

## 【表紙】

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

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

野村DC運用戦略ファンドA

（以下「ファンド」といいます。）

### （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。)

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。

「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

### （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。

なお、販売会社や申込形態によっては、申込単位が上記と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

平成28年5月12日から平成29年5月11日まで

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

(8)【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

(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、「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、「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

(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】

該当事項はありません。



## 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。

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。

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、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A）

##### 《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
追加型	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

## 《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル (日本を含む)		
一般				
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		北米	ファミリーファンド	あり (適時ヘッジ)
一般	年6回 (隔月)	欧州		
公債		アジア		
社債	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他債券 クレジット属性 ( )	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
不動産投信	その他 ( )	アフリカ		
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))		中近東 (中東)		
資産複合 ( )		エマージング		
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。

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### 株式

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

##### 債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

- (1)資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

[ 投資形態による属性区分 ]

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

[ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

[ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

[ 特殊型 ]

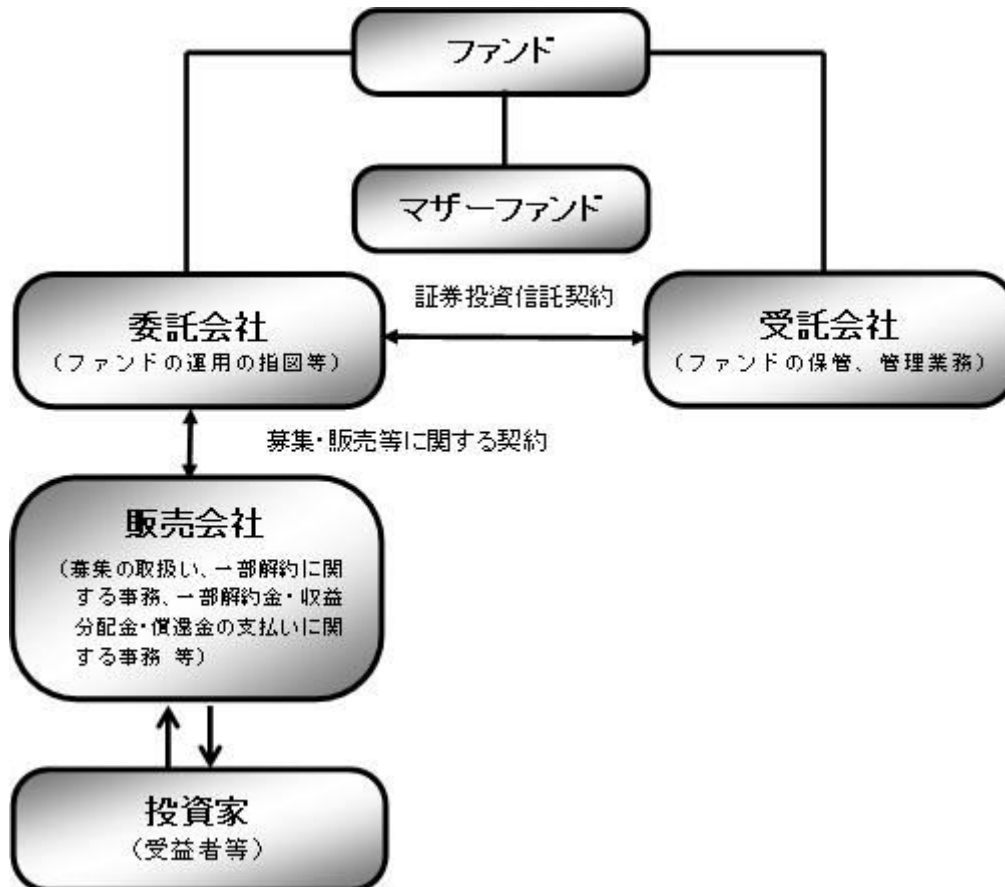
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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



## (2) 【ファンドの沿革】

平成25年3月29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】

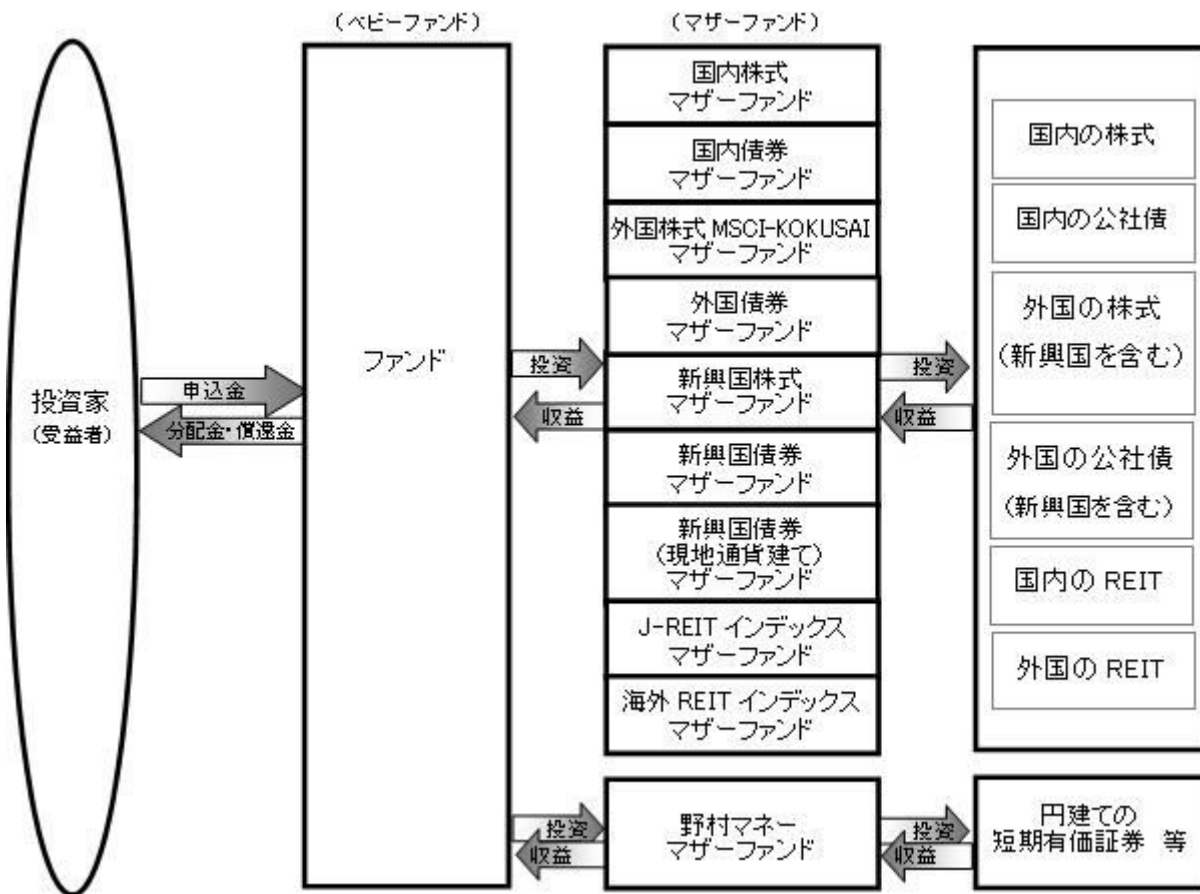


ファンド	野村DC運用戦略ファンドA
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド 国内債券マザーファンド 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 外国債券マザーファンド 新興国株式マザーファンド 新興国債券マザーファンド 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド J-REITインデックス マザーファンド 海外REITインデックス マザーファンド 野村マネー マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

## 《ファミリーファンド方式について》

ファンドは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。

#### 委託会社の概況(平成28年3月末現在)

##### ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

##### ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

##### ・資本金の額

17,180百万円

##### ・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立  
 平成9年(1997年)10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更  
 平成12年(2000年)11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更  
 平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

##### ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

[1] 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。なお、市場環境等によってはポートフォリオのリスク水準をより引き下げた運用を行なう場合があります。
- 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。

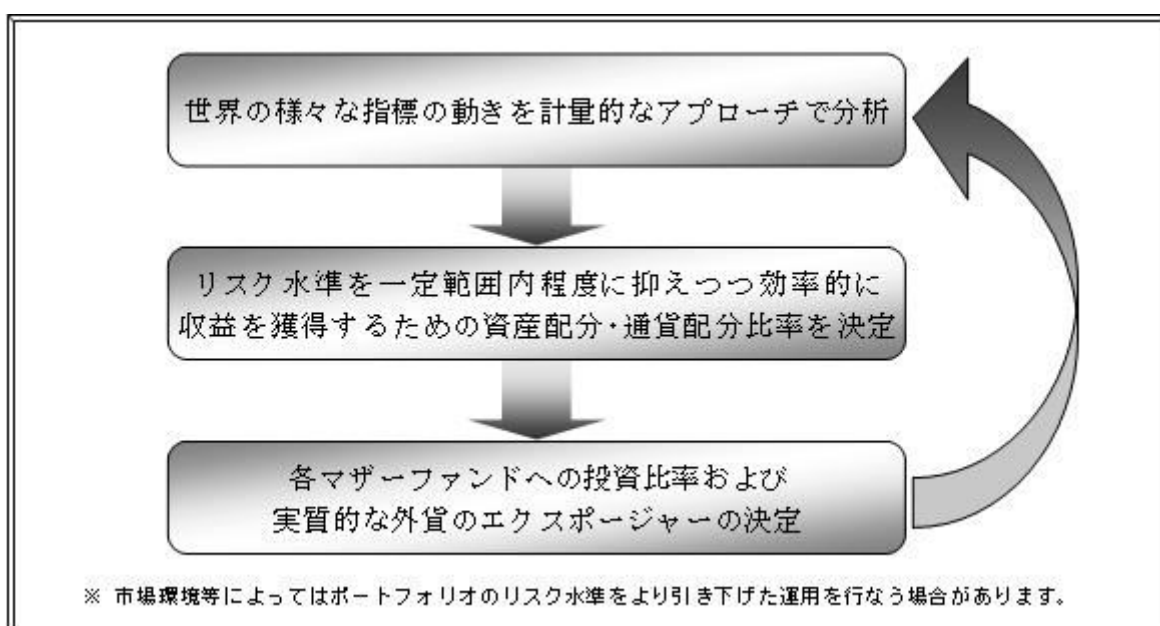
実質的な内外の株式 およびREITへの投資比率	実質的な外貨の エクスポージャー
純資産総額の70%以内	純資産総額の70%以内

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70%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70%以内となるように調整を行いません。

#### 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いません。
- ・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いません。

「NOMURA-BPI国債指数」は、野村証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いません。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、現地通貨建てのエマージング・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いません。
- ・ 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いません。
- ・ REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
- ・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。  
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いません。
- ・ 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。

#### 投資の対象とする資産の種類(信託約款)

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。）

イ．有価証券

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

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

- 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だす資産

- ・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
- ・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等(信託約款)

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書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
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す。 )
6. 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。 )
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。 )
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。 )
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。 )
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券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等(信託約款)

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・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」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」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」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

買っ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いません。

#### 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ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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（預託証券）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ないます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する

比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(新興国債券マザーファンド)

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

(新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド)

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

## 2.運用方法

### (1)投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

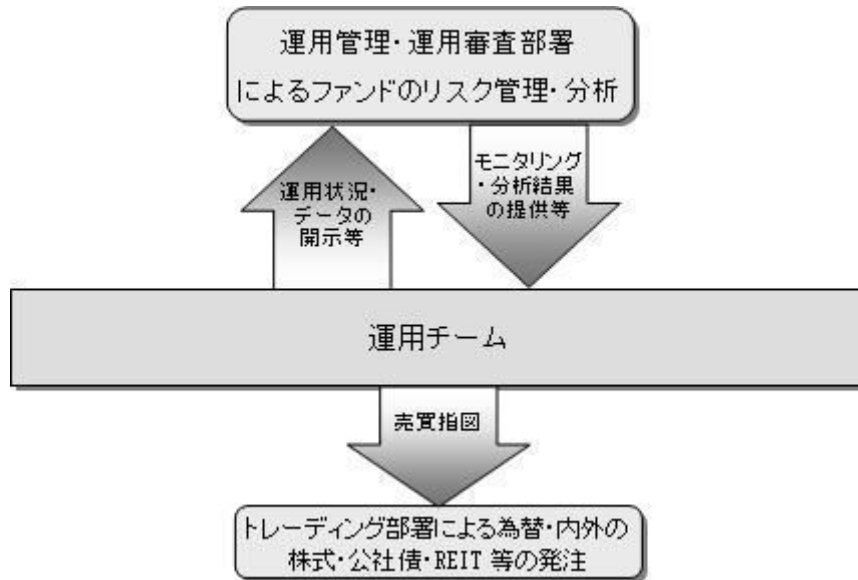
スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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】

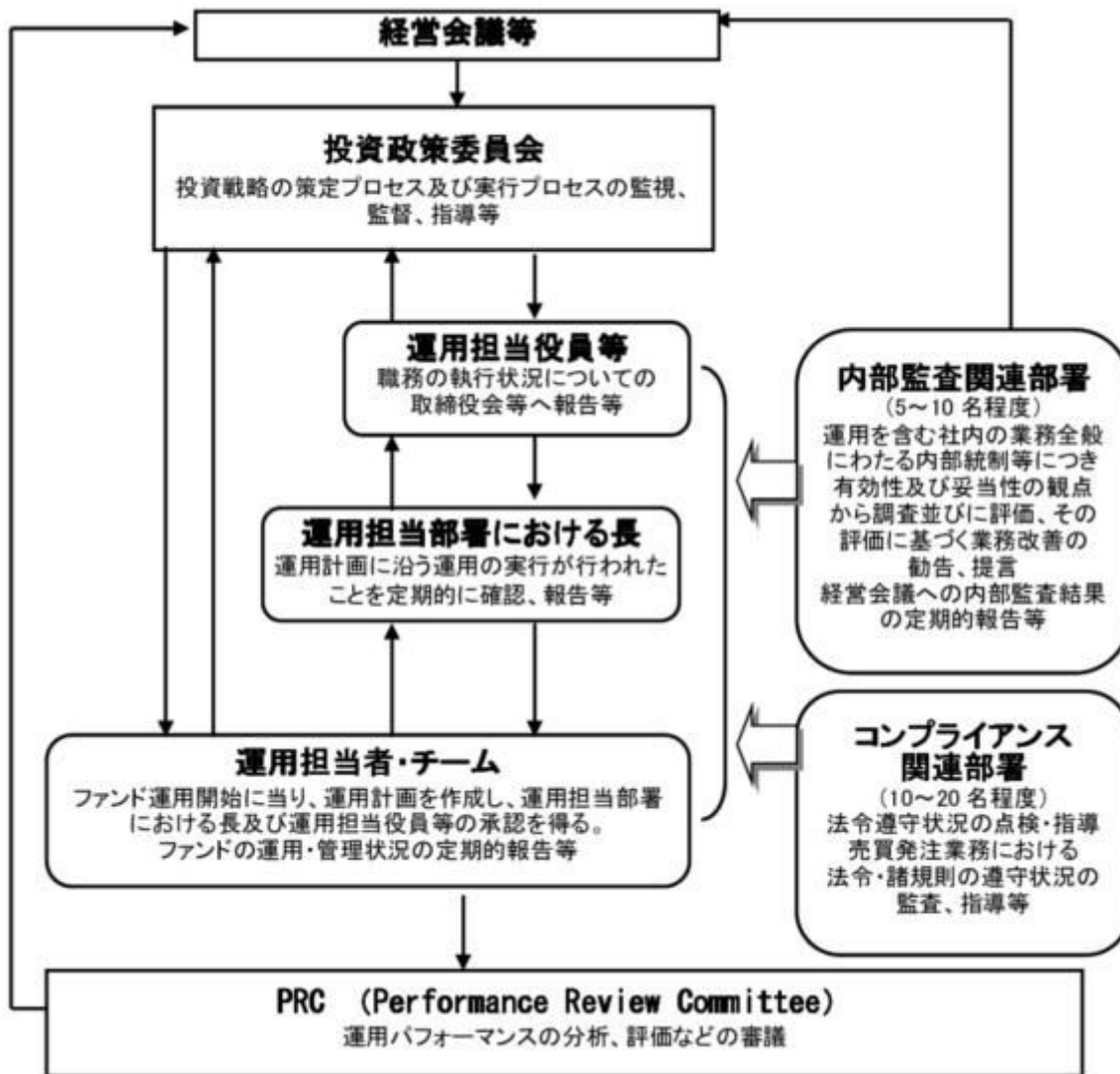
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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。

\* 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。

### （５）【投資制限】

#### 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はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 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（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。
- ・ 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。

#### 投資する株式等の範囲(信託約款)

- （ ）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。

#### 信用取引の指図範囲(信託約款)

- （ ）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券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等の運用指図(信託約款)

- ( ) 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(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引および有価証券店頭指数等スワップ取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ホに掲げるものをいいます。以下同じ。)(これらを総称して以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ( ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ( ) 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ( ) 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(信託約款)

- ( ) 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(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ( ) 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券（外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。）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(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( ) 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( ) 直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ( ) 委託者は、直物為替先渡取引を行なうにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 資金の借入れ(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

- ( )一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ( )収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ( )借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### 基準価額の変動要因

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

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

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の株価変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。

#### [REITの価格変動リスク]

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

#### [債券価格変動リスク]

債券(公社債等)は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の債券価格の変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。

#### [為替変動リスク]

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

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

## その他の留意点

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

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

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

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

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

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

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

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

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

国内株式マザーファンドについて



## 「東証株価指数(TOPIX)」

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「㈱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㈱東京証券取引所が有します。

㈱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。

㈱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。

㈱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㈱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、㈱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、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、㈱東京証券取引所は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## 国内債券マザーファンドについて

## 「NOMURA-BPI国債指数」

「NOMURA-BPI国債指数」は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

## 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて

## 新興国株式マザーファンドについて

## 「MSCI-KOKUSAI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。

## 外国債券マザーファンドについて

「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「(株)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(株)東京証券取引所が有します。

(株)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。

(株)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。

(株)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(株)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、(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、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、(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。

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、参加もしていません。

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

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

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

S&Pは、明示的あるいは黙示的保証を行なうものではなく、かつ、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそこに含まれるデータに関連して、特定の目的あるいは使用のための市場性または適切性について何ら保証を行なうものではないことを明記します。

前記事項を制限することなく、S&Pは、たとえ特別の損害、懲罰的損害、間接的損害あるいは結果的損害（逸失利益を含む）につき、その可能性について通知を受けていたとしても、かかる損害について責任を負いません。

## 委託会社におけるリスクマネジメント体制

## リスク管理関連の委員会

## パフォーマンスの考査

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

## 運用リスクの管理

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

## リスク管理体制図

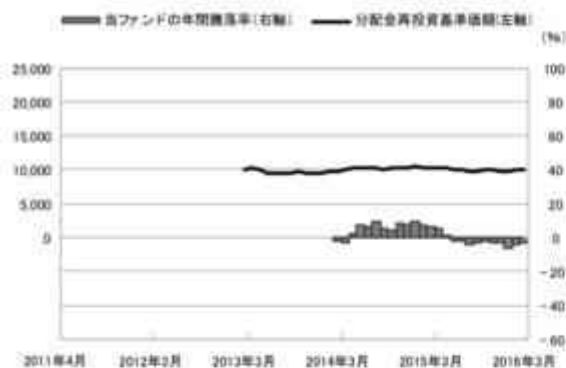


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

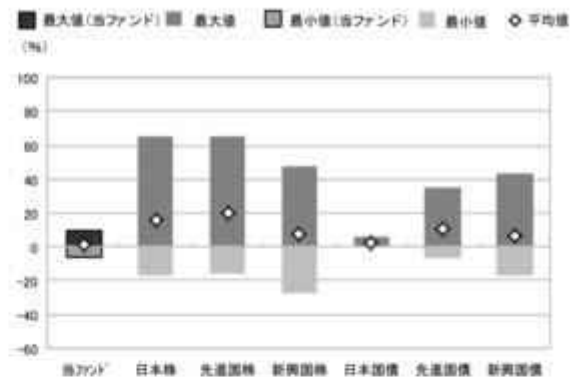
## リスクの定量的比較

(2011年4月末～2016年3月末:月次)

〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉



〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	9.6	65.0	65.7	47.4	6.1	34.9	43.7
最小値(%)	△5.7	△17.0	△15.6	△27.4	0.4	△6.3	△17.4
平均値(%)	1.6	16.2	19.8	7.3	2.4	10.4	6.2

- 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- 年間騰落率は、2014年3月から2016年3月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2011年4月から2016年3月の5年間(当ファンドは2014年3月から2016年3月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

## ＜代表的な資産クラスの指数＞

- 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
- 先進国株:MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債:NOMURA-BPI国債
- 先進国債:シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
- 新興国債:JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(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が発行した指数です。同指数に対する著作権、知的財産その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-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」と呼びます)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を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ており、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)「指数スポンサー」は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に運動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ、NYSE、SPACの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA、JPMS、JP Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年1.512%（税抜年1.40%）以内（平成28年 5月11日現在年1.512%（税抜年1.40%））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0.70%	年0.65%	年0.05%

\* 上記配分は、平成28年 5月11日現在の信託報酬率における配分です。

## 支払先の役務の内容

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

## (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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



## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

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

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは以下の通りです。

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

### 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

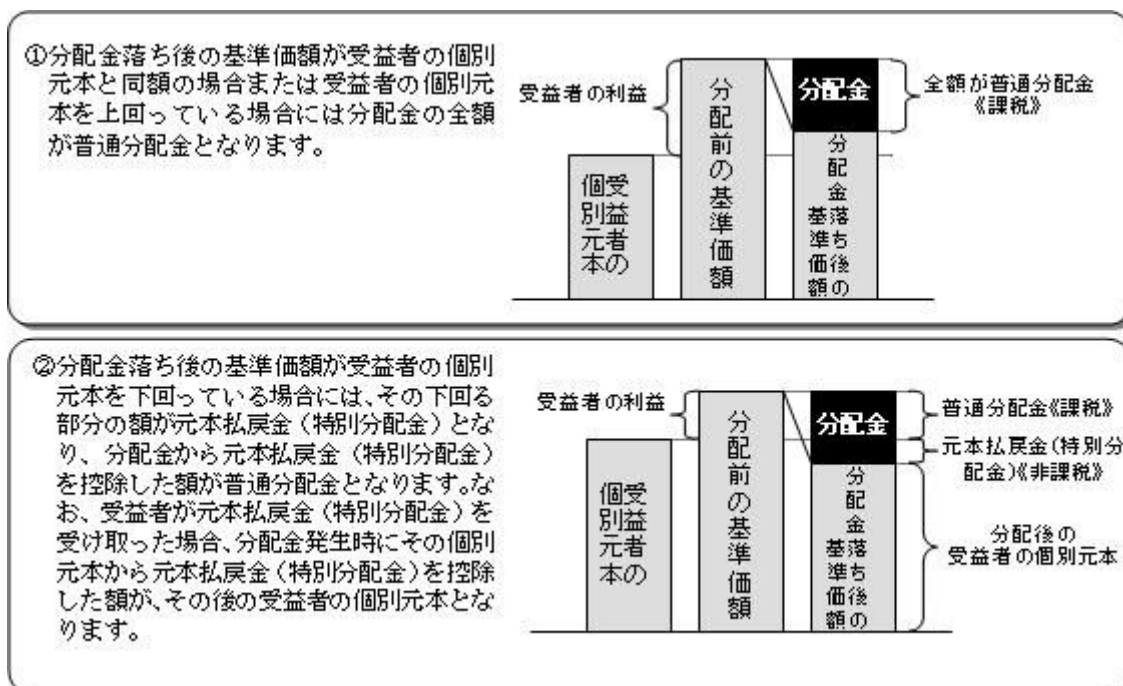
### 換金(解約)時および償還時の課税について

換金(解約)時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

### 分配金の課税について

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



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

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

## 5【運用状況】

以下は平成28年 3月31日現在の運用状況であります。

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

### (1)【投資状況】

#### 野村DC運用戦略ファンドA

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	29,903,135	85.01
現金・預金・その他資産(負債控除後)		5,270,371	14.98
合計(純資産総額)		35,173,506	100.00

#### (参考)国内株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	278,413,493,530	98.09
現金・預金・その他資産(負債控除後)		5,408,041,387	1.90
合計(純資産総額)		283,821,534,917	100.00

#### その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,716,250,000	1.66

#### (参考)国内債券マザーファンド

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

#### (参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	199,669,611,662	61.16
	カナダ	11,796,937,372	3.61
	ドイツ	11,847,076,741	3.62
	イタリア	2,850,570,607	0.87
	フランス	12,420,731,207	3.80
	オランダ	3,926,239,018	1.20
	スペイン	4,126,231,449	1.26
	ベルギー	1,895,353,793	0.58
	オーストリア	238,063,064	0.07
	ルクセンブルグ	37,187,900	0.01
	フィンランド	1,319,220,175	0.40
	アイルランド	654,047,347	0.20
	ポルトガル	217,309,516	0.06
	イギリス	24,692,454,001	7.56
	スイス	11,774,300,206	3.60
	スウェーデン	3,827,514,395	1.17
	ノルウェー	758,368,357	0.23
	デンマーク	2,577,901,609	0.78
	オーストラリア	8,208,103,549	2.51
	ニュージーランド	227,846,818	0.06
香港	3,908,181,450	1.19	
シンガポール	1,601,212,423	0.49	
イスラエル	803,261,002	0.24	
	小計	309,377,723,661	94.77
投資信託受益証券	アメリカ	29,537,371	0.00
投資証券	アメリカ	6,547,977,464	2.00
	カナダ	78,162,640	0.02
	フランス	525,294,333	0.16
	イギリス	404,383,217	0.12
	オーストラリア	891,878,268	0.27
	香港	174,205,982	0.05
	シンガポール	145,310,801	0.04
	小計	8,767,212,705	2.68
現金・預金・その他資産（負債控除後）		8,256,960,153	2.52
合計（純資産総額）		326,431,433,890	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	----	------	---------	---------

株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,592,791,515	1.71
	買建	カナダ	328,649,428	0.10
	買建	ドイツ	1,087,769,032	0.33
	買建	イギリス	676,874,176	0.20
	買建	スイス	324,191,646	0.09

## (参考) 外国債券マザーファンド

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

## (参考) 新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	1,062,947,094	7.66
	メキシコ	594,366,021	4.28

	ブラジル	898,913,291	6.48
	チリ	84,019,342	0.60
	コロンビア	40,646,095	0.29
	ギリシャ	56,702,855	0.40
	トルコ	200,667,646	1.44
	チェコ	26,030,214	0.18
	ハンガリー	40,561,607	0.29
	ポーランド	187,455,128	1.35
	香港	2,862,840,276	20.64
	マレーシア	470,276,804	3.39
	タイ	300,654,309	2.16
	フィリピン	197,139,590	1.42
	インドネシア	363,942,957	2.62
	韓国	2,119,601,936	15.28
	台湾	1,670,409,506	12.04
	インド	1,076,932,538	7.76
	カタール	130,682,208	0.94
	エジプト	23,785,093	0.17
	南アフリカ	921,230,837	6.64
	アラブ首長国連邦	109,180,616	0.78
	小計	13,438,985,963	96.89
投資証券	メキシコ	20,895,477	0.15
	トルコ	7,240,871	0.05
	南アフリカ	54,091,963	0.38
	小計	82,228,311	0.59
現金・預金・その他資産（負債控除後）		348,605,409	2.51
合計（純資産総額）		13,869,819,683	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	324,447,407	2.33

## （参考）新興国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	6,891,415,063	98.05
現金・預金・その他資産（負債控除後）		136,934,911	1.94
合計（純資産総額）		7,028,349,974	100.00

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	187,942,764	9.72
	ブラジル	202,576,908	10.48
	コロンビア	113,957,800	5.89
	ペルー	32,241,835	1.66
	トルコ	178,644,355	9.24
	ハンガリー	100,358,326	5.19
	ポーランド	185,814,672	9.61
	ロシア	96,631,920	5.00
	ルーマニア	54,195,221	2.80
	マレーシア	188,588,192	9.76
	タイ	169,546,950	8.77
	フィリピン	12,837,828	0.66
	インドネシア	189,079,286	9.78
	南アフリカ	169,512,751	8.77
	小計	1,881,928,808	97.42
現金・預金・その他資産（負債控除後）		49,791,380	2.57
合計（純資産総額）		1,931,720,188	100.00

## （参考）J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	19,951,889,900	98.04
現金・預金・その他資産（負債控除後）		398,021,713	1.95
合計（純資産総額）		20,349,911,613	100.00

## その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	396,480,000	1.94

## （参考）海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	13,119,457,916	69.98
	カナダ	343,675,103	1.83
	ドイツ	38,316,684	0.20
	イタリア	19,198,397	0.10
	フランス	862,060,045	4.59
	オランダ	105,383,145	0.56
	スペイン	87,770,298	0.46
	ベルギー	125,965,859	0.67
	アイルランド	45,454,014	0.24
	イギリス	1,085,967,282	5.79
	オーストラリア	1,522,676,328	8.12
	ニュージーランド	89,675,996	0.47
	香港	321,364,223	1.71
	シンガポール	549,340,761	2.93
	イスラエル	7,166,348	0.03
	小計	18,323,472,399	97.75
現金・預金・その他資産（負債控除後）		421,492,788	2.24
合計（純資産総額）		18,744,965,187	100.00

## その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	133,769,188	0.71
	買建	フランス	16,297,074	0.08

## （参考）野村マネー マザーファンド

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

合計(純資産総額)	21,078,790,237	100.00
-----------	----------------	--------

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 野村DC運用戦略ファンドA

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	3,050,874	2.2387	6,829,992	2.2522	6,871,178	19.53
2	日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックスマザーファンド	2,701,762	1.9308	5,216,789	2.0267	5,475,661	15.56
3	日本	親投資信託受益証券	野村マネーマザーファンド	4,396,962	1.0211	4,489,737	1.0211	4,489,737	12.76
4	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	2,532,610	1.6442	4,164,212	1.6959	4,295,053	12.21
5	日本	親投資信託受益証券	海外REITインデックスマザーファンド	1,609,335	1.9501	3,138,513	2.1074	3,391,512	9.64
6	日本	親投資信託受益証券	外国株MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,522,425	1.9050	2,900,280	2.0145	3,066,925	8.71
7	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	1,024,689	1.1556	1,184,194	1.2213	1,251,452	3.55
8	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	549,957	1.1832	650,710	1.2553	690,361	1.96
9	日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	274,294	1.3227	362,809	1.3535	371,256	1.05

