	398,400	82.30	32,788,320.00
HESS CORP	27,400	51.30	1,405,620.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	30.00	498,000.00
KINDER MORGAN INC	181,300	21.79	3,950,527.00
MARATHON OIL CORP	81,200	16.17	1,313,004.00
MARATHON PETROLEUM CORP	51,000	49.96	2,547,960.00
MURPHY OIL CORP	16,700	27.99	467,433.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	18,800	42.14	792,232.00
NOBLE ENERGY INC	40,700	37.21	1,514,447.00
OCCIDENTAL PETE CORP	73,100	66.44	4,856,764.00
ONEOK INC	19,800	54.03	1,069,794.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	17,400	31.86	554,364.00
PHILLIPS 66	45,000	78.50	3,532,500.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,180	193.21	3,126,137.80
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,012	32.09	289,195.08
RANGE RESOURCES CORP	19,000	31.24	593,560.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	46,800	8.61	402,948.00
SPECTRA ENERGY CORP	67,700	41.41	2,803,457.00
TARGA RESOURCES CORP	16,400	58.53	959,892.00
TESORO CORP	11,300	87.23	985,699.00
VALERO ENERGY CORP	44,000	66.60	2,930,400.00
WILLIAMS COS	78,500	27.99	2,197,215.00
AIR PRODUCTS	19,900	141.87	2,823,213.00

ALBEMARLE CORP	11,100	92.41	1,025,751.00
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,800	120.79	700,582.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	21,200	29.66	628,792.00
CELANESE CORP-SERIES A	14,300	89.03	1,273,129.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,900	33.52	767,608.00
DOW CHEM CO	107,900	61.41	6,626,139.00
DU PONT E I DE NEMOURS	83,700	77.79	6,511,023.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	14,100	80.60	1,136,460.00
ECOLAB INC	25,000	123.28	3,082,000.00
FMC CORP	13,200	57.83	763,356.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	7,600	124.03	942,628.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	33,700	92.69	3,123,653.00
MONSANTO CO	41,800	108.49	4,534,882.00
MOSAIC CO/THE	31,200	33.15	1,034,280.00
PPG INDUSTRIES	25,700	101.77	2,615,489.00
PRAXAIR INC	27,200	117.50	3,196,000.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,540	311.17	2,346,221.80
VALSPAR CORP	7,300	111.08	810,884.00
WR GRACE & CO	6,700	71.68	480,256.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,910	221.53	1,309,242.30
VULCAN MATERIALS CO	12,800	120.40	1,541,120.00
AVERY DENNISON CORP	8,700	80.16	697,392.00
BALL CORP	15,800	72.98	1,153,084.00
CROWN HOLDINGS INC	13,100	53.03	694,693.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	37,600	53.38	2,007,088.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	8,800	96.62	850,256.00
SEALED AIR CORP	19,200	47.91	919,872.00
WESTROCK CO	24,300	54.33	1,320,219.00
FREEMONT-MCMORAN INC	124,100	15.07	1,870,187.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	51,000	37.57	1,916,070.00
NUCOR CORP	30,600	63.61	1,946,466.00
ARCONIC INC	43,666	29.49	1,287,710.34
B/E AEROSPACE INC	10,100	62.65	632,765.00
BOEING CO	56,800	170.81	9,702,008.00
GENERAL DYNAMICS	24,810	188.74	4,682,639.40

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,600	209.94	965,724.00	
L3 TECHNOLOGIES INC	7,270	168.49	1,224,922.30	
LOCKHEED MARTIN	25,290	265.33	6,710,195.70	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,210	243.53	3,947,621.30	
RAYTHEON COMPANY	28,200	152.39	4,297,398.00	
ROCKWELL COLLINS INC	12,800	93.52	1,197,056.00	
TEXTRON INC	26,400	49.01	1,293,864.00	
TRANSDIGM GROUP INC	5,230	252.45	1,320,313.50	
UNITED TECHNOLOGIES	76,200	112.07	8,539,734.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	15,300	57.00	872,100.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	89,200	41.68	3,717,856.00	
MASCO CORP	32,900	33.67	1,107,743.00	
SMITH (A.O.) CORP	14,400	49.68	715,392.00	
FLUOR CORP	13,900	57.45	798,555.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,300	59.03	726,069.00	
ACUITY BRANDS INC	4,380	218.49	956,986.20	
AMETEK INC	21,900	54.37	1,190,703.00	
EATON CORP PLC	43,400	71.78	3,115,252.00	
EMERSON ELEC	61,500	62.90	3,868,350.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,400	151.88	1,883,312.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16,900	41.47	700,843.00	
3M CORP	57,970	183.41	10,632,277.70	
GENERAL ELEC CO	860,800	30.45	26,211,360.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	69,300	124.16	8,604,288.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	24,100	64.85	1,562,885.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,960	206.81	2,059,827.60	
AGCO CORP	6,300	63.81	402,003.00	
CATERPILLAR INC DEL	55,900	98.26	5,492,734.00	
CUMMINS INC	15,600	152.18	2,374,008.00	
DEERE & COMPANY	25,800	109.17	2,816,586.00	
DOVER CORP	15,300	79.98	1,223,694.00	
FLOWSERVE CORP	12,200	50.81	619,882.00	
FORTIVE CORP	29,500	57.39	1,693,005.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	30,500	130.26	3,972,930.00	

INGERSOLL-RAND PLC	25,100	81.10	2,035,610.00	
MIDDLEBY CORP	5,700	137.75	785,175.00	
PACCAR	34,100	68.72	2,343,352.00	
PARKER HANNIFIN CORP	12,700	154.41	1,961,007.00	
PENTAIR PLC	16,700	58.54	977,618.00	
SNAP-ON INC	5,450	173.31	944,539.50	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,400	126.40	1,820,160.00	
WABCO HOLDINGS INC	5,200	115.78	602,056.00	
WABTEC CORP	9,000	88.05	792,450.00	
XYLEM INC	17,000	47.75	811,750.00	
AERCAP HOLDINGS NV	15,000	46.79	701,850.00	
FASTENAL CO	27,600	50.61	1,396,836.00	
GRAINGER(W.W.) INC	5,540	254.80	1,411,592.00	
UNITED RENTALS INC	8,600	127.86	1,099,596.00	
CINTAS CORP	7,800	119.51	932,178.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	22,900	59.05	1,352,245.00	
STERICYCLE INC	7,900	83.35	658,465.00	
WASTE CONNECTIONS INC	16,500	82.77	1,365,705.00	
WASTE MANAGEMENT INC	42,200	71.18	3,003,796.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,600	78.06	1,061,616.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	17,700	56.17	994,209.00	
FEDEX CORPORATION	24,130	193.35	4,665,535.50	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	66,300	107.22	7,108,686.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,500	46.97	587,125.00	
DELTA AIR LINES INC	17,700	50.83	899,691.00	
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	56.34	862,002.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,600	75.67	575,092.00	
AMERCO	680	383.87	261,031.60	
CSX CORP	90,300	47.69	4,306,407.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,700	100.71	876,177.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	10,600	86.85	920,610.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,000	122.93	3,442,040.00	
UNION PAC CORP	79,900	109.39	8,740,261.00	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	7,600	79.05	600,780.00	

AUTOLIV INC	8,400	107.33	901,572.00
BORGWARNER INC	21,300	41.38	881,394.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	25,900	75.22	1,948,198.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	24,800	36.16	896,768.00
LEAR CORP	6,900	141.86	978,834.00
FORD MOTOR COMPANY	355,000	12.54	4,451,700.00
GENERAL MOTORS CO	133,700	37.03	4,950,911.00
HARLEY-DAVIDSON INC	16,800	56.42	947,856.00
TESLA INC	12,410	268.95	3,337,669.50
DR HORTON INC	33,600	30.43	1,022,448.00
GARMIN LTD	11,400	50.95	580,830.00
HARMAN INTERNATIONAL	7,000	110.98	776,860.00
LEGGETT & PLATT INC	13,400	48.34	647,756.00
LENNAR CORP-A	18,000	46.18	831,240.00
MOHAWK INDUSTRIES	5,940	221.78	1,317,373.20
NEWELL BRANDS INC	42,200	46.88	1,978,336.00
PULTEGROUP INC	28,900	21.34	616,726.00
TOLL BROTHERS INC	16,400	31.43	515,452.00
WHIRLPOOL CORP	7,120	176.69	1,258,032.80
HASBRO INC	10,700	97.64	1,044,748.00
MATTEL INC	33,400	25.67	857,378.00
POLARIS INDUSTRIES INC	6,200	86.47	536,114.00
COACH INC	27,900	37.96	1,059,084.00
HANESBRANDS INC	37,700	20.85	786,045.00
LULULEMON ATHLETICA INC	10,600	65.97	699,282.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,100	38.21	615,181.00
NIKE INC-B	129,200	56.29	7,272,668.00
PVH CORP	8,000	88.37	706,960.00
RALPH LAUREN CORPORATION	5,800	78.47	455,126.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	18,400	21.64	398,176.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	18,700	19.63	367,081.00
V F CORP	31,900	50.37	1,606,803.00
ARAMARK	23,200	35.67	827,544.00
CARNIVAL CORP	34,800	56.03	1,949,844.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,740	424.76	1,163,842.40

DARDEN RESTAURANTS INC	11,800	75.80	894,440.00
DOMINOS PIZZA INC	4,610	186.10	857,921.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	18,966	59.24	1,123,545.84
LAS VEGAS SANDS CORP	42,100	52.51	2,210,671.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	32,200	89.44	2,879,968.00
MCDONALD'S CORP	81,800	126.70	10,364,060.00
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,400	16.91	311,144.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,900	26.86	1,206,014.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	16,100	47.63	766,843.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,900	95.93	1,621,217.00
STARBUCKS CORP	140,600	56.73	7,976,238.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,900	85.79	935,111.00
WYNN RESORTS LTD	7,700	96.72	744,744.00
YUM BRANDS INC	36,100	68.44	2,470,684.00
CBS CORP-CL B	39,600	65.42	2,590,632.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	20,760	324.46	6,735,789.60
COMCAST CORP-CL A	230,600	75.99	17,523,294.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	14,300	28.57	408,551.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,200	27.99	593,388.00
DISH NETWORK CORP-A	21,800	62.72	1,367,296.00
DISNEY (WALT) CO	146,600	110.71	16,230,086.00
INTERPUBRIC GROUP	39,200	24.49	960,008.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	10,100	86.35	872,135.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	59,500	34.97	2,080,715.00
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	11,286	25.50	287,793.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	35.91	861,840.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	19,300	37.78	729,154.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	9,870	37.93	374,369.10
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	37,400	13.05	488,070.00
OMNICOM GROUP	23,000	85.32	1,962,360.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,800	77.10	601,380.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	163,000	4.91	800,330.00
TEGNA INC	20,600	24.31	500,786.00
TIME WARNER INC	74,500	96.39	7,181,055.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	101,500	30.51	3,096,765.00

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	42,800	30.08	1,287,424.00
VIACOM INC-CLASS B	34,100	44.16	1,505,856.00
GENUINE PARTS CO	14,400	99.23	1,428,912.00
LKQ CORP	30,000	31.98	959,400.00
AMAZON.COM INC	38,710	844.14	32,676,659.40
EXPEDIA INC	11,700	119.85	1,402,245.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	42,300	19.24	813,852.00
NETFLIX INC	41,000	142.01	5,822,410.00
PRICELINE GROUP INC/THE	4,736	1,648.88	7,809,095.68
TRIPADVISOR INC	12,300	46.92	577,116.00
DOLLAR GENERAL CORP	27,100	76.02	2,060,142.00
DOLLAR TREE INC	22,700	78.00	1,770,600.00
KOHL'S CORP	17,200	41.53	714,316.00
MACYS INC	30,400	31.82	967,328.00
NORDSTROM INC	12,700	44.18	561,086.00
TARGET CORP	52,200	65.20	3,403,440.00
ADVANCE AUTO PARTS	7,110	160.99	1,144,638.90
AUTONATION INC	7,100	46.92	333,132.00
AUTOZONE	2,850	737.36	2,101,476.00
BED BATH & BEYOND	15,600	40.88	637,728.00
BEST BUY COMPANY INC	28,400	45.37	1,288,508.00
CARMAX INC	18,300	68.28	1,249,524.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,200	48.50	397,700.00
FOOT LOCKER INC	13,400	70.50	944,700.00
GAP INC	22,900	24.06	550,974.00
HOME DEPOT	118,600	141.54	16,786,644.00
L BRANDS, INC	24,000	57.48	1,379,520.00
LOWE'S COS INC	84,400	76.32	6,441,408.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,250	266.85	2,468,362.50
ROSS STORES INC	39,000	68.26	2,662,140.00
SIGNET JEWELERS LTD	7,100	73.48	521,708.00
STAPLES INC	62,000	9.27	574,740.00
TIFFANY & CO	11,900	83.01	987,819.00
TJX COS INC	62,800	76.83	4,824,924.00

TRACTOR SUPPLY COMPANY	13,000	70.85	921,050.00	
ULTA BEAUTY INC	5,680	272.09	1,545,471.20	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	41,970	175.75	7,376,227.50	
CVS HEALTH CORP	102,200	79.45	8,119,790.00	
KROGER CO	86,000	33.94	2,918,840.00	
RITE AID CORP	99,000	5.87	581,130.00	
SYSCO CORP	51,400	52.63	2,705,182.00	
WAL-MART STORES INC	148,400	68.87	10,220,308.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	88,200	85.65	7,554,330.00	
WHOLE FOODS MARKET INC	31,600	30.56	965,696.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	20,000	47.82	956,400.00	
COCA COLA CO	393,600	41.20	16,216,320.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	17,100	158.51	2,710,521.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,800	94.07	1,674,446.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	17,900	99.80	1,786,420.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	38,400	43.45	1,668,480.00	
PEPSICO INC	138,100	108.12	14,931,372.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	56,700	44.10	2,500,470.00	
BUNGE LIMITED	13,800	75.37	1,040,106.00	
CAMPBELL SOUP CO	19,100	62.55	1,194,705.00	
CONAGRA BRANDS INC	40,000	39.93	1,597,200.00	
GENERAL MILLS	58,000	61.54	3,569,320.00	
HERSHEY CO/THE	13,700	107.65	1,474,805.00	
HORMEL FOODS CORP	27,300	37.24	1,016,652.00	
INGREDION INC	6,800	120.68	820,624.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	11,300	137.84	1,557,592.00	
KELLOGG CO	25,500	74.71	1,905,105.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	58,300	87.28	5,088,424.00	
MCCORMICK & CO INC.	11,300	96.44	1,089,772.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,800	87.60	1,559,280.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	149,000	43.20	6,436,800.00	
TYSON FOODS INC-CL A	28,900	64.90	1,875,610.00	
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	17,500	55.15	965,125.00	
ALTRIA GROUP INC	187,500	72.71	13,633,125.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	148,900	102.99	15,335,211.00	

REYNOLDS AMERICAN INC	81,900	60.71	4,972,149.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,100	48.93	1,179,213.00
CLOROX CO	12,400	130.10	1,613,240.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	81,100	69.00	5,595,900.00
KIMBERLY-CLARK CORP	34,400	126.62	4,355,728.00
PROCTER & GAMBLE CO	245,500	90.79	22,288,945.00
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,600	133.47	347,022.00
COTY INC-CL A	47,635	18.69	890,298.15
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,800	77.80	451,240.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,400	83.27	1,781,978.00
ABBOTT LABORATORIES	164,821	44.20	7,285,088.20
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,100	100.42	712,982.00
BARD (C R)	6,960	241.79	1,682,858.40
BAXTER INTERNATIONAL INC.	47,100	49.42	2,327,682.00
BECTON,DICKINSON	20,590	180.62	3,718,965.80
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131,400	25.36	3,332,304.00
DANAHER CORP	59,400	84.25	5,004,450.00
DENTSPLY SIRONA INC	22,000	60.74	1,336,280.00
DEXCOM INC	8,300	81.39	675,537.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,200	89.93	1,816,586.00
HOLOGIC INC	24,700	39.53	976,391.00
IDEXX LABORATORIES INC	8,600	141.95	1,220,770.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,710	721.47	2,676,653.70
MEDTRONIC PLC	133,600	77.99	10,419,464.00
RESMED INC	14,100	71.92	1,014,072.00
STRYKER CORP	32,200	125.75	4,049,150.00
TELEFLEX INC	4,330	178.05	770,956.50
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,700	190.51	895,397.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,700	81.93	712,791.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,000	116.32	2,210,080.00
AETNA INC	33,500	129.49	4,337,915.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,200	90.32	1,643,824.00
ANTHEM INC	25,100	163.77	4,110,627.00
CARDINAL HEALTH INC	31,000	80.24	2,487,440.00
CENTENE CORP	16,800	70.07	1,177,176.00

CIGNA CORP	24,500	145.33	3,560,585.00
DAVITA INC	15,700	64.66	1,015,162.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	11,600	69.26	803,416.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	60,200	69.23	4,167,646.00
HCA HOLDINGS INC	29,500	84.14	2,482,130.00
HENRY SCHEIN INC	8,060	167.25	1,348,035.00
HUMANA INC	14,220	208.74	2,968,282.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,800	139.13	1,363,474.00
MCKESSON CORP	21,800	149.42	3,257,356.00
MEDNAX INC	9,100	69.78	634,998.00
PATTERSON COS INC	8,700	43.79	380,973.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,300	95.30	1,267,490.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	91,420	163.65	14,960,883.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,600	122.13	1,050,318.00
ABBVIE INC	156,200	61.48	9,603,176.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,600	130.39	2,816,424.00
ALKERMES PLC	15,200	55.55	844,360.00
AMGEN INC	71,800	172.11	12,357,498.00
BIOGEN INC	20,980	290.13	6,086,927.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,800	90.53	1,520,904.00
CELGENE CORP	74,300	118.66	8,816,438.00
GILEAD SCIENCES INC	126,600	70.31	8,901,246.00
INCYTE CORP	16,000	120.18	1,922,880.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,390	373.02	2,756,617.80
SEATTLE GENETICS INC	9,700	65.30	633,410.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,340	168.42	730,942.80
VERTEX PHARMACEUTICALS	23,800	87.70	2,087,260.00
ALLERGAN PLC	37,950	246.93	9,370,993.50
BRISTOL MYERS SQUIBB	160,200	54.28	8,695,656.00
ELI LILLY & CO.	95,200	80.04	7,619,808.00
ENDO INTERNATIONAL PLC	20,500	13.30	272,650.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,600	136.41	763,896.00
JOHNSON & JOHNSON	262,800	118.08	31,031,424.00
MALLINCKRODT PLC	11,100	52.50	582,750.00
MERCK & CO INC	265,500	65.26	17,326,530.00