## 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	85.01
合計	85.01

## (参考)国内株式マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,739,000	7,974.75	13,868,090,250	5,952.00	10,350,528,000	3.64
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,072,400	832.21	9,214,562,004	521.50	5,774,256,600	2.03
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,066,600	4,233.49	4,515,440,434	4,848.00	5,170,876,800	1.82
4	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	926,200	4,318.96	4,000,220,752	4,690.00	4,343,878,000	1.53
5	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,401,900	2,888.85	4,049,878,815	3,006.00	4,214,111,400	1.48
6	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	781,900	7,055.73	5,516,875,287	5,366.00	4,195,675,400	1.47
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,258,300	4,058.38	5,106,659,554	3,086.00	3,883,113,800	1.36



8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,105,000	5,127.99	5,666,428,950	3,412.00	3,770,260,000	1.32
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,489,300	230.89	4,499,884,477	168.10	3,276,151,330	1.15
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	583,200	6,083.06	3,547,640,592	5,136.00	2,995,315,200	1.05
11	日本	株式	ソニー	電気機器	986,500	3,532.58	3,484,890,170	2,893.00	2,853,944,500	1.00
12	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	577,300	5,163.50	2,980,888,550	4,792.00	2,766,421,600	0.97
13	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	1,064,300	2,248.93	2,393,536,199	2,552.50	2,716,625,750	0.95
14	日本	株式	キヤノン	電気機器	752,800	4,097.29	3,084,439,912	3,355.00	2,525,644,000	0.88
15	日本	株式	ファナック	電気機器	143,100	24,010.47	3,435,898,257	17,485.00	2,502,103,500	0.88
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	125,200	21,219.41	2,656,670,132	19,905.00	2,492,106,000	0.87
17	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	255,600	10,951.94	2,799,315,864	9,713.00	2,482,642,800	0.87
18	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,639,800	1,784.57	2,926,337,886	1,496.50	2,453,960,700	0.86
19	日本	株式	花王	化学	393,900	5,678.82	2,236,887,198	6,003.00	2,364,581,700	0.83
20	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,026,000	2,679.60	2,749,269,600	2,090.50	2,144,853,000	0.75
21	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	559,100	4,874.05	2,725,081,355	3,800.00	2,124,580,000	0.74
22	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	494,200	4,735.41	2,340,239,622	4,205.00	2,078,111,000	0.73
23	日本	株式	三井不動産	不動産業	732,000	3,419.59	2,503,139,880	2,808.00	2,055,456,000	0.72
24	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,962,600	1,226.21	2,406,559,746	1,041.50	2,044,047,900	0.72
25	日本	株式	村田製作所	電気機器	146,700	17,593.56	2,580,975,252	13,570.00	1,990,719,000	0.70
26	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,035,500	2,519.60	2,609,045,800	1,906.00	1,973,663,000	0.69
27	日本	株式	キーエンス	電気機器	31,700	62,488.33	1,980,880,061	61,390.00	1,946,063,000	0.68
28	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,567,000	774.78	2,763,640,260	526.60	1,878,382,200	0.66
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,492,000	1,491.38	2,225,138,960	1,179.50	1,759,814,000	0.62
30	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	441,800	4,284.53	1,892,905,354	3,975.00	1,756,155,000	0.61

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	3.11
		食料品	4.96
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.25
		化学	6.00
		医薬品	5.53
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.97
		ガラス・土石製品	0.85
		鉄鋼	1.17
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.64
機械	4.54		

電気機器	11.40
輸送用機器	9.63
精密機器	1.58
その他製品	1.54
電気・ガス業	2.09
陸運業	4.53
海運業	0.21
空運業	0.68
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	8.01
卸売業	4.13
小売業	4.98
銀行業	7.25
証券、商品先物取引業	1.07
保険業	2.27
その他金融業	1.37
不動産業	2.80
サービス業	3.75
合計	98.09

## (参考) 国内債券マザーファンド

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

11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	90,000,000	105.66	95,094,800	105.64	95,084,100	1.3	2019/12/20	1.13
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	90,000,000	103.16	92,844,000	105.49	94,946,400	0.6	2023/3/20	1.13
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 46回	70,000,000	113.50	79,451,200	123.53	86,476,600	1.7	2033/9/20	1.02
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 18回	80,000,000	105.41	84,328,000	106.59	85,278,400	1	2021/9/20	1.01
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 53回	70,000,000	106.43	74,504,200	116.47	81,529,700	1.3	2035/6/20	0.97
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	80,000,000	100.63	80,504,000	101.28	81,024,800	0.2	2019/3/20	0.96
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	80,000,000	101.48	81,185,600	101.27	81,019,200	0.1	2020/6/20	0.96
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	80,000,000	100.64	80,512,000	101.17	80,938,400	0.2	2018/12/20	0.96
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年)第4 5回	60,000,000	102.70	61,621,900	125.42	75,253,200	1.5	2044/12/20	0.89
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	70,000,000	104.16	72,912,700	107.08	74,956,700	0.8	2023/6/20	0.89
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	70,000,000	106.04	74,229,400	106.60	74,626,300	1.2	2020/12/20	0.88
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 24回	70,000,000	104.20	72,941,400	106.25	74,378,500	0.8	2022/6/20	0.88
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	70,000,000	101.22	70,854,700	101.37	70,964,600	0.1	2020/12/20	0.84
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	70,000,000	100.29	70,203,000	101.32	70,929,600	0.1	2020/9/20	0.84
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 96回	65,000,000	104.96	68,225,950	104.29	67,793,700	1.5	2018/9/20	0.80
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第4 9回	60,000,000	111.54	66,929,400	111.42	66,852,000	2.1	2021/3/22	0.79
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第2 88回	65,000,000	104.00	67,603,250	102.78	66,807,000	1.7	2017/9/20	0.79
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	60,000,000	102.68	61,611,100	105.89	63,535,800	0.6	2023/12/20	0.75
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 31回	60,000,000	104.28	62,569,800	105.78	63,468,000	0.6	2023/9/20	0.75
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 13回	50,000,000	120.40	60,204,400	126.73	63,368,000	2.1	2029/9/20	0.75

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.55
合計	99.55

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

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

29	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	269,100	6,500.39	1,749,255,516	5,996.82	1,613,746,845	0.49
30	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	489,000	3,092.28	1,512,129,321	3,206.87	1,568,160,799	0.48

## 種類別及び業種別投資比率

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

	ヘルスケア機器・用品	1.63
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.89
	バイオテクノロジー	2.29
	医薬品	6.42
	銀行	8.05
	各種金融サービス	1.41
	保険	4.11
	不動産管理・開発	0.63
	インターネットソフトウェア・サービス	2.77
	情報技術サービス	2.58
	ソフトウェア	3.20
	通信機器	1.12
	コンピュータ・周辺機器	2.54
	電子装置・機器・部品	0.39
	半導体・半導体製造装置	1.76
	各種電気通信サービス	2.96
	無線通信サービス	0.40
	電力	1.79
	ガス	0.20
	総合公益事業	1.29
	水道	0.09
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.02
	消費者金融	0.50
	資本市場	1.80
	各種消費者サービス	0.02
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
	ヘルスケア・テクノロジー	0.06
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.44
	専門サービス	0.47
投資信託受益証券		0.00
投資証券		2.68
合計		97.47

## (参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,100,000	12,328.84	6,300,040,480	12,355.18	6,313,499,583	3.625	2020/2/15	0.97
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	12,190.50	6,009,919,224	12,203.77	6,016,459,271	3.375	2019/11/15	0.92
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,100,000	11,847.60	5,935,647,882	11,963.00	5,993,465,872	2.625	2020/11/15	0.92
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,600,000	12,092.55	5,997,908,745	11,904.90	5,904,833,213	4.25	2017/11/15	0.91
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	35,000,000	15,263.10	5,342,087,060	15,522.98	5,433,046,319	6	2026/2/15	0.83

6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,400,000	12,313.44	5,344,034,124	12,324.81	5,348,969,472	3.5	2020/5/15	0.82
7	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	23,900,000	21,405.58	5,115,934,129	21,714.10	5,189,671,812	6.5	2027/7/4	0.80
8	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,500,000	16,595.35	4,729,675,214	16,784.88	4,783,693,080	4.25	2023/10/25	0.73
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	11,979.91	4,779,985,573	11,845.04	4,726,172,724	3.5	2018/2/15	0.72
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,000,000	12,294.27	4,548,883,212	12,248.66	4,532,006,998	3.625	2019/8/15	0.69
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,400,000	12,104.82	4,406,156,816	12,280.35	4,470,050,607	3.125	2021/5/15	0.68
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,200,000	12,458.30	4,260,740,103	12,515.40	4,280,267,666	3.625	2021/2/15	0.65
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	19,805.56	3,980,918,587	20,387.49	4,097,886,806	5.5	2029/4/25	0.63
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,000,000	11,447.87	3,777,798,360	12,080.52	3,986,574,106	3	2044/11/15	0.61
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	11,514.47	3,972,493,330	11,461.22	3,954,123,719	1.875	2017/9/30	0.60
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	11,503.96	3,876,835,685	11,620.12	3,915,982,125	2	2022/2/15	0.60
17	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000	19,343.70	3,830,053,998	19,664.52	3,893,575,554	6	2025/10/25	0.60
18	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	25,900,000	14,684.10	3,803,181,960	14,569.29	3,773,446,887	4.25	2019/9/1	0.58
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,500,000	11,861.20	3,736,280,736	11,949.36	3,764,048,813	2.625	2020/8/15	0.58
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,600,000	11,073.43	3,609,939,233	11,390.36	3,713,258,206	1.75	2023/5/15	0.57
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	30,600,000	12,236.16	3,744,264,992	12,126.74	3,710,783,792	3.75	2018/11/15	0.57
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	31,200,000	11,469.60	3,578,517,686	11,826.11	3,689,748,679	2.375	2024/8/15	0.56
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,600,000	21,519.79	3,572,286,057	22,205.11	3,686,049,007	5.75	2032/10/25	0.56
24	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	19,000,000	18,540.44	3,522,685,048	19,226.38	3,653,012,351	3.25	2044/1/22	0.56
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	31,000,000	11,815.93	3,662,939,141	11,738.08	3,638,806,757	2.875	2018/3/31	0.56
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	30,400,000	11,634.81	3,536,985,091	11,941.43	3,630,197,389	2.5	2024/5/15	0.55
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	29,800,000	12,202.52	3,636,352,163	11,890.82	3,543,464,560	4.75	2017/8/15	0.54
28	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	23,800,000	14,715.55	3,502,301,733	14,630.58	3,482,080,182	4.3	2019/10/31	0.53
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	29,300,000	11,692.65	3,425,947,078	11,665.46	3,417,979,977	2.375	2018/6/30	0.52
30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,500,000	16,183.99	3,317,718,789	16,606.10	3,404,252,140	3.5	2026/4/25	0.52

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.96
合計	98.96

## (参考)新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
----	----------	----	-----	----	----	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

1	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	3,670	129,435.22	475,027,282	128,968.80	473,315,496	3.41
2	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	818,000	507.62	415,238,776	563.63	461,053,430	3.32
3	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インターネットソフトウェア・サービス	171,800	2,215.19	380,571,010	2,298.64	394,907,383	2.84
4	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	204,500	1,521.09	311,064,551	1,233.59	252,270,587	1.81
5	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	13,290	13,666.31	181,625,371	15,607.80	207,427,662	1.49
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,806,000	102.27	286,973,997	73.37	205,894,459	1.48
7	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,465,000	89.44	220,470,996	63.64	156,876,051	1.13
8	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネットソフトウェア・サービス	16,600	9,299.31	154,368,671	8,885.94	147,506,684	1.06
9	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	470,557	305.17	143,601,295	292.11	137,455,817	0.99
10	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	61,510	1,717.76	105,659,892	2,050.11	126,102,574	0.90
11	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,660,000	70.03	186,301,714	47.22	125,611,850	0.90
12	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	99,968	1,044.71	104,438,479	1,004.06	100,374,120	0.72
13	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	198,800	633.23	125,888,081	493.03	98,014,630	0.70
14	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インターネットソフトウェア・サービス	4,500	23,581.03	106,114,666	21,396.80	96,285,623	0.69
15	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	50,350	2,021.09	101,761,965	1,896.01	95,464,104	0.68
16	ブラジル	株式	AMBEV SA	飲料	154,956	613.00	94,988,047	598.43	92,731,481	0.66
17	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	171,000	765.42	130,887,827	539.78	92,304,004	0.66
18	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	1,035,300	95.15	98,509,160	87.69	90,793,636	0.65
19	韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO LTD	自動車	5,200	16,561.05	86,117,460	15,332.30	79,727,960	0.57
20	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガス・消耗燃料	602,000	171.49	103,239,647	131.78	79,335,834	0.57
21	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	43,660	1,552.86	67,797,896	1,779.98	77,714,145	0.56
22	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	675	100,545.23	67,868,035	110,333.40	74,475,045	0.53
23	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	83,674	903.85	75,629,119	876.87	73,371,639	0.52
24	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	16,820	5,520.05	92,847,299	4,355.08	73,252,479	0.52
25	南アフリカ	株式	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	家庭用耐久財	95,620	582.84	55,731,805	722.33	69,069,386	0.49
26	香港	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	246,000	509.31	125,291,633	277.52	68,270,658	0.49
27	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	15,630	4,257.80	66,549,547	4,232.14	66,148,504	0.47
28	メキシコ	株式	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	飲料	60,200	956.98	57,610,213	1,088.35	65,518,977	0.47



29	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	357,500	162.05	57,936,250	180.91	64,676,128	0.46
30	南アフリカ	株式	SASOL LTD	石油・ガス・消耗燃料	18,750	3,426.47	64,246,494	3,389.07	63,545,235	0.45

## 種類別及び業種別投資比率

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

	家庭用品	0.72
	パーソナル用品	0.90
	ヘルスケア機器・用品	0.04
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.60
	バイオテクノロジー	0.02
	医薬品	1.84
	銀行	16.22
	各種金融サービス	1.66
	保険	3.67
	不動産管理・開発	2.37
	インターネットソフトウェア・サービス	5.47
	情報技術サービス	2.16
	ソフトウェア	0.18
	通信機器	0.03
	コンピュータ・周辺機器	5.13
	電子装置・機器・部品	2.26
	半導体・半導体製造装置	4.88
	各種電気通信サービス	1.99
	無線通信サービス	4.70
	電力	1.37
	ガス	0.49
	総合公益事業	0.11
	水道	0.28
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.81
	消費者金融	0.16
	資本市場	1.25
	各種消費者サービス	0.21
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.92
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.03
投資証券		0.59
合計		97.48

## (参考) 新興国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	RUSSIA	1,844,500	13,250.04	244,397,010	13,782.45	254,217,367	7.5	2030/3/31	3.61
2	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	700,000	18,386.96	128,708,730	18,465.75	129,260,254	10.625	2025/3/16	1.83
3	アメリカ	国債証券	RUSSIA	620,000	18,002.37	111,614,723	18,676.71	115,795,602	12.75	2028/6/24	1.64
4	アメリカ	国債証券	BRAZIL GLOBAL	1,000,000	13,662.45	136,624,500	11,465.19	114,651,900	7.125	2037/1/20	1.63
5	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	850,000	13,503.17	114,776,975	13,485.00	114,622,513	7.375	2025/2/5	1.63

6	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	12,343.46	111,091,212	12,476.49	112,288,437	5.55	2045/1/21	1.59
7	アメリカ	国債証券	INDONESIA GLOBAL	700,000	15,230.95	106,616,689	15,257.99	106,805,992	8.5	2035/10/12	1.51
8	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	550,000	18,843.16	103,637,430	19,023.55	104,629,526	9.5	2030/2/2	1.48
9	アメリカ	国債証券	BRAZIL GLOBAL	820,000	13,568.18	111,259,105	12,620.16	103,485,312	8.25	2034/1/20	1.47
10	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	11,319.33	101,873,988	11,465.19	103,186,710	5.75	2110/10/12	1.46
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	700,000	14,954.24	104,679,720	14,471.36	101,299,579	7.75	2038/1/17	1.44
12	アメリカ	国債証券	PANAMA GLOBAL	600,000	16,254.09	97,524,540	16,169.58	97,017,480	8.875	2027/9/30	1.38
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000	12,621.56	100,972,548	11,803.23	94,425,840	6.125	2041/1/18	1.34
14	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	710,000	13,357.26	94,836,559	13,225.81	93,903,287	6.05	2040/1/11	1.33
15	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	600,000	14,808.03	88,848,180	15,509.19	93,055,178	6.375	2032/1/15	1.32
16	アメリカ	国債証券	MEXICO GLOBAL	599,000	15,627.20	93,606,938	15,465.33	92,637,327	7.5	2033/4/8	1.31
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	550,000	16,986.51	93,425,805	16,620.30	91,411,650	8.75	2033/11/21	1.30
18	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	800,000	11,394.76	91,158,120	11,239.83	89,918,640	4.75	2044/3/8	1.27
19	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	700,000	12,451.14	87,157,980	12,208.87	85,462,146	5.875	2019/1/15	1.21
20	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	700,000	11,593.16	81,152,136	11,611.67	81,281,718	3.625	2022/3/15	1.15
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	600,000	12,879.32	77,275,944	13,541.69	81,250,145	6.75	2044/1/15	1.15
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000	11,333.19	79,332,354	11,183.49	78,284,430	5.625	2044/2/26	1.11
23	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	600,000	12,651.71	75,910,262	12,484.94	74,909,664	7	2019/3/11	1.06
24	アメリカ	国債証券	PERU GLOBAL	500,000	15,111.51	75,557,574	14,817.42	74,087,100	7.35	2025/7/21	1.05
25	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	600,000	12,366.63	74,199,780	12,202.96	73,217,774	5.75	2024/3/22	1.04
26	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	600,000	12,493.39	74,960,370	12,096.75	72,580,501	6	2041/1/14	1.03
27	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	630,000	11,928.43	75,149,109	11,408.85	71,875,755	4.875	2021/1/22	1.02
28	アメリカ	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND	600,000	11,617.30	69,703,848	11,853.94	71,123,684	5	2020/4/29	1.01
29	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	600,000	11,352.51	68,115,060	11,800.36	70,802,208	4.875	2023/9/16	1.00
30	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	600,000	11,718.72	70,312,320	11,780.69	70,684,164	4	2023/10/2	1.00

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.05
合計	98.05

## (参考) 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
----	------	----	-----	----	---------	---------	---------	---------	-------	------	---------

1	ロシア	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND	60,000,000	159.15	95,495,400	161.05	96,631,920	7.85	2018/3/10	5.00
2	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,780,000,000	3.68	65,545,578	3.80	67,737,010	7.75	2021/4/14	3.50
3	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000	354.54	53,182,308	358.09	53,714,880	3.65	2021/12/17	2.78
4	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,100,000	2,423.00	50,883,198	2,468.82	51,845,326		2018/1/1	2.68
5	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,550,000	655.95	49,524,775	655.91	49,521,384	4.75	2018/6/14	2.56
6	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,070,000,000	4.05	43,425,128	4.31	46,220,790	9.85	2027/6/28	2.39
7	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,460,000	2,960.11	43,217,732	2,961.84	43,242,975	4.378	2019/11/29	2.23
8	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	136,000	2,695.08	36,656,085	2,849.87	38,758,299	10	2021/1/1	2.00
9	ルーマニア	国債証券	ROMANIA	950,000	3,404.22	32,340,123	3,377.90	32,090,101	5.85	2023/4/26	1.66
10	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	800,000	3,806.13	30,449,072	3,904.46	31,235,726	8.8	2018/11/14	1.61
11	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,800,000	823.87	31,307,158	821.22	31,206,707	10.5	2026/12/21	1.61
12	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,030,000	2,924.46	30,122,033	2,936.66	30,247,648	1.5	2020/4/25	1.56
13	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,700,000	344.36	29,960,017	344.96	30,011,604	3.875	2019/6/13	1.55
14	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	112,000	2,361.25	26,449,465	2,654.00	29,724,905	10	2025/1/1	1.53
15	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	830,000	3,415.81	28,351,283	3,407.72	28,284,143	5.25	2020/10/25	1.46
16	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,310,000	1,927.04	25,244,315	2,037.27	26,688,302		2019/7/1	1.38
17	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,360,000	593.92	25,895,165	591.89	25,806,404	7	2031/2/28	1.33
18	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,700,000	363.02	24,322,565	376.55	25,229,348	3.58	2027/12/17	1.30
19	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	610,000	3,970.02	24,217,123	4,096.16	24,986,594	10.5	2020/1/15	1.29
20	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000	3,077.02	24,616,209	3,106.09	24,848,771	3.25	2025/7/25	1.28
21	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,800,000,000	0.86	24,266,718	0.87	24,563,980	8.375	2024/3/15	1.27
22	ハンガリー	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND	52,000,000	46.57	24,218,448	46.94	24,410,511	6.5	2019/6/24	1.26
23	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,390,000,000	1.00	23,961,542	1.01	24,264,845	11	2025/9/15	1.25
24	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	640,000	3,462.65	22,160,997	3,575.70	22,884,480	8	2025/3/12	1.18
25	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000	836.21	22,577,698	838.02	22,626,779	10	2024/12/5	1.17
26	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	760,000	2,923.54	22,218,952	2,925.79	22,236,051	4.24	2018/2/7	1.15
27	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	1,020,000	2,079.48	21,210,699	2,172.55	22,160,063		2019/1/1	1.14
28	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	750,000	2,892.17	21,691,336	2,893.46	21,700,987	3.58	2018/9/28	1.12
29	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	2,480,000,000	0.83	20,780,035	0.86	21,391,267	8.375	2034/3/15	1.10
30	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	750,000	2,808.68	21,065,100	2,824.77	21,185,794	3.418	2022/8/15	1.09

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.42
合 計	97.42

## (参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

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

27	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	594	517,541	307,419,555	493,500	293,139,000	1.44
28	日本	投資証券	福岡リート投資法人 投資証券	1,265	210,011	265,664,364	203,500	257,427,500	1.26
29	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,656	153,746	254,603,658	154,500	255,852,000	1.25
30	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	2,778	82,888	230,263,237	83,100	230,851,800	1.13

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.04
合計	98.04

## (参考) 海外REITインデックス マザーファンド

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

30	アメリカ	投資証券	VEREIT INC	139,500	956.65	133,453,121	996.09	138,954,722	0.74
----	------	------	------------	---------	--------	-------------	--------	-------------	------

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.75
合計	97.75

## (参考)野村マネー マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	日本	社債券	みずほコーポレート銀行 第26回特定社債 間限定同順位特約付	600,000,000	100.14	600,875,839	100.14	600,875,839	0.54	2016/7/20	2.85
2	日本	社債券	三菱UFJリース 第13回社債 間限定同順位特約付	500,000,000	100.04	500,226,693	100.04	500,226,693	0.796	2016/4/22	2.37
3	日本	社債券	三菱UFJリース 第15回社債 間限定同順位特約付	400,000,000	100.39	401,577,249	100.39	401,577,249	0.66	2016/12/14	1.90
4	日本	社債券	みずほコーポレート銀行 第27回特定社債 間限定同順位特約付	400,000,000	100.27	401,086,157	100.27	401,086,157	0.515	2016/10/20	1.90
5	日本	特殊債券	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第46回	390,000,000	100.04	390,178,993	100.04	390,178,993	0.255	2016/6/20	1.85
6	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第12回	300,000,000	100.31	300,956,526	100.31	300,956,526	2	2016/5/31	1.42
7	日本	特殊債券	商工債券 利付第736回い号	300,000,000	100.18	300,552,403	100.18	300,552,403	0.45	2016/9/27	1.42
8	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第261回	300,000,000	100.17	300,529,160	100.17	300,529,160	0.45	2016/8/26	1.42
9	日本	特殊債券	商工債券 利付第733回い号	300,000,000	100.11	300,341,411	100.11	300,341,411	0.55	2016/6/27	1.42
10	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第258回	300,000,000	100.07	300,223,447	100.07	300,223,447	0.55	2016/5/27	1.42
11	日本	社債券	みずほコーポレート銀行 第25回特定社債 間限定同順位特約付	300,000,000	100.03	300,115,294	100.03	300,115,294	0.755	2016/4/20	1.42
12	日本	特殊債券	商工債券 利付(3年)第164回	200,000,000	100.06	200,120,174	100.06	200,120,174	0.2	2016/9/27	0.94
13	日本	特殊債券	農林債券 利付第731回い号	200,000,000	100.05	200,105,940	100.05	200,105,940	0.75	2016/4/27	0.94
14	日本	特殊債券	商工債券 利付(3年)第161回	200,000,000	100.04	200,083,844	100.04	200,083,844	0.25	2016/6/27	0.94
15	日本	特殊債券	日本政策投資銀行社債 財投機関債第34回	200,000,000	100.04	200,081,672	100.04	200,081,672	0.243	2016/6/20	0.94

16	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,994,246		199,994,246			0.94
17	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,991,205		199,991,205			0.94
18	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,969,319		199,969,319			0.94
19	日本	コマーシャルペーパー	三井住友信託銀行	200,000,000		199,957,625		199,957,625			0.94
20	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,943,287		199,943,287			0.94
21	日本	特殊債券	農林債券 利付第733回い号	180,000,000	100.11	180,206,973	100.11	180,206,973	0.55	2016/6/27	0.85
22	日本	特殊債券	商工債券 利付第734回い号	170,000,000	100.15	170,259,795	100.15	170,259,795	0.55	2016/7/27	0.80
23	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第11回	170,000,000	100.12	170,208,318	100.12	170,208,318	1.8	2016/4/26	0.80
24	日本	特殊債券	農林債券 利付第736回い号	150,000,000	100.21	150,316,524	100.21	150,316,524	0.5	2016/9/27	0.71
25	日本	特殊債券	農林債券 利付第735回い号	150,000,000	100.15	150,228,048	100.15	150,228,048	0.45	2016/8/26	0.71
26	日本	特殊債券	首都高速道路第8回	140,000,000	100.16	140,231,864	100.16	140,231,864	0.439	2016/9/20	0.66
27	日本	特殊債券	公営企業債券 政府保証第862回	117,000,000	100.09	117,116,740	100.09	117,116,740	1.8	2016/4/20	0.55
28	日本	地方債証券	大阪府 公募(5年)第73回	102,000,000	100.07	102,072,341	100.07	102,072,341	0.51	2016/5/30	0.48
29	日本	地方債証券	東京都 公募第636回	101,500,000	100.43	101,937,847	100.43	101,937,847	2.04	2016/6/20	0.48
30	日本	地方債証券	神奈川県 公募(5年)第49回	101,700,000	100.14	101,849,799	100.14	101,849,799	0.37	2016/9/20	0.48

## 種類別及び業種別投資比率

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

## 【投資不動産物件】

## 野村DC運用戦略ファンドA

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A

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

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

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

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

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

## （参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新興国株式マザーファンド

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	インター コンチネ タル取 引所	E-mini MSCIエ マージングマ ーケット株 価指数先物 (2016年06月限)	買建	69	米ドル	2,798,885	315,378,360	2,879,370	324,447,407	2.33

## （参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数先物 取引	大阪取引所	REIT指数先物(2016年06月限)	買建	210	日本円	391,462,680	396,480,000	1.94

#### (参考) 海外REITインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2016年06月限)	買建	39	米ドル	1,149,330	129,506,504	1,187,160	133,769,188	0.71
	フランス	Euronext	FTSE EPRA/NAREIT 欧州指数先物(2016 年06月限)	買建	6	ユーロ	125,430	16,017,411	127,620	16,297,074	0.08

#### (参考) 野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

#### 野村DC運用戦略ファンドA

平成28年3月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2014年 2月17日)	33	33	0.9558	0.9558

第2計算期間	(2015年 2月17日)	36	36	1.0324	1.0329
第3計算期間	(2016年 2月17日)	34	34	0.9756	0.9756
	2015年 3月末日	36		1.0341	
	4月末日	36		1.0344	
	5月末日	35		1.0225	
	6月末日	34		0.9966	
	7月末日	35		1.0019	
	8月末日	34		0.9834	
	9月末日	34		0.9763	
	10月末日	34		0.9926	
	11月末日	34		0.9908	
	12月末日	34		0.9843	
	2016年 1月末日	34		0.9788	
	2月末日	34		0.9881	
	3月末日	35		1.0050	

## 【分配の推移】

## 野村DC運用戦略ファンドA

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2013年 3月29日～2014年 2月17日	0.0000円
第2計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日	0.0005円
第3計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日	0.0000円

## 【収益率の推移】

## 野村DC運用戦略ファンドA

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 3月29日～2014年 2月17日	4.4%
第2計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日	8.1%
第3計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日	5.5%

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## 野村DC運用戦略ファンドA

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2013年 3月29日 ~ 2014年 2月17日	35,000,000		35,000,000
第2計算期間	2014年 2月18日 ~ 2015年 2月17日			35,000,000
第3計算期間	2015年 2月18日 ~ 2016年 2月17日			35,000,000

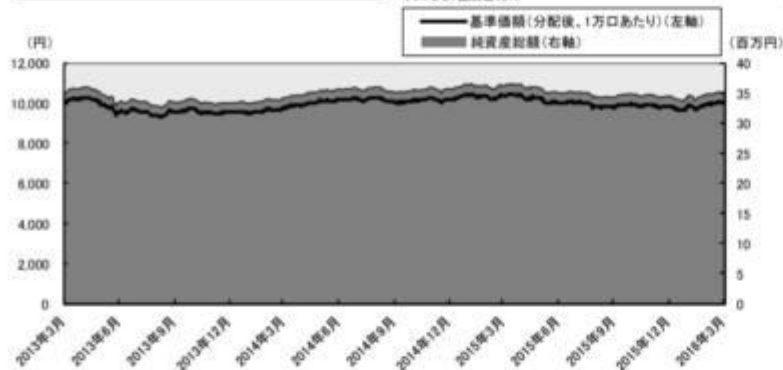
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報

## 運用実績 (2016年3月31日現在)

## 基準価額・純資産の推移

(日次：設定来)



## 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2016年2月	0 円
2015年2月	5 円
2014年2月	0 円
—	—
—	—
設定来累計	5 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	2.0
国内債券マザーファンド	1.1
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	8.7
外国債券マザーファンド	19.5
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	12.2
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	3.6
J-REITインデックス マザーファンド	15.6
海外REITインデックス マザーファンド	9.6
野村マネー マザーファンド	12.8

## 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	0.1
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.0
3	日本電信電話	情報・通信業	0.0
4	日本たばこ産業	食料品	0.0
5	KDDI	情報・通信業	0.0

## ・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

## ・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.2
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1
3	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.1
4	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.1
5	GENERAL ELEC CO	コングロマリット	0.1

## ・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.2

## ・「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	0.4
2	PHILIPPINES GLOBAL	国債証券	0.2
3	RUSSIA	国債証券	0.2
4	BRAZIL GLOBAL	国債証券	0.2
5	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.2

## ・「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	0.1
3	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
4	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1
5	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	0.1

## ・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	1.2
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	1.1
3	日本リートファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.9
4	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.8
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	投資証券	0.6

## ・「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

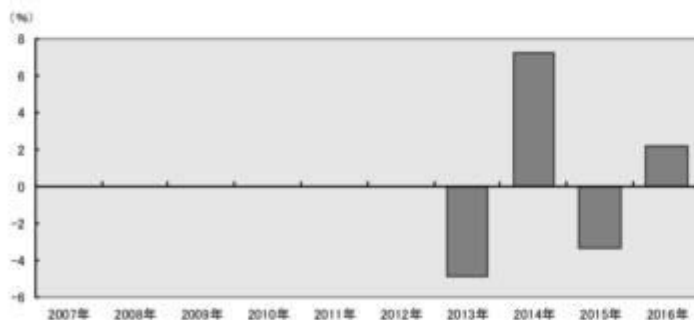
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.6
2	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.4
3	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	0.2
4	UNIBAIL RODAMCO-NA	投資証券	0.2
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	0.2

## ・「野村マネー マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	みずほコーポレート銀行 第26回特定社債間限定同順位特約付	社債券	0.4
2	三菱UFJリース 第13回社債間限定同順位特約付	社債券	0.3
3	三菱UFJリース 第15回社債間限定同順位特約付	社債券	0.2
4	みずほコーポレート銀行 第27回特定社債間限定同順位特約付	社債券	0.2
5	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第46回	特殊債券	0.2

## 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。
- ・2013年は設定日(2013年3月29日)から年末までの収益率。
- ・2016年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

## 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。
- ・取得申込日の翌々営業日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。  
詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

野村アセットマネジメント株式会社  
サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）  
<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

- ・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。
- ・金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、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。）、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、受益権の取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消す場合があります。

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。

### 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け付けについては、午後3時まで、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け付けにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

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）

&lt; 受付時間 &gt; 営業日の午前9時～午後5時

- ・当ファンドは、買取りは行いません。
- ・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付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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。

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### < 基準価額の計算方法 >

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
----	------

株式	原則として、基準価額計算日 <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

## (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25年3月29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、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## (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。

- ( ) 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。

なお、運用の外部委託を行う場合は、委託者と運用の委託先との間で締結する「運用指図に関する権限の委託契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から更新しない旨を書面によって通知がない限り、1年毎に自動的に更新されるものとします。但し、当該契約はファンドの償還日に終了するものとします。

#### 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

受益者は、一部解約の実行を請求することができます。詳しくは、前述の「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

### 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3期計算期間(平成27年2月18日から平成28年2月17日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【野村DC運用戦略ファンドA】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成27年 2月17日現在)	第3期 (平成28年 2月17日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	-	2,105,381
コール・ローン	575,778	3,146,913
親投資信託受益証券	35,570,680	28,482,626
派生商品評価勘定	418,419	672,878
未収利息	1	-
流動資産合計	36,564,878	34,407,798
資産合計	36,564,878	34,407,798
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	143,465	-
未払収益分配金	17,500	-
未払受託者報酬	9,644	9,361
未払委託者報酬	260,346	252,588
その他未払費用	549	546
流動負債合計	431,504	262,495
負債合計	431,504	262,495
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	35,000,000	35,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,133,374	854,697
(分配準備積立金)	2,222,518	2,767,736
元本等合計	36,133,374	34,145,303
純資産合計	36,133,374	34,145,303
負債純資産合計	36,564,878	34,407,798

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日	自	平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日
営業収益				
受取利息		1,358		4,138
有価証券売買等損益		6,543,339		1,556,033
為替差損益		3,315,512		94,026
営業収益合計		3,229,185		1,457,869
営業費用				
受託者報酬		18,974		18,919
委託者報酬		511,978		510,193
その他費用		1,066		1,090
営業費用合計		532,018		530,202
営業利益又は営業損失（ ）		2,697,167		1,988,071
経常利益又は経常損失（ ）		2,697,167		1,988,071
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,697,167		1,988,071
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（ ）		-		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,546,293		1,133,374
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		17,500		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,133,374		854,697



## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成27年 2月18日から平成28年 2月17日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第2期 平成27年 2月17日現在	第3期 平成28年 2月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 35,000,000口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 35,000,000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 1.0324円 (10,000口当たり純資産額) (10,324円)	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 854,697円 3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9756円 (10,000口当たり純資産額) (9,756円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日	第3期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,243,940円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,243,940円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>545,218円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	545,218円
項目													
費用控除後の配当等収益額	A	1,243,940円											
項目													
費用控除後の配当等収益額	A	545,218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	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	0円	収益調整金額	C	0円
分配準備積立金額	D	996,078円	分配準備積立金額	D	2,222,518円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,240,018円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,767,736円
当ファンドの期末残存口数	F	35,000,000口	当ファンドの期末残存口数	F	35,000,000口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	640円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	790円
10,000口当たり分配金額	H	5円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	17,500円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第2期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日	第3期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>当ファンドは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされておりますが、主要投資対象である親投資信託受益証券の保有状況によっては、市場リスクの内容は変動する場合があります。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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>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>	同左
---	----

## (2)金融商品の時価等に関する事項

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

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

第2期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日	第3期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## ( その他の注記 )

## 1 元本の移動

第2期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日		第3期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日	
期首元本額	35,000,000円	期首元本額	35,000,000円
期中追加設定元本額	0円	期中追加設定元本額	0円
期中一部解約元本額	0円	期中一部解約元本額	0円

## 2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第2期 自 平成26年 2月18日 至 平成27年 2月17日	第3期 自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	3,722,943	1,221,067
合計	3,722,943	1,221,067

## 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2期(平成27年 2月17日現在)				第3期(平成28年 2月17日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年 超				うち1年 超			
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	34,341,764	-	34,066,810	274,954	16,352,478	-	15,679,600	672,878
米ドル	22,962,227	-	23,066,550	104,323	10,325,990	-	9,821,960	504,030
カナダドル	694,100	-	664,080	30,020	330,402	-	329,240	1,162
ユーロ	7,849,667	-	7,512,400	337,267	3,900,056	-	3,817,020	83,036
英ポンド	2,167,620	-	2,180,520	12,900	1,371,748	-	1,305,700	66,048
豪ドル	668,150	-	643,260	24,890	424,282	-	405,680	18,602
合計	34,341,764	-	34,066,810	274,954	16,352,478	-	15,679,600	672,878

#### （注）時価の算定方法

##### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド		1,026,597	
		国内債券マザーファンド		1,927,691	
		外国債券マザーファンド		8,444,295	
		外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド		2,592,702	
		野村マネー マザーファンド		4,489,737	
		J-REITインデックス マザーファンド		4,016,789	
		海外REITインデックス マザーファンド		1,538,513	
		新興国債券マザーファンド		2,064,212	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド		2,382,090	
	小計		銘柄数: 9 組入時価比率: 83.4%		28,482,626 100.0%
合計				28,482,626	

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

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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

（参考）

当ファンドは、当該計算期間末現在、主要投資対象である親投資信託受益証券のうち、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-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28年 2月17日現在）	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	10,888,901,692
コール・ローン	16,275,641,465
株式	257,290,312,740
派生商品評価勘定	476,046
未収入金	33,614,000
未収配当金	369,926,713
未収利息	499
その他未収収益	3,152,429
差入委託証拠金	446,750,000
流動資産合計	285,308,775,584
<b>資産合計</b>	
285,308,775,584	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	252,949,762
未払金	4,452,755,560
未払解約金	318,734,899
未払利息	262,666
有価証券貸借取引受入金	19,069,860,179
流動負債合計	24,094,563,066
<b>負債合計</b>	
24,094,563,066	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	220,768,182,636
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	40,446,029,882
元本等合計	261,214,212,518
<b>純資産合計</b>	
261,214,212,518	
<b>負債純資産合計</b>	
285,308,775,584	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	株式
-------------------	----

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28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1,183円
(10,000口当たり純資産額)	(11,832円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	18,114,434,310円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日	
1.金融商品に対する取組方針	
<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28年 2月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在	
期首	平成27年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	180,721,457,487円
同期中における追加設定元本額	76,345,372,635円
同期中における一部解約元本額	36,298,647,486円
期末元本額	220,768,182,636円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	192,863,772円
バランスセレクト50	453,435,803円
バランスセレクト70	507,658,647円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,403,521,952円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	5,225,817,000円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	8,896,568,001円
野村資産設計ファンド2015	97,628,538円
野村資産設計ファンド2020	113,274,122円
野村資産設計ファンド2025	126,558,441円
野村資産設計ファンド2030	122,255,431円
野村資産設計ファンド2035	88,159,440円
野村資産設計ファンド2040	302,008,341円



野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	78,673,809,835円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,267,694,159円
のむラップ・ファンド（普通型）	3,296,559,570円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,044,087,924円
野村資産設計ファンド2045	29,687,720円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,509,769,945円
マイ・ロード	2,456,721,023円
ネクストコア	55,213,757円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	285,373,152円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,317,037,453円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	391,388,063円
野村資産設計ファンド2050	8,521,348円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,028,729,673円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	702,694,818円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	4,904,998,527円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,180,678,773円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	13,520,591円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	47,847,458円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	19,316,640円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,216,244,487円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	500,285,730円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	3,275,426,785円
野村日本株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,354,706,663円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,430,844,075円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	476,779,123円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	75,904,893円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	403,649,004円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	6,368,900,750円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	967,495,938円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	591,885,045円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用）	495,229,009円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	50,606,128円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	10,795,522円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	37,407,817円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	37,919,368円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	95,860,097円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	4,041,488,983円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	12,724,110,038円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	16,079,210,340円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX（確定拠出年金向け）	31,721,826,410円
マイバランスDC30	2,150,345,304円
マイバランスDC50	2,893,563,035円
マイバランスDC70	2,537,267,720円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,332,035,278円
野村DC運用戦略ファンド	67,045,276円
野村DC運用戦略ファンドM	394,384円
野村DC運用戦略ファンドA	867,645円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	65,493,197円

マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	343,976円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	850,699円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	64,000	257.00	16,448,000	貸付有価証券 19,000株（19,000株）
		日本水産	175,200	536.00	93,907,200	
		マルハニチロ	31,100	2,116.00	65,807,600	貸付有価証券 100株
		サカタのタネ	22,400	2,737.00	61,308,800	
		ホクト	15,500	2,027.00	31,418,500	
		住石ホールディングス	44,700	94.00	4,201,800	貸付有価証券 16,800株（12,600株）
		日鉄鉱業	42,000	415.00	17,430,000	
		三井松島産業	99,000	115.00	11,385,000	
		国際石油開発帝石	800,800	901.70	722,081,360	
		日本海洋掘削	4,500	2,075.00	9,337,500	貸付有価証券 2,100株（300株）
		石油資源開発	24,100	2,581.00	62,202,100	貸付有価証券 10,700株
		K & Oエナジーグループ	10,200	1,217.00	12,413,400	
		ショーボンドホールディングス	15,900	3,800.00	60,420,000	貸付有価証券 1,000株
		ミライト・ホールディングス	46,800	782.00	36,597,600	
		タマホーム	11,400	381.00	4,343,400	貸付有価証券 5,200株（1,500株）
		サンヨーホームズ	3,200	473.00	1,513,600	貸付有価証券 1,300株
ダイセキ環境ソリューション	3,500	1,004.00	3,514,000	貸付有価証券 1,600株		

安藤・間	101,400	523.00	53,032,200	
東急建設	49,500	798.00	39,501,000	貸付有価証券 19,000株
コムシスホールディングス	65,300	1,572.00	102,651,600	貸付有価証券 400株
ミサワホーム	18,000	623.00	11,214,000	貸付有価証券 8,200株
高松コンストラクシヨングループ	11,500	2,125.00	24,437,500	貸付有価証券 2,900株
東建コーポレーション	6,200	8,100.00	50,220,000	貸付有価証券 900株
ヤマウラ	7,100	447.00	3,173,700	
大成建設	789,000	711.00	560,979,000	
大林組	455,900	1,001.00	456,355,900	
清水建設	465,000	856.00	398,040,000	貸付有価証券 58,000株
飛島建設	115,300	142.00	16,372,600	貸付有価証券 53,200株（1,300株）
長谷工コーポレーション	177,400	990.00	175,626,000	
松井建設	16,700	655.00	10,938,500	
銭高組	22,000	431.00	9,482,000	貸付有価証券 9,000株（1,000株）
鹿島建設	713,000	658.00	469,154,000	
不動テトラ	107,400	110.00	11,814,000	貸付有価証券 49,500株
大末建設	5,800	734.00	4,257,200	
鉄建建設	92,000	235.00	21,620,000	貸付有価証券 42,000株（1,000株）
西松建設	176,000	421.00	74,096,000	貸付有価証券 52,000株
三井住友建設	582,500	90.00	52,425,000	貸付有価証券 233,000株（134,100株）
大豊建設	59,000	443.00	26,137,000	貸付有価証券 14,000株
前田建設工業	94,000	758.00	71,252,000	貸付有価証券 38,000株
佐田建設	10,500	392.00	4,116,000	貸付有価証券 400株
ナカノフドー建設	11,600	532.00	6,171,200	
奥村組	144,000	559.00	80,496,000	

東鉄工業	18,200	3,085.00	56,147,000	
イチケン	17,000	278.00	4,726,000	貸付有価証券 3,000株
浅沼組	49,000	227.00	11,123,000	貸付有価証券 22,000株
戸田建設	177,000	490.00	86,730,000	
熊谷組	223,000	316.00	70,468,000	
青木あすなろ建設	10,000	668.00	6,680,000	
北野建設	32,000	268.00	8,576,000	
植木組	19,000	220.00	4,180,000	
三井ホーム	20,000	505.00	10,100,000	
矢作建設工業	20,700	717.00	14,841,900	貸付有価証券 400株
ピーエス三菱	18,000	417.00	7,506,000	貸付有価証券 5,600株（1,100株）
日本ハウスホールディングス	31,000	395.00	12,245,000	貸付有価証券 10,900株
大東建託	56,800	14,725.00	836,380,000	
新日本建設	18,100	512.00	9,267,200	
N I P P O	35,000	1,696.00	59,360,000	
東亜道路工業	29,000	350.00	10,150,000	
前田道路	48,000	1,706.00	81,888,000	
日本道路	45,000	541.00	24,345,000	
東亜建設工業	133,000	242.00	32,186,000	
若築建設	87,000	112.00	9,744,000	貸付有価証券 34,000株（2,000株）
東洋建設	47,700	429.00	20,463,300	貸付有価証券 9,300株
五洋建設	168,700	474.00	79,963,800	貸付有価証券 56,000株
大林道路	17,800	748.00	13,314,400	貸付有価証券 7,900株（7,900株）
世紀東急工業	23,800	460.00	10,948,000	
福田組	25,000	940.00	23,500,000	貸付有価証券 10,000株（10,000株）
住友林業	104,600	1,266.00	132,423,600	貸付有価証券 1,300株
日本基礎技術	16,900	404.00	6,827,600	
日成ビルド工業	42,000	363.00	15,246,000	貸付有価証券

				19,000株
ヤマダ・エスバイエル ホーム	77,000	65.00	5,005,000	貸付有価証券 35,000株
巴コーポレーション	18,900	357.00	6,747,300	貸付有価証券 100株
パナホーム	57,000	823.00	46,911,000	
大和ハウス工業	449,100	2,953.50	1,326,416,850	貸付有価証券 5,500株
ライト工業	29,200	1,069.00	31,214,800	
積水ハウス	508,200	1,742.50	885,538,500	
日特建設	16,700	408.00	6,813,600	
北陸電気工事	5,500	771.00	4,240,500	
ユアテック	24,000	783.00	18,792,000	
西部電気工業	13,000	412.00	5,356,000	
四電工	12,000	377.00	4,524,000	
中電工	22,000	2,343.00	51,546,000	貸付有価証券 3,300株
関電工	61,000	829.00	50,569,000	
きんでん	91,900	1,438.00	132,152,200	
東京エネシス	17,000	891.00	15,147,000	
トーエネック	21,000	676.00	14,196,000	
住友電設	12,000	1,414.00	16,968,000	
日本電設工業	24,800	2,094.00	51,931,200	
協和エクシオ	59,600	1,188.00	70,804,800	貸付有価証券 16,600株
新日本空調	12,800	922.00	11,801,600	貸付有価証券 800株
N D S	24,000	284.00	6,816,000	
九電工	28,000	2,318.00	64,904,000	貸付有価証券 12,000株(11,000株)
三機工業	33,700	904.00	30,464,800	
日揮	153,000	1,697.00	259,641,000	
中外炉工業	46,000	181.00	8,326,000	貸付有価証券 13,000株
ヤマト	13,600	425.00	5,780,000	
太平電業	22,000	944.00	20,768,000	貸付有価証券 9,000株
高砂熱学工業	45,300	1,490.00	67,497,000	貸付有価証券 20,900株

三晃金属工業	15,000	258.00	3,870,000	
朝日工業社	17,000	420.00	7,140,000	
明星工業	27,500	406.00	11,165,000	
大気社	18,600	2,578.00	47,950,800	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
ダイダン	20,000	740.00	14,800,000	
日比谷総合設備	18,300	1,626.00	29,755,800	
東芝プラントシステム	24,700	1,283.00	31,690,100	貸付有価証券 10,600株
OSJBホールディングス	31,000	216.00	6,696,000	
東洋エンジニアリング	81,000	255.00	20,655,000	貸付有価証券 30,000株(2,000株)
千代田化工建設	110,000	774.00	85,140,000	貸付有価証券 12,000株
新興プランテック	31,200	868.00	27,081,600	貸付有価証券 1,700株
日本製粉	100,000	791.00	79,100,000	
日清製粉グループ本社	166,700	1,817.00	302,893,900	
日東富士製粉	12,000	339.00	4,068,000	
昭和産業	63,000	446.00	28,098,000	
鳥越製粉	12,100	633.00	7,659,300	
中部飼料	14,100	787.00	11,096,700	
フィード・ワン	91,500	116.00	10,614,000	貸付有価証券 25,900株
東洋精糖	23,000	99.00	2,277,000	
日本甜菜製糖	77,000	188.00	14,476,000	
三井製糖	60,000	479.00	28,740,000	
塩水港精糖	16,200	222.00	3,596,400	貸付有価証券 500株
日新製糖	2,100	4,175.00	8,767,500	
森永製菓	137,000	605.00	82,885,000	
中村屋	35,000	453.00	15,855,000	
江崎グリコ	35,100	5,560.00	195,156,000	
名糖産業	6,700	1,281.00	8,582,700	
不二家	87,000	186.00	16,182,000	貸付有価証券 4,000株
山崎製パン	111,000	2,129.00	236,319,000	
第一屋製パン	23,000	102.00	2,346,000	

モロゾフ	23,000	414.00	9,522,000	
亀田製菓	8,500	4,365.00	37,102,500	
寿スピリッツ	3,600	5,670.00	20,412,000	貸付有価証券 1,600株
カルビー	56,300	4,450.00	250,535,000	貸付有価証券 25,100株
森永乳業	136,000	529.00	71,944,000	
六甲バター	6,800	1,712.00	11,641,600	貸付有価証券 3,000株
ヤクルト本社	81,500	5,420.00	441,730,000	貸付有価証券 32,100株（15,500株）
明治ホールディングス	90,000	9,020.00	811,800,000	
雪印メグミルク	35,800	2,643.00	94,619,400	貸付有価証券 2,500株
プリマハム	96,000	276.00	26,496,000	貸付有価証券 4,000株
日本ハム	112,000	2,456.00	275,072,000	貸付有価証券 1,000株
伊藤ハム	73,000	711.00	51,903,000	貸付有価証券 33,000株（26,000株）
林兼産業	49,000	92.00	4,508,000	貸付有価証券 22,000株
丸大食品	78,000	421.00	32,838,000	
米久	4,900	2,570.00	12,593,000	
S Foods	9,500	2,202.00	20,919,000	貸付有価証券 4,300株（3,300株）
サッポロホールディングス	232,000	507.00	117,624,000	貸付有価証券 19,000株
アサヒグループホールディングス	285,200	3,328.00	949,145,600	
キリンホールディングス	616,000	1,462.50	900,900,000	貸付有価証券 900株
宝ホールディングス	110,000	788.00	86,680,000	
オエノンホールディングス	41,000	204.00	8,364,000	
養命酒製造	4,700	1,904.00	8,948,800	
コカ・コーラウエスト	51,500	2,513.00	129,419,500	貸付有価証券 22,600株（22,600株）
コカ・コーライースト ジャパン	53,800	1,953.00	105,071,400	貸付有価証券 4,200株
サントリー食品インター	104,100	4,595.00	478,339,500	

ナショナル				
ダイトードリンコ	7,700	5,050.00	38,885,000	貸付有価証券 100株（100株）
伊藤園	45,100	3,100.00	139,810,000	貸付有価証券 18,000株（2,500株）
キーコーヒー	13,400	1,809.00	24,240,600	貸付有価証券 100株
ユニカフェ	4,100	918.00	3,763,800	
ジャパンフーズ	1,900	1,084.00	2,059,600	貸付有価証券 800株
日清オイリオグループ	80,000	453.00	36,240,000	
不二製油グループ本社	40,600	1,882.00	76,409,200	
かどや製油	1,500	2,712.00	4,068,000	貸付有価証券 400株
J - オイルミルズ	64,000	335.00	21,440,000	
キッコーマン	115,000	3,725.00	428,375,000	貸付有価証券 1,000株
味の素	326,000	2,754.50	897,967,000	
キューピー	77,300	2,448.00	189,230,400	貸付有価証券 11,200株（4,400株）
ハウス食品グループ本社	51,900	2,124.00	110,235,600	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
カゴメ	54,600	2,066.00	112,803,600	貸付有価証券 25,100株（11,600株）
焼津水産化学工業	7,200	1,003.00	7,221,600	
アリアケジャパン	12,400	6,430.00	79,732,000	
ピエトロ	1,400	1,843.00	2,580,200	貸付有価証券 600株（600株）
エバラ食品工業	3,600	1,940.00	6,984,000	
ニチレイ	162,000	868.00	140,616,000	
東洋水産	74,700	4,065.00	303,655,500	
イトアアンド	1,700	2,214.00	3,763,800	貸付有価証券 700株
日清食品ホールディングス	64,300	5,330.00	342,719,000	貸付有価証券 21,300株
永谷園ホールディングス	15,000	1,037.00	15,555,000	
一正蒲鉾	5,300	861.00	4,563,300	貸付有価証券 1,300株
フジッコ	14,700	2,194.00	32,251,800	貸付有価証券 4,300株（4,300株）



ロック・フィールド	7,900	2,930.00	23,147,000	
日本たばこ産業	898,700	4,359.00	3,917,433,300	貸付有価証券 7,600株
ケンコーマヨネーズ	4,900	2,197.00	10,765,300	
わらべや日洋	8,200	2,211.00	18,130,200	貸付有価証券 3,600株
なとり	7,600	1,623.00	12,334,800	
北の達人コーポレーション	2,100	510.00	1,071,000	貸付有価証券 900株
ユーグレナ	51,300	1,492.00	76,539,600	貸付有価証券 23,600株
ミヨシ油脂	52,000	119.00	6,188,000	貸付有価証券 2,000株
理研ビタミン	4,500	3,635.00	16,357,500	
片倉工業	17,800	1,151.00	20,487,800	貸付有価証券 800株
グンゼ	115,000	280.00	32,200,000	
東洋紡	563,000	152.00	85,576,000	貸付有価証券 40,000株
ユニチカ	414,000	49.00	20,286,000	貸付有価証券 190,000株
富士紡ホールディングス	69,000	205.00	14,145,000	貸付有価証券 11,000株（11,000株）
倉敷紡績	146,000	177.00	25,842,000	
シキボウ	87,000	103.00	8,961,000	
日本毛織	44,000	744.00	32,736,000	
大東紡織	20,000	57.00	1,140,000	
トーア紡コーポレーション	6,000	435.00	2,610,000	貸付有価証券 1,600株
ダイドーリミテッド	15,900	455.00	7,234,500	貸付有価証券 2,100株
帝国繊維	14,900	1,423.00	21,202,700	貸付有価証券 400株
帝人	581,000	375.00	217,875,000	
東レ	1,031,000	908.10	936,251,100	貸付有価証券 15,000株
サカイオーボックス	37,000	164.00	6,068,000	
住江織物	36,000	280.00	10,080,000	
日本フェルト	7,500	452.00	3,390,000	
イチカワ	9,000	260.00	2,340,000	

日東製網	15,000	119.00	1,785,000	
芦森工業	31,000	142.00	4,402,000	貸付有価証券 14,000株
アツギ	109,000	110.00	11,990,000	貸付有価証券 8,000株
ダイニック	27,000	150.00	4,050,000	
セーレン	35,400	1,075.00	38,055,000	
東海染工	20,000	117.00	2,340,000	
小松精練	21,800	565.00	12,317,000	貸付有価証券 9,200株
ワコールホールディングス	85,000	1,314.00	111,690,000	
ホギメディカル	8,900	5,520.00	49,128,000	貸付有価証券 3,900株（2,400株）
レナウン	38,400	102.00	3,916,800	貸付有価証券 17,700株（7,000株）
クラウディア	3,700	468.00	1,731,600	貸付有価証券 1,200株
T S Iホールディングス	63,400	725.00	45,965,000	貸付有価証券 27,500株
三陽商会	80,000	257.00	20,560,000	貸付有価証券 36,000株
ナイガイ	52,000	40.00	2,080,000	貸付有価証券 23,000株
オンワードホールディングス	95,000	695.00	66,025,000	貸付有価証券 32,000株（2,000株）
ルック	26,000	144.00	3,744,000	貸付有価証券 5,000株
キムラタン	599,000	7.00	4,193,000	貸付有価証券 63,000株
ゴールドウイン	6,000	4,540.00	27,240,000	貸付有価証券 2,700株
デサント	32,400	1,643.00	53,233,200	
キング	7,000	388.00	2,716,000	
ヤマトインターナショナル	8,700	382.00	3,323,400	貸付有価証券 2,800株
特種東海製紙	83,000	350.00	29,050,000	
王子ホールディングス	583,000	426.00	248,358,000	貸付有価証券 36,000株
日本製紙	73,500	1,767.00	129,874,500	貸付有価証券 32,700株

三菱製紙	216,000	77.00	16,632,000	貸付有価証券 31,000株
北越紀州製紙	88,200	611.00	53,890,200	貸付有価証券 2,700株
中越パルプ工業	56,000	160.00	8,960,000	貸付有価証券 25,000株（17,000株）
巴川製紙所	22,000	178.00	3,916,000	貸付有価証券 1,000株
大王製紙	62,900	919.00	57,805,100	貸付有価証券 29,000株（8,200株）
レンゴー	126,000	533.00	67,158,000	貸付有価証券 12,000株
トモク	45,000	247.00	11,115,000	
ザ・パック	10,100	2,659.00	26,855,900	
クラレ	224,200	1,223.00	274,196,600	貸付有価証券 5,800株
旭化成	886,000	685.20	607,087,200	
共和レザー	9,300	831.00	7,728,300	
昭和電工	946,000	114.00	107,844,000	貸付有価証券 435,000株
住友化学	1,046,000	477.00	498,942,000	
日本化成	27,000	111.00	2,997,000	
住友精化	29,000	570.00	16,530,000	貸付有価証券 13,000株
日産化学工業	85,400	2,573.00	219,734,200	貸付有価証券 900株
ラサ工業	54,000	97.00	5,238,000	貸付有価証券 10,000株（5,000株）
クレハ	107,000	366.00	39,162,000	貸付有価証券 49,000株（23,000株）
多木化学	9,000	622.00	5,598,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
テイカ	24,000	524.00	12,576,000	
石原産業	255,000	72.00	18,360,000	
片倉コープアグリ	17,000	210.00	3,570,000	
日東エフシー	8,300	809.00	6,714,700	貸付有価証券 200株
日本曹達	92,000	501.00	46,092,000	
東ソー	383,000	422.00	161,626,000	貸付有価証券 1,000株
トクヤマ	236,000	146.00	34,456,000	貸付有価証券

				106,000株
セントラル硝子	154,000	545.00	83,930,000	
東亜合成	89,000	886.00	78,854,000	
大阪ソーダ	61,000	412.00	25,132,000	貸付有価証券 26,000株
関東電化工業	34,000	812.00	27,608,000	貸付有価証券 7,000株
デンカ	294,000	387.00	113,778,000	
信越化学工業	254,800	5,560.00	1,416,688,000	貸付有価証券 100株
日本カーバイド工業	48,000	114.00	5,472,000	貸付有価証券 6,000株
堺化学工業	57,000	308.00	17,556,000	
エア・ウォーター	117,000	1,560.00	182,520,000	
大陽日酸	109,500	1,022.00	111,909,000	貸付有価証券 22,100株(7,200株)
日本化学工業	53,000	193.00	10,229,000	
日本パーカライジング	72,600	967.00	70,204,200	
高压ガス工業	21,000	586.00	12,306,000	
チタン工業	17,000	163.00	2,771,000	貸付有価証券 5,000株
四国化成工業	20,000	882.00	17,640,000	
戸田工業	28,000	298.00	8,344,000	貸付有価証券 13,000株
ステラ ケミファ	7,300	1,956.00	14,278,800	貸付有価証券 1,600株(1,000株)
保土谷化学工業	43,000	173.00	7,439,000	貸付有価証券 19,000株
日本触媒	20,600	6,940.00	142,964,000	
大日精化工業	55,000	443.00	24,365,000	
カネカ	192,000	879.00	168,768,000	
三菱瓦斯化学	244,000	569.00	138,836,000	貸付有価証券 14,000株
三井化学	603,000	388.00	233,964,000	
J S R	133,300	1,550.00	206,615,000	
東京応化工業	28,500	2,849.00	81,196,500	貸付有価証券 1,400株
大阪有機化学工業	10,100	611.00	6,171,100	
三菱ケミカルホールディングス	951,800	601.80	572,793,240	