MYLAN NV	43,100	42.00	1,810,200.00
PERRIGO CO PLC	13,800	83.12	1,147,056.00
PFIZER INC	582,400	33.62	19,580,288.00
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	1,500	115.20	172,800.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	87,100	35.81	3,119,051.00
ZOETIS INC	45,800	52.78	2,417,324.00
BANK OF AMERICA CORP	980,000	24.58	24,088,400.00
BB&T CORPORATION	77,800	48.00	3,734,400.00
CIT GROUP INC	19,400	42.66	827,604.00
CITIGROUP	278,900	60.38	16,839,982.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,400	38.25	1,927,800.00
COMERICA INC	17,300	72.55	1,255,115.00
FIFTH THIRD BANCORP	73,700	27.60	2,034,120.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,500	95.76	1,388,520.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107,000	14.17	1,516,190.00
JPMORGAN CHASE & CO	347,000	90.53	31,413,910.00
KEYCORP	102,800	18.99	1,952,172.00
M & T BANK CORP	13,700	167.58	2,295,846.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	30,500	19.28	588,040.00
PNC FINANCIAL	47,000	126.96	5,967,120.00
REGIONS FINANCIAL CORP	121,000	15.59	1,886,390.00
SIGNATURE BANK	5,070	160.97	816,117.90
SUNTRUST BKS INC.	48,300	59.85	2,890,755.00
US BANCORP	164,100	55.01	9,027,141.00
WELLS FARGO CO	460,400	58.12	26,758,448.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	116,990	167.74	19,623,902.60
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,200	25.33	815,626.00
VOYA FINANCIAL INC	18,700	42.50	794,750.00
AFLAC INC	39,000	71.19	2,776,410.00
ALLEGHANY CORP	1,510	638.47	964,089.70
ALLSTATE CORP	36,200	80.80	2,924,960.00
AMERICAN INTL GROUP	102,600	62.27	6,388,902.00
AON PLC	25,700	117.28	3,014,096.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,100	94.04	1,137,884.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,600	56.47	937,402.00

ASSURANT INC	6,200	96.52	598,424.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,500	68.61	583,185.00
CHUBB LTD	44,500	135.73	6,039,985.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,500	73.09	1,132,895.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,010	235.51	944,395.10
FNF GROUP	24,400	37.51	915,244.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	37,500	48.60	1,822,500.00
LINCOLN NATIONAL CORP	22,300	72.66	1,620,318.00
LOEWS CORP	27,700	47.05	1,303,285.00
MARKEL CORP	1,340	959.53	1,285,770.20
MARSH & MCLENNAN COS	49,500	73.26	3,626,370.00
METLIFE INC	89,400	53.65	4,796,310.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	27,900	62.60	1,746,540.00
PROGRESSIVE CO	56,500	38.61	2,181,465.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	41,800	112.11	4,686,198.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,300	129.16	813,708.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,200	146.17	613,914.00
TORCHMARK CORP	11,200	77.42	867,104.00
TRAVELERS COS INC/THE	27,500	121.79	3,349,225.00
UNUM GROUP	22,500	49.10	1,104,750.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,600	126.40	1,592,640.00
WR BERKLEY CORP	9,900	70.76	700,524.00
XL GROUP LTD	26,400	40.64	1,072,896.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	16,600	64.24	1,066,384.00
ALPHABET INC-CL A	28,320	842.17	23,850,254.40
ALPHABET INC-CL C	29,700	824.16	24,477,552.00
COSTAR GROUP INC	3,210	208.53	669,381.30
EBAY INC	102,300	33.54	3,431,142.00
FACEBOOK INC-A	223,100	133.84	29,859,704.00
MERCADOLIBRE INC	3,910	198.01	774,219.10
TWITTER INC	53,900	16.35	881,265.00
VERISIGN INC	9,600	81.92	786,432.00
YAHOO! INC	86,300	45.16	3,897,308.00
ZILLOW GROUP INC - C	10,900	35.19	383,571.00
ACCENTURE PLC-CL A	59,600	120.72	7,194,912.00

ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,760	231.41	1,332,921.60
AUTOMATIC DATA PROCESS	43,600	99.88	4,354,768.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	11,400	68.62	782,268.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	58,700	58.10	3,410,470.00
COMPUTER SCIENCES CORP	13,800	70.84	977,592.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	30,300	81.72	2,476,116.00
FIRST DATA CORP- CLASS A	30,200	16.18	488,636.00
FISERV INC	21,400	111.25	2,380,750.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,850	166.54	1,473,879.00
GARTNER INC	8,100	103.43	837,783.00
GLOBAL PAYMENTS INC	14,600	77.67	1,133,982.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	87,160	181.43	15,813,438.80
MASTERCARD INC	93,000	109.30	10,164,900.00
PAYCHEX INC	31,500	59.49	1,873,935.00
PAYPAL HOLDINGS INC	103,800	42.15	4,375,170.00
SABRE CORP	20,000	21.30	426,000.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,300	53.95	879,385.00
VANTIV INC - CL A	14,800	64.54	955,192.00
VISA INC-CLASS A SHARES	181,100	87.41	15,829,951.00
WESTERN UNION CO	45,800	19.55	895,390.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,700	45.39	2,619,003.00
ADOBE SYSTEMS INC.	47,700	118.93	5,672,961.00
ANSYS INC	8,300	100.43	833,569.00
AUTODESK INC.	18,900	85.14	1,609,146.00
CA INC	30,900	31.89	985,401.00
CADENCE DESIGN SYS INC	29,100	30.24	879,984.00
CDK GLOBAL INC	12,800	65.01	832,128.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	12,100	101.00	1,222,100.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,900	79.94	1,191,106.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	21,701	65.12	1,413,169.12
ELECTRONIC ARTS	29,000	87.85	2,547,650.00
FORTINET INC	13,900	37.24	517,636.00
INTUIT INC	23,500	119.24	2,802,140.00
MICROSOFT CORP	711,300	64.52	45,893,076.00

MOBILEYE NV	17,000	44.97	764,490.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	25,000	16.86	421,500.00
ORACLE CORPORATION	296,700	41.59	12,339,753.00
RED HAT INC	17,800	81.53	1,451,234.00
SALESFORCE.COM INC	61,500	80.82	4,970,430.00
SERVICENOW INC	15,700	91.85	1,442,045.00
SPLUNK INC	12,800	62.86	804,608.00
SYMANTEC CORP	60,800	28.47	1,730,976.00
SYNOPSYS INC	14,900	70.66	1,052,834.00
VMWARE INC - CLASS A	7,400	90.95	673,030.00
WORKDAY INC-CLASS A	12,000	85.50	1,026,000.00
CISCO SYSTEMS	482,800	33.60	16,222,080.00
F5 NETWORKS INC	6,200	143.24	888,088.00
HARRIS CORP	11,900	108.65	1,292,935.00
JUNIPER NETWORKS INC	33,500	28.09	941,015.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,500	78.66	1,140,570.00
PALO ALTO NETWORKS INC	8,500	152.93	1,299,905.00
APPLE INC	517,800	135.34	70,081,641.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	158,800	24.33	3,863,604.00
HP INC	167,000	15.92	2,658,640.00
NETAPP INC	26,700	40.56	1,082,952.00
SEAGATE TECHNOLOGY	28,600	47.57	1,360,502.00
WESTERN DIGITAL CORP	27,800	75.95	2,111,410.00
XEROX CORP	84,000	7.40	621,600.00
AMPHENOL CORP-CL A	29,300	69.38	2,032,834.00
ARROW ELECTRS INC	8,900	73.06	650,234.00
AVNET	12,200	46.29	564,738.00
CDW CORPORATION	14,000	58.83	823,620.00
CORNING INC	101,000	27.71	2,798,710.00
FLEX LTD	55,000	16.47	905,850.00
FLIR SYSTEMS INC	12,700	36.40	462,280.00
TE CONNECTIVITY LTD	34,300	75.23	2,580,389.00
TRIMBLE INC	23,200	30.86	715,952.00
ANALOG DEVICES INC	29,200	81.97	2,393,524.00
APPLIED MATERIALS	103,200	35.18	3,630,576.00

BROADCOM LTD	37,900	208.18	7,890,022.00
INTEL CORP	453,300	36.41	16,504,653.00
KLA TENCOR CORP	15,000	88.53	1,327,950.00
LAM RESEARCH	15,400	114.57	1,764,378.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	22,700	64.80	1,470,960.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	41,000	15.79	647,390.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,000	45.03	1,215,810.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	20,600	71.71	1,477,226.00
MICRON TECHNOLOGY	100,900	22.98	2,318,682.00
NVIDIA CORP	51,200	107.25	5,491,200.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,000	102.49	2,869,720.00
QORVO INC	12,700	67.15	852,805.00
QUALCOMM INC	141,300	56.88	8,037,144.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,100	92.43	1,672,983.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	96,100	76.25	7,327,625.00
XILINX INC	25,000	59.61	1,490,250.00
AT & T INC	590,900	41.25	24,374,625.00
CENTURYLINK INC	52,200	24.28	1,267,416.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	114,000	3.29	375,060.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	30,100	57.33	1,725,633.00
VERIZON COMMUNICATIONS	391,500	48.46	18,972,090.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,500	30.99	480,345.00
SPRINT CORP	75,000	9.00	675,000.00
T-MOBILE US INC	28,300	60.61	1,715,263.00
ALLIANT ENERGY CORP	22,900	37.93	868,597.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	46,900	63.70	2,987,530.00
DUKE ENERGY CORP	65,900	78.90	5,199,510.00
EDISON INTERNATIONAL	31,700	75.79	2,402,543.00
ENTERGY CORP	17,100	72.77	1,244,367.00
EVERSOURCE ENERGY	30,700	56.29	1,728,103.00
EXELON CORPORATION	88,100	35.42	3,120,502.00
FIRSTENERGY CORP	41,800	30.62	1,279,916.00
NEXTERA ENERGY INC	44,200	126.19	5,577,598.00
OGE ENERGY CORP	19,600	34.62	678,552.00
PG&E CORP	48,100	63.39	3,049,059.00

PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,100	78.55	871,905.00	
PPL CORPORATION	64,500	35.72	2,303,940.00	
SOUTHERN CO.	94,800	48.24	4,573,152.00	
WESTAR ENERGY INC	13,400	52.76	706,984.00	
XCEL ENERGY INC	49,400	41.89	2,069,366.00	
ATMOS ENERGY CORP	10,500	75.90	796,950.00	
UGI CORP	16,300	47.50	774,250.00	
AMEREN CORPORATION	22,900	52.94	1,212,326.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	38,400	26.37	1,012,608.00	
CMS ENERGY CORP	27,300	43.09	1,176,357.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,300	74.29	2,176,697.00	
DOMINION RESOURCES INC/VA	60,100	73.28	4,404,128.00	
DTE ENERGY COMPANY	17,000	98.67	1,677,390.00	
NISOURCE INC	30,300	22.67	686,901.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	48,700	43.66	2,126,242.00	
SCANA CORP	12,900	67.32	868,428.00	
SEMPRA ENERGY	22,900	105.90	2,425,110.00	
WEC ENERGY GROUP INC	30,600	57.48	1,758,888.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,800	73.44	1,233,792.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	47,100	15.30	720,630.00	
ALLY FINANCIAL INC	42,100	23.22	977,562.00	
AMERICAN EXPRESS CO	75,200	79.51	5,979,152.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	48,400	90.51	4,380,684.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,500	70.84	2,727,340.00	
NAVIENT CORP	29,900	15.49	463,151.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	80,500	36.85	2,966,425.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,200	167.90	873,080.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,700	129.16	2,027,812.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	102,100	47.07	4,805,847.00	
BLACKROCK INC	11,660	391.97	4,570,370.20	
CME GROUP INC	32,400	121.83	3,947,292.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	25,600	37.17	951,552.00	
EATON VANCE CORP	11,700	43.38	507,546.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	35,900	42.29	1,518,211.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	34,980	249.44	8,725,411.20	

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	56,900	58.65	3,337,185.00	
INVESCO LTD	39,600	32.55	1,288,980.00	
MOODYS CORP	16,800	110.22	1,851,696.00	
MORGAN STANLEY	137,300	46.11	6,330,903.00	
MSCI INC	8,500	94.20	800,700.00	
NASDAQ INC	11,100	71.34	791,874.00	
NORTHERN TRUST CORP	20,700	87.34	1,807,938.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,100	79.07	956,747.00	
S&P GLOBAL INC	25,500	128.61	3,279,555.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	113,900	41.55	4,732,545.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,700	50.30	638,810.00	
STATE STREET CORP	37,200	80.76	3,004,272.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,900	71.32	1,704,548.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,300	43.27	1,094,731.00	
H & R BLOCK INC	22,400	20.56	460,544.00	
AES CORP	65,000	11.65	757,250.00	
CALPINE CORP	34,700	11.56	401,132.00	
CERNER CORP	28,700	55.61	1,596,007.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	31,200	50.84	1,586,208.00	
ILLUMINA INC	14,200	161.30	2,290,460.00	
METTLER-TOLEDO INTL	2,620	466.28	1,221,653.60	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	14,200	76.87	1,091,554.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,700	157.71	5,945,667.00	
WATERS CORP	8,000	153.00	1,224,000.00	
DUN & BRADSTREET CORP	3,600	106.91	384,876.00	
EQUIFAX INC	11,700	129.93	1,520,181.00	
IHS MARKIT LTD	35,373	40.00	1,414,920.00	
MANPOWERGROUP INC	7,000	96.09	672,630.00	
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,200	44.85	1,533,870.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	13,300	48.07	639,331.00	
VERISK ANALYTICS INC	15,900	84.27	1,339,893.00	
CBRE GROUP INC	29,600	35.02	1,036,592.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,000	6.91	787,740.00	
JONES LANG LASALLE INC	4,700	115.24	541,628.00	
小計	銘柄数：600		1,992,067,736.11	

				(226,039,926,016)	
	組入時価比率：63.1%			66.1%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	16,600	31.21	518,086.00	
	ARC RESOURCES LTD	32,900	21.26	699,454.00	
	CAMECO CORP	38,600	15.50	598,300.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	105,200	39.69	4,175,388.00	
	CENOVUS ENERGY INC	78,500	18.12	1,422,420.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	53,700	15.07	809,259.00	
	ENBRIDGE INC	89,300	55.43	4,949,899.00	
	ENCANA CORP	95,000	16.29	1,547,550.00	
	HUSKY ENERGY INC	35,745	16.30	582,643.50	
	IMPERIAL OIL	28,500	42.94	1,223,790.00	
	INTER PIPELINE LTD	33,100	29.07	962,217.00	
	KEYERA CORP	17,800	41.20	733,360.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,400	42.68	1,596,232.00	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	17,200	28.63	492,436.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	20,726	30.12	624,267.12	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,600	26.26	593,476.00	
	SUNCOR ENERGY INC	159,300	42.49	6,768,657.00	
	TOURMALINE OIL CORP	21,600	31.27	675,432.00	
	TRANSCANADA CORP	81,700	62.22	5,083,374.00	
	VERESEN INC	29,000	14.00	406,000.00	
	VERMILION ENERGY INC	12,000	51.94	623,280.00	
	AGRIUM INC	12,400	136.06	1,687,144.00	
	METHANEX CORP	8,200	64.30	527,260.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	81,200	24.47	1,986,964.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,660	268.44	714,050.40	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,600	61.66	1,331,856.00	
BARRICK GOLD	112,000	26.81	3,002,720.00		
ELDORADO GOLD CORPORATION	70,800	4.97	351,876.00		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,000	15.87	1,031,550.00		
FRANCO-NEVADA CORP	16,900	89.46	1,511,874.00		
GOLDCORP INC	82,900	23.11	1,915,819.00		
KINROSS GOLD CORP	118,600	5.14	609,604.00		
SILVER WHEATON CORP	41,600	28.54	1,187,264.00		

TECK RESOURCES LTD	54,900	27.78	1,525,122.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	98,000	4.66	456,680.00
YAMANA GOLD INC	97,000	4.49	435,530.00
WEST FRASER TIMBER	6,800	52.40	356,320.00
BOMBARDIER B SHEARS	189,000	2.50	472,500.00
CAE INC	26,000	20.43	531,180.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,500	57.13	828,385.00
FINNING INTERNATIONAL INC	15,200	26.65	405,080.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	74,100	93.63	6,937,983.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,600	197.51	2,686,136.00
LINAMAR CORP	4,800	61.12	293,376.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	37,700	59.05	2,226,185.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,800	32.48	675,584.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,300	70.44	1,500,372.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	40,400	28.02	1,132,008.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	6,400	154.51	988,864.00
DOLLARAMA INC	10,700	102.08	1,092,256.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	40,400	61.95	2,502,780.00
EMPIRE CO LTD A	16,200	17.09	276,858.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	20.32	191,008.00
LOBLAW COMPANIES	21,000	68.45	1,437,450.00
METRO INC	23,200	40.17	931,944.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,800	110.76	531,648.00
SAPUTO INC	23,900	45.66	1,091,274.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	31,300	21.19	663,247.00
BANK OF MONTREAL	61,700	101.48	6,261,316.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	115,200	81.99	9,445,248.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	38,200	116.50	4,450,300.00
NATIONAL BANK OF CANADA	33,400	58.46	1,952,564.00
ROYAL BANK OF CANADA	142,400	98.68	14,052,032.00
TORONTO DOMINION BANK	177,800	69.27	12,316,206.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	36,000	14.08	506,880.00
ONEX CORPORATION	8,000	95.25	762,000.00

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,190	630.95	1,381,780.50	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	30,000	37.47	1,124,100.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,900	58.44	578,556.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,600	97.02	1,222,452.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	188,400	24.91	4,693,044.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	34,800	32.18	1,119,864.00	
	POWER FINANCIAL CORP	24,300	35.59	864,837.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	59,100	49.94	2,951,454.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	21,400	63.73	1,363,822.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,780	612.00	1,089,360.00	
	OPEN TEXT CORP	24,200	44.43	1,075,206.00	
	BLACKBERRY LTD	50,900	9.62	489,658.00	
	BCE INC	13,800	58.60	808,680.00	
	TELUS CORP	19,300	43.37	837,041.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	34,700	57.09	1,981,023.00	
	EMERA INC	4,900	45.41	222,509.00	
	FORTIS INC	38,400	42.91	1,647,744.00	
	HYDRO ONE LTD	17,300	23.83	412,259.00	
	ATCO LTD CL1	6,800	45.42	308,856.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	12,400	36.38	451,112.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	83,300	48.55	4,044,215.00	
	CI FINANCIAL CORP	24,200	28.05	678,810.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	41.80	430,540.00	
	THOMSON REUTERS CORP	32,400	58.72	1,902,528.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,300	20.35	229,955.00	
小計	銘柄数：91			162,769,223.52	
				(14,121,857,832)	
	組入時価比率：3.9%			4.1%	
ユーロ	SAIPEM SPA	589,700	0.47	278,279.43	
	TENARIS SA	46,000	15.94	733,240.00	
	ENI SPA	243,000	14.40	3,499,200.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	47,000	13.71	644,370.00	
	NESTE OYJ	12,500	34.52	431,500.00	
	OMV AG	13,800	34.47	475,686.00	
	REPSOL SA	108,781	13.89	1,511,511.99	

SNAM SPA	233,000	3.80	885,866.00
TOTAL SA	216,100	47.82	10,333,902.00
VOPAK	7,100	41.79	296,709.00
AIR LIQUIDE	37,600	104.90	3,944,240.00
AKZO NOBEL	23,700	62.80	1,488,360.00
ARKEMA	6,700	94.90	635,830.00
BASF SE	88,000	89.39	7,866,320.00
COVESTRO AG	6,800	72.48	492,864.00
EVONIK INDUSTRIES AG	16,900	30.63	517,647.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	43.60	279,040.00
K+S AG	18,800	23.14	435,126.00
KONINKLIJKE DSM NV	17,000	60.71	1,032,070.00
LANXESS	8,500	67.55	574,175.00
LINDE AG	17,710	151.55	2,683,950.50
SOLVAY SA	7,300	113.90	831,470.00
SYMRISE AG	12,100	56.71	686,191.00
UMICORE	9,400	49.67	466,898.00
CRH PLC	82,300	32.37	2,664,051.00
HEIDELBERGCEMENT AG	14,300	85.66	1,224,938.00
IMERYS	3,800	76.74	291,612.00
ARCELORMITTAL	178,000	8.63	1,536,674.00
THYSSENKRUPP AG	36,300	23.14	840,163.50
VOESTALPINE AG	11,000	40.76	448,415.00
STORA ENSO OYJ-R	54,000	10.29	555,660.00
UPM-KYMMENE OYJ	50,300	22.72	1,142,816.00
AIRBUS SE	55,400	65.77	3,643,658.00
DASSAULT AVIATION SA	200	1,083.05	216,610.00
LEONARDO SPA	41,000	11.92	488,720.00
SAFRAN SA	30,400	64.90	1,972,960.00
THALES SA	10,500	88.05	924,525.00
ZODIAC AEROSPACE	19,500	26.63	519,285.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	48,100	45.98	2,211,638.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,012	29.82	567,032.90
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	9,300	35.19	327,313.50
BOUYGUES	20,100	35.41	711,741.00

EIFFAGE SA	6,100	68.81	419,741.00
FERROVIAL SA	46,466	17.14	796,427.24
HOCHTIEF AG	2,000	141.35	282,700.00
VINCI	48,900	68.90	3,369,210.00
LEGRAND SA	25,300	55.38	1,401,114.00
OSRAM LICHT AG	8,850	56.73	502,060.50
PRYSMIAN SPA	19,400	24.14	468,316.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	54,400	66.00	3,590,400.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	91,600	27.66	2,534,114.00
SIEMENS AG	73,400	121.65	8,929,110.00
ALSTOM	15,500	26.40	409,200.00
ANDRITZ AG	7,200	51.36	369,792.00
CNH INDUSTRIAL NV	99,000	8.83	874,665.00
GEA GROUP AG	17,000	39.26	667,420.00
KONE OYJ	32,300	41.64	1,344,972.00
MAN SE	3,700	97.14	359,418.00
METSO OYJ	10,300	29.04	299,112.00
WARTSILA OYJ	14,700	49.63	729,561.00
ZARDOYA OTIS S.A	17,546	7.82	137,209.72
BRENTAG AG	15,190	54.50	827,855.00
REXEL SA	28,600	16.32	466,895.00
EDENRED	21,400	20.79	445,013.00
SOCIETE BIC SA	2,810	118.60	333,266.00
BOLLORE	87,000	3.69	321,552.00
DEUTSCHE POST AG-REG	92,600	31.98	2,961,811.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,600	13.34	301,597.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	80,000	5.93	475,120.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	63,010	13.84	872,058.40
ADP	2,800	106.85	299,180.00
AENA SA	6,500	135.00	877,500.00
ATLANTIA SPA	38,700	22.11	855,657.00
FRAPORT AG	3,800	59.51	226,138.00
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	45,000	9.06	407,700.00
CONTINENTAL AG	10,450	190.50	1,990,725.00
MICHELIN (CGDE)	17,500	105.90	1,853,250.00

NOKIAN RENKAAT OYJ	11,300	36.38	411,094.00
SCHAEFFLER AG	16,000	14.87	238,000.00
VALEO SA	22,800	59.00	1,345,200.00
BAYER MOTOREN WERK	31,600	85.45	2,700,220.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	5,300	69.61	368,933.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	92,200	67.79	6,250,238.00
FERRARI NV	11,600	62.25	722,100.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,000	10.78	959,420.00
PEUGEOT CITROEN	47,300	18.49	874,577.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	15,200	54.37	826,424.00
RENAULT SA	18,600	88.16	1,639,776.00
VOLKSWAGEN AG	3,250	147.55	479,537.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	17,900	143.60	2,570,440.00
SEB SA	2,000	123.45	246,900.00
ADIDAS AG	17,900	147.60	2,642,040.00
CHRISTIAN DIOR SE	5,380	200.10	1,076,538.00
HERMES INTERNATIONAL	2,480	407.25	1,009,980.00
HUGO BOSS AG	6,300	64.18	404,334.00
KERING SA	7,180	228.95	1,643,861.00
LUXOTTICA GROUP SPA	16,500	49.34	814,110.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	26,720	189.70	5,068,784.00
ACCOR SA	16,400	38.53	631,892.00
PADDY POWER PLC	8,400	98.60	828,240.00
SODEXO	8,900	103.65	922,485.00
ALTICE NV - A	36,830	20.60	758,698.00
ALTICE NV - B	10,010	20.61	206,356.15
AXEL SPRINGER SE	4,400	48.04	211,398.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,300	17.10	278,730.00
JC DECAUX SA	6,800	30.06	204,408.00
LAGARDERE S.C.A	11,600	23.97	278,110.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	22,300	39.06	871,038.00
PUBLICIS GROUPE	18,100	63.21	1,144,101.00
RTL GROUP	3,900	72.97	284,583.00
SES FDR	34,400	19.57	673,380.00
TELENET GROUP HOLDING NV	5,200	53.00	275,600.00

VIVENDI SA	100,000	16.98	1,698,000.00
ZALANDO SE	8,100	37.57	304,357.50
INDITEX SA	104,900	31.17	3,270,257.50
CARREFOUR SUPERMARCHE	53,500	22.74	1,216,590.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	51.81	305,679.00
COLRUYT SA	6,000	45.39	272,370.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	56,000	4.97	278,376.00
JERONIMO MARTINS	23,000	16.07	369,610.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	123,200	20.35	2,507,120.00
METRO AG	18,200	29.93	544,726.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	73,000	101.65	7,420,450.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	21,900	33.20	727,080.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,700	69.75	676,575.00
HEINEKEN NV	22,300	76.05	1,695,915.00
PERNOD RICARD SA	20,700	108.05	2,236,635.00
REMY COINTREAU	2,300	85.32	196,236.00
DANONE	56,400	59.15	3,336,060.00
KERRY GROUP PLC-A	15,800	68.60	1,083,880.00
HENKEL AG & CO KGAA	9,900	101.75	1,007,325.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,300	117.50	2,032,750.00
BEIERSDORF AG	10,000	83.69	836,900.00
LOREAL-ORD	24,090	171.85	4,139,866.50
UNILEVER NV-CVA	156,000	39.57	6,172,920.00
ESSILOR INTERNATIONAL	19,700	108.55	2,138,435.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	20,800	76.64	1,594,112.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	39,600	75.27	2,980,692.00
GRIFOLS SA	28,800	20.92	602,496.00
BAYER AG-REG	79,300	105.95	8,401,835.00
MERCK KGAA	12,500	101.50	1,268,750.00
ORION OYJ	9,500	47.07	447,165.00
SANOFI	111,200	81.63	9,077,256.00
UCB SA	12,100	68.11	824,131.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	27,900	22.50	627,889.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	629,000	6.31	3,971,506.00
BANCO DE SABADELL SA	499,574	1.48	739,869.09

BANCO SANTANDER SA	1,399,000	5.20	7,284,593.00
BANK OF IRELAND	2,850,000	0.24	686,850.00
BANKIA SA	430,000	0.95	412,370.00
BANKINTER S.A.	65,000	7.37	479,180.00
BCO POPULAR ESPANOL	300,260	0.83	251,317.62
BNP PARIBAS	101,500	57.02	5,787,530.00
CAIXABANK	345,000	3.41	1,177,140.00
COMMERZBANK AG	102,000	7.49	764,082.00
CREDIT AGRICOLE SA	108,000	12.14	1,311,660.00
ERSTE GROUP BANK AG	28,900	29.77	860,353.00
ING GROEP NV	371,000	13.67	5,071,570.00
INTESA SANPAOLO	1,211,000	2.19	2,659,356.00
INTESA SANPAOLO-RSP	92,000	2.09	192,832.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	24,000	58.50	1,404,000.00
MEDIOBANCA S.P.A.	53,000	8.12	430,360.00
NATIXIS	87,000	5.60	487,287.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	22.30	245,355.00
SOCIETE GENERALE	74,200	43.52	3,229,184.00
UNICREDIT SPA	181,317	12.63	2,290,033.71
EURAZEO	4,069	59.25	241,088.25
EXOR NV	10,400	45.60	474,240.00
GROUPE BRUXELLES LAM	7,800	80.00	624,000.00
WENDEL	2,900	108.65	315,085.00
AEGON NV	180,000	5.26	947,700.00
AGEAS	19,000	37.36	709,935.00
ALLIANZ SE-REG	43,790	158.35	6,934,146.50
ASSICURAZIONI GENERALI	112,000	14.78	1,655,360.00
AXA	185,500	22.87	4,242,385.00
CNP ASSURANCES	16,500	18.11	298,897.50
HANNOVER RUECK SE	5,600	107.10	599,760.00
MAPFRE SA	98,000	2.93	287,728.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,550	177.70	2,763,235.00
NN GROUP NV	30,000	29.82	894,600.00
POSTE ITALIANE SPA	50,000	6.01	300,500.00

SAMPO OYJ-A SHS	43,000	43.26	1,860,180.00
SCOR SE	15,400	32.54	501,116.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	1.99	213,786.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,200	37.98	425,432.00
AMADEUS IT GROUP SA	42,600	42.93	1,829,031.00
ATOS SE	8,600	105.90	910,740.00
CAP GEMINI SA	15,800	81.49	1,287,542.00
DASSAULT SYSTEMES SA	12,800	76.69	981,632.00
GEMALTO	7,600	54.93	417,468.00
SAP SE	94,200	86.93	8,188,806.00
NOKIA OYJ	568,000	4.71	2,677,552.00
INGENICO GROUP	5,500	81.03	445,665.00
ASML HOLDING NV	35,200	119.20	4,195,840.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	108,900	17.25	1,879,069.50
STMICROELECTRONICS NV	60,000	13.34	800,700.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	313,300	15.93	4,992,435.50
ELISA OYJ	12,900	31.30	403,770.00
ILIAD SA	2,710	196.80	533,328.00
KONINKLIJKE KPN NV	320,000	2.62	840,320.00
ORANGE SA	190,000	14.65	2,784,450.00
PROXIMUS	15,100	27.51	415,401.00
SFR GROUP SA	7,700	26.48	203,896.00
TELECOM ITALIA SPA	990,000	0.79	783,585.00
TELECOM ITALIA-RNC	570,000	0.65	370,500.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	74,600	3.93	293,774.80
TELEFONICA SA	445,000	9.32	4,149,625.00
ELECTRICITE DE FRANCE	22,800	9.15	208,779.60
ENDESA S.A.	31,700	19.97	633,049.00
ENEL SPA	728,000	4.01	2,925,104.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	235,000	2.85	670,925.00
FORTUM OYJ	44,000	14.32	630,080.00
IBERDROLA SA	540,201	6.06	3,273,618.06
RED ELECTRICA CORPORACION SA	43,200	17.25	745,200.00
TERNA SPA	152,000	4.35	661,504.00
ENAGAS	22,800	23.42	534,090.00

	GAS NATURAL SDG	32,800	18.06	592,532.00	
	E.ON SE	189,000	7.13	1,347,948.00	
	ENGIE	152,000	11.19	1,701,640.00	
	INNOGY SE	12,700	33.81	429,450.50	
	RWE AG	49,600	13.25	657,448.00	
	SUEZ	33,300	14.74	490,842.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	46,100	16.17	745,667.50	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	133,000	18.51	2,462,495.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	18,900	83.44	1,577,016.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,030	418.35	430,900.50	
	QIAGEN NV	21,474	26.95	578,724.30	
	BUREAU VERITAS SA	25,500	18.81	479,655.00	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,600	56.39	654,124.00	
	RELX NV	95,400	16.38	1,562,652.00	
	WOLTERS KLUWER	29,900	37.21	1,112,728.50	
	DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	32,900	31.86	1,048,358.50	
	IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00	
	VONOVIA SE	44,600	32.86	1,465,779.00	
小計	銘柄数：235			343,497,128.26	
				(41,563,152,519)	
	組入時価比率：11.6%			12.1%	
英ポンド	PETROFAC LTD	26,000	8.74	227,240.00	
	BP PLC	1,802,000	4.48	8,080,168.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	415,000	21.23	8,810,450.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	359,300	22.25	7,996,221.50	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	12,000	33.81	405,720.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,150	30.72	588,288.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	136,400	13.69	1,867,998.00	
	ANTOFAGASTA PLC	41,000	8.48	347,885.00	
	BHP BILLITON PLC	201,500	14.14	2,849,210.00	
	FRESNILLO PLC	20,900	15.04	314,336.00	
	GLENCORE PLC	1,169,000	3.24	3,793,405.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	8,800	73.45	646,360.00	
	RIO TINTO PLC-REG	118,300	36.47	4,314,401.00	
	MONDI PLC	37,000	18.40	680,800.00	
		306,000	6.03	1,846,710.00	

BAE SYSTEMS PLC			
COBHAM PLC	169,500	1.14	194,416.50
MEGGITT PLC	78,000	4.24	330,720.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	183,000	6.93	1,269,105.00
DCC PLC	8,600	68.00	584,800.00
SMITHS GROUP PLC	37,100	15.27	566,517.00
IMI PLC	25,900	12.29	318,311.00
WEIR GROUP PLC	22,000	20.14	443,080.00
ASHTED GROUP PLC	47,600	17.12	814,912.00
BUNZLE	33,100	21.42	709,002.00
TRAVIS PERKINS PLC	24,700	15.03	371,241.00
WOLSELEY PLC	24,200	50.25	1,216,050.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	8.98	232,711.50
G4S PLC	152,000	2.59	394,592.00
ROYAL MAIL PLC	88,000	4.10	360,800.00
EASYJET PLC	16,300	9.51	155,094.50
GKN PLC	169,000	3.47	586,599.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	98,000	5.17	506,660.00
PERSIMMON PLC	29,500	20.12	593,540.00
TAYLOR WIMPEY PLC	319,000	1.76	564,311.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	12,400	29.26	362,824.00
BURBERRY GROUP PLC	41,900	16.44	688,836.00
CARNIVAL PLC	18,700	43.26	808,962.00
COMPASS GROUP PLC	156,600	14.48	2,267,568.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	18,183	38.73	704,227.59
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	69,000	4.89	337,548.00
TUI AG-DI	49,000	11.21	549,290.00
WHITBREAD PLC	17,300	39.47	682,831.00
WILLIAM HILL PLC	85,000	2.63	223,550.00
ITV PLC	353,000	2.08	734,593.00
PEARSON	78,000	6.60	514,800.00
SKY PLC	99,000	9.98	988,020.00
WPP PLC	123,400	18.90	2,332,260.00
MARKS & SPENCER PLC	153,000	3.30	504,900.00
NEXT PLC	14,000	38.52	539,280.00

DIXONS CARPHONE PLC	92,000	3.02	278,484.00	
KINGFISHER PLC	214,000	3.28	703,418.00	
MORRISON SUPERMARKETS	213,000	2.49	531,009.00	
SAINSBURY	150,000	2.67	400,950.00	
TESCO PLC	787,000	1.96	1,548,816.00	
COCA-COLA HBC AG-CDI	16,700	19.12	319,304.00	
DIAGEO PLC	241,200	22.57	5,443,884.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,000	25.68	873,120.00	
TATE & LYLE ORD.	48,000	7.29	349,920.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	178,800	49.76	8,897,982.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	91,600	36.65	3,357,140.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,500	69.01	4,175,105.00	
UNILEVER PLC	122,800	33.47	4,110,730.00	
SMITH & NEPHEW PLC	84,000	12.07	1,013,880.00	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	8.27	310,312.50	
SHIRE PLC	86,100	47.63	4,100,943.00	
ASTRAZENECA PLC	121,100	45.24	5,479,169.50	
GLAXOSMITHKLINE PLC	467,400	16.17	7,557,858.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,900	20.15	280,085.00	
BARCLAYS PLC	1,618,000	2.38	3,850,840.00	
HSBC HOLDINGS PLC	1,909,000	7.04	13,454,632.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,150,000	0.67	4,135,875.00	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	341,000	2.43	830,335.00	
STANDARD CHARTERED PLC	320,000	8.08	2,586,240.00	
ADMIRAL GROUP PLC	21,900	18.67	408,873.00	
AVIVA PLC	395,000	5.03	1,986,850.00	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	136,083	3.57	485,816.31	
LEGAL & GENERAL	577,000	2.45	1,417,112.00	
OLD MUTUAL PLC	488,000	2.17	1,061,400.00	
PRUDENTIAL PLC	246,700	16.29	4,019,976.50	
RSA INSURANCE GROUP PLC	98,750	5.88	580,650.00	
ST JAMES S PLACE PLC	49,000	10.95	536,550.00	
STANDARD LIFE PLC	187,000	3.67	687,412.00	
AUTO TRADER GROUP PLC	95,000	4.01	381,805.00	
WORLDPAY GROUP PLC	166,000	2.70	448,200.00	