日本合成化学工業	33,000	675.00	22,275,000	
ダイセル	199,900	1,524.00	304,647,600	
住友ベークライト	133,000	456.00	60,648,000	貸付有価証券 55,000株
積水化学工業	322,600	1,265.00	408,089,000	
日本ゼオン	122,000	697.00	85,034,000	貸付有価証券 11,000株
アイカ工業	42,700	2,077.00	88,687,900	
宇部興産	761,000	195.00	148,395,000	
積水樹脂	21,900	1,345.00	29,455,500	
タキロン	33,000	534.00	17,622,000	貸付有価証券 8,000株（2,000株）
旭有機材工業	46,000	197.00	9,062,000	
日立化成	70,200	1,842.00	129,308,400	
ニチバン	14,000	608.00	8,512,000	
リケンテクノス	23,000	346.00	7,958,000	貸付有価証券 5,700株（500株）
大倉工業	34,000	267.00	9,078,000	
積水化成品工業	36,000	345.00	12,420,000	
群栄化学工業	38,000	272.00	10,336,000	
タイガースポリマー	7,000	639.00	4,473,000	
ミライアル	5,100	824.00	4,202,400	
ダイキアクシス	2,600	809.00	2,103,400	
ダイキョーニシカワ	18,300	1,581.00	28,932,300	貸付有価証券 5,000株
日本化薬	92,000	1,138.00	104,696,000	貸付有価証券 1,000株
カーリットホールディングス	13,200	475.00	6,270,000	
日本精化	11,800	711.00	8,389,800	
扶桑化学工業	9,000	1,315.00	11,835,000	貸付有価証券 600株
A D E K A	69,900	1,471.00	102,822,900	
日油	108,000	784.00	84,672,000	
新日本理化	22,400	138.00	3,091,200	貸付有価証券 10,300株
ハリマ化成グループ	12,100	509.00	6,158,900	貸付有価証券 200株
花王	382,200	5,591.00	2,136,880,200	

第一工業製薬	32,000	305.00	9,760,000	貸付有価証券 14,000株
ニイタカ	2,100	1,290.00	2,709,000	
三洋化成工業	45,000	776.00	34,920,000	
大日本塗料	81,000	198.00	16,038,000	
日本ペイントホールディングス	109,700	2,274.00	249,457,800	貸付有価証券 37,400株
関西ペイント	160,800	1,646.00	264,676,800	貸付有価証券 62,300株
神東塗料	10,000	173.00	1,730,000	
中国塗料	41,000	687.00	28,167,000	
日本特殊塗料	9,900	933.00	9,236,700	
藤倉化成	19,300	519.00	10,016,700	
太陽ホールディングス	10,400	3,670.00	38,168,000	貸付有価証券 600株
D I C	569,000	244.00	138,836,000	
サカタインクス	29,000	1,076.00	31,204,000	
東洋インキ S C ホールディングス	140,000	447.00	62,580,000	
T & K T O K A	10,300	895.00	9,218,500	
富士フイルムホールディングス	325,200	4,250.00	1,382,100,000	
資生堂	269,600	2,273.50	612,935,600	貸付有価証券 44,500株
ライオン	164,000	1,148.00	188,272,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
高砂香料工業	9,300	2,353.00	21,882,900	
マンダム	13,200	4,375.00	57,750,000	
ミルボン	8,400	4,060.00	34,104,000	
ファンケル	32,900	1,315.00	43,263,500	貸付有価証券 13,300株(13,300株)
コーセー	23,000	8,770.00	201,710,000	貸付有価証券 5,600株
コタ	4,400	1,506.00	6,626,400	
シーズ・ホールディングス	17,900	1,826.00	32,685,400	貸付有価証券 8,200株
シーボン	1,600	2,330.00	3,728,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	14,500	8,000.00	116,000,000	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
ノエビアホールディング	9,000	2,958.00	26,622,000	

ス				
アジュバンコスメジャパン	2,700	985.00	2,659,500	
エステー	9,700	1,095.00	10,621,500	
アグロ カネショウ	5,500	880.00	4,840,000	貸付有価証券 300株
コニシ	11,100	2,367.00	26,273,700	
長谷川香料	18,000	1,384.00	24,912,000	
星光PMC	7,800	905.00	7,059,000	貸付有価証券 3,400株（200株）
小林製薬	21,500	9,280.00	199,520,000	
荒川化学工業	12,100	933.00	11,289,300	
メック	11,000	795.00	8,745,000	貸付有価証券 1,900株（1,300株）
日本高純度化学	4,000	2,017.00	8,068,000	
JCU	4,200	3,340.00	14,028,000	
新田ゼラチン	9,300	670.00	6,231,000	貸付有価証券 2,400株（2,000株）
OATアグリオ	1,200	1,224.00	1,468,800	貸付有価証券 500株
デクセリアルズ	31,800	996.00	31,672,800	貸付有価証券 14,200株（100株）
アース製薬	10,200	4,050.00	41,310,000	貸付有価証券 3,200株（2,900株）
イハラケミカル工業	21,800	1,165.00	25,397,000	
北興化学工業	15,000	288.00	4,320,000	
大成ラミック	4,000	2,950.00	11,800,000	
クミアイ化学工業	29,300	1,137.00	33,314,100	貸付有価証券 13,500株（10,600株）
日本農薬	32,400	566.00	18,338,400	貸付有価証券 14,900株（500株）
アキレス	116,000	140.00	16,240,000	
有沢製作所	21,000	559.00	11,739,000	
日東電工	109,800	5,722.00	628,275,600	貸付有価証券 1,400株
レック	4,400	1,251.00	5,504,400	貸付有価証券 300株
きもと	23,100	174.00	4,019,400	貸付有価証券 600株
藤森工業	12,200	2,438.00	29,743,600	貸付有価証券

				100株
前澤化成工業	9,900	1,005.00	9,949,500	
J S P	9,300	2,195.00	20,413,500	
エフピコ	12,600	4,625.00	58,275,000	貸付有価証券 800株
天馬	10,900	1,885.00	20,546,500	
信越ポリマー	27,800	577.00	16,040,600	
東リ	37,000	285.00	10,545,000	
ニフコ	27,200	5,160.00	140,352,000	貸付有価証券 11,700株(100株)
日本バルカー工業	55,000	275.00	15,125,000	
ユニ・チャーム	287,700	2,259.00	649,914,300	貸付有価証券 37,500株(31,500株)
協和発酵キリン	170,000	1,522.00	258,740,000	
武田薬品工業	565,900	5,298.00	2,998,138,200	
アステラス製薬	1,591,100	1,549.00	2,464,613,900	
大日本住友製薬	100,600	1,189.00	119,613,400	貸付有価証券 46,300株
塩野義製薬	207,100	4,410.00	913,311,000	
田辺三菱製薬	165,600	1,941.00	321,429,600	
わかもと製薬	16,000	267.00	4,272,000	
あすか製薬	18,000	1,090.00	19,620,000	貸付有価証券 2,000株
日本新薬	32,600	3,760.00	122,576,000	貸付有価証券 2,600株
ビオフェルミン製薬	2,300	3,395.00	7,808,500	
中外製薬	141,500	3,200.00	452,800,000	
科研製薬	24,500	6,660.00	163,170,000	貸付有価証券 500株
エーザイ	174,900	6,775.00	1,184,947,500	
ロート製薬	69,600	1,961.00	136,485,600	
小野薬品工業	64,500	18,625.00	1,201,312,500	
久光製薬	44,100	4,675.00	206,167,500	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
有機合成薬品工業	9,000	231.00	2,079,000	
持田製薬	9,800	8,490.00	83,202,000	
参天製薬	261,500	1,649.00	431,213,500	
扶桑薬品工業	48,000	242.00	11,616,000	貸付有価証券 1,000株



日本ケミファ	20,000	483.00	9,660,000	
ツムラ	44,700	2,678.00	119,706,600	貸付有価証券 11,800株
日医工	33,200	2,630.00	87,316,000	
キッセイ薬品工業	25,200	2,627.00	66,200,400	
生化学工業	27,100	1,303.00	35,311,300	貸付有価証券 7,200株
栄研化学	11,900	2,068.00	24,609,200	
日水製薬	5,700	1,255.00	7,153,500	
鳥居薬品	9,700	2,335.00	22,649,500	貸付有価証券 300株
JCRファーマ	10,900	1,885.00	20,546,500	貸付有価証券 100株
東和薬品	6,500	4,985.00	32,402,500	
富士製薬工業	3,900	1,973.00	7,694,700	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	24,100	7,170.00	172,797,000	貸付有価証券 8,600株
ゼリア新薬工業	29,100	1,359.00	39,546,900	貸付有価証券 100株
第一三共	477,900	2,158.00	1,031,308,200	貸付有価証券 115,500株
キョーリン製薬ホールディングス	37,900	2,075.00	78,642,500	
大幸薬品	7,000	1,279.00	8,953,000	貸付有価証券 3,100株
ダイト	5,900	2,524.00	14,891,600	
大塚ホールディングス	305,500	3,938.00	1,203,059,000	
大正製薬ホールディングス	34,200	8,560.00	292,752,000	貸付有価証券 15,700株
ペプチドリーム	17,500	3,575.00	62,562,500	貸付有価証券 8,000株
日本コークス工業	114,600	76.00	8,709,600	
昭和シェル石油	142,900	917.00	131,039,300	貸付有価証券 20,500株
ニチレキ	17,400	764.00	13,293,600	
東燃ゼネラル石油	214,000	929.00	198,806,000	
ユシロ化学工業	7,600	1,226.00	9,317,600	
ピーピー・カストロール	5,800	1,203.00	6,977,400	貸付有価証券 100株

富士石油	32,900	267.00	8,784,300	
MORESCO	4,500	1,434.00	6,453,000	貸付有価証券 200株
出光興産	74,100	1,764.00	130,712,400	貸付有価証券 6,600株（6,600株）
JXホールディングス	1,682,000	434.50	730,829,000	貸付有価証券 73,300株
コスモエネルギーホールディングス	42,900	1,151.00	49,377,900	貸付有価証券 1,800株
横浜ゴム	85,700	1,793.00	153,660,100	貸付有価証券 36,700株
東洋ゴム工業	64,300	1,798.00	115,611,400	
ブリヂストン	479,500	3,992.00	1,914,164,000	貸付有価証券 500株
住友ゴム工業	133,000	1,567.00	208,411,000	貸付有価証券 59,100株
藤倉ゴム工業	11,900	438.00	5,212,200	貸付有価証券 400株
オカモト	44,000	848.00	37,312,000	貸付有価証券 20,000株
フコク	5,200	859.00	4,466,800	
ニッタ	15,300	3,070.00	46,971,000	
住友理工	30,700	953.00	29,257,100	貸付有価証券 600株
三ツ星ベルト	34,000	851.00	28,934,000	
バンドー化学	52,000	433.00	22,516,000	
日東紡績	94,000	345.00	32,430,000	
旭硝子	750,000	550.00	412,500,000	
日本板硝子	685,000	70.00	47,950,000	貸付有価証券 316,000株
石塚硝子	20,000	195.00	3,900,000	
日本山村硝子	56,000	163.00	9,128,000	
日本電気硝子	293,000	527.00	154,411,000	
オハラ	5,400	512.00	2,764,800	貸付有価証券 1,800株
住友大阪セメント	281,000	414.00	116,334,000	貸付有価証券 10,000株
太平洋セメント	886,000	229.00	202,894,000	
デイ・シイ	13,100	309.00	4,047,900	貸付有価証券 900株

日本ヒューム	13,600	538.00	7,316,800	
日本コンクリート工業	29,200	249.00	7,270,800	貸付有価証券 13,400株
三谷セキサン	7,100	1,398.00	9,925,800	貸付有価証券 100株
アジアパイルホールディングス	17,500	354.00	6,195,000	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	123,000	271.00	33,333,000	
日本カーボン	70,000	186.00	13,020,000	貸付有価証券 32,000株(7,000株)
東洋炭素	7,900	1,399.00	11,052,100	貸付有価証券 2,300株
ノリタケカンパニーリミテド	80,000	242.00	19,360,000	
TOTO	104,400	3,150.00	328,860,000	貸付有価証券 5,700株
日本碍子	179,000	2,103.00	376,437,000	貸付有価証券 4,000株
日本特殊陶業	122,400	2,247.00	275,032,800	貸付有価証券 23,400株
ダントーホールディングス	16,000	174.00	2,784,000	貸付有価証券 7,000株(4,000株)
MARUWA	5,200	2,430.00	12,636,000	貸付有価証券 100株
品川リフラクトリーズ	36,000	197.00	7,092,000	
黒崎播磨	31,000	235.00	7,285,000	
ヨータイ	8,000	308.00	2,464,000	貸付有価証券 1,000株
イソライト工業	7,000	176.00	1,232,000	
東京窯業	17,000	164.00	2,788,000	
ニッカトー	5,000	364.00	1,820,000	
フジミインコーポレーテッド	12,500	1,150.00	14,375,000	貸付有価証券 200株
エーアンドエーマテリアル	29,000	70.00	2,030,000	貸付有価証券 7,000株
ニチアス	72,000	652.00	46,944,000	貸付有価証券 23,000株
ニチハ	18,900	1,532.00	28,954,800	
新日鐵住金	640,500	1,906.00	1,220,793,000	貸付有価証券 57,100株
神戸製鋼所	2,609,000	86.00	224,374,000	貸付有価証券

				58,000株
中山製鋼所	159,000	65.00	10,335,000	貸付有価証券 53,000株
合同製鐵	79,000	189.00	14,931,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	388,300	1,349.50	524,010,850	貸付有価証券 173,300株
日新製鋼	64,800	1,170.00	75,816,000	貸付有価証券 17,800株
東京製鐵	78,400	743.00	58,251,200	貸付有価証券 9,800株(9,700株)
共英製鋼	15,100	1,741.00	26,289,100	貸付有価証券 7,000株
大和工業	31,400	2,262.00	71,026,800	
東京鐵鋼	30,000	394.00	11,820,000	
大阪製鐵	8,900	1,768.00	15,735,200	
淀川製鋼所	21,100	2,384.00	50,302,400	
東洋鋼鈑	34,000	304.00	10,336,000	
丸一鋼管	47,500	3,095.00	147,012,500	貸付有価証券 300株(300株)
モリ工業	23,000	304.00	6,992,000	
大同特殊鋼	238,000	423.00	100,674,000	貸付有価証券 33,000株(2,000株)
日本高周波鋼業	56,000	70.00	3,920,000	貸付有価証券 24,000株
日本冶金工業	104,500	108.00	11,286,000	貸付有価証券 48,200株
山陽特殊製鋼	84,000	523.00	43,932,000	
愛知製鋼	84,000	418.00	35,112,000	
日立金属	162,600	1,184.00	192,518,400	
日本金属	37,000	95.00	3,515,000	貸付有価証券 16,000株
大平洋金属	99,000	294.00	29,106,000	貸付有価証券 45,000株(7,000株)
新日本電工	80,400	162.00	13,024,800	貸付有価証券 2,500株
栗本鐵工所	68,000	161.00	10,948,000	貸付有価証券 8,000株
虹技	20,000	157.00	3,140,000	
日本鑄鐵管	15,000	131.00	1,965,000	
三菱製鋼	99,000	184.00	18,216,000	

日亜鋼業	19,600	242.00	4,743,200	
日本精線	10,000	461.00	4,610,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	12,700	585.00	7,429,500	貸付有価証券 300株
新家工業	28,000	127.00	3,556,000	貸付有価証券 6,000株
大紀アルミニウム工業所	22,000	255.00	5,610,000	
日本軽金属ホールディング グス	321,500	169.00	54,333,500	貸付有価証券 141,400株（68,300 株）
三井金属鉱業	362,000	160.00	57,920,000	貸付有価証券 95,000株（14,000株）
東邦亜鉛	74,000	280.00	20,720,000	貸付有価証券 34,000株
三菱マテリアル	886,000	303.00	268,458,000	貸付有価証券 278,000株
住友金属鉱山	392,000	1,093.00	428,456,000	貸付有価証券 12,000株
DOWAホールディング グス	183,000	600.00	109,800,000	
古河機械金属	221,000	160.00	35,360,000	貸付有価証券 20,000株
大阪チタニウムテクノ ロジーズ	14,000	1,600.00	22,400,000	貸付有価証券 6,400株
東邦チタニウム	24,000	875.00	21,000,000	貸付有価証券 11,000株
UACJ	198,000	212.00	41,976,000	貸付有価証券 91,000株
古河電気工業	447,000	242.00	108,174,000	
住友電気工業	568,600	1,347.00	765,904,200	
フジクラ	198,000	493.00	97,614,000	
昭和電線ホールディング グス	169,000	53.00	8,957,000	貸付有価証券 75,000株
東京特殊電線	2,000	859.00	1,718,000	
タツタ電線	29,600	350.00	10,360,000	
沖電線	16,000	192.00	3,072,000	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
カナレ電気	2,200	1,624.00	3,572,800	貸付有価証券 400株
平河ヒューテック	6,700	957.00	6,411,900	

リョービ	87,000	402.00	34,974,000	
アーレスティ	16,400	655.00	10,742,000	
アサヒホールディングス	21,400	1,539.00	32,934,600	
稲葉製作所	7,500	1,119.00	8,392,500	貸付有価証券 200株
宮地エンジニアリンググループ	44,000	128.00	5,632,000	貸付有価証券 20,000株
トーカロ	10,000	1,907.00	19,070,000	
アルファC o	4,700	1,045.00	4,911,500	
SUMCO	111,200	708.00	78,729,600	貸付有価証券 20,100株
川田テクノロジーズ	2,700	3,045.00	8,221,500	貸付有価証券 1,200株
東洋製罐グループホールディングス	100,900	1,945.00	196,250,500	貸付有価証券 5,200株（500株）
ホッカンホールディングス	37,000	290.00	10,730,000	
コロナ	7,400	957.00	7,081,800	
横河ブリッジホールディングス	26,900	1,017.00	27,357,300	貸付有価証券 12,400株
駒井ハルテック	25,000	213.00	5,325,000	
高田機工	12,000	181.00	2,172,000	
三和ホールディングス	143,900	710.00	102,169,000	
文化シャッター	39,500	900.00	35,550,000	
三協立山	18,600	1,268.00	23,584,800	貸付有価証券 8,600株
アルインコ	8,000	978.00	7,824,000	貸付有価証券 1,200株
東洋シャッター	3,500	545.00	1,907,500	
LIXILグループ	197,800	2,399.00	474,522,200	貸付有価証券 16,900株
日本フィルコン	10,300	422.00	4,346,600	貸付有価証券 300株（300株）
ノーリツ	27,800	1,900.00	52,820,000	貸付有価証券 8,500株（3,900株）
長府製作所	15,200	2,447.00	37,194,400	貸付有価証券 1,600株
リンナイ	26,400	9,650.00	254,760,000	貸付有価証券 4,000株
ダイニチ工業	7,200	598.00	4,305,600	

日東精工	20,000	290.00	5,800,000	
三洋工業	18,000	150.00	2,700,000	
岡部	29,500	682.00	20,119,000	貸付有価証券 8,400株（100株）
ジーテクト	14,800	1,163.00	17,212,400	
中国工業	2,200	640.00	1,408,000	貸付有価証券 900株
東プレ	27,300	2,076.00	56,674,800	貸付有価証券 12,300株（11,800株）
高周波熱錬	26,400	804.00	21,225,600	貸付有価証券 4,300株
東京製綱	96,000	140.00	13,440,000	貸付有価証券 44,000株
サンコール	7,500	471.00	3,532,500	
モリテック スチール	7,100	244.00	1,732,400	
パイオラックス	7,200	5,260.00	37,872,000	
日本発條	133,700	1,011.00	135,170,700	貸付有価証券 7,700株（7,700株）
中央発條	18,000	260.00	4,680,000	
アドバネクス	2,600	1,242.00	3,229,200	
立川ブラインド工業	5,900	685.00	4,041,500	貸付有価証券 900株
三益半導体工業	10,500	972.00	10,206,000	
日本ドライケミカル	1,800	2,094.00	3,769,200	貸付有価証券 200株
日本製鋼所	235,000	378.00	88,830,000	
三浦工業	63,300	1,839.00	116,408,700	
タクマ	52,000	875.00	45,500,000	
ツガミ	41,000	401.00	16,441,000	
オークマ	92,000	848.00	78,016,000	貸付有価証券 42,000株（4,000株）
東芝機械	77,000	372.00	28,644,000	貸付有価証券 20,000株
アマダホールディングス	207,100	1,082.00	224,082,200	
アイダエンジニアリング	37,200	862.00	32,066,400	
滝澤鉄工所	44,000	122.00	5,368,000	
富士機械製造	46,400	1,033.00	47,931,200	
牧野フライス製作所	71,000	722.00	51,262,000	貸付有価証券 6,000株（6,000株）

オーエスジー	64,700	1,914.00	123,835,800	貸付有価証券 29,800株（27,600株）
ダイジェット工業	16,000	126.00	2,016,000	
旭ダイヤモンド工業	38,900	954.00	37,110,600	
D M G 森精機	78,400	931.00	72,990,400	貸付有価証券 36,100株
ソディック	27,000	678.00	18,306,000	
ディスコ	18,100	10,350.00	187,335,000	貸付有価証券 8,000株
日東工器	8,300	2,108.00	17,496,400	
パンチ工業	5,600	683.00	3,824,800	貸付有価証券 100株
豊和工業	7,900	535.00	4,226,500	貸付有価証券 3,600株
O K K	55,000	106.00	5,830,000	
東洋機械金属	10,500	320.00	3,360,000	
津田駒工業	34,000	95.00	3,230,000	貸付有価証券 15,000株
エンシュウ	35,000	77.00	2,695,000	貸付有価証券 8,000株
島精機製作所	20,000	1,706.00	34,120,000	貸付有価証券 9,200株（300株）
フリーー	2,100	3,140.00	6,594,000	
日阪製作所	17,900	763.00	13,657,700	
やまびこ	26,000	762.00	19,812,000	
ペガサスミシン製造	14,600	485.00	7,081,000	貸付有価証券 400株（400株）
ナプテスコ	73,800	2,313.00	170,699,400	貸付有価証券 2,400株
三井海洋開発	16,600	1,444.00	23,970,400	貸付有価証券 7,600株（400株）
レオン自動機	12,000	586.00	7,032,000	貸付有価証券 700株
S M C	42,600	26,555.00	1,131,243,000	貸付有価証券 600株（600株）
新川	12,700	380.00	4,826,000	貸付有価証券 5,800株（4,200株）
ホソカワミクロン	24,000	537.00	12,888,000	
ユニオンツール	6,100	2,320.00	14,152,000	貸付有価証券 2,800株（1,400株）
オイレス工業	18,400	1,757.00	32,328,800	貸付有価証券



				1,200株
日精エー・エス・ビー機械	5,200	1,869.00	9,718,800	貸付有価証券 2,300株
サトーホールディングス	19,100	2,435.00	46,508,500	貸付有価証券 5,700株
日本エアーテック	5,000	678.00	3,390,000	貸付有価証券 1,900株
日精樹脂工業	10,300	662.00	6,818,600	
ワイエイシイ	5,700	564.00	3,214,800	貸付有価証券 2,600株
小松製作所	696,100	1,729.50	1,203,904,950	
住友重機械工業	414,000	466.00	192,924,000	
日立建機	63,400	1,606.00	101,820,400	貸付有価証券 28,800株(400株)
日工	21,000	319.00	6,699,000	
巴工業	5,800	1,410.00	8,178,000	
井関農機	145,000	162.00	23,490,000	貸付有価証券 67,000株(2,000株)
TOWA	13,700	627.00	8,589,900	貸付有価証券 6,300株(1,800株)
丸山製作所	30,000	159.00	4,770,000	
北川鉄工所	65,000	199.00	12,935,000	
タカキタ	3,500	505.00	1,767,500	貸付有価証券 400株(200株)
クボタ	681,800	1,485.50	1,012,813,900	貸付有価証券 23,500株
荏原実業	4,200	1,203.00	5,052,600	
三菱化工機	47,000	224.00	10,528,000	貸付有価証券 21,000株
月島機械	26,900	997.00	26,819,300	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
帝国電機製作所	10,300	667.00	6,870,100	
東京機械製作所	53,000	36.00	1,908,000	貸付有価証券 21,000株
新東工業	32,200	888.00	28,593,600	
澁谷工業	11,900	1,263.00	15,029,700	貸付有価証券 4,100株(500株)
アイチ コーポレーション	20,100	733.00	14,733,300	
小森コーポレーション	34,500	1,217.00	41,986,500	

鶴見製作所	10,600	1,712.00	18,147,200	
住友精密工業	22,000	342.00	7,524,000	
酒井重工業	27,000	176.00	4,752,000	
荏原製作所	314,000	435.00	136,590,000	貸付有価証券 111,000株（57,000株）
石井鐵工所	21,000	142.00	2,982,000	
西島製作所	15,100	905.00	13,665,500	貸付有価証券 6,900株（1,300株）
北越工業	15,200	632.00	9,606,400	
ダイキン工業	197,600	7,588.00	1,499,388,800	貸付有価証券 17,000株
オルガノ	24,000	412.00	9,888,000	
トーヨーカネツ	76,000	233.00	17,708,000	貸付有価証券 1,000株
栗田工業	85,300	2,498.00	213,079,400	
椿本チエイン	81,000	629.00	50,949,000	
大同工業	28,000	174.00	4,872,000	
日本コンベヤ	47,000	113.00	5,311,000	貸付有価証券 21,000株
木村化工機	12,100	357.00	4,319,700	貸付有価証券 1,100株
アネスト岩田	22,900	878.00	20,106,200	
ダイフク	72,900	1,800.00	131,220,000	貸付有価証券 16,700株（16,700株）
サムコ	2,300	777.00	1,787,100	貸付有価証券 800株
加藤製作所	32,000	365.00	11,680,000	貸付有価証券 15,000株（2,000株）
油研工業	27,000	188.00	5,076,000	
タダノ	65,000	955.00	62,075,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
フジテック	39,500	1,160.00	45,820,000	貸付有価証券 18,200株（13,100株）
C K D	37,700	766.00	28,878,200	
キトー	17,100	728.00	12,448,800	貸付有価証券 5,200株
平和	42,000	2,317.00	97,314,000	
理想科学工業	15,000	1,682.00	25,230,000	
S A N K Y O	37,700	4,105.00	154,758,500	

日本金銭機械	12,500	929.00	11,612,500	貸付有価証券 5,700株(1,200株)
マースエンジニアリング	7,700	1,952.00	15,030,400	
福島工業	8,400	2,248.00	18,883,200	
オーイズミ	5,700	439.00	2,502,300	貸付有価証券 2,500株
ダイコク電機	5,600	1,199.00	6,714,400	貸付有価証券 2,500株
竹内製作所	20,100	1,453.00	29,205,300	貸付有価証券 2,800株
アマノ	42,000	1,526.00	64,092,000	
JUKI	20,100	888.00	17,848,800	貸付有価証券 9,300株
サンデンホールディングス	83,000	291.00	24,153,000	貸付有価証券 38,000株
蛇の目マシン工業	13,200	532.00	7,022,400	貸付有価証券 5,800株
マックス	21,000	1,159.00	24,339,000	
グローリー	46,300	3,670.00	169,921,000	
新晃工業	9,500	1,611.00	15,304,500	
大和冷機工業	21,800	936.00	20,404,800	
セガサミーホールディングス	145,800	1,135.00	165,483,000	貸付有価証券 45,500株
日本ピストンリング	5,600	1,530.00	8,568,000	
リケン	63,000	368.00	23,184,000	
T P R	16,700	2,584.00	43,152,800	貸付有価証券 400株
ツバキ・ナカシマ	12,600	1,392.00	17,539,200	貸付有価証券 5,700株
ホシザキ電機	29,700	8,050.00	239,085,000	貸付有価証券 1,000株
大豊工業	10,900	1,097.00	11,957,300	
日本精工	278,700	1,022.00	284,831,400	貸付有価証券 5,100株
NTN	336,000	355.00	119,280,000	
ジェイテクト	144,600	1,549.00	223,985,400	
不二越	126,000	367.00	46,242,000	貸付有価証券 57,000株
日本トムソン	46,000	394.00	18,124,000	
THK	90,200	1,967.00	177,423,400	貸付有価証券

				41,600株(39,100株)
ユーシン精機	5,300	1,662.00	8,808,600	
前澤給装工業	5,500	1,385.00	7,617,500	
イーグル工業	16,800	1,423.00	23,906,400	
前澤工業	9,900	275.00	2,722,500	
日本ピラー工業	13,700	900.00	12,330,000	
キッツ	65,900	474.00	31,236,600	貸付有価証券 23,100株(4,700株)
日立工機	36,300	746.00	27,079,800	貸付有価証券 100株
マキタ	88,500	6,550.00	579,675,000	貸付有価証券 12,100株
日立造船	107,600	525.00	56,490,000	貸付有価証券 2,600株
三菱重工業	2,416,000	403.60	975,097,600	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
I H I	1,043,000	184.00	191,912,000	貸付有価証券 393,000株(97,000 株)
日清紡ホールディングス	75,300	1,124.00	84,637,200	
イビデン	83,100	1,329.00	110,439,900	貸付有価証券 38,300株(31,400株)
コニカミノルタ	338,800	927.00	314,067,600	
ブラザー工業	175,400	1,184.00	207,673,600	貸付有価証券 75,900株
ミネベア	219,000	765.00	167,535,000	貸付有価証券 24,000株(18,000株)
日立製作所	3,461,000	471.00	1,630,131,000	
東芝	2,856,000	166.60	475,809,600	貸付有価証券 1,285,000株
三菱電機	1,447,000	1,081.50	1,564,930,500	
富士電機	409,000	368.00	150,512,000	
東洋電機製造	27,000	310.00	8,370,000	貸付有価証券 3,000株
安川電機	168,500	1,240.00	208,940,000	貸付有価証券 46,100株
シンフォニアテクノロジー	88,000	144.00	12,672,000	
明電舎	125,000	461.00	57,625,000	
オリジン電気	20,000	255.00	5,100,000	