	SAGE GROUP PLC (THE)	105,000	6.35	667,275.00	
	BT GROUP PLC	816,000	3.12	2,550,000.00	
	INMARSAT PLC	42,500	6.50	276,462.50	
	VODAFONE GROUP PLC	2,548,000	1.98	5,052,684.00	
	SSE PLC	95,600	15.31	1,463,636.00	
	CENTRICA PLC	524,000	2.35	1,231,400.00	
	NATIONAL GRID PLC	360,000	9.58	3,448,800.00	
	SEVERN TRENT PLC	23,700	23.01	545,337.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,000	9.46	634,155.00	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	14,300	27.71	396,253.00	
	3I GROUP PLC	97,000	7.20	698,400.00	
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	94,000	2.63	247,502.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,000	13.62	340,500.00	
	INVESTEC PLC	61,000	5.92	361,120.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	30,000	31.19	935,700.00	
	SCHRODERS PLC	13,300	30.45	404,985.00	
	CAPITA PLC	64,000	5.16	330,240.00	
	EXPERIAN PLC	90,900	15.97	1,451,673.00	
	INTERTEK GROUP PLC	16,300	35.20	573,760.00	
	RELX PLC	105,800	14.71	1,556,318.00	
小計	銘柄数：104			174,992,021.90	
				(24,805,119,104)	
	組入時価比率：6.9%			7.2%	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	830	572.00	474,760.00	
	GIVAUDAN-REG	886	1,784.00	1,580,624.00	
	SIKA AG-BR	204	5,395.00	1,100,580.00	
	SYNGENTA AG-REG	8,950	428.50	3,835,075.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	43,900	56.40	2,475,960.00	
	GEBERIT AG-REG	3,580	427.40	1,530,092.00	
	ABB LTD	179,900	22.94	4,126,906.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	190.50	367,665.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,870	193.10	747,297.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,250	138.60	727,650.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	49,800	76.30	3,799,740.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,930	339.70	995,321.00	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	66.35	305,210.00	
	DUFREY AG-REG	4,500	144.80	651,600.00	
	ARYZTA AG	8,500	32.44	275,740.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	230	1,282.00	294,860.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	5,490.00	570,960.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	10	64,395.00	643,950.00	
	NESTLE SA-REG	298,900	72.45	21,655,305.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,000	126.10	630,500.00	
	ACTELION LTD	9,390	268.70	2,523,093.00	
	GALENICA AG-REG	360	1,106.00	398,160.00	
	NOVARTIS-REG	214,400	76.20	16,337,280.00	
	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	67,440	242.80	16,374,432.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	3,200	65.65	210,080.00	
	BALOISE HOLDING AG	5,000	130.40	652,000.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,180	314.10	998,838.00	
	SWISS RE LTD	30,900	93.10	2,876,790.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,390	279.40	4,020,566.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,560	447.00	1,144,320.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	189,000	15.16	2,865,240.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,000	48.80	1,073,600.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,690	527.50	891,475.00	
	UBS GROUP AG	350,200	15.94	5,582,188.00	
	LONZA AG-REG	5,710	179.60	1,025,516.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	15,300	71.35	1,091,655.00	
	SGS SA-REG	515	2,126.00	1,094,890.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,800	85.00	578,000.00	
小計	銘柄数：38			106,527,918.00	
				(12,112,224,276)	
	組入時価比率：3.4%			3.5%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	17,100	195.40	3,341,340.00	
	BOLIDEN AB	26,300	282.50	7,429,750.00	
	ASSA ABLOY AB-B	96,300	172.90	16,650,270.00	
	SKANSKA AB-B SHS	31,700	216.50	6,863,050.00	
	ALFA LAVAL AB	27,700	165.10	4,573,270.00	
	ATLAS COPCO AB-A	64,600	293.80	18,979,480.00	

	ATLAS COPCO AB-B	38,200	264.60	10,107,720.00	
	SANDVIK AB	103,000	122.00	12,566,000.00	
	SKF AB-B SHARES	38,800	168.40	6,533,920.00	
	VOLVO AB-B SHS	149,000	119.20	17,760,800.00	
	SECURITAS AB-B SHS	29,000	131.80	3,822,200.00	
	ELECTROLUX AB-B	23,300	234.50	5,463,850.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	75.50	2,869,000.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	91,700	243.40	22,319,780.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,800	289.40	2,257,320.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,900	283.30	5,354,370.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	57,600	269.90	15,546,240.00	
	GETINGE AB-B SHS	19,100	145.80	2,784,780.00	
	NORDEA BANK AB	290,000	108.70	31,523,000.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	144,000	104.60	15,062,400.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	148,000	132.00	19,536,000.00	
	SWEDBANK AB	88,100	231.10	20,359,910.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,800	177.10	2,975,280.00	
	INVESTOR AB-B SHS	44,100	359.70	15,862,770.00	
	KINNEVIK AB - B	23,600	238.20	5,621,520.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,400	582.00	1,978,800.00	
	ERICSSON LM-B	297,000	54.30	16,127,100.00	
	HEXAGON AB-B SHS	24,200	370.30	8,961,260.00	
	TELIA CO AB	247,000	35.40	8,743,800.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6,800	490.40	3,334,720.00	
	TELE 2 AB-B SHS	34,000	79.15	2,691,100.00	
小計	銘柄数：31			318,000,800.00	
				(4,070,410,240)	
	組入時価比率：1.1%				1.2%
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	106,600	148.30	15,808,780.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,800	329.20	5,530,560.00	
	NORSK HYDRO	130,000	48.95	6,363,500.00	
	SCHIBSTED ASA	7,800	217.90	1,699,620.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,100	200.00	1,820,000.00	
	MARINE HARVEST ASA	35,900	144.00	5,169,600.00	

	ORKLA ASA	80,000	74.25	5,940,000.00	
	DNB ASA	94,000	142.80	13,423,200.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,700	133.00	2,620,100.00	
	TELENOR ASA	71,900	132.60	9,533,940.00	
小計	銘柄数：10			67,909,300.00	
				(928,999,224)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,100	424.70	3,864,770.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,500	277.20	6,237,000.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	21,200	519.50	11,013,400.00	
	ISS A/S	16,100	253.10	4,074,910.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	375	11,650.00	4,368,750.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	620	12,240.00	7,588,800.00	
	DSV A/S	17,700	347.10	6,143,670.00	
	PANDORA A/S	10,500	835.50	8,772,750.00	
	CARLSBERG B	10,500	612.50	6,431,250.00	
	COLOPLAST-B	11,700	495.70	5,799,690.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	132.60	1,723,800.00	
	GENMAB A/S	5,490	1,433.00	7,867,170.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	183,200	246.40	45,140,480.00	
	DANSKE BANK AS	66,900	241.90	16,183,110.00	
	TRYG A/S	11,800	132.40	1,562,320.00	
	TDC A/S	76,800	37.65	2,891,520.00	
DONG ENERGY A/S	14,100	259.50	3,658,950.00		
小計	銘柄数：17			143,322,340.00	
				(2,333,287,695)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	25,500	29.62	755,310.00	
	OIL SEARCH LTD	129,000	7.05	909,450.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	175,000	7.09	1,240,750.00	
	SANTOS LTD.	176,000	3.97	698,720.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	73,500	31.74	2,332,890.00	
	INCITEC PIVOT LTD	161,000	3.87	623,070.00	
	ORICA LTD	36,600	18.70	684,420.00	
	BORAL LTD	115,000	6.24	717,600.00	

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	44,000	19.14	842,160.00
AMCOR	112,000	14.90	1,668,800.00
ALUMINA LTD	233,000	2.00	466,000.00
BHP BILLITON LIMITED	307,400	26.94	8,281,356.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	148,000	7.05	1,043,400.00
NEWCREST MINING	75,000	22.73	1,704,750.00
RIO TINTO LTD	40,800	69.27	2,826,216.00
SOUTH32 LTD	507,000	2.62	1,328,340.00
CIMIC GROUP LTD	8,938	39.06	349,118.28
BRAMBLES LTD	153,000	10.60	1,621,800.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	44,133	3.47	153,141.51
AURIZON HOLDINGS LTD	191,000	5.24	1,000,840.00
SYDNEY AIRPORT	107,900	6.08	656,032.00
TRANSURBAN GROUP	198,000	10.88	2,154,240.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,000	15.68	815,360.00
CROWN RESORTS LTD	36,000	11.62	418,320.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	5,900	57.70	340,430.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	30.33	157,716.00
TABCORP HOLDINGS	78,000	4.35	339,300.00
TATTS GROUP LTD	147,000	4.02	590,940.00
REA GROUP LTD	5,400	54.38	293,652.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	5.16	273,480.00
WESFARMERS LIMITED	107,500	42.85	4,606,375.00
WOOLWORTHS LIMITED	121,600	25.36	3,083,776.00
COCA-COLA AMATIL LTD	60,000	10.04	602,400.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	11.96	861,120.00
COCHLEAR LTD	5,800	135.00	783,000.00
HEALTHSCOPE LTD	176,000	2.37	417,120.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,100	71.91	1,013,931.00
SONIC HEALTHCARE LTD	38,000	21.65	822,700.00
CSL LIMITED	43,500	122.40	5,324,400.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	280,400	30.21	8,470,884.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,115	11.46	402,417.90
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	44,300	12.33	546,219.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	164,500	85.08	13,995,660.00

	NATIONAL AUSTRALIA BANK	254,400	31.83	8,097,552.00	
	WESTPAC BANKING CORP	320,700	33.65	10,791,555.00	
	AMP LIMITED	281,000	5.24	1,472,440.00	
	CHALLENGER LIMITED	56,000	11.90	666,400.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	228,000	5.99	1,365,720.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	261,000	2.81	733,410.00	
	QBE INSURANCE	132,000	13.02	1,718,640.00	
	SUNCORP GROUP LTD	126,000	13.72	1,728,720.00	
	COMPUTERSHARE LTD	47,000	13.46	632,620.00	
	TELSTRA CORP LTD	414,000	4.85	2,007,900.00	
	TPG TELECOM LTD	33,000	6.35	209,550.00	
	VOCUS GROUP LTD	54,000	4.10	221,400.00	
	AUSNET SERVICES	163,400	1.63	267,159.00	
	APA GROUP	111,000	8.61	955,710.00	
	AGL ENERGY LTD	65,700	24.27	1,594,539.00	
	DUET GROUP	229,000	2.79	638,910.00	
	ASX LTD	19,600	52.00	1,019,200.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,500	88.19	2,601,605.00	
	SEEK LTD	32,800	14.93	489,704.00	
小計	銘柄数：62			113,430,338.69	
				(9,897,931,354)	
	組入時価比率：2.8%			2.9%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	69,000	10.11	697,590.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	91,110	6.75	614,992.50	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,000	8.73	305,550.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	168,000	3.56	598,080.00	
	CONTACT ENERGY LTD	76,000	4.89	371,640.00	
	MERCURY NZ LTD	60,000	2.97	178,200.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	120,000	2.64	316,800.00	
小計	銘柄数：7			3,082,852.50	
				(252,146,505)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	257,540	92.80	23,899,712.00	
	NWS HOLDINGS LTD	159,500	14.36	2,290,420.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	11.06	1,183,420.00	

MTR CORP	137,000	40.00	5,480,000.00
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	140,000	28.65	4,011,000.00
LI & FUNG LTD	563,600	3.52	1,983,872.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	75,000	26.80	2,010,000.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	223,000	37.30	8,317,900.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	94,000	14.64	1,376,160.00
SANDS CHINA LTD	233,600	32.95	7,697,120.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	108,333	9.16	992,330.28
SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	6.19	1,027,540.00
WYNN MACAU LTD	148,400	13.98	2,074,632.00
WH GROUP LIMITED	810,000	5.95	4,819,500.00
BANK OF EAST ASIA	120,860	34.50	4,169,670.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	363,500	31.60	11,486,600.00
HANG SENG BANK	72,200	164.30	11,862,460.00
FIRST PACIFIC CO	226,000	5.98	1,351,480.00
AIA GROUP LTD	1,154,000	47.40	54,699,600.00
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	98.00	2,146,200.00
HKT TRUST AND HKT LTD	259,600	10.38	2,694,648.00
PCCW LTD	386,000	4.65	1,794,900.00
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	65,000	63.20	4,108,000.00
CLP HLDGS	159,000	77.50	12,322,500.00
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	132,000	69.90	9,226,800.00
HONG KONG & CHINA GAS	719,809	14.80	10,653,173.20
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	110,200	202.40	22,304,480.00
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	261,040	52.00	13,574,080.00
HANG LUNG GROUP LTD	81,000	32.25	2,612,250.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	19.70	4,196,100.00
HENDERSON LAND	107,818	43.80	4,722,428.40
HYSAN DEVELOPMENT	65,000	34.80	2,262,000.00
KERRY PROPERTIES	57,000	23.25	1,325,250.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	519,666	9.36	4,864,073.76
SINO LAND CO.LTD	314,000	12.64	3,968,960.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	108.30	15,053,700.00
SWIRE PACIFIC-A	53,500	80.15	4,288,025.00
SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	22.95	2,680,560.00

	WHARF(HOLDING)	133,000	59.65	7,933,450.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	75,000	48.75	3,656,250.00	
小計	銘柄数：40			287,121,244.64	
				(4,197,712,596)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	140,000	3.40	476,000.00	
	KEPPEL CORP.	142,700	6.53	931,831.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	99,040	3.16	312,966.40	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	0.94	153,220.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	52,040	9.83	511,553.20	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	207,000	2.43	503,010.00	
	SATS LTD	59,000	4.91	289,690.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	614,600	1.01	620,746.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	148,000	3.47	513,560.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	42.63	426,300.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	620,320	0.44	272,940.80	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	184,000	3.91	719,440.00	
	DBS GROUP HLDGS	168,000	18.54	3,114,720.00	
	OCBC-ORD	303,000	9.45	2,863,350.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	125,000	20.82	2,602,500.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	757,000	3.98	3,012,860.00	
	STARHUB LTD	69,000	2.78	191,820.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	7.63	587,510.00	
	CAPITALAND LIMITED	246,000	3.45	848,700.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	41,000	9.17	375,970.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	266,000	2.76	734,160.00	
	UOL GROUP LIMITED	48,700	6.55	318,985.00	
小計	銘柄数：22			20,381,832.40	
				(1,632,177,138)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シケル	FRUTAROM	3,800	197.10	748,980.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	50,000	17.11	855,500.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,300	434.00	998,200.00	
	BANK HAPOALIM BM	102,000	23.05	2,351,100.00	

	BANK LEUMI LE- ISRAEL	142,000	16.17	2,296,140.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,000	61.30	796,900.00	
	NICE LTD	5,900	257.00	1,516,300.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	204,000	6.61	1,348,440.00	
	AZRIELI GROUP	4,100	173.00	709,300.00	
	小計 銘柄数：9			11,620,860.00	
				(354,668,647)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
	合計			342,309,613,146	
				(342,309,613,146)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成29年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	198,510.00	
	小計	銘柄数：1	509,000	198,510.00	
		組入時価比率：0.0%		(22,524,929)	0.2%
	合計			22,524,929	(22,524,929)
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,900	640,234.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	880,232.00	
		AMERICAN TOWER CORP	40,700	4,383,797.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	95,000	1,026,000.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,230	2,369,096.10	
		BOSTON PROPERTIES	14,900	2,038,916.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,000	705,300.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,200	671,334.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	51,000	725,730.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,900	2,977,450.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,300	1,578,042.00	
		DUKE REALTY CORP	34,000	858,840.00	
		EQUINIX INC	6,770	2,526,428.60	

	EQUITY RESIDENTIAL	34,800	2,153,424.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,190	1,410,577.20	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	11,800	883,466.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,910	970,855.00	
	GGP INC	56,500	1,412,500.00	
	HCP INC	44,700	1,384,806.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	70,100	1,302,458.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,400	902,800.00	
	KIMCO REALTY CORP	40,000	969,200.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	559,988.00	
	MACERICH CO /THE	12,300	822,132.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,200	1,114,064.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	645,395.00	
	PROLOGIS INC	51,400	2,576,168.00	
	PUBLIC STORAGE	14,060	3,102,198.40	
	REALTY INCOME CORP	24,700	1,496,326.00	
	REGENCY CENTERS CORP	10,300	716,056.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,000	1,307,160.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	30,070	5,387,942.60	
	SL GREEN REALTY CORP	9,800	1,084,958.00	
	UDR INC	25,300	897,391.00	
	VENTAS INC	33,400	2,089,838.00	
	VEREIT INC	95,000	831,250.00	
	VORNADO REALTY TRUST	16,500	1,814,670.00	
	WELLTOWER INC	34,000	2,246,720.00	
	WEYERHAEUSER CO	72,200	2,420,144.00	
小計	銘柄数：39	1,158,930	61,883,886.90	
			(7,021,964,646)	
	組入時価比率：2.0%		76.4%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	315,384.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	452,244.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	229,218.00	
小計	銘柄数：3	37,400	996,846.00	
			(86,486,358)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	

ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	3,100	243,288.00	
	GECINA SA	4,000	488,600.00	
	ICADE	3,700	255,041.00	
	KLEPIERRE	20,500	741,895.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	9,570	2,137,459.50	
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.1%	40,870	3,866,283.50 (467,820,303) 5.1%	
英ポンド	BRITISH LAND	92,000	558,900.00	
	HAMMERSON PLC	74,000	416,990.00	
	INTU PROPERTIES PLC	88,000	238,832.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,500	815,300.00	
	SEGRO PLC	86,000	415,380.00	
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.1%	417,500	2,445,402.00 (346,635,733) 3.8%	
豪ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	91,000	850,850.00	
	GOODMAN GROUP	174,000	1,263,240.00	
	GPT GROUP	179,000	873,520.00	
	LENDLEASE GROUP	53,000	791,820.00	
	MIRVAC GROUP	340,000	731,000.00	
	SCENTRE GROUP	505,000	2,232,100.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	227,000	1,028,310.00	
	VICINITY CENTRES	328,704	949,954.56	
	WESTFIELD CORP	191,000	1,720,910.00	
小計	銘柄数：9 組入時価比率：0.3%	2,088,704	10,441,704.56 (911,143,139) 9.9%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,742,000.00	
	LINK REIT	215,000	11,405,750.00	
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.1%	475,000	13,147,750.00 (192,220,105) 2.1%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	239,000	590,330.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	192,000	294,720.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	249,900	488,554.50	

		SUNTEC REIT	243,000	419,175.00
	小計	銘柄数：4	923,900	1,792,779.50 (143,565,782)
		組入時価比率：0.0%		1.6%
	合計			9,169,836,066 (9,169,836,066)
	合計			9,192,360,995 (9,192,360,995)

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年 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	6,557,759,003	-	6,726,744,182	168,985,179
合計	6,557,759,003	-	6,726,744,182	168,985,179

(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。

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29年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	186,159,914
コール・ローン	1,259,038,896
国債証券	644,221,428,672
未収入金	835,630,454

(平成29年 2月17日現在)

未収利息	5,512,352,014
前払費用	249,103,342
流動資産合計	652,263,713,292
資産合計	652,263,713,292
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,239,320,985
未払利息	1,662
その他未払費用	2,611,800
流動負債合計	1,241,934,447
負債合計	1,241,934,447
純資産の部	
元本等	
元本	301,712,964,334
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	349,308,814,511
元本等合計	651,021,778,845
純資産合計	651,021,778,845
負債純資産合計	652,263,713,292

## 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>
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>

(貸借対照表に関する注記)

平成29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	2.1578円
(10,000口当たり純資産額)	(21,578円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年 2月18日

至 平成29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、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。

## 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29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29年 2月17日現在

	平成28年 2月18日
期首	
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	284,045,302,199円
同期中における追加設定元本額	46,167,543,299円
同期中における一部解約元本額	28,499,881,164円
期末元本額	301,712,964,334円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	91,717,592円
バランスセレクト50	93,876,823円
バランスセレクト70	74,160,432円
野村外国債券インデックスファンド	289,965,784円

野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,837,470,632円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	28,586,639,570円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,533,252,684円
野村資産設計ファンド2015	40,814,399円
野村資産設計ファンド2020	47,434,304円
野村資産設計ファンド2025	49,869,712円
野村資産設計ファンド2030	41,065,833円
野村資産設計ファンド2035	28,363,995円
野村資産設計ファンド2040	73,027,972円
野村外国債券インデックス(野村投資一任口座向け)	187,161,813,463円
のむらップ・ファンド(保守型)	4,697,592,727円
のむらップ・ファンド(普通型)	6,638,322,216円
のむらップ・ファンド(積極型)	1,600,309,360円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	1,768,915,520円
野村資産設計ファンド2045	5,891,340円
野村インデックスファンド・外国債券	642,446,233円
マイ・ロード	8,209,938,743円
ネクストコア	518,093,348円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	90,260,615円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	2,422,044,362円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	740,381,930円
野村資産設計ファンド2050	4,489,244円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,627,327円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	834,792円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	688,572円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	770,338円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	261,362,747円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	51,916,404円
インデックス・ブレンド(タイプ)	16,458円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,472円
インデックス・ブレンド(タイプ)	12,276円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,472円
インデックス・ブレンド(タイプ)	16,886円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	17,528,483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)	31,955,815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)	2,284,836,588円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	652,527,053円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	6,595,183,917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)	1,731,937,687円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	3,010,281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)	23,771,766円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	2,146,026円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,262,317,913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)	513,124,952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)	1,884,434,823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)	199,507,326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)	193,631,621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)	240,648,566円

野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	2,182,145,450円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,080,366,593円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,049,915,900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)	407,326,546円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,535,146円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,363,144円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,585,617円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	527,651,318円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,054,579,732円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	2,745,827,258円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,503,237,208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)	12,623,865,996円
マイバランスDC30	1,180,348,666円
マイバランスDC50	714,778,281円
マイバランスDC70	430,798,771円
野村DC外国債券インデックスファンド	3,102,243,500円
野村DC運用戦略ファンド	818,249,776円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	6,206,427円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	23,324,694円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	680,841円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	947,076円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年 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29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	10,500,000.00	12,104,940.75	
		US TREASURY BOND	19,300,000.00	22,491,283.95	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	15,748,991.87	
		US TREASURY BOND	21,100,000.00	26,909,093.75	
		US TREASURY BOND	16,600,000.00	20,711,092.92	
		US TREASURY BOND	51,200,000.00	51,399,997.44	
		US TREASURY BOND	43,200,000.00	55,701,000.00	
		US TREASURY BOND	18,800,000.00	25,366,779.84	

US TREASURY BOND	23,700,000.00	31,769,108.19	
US TREASURY BOND	12,000,000.00	15,521,250.00	
US TREASURY BOND	5,000,000.00	6,361,914.00	
US TREASURY BOND	800,000.00	1,021,437.44	
US TREASURY BOND	100,000.00	124,234.37	
US TREASURY BOND	25,300,000.00	24,465,889.36	
US TREASURY BOND	16,000,000.00	18,115,000.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	203,242.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,988.28	
US TREASURY N/B	300,000.00	299,625.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	820,406.24	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,100,988.24	
US TREASURY N/B	200,000.00	203,726.56	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,087,518.91	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,002,500.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,995,703.00	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	33,911,015.20	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,666,347.55	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,194,937.44	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	15,749,218.56	
US TREASURY N/B	600,000.00	600,023.40	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,784,257.68	
US TREASURY N/B	15,500,000.00	15,496,366.80	
US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,429,255.94	
US TREASURY N/B	31,200,000.00	31,771,593.36	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,540,175.25	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	997,773.40	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,951,593.20	
US TREASURY N/B	18,400,000.00	18,486,250.00	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,623,252.80	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	5,011,500.00	
US TREASURY N/B	19,600,000.00	19,579,327.88	
US TREASURY N/B	20,800,000.00	20,930,000.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	798,593.68	
US TREASURY N/B	27,400,000.00	27,515,592.38	

US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,941,796.00	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,389,218.72	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,000,159.29	
US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,435,108.84	
US TREASURY N/B	700,000.00	695,269.47	
US TREASURY N/B	35,700,000.00	37,288,367.97	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,816.40	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,007,734.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	700,792.96	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,521,073.65	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,530,077.85	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,694,074.08	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,503,808.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,010,468.60	
US TREASURY N/B	27,500,000.00	28,311,032.75	
US TREASURY N/B	900,000.00	891,386.64	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,511,074.05	
US TREASURY N/B	16,200,000.00	16,282,265.22	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,255,581.72	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,016,718.40	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	25,681,287.15	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,279,964.70	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,994,335.50	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,638,937.36	
US TREASURY N/B	27,600,000.00	28,695,375.00	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,640,163.40	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,389,062.50	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,949,991.99	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,588,358.65	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	27,539,576.82	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,971,054.50	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,850,874.56	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,968,007.70	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,852,108.49	
US TREASURY N/B	49,300,000.00	51,872,843.75	

US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,692,750.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,801,757.70	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,883,280.80	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,815,437.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,993,046.80	
US TREASURY N/B	51,800,000.00	54,982,866.54	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,678,484.24	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,950,000.00	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	21,190,170.81	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,179,749.76	
US TREASURY N/B	47,700,000.00	50,567,585.67	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,477,656.25	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,742,655.42	
US TREASURY N/B	13,200,000.00	13,198,967.76	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,167,343.40	
US TREASURY N/B	42,500,000.00	43,884,569.25	
US TREASURY N/B	37,600,000.00	38,164,000.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,066,562.20	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,602,749.92	
US TREASURY N/B	52,600,000.00	54,327,988.90	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,960,437.16	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,370,804.29	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,890,625.00	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	49,059,668.44	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,042,968.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,737,500.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,831,500.00	
US TREASURY N/B	12,900,000.00	13,120,709.97	
US TREASURY N/B	38,400,000.00	40,388,997.12	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,641,502.50	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,385,155.40	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,852,320.07	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,060,670.20	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,330,226.38	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,148,748.80	

US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,032,031.00	
US TREASURY N/B	26,000,000.00	26,081,250.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,980,000.00	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,503,655.32	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,891,796.50	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	33,761,869.83	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,221,866.64	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,782,437.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,871,093.00	
US TREASURY N/B	11,900,000.00	11,738,699.07	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	27,120,233.70	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,090,976.10	
US TREASURY N/B	12,800,000.00	12,468,999.68	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,998,983.40	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	21,522,186.40	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,863,202.70	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	24,076,170.00	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,578,905.70	
US TREASURY N/B	42,200,000.00	41,128,512.46	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	29,385,874.24	
US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,731,920.42	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	17,332,874.16	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,647,968.08	
US TREASURY N/B	29,100,000.00	29,516,036.88	
US TREASURY N/B	23,100,000.00	22,928,554.11	
US TREASURY N/B	24,700,000.00	24,020,750.00	
US TREASURY N/B	26,500,000.00	25,961,718.75	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,486,249.60	
US TREASURY N/B	19,600,000.00	19,316,717.28	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,334,179.50	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	4,392,093.75	
US TREASURY N/B	500,000.00	631,250.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,359.37	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,700,125.00	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,641,085.72	

	US TREASURY N/B	7,200,000.00	8,890,312.32	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,220,000.00	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,878,124.80	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,193,749.60	
	US TREASURY N/B	7,800,000.00	9,471,515.04	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,122,421.70	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,665,780.90	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,608,163.90	
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,252,000.00	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,466,601.45	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	8,808,116.49	
	US TREASURY N/B	14,600,000.00	13,811,827.76	
	US TREASURY N/B	18,200,000.00	18,443,139.26	
	US TREASURY N/B	15,400,000.00	17,060,312.50	
	US TREASURY N/B	23,200,000.00	25,697,623.84	
	US TREASURY N/B	18,900,000.00	20,054,670.93	
	US TREASURY N/B	30,600,000.00	31,004,014.86	
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	36,484,875.00	
	US TREASURY N/B	26,000,000.00	23,194,841.80	
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,432,139.54	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,926,875.00	
	US TREASURY N/B	15,500,000.00	15,301,406.25	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,005,702.90	
	US TREASURY NOTE	33,600,000.00	34,312,686.24	
小計	銘柄数：172	2,442,700,000.00	2,531,408,538.68	
			(287,238,926,884)	
	組入時価比率：44.1%		44.6%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	4,600,000.00	4,953,694.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	7,846,176.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,220,064.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,300,000.00	6,584,508.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,990,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	9,574,955.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	9,658,775.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,873,150.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	7,140,793.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,300,000.00	4,397,137.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,659,796.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,431,566.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,774,912.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,091,514.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	11,436,285.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	773,480.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,628,014.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,084,123.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	8,900,265.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	5,821,062.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	920,590.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,680,000.00	7,959,384.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	5,005,276.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	7,082,150.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	8,189,184.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	11,506,020.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,926,180.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	547,865.00	
小計	銘柄数：28	148,380,000.00	163,977,318.00	
			(14,226,672,109)	
	組入時価比率：2.2%		2.2%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	70,000,000.00	68,193,860.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	104,500,000.00	107,407,921.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,000,000.00	45,594,288.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	70,700,000.00	72,781,620.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	124,300,000.00	121,543,398.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,400,000.00	46,955,018.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,700,000.00	35,615,653.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,000,000.00	7,134,176.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	83,100,000.00	83,291,130.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,100,000.00	50,562,273.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,500,000.00	44,683,429.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,964,200.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	56,269,362.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	32,740,682.50
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	63,760,294.20
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	86,292,195.00
	銘柄数：16	913,000,000.00	932,789,502.40 (5,186,309,633)
	組入時価比率：0.8%		0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	6,561,408.00
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,386,750.00
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	8,067,381.00
	BELGIUM KINGDOM	7,200,000.00	8,719,560.00
	BELGIUM KINGDOM	4,800,000.00	5,843,160.00
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	7,968,640.00
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,704,400.00
	BELGIUM KINGDOM	10,000,000.00	11,655,000.00
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,324,703.60
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,850,818.00
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	9,772,652.80
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	8,345,509.80
	BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,292,240.30
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,500,000.00	2,628,000.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,702,840.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,600,000.00	17,364,237.20
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	17,531,558.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,500,000.00	7,841,062.50
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,019,200.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,800,000.00	18,918,107.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	7,588,039.80
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,700,000.00	2,722,005.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,300,000.00	14,148,154.30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,900,000.00	9,918,978.80
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	9,829,160.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	27,500,000.00	30,977,870.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,600,000.00	12,442,174.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,900,000.00	9,643,285.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	919,350.90	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	11,623,611.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,000,000.00	21,633,129.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	7,346,922.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,900,000.00	17,430,600.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,900,000.00	9,355,180.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	917,640.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000,000.00	17,616,060.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,362,560.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,800,000.00	6,393,120.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	7,462,260.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,400,000.00	8,637,420.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	11,186,604.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,029,582.00
BUNDES Obligation	1,100,000.00	1,131,350.00
BUNDES Obligation	8,000,000.00	8,224,000.00
BUNDES Obligation	2,100,000.00	2,148,090.00
BUNDES Obligation	3,000,000.00	3,099,600.00
BUNDES Obligation	1,600,000.00	1,638,880.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,700,000.00	19,524,870.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,700,000.00	7,485,240.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,618,650.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,695,170.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,300,000.00	9,316,750.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,185,100.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	9,474,360.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,500,000.00	15,144,435.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,500,000.00	9,489,825.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,526,400.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,765,708.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,777,304.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,000,000.00	16,050,160.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,100,000.00	20,354,901.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,460,152.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,674,585.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	6,804,000.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	8,311,920.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,057,520.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	31,627,626.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,365,940.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,033,836.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	11,138,790.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,764,610.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	10,410,334.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	8,480,921.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	13,302,432.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	14,646,544.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	8,166,653.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	6,235,353.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,500,000.00	11,360,505.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	11,390,391.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	12,676,238.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,600,000.00	31,562,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,496,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,300,000.00	16,548,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,049,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	499,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,095,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	824,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,080,000.00	12,191,324.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,100,000.00	6,846,030.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	32,628,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	18,203,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,014,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,832,695.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,884,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,037,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,800,000.00	15,031,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,052,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	11,807,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,700,000.00	25,512,750.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	3,913,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	7,920,626.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	7,454,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,228,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	18,865,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,611,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	18,316,570.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,908,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	10,149,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,600,000.00	12,381,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,200,000.00	25,316,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	8,977,540.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,500,000.00	23,933,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	25,647,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,694,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	8,881,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	10,905,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	7,747,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,374,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,600,000.00	20,127,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	8,808,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	8,094,330.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,542,627.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,100,000.00	2,350,874.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,245,800.00	
FINNISH GOVERNMENT	900,000.00	926,399.70	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,323,790.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,512,819.20	
FINNISH GOVERNMENT	4,200,000.00	4,592,637.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,138,240.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,039,945.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,998,130.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,292,589.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	681,760.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,072,062.40	

FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,268,304.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,500,000.00	9,743,789.00	
FRANCE (GOVT OF)	4,500,000.00	5,132,025.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,843,600.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,400,000.00	5,693,922.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	6,732,567.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	11,678,860.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,800,000.00	27,531,077.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,200,000.00	2,221,780.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	12,694,171.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	4,962,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	12,798,384.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	16,621,776.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,300,000.00	30,085,965.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,037,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	13,735,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	17,452,489.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	16,734,421.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	22,489,407.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	12,335,374.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	32,000,000.00	40,262,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,715,480.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	28,631,394.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,000,000.00	5,078,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	40,693,140.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,375,040.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000.00	36,386,297.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,007,871.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000.00	31,374,268.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	9,866,953.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	16,509,545.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,900,000.00	20,886,960.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,200,000.00	16,599,712.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	6,916,990.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,800,000.00	5,667,320.00	

IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	3,600,000.00	4,006,692.00	
IRISH GOVERNMENT	5,600,000.00	6,061,272.00	
IRISH GOVERNMENT	3,400,000.00	3,960,541.00	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,100,989.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,180,330.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,720,450.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	2,600,000.00	2,864,550.00	
IRISH TSY 2% 2045	2,500,000.00	2,414,117.50	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,600,000.00	7,840,140.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,900,000.00	8,421,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	4,459,048.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	7,897,330.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,050,488.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,605,910.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,874,367.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,704,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,269,390.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,256,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,564,418.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,329,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	3,995,200.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	11,041,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	5,423,440.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	7,685,645.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,200,000.00	9,701,673.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	6,164,118.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,371,300.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,757,500.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,653,250.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,400,000.00	2,457,120.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,600,000.00	6,445,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,182,320.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	3,958,350.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	6,022,500.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,993,300.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,900,000.00	4,347,837.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,325,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,511,940.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,100,000.00	9,594,946.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,199,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,200,000.00	7,860,746.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,800,000.00	8,004,092.80	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,400,000.00	4,129,810.00	
	SPANISH GOVERNMENT	18,500,000.00	26,629,473.50	
	SPANISH GOVERNMENT	8,500,000.00	12,427,000.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	6,546,259.20	
小計	銘柄数：215	1,707,280,000.00	2,099,106,824.40 (253,991,925,752)	
	組入時価比率：39.0%		39.4%	
英債券	UK TREASURY	100,000.00	105,170.00	
	UK TREASURY	9,250,000.00	9,404,475.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	7,198,620.00	
	UK TREASURY	19,600,000.00	20,356,560.00	
	UK TREASURY	2,600,000.00	2,839,460.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,617,860.00	
	UK TREASURY	16,090,000.00	17,000,694.00	
	UK TREASURY	7,000,000.00	7,857,500.00	
	UK TREASURY	2,200,000.00	2,291,960.00	
	UK TREASURY	9,340,000.00	12,376,434.00	
	UK TREASURY	8,900,000.00	10,218,980.00	
	UK TREASURY	4,650,000.00	5,452,590.00	
	UK TREASURY	8,500,000.00	9,000,650.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,569,200.00	
	UK TREASURY	11,200,000.00	12,656,000.00	
	UK TREASURY	12,450,000.00	16,269,660.00	
	UK TREASURY	9,530,000.00	12,300,371.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,040,515.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,950,930.00	
	UK TREASURY	6,250,000.00	8,423,750.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,303,360.00	

	UK TREASURY	4,900,000.00	6,794,340.00	
	UK TREASURY	4,400,000.00	6,644,000.00	
	UK TREASURY	4,200,000.00	5,979,960.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,209,710.00	
	UK TREASURY	6,100,000.00	9,265,900.00	
	UK TREASURY	20,000,000.00	26,580,000.00	
	UK TREASURY	5,950,000.00	9,052,330.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,453,535.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,073,375.00	
	UK TREASURY	2,500,000.00	3,088,500.00	
	UK TREASURY	5,800,000.00	9,163,420.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	21,050,000.00	26,680,875.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,500,000.00	10,937,550.00	
小計	銘柄数：34	260,510,000.00	331,158,234.00	
			(46,941,679,669)	
	組入時価比率：7.2%		7.3%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	4,900,000.00	5,477,710.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,600,000.00	5,238,360.00	
小計	銘柄数：2	8,500,000.00	10,716,070.00	
			(1,218,417,159)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	4,600,000.00	5,060,105.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	49,400,000.00	59,211,828.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	53,400,000.00	63,089,430.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	26,600,000.00	28,738,932.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	41,700,000.00	48,392,850.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	9,100,000.00	9,332,641.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,300,000.00	21,677,451.50	
小計	銘柄数：7	201,100,000.00	235,503,239.40	
			(3,014,441,464)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	26,100,000.00	28,341,990.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	30,724,320.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,882,010.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	49,538,170.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,754,520.00	

小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,624,800.00
	銘柄数：6	122,300,000.00	132,865,810.00 (1,817,604,280)
	組入時価比率：0.3%		0.3%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	4,500,000.00	4,565,250.00
	KINGDOM OF DENMARK	30,800,000.00	34,628,440.00
	KINGDOM OF DENMARK	41,100,000.00	47,441,730.00
	KINGDOM OF DENMARK	30,100,000.00	33,095,853.00
	KINGDOM OF DENMARK	31,400,000.00	35,098,920.00
	KINGDOM OF DENMARK	48,300,000.00	81,069,231.60
	小計	銘柄数：6	186,200,000.00
	組入時価比率：0.6%		0.6%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	2,300,000.00	2,357,960.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	14,400,000.00	14,500,800.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,484,800.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	5,929,920.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	11,980,230.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,107,220.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	33,330,990.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	12,383,160.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	10,598,500.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,944,375.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	22,484,800.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	4,977,225.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,380,800.00
小計	銘柄数：13	139,400,000.00	145,460,780.00 (4,080,174,879)
	組入時価比率：0.6%		0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,600,000.00	8,809,238.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,600,000.00	12,396,664.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,369,062.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,100,000.00	14,085,919.10
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,300,000.00	6,214,761.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	11,670,248.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,400,000.00	9,858,660.00