山洋電気	36,000	498.00	17,928,000	
デンヨー	12,500	1,181.00	14,762,500	貸付有価証券 4,500株
東芝テック	97,000	353.00	34,241,000	
芝浦メカトロニクス	22,000	182.00	4,004,000	貸付有価証券 9,000株
マブチモーター	38,800	4,895.00	189,926,000	
日本電産	163,300	7,336.00	1,197,968,800	貸付有価証券 74,100株
東光高岳	7,500	1,330.00	9,975,000	貸付有価証券 700株
ダブル・スコープ	4,000	3,650.00	14,600,000	貸付有価証券 1,800株
ダイヘン	80,000	455.00	36,400,000	
田淵電機	15,400	405.00	6,237,000	貸付有価証券 6,500株
ヤーマン	1,700	1,917.00	3,258,900	
JVCケンウッド	99,500	280.00	27,860,000	貸付有価証券 43,700株
ミマキエンジニアリング	9,100	424.00	3,858,400	貸付有価証券 4,200株（200株）
第一精工	5,600	1,279.00	7,162,400	貸付有価証券 400株（400株）
日新電機	31,800	905.00	28,779,000	貸付有価証券 3,700株
大崎電気工業	25,000	680.00	17,000,000	貸付有価証券 10,000株
オムロン	155,700	3,025.00	470,992,500	貸付有価証券 21,300株
日東工業	21,700	1,827.00	39,645,900	
I D E C	17,700	971.00	17,186,700	
不二電機工業	1,300	1,313.00	1,706,900	貸付有価証券 200株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	261,000	442.00	115,362,000	貸付有価証券 102,000株
サクサホールディングス	34,000	177.00	6,018,000	貸付有価証券 12,000株（12,000株）
メルコホールディングス	7,500	2,001.00	15,007,500	貸付有価証券 3,200株（3,200株）
テクノメディカ	3,000	2,069.00	6,207,000	
日本電気	1,865,000	275.00	512,875,000	貸付有価証券

				33,000株
富士通	1,308,000	391.00	511,428,000	
沖電気工業	588,000	142.00	83,496,000	貸付有価証券 217,000株
岩崎通信機	64,000	67.00	4,288,000	貸付有価証券 28,000株
電気興業	36,000	508.00	18,288,000	
サンケン電気	74,000	286.00	21,164,000	貸付有価証券 34,000株
ナカヨ	13,000	322.00	4,186,000	貸付有価証券 5,000株
アイホン	7,700	1,780.00	13,706,000	
ルネサスエレクトロニクス	70,200	663.00	46,542,600	貸付有価証券 32,400株(900株)
セイコーエプソン	202,000	1,765.00	356,530,000	貸付有価証券 59,000株(1,100株)
ワコム	106,800	451.00	48,166,800	貸付有価証券 42,800株
アルバック	24,900	3,020.00	75,198,000	
アクセル	6,100	863.00	5,264,300	貸付有価証券 800株
E I Z O	13,400	2,905.00	38,927,000	貸付有価証券 1,900株
ジャパンディスプレイ	253,400	215.00	54,481,000	貸付有価証券 116,900株(59,600株)
日本信号	37,400	807.00	30,181,800	
京三製作所	32,000	316.00	10,112,000	
能美防災	15,400	1,341.00	20,651,400	
ホーチキ	9,800	1,087.00	10,652,600	
エレコム	11,700	1,414.00	16,543,800	
日本無線	35,000	266.00	9,310,000	貸付有価証券 14,000株
パナソニック	1,550,100	877.00	1,359,437,700	
シャープ	1,147,000	156.00	178,932,000	貸付有価証券 529,000株(53,000株)
アンリツ	81,500	625.00	50,937,500	貸付有価証券 37,600株
富士通ゼネラル	41,000	1,490.00	61,090,000	
日立国際電気	31,000	1,274.00	39,494,000	

ソニー	957,200	2,481.00	2,374,813,200	
T D K	81,900	5,810.00	475,839,000	
帝国通信工業	32,000	163.00	5,216,000	
ミツミ電機	51,600	474.00	24,458,400	貸付有価証券 22,700株（9,000株）
タムラ製作所	52,000	270.00	14,040,000	
アルプス電気	115,100	1,829.00	210,517,900	
池上通信機	43,000	122.00	5,246,000	貸付有価証券 19,000株
パイオニア	219,500	230.00	50,485,000	貸付有価証券 93,400株（12,300株）
日本電波工業	12,200	666.00	8,125,200	貸付有価証券 4,700株
鈴木	3,900	459.00	1,790,100	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
日本トリム	3,600	4,085.00	14,706,000	貸付有価証券 1,600株（100株）
ローランド ディー . ジー .	6,700	2,279.00	15,269,300	貸付有価証券 2,500株
フォスター電機	17,000	2,207.00	37,519,000	
クラリオン	71,000	338.00	23,998,000	貸付有価証券 31,000株（1,000株）
S M K	40,000	497.00	19,880,000	
ヨコオ	9,700	513.00	4,976,100	
東光	27,000	361.00	9,747,000	貸付有価証券 12,000株
ティアック	98,000	40.00	3,920,000	貸付有価証券 45,000株
ホシデン	41,100	628.00	25,810,800	貸付有価証券 12,300株
ヒロセ電機	21,900	12,680.00	277,692,000	
日本航空電子工業	39,000	1,170.00	45,630,000	
T O A	16,000	993.00	15,888,000	貸付有価証券 1,400株
日立マクセル	22,500	1,576.00	35,460,000	貸付有価証券 2,800株
古野電気	16,100	684.00	11,012,400	貸付有価証券 1,000株
ユニデンホールディング ス	43,000	108.00	4,644,000	貸付有価証券 19,000株
アルパイン	32,300	1,238.00	39,987,400	貸付有価証券

				6,800株
スミダコーポレーション	11,100	661.00	7,337,100	貸付有価証券 5,100株(1,000株)
アイコム	7,500	2,191.00	16,432,500	
リオン	5,200	1,452.00	7,550,400	
船井電機	13,700	911.00	12,480,700	貸付有価証券 6,300株
横河電機	135,800	1,195.00	162,281,000	貸付有価証券 8,400株(5,300株)
新電元工業	48,000	354.00	16,992,000	
アズビル	44,300	2,867.00	127,008,100	
東亜ディーケーケー	5,700	501.00	2,855,700	
日本光電工業	56,700	2,721.00	154,280,700	貸付有価証券 25,300株(10,800株)
チノー	4,800	1,007.00	4,833,600	
共和電業	16,500	354.00	5,841,000	
日本電子材料	5,400	377.00	2,035,800	貸付有価証券 100株
堀場製作所	25,100	3,555.00	89,230,500	
アドバンテスト	92,500	1,009.00	93,332,500	貸付有価証券 36,800株(5,400株)
小野測器	6,600	683.00	4,507,800	貸付有価証券 200株
エスペック	14,000	1,360.00	19,040,000	
パナソニック デバイス SUNX	11,900	538.00	6,402,200	
キーエンス	30,700	55,940.00	1,717,358,000	貸付有価証券 13,700株
日置電機	7,100	2,161.00	15,343,100	
シスメックス	105,300	6,310.00	664,443,000	貸付有価証券 1,000株
日本マイクロニクス	17,700	877.00	15,522,900	貸付有価証券 8,100株(5,200株)
メガチップス	14,200	1,005.00	14,271,000	貸付有価証券 6,500株
OBARA GROUP	8,800	4,325.00	38,060,000	貸付有価証券 3,100株(300株)
澤藤電機	7,000	177.00	1,239,000	貸付有価証券 2,000株
コーセル	18,800	948.00	17,822,400	貸付有価証券



				2,600株
新日本無線	9,900	360.00	3,564,000	貸付有価証券 4,500株(3,000株)
オプテックス	10,000	2,641.00	26,410,000	貸付有価証券 3,100株
千代田インテグレ	7,100	2,552.00	18,119,200	
レーザーテック	15,900	1,300.00	20,670,000	貸付有価証券 4,600株
スタンレー電気	97,400	2,517.00	245,155,800	貸付有価証券 25,100株(9,100株)
岩崎電気	46,000	180.00	8,280,000	貸付有価証券 3,000株
ウシオ電機	82,300	1,594.00	131,186,200	
岡谷電機産業	7,200	367.00	2,642,400	貸付有価証券 100株(100株)
ヘリオス テクノ ホールディング	11,500	378.00	4,347,000	貸付有価証券 5,300株
日本セラミック	7,800	1,852.00	14,445,600	貸付有価証券 3,500株(1,300株)
遠藤照明	6,800	1,010.00	6,868,000	貸付有価証券 1,300株
日本デジタル研究所	11,400	1,556.00	17,738,400	
古河電池	10,000	610.00	6,100,000	貸付有価証券 4,000株(3,000株)
双信電機	6,600	252.00	1,663,200	貸付有価証券 500株
山一電機	11,800	537.00	6,336,600	貸付有価証券 5,200株(3,900株)
図研	9,800	1,176.00	11,524,800	貸付有価証券 300株(300株)
日本電子	54,000	548.00	29,592,000	
カシオ計算機	136,000	2,070.00	281,520,000	貸付有価証券 62,700株
ファナック	138,800	16,120.00	2,237,456,000	
日本シイエムケイ	29,200	340.00	9,928,000	貸付有価証券 13,400株
エンプラス	6,900	3,720.00	25,668,000	貸付有価証券 600株(600株)
大真空	25,000	200.00	5,000,000	貸付有価証券 8,000株
ローム	66,900	4,780.00	319,782,000	

浜松ホトニクス	105,900	2,724.00	288,471,600	貸付有価証券 48,600株
三井ハイテック	19,700	538.00	10,598,600	貸付有価証券 200株
新光電気工業	51,200	631.00	32,307,200	貸付有価証券 17,600株
京セラ	222,700	4,893.00	1,089,671,100	
太陽誘電	66,000	1,125.00	74,250,000	貸付有価証券 100株
村田製作所	142,300	13,595.00	1,934,568,500	貸付有価証券 400株
ユーシン	17,900	651.00	11,652,900	貸付有価証券 6,700株（5,200株）
双葉電子工業	23,200	1,439.00	33,384,800	貸付有価証券 200株
北陸電気工業	55,000	122.00	6,710,000	貸付有価証券 25,000株
ニチコン	42,700	729.00	31,128,300	
日本ケミコン	110,000	147.00	16,170,000	貸付有価証券 1,000株
K O A	18,800	874.00	16,431,200	
市光工業	32,000	175.00	5,600,000	貸付有価証券 14,000株
小糸製作所	81,300	4,910.00	399,183,000	
ミツバ	23,000	1,475.00	33,925,000	
スター精密	25,800	1,255.00	32,379,000	貸付有価証券 11,800株
S C R E E Nホールディングス	139,000	825.00	114,675,000	貸付有価証券 18,000株
キャノン電子	12,400	1,635.00	20,274,000	
キャノン	730,400	3,206.00	2,341,662,400	貸付有価証券 23,300株
リコー	439,300	1,150.00	505,195,000	貸付有価証券 49,900株
M U T O Hホールディングス	16,000	201.00	3,216,000	貸付有価証券 7,000株
東京エレクトロン	121,700	6,677.00	812,590,900	貸付有価証券 400株
トヨタ紡織	47,400	1,773.00	84,040,200	
鬼怒川ゴム工業	31,000	513.00	15,903,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）

ユニプレス	28,100	1,770.00	49,737,000	
豊田自動織機	123,500	4,825.00	595,887,500	貸付有価証券 10,900株
モリタホールディングス	23,700	1,199.00	28,416,300	貸付有価証券 5,500株
三櫻工業	17,200	572.00	9,838,400	
デンソー	335,200	4,251.00	1,424,935,200	貸付有価証券 8,200株
東海理化電機製作所	39,700	2,449.00	97,225,300	
三井造船	525,000	138.00	72,450,000	貸付有価証券 122,000株
川崎重工業	1,056,000	303.00	319,968,000	貸付有価証券 235,000株（7,000株）
名村造船所	40,700	664.00	27,024,800	貸付有価証券 14,800株（200株）
サノヤスホールディングス	16,500	199.00	3,283,500	貸付有価証券 2,500株
日本車輛製造	56,000	231.00	12,936,000	貸付有価証券 25,000株（8,000株）
ニチユ三菱フォークリフト	15,600	454.00	7,082,400	
近畿車輛	20,000	277.00	5,540,000	貸付有価証券 9,000株
日産自動車	1,904,400	979.70	1,865,740,680	貸付有価証券 44,900株
いすゞ自動車	393,100	1,123.50	441,647,850	
トヨタ自動車	1,687,400	6,076.00	10,252,642,400	貸付有価証券 35,600株（7,500株）
日野自動車	193,600	1,147.00	222,059,200	貸付有価証券 25,100株
三菱自動車工業	538,700	812.00	437,424,400	
エフテック	7,100	1,030.00	7,313,000	貸付有価証券 3,100株（1,700株）
レシップホールディングス	4,400	710.00	3,124,000	貸付有価証券 2,000株
G M B	2,200	808.00	1,777,600	
ファルテック	2,400	1,286.00	3,086,400	
武蔵精密工業	14,500	2,102.00	30,479,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
日産車体	66,200	1,158.00	76,659,600	貸付有価証券 8,100株

新明和工業	59,000	774.00	45,666,000	
極東開発工業	27,000	1,057.00	28,539,000	貸付有価証券 11,800株
日信工業	30,300	1,407.00	42,632,100	貸付有価証券 14,000株
トピー工業	112,000	209.00	23,408,000	
ティラド	53,000	161.00	8,533,000	
曙ブレーキ工業	68,700	234.00	16,075,800	貸付有価証券 31,700株（900株）
タチエス	21,500	1,435.00	30,852,500	
N O K	65,600	1,888.00	123,852,800	
フタバ産業	41,300	488.00	20,154,400	貸付有価証券 2,700株
K Y B	152,000	294.00	44,688,000	
シロキ工業	34,000	329.00	11,186,000	
大同メタル工業	18,900	774.00	14,628,600	貸付有価証券 4,900株
プレス工業	72,000	386.00	27,792,000	貸付有価証券 21,200株
ミクニ	12,900	322.00	4,153,800	貸付有価証券 400株
カルソニックカンセイ	104,000	741.00	77,064,000	貸付有価証券 7,000株
太平洋工業	30,100	1,002.00	30,160,200	貸付有価証券 13,600株（12,000株）
ケーヒン	31,200	1,550.00	48,360,000	
河西工業	16,600	1,233.00	20,467,800	
アイシン精機	136,500	4,485.00	612,202,500	貸付有価証券 21,400株
富士機工	15,700	419.00	6,578,300	
マツダ	429,600	1,642.50	705,618,000	
ダイハツ工業	161,900	1,608.00	260,335,200	貸付有価証券 74,700株（26,900株）
今仙電機製作所	12,400	1,031.00	12,784,400	貸付有価証券 4,100株（3,900株）
本田技研工業	1,220,900	2,958.00	3,611,422,200	
スズキ	283,600	2,796.00	792,945,600	
富士重工業	428,700	3,676.00	1,575,901,200	
安永	4,500	498.00	2,241,000	貸付有価証券 1,400株

ヤマハ発動機	191,600	1,794.00	343,730,400	
ショーワ	35,200	895.00	31,504,000	
T B K	16,100	360.00	5,796,000	
エクセディ	18,400	2,266.00	41,694,400	貸付有価証券 8,500株
豊田合成	49,300	2,218.00	109,347,400	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
愛三工業	23,800	910.00	21,658,000	
盟和産業	1,700	838.00	1,424,600	
ヨロズ	12,700	2,169.00	27,546,300	
エフ・シー・シー	22,200	1,900.00	42,180,000	
シマノ	54,700	17,320.00	947,404,000	貸付有価証券 8,700株
タカタ	24,500	495.00	12,127,500	貸付有価証券 11,300株(1,800株)
テイ・エス テック	31,500	2,510.00	79,065,000	貸付有価証券 3,800株(3,600株)
ジャムコ	5,900	2,522.00	14,879,800	貸付有価証券 2,700株
テルモ	208,000	3,750.00	780,000,000	貸付有価証券 700株
クリエートメディック	4,500	817.00	3,676,500	貸付有価証券 1,400株
日機装	50,700	793.00	40,205,100	貸付有価証券 900株
島津製作所	175,000	1,766.00	309,050,000	
J M S	25,000	286.00	7,150,000	
クボテック	2,900	417.00	1,209,300	貸付有価証券 1,300株(1,000株)
モリテックス	2,900	289.00	838,100	貸付有価証券 100株
長野計器	8,700	587.00	5,106,900	貸付有価証券 3,100株(2,500株)
ブイ・テクノロジー	3,200	3,525.00	11,280,000	貸付有価証券 1,500株
東京計器	43,000	161.00	6,923,000	
愛知時計電機	18,000	302.00	5,436,000	貸付有価証券 1,000株
オーバル	13,200	210.00	2,772,000	貸付有価証券 6,100株
東京精密	26,200	2,118.00	55,491,600	

マニー	12,400	1,638.00	20,311,200	貸付有価証券 5,700株
ニコン	253,300	1,695.00	429,343,500	貸付有価証券 103,300株(6,600株)
トプコン	45,500	1,091.00	49,640,500	貸付有価証券 21,000株
オリンパス	202,100	4,010.00	810,421,000	貸付有価証券 4,800株
理研計器	11,000	1,050.00	11,550,000	
タムロン	10,900	1,692.00	18,442,800	
H O Y A	315,700	4,078.00	1,287,424,600	
ノーリツ鋼機	12,200	409.00	4,989,800	
エー・アンド・デイ	12,300	371.00	4,563,300	
シチズンホールディングス	167,000	636.00	106,212,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
リズム時計工業	59,000	134.00	7,906,000	貸付有価証券 5,000株
大研医器	10,700	866.00	9,266,200	貸付有価証券 4,900株(200株)
メニコン	6,800	3,035.00	20,638,000	
松風	6,600	1,256.00	8,289,600	貸付有価証券 2,200株
セイコーホールディングス	87,000	406.00	35,322,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
ニプロ	101,100	1,069.00	108,075,900	貸付有価証券 43,000株
スノーピーク	1,100	3,495.00	3,844,500	貸付有価証券 500株(400株)
パラマウントベッドホールディングス	14,300	3,710.00	53,053,000	
トランザクション	2,000	558.00	1,116,000	貸付有価証券 900株
S H O - B I	4,500	372.00	1,674,000	貸付有価証券 200株
ニホンフラッシュ	4,000	968.00	3,872,000	貸付有価証券 1,800株(100株)
前田工織	14,900	944.00	14,065,600	貸付有価証券 6,900株
永大産業	19,000	391.00	7,429,000	
アートネイチャー	10,900	902.00	9,831,800	
ダンロップスポーツ	8,600	906.00	7,791,600	貸付有価証券

				3,900株(100株)
バンダイナムコホールディングス	140,300	2,278.00	319,603,400	貸付有価証券 100株
アイフィスジャパン	2,300	379.00	871,700	
共立印刷	22,500	281.00	6,322,500	
SHOEI	6,500	1,839.00	11,953,500	
フランスベッドホールディングス	18,900	950.00	17,955,000	
パイロットコーポレーション	23,700	3,630.00	86,031,000	貸付有価証券 300株
萩原工業	2,800	2,027.00	5,675,600	
トッパン・フォームズ	24,200	1,356.00	32,815,200	
フジシールインターナショナル	16,500	3,725.00	61,462,500	貸付有価証券 1,100株
タカラトミー	44,600	780.00	34,788,000	貸付有価証券 19,500株(4,600株)
廣済堂	12,600	326.00	4,107,600	貸付有価証券 5,600株
As-me エステール	3,600	584.00	2,102,400	
アーク	57,100	79.00	4,510,900	貸付有価証券 26,300株
タカノ	6,000	599.00	3,594,000	
プロネクサス	12,700	1,083.00	13,754,100	
ホクシン	10,800	105.00	1,134,000	貸付有価証券 200株
ウッドワン	25,000	229.00	5,725,000	
大建工業	53,000	245.00	12,985,000	
凸版印刷	383,000	976.00	373,808,000	貸付有価証券 11,000株(6,000株)
大日本印刷	401,000	972.00	389,772,000	貸付有価証券 120,000株(120,000株)
図書印刷	25,000	444.00	11,100,000	貸付有価証券 11,000株
共同印刷	46,000	332.00	15,272,000	貸付有価証券 2,000株
日本写真印刷	22,800	2,044.00	46,603,200	
光村印刷	13,000	204.00	2,652,000	
宝印刷	6,500	1,234.00	8,021,000	
アシックス	126,400	1,862.00	235,356,800	貸付有価証券

				58,300株(9,300株)
ツツミ	6,800	2,366.00	16,088,800	
小松ウオール工業	4,600	1,668.00	7,672,800	
ヤマハ	99,700	2,960.00	295,112,000	
河合楽器製作所	5,000	1,874.00	9,370,000	貸付有価証券 1,400株(300株)
クリナップ	15,900	698.00	11,098,200	
ビジョン	76,900	2,370.00	182,253,000	貸付有価証券 35,400株
兼松日産農林	14,000	128.00	1,792,000	
キングジム	11,300	735.00	8,305,500	
リンテック	32,300	2,087.00	67,410,100	
T A S A K I	2,500	1,286.00	3,215,000	貸付有価証券 1,100株(100株)
イトーキ	28,600	720.00	20,592,000	貸付有価証券 11,400株(11,100株)
任天堂	83,600	15,610.00	1,304,996,000	
三菱鉛筆	10,200	4,305.00	43,911,000	貸付有価証券 4,700株(4,700株)
タカラスタンダード	56,000	939.00	52,584,000	
コクヨ	70,500	1,118.00	78,819,000	
ナカバヤシ	28,000	250.00	7,000,000	
グローブライド	6,600	1,429.00	9,431,400	
岡村製作所	47,300	998.00	47,205,400	
美津濃	73,000	479.00	34,967,000	
アデランス	23,500	522.00	12,267,000	貸付有価証券 10,800株(5,700株)
東京電力	1,150,900	544.00	626,089,600	貸付有価証券 52,000株
中部電力	415,100	1,442.00	598,574,200	
関西電力	553,600	1,263.00	699,196,800	貸付有価証券 1,400株
中国電力	187,600	1,546.00	290,029,600	貸付有価証券 24,200株
北陸電力	132,900	1,663.00	221,012,700	
東北電力	339,000	1,464.00	496,296,000	
四国電力	122,200	1,626.00	198,697,200	貸付有価証券 47,700株
九州電力	299,600	1,110.00	332,556,000	貸付有価証券



				138,300株
北海道電力	127,000	1,000.00	127,000,000	
沖縄電力	14,400	2,873.00	41,371,200	
電源開発	115,700	3,395.00	392,801,500	貸付有価証券 12,400株
イーレックス	2,600	1,644.00	4,274,400	貸付有価証券 1,100株
東京瓦斯	1,514,000	532.50	806,205,000	
大阪瓦斯	1,404,000	427.60	600,350,400	
東邦瓦斯	342,000	757.00	258,894,000	
北海道瓦斯	32,000	274.00	8,768,000	貸付有価証券 14,000株
広島ガス	23,600	406.00	9,581,600	
西部瓦斯	153,000	244.00	37,332,000	
静岡ガス	38,500	727.00	27,989,500	
メタウォーター	8,700	2,438.00	21,210,600	貸付有価証券 4,000株
SBSホールディングス	13,400	674.00	9,031,600	
東武鉄道	725,000	578.00	419,050,000	貸付有価証券 124,000株(27,000 株)
相鉄ホールディングス	233,000	689.00	160,537,000	
東京急行電鉄	790,000	890.00	703,100,000	貸付有価証券 18,000株(13,000株)
京浜急行電鉄	372,000	1,006.00	374,232,000	貸付有価証券 13,000株
小田急電鉄	435,000	1,299.00	565,065,000	貸付有価証券 98,000株
京王電鉄	379,000	1,053.00	399,087,000	貸付有価証券 17,000株(2,000株)
京成電鉄	203,000	1,585.00	321,755,000	貸付有価証券 2,000株
富士急行	37,000	1,219.00	45,103,000	貸付有価証券 10,000株(4,000株)
新京成電鉄	17,000	415.00	7,055,000	
東日本旅客鉄道	248,000	9,603.00	2,381,544,000	貸付有価証券 14,700株(14,700株)
西日本旅客鉄道	130,600	6,493.00	847,985,800	
東海旅客鉄道	121,500	20,325.00	2,469,487,500	貸付有価証券 500株(500株)

西武ホールディングス	108,100	2,217.00	239,657,700	貸付有価証券 29,000株
鴻池運輸	19,200	1,245.00	23,904,000	
西日本鉄道	176,000	821.00	144,496,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
ハマキョウレックス	10,400	1,748.00	18,179,200	貸付有価証券 900株
サカイ引越センター	5,300	2,601.00	13,785,300	貸付有価証券 2,400株(2,000株)
近鉄グループホールディングス	1,365,000	483.00	659,295,000	貸付有価証券 271,000株
阪急阪神ホールディングス	911,000	705.00	642,255,000	
南海電気鉄道	305,000	659.00	200,995,000	
京阪電気鉄道	304,000	771.00	234,384,000	貸付有価証券 80,000株
神戸電鉄	33,000	352.00	11,616,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
名古屋鉄道	494,000	550.00	271,700,000	貸付有価証券 162,000株
山陽電気鉄道	49,000	457.00	22,393,000	
日本通運	525,000	498.00	261,450,000	
ヤマトホールディングス	250,700	2,239.50	561,442,650	貸付有価証券 37,200株
山九	179,000	525.00	93,975,000	
丸運	7,300	237.00	1,730,100	
丸全昭和運輸	46,000	405.00	18,630,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
センコー	61,000	706.00	43,066,000	貸付有価証券 17,000株
トナミホールディングス	28,000	257.00	7,196,000	
ニッコンホールディングス	44,400	1,937.00	86,002,800	
日本石油輸送	15,000	238.00	3,570,000	
福山通運	82,000	527.00	43,214,000	貸付有価証券 38,000株(29,000株)
セイノーホールディングス	96,200	1,201.00	115,536,200	
神奈川中央交通	16,000	668.00	10,688,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日立物流	28,300	1,675.00	47,402,500	

丸和運輸機関	3,000	1,974.00	5,922,000	貸付有価証券 1,300株
C & F ロジホールディングス	13,000	829.00	10,777,000	
日本郵船	1,218,000	206.00	250,908,000	
商船三井	661,000	203.00	134,183,000	貸付有価証券 296,000株
川崎汽船	594,000	184.00	109,296,000	貸付有価証券 274,000株
N S ユナイテッド海運	61,000	153.00	9,333,000	貸付有価証券 25,000株
明治海運	12,100	343.00	4,150,300	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
飯野海運	70,200	436.00	30,607,200	
共栄タンカー	11,000	135.00	1,485,000	貸付有価証券 5,000株
乾汽船	10,700	747.00	7,992,900	貸付有価証券 4,300株
日本航空	259,700	4,007.00	1,040,617,900	
A N A ホールディングス	2,518,000	309.00	778,062,000	貸付有価証券 142,000株
パスコ	12,000	381.00	4,572,000	貸付有価証券 5,000株
トランコム	3,900	6,440.00	25,116,000	貸付有価証券 100株
日新	56,000	292.00	16,352,000	
三菱倉庫	96,000	1,428.00	137,088,000	貸付有価証券 15,000株
三井倉庫ホールディングス	79,000	266.00	21,014,000	貸付有価証券 26,000株(9,000株)
住友倉庫	99,000	544.00	53,856,000	
澁澤倉庫	35,000	270.00	9,450,000	
東陽倉庫	23,000	223.00	5,129,000	
日本トランスシティ	31,000	345.00	10,695,000	
ケイヒン	25,000	142.00	3,550,000	
中央倉庫	7,800	896.00	6,988,800	
安田倉庫	10,600	684.00	7,250,400	
東洋埠頭	39,000	141.00	5,499,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	11,000	314.00	3,454,000	

上組	162,000	1,003.00	162,486,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
サンリツ	3,300	489.00	1,613,700	
キムラユニティー	3,400	1,076.00	3,658,400	
キューソー流通システム	3,700	2,079.00	7,692,300	
郵船ロジスティクス	12,500	1,212.00	15,150,000	貸付有価証券 3,700株(400株)
近鉄エクスプレス	24,300	1,572.00	38,199,600	貸付有価証券 8,900株(8,600株)
東海運	7,300	270.00	1,971,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
エーアイティー	6,200	991.00	6,144,200	貸付有価証券 2,800株
内外トランスライン	3,400	845.00	2,873,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
NEC ネットエスアイ	16,800	1,734.00	29,131,200	
システナ	13,100	1,491.00	19,532,100	
デジタルアーツ	6,500	1,975.00	12,837,500	貸付有価証券 2,900株(2,600株)
新日鉄住金ソリューションズ	22,300	1,917.00	42,749,100	
キューブシステム	5,800	498.00	2,888,400	
コア	5,600	1,135.00	6,356,000	貸付有価証券 2,500株
ソフトクリエイトホールディングス	4,800	756.00	3,628,800	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
ITホールディングス	44,400	2,459.00	109,179,600	
ネオス	4,000	407.00	1,628,000	貸付有価証券 1,800株(800株)
電算システム	4,600	1,438.00	6,614,800	貸付有価証券 2,000株
グリー	81,200	544.00	44,172,800	貸付有価証券 21,400株
コーエーテクモホールディングス	31,800	1,593.00	50,657,400	貸付有価証券 100株(100株)
三菱総合研究所	5,200	3,150.00	16,380,000	
ボルテージ	2,600	1,153.00	2,997,800	貸付有価証券 200株
電算	1,500	2,296.00	3,444,000	貸付有価証券 200株
AGS	2,200	803.00	1,766,600	貸付有価証券

				800株
ファインデックス	8,800	843.00	7,418,400	貸付有価証券 4,000株(2,800株)
ヒト・コミュニケーションズ	3,000	1,671.00	5,013,000	貸付有価証券 1,400株(400株)
ブレインパッド	2,000	599.00	1,198,000	貸付有価証券 900株
K L a b	20,700	495.00	10,246,500	貸付有価証券 9,500株(200株)
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	8,800	922.00	8,113,600	貸付有価証券 3,900株
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	496.00	1,438,400	貸付有価証券 1,300株
ネクソン	128,000	1,573.00	201,344,000	
アイスタイル	20,400	774.00	15,789,600	貸付有価証券 4,400株(200株)
エムアップ	3,500	456.00	1,596,000	貸付有価証券 1,500株
エイチーム	4,900	1,390.00	6,811,000	貸付有価証券 1,300株(200株)
テクノスジャパン	1,500	2,570.00	3,855,000	貸付有価証券 600株
e n i s h	3,900	480.00	1,872,000	貸付有価証券 1,800株
コロプラ	37,000	1,970.00	72,890,000	
モバイルクリエイト	8,800	364.00	3,203,200	貸付有価証券 4,000株(300株)
オルトプラス	4,900	367.00	1,798,300	貸付有価証券 2,200株(300株)
ブロードリーフ	13,800	1,228.00	16,946,400	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
ハーツユナイテッドグループ	4,000	1,858.00	7,432,000	貸付有価証券 1,800株(1,100株)
ブイキューブ	6,600	1,065.00	7,029,000	貸付有価証券 3,000株(200株)
サイバーリンクス	1,500	782.00	1,173,000	
VOYAGE GROUP	3,000	1,043.00	3,129,000	貸付有価証券 1,400株
オブティム	800	4,030.00	3,224,000	貸付有価証券 300株(100株)
ベリサーブ	1,500	1,959.00	2,938,500	貸付有価証券 700株(400株)