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,508,006.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	7,994,010.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	18,300,000.00	19,060,694.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,300,000.00	13,811,670.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,250,000.00	13,182,075.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	791,497.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	375,480.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,360,216.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,170,556.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,638,590.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,599,962.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,032,000.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	171,460.00	
小計	銘柄数：20	144,850,000.00	156,100,773.10	
			(13,621,353,460)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,671,840.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,600,000.00	5,764,892.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,000,000.00	4,246,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	3,056,586.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,495,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,139,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,438,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,634,950.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,507,004.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	560,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,900,000.00	3,045,000.00	
小計	銘柄数：11	29,980,000.00	31,558,972.00	
			(2,527,242,477)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,728,047.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,703,762.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,021,000.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	906,929.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,411,900.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	12,159,420.00	

	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	9,965,020.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,416,603.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,090,204.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,791,350.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,496,996.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	10,130,016.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,843,001.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	593,400.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	8,962,659.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	5,557,872.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,692,000.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,898,590.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,494,110.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,265,038.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,416,684.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	366,760.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,657,500.00	
小計	銘柄数：23	112,000,000.00	111,568,865.60	
			(2,841,659,006)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,600,000.00	23,765,358.12	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,300,000.00	24,979,140.34	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	25,064,122.32	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,200,000.00	24,641,028.72	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	70,000,000.00	78,642,431.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,000,000.00	24,949,044.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	25,152,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,400,000.00	43,014,646.72	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	47,100,000.00	34,503,660.78	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,500,000.00	25,253,250.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	4,628,985.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,600,000.00	17,955,360.42	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,100,000.00	25,332,272.42	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,100,000.00	43,032,704.23	
小計	銘柄数：14	450,800,000.00	420,914,005.57	

			(3,674,579,268)	
		組入時価比率：0.6%	0.6%	
合計			644,221,428,672	
			(644,221,428,672)	

(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。

## 新興国債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(平成29年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	81,223,646
コール・ローン	14,267,568
国債証券	7,970,203,556
未収利息	123,830,685
前払費用	4,856,121
流動資産合計	8,194,381,576
資産合計	8,194,381,576
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,800
未払金	51,708,279
未払解約金	7,620,386
未払利息	18
その他未払費用	52,500
流動負債合計	59,398,983
負債合計	59,398,983
純資産の部	
元本等	
元本	4,499,141,347
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,635,841,246
元本等合計	8,134,982,593
純資産合計	8,134,982,593
負債純資産合計	8,194,381,576

### 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29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	1.8081円
(10,000口当たり純資産額)	(18,081円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年 2月18日 至 平成29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。 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。</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29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29年 2月17日現在	
期首	平成28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	3,866,356,460円
同期中における追加設定元本額	1,560,513,481円
同期中における一部解約元本額	927,728,594円
期末元本額	4,499,141,347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	1,305,710,132円
ネクストコア	98,605,647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	218,575,464円
インデックス・ブレンド(タイプ )	69,429円
インデックス・ブレンド(タイプ )	48,393円
インデックス・ブレンド(タイプ )	59,033円
インデックス・ブレンド(タイプ )	39,157円
インデックス・ブレンド(タイプ )	49,938円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	10,573,774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)	80,204,210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)	3,565,949円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	28,294,107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)	2,597,297,837円
野村DC運用戦略ファンド	155,680,693円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	367,584円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成29年 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29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	ARGENT-GLOBAL	640,000.00	957,872.32	
		ARGENT-GLOBAL	220,000.00	323,562.31	
		ARGENT-GLOBAL	1,100,000.00	696,850.00	
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	400,000.00	245,000.00	
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	500,000.00	328,250.00	
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	350,000.00	179,917.50	
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	400,000.00	190,000.00	
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	300,000.00	142,200.00	
		BRAZIL GLOBAL	350,000.00	409,325.00	
		BRAZIL GLOBAL	450,000.00	564,750.00	
		BRAZIL GLOBAL	450,000.00	561,375.00	
		BRAZIL GLOBAL	300,000.00	426,750.00	
		BRAZIL GLOBAL	220,000.00	268,400.00	
		BRAZIL GLOBAL	700,000.00	778,750.00	
		COLOMBIA GLOBAL	550,000.00	611,325.00	
		COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	315,937.50	
		COLOMBIA GLOBAL	320,000.00	404,800.00	
		CROATIA	200,000.00	219,204.00	
		CROATIA	200,000.00	218,900.00	
		CROATIA	400,000.00	427,336.00	
CROATIA	400,000.00	439,816.00			

FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000.00	538,250.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	530,000.00	553,850.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	366,500.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000.00	582,750.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000.00	475,000.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000.00	433,750.00	
HUNGARY	300,000.00	311,127.30	
HUNGARY	400,000.00	439,768.00	
HUNGARY	300,000.00	338,313.30	
HUNGARY	500,000.00	554,205.00	
INDONESIA GLOBAL	600,000.00	675,957.60	
INDONESIA GLOBAL	700,000.00	1,005,760.00	
INDONESIA GLOBAL	200,000.00	243,988.20	
MEXICO GLOBAL	399,000.00	506,730.00	
MEXICO GLOBAL	380,000.00	458,287.60	
PANAMA GLOBAL	300,000.00	378,375.00	
PANAMA GLOBAL	300,000.00	421,875.00	
PANAMA GLOBAL	250,000.00	363,000.00	
PANAMA GLOBAL	350,000.00	440,125.00	
PERU GLOBAL	300,000.00	388,875.00	
PERU GLOBAL	320,000.00	408,800.00	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	768,854.50	
PHILIPPINES GLOBAL	650,000.00	1,033,217.25	
PHILIPPINES GLOBAL	200,000.00	286,288.40	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	650,211.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	800,000.00	844,000.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	965,709.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,600,000.00	1,678,400.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	750,000.00	759,375.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000.00	636,300.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	191,200.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	411,800.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	211,250.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	820,000.00	926,600.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000.00	754,950.00	

REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	398,600.00	
REPUBLIC OF CROATIA	300,000.00	327,081.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	320,000.00	352,280.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	600,000.00	673,236.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	250,000.00	355,412.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	550,000.00	656,707.15	
REPUBLIC OF INDONESIA	450,000.00	494,821.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	322,358.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	513,268.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	397,502.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	250,000.00	276,016.25	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	822,135.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	419,151.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	762,660.60	
REPUBLIC OF PANAMA	150,000.00	162,375.00	
REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	205,000.00	
REPUBLIC OF PERU	450,000.00	672,750.00	
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	580,625.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	639,228.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	217,001.60	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	799,654.20	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	400,000.00	469,651.20	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	400,000.00	410,179.20	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	437,810.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	430,214.40	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	250,000.00	277,899.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	300,000.00	310,200.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	350,000.00	385,875.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	206,984.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	150,000.00	171,936.00	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	416,972.00	
REPUBLIC OF TURKEY	200,000.00	203,350.00	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	426,972.40	
REPUBLIC OF TURKEY	300,000.00	286,580.40	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	422,624.00	

REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	582,525.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	507,567.00	
REPUBLIC OF TURKEY	700,000.00	734,931.40	
REPUBLIC OF VENEZUELA	450,000.00	261,000.00	
REPUBLIC OF VENEZUELA	700,000.00	405,720.00	
REPUBLIC OF VENEZUELA	200,000.00	87,140.00	
ROMANIA	400,000.00	460,534.40	
ROMANIA	300,000.00	312,750.00	
ROMANIA	300,000.00	321,582.00	
ROMANIA	200,000.00	240,364.00	
RUSSIA	600,000.00	682,818.00	
RUSSIA	320,000.00	559,379.20	
RUSSIA	1,658,500.00	1,994,014.55	
RUSSIA FOREIGN BOND	600,000.00	646,237.80	
RUSSIAN FEDERATION	600,000.00	618,243.00	
RUSSIAN FEDERATION	600,000.00	638,001.60	
RUSSIAN FEDERATION	600,000.00	645,075.00	
RUSSIAN FEDERATION	200,000.00	209,325.00	
RUSSIAN FEDERATION	600,000.00	653,773.20	
RUSSIAN FEDERATION	400,000.00	451,715.20	
TURKEY GLOBAL	800,000.00	858,090.40	
TURKEY GLOBAL	650,000.00	709,033.00	
TURKEY GLOBAL	600,000.00	618,597.00	
TURKEY GLOBAL	1,450,000.00	1,636,426.50	
TURKEY GLOBAL	250,000.00	384,223.50	
TURKEY GLOBAL	400,000.00	474,846.80	
TURKEY GLOBAL	620,000.00	662,096.14	
TURKEY GLOBAL	150,000.00	166,698.75	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	765,000.00	756,967.50	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	209,000.00	206,899.55	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	209,000.00	204,088.50	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	500,000.00	486,250.00	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	500,000.00	481,233.50	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	500,000.00	475,000.00	
UNITED MEXICAN STATES	800,000.00	752,288.00	

		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	216,750.00	
		UNITED MEXICAN STATES	600,000.00	647,700.00	
		UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	709,800.00	
		UNITED MEXICAN STATES	850,000.00	863,600.00	
		UNITED MEXICAN STATES	800,000.00	782,800.00	
		UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	403,400.00	
		UNITED MEXICAN STATES	710,000.00	779,402.50	
		UNITED MEXICAN STATES	800,000.00	740,000.00	
		UNITED MEXICAN STATES	900,000.00	924,525.00	
		VENEZUELA GLOBAL	150,000.00	109,800.00	
		VENEZUELA GLOBAL	200,000.00	108,006.00	
		VENEZUELA GLOBAL	100,000.00	46,530.00	
		VENEZUELA GLOBAL	600,000.00	307,500.00	
		VENEZUELA GLOBAL	200,000.00	96,500.00	
	小計	銘柄数：140	65,560,500.00	70,240,623.57	
				(7,970,203,556)	
		組入時価比率：98.0%		100.0%	
	合計			7,970,203,556	
				(7,970,203,556)	

(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29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	4,555,800	-	4,538,000	17,800
米ドル	4,555,800	-	4,538,000	17,800
合計	4,555,800	-	4,538,000	17,800

(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29年 2月17日現在）

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	63,741,593
コール・ローン	11,731,304
国債証券	4,091,910,141
特殊債券	10,819,215
未収利息	69,908,210
前払費用	10,836,262
流動資産合計	4,258,946,725
資産合計	4,258,946,725
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,140
未払解約金	7,780,673
未払利息	15
その他未払費用	157,200
流動負債合計	7,947,028
負債合計	7,947,028
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	3,335,139,854
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	915,859,843
元本等合計	4,250,999,697
純資産合計	4,250,999,697
負債純資産合計	4,258,946,725

### 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、特殊債券 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。
-------------------	---

	<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>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る場合、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29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	1.2746円
(10,000口当たり純資産額)	(12,746円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年 2月18日 至 平成29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。 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。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>    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。</p> <p>    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。</p> <p>    流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成29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、特殊債券	(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。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、	附属明細表に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。	

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年 2月17日現在	
期首	平成28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	1,395,188,317円
同期中における追加設定元本額	2,189,512,681円
同期中における一部解約元本額	249,561,144円
期末元本額	3,335,139,854円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	14,418,861円
野村資産設計ファンド2020	16,090,101円
野村資産設計ファンド2025	17,203,557円
野村資産設計ファンド2030	14,172,151円
野村資産設計ファンド2035	9,787,968円
野村資産設計ファンド2040	25,200,900円
野村資産設計ファンド2045	2,071,064円
野村インデックスファンド・新興国債券	455,934,411円
ネクストコア	88,282,206円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	155,684,247円
野村資産設計ファンド2050	1,496,298円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	1,269,537円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	291,643円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	233,922円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	264,605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)	2,131,067,629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	262,128,258円
野村DC運用戦略ファンド	139,276,794円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	265,702円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成29年 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29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	6,850,000.00	6,673,256.30		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,800,000.00	4,933,569.60		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,200,000.00	2,089,738.20		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,950,000.00	11,272,400.85		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	3,000,000.00	2,933,469.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,200,000.00	7,955,189.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,600,000.00	5,336,547.40		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	3,567,088.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,350,000.00	4,360,005.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	2,147,018.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,317,724.60		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	3,985,680.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,700,000.00	2,079,519.90		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	5,367,325.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	3,200,000.00	3,178,083.20		
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	3,400,000.00	3,534,861.00		
		小計	銘柄数：16	72,550,000.00	73,731,475.05	(409,947,001)
			組入時価比率：9.6%		10.0%	
		リアル	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	1,540,000.00	1,349,423.46
	レアル		LETRA TESOURO NACIONAL	400,000.00	342,622.00	
レアル	LETRA TESOURO NACIONAL		2,430,000.00	2,030,770.44		
レアル	LETRA TESOURO NACIONAL		2,310,000.00	1,838,903.22		
レアル	NOTA DO TESOURO NACIONAL		256,000.00	2,580,331.52		
レアル	NOTA DO TESOURO NACIONAL		100,000.00	1,001,977.00		

小計	NOTA DO TESOURO NACIONAL	251,000.00	2,496,486.16
	銘柄数：7	7,287,000.00	11,640,513.80 (427,323,261)
	組入時価比率：10.1%		10.3%
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,820,000,000.00	4,066,821,660.00
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,150,000,000.00	3,894,628,500.00
	銘柄数：2	6,970,000,000.00	7,961,450,160.00 (313,681,136)
	組入時価比率：7.4%		7.6%
又エボソル	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	599,449.20
	PERU BONO SOBERANO	480,000.00	523,290.72
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	522,146.50
	PERU BONO SOBERANO	620,000.00	635,245.18
	REPUBLIC OF PERU	500,000.00	503,027.00
	銘柄数：5	2,700,000.00	2,783,158.60 (97,187,898)
	組入時価比率：2.3%		2.4%
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	200,000.00	193,300.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	300,000.00	284,850.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,410,000.00	1,397,310.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,050,000.00	957,600.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	950,000.00	911,050.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,650,000.00	1,574,925.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,390,000.00	1,263,510.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	570,000.00	480,510.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	460,000.00	419,520.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	512,720.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,010,000.00	928,190.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,620,000.00	1,389,150.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,198,800.00
	銘柄数：13	12,330,000.00	11,511,435.00 (356,048,684)
組入時価比率：8.4%		8.7%	
フォロント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	32,000,000.00	36,213,120.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	48,000,000.00	51,144,000.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	81,000,000.00	98,095,050.00

小計	HUNGARY GOVERNMENT BOND	36,000,000.00	44,569,800.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	92,688,750.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	30,000,000.00	29,866,500.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	92,000,000.00	106,753,580.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	75,000,000.00	71,066,100.00	
	銘柄数：8	471,000,000.00	530,396,900.00	(208,711,180)
	組入時価比率：4.9%			5.1%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	910,000.00	932,932.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	990,000.00	1,012,176.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	380,000.00	410,134.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,730,000.00	1,677,062.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	830,000.00	901,131.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,700,000.00	1,637,780.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	571,020.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	557,800.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	400,000.00	383,400.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	980,000.00	1,104,950.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,140,000.00	1,180,527.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	2,052,960.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,650,000.00	1,493,167.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	300,000.00	267,600.00	
	小計	銘柄数：14	14,210,000.00	14,182,639.50
組入時価比率：9.4%			9.7%	
ルーブル	RUSSIA FOREIGN BOND	130,000,000.00	128,766,300.00	
小計	銘柄数：1	130,000,000.00	128,766,300.00	(254,957,274)
組入時価比率：6.0%			6.2%	
レイ	ROMANIA	440,000.00	442,706.00	
	ROMANIA	790,000.00	808,703.25	
	ROMANIA	300,000.00	339,595.50	
	ROMANIA	300,000.00	303,585.00	
	ROMANIA	950,000.00	1,082,724.50	
	ROMANIA	820,000.00	884,624.20	
	ROMANIA	610,000.00	703,659.40	

小計	銘柄数：7	4,210,000.00	4,565,597.85 (122,129,742)	3.0%
	組入時価比率：2.9%			
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,760,000.00	1,767,392.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,760,000.00	1,798,368.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,299,313.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,035,334.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	505,250.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	750,000.00	733,206.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,280,000.00	1,246,771.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,208,896.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,240,000.00	1,262,920.16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	786,856.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	740,000.00	695,600.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	200,000.00	199,528.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	550,000.00	516,846.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	366,760.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	200,000.00	190,424.80	
小計	銘柄数：15	13,700,000.00	13,613,468.44 (346,735,041)	8.5%
	組入時価比率：8.2%			
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	622,491.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,200,000.00	11,618,622.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,700,000.00	10,194,680.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,700,000.00	9,932,761.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,061,460.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,898,420.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,700,000.00	9,359,268.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,733,995.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,200,000.00	10,099,677.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	7,098,643.30	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,880,310.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,012,555.00	
小計	銘柄数：12	91,300,000.00	97,512,884.80 (315,941,746)	7.7%
	組入時価比率：7.4%			

フィリピン	REPUBLIC OF PHILIPPINES	5,000,000.00	5,170,650.00	
小計	銘柄数：1	5,000,000.00	5,170,650.00	
			(11,737,375)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ルビア	INDONESIA GOVERNMENT	2,700,000,000.00	2,759,670,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,900,000,000.00	3,267,430,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,700,000,000.00	2,039,872,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,880,000,000.00	1,870,246,560.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,330,000,000.00	5,586,373,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,880,000,000.00	8,308,865,920.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,650,000,000.00	4,491,063,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,330,000,000.00	1,442,651,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,336,013,760.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,400,000,000.00	1,568,735,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,300,000,000.00	3,364,267,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,500,000,000.00	3,927,271,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,280,000,000.00	4,395,560,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,600,000,000.00	3,667,482,000.00	
小計	銘柄数：14	45,560,000,000.00	48,025,501,740.00	
			(413,019,314)	
	組入時価比率：9.7%		10.1%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,980,000.00	2,942,207.04	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,340,000.00	3,207,439.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,300,000.00	3,226,801.38	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	7,976,589.43	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	5,544,232.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,160,000.00	5,164,544.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,000,000.00	964,895.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,700,000.00	2,710,478.66	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,700,000.00	4,316,010.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,450,000.00	6,167,593.31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000.00	5,507,439.37	
小計	銘柄数：11	52,630,000.00	47,728,230.49	
			(416,667,452)	
	組入時価比率：9.8%		10.1%	
合計			4,091,910,141	

				(4,091,910,141)	
特殊債券	ルール	INTL FINANCE CORP	5,000,000.00	5,464,250.00	
	小計	銘柄数：1	5,000,000.00	5,464,250.00	
		組入時価比率：0.3%			(10,819,215)
	合計			10,819,215	
合計				(10,819,215)	
合計				4,102,729,356	
				(4,102,729,356)	