ティーガイア	13,300	1,159.00	15,414,700	
日本アジアグループ	11,400	468.00	5,335,200	
豆蔵ホールディングス	10,500	618.00	6,489,000	貸付有価証券 4,600株
テクマトリックス	5,700	1,394.00	7,945,800	貸付有価証券 2,600株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	234,000	269.00	62,946,000	貸付有価証券 108,500株
GMOペイメントゲート ウェイ	11,600	5,520.00	64,032,000	貸付有価証券 5,300株（1,100株）
ザッパラス	7,500	377.00	2,827,500	貸付有価証券 2,600株
インターネットイニシア ティブ	21,600	2,083.00	44,992,800	貸付有価証券 800株
さくらインターネット	6,600	1,798.00	11,866,800	貸付有価証券 3,000株（2,100株）
GMOクラウド	3,000	659.00	1,977,000	貸付有価証券 700株
SRAホールディングス	7,700	2,243.00	17,271,100	
Minorityソリューションズ	1,900	836.00	1,588,400	
システムインテグレータ	1,900	693.00	1,316,700	貸付有価証券 800株
朝日ネット	12,100	476.00	5,759,600	
コムチュア	2,300	1,878.00	4,319,400	
gumi	13,800	507.00	6,996,600	貸付有価証券 6,200株
パイブドHD	1,700	1,024.00	1,740,800	貸付有価証券 600株
フェイス	3,500	1,148.00	4,018,000	貸付有価証券 1,500株
ハイマックス	1,800	1,063.00	1,913,400	
野村総合研究所	93,800	3,780.00	354,564,000	貸付有価証券 1,900株（100株）
サイバネットシステム	10,900	562.00	6,125,800	貸付有価証券 5,000株（4,700株）
CEホールディングス	2,000	902.00	1,804,000	
インテージホールディングス	7,000	1,418.00	9,926,000	
東邦システムサイエンス	3,900	560.00	2,184,000	
ソースネクスト	6,700	433.00	2,901,100	貸付有価証券

				1,200株(1,200株)
ティー・ワイ・オー	18,400	149.00	2,741,600	貸付有価証券 8,200株(600株)
クレスコ	3,000	1,750.00	5,250,000	
フジ・メディア・ホールディングス	139,400	1,286.00	179,268,400	貸付有価証券 11,800株
オービック	46,200	5,380.00	248,556,000	
ジャストシステム	24,300	825.00	20,047,500	貸付有価証券 2,200株
TDCソフトウェアエンジニアリング	2,900	1,069.00	3,100,100	
ヤフー	959,700	436.00	418,429,200	貸付有価証券 434,800株
トレンドマイクロ	65,000	4,110.00	267,150,000	
インフォメーション・ディベロプメント	2,500	865.00	2,162,500	
日本オラクル	21,500	4,980.00	107,070,000	
アルファシステムズ	4,400	1,630.00	7,172,000	
フューチャーアーキテクト	16,100	754.00	12,139,400	
CAC Holdings	10,000	714.00	7,140,000	貸付有価証券 1,800株
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	1,218.00	4,384,800	
トーセ	3,600	669.00	2,408,400	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルタント	6,800	4,495.00	30,566,000	貸付有価証券 200株
伊藤忠テクノソリューションズ	30,300	2,105.00	63,781,500	貸付有価証券 5,300株
アイティフォー	17,400	449.00	7,812,600	
東計電算	2,400	1,891.00	4,538,400	
エクスネット	1,200	1,476.00	1,771,200	
大塚商会	36,000	5,370.00	193,320,000	
サイボウズ	17,800	294.00	5,233,200	貸付有価証券 1,300株
ソフトブレーン	19,600	137.00	2,685,200	貸付有価証券 5,600株
電通国際情報サービス	8,200	2,087.00	17,113,400	
EMシステムズ	2,200	2,582.00	5,680,400	貸付有価証券 500株(100株)

ウェザーニューズ	4,500	3,555.00	15,997,500	
C I J	12,100	423.00	5,118,300	貸付有価証券 1,600株
東洋ビジネスエンジニア リング	1,300	1,288.00	1,674,400	貸付有価証券 500株
日本エンタープライズ	13,700	177.00	2,424,900	貸付有価証券 6,000株
WOWOW	6,400	2,471.00	15,814,400	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
フュージョンパートナー	7,600	487.00	3,701,200	貸付有価証券 900株
日本コロムビア	4,600	459.00	2,111,400	貸付有価証券 1,500株
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,300	365.00	4,124,500	貸付有価証券 5,200株
ネットワンシステムズ	58,000	576.00	33,408,000	貸付有価証券 26,700株
アルゴグラフィックス	6,100	1,715.00	10,461,500	
マーベラス	22,600	811.00	18,328,600	貸付有価証券 10,400株(600株)
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	24,600	1,241.00	30,528,600	貸付有価証券 400株
日本ユニシス	37,000	1,350.00	49,950,000	貸付有価証券 17,000株(10,700株)
兼松エレクトロニクス	8,400	1,827.00	15,346,800	
東京放送ホールディング ス	80,200	1,701.00	136,420,200	貸付有価証券 34,600株(11,200株)
日本テレビホールディン グス	122,300	1,921.00	234,938,300	
朝日放送	13,200	674.00	8,896,800	
テレビ朝日ホールディン グス	36,600	1,975.00	72,285,000	貸付有価証券 4,600株
スカパーJ S A Tホール ディングス	101,600	643.00	65,328,800	貸付有価証券 6,500株
テレビ東京ホールディン グス	12,100	1,803.00	21,816,300	貸付有価証券 5,500株
日本BS放送	2,200	1,012.00	2,226,400	貸付有価証券 700株(700株)
U - N E X T	3,100	882.00	2,734,200	貸付有価証券 400株
コネクシオ	11,800	1,081.00	12,755,800	貸付有価証券 3,500株(3,500株)



日本通信	71,100	164.00	11,660,400	貸付有価証券 32,800株（17,100株）
クロップス	2,400	514.00	1,233,600	
日本電信電話	1,035,000	4,871.00	5,041,485,000	
K D D I	1,360,300	3,001.00	4,082,260,300	貸付有価証券 10,400株
光通信	16,100	7,740.00	124,614,000	貸付有価証券 700株
N T T ドコモ	1,032,700	2,641.00	2,727,360,700	
エムティーアイ	17,100	663.00	11,337,300	貸付有価証券 7,800株
G M O インターネット	49,600	1,169.00	57,982,400	貸付有価証券 22,900株（7,200株）
カドカワ	41,800	1,630.00	68,134,000	
学研ホールディングス	45,000	230.00	10,350,000	
ゼンリン	17,700	1,789.00	31,665,300	
昭文社	7,300	623.00	4,547,900	貸付有価証券 700株
インプレスホールディングス	11,000	120.00	1,320,000	貸付有価証券 5,000株（100株）
アイネット	7,500	1,062.00	7,965,000	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
松竹	88,000	1,019.00	89,672,000	貸付有価証券 40,000株
東宝	95,500	2,789.00	266,349,500	
東映	50,000	887.00	44,350,000	
A O I P r o .	6,700	978.00	6,552,600	
エヌ・ティ・ティ・データ	82,700	5,580.00	461,466,000	
ピー・シー・エー	1,700	1,417.00	2,408,900	
ビジネスブレイン太田昭和	2,000	905.00	1,810,000	
D T S	14,900	2,041.00	30,410,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	56,700	2,751.00	155,981,700	貸付有価証券 22,500株（20,200株）
シーイーシー	8,700	1,067.00	9,282,900	
カブコン	34,200	2,238.00	76,539,600	
アイ・エス・ビー	1,600	688.00	1,100,800	貸付有価証券 700株
ジャステック	8,500	865.00	7,352,500	貸付有価証券

				3,900株
S C S K	31,800	4,315.00	137,217,000	
日本システムウエア	5,000	860.00	4,300,000	貸付有価証券 2,200株
アイネス	18,900	1,017.00	19,221,300	
T K C	12,400	3,150.00	39,060,000	
富士ソフト	19,900	2,279.00	45,352,100	
N S D	28,400	1,583.00	44,957,200	
コナミホールディングス	60,500	2,718.00	164,439,000	貸付有価証券 14,800株
福井コンピュータホールディングス	2,900	941.00	2,728,900	
J B C Cホールディングス	11,200	649.00	7,268,800	
ミロク情報サービス	9,900	913.00	9,038,700	
ソフトバンクグループ	758,700	5,398.00	4,095,462,600	
ハウスイ	11,000	108.00	1,188,000	貸付有価証券 4,000株
高千穂交易	5,100	863.00	4,401,300	
伊藤忠食品	3,300	4,135.00	13,645,500	貸付有価証券 800株(800株)
エレマテック	6,200	2,095.00	12,989,000	
J A L U X	4,300	2,029.00	8,724,700	貸付有価証券 1,500株(900株)
あらた	6,000	2,138.00	12,828,000	
トーメンデバイス	2,000	1,713.00	3,426,000	
東京エレクトロン デバイス	4,800	1,486.00	7,132,800	
フィールズ	8,800	1,639.00	14,423,200	貸付有価証券 4,000株(3,700株)
双日	843,500	216.00	182,196,000	
アルフレッサ ホールディングス	168,300	1,914.00	322,126,200	貸付有価証券 2,400株
横浜冷凍	33,100	1,012.00	33,497,200	貸付有価証券 15,300株(10,500株)
神栄	18,000	105.00	1,890,000	貸付有価証券 8,000株
山下医科器械	1,100	1,585.00	1,743,500	貸付有価証券 400株
ラサ商事	6,300	603.00	3,798,900	

アルコニックス	7,600	1,237.00	9,401,200	
神戸物産	8,600	2,307.00	19,840,200	貸付有価証券 3,900株(200株)
あいホールディングス	23,800	2,563.00	60,999,400	貸付有価証券 3,100株
ディービーエックス	3,600	1,023.00	3,682,800	
ダイワボウホールディングス	122,000	198.00	24,156,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	24,100	1,311.00	31,595,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,200	955.00	22,156,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
八洲電機	10,300	522.00	5,376,600	
U K Cホールディングス	8,600	2,063.00	17,741,800	
O C H Iホールディングス	3,900	965.00	3,763,500	
T O K A Iホールディングス	58,800	570.00	33,516,000	貸付有価証券 27,100株(13,100株)
三洋貿易	7,300	1,272.00	9,285,600	
ウイン・パートナーズ	4,800	1,421.00	6,820,800	貸付有価証券 300株
ミタチ産業	3,400	629.00	2,138,600	貸付有価証券 500株
シップヘルスケアホールディングス	27,200	2,624.00	71,372,800	貸付有価証券 1,400株
明治電機工業	4,200	1,043.00	4,380,600	貸付有価証券 1,900株
デリカフーズ	2,800	874.00	2,447,200	貸付有価証券 1,200株
スターティア	2,600	476.00	1,237,600	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
富士興産	5,200	421.00	2,189,200	
協栄産業	17,000	123.00	2,091,000	
小野建	11,600	961.00	11,147,600	
佐鳥電機	10,600	679.00	7,197,400	貸付有価証券 4,800株
エコトレーディング	3,100	609.00	1,887,900	貸付有価証券 1,400株
伯東	10,200	959.00	9,781,800	
コンドーテック	10,600	751.00	7,960,600	
中山福	8,300	737.00	6,117,100	貸付有価証券

				600株
ナガイレーベン	19,300	1,878.00	36,245,400	貸付有価証券 2,200株
三菱食品	14,700	2,931.00	43,085,700	
松田産業	9,700	1,223.00	11,863,100	
第一興商	23,700	4,475.00	106,057,500	
メディカルホールディングス	133,900	1,620.00	216,918,000	
アドヴァン	13,600	979.00	13,314,400	貸付有価証券 700株
S P K	3,100	1,923.00	5,961,300	
萩原電気	3,400	1,831.00	6,225,400	
アズワン	10,500	3,935.00	41,317,500	
スズデン	4,300	1,020.00	4,386,000	貸付有価証券 100株
尾家産業	4,300	837.00	3,599,100	
シモジマ	9,200	1,069.00	9,834,800	
ドウシシャ	15,700	2,126.00	33,378,200	
小津産業	2,900	2,066.00	5,991,400	
高速	8,000	872.00	6,976,000	
たけびし	4,700	948.00	4,455,600	貸付有価証券 1,800株
黒田電気	24,900	1,540.00	38,346,000	
丸文	11,800	676.00	7,976,800	
ハピネット	12,200	899.00	10,967,800	貸付有価証券 2,800株
橋本総業	2,800	1,433.00	4,012,400	
エクセル	6,500	1,241.00	8,066,500	貸付有価証券 2,900株
マルカキカイ	4,300	1,290.00	5,547,000	貸付有価証券 500株
ガリバーインターナショナル	36,000	1,108.00	39,888,000	貸付有価証券 16,600株（14,000株）
日本エム・ディ・エム	11,200	555.00	6,216,000	貸付有価証券 5,100株
進和	7,900	1,361.00	10,751,900	
エスケイジャパン	3,200	460.00	1,472,000	貸付有価証券 1,400株（1,100株）
ダイトエレクトロン	6,100	693.00	4,227,300	貸付有価証券 300株

シークス	8,500	2,792.00	23,732,000	貸付有価証券 3,900株
田中商事	4,100	617.00	2,529,700	
オーハシテクニカ	7,500	1,280.00	9,600,000	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
白銅	3,800	997.00	3,788,600	
伊藤忠商事	1,050,800	1,363.00	1,432,240,400	貸付有価証券 100株
丸紅	1,317,800	560.50	738,626,900	貸付有価証券 354,600株
高島	25,000	156.00	3,900,000	
長瀬産業	80,500	1,173.00	94,426,500	
蝶理	8,500	1,386.00	11,781,000	
豊田通商	149,100	2,286.00	340,842,600	貸付有価証券 300株
三共生興	20,200	389.00	7,857,800	貸付有価証券 100株
兼松	285,000	153.00	43,605,000	貸付有価証券 23,000株
ツカモトコーポレーショ ン	24,000	100.00	2,400,000	貸付有価証券 6,000株
三井物産	1,210,900	1,294.00	1,566,904,600	貸付有価証券 242,600株
日本紙パルプ商事	70,000	306.00	21,420,000	
日立ハイテクノロジーズ	46,400	2,928.00	135,859,200	
カメイ	17,400	938.00	16,321,200	
東都水産	22,000	175.00	3,850,000	
ＯＵＧホールディングス	19,000	215.00	4,085,000	
スターゼン	4,800	3,095.00	14,856,000	
山善	51,400	895.00	46,003,000	
椿本興業	15,000	285.00	4,275,000	
住友商事	842,900	1,094.50	922,554,050	貸付有価証券 10,700株
内田洋行	33,000	394.00	13,002,000	
三菱商事	1,004,800	1,736.50	1,744,835,200	貸付有価証券 24,700株
第一実業	30,000	455.00	13,650,000	
キャノンマーケティング ジャパン	38,200	1,913.00	73,076,600	
西華産業	44,000	214.00	9,416,000	

佐藤商事	11,900	619.00	7,366,100	
菱洋エレクトロ	15,400	1,072.00	16,508,800	貸付有価証券 7,100株
東京産業	13,300	392.00	5,213,600	
ユアサ商事	12,700	2,315.00	29,400,500	
神鋼商事	30,000	195.00	5,850,000	
小林産業	8,800	194.00	1,707,200	
阪和興業	134,000	442.00	59,228,000	貸付有価証券 1,000株
カナデン	12,800	837.00	10,713,600	
菱電商事	21,000	604.00	12,684,000	
フルサト工業	7,400	1,568.00	11,603,200	
岩谷産業	159,000	598.00	95,082,000	貸付有価証券 38,000株（21,000株）
すてきナイスグループ	57,000	131.00	7,467,000	
昭光通商	47,000	75.00	3,525,000	貸付有価証券 22,000株
ニチモウ	21,000	169.00	3,549,000	貸付有価証券 9,000株
極東貿易	19,000	217.00	4,123,000	
イワキ	20,000	180.00	3,600,000	
三愛石油	34,000	942.00	32,028,000	
稲畑産業	32,100	1,209.00	38,808,900	
G S Iクレオス	35,000	115.00	4,025,000	貸付有価証券 16,000株（14,000株）
明和産業	12,300	353.00	4,341,900	貸付有価証券 2,000株
ワキタ	28,500	801.00	22,828,500	
東邦ホールディングス	42,900	2,290.00	98,241,000	貸付有価証券 19,100株（17,300株）
サンゲツ	48,300	1,906.00	92,059,800	
ミツウロコグループホー ルディングス	21,500	542.00	11,653,000	
シナネンホールディング ス	29,000	434.00	12,586,000	
伊藤忠エネクス	34,500	846.00	29,187,000	
サンリオ	41,300	2,049.00	84,623,700	貸付有価証券 19,000株
サンワテクノス	8,500	679.00	5,771,500	

リョーサン	21,200	2,806.00	59,487,200	
新光商事	15,700	1,016.00	15,951,200	
トーホー	6,000	2,199.00	13,194,000	
三信電気	18,500	810.00	14,985,000	
東陽テクニカ	19,600	1,049.00	20,560,400	貸付有価証券 8,700株
モスフードサービス	17,500	3,100.00	54,250,000	貸付有価証券 100株（100株）
加賀電子	12,100	1,268.00	15,342,800	
ソーダニッカ	13,800	446.00	6,154,800	
立花エレテック	9,900	1,074.00	10,632,600	
フォーバル	5,300	641.00	3,397,300	貸付有価証券 400株
PALTAC	21,400	1,781.00	38,113,400	
三谷産業	14,200	299.00	4,245,800	貸付有価証券 6,500株（100株）
太平洋興発	56,000	73.00	4,088,000	貸付有価証券 18,000株
ヤマタネ	62,000	159.00	9,858,000	
丸紅建材リース	12,000	180.00	2,160,000	
日鉄住金物産	88,000	325.00	28,600,000	貸付有価証券 8,000株
トラスコ中山	15,300	3,930.00	60,129,000	貸付有価証券 1,800株
オートバックスセブン	51,300	1,845.00	94,648,500	貸付有価証券 23,600株
加藤産業	20,900	2,700.00	56,430,000	
イノテック	12,300	431.00	5,301,300	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	12,600	1,861.00	23,448,600	
J Kホールディングス	13,400	450.00	6,030,000	
日伝	5,500	2,673.00	14,701,500	
北沢産業	11,000	149.00	1,639,000	
杉本商事	7,700	1,123.00	8,647,100	
因幡電機産業	18,700	3,420.00	63,954,000	
バイテックホールディングス	4,100	944.00	3,870,400	貸付有価証券 1,800株
ミスミグループ本社	150,300	1,513.00	227,403,900	貸付有価証券 62,700株

アルテック	11,400	139.00	1,584,600	貸付有価証券 4,000株
タキヒヨー	22,000	449.00	9,878,000	貸付有価証券 1,000株
蔵王産業	2,200	1,253.00	2,756,600	貸付有価証券 200株
スズケン	60,900	3,555.00	216,499,500	貸付有価証券 6,400株（6,400株）
ジェコス	9,200	895.00	8,234,000	貸付有価証券 200株
ルネサスイーストン	8,300	390.00	3,237,000	
ローソン	50,700	9,210.00	466,947,000	
サンエー	9,100	4,690.00	42,679,000	貸付有価証券 400株
ダイユーエイト	3,500	721.00	2,523,500	貸付有価証券 1,500株
カワチ薬品	10,400	1,893.00	19,687,200	
エービーシー・マート	17,100	6,480.00	110,808,000	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
ハードオフコーポレーション	6,500	1,617.00	10,510,500	
アスクル	16,300	3,340.00	54,442,000	貸付有価証券 7,200株
ゲオホールディングス	25,400	1,666.00	42,316,400	貸付有価証券 11,300株（300株）
アダストリア	12,300	5,880.00	72,324,000	
ジーフット	8,100	838.00	6,787,800	
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	19,000	78.00	1,482,000	貸付有価証券 8,000株
くらコーポレーション	7,800	5,050.00	39,390,000	
キャンドウ	7,100	1,423.00	10,103,300	貸付有価証券 2,700株（1,800株）
パル	7,800	2,431.00	18,961,800	
エディオン	56,600	878.00	49,694,800	貸付有価証券 26,200株（9,800株）
サーラコーポレーション	11,500	588.00	6,762,000	
ワッツ	5,300	778.00	4,123,400	貸付有価証券 1,300株
ハローズ	4,000	2,584.00	10,336,000	
あみやき亭	2,600	4,365.00	11,349,000	
ひらまつ	18,400	600.00	11,040,000	貸付有価証券



				7,700株
ゲンキー	2,700	2,494.00	6,733,800	貸付有価証券 1,200株(800株)
サッポロドラッグストア	1,300	1,990.00	2,587,000	貸付有価証券 600株
大黒天物産	3,200	4,580.00	14,656,000	貸付有価証券 1,400株
ハニーズ	11,800	1,185.00	13,983,000	貸付有価証券 4,600株(2,400株)
ファーマライズホールディングス	3,000	483.00	1,449,000	
アルペン	11,900	1,725.00	20,527,500	貸付有価証券 5,000株
クオール	13,600	1,429.00	19,434,400	貸付有価証券 3,200株
ジェイアイエヌ	9,100	4,960.00	45,136,000	貸付有価証券 4,100株(3,400株)
ビックカメラ	69,200	909.00	62,902,800	貸付有価証券 31,900株(10,500株)
DCMホールディングス	65,800	841.00	55,337,800	貸付有価証券 23,700株
Monotaro	47,200	2,366.00	111,675,200	貸付有価証券 21,300株(4,400株)
東京一番フーズ	2,200	494.00	1,086,800	貸付有価証券 800株(800株)
ダイヤモンドダイニング	2,100	1,061.00	2,228,100	貸付有価証券 900株
きちり	3,600	637.00	2,293,200	貸付有価証券 1,600株(600株)
アークランドサービス	4,200	2,619.00	10,999,800	
J.フロントリテイリング	169,400	1,342.00	227,334,800	
ドトール・日レスホールディングス	23,500	1,742.00	40,937,000	貸付有価証券 4,400株
マツモトキヨシホールディングス	27,600	5,220.00	144,072,000	
ブロンコビリー	5,200	2,560.00	13,312,000	貸付有価証券 800株(700株)
スタートトゥデイ	40,700	3,385.00	137,769,500	
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,164.00	4,423,200	貸付有価証券 1,600株
物語コーポレーション	3,500	4,770.00	16,695,000	

ココカラファイン	13,900	4,205.00	58,449,500	
三越伊勢丹ホールディングス	266,300	1,292.00	344,059,600	
ウエルシアホールディングス	11,600	5,570.00	64,612,000	
クリエイイトSDホールディングス	19,700	2,311.00	45,526,700	
丸善CHIホールディングス	15,600	318.00	4,960,800	貸付有価証券 3,700株
ミサワ	1,600	461.00	737,600	貸付有価証券 700株
エー・ピーカンパニー	2,200	1,200.00	2,640,000	貸付有価証券 1,000株
チムニー	3,300	2,601.00	8,583,300	
シュッピン	3,800	979.00	3,720,200	貸付有価証券 1,700株
ネクステージ	2,200	517.00	1,137,400	貸付有価証券 900株
ジョイフル本田	21,700	2,198.00	47,696,600	
キリン堂ホールディングス	4,300	914.00	3,930,200	貸付有価証券 200株
ホットランド	3,500	1,020.00	3,570,000	貸付有価証券 1,500株
すかいらーく	40,900	1,518.00	62,086,200	
綿半ホールディングス	3,700	1,325.00	4,902,500	貸付有価証券 1,700株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	44,400	977.00	43,378,800	貸付有価証券 9,300株
ブックオフコーポレーション	7,600	881.00	6,695,600	貸付有価証券 1,100株
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,800	688.00	1,926,400	貸付有価証券 1,200株
あさひ	9,900	1,261.00	12,483,900	貸付有価証券 4,600株
日本調剤	3,400	3,415.00	11,611,000	貸付有価証券 1,500株（400株）
コスモス薬品	6,700	17,030.00	114,101,000	貸付有価証券 3,100株（2,300株）
トーエル	6,500	699.00	4,543,500	貸付有価証券 800株（800株）
一六堂	3,200	347.00	1,110,400	

セブン & アイ・ホールディングス	560,100	4,604.00	2,578,700,400	貸付有価証券 31,900株
薬王堂	1,900	2,535.00	4,816,500	貸付有価証券 100株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	12,000	2,810.00	33,720,000	貸付有価証券 300株
ツルハホールディングス	30,700	9,180.00	281,826,000	
サンマルクホールディングス	10,600	2,775.00	29,415,000	
フェリシモ	3,800	948.00	3,602,400	
トリドール	16,400	2,239.00	36,719,600	
クスリのアオキ	11,900	4,800.00	57,120,000	
メディカルシステムネットワーク	15,100	432.00	6,523,200	
総合メディカル	6,500	3,440.00	22,360,000	貸付有価証券 1,900株
はるやま商事	5,600	765.00	4,284,000	
カッパ・クリエイト	18,700	1,135.00	21,224,500	貸付有価証券 8,600株
ライトオン	10,000	1,445.00	14,450,000	貸付有価証券 4,600株
ジーンズメイト	4,300	164.00	705,200	貸付有価証券 1,900株（1,000株）
良品計画	15,400	22,720.00	349,888,000	
三城ホールディングス	16,500	436.00	7,194,000	
アルピス	3,500	1,875.00	6,562,500	
コナカ	15,700	537.00	8,430,900	
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,447.00	2,315,200	貸付有価証券 100株（100株）
G - 7ホールディングス	3,900	1,114.00	4,344,600	
イオン北海道	8,900	515.00	4,583,500	貸付有価証券 4,100株
コジマ	19,700	225.00	4,432,500	貸付有価証券 900株
ヒマラヤ	4,200	998.00	4,191,600	貸付有価証券 300株
コーナン商事	19,000	1,540.00	29,260,000	貸付有価証券 8,500株
エコス	4,900	1,144.00	5,605,600	貸付有価証券 2,200株（100株）
ワタミ	15,800	1,015.00	16,037,000	貸付有価証券

				7,100株(5,500株)
マルシェ	3,200	838.00	2,681,600	貸付有価証券 1,500株
ドンキホーテホールディングス	86,600	3,620.00	313,492,000	貸付有価証券 16,300株
西松屋チェーン	26,400	920.00	24,288,000	貸付有価証券 12,100株
ゼンショーホールディングス	68,900	1,373.00	94,599,700	貸付有価証券 2,900株(2,700株)
幸楽苑ホールディングス	8,400	1,549.00	13,011,600	貸付有価証券 3,900株(1,800株)
ハークスレイ	3,700	1,062.00	3,929,400	
サイゼリヤ	22,000	2,235.00	49,170,000	
V Tホールディングス	45,300	538.00	24,371,400	貸付有価証券 500株
魚力	4,200	1,286.00	5,401,200	
ポブラ	3,300	490.00	1,617,000	貸付有価証券 1,500株
ユナイテッドアローズ	19,100	4,835.00	92,348,500	貸付有価証券 800株
ハイデイ日高	10,100	3,450.00	34,845,000	貸付有価証券 4,700株
京都きもの友禅	9,100	829.00	7,543,900	貸付有価証券 3,800株
コロワイド	44,400	1,678.00	74,503,200	貸付有価証券 20,000株(100株)
ピーシーデポコーポレーション	11,100	1,048.00	11,632,800	貸付有価証券 5,100株(100株)
壱番屋	6,100	5,700.00	34,770,000	貸付有価証券 2,100株
トップカルチャー	4,800	453.00	2,174,400	
P L A N T	3,000	1,128.00	3,384,000	貸付有価証券 1,100株
スギホールディングス	24,000	5,400.00	129,600,000	
スクロール	20,200	392.00	7,918,400	貸付有価証券 8,800株(600株)
ヨンドシーホールディングス	10,200	2,332.00	23,786,400	貸付有価証券 4,700株(1,800株)
ファミリーマート	41,100	5,730.00	235,503,000	貸付有価証券 3,100株(1,300株)
木曽路	16,400	2,186.00	35,850,400	貸付有価証券

				6,800株(5,500株)
サトレストランシステムズ	15,700	785.00	12,324,500	貸付有価証券 200株
千趣会	26,400	706.00	18,638,400	貸付有価証券 3,700株(300株)
タカキュー	10,300	176.00	1,812,800	貸付有価証券 1,700株
ケーヨー	22,500	501.00	11,272,500	貸付有価証券 10,000株
上新電機	32,000	857.00	27,424,000	
日本瓦斯	15,300	2,158.00	33,017,400	貸付有価証券 6,600株
ベスト電器	43,100	113.00	4,870,300	貸付有価証券 15,100株(14,100株)
ロイヤルホールディングス	22,200	2,035.00	45,177,000	貸付有価証券 600株
東天紅	10,000	129.00	1,290,000	貸付有価証券 1,000株
いなげや	14,900	1,216.00	18,118,400	
島忠	34,600	2,499.00	86,465,400	
チヨダ	15,800	2,811.00	44,413,800	貸付有価証券 3,200株
ライフコーポレーション	8,400	2,367.00	19,882,800	貸付有価証券 3,600株(100株)
リンガーハット	12,100	2,345.00	28,374,500	貸付有価証券 5,500株
さが美	10,000	91.00	910,000	貸付有価証券 4,000株(2,000株)
Mr Max	11,700	278.00	3,252,600	貸付有価証券 5,000株
テンアライド	12,300	373.00	4,587,900	
AOKIホールディングス	30,500	1,220.00	37,210,000	
オークワ	21,000	977.00	20,517,000	
コメリ	20,600	2,209.00	45,505,400	
青山商事	25,700	4,085.00	104,984,500	貸付有価証券 100株
しまむら	15,600	12,100.00	188,760,000	貸付有価証券 200株
はせがわ	4,700	404.00	1,898,800	貸付有価証券 900株(900株)