(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29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	2,278,140	-	2,269,000	9,140
米ドル	2,278,140	-	2,269,000	9,140
合計	2,278,140	-	2,269,000	9,140

### (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いません。

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。

## 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29年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	360,455,107
投資証券	22,872,846,350
派生商品評価勘定	5,332,320
未収入金	27,024,450
未収配当金	162,183,874
差入委託証拠金	19,251,020
流動資産合計	23,447,093,121
資産合計	23,447,093,121
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,014,444
未払金	43,218,035
未払解約金	12,393,141
未払利息	475
流動負債合計	58,626,095
負債合計	58,626,095
純資産の部	
元本等	
元本	11,851,562,969
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	11,536,904,057
元本等合計	23,388,467,026
純資産合計	23,388,467,026
負債純資産合計	23,447,093,121

## 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 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>

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成29年 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	1.9735円
(10,000口当たり純資産額)	(19,735円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年 2月18日 至 平成29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>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成29年 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29年 2月17日現在	
期首	平成28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	9,858,123,946円
同期中における追加設定元本額	5,236,508,314円
同期中における一部解約元本額	3,243,069,291円
期末元本額	11,851,562,969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）	977,744,245円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,042,271,430円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	815,865,525円
野村資産設計ファンド2015	26,166,170円
野村資産設計ファンド2020	21,573,932円
野村資産設計ファンド2025	21,229,172円
野村資産設計ファンド2030	24,474,621円
野村資産設計ファンド2035	18,111,690円
野村資産設計ファンド2040	34,196,345円
野村資産設計ファンド2045	2,903,043円
野村インデックスファンド・J-REIT	2,696,117,033円
ネクストコア	211,640,029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	290,342,225円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	741,478,384円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	623,036,619円
野村資産設計ファンド2050	2,714,756円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	18,263円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	12,744円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	23,683円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	23,554円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	45,459円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	3,835,448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）	786,395,032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）	1,176,320,557円
野村DC運用戦略ファンド	333,570,155円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	1,452,855円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成29年 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29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
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	946	459,756,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法人 投資証券	519	180,352,500	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,348	506,552,400	
		産業ファンド投資法人 投資証券	773	395,003,000	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,635	773,372,500	
		ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	674	206,918,000	
		アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,285	687,475,000	
		G L P 投資法人 投資証券	5,456	695,094,400	
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,085	269,514,000	
		日本プロロジスリート投資法人 投資証券	3,646	852,434,800	
		星野リゾート・リート投資法人 投資証券	322	184,828,000	
		S I A 不動産投資法人 投資証券	179	70,884,000	
		イオンリート投資法人 投資証券	2,563	316,530,500	
		ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,999	376,011,900	
		日本リート投資法人 投資証券	765	215,424,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	1,592	162,065,600			
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	144	25,200,000			

積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,727	256,286,800	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	358	38,843,000	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	833	217,413,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	366	36,966,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	541	44,848,900	
ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	164	23,698,000	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	8,165	1,355,390,000	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	493	61,920,800	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	2,147	231,017,200	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	639	59,746,500	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	174	15,625,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	442	145,197,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	347	30,466,600	
さくら総合リート投資法人 投資証券	657	52,822,800	
投資法人みらい 投資証券	347	59,128,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	38	5,563,200	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,756	1,730,768,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,581	1,589,896,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	5,032	1,159,876,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	4,978	886,581,800	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,797	804,157,500	
プレミア投資法人 投資証券	2,571	328,059,600	

	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,908	261,586,800	
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	382	160,058,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	6,023	1,046,797,400	
	森トラスト総合リート投資法人 投 資証券	2,472	457,072,800	
	インヴィンシブル投資法人 投資証 券	6,957	337,066,650	
	フロンティア不動産投資法人 投資 証券	968	485,936,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証 券	1,941	164,596,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法 人 投資証券	1,735	411,021,500	
	福岡リート投資法人 投資証券	1,443	255,555,300	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	798	513,912,000	
	積水ハウス・S Iレジデンシャル投 資法人 投資証券	2,158	267,807,800	
	いちごオフィスリート投資法人 投 資証券	2,840	211,296,000	
	大和証券オフィス投資法人 投資証 券	903	538,188,000	
	阪急リート投資法人 投資証券	1,166	180,496,800	
	スターツプロシード投資法人 投資 証券	491	74,730,200	
	大和ハウスリート投資法人 投資証 券	2,906	815,133,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	7,417	561,466,900	
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	3,201	259,281,000	
	ジャパンエクセレント投資法人 投 資証券	2,549	359,154,100	
小計	銘柄数：58	113,342	22,872,846,350	
	組入時価比率：97.8%		100.0%	
合計			22,872,846,350	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29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	511,443,020	-	513,792,000	2,317,876
合計	511,443,020	-	513,792,000	2,317,876

## (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29年 2月17日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	55,826,174
コール・ローン	26,210,344
投資証券	18,892,966,306
派生商品評価勘定	3,601,888
未収入金	8,828,551
未収配当金	55,092,759
差入委託証拠金	42,939,853
流動資産合計	19,085,465,875
資産合計	19,085,465,875
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	22,971,280
未払利息	34
その他未払費用	185,600
流動負債合計	23,156,914
負債合計	23,156,914
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	8,816,922,680
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	10,245,386,281
元本等合計	19,062,308,961
純資産合計	19,062,308,961
負債純資産合計	19,085,465,875

## 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。 先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.費用・収益の計上基準	<p>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。 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29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	2.1620円
(10,000口当たり純資産額)	(21,620円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年 2月18日 至 平成29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、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。

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。

### 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29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29年 2月17日現在	
期首	平成28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	8,567,191,100円
同期中における追加設定元本額	2,706,060,454円
同期中における一部解約元本額	2,456,328,874円
期末元本額	8,816,922,680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)	939,304,866円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,922,666,412円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	783,790,230円
野村資産設計ファンド2015	25,137,462円
野村資産設計ファンド2020	20,724,409円

野村資産設計ファンド2025	20,393,194円
野村資産設計ファンド2030	23,512,297円
野村資産設計ファンド2035	17,399,271円
野村資産設計ファンド2040	32,851,647円
野村資産設計ファンド2045	2,788,306円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,727,010,557円
ネクストコア	53,789,241円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	184,563,025円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	643,282,281円
野村資産設計ファンド2050	2,607,527円
インデックス・ブレンド（タイプ）	16,602円
インデックス・ブレンド（タイプ）	11,749円
インデックス・ブレンド（タイプ）	21,898円
インデックス・ブレンド（タイプ）	21,222円
インデックス・ブレンド（タイプ）	41,761円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	12,742,367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）	510,156,494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）	808,342,099円
野村DC運用戦略ファンド	85,452,862円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	294,901円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成29年 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29年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	12,100	383,086.00	
		AGREE REALTY CORP	3,700	177,970.00	
		ALEXANDERS INC	530	230,984.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,220	1,531,140.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,100	263,642.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	20,400	1,011,432.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	33,500	767,820.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	24,200	1,093,114.00	

APPLE HOSPITALITY REIT INC	23,600	481,676.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,800	66,240.00	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	3,200	42,240.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,100	92,928.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,900	3,742,563.00	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	56,952.00	
BOSTON PROPERTIES	23,390	3,200,687.60	
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,600	434,644.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	40,400	949,804.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,210	1,081,502.70	
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	12,900	317,985.00	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	9,000	138,870.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	25,900	269,360.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	72,480.00	
CHATHAM LODGING TRUST	5,900	120,124.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,200	235,428.00	
CITY OFFICE REIT INC	3,300	42,900.00	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	85,400	1,215,242.00	
COLONY STARWOOD HOMES	7,500	240,600.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,500	425,685.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,000	45,700.00	
CORECIVIC INC	17,700	578,613.00	
CORESITE REALTY CORP	5,060	438,702.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,300	474,045.00	
COUSINS PROPERTIES INC	51,400	448,208.00	
CUBESMART	27,900	718,983.00	
CYRUSONE INC	11,210	530,569.30	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13,700	642,941.00	
DDR CORP	47,600	689,724.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	30,600	346,392.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	24,170	2,492,893.80	
DOUGLAS EMMETT INC	22,200	868,464.00	
DUKE REALTY CORP	54,600	1,379,196.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	11,700	572,715.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	3,100	62,868.00	

INC			
EASTGROUP PROPERTIES	4,890	349,537.20	
EDUCATION REALTY TRUST INC	11,100	452,325.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	19,300	402,019.00	
EPR PROPERTIES	9,590	720,209.00	
EQUITY COMMONWEALTH	18,900	590,247.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,380	942,489.40	
EQUITY ONE INC	14,100	438,933.00	
EQUITY RESIDENTIAL	55,650	3,443,622.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,050	2,290,194.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,350	1,448,734.50	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	59,840.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,030	1,549,715.00	
FELCOR LODGING TRUST INC	20,100	148,539.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,600	464,640.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,400	86,940.00	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	32,700	747,195.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,100	194,740.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,800	192,128.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,000	953,100.00	
GEO GROUP INC/THE	11,700	527,319.00	
GETTY REALTY CORP	3,921	102,102.84	
GGP INC	88,700	2,217,500.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	72,936.00	
GLOBAL NET LEASE INC	25,200	206,136.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	11,000	215,050.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	21,200	579,820.00	
HCP INC	71,700	2,221,266.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17,500	541,450.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	22,000	674,740.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,900	123,900.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,080	766,667.20	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	25,400	821,944.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	112,400	2,088,392.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	22,600	804,786.00	
	9,000	84,150.00	

INDEPENDENCE REALTY TRUST IN			
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	18,300	119,133.00	
IRON MOUNTAIN INC	37,700	1,394,900.00	
ISTAR INC	10,500	123,375.00	
KILROY REALTY CORP	15,050	1,146,960.50	
KIMCO REALTY CORP	65,300	1,582,219.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	12,700	293,878.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	17,100	519,498.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	33,500	373,860.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	22,700	888,932.00	
LIFE STORAGE INC	7,010	592,064.60	
LTC PROPERTIES INC	6,000	279,540.00	
MACERICH CO /THE	18,600	1,243,224.00	
MACK-CALI REALTY CORP	13,500	379,485.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	87,000	75,255.00	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,100	34,844.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	49,700	663,495.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,440	1,734,756.80	
MONMOUTH REIT-CLASS A	10,100	145,339.00	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	25,600	259,072.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,700	1,010,377.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6,700	155,507.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,900	436,482.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,500	129,375.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	70,500.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	7,600	92,644.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,100	954,471.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,100	50,085.00	
PARKWAY INC	6,473	139,169.50	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,000	320,980.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,500	181,335.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	20,100	388,533.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,000	488,620.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	3,500	49,280.00	

PROLOGIS INC	80,900	4,054,708.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,900	335,385.00	
PUBLIC STORAGE	22,720	5,012,940.80	
QTS REALTY TRUST INC CL A	7,480	376,244.00	
QUALITY CARE PROPERTIES	14,900	276,097.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12,200	196,786.00	
REALTY INCOME CORP	39,280	2,379,582.40	
REGENCY CENTERS CORP	16,100	1,119,272.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,200	362,060.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	35,800	538,432.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	10,200	231,336.00	
RLJ LODGING TRUST	18,700	442,255.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,710	499,608.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10,100	257,247.00	
SAUL CENTERS INC	1,700	110,381.00	
SELECT INCOME REIT	9,800	252,252.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	36,800	728,640.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	3,500	157,045.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5,600	99,232.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	8,582,722.00	
SL GREEN REALTY CORP	15,370	1,701,612.70	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	74,800	805,596.00	
STAG INDUSTRIAL INC	11,500	276,805.00	
STORE CAPITAL CORP	24,200	588,060.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,500	218,430.00	
SUN COMMUNITIES INC	9,970	807,470.30	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,700	503,907.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,000	501,150.00	
TAUBMAN CENTERS INC	9,370	637,253.70	
TERRENO REALTY CORP	6,600	180,774.00	
TIER REIT INC	7,200	129,024.00	
UDR INC	41,100	1,457,817.00	
UMH PROPERTIES INC	3,600	51,192.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,900	120,080.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	14,400	393,984.00	

	URSTADT BIDDLE-CL A	3,900	86,346.00	
	VENTAS INC	53,880	3,371,271.60	
	VEREIT INC	147,500	1,290,625.00	
	VORNADO REALTY TRUST	26,150	2,875,977.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	28,500	267,900.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	11,300	368,945.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	18,300	658,251.00	
	WELLTOWER INC	55,180	3,646,294.40	
	WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,000	16,900.00	
	WHITESTONE REIT	4,200	59,052.00	
	WP CAREY INC	16,390	1,038,470.40	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,900	310,453.00	
小計	銘柄数：158	3,315,404	121,193,476.24 (13,751,823,748)	
	組入時価比率：72.1%		72.7%	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	1,500	17,145.00	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	6,700	236,979.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	11,100	139,860.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,500	171,115.00	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	2,000	62,820.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,500	335,055.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5,600	273,840.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	99,820.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,500	199,530.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	6,700	91,053.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	75,852.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	10,400	101,400.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,400	38,544.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	168,588.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,300	150,513.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,900	484,671.00	

	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,200	40,196.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,600	58,420.00	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ES	5,600	118,384.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	48,510.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	66,650.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	3,500	75,880.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4,700	47,752.00	
	ONEREIT	6,570	24,637.50	
	PLAZA RETAIL REIT	7,500	38,700.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,000	100,130.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,200	647,592.00	
	SLATE OFFICE REIT	2,100	16,926.00	
	SLATE RETAIL REIT	2,300	33,005.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,700	322,234.00	
小計	銘柄数：30	220,970	4,285,801.50	
			(371,836,138)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
ユーロ	AEDIFICA	2,230	160,560.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	16,600	187,912.00	
	ALTAREA	355	61,841.00	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	8,300	112,340.50	
	BEFIMMO S.C.A.	3,455	178,278.00	
	BENI STABILI SPA	168,000	96,516.00	
	COFINIMMO	3,050	323,147.50	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	7,500	255,562.50	
	FONCIERE DES REGIONS	8,020	629,409.60	
	GECINA SA	6,240	762,216.00	
	GREEN REIT PLC	100,509	139,204.96	
	HAMBORNER REIT AG	12,100	114,139.30	
	HIBERNIA REIT PLC	112,000	143,248.00	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	16,900	194,350.00	
	ICADE	7,020	483,888.60	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	53,604	40,122.59	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,900	45,600.00	

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	52,800	64,416.00	
	KLEPIERRE	31,300	1,132,747.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,210	103,235.65	
	MERCIALYS	8,380	150,211.50	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	72,600	796,422.00	
	MONTEA SCA	940	42,441.00	
	NSI NV	24,000	91,824.00	
	RETAIL ESTATES	870	64,388.70	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	15,210	3,397,153.50	
	VASTNED RETAIL NV	2,820	96,838.80	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,520	222,213.60	
	WERELDHAVE BELGIUM	290	29,797.50	
	WERELDHAVE NV	6,000	253,440.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	500	17,725.00	
小計	銘柄数：31	760,223	10,391,190.80	
			(1,257,334,086)	
	組入時価比率：6.6%		6.7%	
英債券	ASSURA PLC	256,000	144,256.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	22,500	162,787.50	
	BRITISH LAND	157,600	957,420.00	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	64,000	36,800.00	
	DERWENT LONDON PLC	17,200	448,576.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	67,200	73,416.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	52,200	337,734.00	
	HAMMERSON PLC	121,200	682,962.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	121,000	141,570.00	
	INTU PROPERTIES PLC	135,000	366,390.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,500	1,278,180.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	101,000	150,591.00	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	14,200	29,021.25	
	MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	7,200	34,560.00	
	NEWRIVER REIT PLC	35,000	115,290.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	91,000	96,915.00	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	193,000	72,162.70	
	REGIONAL REIT LTD	26,000	26,845.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	33,000	125,961.00	

小計	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	78,700	46,039.50	
	SEGRO PLC	124,800	602,784.00	
	SHAFTESBURY PLC	42,100	379,952.50	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	164,000	234,356.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	17,800	136,793.00	
	銘柄数：24	2,063,200	6,681,362.45	(947,083,127)
組入時価比率：5.0%			5.0%	
豪ドル	360 CAPITAL GROUP LTD	19,000	16,625.00	
	ABACUS PROPERTY GROUP	45,000	134,100.00	
	ALE PROPERTY GROUP	26,000	113,360.00	
	ARENA REIT	35,220	71,496.60	
	ASPEN GROUP	13,000	13,650.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	7,000	44,520.00	
	BWP TRUST	73,000	210,970.00	
	CENTURIA URBAN REIT	11,100	24,864.00	
	CHARTER HALL GROUP	63,000	311,850.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	25,000	97,500.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	48,000	204,960.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	177,000	179,655.00	
	DEXUS PROPERTY GROUP	148,100	1,384,735.00	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	33,250	86,450.00	
	GDI PROPERTY GROUP	70,300	69,245.50	
	GENERATION HEALTHCARE REIT	22,000	41,360.00	
	GOODMAN GROUP	245,100	1,779,426.00	
	GPT GROUP	271,000	1,322,480.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,550	83,898.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	62,596.80	
	INDUSTRIA REIT	23,000	47,610.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	22,000	59,620.00	
	INVESTA OFFICE FUND	97,000	452,020.00	
	MIRVAC GROUP	561,000	1,206,150.00	
NATIONAL STORAGE REIT	71,018	102,976.10		
PROPERTYLINK GROUP	109,000	87,745.00		
SCENTRE GROUP	809,000	3,575,780.00		

小計	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	109,100	240,020.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	370,000	1,676,100.00	
	VICINITY CENTRES	504,000	1,456,560.00	
	VIVA ENERGY REIT	56,000	131,600.00	
	WESTFIELD CORP	293,400	2,643,534.00	
	銘柄数：32	4,405,818	17,933,457.00	
	組入時価比率：8.2%		(1,564,873,457)	8.3%
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	138,000	142,140.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	153,000	194,310.00	
	INVESTORE PROPERTY LTD	32,000	44,480.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	188,000	268,840.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	158,571	195,042.33	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	67,525	109,728.12	
	STRIDE STAPLED GROUP	58,000	103,240.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	48,033	98,227.48	
小計	銘柄数：8	843,129	1,156,007.93	
			(94,549,888)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
香港ドル	CHAMPION REIT	328,000	1,436,640.00	
	FORTUNE REIT	211,000	1,846,250.00	
	LINK REIT	342,000	18,143,100.00	
	PROSPERITY REIT	180,000	572,400.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	120,000	260,400.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	124,000	400,520.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	140,000	652,400.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	160,000	739,200.00	
小計	銘柄数：8	1,605,000	24,050,910.00	
			(351,624,304)	
	組入時価比率：1.8%		1.9%	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	89,400	119,796.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	129,000	95,460.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	358,000	884,260.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	130,000	151,450.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	127,000	102,870.00	

	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	153,300	90,447.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	335,000	514,225.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	406,000	793,730.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	110,000	156,200.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	113,000	155,375.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	100,000	59,500.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	83,500	106,045.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	94,000	188,940.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	85,000	109,225.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	158,000	149,310.00	
	KEPPEL DC REIT	119,756	139,515.74	
	KEPPEL REIT	285,000	289,275.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	282,800	108,878.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	273,025	412,267.75	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	271,900	265,102.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	180,000	301,500.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	230,900	244,754.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	79,650	55,356.75	
	QUE HOSPITALITY TRUST	160,043	109,629.45	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	59,000	142,190.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,764	58,856.16	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	106,700	68,821.50	
	SPH REIT	120,500	116,885.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	209,900	157,425.00	
	SUNTEC REIT	388,000	669,300.00	
小計	銘柄数：30	5,372,138	6,816,589.85	
			(545,872,515)	
	組入時価比率：2.9%		2.9%	
新シェケル	REIT 1 LTD	22,490	261,108.90	
小計	銘柄数：1	22,490	261,108.90	
			(7,969,043)	
	組入時価比率：0.0%		0.0%	
合計			18,892,966,306	
			(18,892,966,306)	

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年 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	152,016,891	-	155,618,779	3,601,888
合計	152,016,891	-	155,618,779	3,601,888

(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。

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29年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,508,336,364
地方債証券	652,646,408
特殊債券	6,523,775,644
社債券	4,706,796,716
コマーシャル・ペーパー	899,997,765
未収利息	22,484,636
前払費用	19,877,477
流動資産合計	20,333,915,010
資産合計	20,333,915,010
負債の部	
流動負債	
未払金	580,648,200
未払解約金	7,499,791
未払利息	9,913
流動負債合計	588,157,904
負債合計	588,157,904
純資産の部	

(平成29年 2月17日現在)

元本等	
元本	19,340,960,304
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	404,796,802
元本等合計	19,745,757,106
純資産合計	19,745,757,106
負債純資産合計	20,333,915,010

## 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29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	1.0209円
(10,000口当たり純資産額)	(10,209円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年 2月18日 至 平成29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。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>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 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29年 2月17日現在	
期首	平成28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	21,717,696,368円
同期中における追加設定元本額	3,918,288,900円
同期中における一部解約元本額	6,295,024,964円
期末元本額	19,340,960,304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	3,583,437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	129,079,077円
野村新中国株投資 マネープール・ファンド	17,198,352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	453,009,045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	23,365,011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	21,092,851円
野村・グリーン・テクノロジー マネープール・ファンド	1,020,305円
野村新興国消費関連株投信 マネープール・ファンド	5,543,507円
野村世界業種別投資シリーズ（マネープール・ファンド）	11,889,368円
ノムラ・アジア・シリーズ（マネープール・ファンド）	52,240,117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	4,691,292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	1,937,870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	3,826,372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	2,302,497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
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252円
野村ドイチェ・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
野村ドイチェ・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
野村ドイチェ・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
野村ドイチェ・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
野村ドイチェ・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
野村ドイチェ・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
野村ドイチェ・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
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	2,952,997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
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795円
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795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)	5,423,785,404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)	4,206,288,588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)	3,161,244,481円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Yプライス(適格機関投資家専用)	1,022,526,935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
野村DC運用戦略ファンド	379,067,282円
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Aコース	9,818円
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Bコース	9,818円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成29年 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29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	北海道 公募平成18年度第12回	50,000,000	50,030,693	
		北海道 公募(5年)平成23年度第14回	200,000,000	200,076,800	
		神奈川県 公募第145回	100,000,000	100,149,768	
		広島県 公募平成18年度第4回	200,000,000	200,376,589	
		福島県 公募平成23年度第2回	100,000,000	100,011,814	
		川崎市 公募(5年)第31回	2,000,000	2,000,744	
	小計	銘柄数:6 組入時価比率:3.3%	652,000,000	652,646,408	5.1%
合計			652,646,408		
特殊債券	日本円	日本政策投資銀行社債 財投機関債第21回	200,000,000	200,074,448	
		地方公共団体金融機構債券(5年)第9回	100,000,000	100,070,692	
		地方公共団体金融機構債券(2年)第2回	200,000,000	200,033,480	
		国際協力銀行債券 第27回財投機関債	100,000,000	100,136,800	
		都市再生債券 財投機関債第14回	100,000,000	100,146,600	
		中部国際空港社債 財投機関債第2回	1,500,000,000	1,500,208,039	
		住宅金融支援機構債券 財投機関債第2回	280,000,000	280,374,278	

		日本学生支援債券 財投機関債第3 8回	400,000,000	400,026,342	
		商工債券 利付第741回い号	100,000,000	100,007,693	
		商工債券 利付第743回い号	300,000,000	300,241,166	
		商工債券 利付第745回い号	200,000,000	200,254,360	
		商工債券 利付第751回い号	20,000,000	20,044,720	
		農林債券 利付第741回い号	200,000,000	200,028,814	
		農林債券 利付第742回い号	200,000,000	200,103,200	
		しんきん中金債券 利付第267回	100,000,000	100,014,720	
		しんきん中金債券 利付第268回	500,000,000	500,214,681	
		しんきん中金債券 利付第269回	80,000,000	80,058,206	
		しんきん中金債券 利付第270回	100,000,000	100,093,327	
		しんきん中金債券 利付第271回	300,000,000	300,384,577	
		商工債券 利付(3年)第169回	100,000,000	100,009,620	
		商工債券 利付(3年)第171回	200,000,000	200,086,817	
		商工債券 利付(3年)第173回	500,000,000	500,383,852	
		東日本高速道路 第18回	130,000,000	130,319,581	
		中日本高速道路社債 第15回	530,000,000	530,391,736	
		中日本高速道路社債 第53回	80,000,000	80,067,895	
	小計	銘柄数: 25 組入時価比率: 33.0%	6,520,000,000	6,523,775,644 51.1%	
	合計			6,523,775,644	
社債券	日本円	ポヨラ・バンク・ピーエルシー 第 3回円貨社債(2014)	200,000,000	200,189,942	
		みずほコーポレート銀行 第7回特 定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,908,968	
		みずほコーポレート銀行 第29回 特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,244,315	
		みずほコーポレート銀行 第30回 特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,320,400	
		ホンダファイナンス 第18回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,038,520	
		ホンダファイナンス 第19回社債 間限定同順位特約付	200,000,000	200,259,962	
		日立キャピタル 第43回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,189,544	
		三井住友ファイナンス&リース 第 4回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,042,567	

		三菱UFJリース 第17回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,016,854	
		三菱UFJリース 第19回社債間 限定同順位特約付	300,000,000	300,391,188	
		三菱地所 第79回担保提供制限等 財務上特約無	600,000,000	600,783,533	
		東日本旅客鉄道 第5回	500,000,000	500,364,830	
		西日本鉄道 第38回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,303,000	
		日本電信電話 第52回	1,300,000,000	1,301,614,972	
		中部電力 第411回	100,000,000	100,558,327	
		大阪瓦斯 第7回社債間限定同順位 特約付	200,000,000	200,569,794	
	小計	銘柄数：16 組入時価比率：23.8%	4,700,000,000	4,706,796,716	36.8%
	合計			4,706,796,716	
コマーシャル・ ペーパー	日本円	三井住友F&L	200,000,000	199,999,752	
		三井住友F&L	200,000,000	199,999,640	
		三井住友F&L	200,000,000	199,999,528	
		三井住友F&L	200,000,000	199,999,416	
		三井住友F&L	100,000,000	99,999,429	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：4.6%	900,000,000	899,997,765	7.0%
	合計			899,997,765	
合計				12,783,216,533	

(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29年 3月31日現在

資産総額	10,735,695,892円
負債総額	3,481,742,093円
純資産総額（ - ）	7,253,953,799円
発行済口数	6,784,595,760口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0692円

## （参考）国内株式マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	372,804,526,322円
負債総額	53,634,468,728円
純資産総額（ - ）	319,170,057,594円
発行済口数	221,566,331,400口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4405円

## （参考）国内債券マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	16,418,128,688円
負債総額	162,801,755円
純資産総額（ - ）	16,255,326,933円
発行済口数	12,174,408,831口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3352円

## （参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	364,991,347,743円
負債総額	638,867,425円
純資産総額（ - ）	364,352,480,318円
発行済口数	157,848,148,117口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3082円

## （参考）外国債券マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	652,625,308,368円
負債総額	624,261,356円
純資産総額（ - ）	652,001,047,012円
発行済口数	303,724,840,423口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1467円

## （参考）新興国株式マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	20,655,074,733円
負債総額	93,373,249円
純資産総額（ - ）	20,561,701,484円
発行済口数	18,425,596,627口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1159円

## （参考）新興国債券マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	8,933,239,598円
負債総額	163,217,697円
純資産総額（ - ）	8,770,021,901円
発行済口数	4,835,214,814口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8138円

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	4,941,801,828円
負債総額	371,913,225円
純資産総額（ - ）	4,569,888,603円
発行済口数	3,542,580,255口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2900円

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	30,130,625,337円
負債総額	1,268,674,789円
純資産総額（ - ）	28,861,950,548円
発行済口数	14,666,428,495口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9679円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	18,877,578,649円
負債総額	37,553,801円
純資産総額（ - ）	18,840,024,848円
発行済口数	8,870,752,092口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1238円

（参考）野村マネー マザーファンド

平成29年 3月31日現在

資産総額	19,550,293,351円
負債総額	297,599,920円
純資産総額（ - ）	19,252,693,431円
発行済口数	18,858,441,003口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0209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29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。

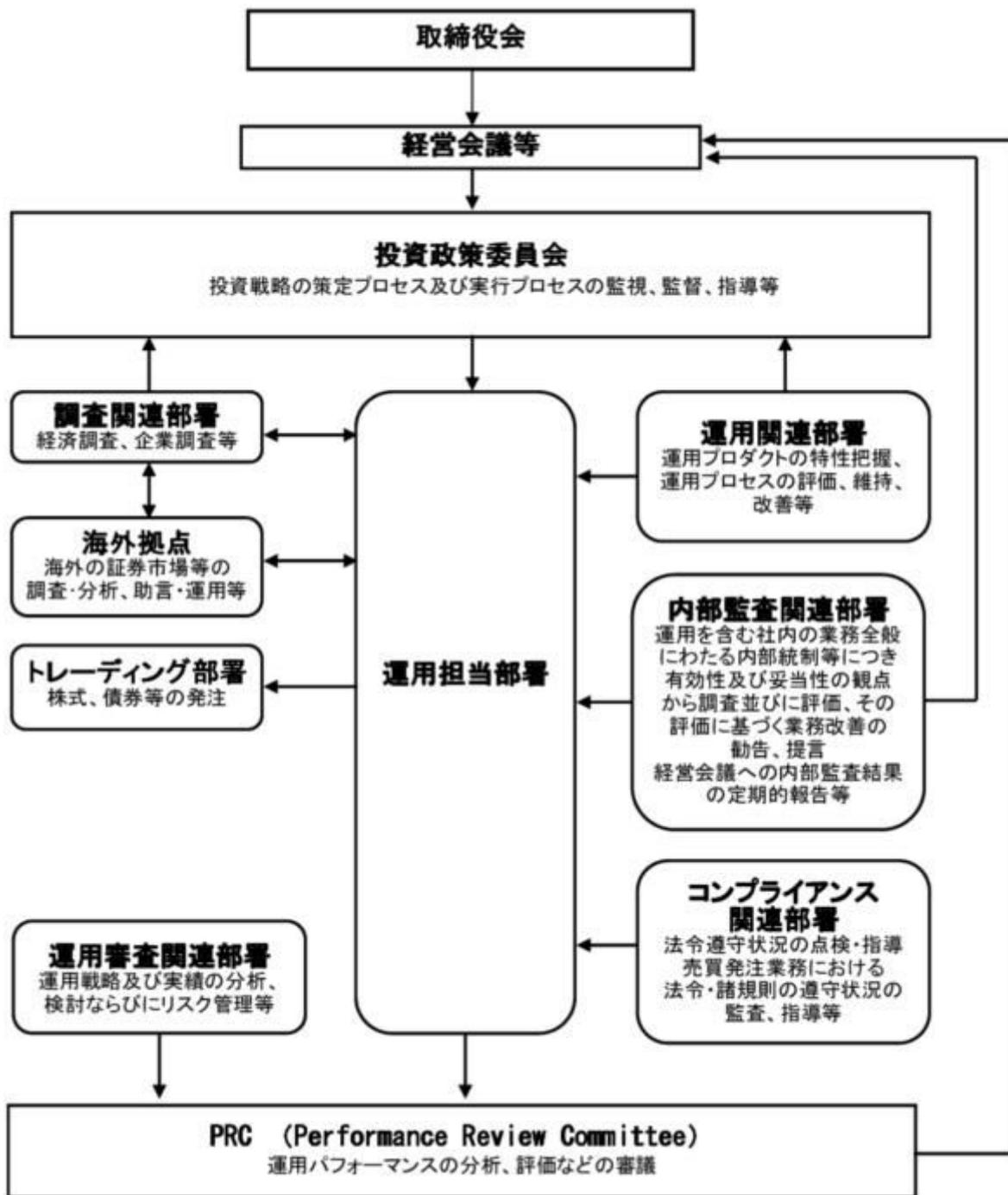
###### 代表執行役・執行役

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29年2月28日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
----	----	------------

追加型株式投資信託	944	20,980,509
単位型株式投資信託	67	306,824
追加型公社債投資信託	15	5,940,030
単位型公社債投資信託	328	1,937,875
合計	1,354	29,165,239

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		411	208
金銭の信託		56,824	55,341
有価証券		17,100	24,100
前払金		15	34
前払費用		29	2
未収入金		330	511
未収委託者報酬		12,679	14,131
未収運用受託報酬		7,436	7,309
繰延税金資産		2,594	2,028
その他		73	56
貸倒引当金		9	10
流動資産計		97,486	103,715
固定資産			

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

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

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

## (2) 【損益計算書】

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金

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

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

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

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="687 353 986 479"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 外国税支払損失引当金 将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p>								
5. 消費税等の会計処理方法	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p>								
6. 連結納税制度の適用	<p>連結納税制度を適用しております。</p>								

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

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

## 損益計算書関係

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

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## （２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## ２．金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### （1）金融商品に対する取組方針

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

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

### （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

    その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

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

4．その他有価証券(平成27年3月31日)

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

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

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成28年3月31日)

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

4．その他有価証券(平成28年3月31日)

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

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

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

## 退職給付関係

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企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	17,218 百万円
勤務費用	811
利息費用	181
数理計算上の差異の発生額	1,150
退職給付の支払額	654
その他	13
退職給付債務の期末残高	18,692

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

## 税効果会計関係

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

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

## 企業結合等関係

## 1. 会社分割について

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

## (1) 企業結合の概要

### 会社分割の目的

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

### 会社分割日程

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

### 会社分割の方法

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

## (2) 実施した会計処理の概要

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

## 2. 吸収合併について

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

## (1) 企業結合の概要

### 吸収合併の目的

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

### 吸収合併日程

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

### 吸収合併の方法

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

## (2) 実施した会計処理の概要

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

### セグメント情報等

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

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

品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

### 売上高

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

### 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

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

### (2) 地域ごとの情報

#### 売上高

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

### (イ) 子会社等

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

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

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

(株)野村総合研究所

流動資産合計 229,418

固定資産合計 273,220

流動負債合計 87,832

固定負債合計 65,965

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

### (イ) 子会社等

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

### (ウ) 兄弟会社等

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

### (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

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

### 1株当たり情報

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

### 中間財務諸表

#### 中間貸借対照表

		平成28年9月30日現在
--	--	--------------

区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		231
金銭の信託		54,692
有価証券		4,400
未収委託者報酬		13,740
未収運用受託報酬		7,312
繰延税金資産		907
その他		612
貸倒引当金		10
流動資産計		81,887
固定資産		
有形固定資産	1	1,065
無形固定資産		7,506
ソフトウェア		7,505
その他		0
投資その他の資産		21,276
投資有価証券		7,976
関係会社株式		10,341
前払年金費用		2,689
その他		269
固定資産計		29,848
資産合計		111,736

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

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

## 中間損益計算書

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

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計	
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			利益 剰余金 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		

当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当中間期変動額									
剰余金の配当							34,973	34,973	34,973
中間純利益							13,781	13,781	13,781
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額 (純額)									
当中間期変動額合 計	-	-	-	-	-	-	21,191	21,191	21,191
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	22,213	47,505	78,415

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの...中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの...移動平均法による原価法
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法によっております。  (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
4 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

<p>5 消費税等の会計処理</p> <p>6 連結納税制度の適用</p>	<p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。</p> <p>退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---------------------------------------	--

## [会計方針の変更]

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

なお、当中間会計期間において、中間財務諸表に与える影響額は軽微であります。

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

平成28年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	3,889百万円
2 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。	

## 中間損益計算書関係

<p>自 平成28年4月1日</p> <p>至 平成28年9月30日</p>
--

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

## 中間株主資本等変動計算書関係

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

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	231	231	-
(2)金銭の信託	54,692	54,692	-
(3)未収委託者報酬	13,740	13,740	-
(4)未収運用受託報酬	7,312	7,312	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,173	11,173	-
(6)関係会社株式	3,064	165,608	162,544

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,202百万円、関係会社株式7,277百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券」「(6) 関係会社株式」には含めておりません。

## 有価証券関係

当中間会計期間末（平成28年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(平成28年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(平成28年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	165,608	162,544
合計	3,064	165,608	162,544

## 3．その他有価証券(平成28年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの 株式	6,773	282	6,490
小計	6,773	282	6,490
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの 譲渡性預金	4,400	4,400	-
小計	4,400	4,400	-
合計	11,173	4,682	6,490

## セグメント情報等

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

## 1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 1 株当たり情報

		自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日
1株当たり純資産額		16,090円12銭
1株当たり中間純利益		2,675円66銭
(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。		
2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。		
	中間純利益	13,781百万円
	普通株主に帰属しない金額	-
	普通株式に係る中間純利益	13,781百万円
	期中平均株式数	5,150千株

## [ 重要な後発事象 ]

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

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

## 1. 配当財産の種類及び帳簿価額

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

## 2. 剰余金の配当効力発生日

平成28年10月27日（木）

## 3. 配当原資

利益剰余金

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

\* 平成29年2月末現在

#### (2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引
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	業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社 大垣共立銀行	36,166百万円	
株式会社 山陰合同銀行	20,705百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社 南都銀行	29,249百万円	
株式会社 西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社 八十二銀行	52,243百万円	
株式会社 百五銀行	20,000百万円	
株式会社 広島銀行	54,573百万円	
株式会社 北洋銀行	121,101百万円	
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 武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社 山梨中央銀行	15,400百万円	
富国生命保険相互会社	116,000百万円 <sup>1</sup>	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29年2月末現在

1 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。
- (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28年6月6日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

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

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

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

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成29年4月7日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 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28年2月18日から平成29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29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28年11月21日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。