高島屋	195,000	891.00	173,745,000	
松屋	26,900	861.00	23,160,900	貸付有価証券 12,400株（300株）
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,600	1,840.00	126,224,000	
近鉄百貨店	51,000	297.00	15,147,000	貸付有価証券 23,000株
丸栄	27,000	83.00	2,241,000	貸付有価証券 12,000株
ニッセンホールディング ス	19,700	139.00	2,738,300	貸付有価証券 9,000株（3,300株）
パルコ	12,800	883.00	11,302,400	貸付有価証券 1,300株
丸井グループ	164,300	1,482.00	243,492,600	貸付有価証券 26,100株
アクシアル リテイリン グ	10,300	3,375.00	34,762,500	
井筒屋	73,000	49.00	3,577,000	貸付有価証券 33,000株
イオン	551,000	1,401.00	771,951,000	貸付有価証券 38,600株（38,600株）
ユニーグループ・ホール ディングス	128,200	771.00	98,842,200	
イズミ	26,600	4,265.00	113,449,000	貸付有価証券 1,600株
東武ストア	16,000	299.00	4,784,000	貸付有価証券 7,000株
平和堂	27,100	2,080.00	56,368,000	貸付有価証券 12,100株
フジ	14,900	2,035.00	30,321,500	
ヤオコー	15,200	4,340.00	65,968,000	貸付有価証券 400株
ゼビオホールディングス	18,200	1,725.00	31,395,000	
ケーズホールディングス	28,300	3,565.00	100,889,500	貸付有価証券 13,000株
O l y m p i c グループ	7,900	565.00	4,463,500	
日産東京販売ホールディ ングス	22,500	279.00	6,277,500	
アインホールディングス	16,100	4,820.00	77,602,000	
元気寿司	3,700	2,172.00	8,036,400	
ヤマダ電機	407,100	513.00	208,842,300	貸付有価証券 166,200株（48,300

				株)
アークランドサカモト	22,600	988.00	22,328,800	
ニトリホールディングス	57,900	8,190.00	474,201,000	貸付有価証券 10,200株(7,200株)
グルメ杵屋	10,000	991.00	9,910,000	貸付有価証券 4,000株
愛眼	10,700	203.00	2,172,100	貸付有価証券 4,500株(3,500株)
ケーユーホールディングス	7,000	696.00	4,872,000	貸付有価証券 800株
吉野家ホールディングス	49,400	1,402.00	69,258,800	貸付有価証券 22,700株
松屋フーズ	6,400	2,797.00	17,900,800	貸付有価証券 2,900株
サガミチェーン	17,900	1,206.00	21,587,400	貸付有価証券 7,400株(6,000株)
関西スーパーマーケット	10,900	781.00	8,512,900	
王将フードサービス	9,800	3,855.00	37,779,000	貸付有価証券 100株
ブレナス	15,000	1,893.00	28,395,000	貸付有価証券 6,900株
ミニストップ	9,900	1,967.00	19,473,300	貸付有価証券 4,400株(100株)
アークス	25,100	2,090.00	52,459,000	
バローホールディングス	28,800	2,392.00	68,889,600	
藤久	1,100	1,669.00	1,835,900	貸付有価証券 400株
ベルク	6,600	3,780.00	24,948,000	
大庄	6,300	1,452.00	9,147,600	貸付有価証券 2,800株
ファーストリテイリング	26,800	31,240.00	837,232,000	貸付有価証券 2,900株(300株)
サンドラッグ	28,300	7,580.00	214,514,000	
サックスパーホールディングス	12,600	1,472.00	18,547,200	貸付有価証券 2,100株
ヤマザワ	2,800	1,645.00	4,606,000	貸付有価証券 1,000株
やまや	2,700	1,862.00	5,027,400	
ベルーナ	33,400	507.00	16,933,800	
島根銀行	2,800	1,189.00	3,329,200	
じもとホールディングス	96,100	147.00	14,126,700	

足利ホールディングス	98,300	325.00	31,947,500	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	18,500	2,681.00	49,598,500	
九州フィナンシャルグループ	205,000	637.00	130,585,000	
ゆうちょ銀行	257,400	1,277.00	328,699,800	貸付有価証券 94,300株
新生銀行	1,159,000	141.00	163,419,000	貸付有価証券 495,000株
あおぞら銀行	847,000	360.00	304,920,000	貸付有価証券 115,000株（69,000株）
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,743,800	489.00	5,253,718,200	貸付有価証券 222,800株（222,800株）
りそなホールディングス	1,566,500	405.00	634,432,500	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,795,000	328.30	917,598,500	
三井住友フィナンシャルグループ	1,072,200	3,139.00	3,365,635,800	
第四銀行	169,000	369.00	62,361,000	
北越銀行	145,000	187.00	27,115,000	貸付有価証券 1,000株
西日本シティ銀行	436,000	198.00	86,328,000	
千葉銀行	516,000	536.00	276,576,000	貸付有価証券 18,000株（18,000株）
横浜銀行	898,000	491.20	441,097,600	貸付有価証券 2,000株
常陽銀行	484,000	396.00	191,664,000	貸付有価証券 193,000株（193,000株）
群馬銀行	298,000	498.00	148,404,000	貸付有価証券 6,000株（6,000株）
武蔵野銀行	21,400	2,937.00	62,851,800	
千葉興業銀行	36,700	462.00	16,955,400	
筑波銀行	55,600	287.00	15,957,200	貸付有価証券 200株（200株）
七十七銀行	210,000	411.00	86,310,000	
青森銀行	98,000	293.00	28,714,000	貸付有価証券 43,000株（39,000株）
秋田銀行	87,000	277.00	24,099,000	



山形銀行	75,000	389.00	29,175,000	貸付有価証券 34,000株（8,000株）
岩手銀行	9,400	3,750.00	35,250,000	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
東邦銀行	120,000	331.00	39,720,000	
東北銀行	68,000	139.00	9,452,000	
みちのく銀行	67,000	169.00	11,323,000	貸付有価証券 31,000株（18,000株）
ふくおかフィナンシャル グループ	579,000	368.00	213,072,000	貸付有価証券 23,000株（23,000株）
静岡銀行	392,000	839.00	328,888,000	貸付有価証券 17,000株（4,000株）
十六銀行	168,000	366.00	61,488,000	
スルガ銀行	127,100	1,883.00	239,329,300	
八十二銀行	242,000	513.00	124,146,000	
山梨中央銀行	83,000	405.00	33,615,000	
大垣共立銀行	179,000	349.00	62,471,000	貸付有価証券 13,000株
福井銀行	114,000	181.00	20,634,000	貸付有価証券 2,000株
北國銀行	149,000	279.00	41,571,000	
清水銀行	4,500	2,098.00	9,441,000	
富山銀行	2,600	2,853.00	7,417,800	貸付有価証券 1,000株
滋賀銀行	126,000	464.00	58,464,000	貸付有価証券 58,000株（5,000株）
南都銀行	129,000	313.00	40,377,000	貸付有価証券 7,000株
百五銀行	120,000	410.00	49,200,000	
京都銀行	256,000	748.00	191,488,000	
紀陽銀行	52,600	1,216.00	63,961,600	貸付有価証券 200株
三重銀行	60,000	192.00	11,520,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	911,000	168.00	153,048,000	
広島銀行	395,000	420.00	165,900,000	
山陰合同銀行	81,100	655.00	53,120,500	
中国銀行	94,900	1,202.00	114,069,800	
鳥取銀行	43,000	162.00	6,966,000	
伊予銀行	143,200	796.00	113,987,200	

百十四銀行	147,000	329.00	48,363,000	貸付有価証券 8,000株
四国銀行	104,000	212.00	22,048,000	貸付有価証券 15,000株
阿波銀行	110,000	518.00	56,980,000	
大分銀行	77,000	343.00	26,411,000	貸付有価証券 35,000株
宮崎銀行	89,000	275.00	24,475,000	
佐賀銀行	81,000	199.00	16,119,000	
十八銀行	82,000	224.00	18,368,000	貸付有価証券 17,000株
沖縄銀行	10,600	3,495.00	37,047,000	貸付有価証券 3,600株
琉球銀行	27,600	1,182.00	32,623,200	貸付有価証券 1,400株
セブン銀行	501,700	468.00	234,795,600	貸付有価証券 215,500株
みずほフィナンシャルグループ	18,863,800	168.70	3,182,323,060	貸付有価証券 598,400株（136,000株）
高知銀行	52,000	108.00	5,616,000	貸付有価証券 3,000株
山口フィナンシャルグループ	125,000	1,063.00	132,875,000	貸付有価証券 57,000株（24,000株）
長野銀行	44,000	174.00	7,656,000	貸付有価証券 20,000株（2,000株）
名古屋銀行	112,000	365.00	40,880,000	貸付有価証券 51,000株（4,000株）
北洋銀行	201,700	288.00	58,089,600	
愛知銀行	4,500	4,390.00	19,755,000	
第三銀行	76,000	141.00	10,716,000	貸付有価証券 26,000株（2,000株）
中京銀行	55,000	193.00	10,615,000	
東日本銀行	64,000	263.00	16,832,000	
大光銀行	47,000	186.00	8,742,000	
愛媛銀行	79,000	221.00	17,459,000	貸付有価証券 36,000株（28,000株）
トマト銀行	52,000	145.00	7,540,000	
みなと銀行	121,000	154.00	18,634,000	
京葉銀行	110,000	425.00	46,750,000	

関西アーバン銀行	18,700	1,050.00	19,635,000	
栃木銀行	72,000	428.00	30,816,000	
北日本銀行	4,200	2,542.00	10,676,400	
東和銀行	188,000	81.00	15,228,000	
福島銀行	165,000	71.00	11,715,000	貸付有価証券 10,000株
大東銀行	80,000	176.00	14,080,000	貸付有価証券 8,000株
トモニホールディングス	102,700	338.00	34,712,600	
フィデアホールディングス	81,900	177.00	14,496,300	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
池田泉州ホールディングス	142,100	391.00	55,561,100	貸付有価証券 300株
F P G	39,700	901.00	35,769,700	貸付有価証券 18,300株（12,200株）
S B I ホールディングス	160,800	1,010.00	162,408,000	貸付有価証券 600株
日本アジア投資	9,100	259.00	2,356,900	貸付有価証券 2,100株
ジャフコ	22,400	3,160.00	70,784,000	貸付有価証券 2,000株
大和証券グループ本社	1,253,000	662.30	829,861,900	
野村ホールディングス	2,576,500	500.00	1,288,250,000	
岡三証券グループ	114,000	543.00	61,902,000	
丸三証券	39,700	1,174.00	46,607,800	貸付有価証券 7,200株
東洋証券	52,000	286.00	14,872,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	153,700	518.00	79,616,600	貸付有価証券 53,000株
光世証券	32,000	136.00	4,352,000	貸付有価証券 14,000株（9,000株）
水戸証券	41,500	320.00	13,280,000	貸付有価証券 2,500株
いちよし証券	29,900	1,088.00	32,531,200	貸付有価証券 11,900株
松井証券	68,100	944.00	64,286,400	貸付有価証券 8,400株
だいこう証券ビジネス	6,500	748.00	4,862,000	
マネックスグループ	157,500	268.00	42,210,000	貸付有価証券 69,600株（39,600株）
カブドットコム証券	118,700	327.00	38,814,900	貸付有価証券

				54,800株
極東証券	18,000	1,289.00	23,202,000	貸付有価証券 8,200株
岩井コスモホールディングス	12,600	1,035.00	13,041,000	貸付有価証券 200株(200株)
藍澤証券	18,800	557.00	10,471,600	貸付有価証券 3,800株
マネースクウェアHD	4,600	941.00	4,328,600	
マネーパートナーズグループ	12,400	300.00	3,720,000	貸付有価証券 5,700株
小林洋行	3,800	234.00	889,200	貸付有価証券 400株
かんぽ生命保険	40,900	2,392.00	97,832,800	貸付有価証券 18,800株
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	297,500	2,946.00	876,435,000	
アニコムホールディングス	9,100	2,436.00	22,167,600	貸付有価証券 4,100株
MS&ADインシュアランスグループホール	400,200	2,870.50	1,148,774,100	
ソニーフィナンシャルホールディングス	128,300	1,485.00	190,525,500	
第一生命保険	858,000	1,323.50	1,135,563,000	
東京海上ホールディングス	542,500	3,677.00	1,994,772,500	
T&Dホールディングス	488,000	1,130.00	551,440,000	
全国保証	34,800	3,295.00	114,666,000	
クレディセゾン	101,600	1,901.00	193,141,600	貸付有価証券 2,200株
アクリーティブ	11,000	347.00	3,817,000	貸付有価証券 5,000株
芙蓉総合リース	15,300	4,735.00	72,445,500	
興銀リース	25,200	1,855.00	46,746,000	
東京センチュリーリース	31,400	3,785.00	118,849,000	貸付有価証券 1,000株
日本証券金融	59,000	468.00	27,612,000	
アイフル	224,200	284.00	63,672,800	貸付有価証券 103,400株(2,500株)
ポケットカード	13,400	446.00	5,976,400	貸付有価証券 5,400株
リコーリース	10,500	3,160.00	33,180,000	貸付有価証券

				3,700株
イオンフィナンシャルサービス	87,800	2,427.00	213,090,600	貸付有価証券 39,100株
アコム	269,000	446.00	119,974,000	貸付有価証券 118,900株(10,400株)
ジャックス	74,000	374.00	27,676,000	貸付有価証券 1,000株
オリエントコーポレーション	579,000	184.00	106,536,000	貸付有価証券 54,300株(27,500株)
日立キャピタル	31,600	2,366.00	74,765,600	
アプラスフィナンシャル	64,200	85.00	5,457,000	貸付有価証券 29,600株
オリックス	948,200	1,388.50	1,316,575,700	
三菱UFJリース	339,600	481.00	163,347,600	
日本取引所グループ	393,200	1,650.00	648,780,000	
イー・ギャランティ	4,400	2,187.00	9,622,800	貸付有価証券 1,400株
アサックス	2,300	1,321.00	3,038,300	
NECキャピタルソリューション	5,400	1,533.00	8,278,200	
いちごグループホールディングス	111,100	336.00	37,329,600	貸付有価証券 51,200株(600株)
日本駐車場開発	146,400	111.00	16,250,400	貸付有価証券 67,500株
ヒューリック	279,100	951.00	265,424,100	貸付有価証券 67,400株(10,000株)
三栄建築設計	5,400	1,139.00	6,150,600	貸付有価証券 2,400株
野村不動産ホールディングス	88,800	1,897.00	168,453,600	
三重交通グループホールディングス	23,700	440.00	10,428,000	
サムティ	7,100	975.00	6,922,500	貸付有価証券 3,200株(3,000株)
ディア・ライフ	6,700	308.00	2,063,600	貸付有価証券 100株(100株)
エー・ディー・ワークス	92,000	41.00	3,772,000	貸付有価証券 500株
日本商業開発	4,400	1,707.00	7,510,800	貸付有価証券 2,000株
プレサンスコーポレー	4,500	3,395.00	15,277,500	貸付有価証券

ション				100株
ユニゾホールディングス	8,400	3,695.00	31,038,000	貸付有価証券 100株
日本管理センター	8,700	1,591.00	13,841,700	貸付有価証券 600株
サンセイランディック	3,100	854.00	2,647,400	貸付有価証券 1,400株
エストラスト	2,300	595.00	1,368,500	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
フージャースホールディングス	18,600	426.00	7,923,600	貸付有価証券 7,700株
オープンハウス	19,300	1,923.00	37,113,900	貸付有価証券 8,700株
東急不動産ホールディングス	323,900	676.00	218,956,400	
飯田グループホールディングス	124,000	1,965.00	243,660,000	貸付有価証券 10,800株
パーク24	67,500	2,930.00	197,775,000	貸付有価証券 18,400株
パラカ	4,600	1,320.00	6,072,000	
三井不動産	710,000	2,568.50	1,823,635,000	
三菱地所	996,000	2,132.00	2,123,472,000	貸付有価証券 152,000株
平和不動産	25,300	1,138.00	28,791,400	貸付有価証券 4,900株(4,900株)
東京建物	146,200	1,183.00	172,954,600	
ダイビル	34,500	898.00	30,981,000	
京阪神ビルディング	22,200	580.00	12,876,000	
住友不動産	321,000	2,934.00	941,814,000	
大京	249,000	173.00	43,077,000	貸付有価証券 20,000株
テーオーシー	51,900	854.00	44,322,600	
東京楽天地	22,000	469.00	10,318,000	
レオパレス21	157,700	616.00	97,143,200	貸付有価証券 2,500株
スターツコーポレーション	15,400	2,206.00	33,972,400	貸付有価証券 1,200株
フジ住宅	17,100	665.00	11,371,500	貸付有価証券 7,500株
空港施設	16,200	507.00	8,213,400	
明和地所	7,300	595.00	4,343,500	

住友不動産販売	9,600	2,038.00	19,564,800	
ゴールドクレスト	10,600	1,641.00	17,394,600	貸付有価証券 300株
日本エスリード	5,200	1,027.00	5,340,400	貸付有価証券 100株
日神不動産	17,800	362.00	6,443,600	
タカラレーベン	59,300	557.00	33,030,100	貸付有価証券 11,100株（1,700株）
サンヨーハウジング名古屋	7,500	994.00	7,455,000	
イオンモール	86,400	1,564.00	135,129,600	
ファースト住建	5,000	1,265.00	6,325,000	
トーセイ	20,300	611.00	12,403,300	貸付有価証券 9,400株（500株）
穴吹興産	15,000	245.00	3,675,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	83,200	1,052.00	87,526,400	貸付有価証券 15,500株
サンフロンティア不動産	16,200	950.00	15,390,000	貸付有価証券 7,400株（5,800株）
エフ・ジェー・ネクスト	11,700	485.00	5,674,500	
ランドビジネス	9,000	262.00	2,358,000	
グランディハウス	11,700	366.00	4,282,200	
日本空港ビルデング	42,700	3,895.00	166,316,500	貸付有価証券 19,700株（300株）
日本工営	47,000	361.00	16,967,000	貸付有価証券 12,000株
ネクスト	40,000	1,021.00	40,840,000	貸付有価証券 18,400株
ジェイエシーリクルートメント	6,500	1,006.00	6,539,000	貸付有価証券 2,900株（2,900株）
日本M&Aセンター	21,900	4,845.00	106,105,500	貸付有価証券 4,500株
ノバレーゼ	3,600	812.00	2,923,200	貸付有価証券 1,300株（1,000株）
アコーディア・ゴルフ	39,300	1,068.00	41,972,400	貸付有価証券 500株
中広	1,300	607.00	789,100	
タケエイ	12,200	709.00	8,649,800	貸付有価証券 5,600株
トラスト・テック	2,800	2,356.00	6,596,800	
パソナグループ	12,300	590.00	7,257,000	貸付有価証券

				5,600株(4,500株)
CDS	3,200	834.00	2,668,800	貸付有価証券 1,100株
リンクアンドモチベーション	28,600	103.00	2,945,800	貸付有価証券 13,200株
GCAサヴィアン	12,600	874.00	11,012,400	貸付有価証券 2,000株
エス・エム・エス	17,600	1,751.00	30,817,600	貸付有価証券 8,100株
テンプホールディングス	99,300	1,507.00	149,645,100	
リニカル	8,300	1,528.00	12,682,400	貸付有価証券 3,800株
クックパッド	31,500	1,869.00	58,873,500	貸付有価証券 14,500株
エスクリ	6,000	573.00	3,438,000	貸付有価証券 2,700株(1,900株)
アイ・ケイ・ケイ	7,600	608.00	4,620,800	貸付有価証券 1,300株
学情	5,200	958.00	4,981,600	貸付有価証券 2,400株(500株)
スタジオアリス	6,500	2,148.00	13,962,000	
シミックホールディングス	6,400	1,443.00	9,235,200	貸付有価証券 2,900株(1,900株)
NJS	2,900	1,161.00	3,366,900	
総合警備保障	47,300	5,600.00	264,880,000	貸付有価証券 1,100株
カカクコム	102,800	2,029.00	208,581,200	貸付有価証券 46,600株(33,700株)
ルネサンス	7,200	1,171.00	8,431,200	貸付有価証券 3,100株
ディップ	15,700	2,022.00	31,745,400	貸付有価証券 7,200株
オプトホールディング	8,800	526.00	4,628,800	貸付有価証券 2,200株
新日本科学	13,400	342.00	4,582,800	貸付有価証券 6,200株
ツクイ	16,800	1,333.00	22,394,400	貸付有価証券 7,200株(1,500株)
キャリアデザインセンター	3,900	818.00	3,190,200	貸付有価証券 1,700株(1,000株)
エムスリー	122,700	2,552.00	313,130,400	貸付有価証券 50,200株



ツカダ・グローバルホールディング	10,300	639.00	6,581,700	貸付有価証券 2,800株
アウトソーシング	6,600	2,743.00	18,103,800	貸付有価証券 3,000株（1,600株）
ウェルネット	5,300	2,840.00	15,052,000	貸付有価証券 2,400株
ディー・エヌ・エー	63,500	1,637.00	103,949,500	
博報堂DYホールディングス	196,400	1,232.00	241,964,800	
ぐるなび	16,400	2,302.00	37,752,800	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
エスアールジータカミヤ	11,400	316.00	3,602,400	貸付有価証券 5,200株
ジャパンベストレスキューシステム	16,100	235.00	3,783,500	貸付有価証券 6,900株（1,100株）
ファンコミュニケーションズ	32,700	614.00	20,077,800	貸付有価証券 15,000株（6,300株）
ジェイコムホールディングス	2,900	2,028.00	5,881,200	貸付有価証券 1,300株
WDBホールディングス	5,100	829.00	4,227,900	貸付有価証券 2,300株（1,800株）
ティア	5,900	585.00	3,451,500	貸付有価証券 2,700株（500株）
バリューコマース	13,100	328.00	4,296,800	貸付有価証券 1,300株
インフォマート	20,500	968.00	19,844,000	貸付有価証券 9,400株
J Pホールディングス	35,200	251.00	8,835,200	貸付有価証券 16,200株（1,200株）
E P Sホールディングス	15,800	1,313.00	20,745,400	
レグス	2,100	598.00	1,255,800	貸付有価証券 700株
プレステージ・インターナショナル	11,900	1,110.00	13,209,000	
アミューズ	3,900	4,065.00	15,853,500	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
ドリームインキュベータ	4,700	2,018.00	9,484,600	貸付有価証券 2,100株
クイック	7,200	676.00	4,867,200	
T A C	7,800	179.00	1,396,200	貸付有価証券 3,300株
ケネディクス	190,200	418.00	79,503,600	貸付有価証券

				40,400株(40,400株)
電通	157,900	5,420.00	855,818,000	貸付有価証券 2,800株
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,600	429.00	2,831,400	
ぴあ	4,200	2,155.00	9,051,000	貸付有価証券 1,300株
イオンファンタジー	5,000	2,017.00	10,085,000	貸付有価証券 2,300株(200株)
シーティーエス	3,200	688.00	2,201,600	
ネクシィーズ	5,100	655.00	3,340,500	貸付有価証券 2,300株(1,900株)
みらかホールディングス	36,200	4,525.00	163,805,000	
アルプス技研	5,200	2,046.00	10,639,200	貸付有価証券 2,200株
ダイオーズ	2,500	1,003.00	2,507,500	
日本空調サービス	6,900	1,070.00	7,383,000	
オリエンタルランド	153,200	7,935.00	1,215,642,000	貸付有価証券 62,300株
ダスキン	40,100	2,107.00	84,490,700	
明光ネットワークジャパン	16,400	1,100.00	18,040,000	貸付有価証券 5,100株(4,300株)
ファルコホールディングス	6,200	1,269.00	7,867,800	
秀英予備校	2,500	526.00	1,315,000	貸付有価証券 1,100株
田谷	2,400	676.00	1,622,400	貸付有価証券 1,000株
ラウンドワン	44,200	640.00	28,288,000	貸付有価証券 1,000株
リゾートトラスト	59,400	2,560.00	152,064,000	貸付有価証券 24,800株
ビー・エム・エル	8,300	3,830.00	31,789,000	
ワタベウェディング	4,200	414.00	1,738,800	
りらいあコミュニケーションズ	23,400	927.00	21,691,800	
リソー教育	26,300	295.00	7,758,500	貸付有価証券 12,100株(1,600株)
早稲田アカデミー	1,800	894.00	1,609,200	
ユー・エス・エス	171,500	1,513.00	259,479,500	
東京個別指導学院	6,900	672.00	4,636,800	貸付有価証券

				3,100株
サイバーエージェント	34,600	5,090.00	176,114,000	貸付有価証券 14,400株(14,400株)
楽天	662,800	1,009.00	668,765,200	
テー・オー・ダブリュー	8,500	570.00	4,845,000	貸付有価証券 3,600株
セントラルスポーツ	4,800	2,226.00	10,684,800	貸付有価証券 2,200株
フルキャストホールディングス	13,000	634.00	8,242,000	貸付有価証券 5,900株
リゾートソリューション	14,000	296.00	4,144,000	
テクノプロ・ホールディングス	23,000	2,863.00	65,849,000	貸付有価証券 100株(100株)
インターワークス	1,800	605.00	1,089,000	
リブセンス	9,500	386.00	3,667,000	貸付有価証券 4,400株(2,400株)
ジャパンマテリアル	5,900	2,124.00	12,531,600	貸付有価証券 2,700株
ベクトル	4,400	2,155.00	9,482,000	貸付有価証券 1,600株(1,500株)
ウチヤマホールディングス	7,300	469.00	3,423,700	貸付有価証券 3,300株
サクセスホールディングス	1,300	1,058.00	1,375,400	
キャリアリンク	1,900	1,493.00	2,836,700	貸付有価証券 800株
I B J	8,300	365.00	3,029,500	貸付有価証券 3,800株
アサンテ	5,200	1,541.00	8,013,200	
N・フィールド	5,000	807.00	4,035,000	貸付有価証券 2,300株
M & A キャピタルパートナーズ	1,200	1,595.00	1,914,000	貸付有価証券 500株
ライドオン・エクスプレス	2,200	1,741.00	3,830,200	貸付有価証券 700株(700株)
E R I ホールディングス	3,600	782.00	2,815,200	貸付有価証券 1,500株(500株)
アビスト	1,500	1,947.00	2,920,500	
ウィルグループ	3,200	833.00	2,665,600	
日本ビューホテル	1,500	1,449.00	2,173,500	貸付有価証券 700株

リクルートホールディングス	285,800	3,355.00	958,859,000	貸付有価証券 16,900株(16,900株)
エラン	1,200	982.00	1,178,400	貸付有価証券 100株
日本郵政	312,500	1,393.00	435,312,500	貸付有価証券 53,100株
ベルシステム24ホールディングス	20,800	983.00	20,446,400	貸付有価証券 9,500株
リロ・ホールディング	5,300	12,670.00	67,151,000	貸付有価証券 100株
東祥	4,200	3,730.00	15,666,000	貸付有価証券 100株
エイチ・アイ・エス	23,100	3,355.00	77,500,500	貸付有価証券 10,600株
ラックランド	2,000	1,393.00	2,786,000	貸付有価証券 900株
共立メンテナンス	10,600	7,860.00	83,316,000	貸付有価証券 4,900株
イチネンホールディングス	14,800	894.00	13,231,200	貸付有価証券 300株
建設技術研究所	8,400	903.00	7,585,200	
スペース	7,600	1,209.00	9,188,400	
燦ホールディングス	2,800	1,411.00	3,950,800	
スバル興業	10,000	374.00	3,740,000	
東京テアトル	54,000	115.00	6,210,000	貸付有価証券 22,000株
ナガワ	2,600	2,800.00	7,280,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
よみうりランド	28,000	397.00	11,116,000	貸付有価証券 11,000株
東京都競馬	97,000	203.00	19,691,000	貸付有価証券 19,000株
常磐興産	52,000	147.00	7,644,000	貸付有価証券 23,000株(1,000株)
カナモト	19,800	2,449.00	48,490,200	貸付有価証券 8,900株(100株)
東京ドーム	113,000	509.00	57,517,000	
西尾レントオール	11,400	2,614.00	29,799,600	
トランス・コスモス	16,400	2,420.00	39,688,000	貸付有価証券 4,600株
乃村工藝社	30,300	1,343.00	40,692,900	貸付有価証券

				14,000株
藤田観光	51,000	500.00	25,500,000	貸付有価証券 23,000株
日本管財	12,100	1,727.00	20,896,700	
トーカイ	6,300	2,978.00	18,761,400	
白洋舎	15,000	250.00	3,750,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
セコム	147,400	7,997.00	1,178,757,800	
セントラル警備保障	6,200	1,933.00	11,984,600	
丹青社	26,500	632.00	16,748,000	貸付有価証券 9,400株（9,400株）
メイテック	17,600	3,885.00	68,376,000	貸付有価証券 1,900株
アサツー ディ・ケイ	24,900	2,770.00	68,973,000	貸付有価証券 6,800株
応用地質	14,900	1,278.00	19,042,200	
船井総研ホールディングス	19,700	1,321.00	26,023,700	
進学会	6,800	601.00	4,086,800	
オオバ	7,700	344.00	2,648,800	
学究社	2,000	1,288.00	2,576,000	貸付有価証券 800株（300株）
ベネッセホールディングス	47,500	3,410.00	161,975,000	貸付有価証券 19,600株
イオンディライト	13,700	3,510.00	48,087,000	貸付有価証券 6,300株
ナック	8,700	826.00	7,186,200	貸付有価証券 3,600株
ニチイ学館	24,600	799.00	19,655,400	貸付有価証券 11,300株（9,100株）
ダイセキ	26,600	1,665.00	44,289,000	貸付有価証券 8,100株
ステップ	4,700	992.00	4,662,400	
小計	銘柄数：1,924		257,290,312,740	
	組入時価比率：98.5%		100.0%	
合計			257,290,312,740	

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

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

## (2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年 2月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	4,153,825,000	-	3,901,500,000	252,473,716
合計	4,153,825,000	-	3,901,500,000	252,473,716

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

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

(平成28年 2月17日現在)

純資産合計	9,704,855,020
負債純資産合計	9,722,268,020

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	<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.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>
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>

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3227円
(10,000口当たり純資産額)	(13,227円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

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

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。



## (2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第350回	40,000,000	40,104,400	
		国庫債券 利付(2年)第355回	60,000,000	60,218,400	
		国庫債券 利付(2年)第357回	100,000,000	100,405,000	
		国庫債券 利付(2年)第360回	130,000,000	130,607,100	
		国庫債券 利付(5年)第103回	40,000,000	40,192,400	
		国庫債券 利付(5年)第104回	50,000,000	50,186,000	
		国庫債券 利付(5年)第105回	50,000,000	50,230,000	
		国庫債券 利付(5年)第106回	40,000,000	40,218,800	
		国庫債券 利付(5年)第107回	40,000,000	40,257,200	
		国庫債券 利付(5年)第108回	60,000,000	60,275,400	
		国庫債券 利付(5年)第110回	20,000,000	20,194,000	
		国庫債券 利付(5年)第111回	40,000,000	40,471,200	
		国庫債券 利付(5年)第112回	100,000,000	101,322,000	
		国庫債券 利付(5年)第113回	50,000,000	50,538,000	
		国庫債券 利付(5年)第114回	20,000,000	20,238,600	
		国庫債券 利付(5年)第115回	60,000,000	60,559,800	
		国庫債券 利付(5年)第116回	160,000,000	161,638,400	
		国庫債券 利付(5年)第117回	190,000,000	192,086,200	
		国庫債券 利付(5年)第118回	50,000,000	50,594,000	
		国庫債券 利付(5年)第119回	40,000,000	40,341,200	
		国庫債券 利付(5年)第120回	20,000,000	20,252,200	
		国庫債券 利付(5年)第121回	40,000,000	40,360,000	
		国庫債券 利付(5年)第122回	130,000,000	131,227,200	
		国庫債券 利付(5年)第123回	240,000,000	242,361,600	
		国庫債券 利付(5年)第125回	130,000,000	131,378,000	
		国庫債券 利付(5年)第126回	70,000,000	70,765,800	
		国庫債券 利付(40年)第1回	10,000,000	13,515,200	
国庫債券 利付(40年)第2回	10,000,000	12,998,900			
国庫債券 利付(40年)第3回	20,000,000	26,067,000			
国庫債券 利付(40年)第4回	15,000,000	19,623,450			
国庫債券 利付(40年)第5回	28,000,000	35,051,800			

国庫債券 利付(40年)第6回	20,000,000	24,439,200	
国庫債券 利付(40年)第7回	30,000,000	34,784,100	
国庫債券 利付(40年)第8回	10,000,000	10,631,000	
国庫債券 利付(10年)第285回	68,000,000	69,352,520	
国庫債券 利付(10年)第286回	30,000,000	30,776,100	
国庫債券 利付(10年)第287回	50,000,000	51,360,500	
国庫債券 利付(10年)第288回	65,000,000	66,892,800	
国庫債券 利付(10年)第289回	100,000,000	103,023,000	
国庫債券 利付(10年)第290回	50,000,000	51,627,000	
国庫債券 利付(10年)第291回	20,000,000	20,609,200	
国庫債券 利付(10年)第292回	45,000,000	46,746,000	
国庫債券 利付(10年)第293回	30,000,000	31,379,700	
国庫債券 利付(10年)第294回	40,000,000	41,746,000	
国庫債券 利付(10年)第295回	25,000,000	25,974,000	
国庫債券 利付(10年)第296回	65,000,000	67,798,900	
国庫債券 利付(10年)第297回	40,000,000	41,769,600	
国庫債券 利付(10年)第298回	20,000,000	20,828,000	
国庫債券 利付(10年)第299回	45,000,000	47,025,900	
国庫債券 利付(10年)第300回	35,000,000	36,792,000	
国庫債券 利付(10年)第301回	45,000,000	47,493,900	
国庫債券 利付(10年)第302回	40,000,000	42,082,800	
国庫債券 利付(10年)第303回	45,000,000	47,512,800	
国庫債券 利付(10年)第304回	30,000,000	31,567,200	

回			
国庫債券 利付(10年)第305回	70,000,000	73,912,300	
国庫債券 利付(10年)第306回	45,000,000	47,843,100	
国庫債券 利付(10年)第307回	30,000,000	31,772,400	
国庫債券 利付(10年)第308回	30,000,000	31,868,700	
国庫債券 利付(10年)第309回	40,000,000	42,142,800	
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	31,555,800	
国庫債券 利付(10年)第311回	20,000,000	20,852,800	
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	74,509,400	
国庫債券 利付(10年)第313回	60,000,000	64,370,400	
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	31,878,600	
国庫債券 利付(10年)第315回	50,000,000	53,555,500	
国庫債券 利付(10年)第316回	10,000,000	10,657,400	
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	32,066,100	
国庫債券 利付(10年)第318回	140,000,000	148,855,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	30,000,000	32,159,100	
国庫債券 利付(10年)第320回	190,000,000	202,559,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	40,000,000	42,756,400	
国庫債券 利付(10年)第322回	30,000,000	31,883,700	
国庫債券 利付(10年)第323回	20,000,000	21,308,200	
国庫債券 利付(10年)第324回	70,000,000	74,132,100	
国庫債券 利付(10年)第325回	90,000,000	95,526,000	

国庫債券 利付(10年)第326回	40,000,000	42,259,600	
国庫債券 利付(10年)第327回	50,000,000	53,169,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	130,000,000	136,633,900	
国庫債券 利付(10年)第329回	70,000,000	74,680,200	
国庫債券 利付(10年)第330回	50,000,000	53,418,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	30,000,000	31,592,400	
国庫債券 利付(10年)第332回	60,000,000	63,240,600	
国庫債券 利付(10年)第333回	20,000,000	21,088,800	
国庫債券 利付(10年)第334回	40,000,000	42,192,800	
国庫債券 利付(10年)第335回	50,000,000	52,325,500	
国庫債券 利付(10年)第336回	40,000,000	41,858,800	
国庫債券 利付(10年)第337回	10,000,000	10,287,700	
国庫債券 利付(10年)第338回	210,000,000	217,723,800	
国庫債券 利付(10年)第339回	50,000,000	51,793,500	
国庫債券 利付(10年)第340回	25,000,000	25,883,750	
国庫債券 利付(10年)第341回	70,000,000	71,747,200	
国庫債券 利付(30年)第3回	10,000,000	12,749,900	
国庫債券 利付(30年)第5回	10,000,000	12,668,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	10,000,000	12,992,300	
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	19,303,500	
国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	24,150,400	
国庫債券 利付(30年)第9回	20,000,000	22,847,800	
国庫債券 利付(30年)第10回	10,000,000	10,926,900	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	11,904,400	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	12,565,700	

国庫債券	利付（30年）第13回	10,000,000	12,384,900
国庫債券	利付（30年）第14回	30,000,000	39,158,700
国庫債券	利付（30年）第15回	10,000,000	13,225,200
国庫債券	利付（30年）第16回	10,000,000	13,231,900
国庫債券	利付（30年）第17回	10,000,000	13,045,700
国庫債券	利付（30年）第18回	20,000,000	25,732,400
国庫債券	利付（30年）第19回	10,000,000	12,866,700
国庫債券	利付（30年）第20回	10,000,000	13,225,300
国庫債券	利付（30年）第21回	10,000,000	12,853,500
国庫債券	利付（30年）第22回	10,000,000	13,227,100
国庫債券	利付（30年）第23回	10,000,000	13,227,200
国庫債券	利付（30年）第24回	10,000,000	13,226,500
国庫債券	利付（30年）第25回	20,000,000	25,701,200
国庫債券	利付（30年）第26回	20,000,000	26,077,600
国庫債券	利付（30年）第27回	20,000,000	26,501,600
国庫債券	利付（30年）第28回	30,000,000	39,831,600
国庫債券	利付（30年）第29回	20,000,000	26,170,800
国庫債券	利付（30年）第30回	30,000,000	38,691,600
国庫債券	利付（30年）第31回	30,000,000	38,106,000
国庫債券	利付（30年）第32回	40,000,000	51,800,000
国庫債券	利付（30年）第33回	60,000,000	73,880,400
国庫債券	利付（30年）第34回	30,000,000	38,293,200
国庫債券	利付（30年）第35回	32,000,000	39,442,880
国庫債券	利付（30年）第36回	30,000,000	36,970,200
国庫債券	利付（30年）第37回	30,000,000	36,318,300
国庫債券	利付（30年）第38回	20,000,000	23,738,200
国庫債券	利付（30年）第39回	20,000,000	24,201,200
国庫債券	利付（30年）第40回	20,000,000	23,715,400
国庫債券	利付（30年）第41回	20,000,000	23,225,000
国庫債券	利付（30年）第42回	20,000,000	23,222,000
国庫債券	利付（30年）第43回	10,000,000	11,609,400
国庫債券	利付（30年）第44回	20,000,000	23,215,200
国庫債券	利付（30年）第45回	140,000,000	155,491,000
国庫債券	利付（30年）第46回	10,000,000	11,101,400
国庫債券	利付（30年）第47回	20,000,000	22,695,600
国庫債券	利付（30年）第48回	20,000,000	21,677,800

国庫債券	利付（30年）第49回	40,000,000	43,328,000	
国庫債券	利付（20年）第37回	30,000,000	31,545,000	
国庫債券	利付（20年）第40回	70,000,000	74,466,700	
国庫債券	利付（20年）第41回	30,000,000	31,541,100	
国庫債券	利付（20年）第42回	10,000,000	10,854,100	
国庫債券	利付（20年）第43回	10,000,000	11,096,800	
国庫債券	利付（20年）第44回	10,000,000	11,080,800	
国庫債券	利付（20年）第45回	10,000,000	11,039,800	
国庫債券	利付（20年）第46回	5,000,000	5,506,900	
国庫債券	利付（20年）第47回	15,000,000	16,612,500	
国庫債券	利付（20年）第49回	60,000,000	66,865,800	
国庫債券	利付（20年）第52回	25,000,000	28,121,250	
国庫債券	利付（20年）第53回	10,000,000	11,307,300	
国庫債券	利付（20年）第54回	10,000,000	11,366,100	
国庫債券	利付（20年）第55回	10,000,000	11,302,300	
国庫債券	利付（20年）第56回	10,000,000	11,352,500	
国庫債券	利付（20年）第57回	10,000,000	11,288,700	
国庫債券	利付（20年）第58回	10,000,000	11,340,400	
国庫債券	利付（20年）第59回	110,000,000	123,791,800	
国庫債券	利付（20年）第60回	10,000,000	11,047,100	
国庫債券	利付（20年）第61回	10,000,000	10,795,800	
国庫債券	利付（20年）第62回	10,000,000	10,668,600	
国庫債券	利付（20年）第63回	10,000,000	11,407,400	
国庫債券	利付（20年）第64回	10,000,000	11,519,400	
国庫債券	利付（20年）第65回	10,000,000	11,560,600	
国庫債券	利付（20年）第66回	20,000,000	22,963,600	
国庫債券	利付（20年）第67回	10,000,000	11,595,900	
国庫債券	利付（20年）第68回	10,000,000	11,839,600	
国庫債券	利付（20年）第69回	30,000,000	35,275,200	
国庫債券	利付（20年）第70回	10,000,000	12,049,700	
国庫債券	利付（20年）第71回	10,000,000	11,882,400	
国庫債券	利付（20年）第72回	20,000,000	23,676,200	
国庫債券	利付（20年）第73回	30,000,000	35,377,800	
国庫債券	利付（20年）第74回	10,000,000	11,881,100	
国庫債券	利付（20年）第75回	40,000,000	47,648,000	
国庫債券	利付（20年）第76回	17,000,000	19,941,680	

国庫債券 利付（20年）第77回	15,000,000	17,731,800	
国庫債券 利付（20年）第78回	10,000,000	11,762,000	
国庫債券 利付（20年）第79回	10,000,000	11,855,200	
国庫債券 利付（20年）第80回	10,000,000	11,948,400	
国庫債券 利付（20年）第81回	10,000,000	11,888,200	
国庫債券 利付（20年）第82回	15,000,000	17,975,700	
国庫債券 利付（20年）第83回	15,000,000	18,017,550	
国庫債券 利付（20年）第84回	10,000,000	11,913,800	
国庫債券 利付（20年）第85回	13,000,000	15,656,940	
国庫債券 利付（20年）第86回	10,000,000	12,244,200	
国庫債券 利付（20年）第87回	30,000,000	36,432,000	
国庫債券 利付（20年）第88回	20,000,000	24,562,000	
国庫債券 利付（20年）第89回	20,000,000	24,357,000	
国庫債券 利付（20年）第90回	20,000,000	24,424,000	
国庫債券 利付（20年）第91回	10,000,000	12,316,800	
国庫債券 利付（20年）第92回	30,000,000	36,410,400	
国庫債券 利付（20年）第93回	20,000,000	24,111,200	
国庫債券 利付（20年）第94回	20,000,000	24,343,200	
国庫債券 利付（20年）第95回	10,000,000	12,423,200	
国庫債券 利付（20年）第96回	15,000,000	18,299,850	
国庫債券 利付（20年）第97回	10,000,000	12,341,100	
国庫債券 利付（20年）第99回	150,000,000	183,793,500	
国庫債券 利付（20年）第100回	20,000,000	24,805,400	
国庫債券 利付（20年）第101回	20,000,000	25,279,000	
国庫債券 利付（20年）第102回	20,000,000	25,356,200	
国庫債券 利付（20年）第103回	15,000,000	18,836,250	
国庫債券 利付（20年）第104回	10,000,000	12,308,800	
国庫債券 利付（20年）第105回	20,000,000	24,664,200	
国庫債券 利付（20年）第106回	10,000,000	12,454,900	
国庫債券 利付（20年）第107回	20,000,000	24,708,000	
国庫債券 利付（20年）第108回	40,000,000	48,386,800	

回			
国庫債券 利付(20年)第109回	10,000,000	12,112,700	
国庫債券 利付(20年)第110回	20,000,000	24,748,800	
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	12,531,900	
国庫債券 利付(20年)第112回	35,000,000	43,409,450	
国庫債券 利付(20年)第113回	40,000,000	49,688,800	
国庫債券 利付(20年)第114回	30,000,000	37,345,500	
国庫債券 利付(20年)第115回	10,000,000	12,582,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	70,000,000	88,144,700	
国庫債券 利付(20年)第118回	10,000,000	12,335,900	
国庫債券 利付(20年)第119回	10,000,000	12,052,800	
国庫債券 利付(20年)第120回	25,000,000	29,445,500	
国庫債券 利付(20年)第121回	100,000,000	122,099,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	20,000,000	24,124,200	
国庫債券 利付(20年)第123回	10,000,000	12,502,900	
国庫債券 利付(20年)第124回	20,000,000	24,722,800	
国庫債券 利付(20年)第125回	10,000,000	12,667,900	
国庫債券 利付(20年)第126回	30,000,000	37,116,600	
国庫債券 利付(20年)第127回	20,000,000	24,440,200	
国庫債券 利付(20年)第128回	20,000,000	24,457,200	
国庫債券 利付(20年)第129回	20,000,000	24,166,800	
国庫債券 利付(20年)第130回	20,000,000	24,160,400	



国庫債券 利付(20年)第131回	15,000,000	17,899,800	
国庫債券 利付(20年)第132回	10,000,000	11,935,600	
国庫債券 利付(20年)第134回	10,000,000	12,087,600	
国庫債券 利付(20年)第135回	15,000,000	17,905,350	
国庫債券 利付(20年)第136回	15,000,000	17,665,950	
国庫債券 利付(20年)第137回	10,000,000	11,928,900	
国庫債券 利付(20年)第138回	10,000,000	11,615,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	10,000,000	11,767,400	
国庫債券 利付(20年)第140回	70,000,000	83,437,900	
国庫債券 利付(20年)第141回	30,000,000	35,755,800	
国庫債券 利付(20年)第142回	20,000,000	24,149,200	
国庫債券 利付(20年)第143回	10,000,000	11,740,100	
国庫債券 利付(20年)第144回	10,000,000	11,573,500	
国庫債券 利付(20年)第145回	20,000,000	23,789,800	
国庫債券 利付(20年)第146回	70,000,000	83,172,600	
国庫債券 利付(20年)第147回	20,000,000	23,410,400	
国庫債券 利付(20年)第148回	10,000,000	11,514,800	
国庫債券 利付(20年)第149回	20,000,000	22,991,600	
国庫債券 利付(20年)第150回	20,000,000	22,599,400	
国庫債券 利付(20年)第151回	40,000,000	43,728,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	190,000,000	207,210,200	
国庫債券 利付(20年)第153回	70,000,000	77,415,100	

	回			
	国庫債券 利付（20年）第154回	50,000,000	54,258,500	
	回			
	国庫債券 利付（20年）第155回	20,000,000	20,917,400	
	回			
小計	銘柄数：248 組入時価比率：99.3%	8,753,000,000	9,641,615,370 100.0%	
合計			9,641,615,370	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.8685円
(10,000口当たり純資産額)	(18,685円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

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

## 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在	
期首	平成27年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	149,633,076,503円
同期中における追加設定元本額	37,101,159,185円
同期中における一部解約元本額	28,162,611,486円
期末元本額	158,571,624,202円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	63,877,730円
バランスセレクト50	200,963,442円
バランスセレクト70	187,017,799円
野村外国株式インデックスファンド	561,444,665円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,800,256,860円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	10,426,362,943円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	5,916,704,859円
野村資産設計ファンド2015	39,606,261円
野村資産設計ファンド2020	45,701,967円
野村資産設計ファンド2025	50,921,323円
野村資産設計ファンド2030	49,143,520円
野村資産設計ファンド2035	35,647,310円
野村資産設計ファンド2040	121,849,940円
野村外国株インデックス（野村投資一任口座向け）	15,911,200,658円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	882,903,824円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	5,435,253,524円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	4,380,798,620円
野村資産設計ファンド2045	11,967,855円
野村インデックスファンド・外国株式	2,296,007,677円
マイ・ロード	1,666,895,775円
ネクストコア	84,049,170円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	88,722,635円
野村外国株インデックス（野村SMA・EW向け）	452,067,224円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	214,711,057円
野村資産設計ファンド2050	3,432,627円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	684,160,749円

グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	467,317,320円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	9,786,547,797円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,926,189,341円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	8,991,689円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	38,896,581円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	28,261,719円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	133,083,317円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	1,452,118,533円
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	587,441,892円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	237,794,913円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	33,654,861円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	268,441,094円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	4,840,763,033円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	636,100,640円
野村MSCI-KOKUSAインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,099,869,564円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	102,805,798円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,583,074円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	16,281,431円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	13,786,973円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA(確定拠出年金向け)	54,634,433,083円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,259,363,786円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,170,700,092円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,829,623,049円
マイバランスDC30	679,792,400円
マイバランスDC50	1,173,093,499円
マイバランスDC70	917,696,389円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA	12,485,049,884円
野村DC運用戦略ファンド	101,648,823円
野村DC運用戦略ファンドM	545,648円
野村DC運用戦略ファンドA	1,387,585円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	24,198,099円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	152,505円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	339,776円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1)株式(平成28年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES	41,100	41.20	1,693,320.00	

CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,700	65.61	1,161,297.00
CORE LABORATORIES N.V.	3,830	101.67	389,396.10
ENSCO PLC-CL A	23,000	8.53	196,190.00
FMC TECHNOLOGIES INC	22,500	23.48	528,300.00
HALLIBURTON CO	80,300	29.94	2,404,182.00
HELMERICH & PAYNE	10,600	48.64	515,584.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,600	28.06	1,026,996.00
OCEANEERING INTL INC	9,500	26.55	252,225.00
SCHLUMBERGER LTD	119,700	71.75	8,588,475.00
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	76,000	6.62	503,120.00
ANADARKO PETE	48,200	39.09	1,884,138.00
ANTERO RESOURCES CORP	7,400	24.64	182,336.00
APACHE CORPORATION	35,900	37.47	1,345,173.00
CABOT OIL & GAS CORP	39,600	19.26	762,696.00
CHENIERE ENERGY INC	20,600	26.58	547,548.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	51,600	1.86	95,976.00
CHEVRON CORP	177,700	84.81	15,070,737.00
CIMAREX ENERGY CO	9,000	84.28	758,520.00
COLUMBIA PIPELINE GROUP	35,300	16.82	593,746.00
CONCHO RESOURCES INC	11,800	88.14	1,040,052.00
CONOCOPHILLIPS	116,200	32.76	3,806,712.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,000	18.46	147,680.00
DEVON ENERGY CORP	37,400	21.26	795,124.00
ENERGEN CORP	6,800	22.90	155,720.00
EOG RESOURCES INC	51,500	67.89	3,496,335.00
EQT CORP	14,100	60.32	850,512.00
EXXON MOBIL CORP	393,800	81.22	31,984,436.00
HESS CORP	26,400	40.84	1,078,176.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	30.87	512,442.00
KINDER MORGAN INC	176,000	15.62	2,749,120.00
MARATHON OIL CORP	62,400	7.40	461,760.00
MARATHON PETROLEUM CORP	49,900	32.54	1,623,746.00
MURPHY OIL CORP	15,000	16.80	252,000.00
NOBLE ENERGY INC	41,100	28.64	1,177,104.00
OCCIDENTAL PETE CORP	72,400	68.01	4,923,924.00

ONEOK INC	19,800	21.03	416,394.00
PHILLIPS 66	51,000	78.25	3,990,750.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,200	115.45	1,754,840.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	6.65	126,350.00
RANGE RESOURCES CORP	16,700	26.04	434,868.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	33,600	8.00	268,800.00
SPECTRA ENERGY CORP	63,300	28.40	1,797,720.00
TESORO CORP	11,300	70.43	795,859.00
VALERO ENERGY CORP	46,700	57.35	2,678,245.00
WHITING PETROLEUM CORP	17,800	4.76	84,728.00
WILLIAMS COS	66,200	15.01	993,662.00
AIR PRODUCTS	19,430	131.35	2,552,130.50
AIRGAS INC	6,450	140.48	906,096.00
ALBEMARLE CORP	10,200	52.32	533,664.00
ASHLAND INC	5,900	95.54	563,686.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,500	24.55	306,875.00
CELANESE CORP-SERIES A	14,600	58.69	856,874.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,450	31.14	667,953.00
DOW CHEM CO	106,600	46.83	4,992,078.00
DU PONT E I DE NEMOURS	85,300	58.86	5,020,758.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	14,200	62.36	885,512.00
ECOLAB INC	25,100	108.65	2,727,115.00
FMC CORP	13,200	36.79	485,628.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	7,700	106.54	820,358.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	37,400	77.93	2,914,582.00
MONSANTO CO	44,100	87.94	3,878,154.00
MOSAIC CO/THE	29,300	23.54	689,722.00
PPG INDUSTRIES	25,800	93.62	2,415,396.00
PRAXAIR INC	27,100	104.00	2,818,400.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,470	258.94	1,934,281.80
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,100	43.58	178,678.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,500	135.41	744,755.00
VULCAN MATERIALS CO	12,800	93.26	1,193,728.00
AVERY DENNISON CORP	8,300	64.83	538,089.00
BALL CORP	12,400	66.26	821,624.00



CROWN HOLDINGS INC	12,600	45.60	574,560.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	37,600	35.10	1,319,760.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	8,900	47.39	421,771.00	
SEALED AIR CORP	19,900	43.43	864,257.00	
WESTROCK CO	24,300	31.51	765,693.00	
ALCOA INC	121,000	8.12	982,520.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	97,000	6.37	617,890.00	
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	49,700	24.56	1,220,632.00	
NUCOR CORP	30,700	40.18	1,233,526.00	
B/E AEROSPACE INC	10,100	40.67	410,767.00	
BOEING CO	61,100	112.60	6,879,860.00	
GENERAL DYNAMICS	25,730	131.51	3,383,752.30	
HONEYWELL INTERNATIONAL	69,900	104.95	7,336,005.00	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	7,700	116.20	894,740.00	
LOCKHEED MARTIN	26,470	209.00	5,532,230.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,810	184.22	3,096,738.20	
RAYTHEON COMPANY	28,600	120.81	3,455,166.00	
ROCKWELL COLLINS INC	12,200	82.80	1,010,160.00	
TEXTRON INC	26,400	32.84	866,976.00	
TRANSDIGM GROUP INC	4,980	205.24	1,022,095.20	
UNITED TECHNOLOGIES	80,100	86.48	6,927,048.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	14,800	47.75	706,700.00	
MASCO CORP	32,900	26.43	869,547.00	
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	8,400	32.99	277,116.00	
FLUOR CORP	14,200	44.99	638,858.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,000	37.21	409,310.00	
QUANTA SERVICES INC	18,600	18.04	335,544.00	
ACUITY BRANDS INC	4,020	185.89	747,277.80	
AMETEK INC	23,300	45.98	1,071,334.00	
EATON CORP PLC	44,500	54.82	2,439,490.00	
EMERSON ELEC	62,100	46.62	2,895,102.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,400	100.26	1,243,224.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	15,400	33.03	508,662.00	
3M CORP	59,100	155.53	9,191,823.00	
	58,300	86.49	5,042,367.00	

DANAHER CORP			
GENERAL ELEC CO	891,400	28.86	25,725,804.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,410	167.29	1,574,198.90
AGCO CORP	6,300	47.34	298,242.00
CATERPILLAR INC DEL	53,700	65.21	3,501,777.00
CUMMINS INC	16,100	99.14	1,596,154.00
DEERE & COMPANY	29,700	79.81	2,370,357.00
DOVER CORP	14,500	60.29	874,205.00
FLOWSERVE CORP	12,300	41.93	515,739.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	31,100	93.54	2,909,094.00
INGERSOLL-RAND PLC	25,100	51.74	1,298,674.00
PACCAR	33,500	51.36	1,720,560.00
PARKER HANNIFIN CORP	13,200	99.65	1,315,380.00
PENTAIR PLC	17,400	45.74	795,876.00
SNAP-ON INC	5,460	141.88	774,664.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,700	92.97	1,366,659.00
WABCO HOLDINGS INC	5,200	92.52	481,104.00
WABTEC CORP	9,400	67.49	634,406.00
XYLEM INC	17,000	37.00	629,000.00
AERCAP HOLDINGS NV	8,700	29.15	253,605.00
FASTENAL CO	26,200	43.68	1,144,416.00
GRAINGER(W.W.) INC	5,590	213.97	1,196,092.30
UNITED RENTALS INC	8,600	47.56	409,016.00
ADT CORP/THE	15,800	39.64	626,312.00
CINTAS CORP	9,100	83.98	764,218.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	22,900	45.43	1,040,347.00
STERICYCLE INC	8,100	109.47	886,707.00
TYCO INTERNATIONAL PLC	39,100	34.20	1,337,220.00
WASTE MANAGEMENT INC	42,800	54.79	2,345,012.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,700	71.21	975,577.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	18,300	46.58	852,414.00
FEDEX CORPORATION	25,170	132.11	3,325,208.70
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	66,100	98.56	6,514,816.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	15,400	38.61	594,594.00
DELTA AIR LINES INC	19,100	44.58	851,478.00

SOUTHWEST AIRLINES	15,300	37.08	567,324.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,300	48.87	454,491.00
AMERCO	680	342.09	232,621.20
CSX CORP	93,200	24.76	2,307,632.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	34,600	8.13	281,298.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,700	75.55	657,285.00
KANSAS CITY SOUTHERN	10,200	80.63	822,426.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,700	73.99	2,123,513.00
UNION PAC CORP	82,200	79.37	6,524,214.00
AUTOLIV INC	8,500	105.46	896,410.00
BORGWARNER INC	21,300	32.40	690,120.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	26,500	63.12	1,672,680.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	25,200	30.35	764,820.00
JOHNSON CONTROLS INC	61,900	35.48	2,196,212.00
LEAR CORP	7,400	103.90	768,860.00
FORD MOTOR COMPANY	349,000	11.87	4,142,630.00
GENERAL MOTORS CO	134,400	28.58	3,841,152.00
HARLEY-DAVIDSON INC	19,000	39.70	754,300.00
TESLA MOTORS INC	9,080	155.17	1,408,943.60
DR HORTON INC	31,700	24.78	785,526.00
GARMIN LTD	10,200	35.23	359,346.00
HARMAN INTERNATIONAL	7,000	73.06	511,420.00
JARDEN CORP	19,300	50.83	981,019.00
LEGGETT & PLATT INC	13,400	42.98	575,932.00
LENNAR CORP-A	16,800	40.30	677,040.00
MOHAWK INDUSTRIES	6,020	159.52	960,310.40
NEWELL RUBBERMAID INC	25,500	36.00	918,000.00
PULTEGROUP INC	29,500	16.67	491,765.00
TOLL BROTHERS INC	16,400	25.71	421,644.00
WHIRLPOOL CORP	7,340	135.45	994,203.00
HASBRO INC	10,800	71.04	767,232.00
MATTEL INC	31,800	30.35	965,130.00
POLARIS INDUSTRIES INC	6,200	83.51	517,762.00
COACH INC	26,500	35.58	942,870.00
HANESBRANDS INC	37,700	27.47	1,035,619.00

LULULEMON ATHLETICA INC	10,600	59.80	633,880.00	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	18,700	50.76	949,212.00	
NIKE INC-B	128,300	57.79	7,414,457.00	
PVH CORP	7,600	73.92	561,792.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	5,800	88.33	512,314.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	17,100	79.94	1,366,974.00	
V F CORP	32,300	59.60	1,925,080.00	
ARAMARK	21,600	30.18	651,888.00	
CARNIVAL CORP	39,200	45.02	1,764,784.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,950	492.94	1,454,173.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,900	59.54	648,986.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	46,300	18.99	879,237.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	37,100	45.82	1,699,922.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	20,200	65.06	1,314,212.00	
MCDONALD'S CORP	89,000	119.18	10,607,020.00	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	7,500	15.16	113,700.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	42,300	19.15	810,045.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	15,000	40.56	608,400.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,900	72.51	1,225,419.00	
STARBUCKS CORP	140,400	56.41	7,919,964.00	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	16,200	65.04	1,053,648.00	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,900	67.08	731,172.00	
WYNN RESORTS LTD	7,700	74.65	574,805.00	
YUM BRANDS INC	40,700	69.52	2,829,464.00	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	19,300	32.69	630,917.00	
CBS CORP-CL B	41,400	44.92	1,859,688.00	
CHARTER COMMUNICATION-A	7,950	168.93	1,342,993.50	
COMCAST CORP-CL A	234,700	57.48	13,490,556.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	14,300	25.56	365,508.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	26,500	25.03	663,295.00	
DISH NETWORK CORP-A	20,900	44.15	922,735.00	
DISNEY (WALT) CO	151,500	92.91	14,075,865.00	
INTERPUBRIC GROUP	39,200	20.70	811,440.00	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	58,300	33.96	1,979,868.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	23,700	35.28	836,136.00	

LIBERTY MEDIA CORP-A	8,170	32.68	266,995.60
LIBERTY MEDIA CORP-C	19,300	32.27	622,811.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	37,400	10.94	409,156.00
OMNICOM GROUP	23,100	75.75	1,749,825.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,100	53.81	382,051.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	222,000	3.49	774,780.00
TEGNA INC	20,600	23.21	478,126.00
TIME WARNER CABLE-A	26,660	186.09	4,961,159.40
TIME WARNER INC	77,300	63.33	4,895,409.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	115,300	25.61	2,952,833.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	40,900	25.63	1,048,267.00
VIACOM INC-CLASS B	32,800	34.29	1,124,712.00
GENUINE PARTS CO	14,200	89.61	1,272,462.00
LKQ CORP	28,100	25.67	721,327.00
AMAZON.COM INC	37,560	521.10	19,572,516.00
EXPEDIA INC	11,700	105.44	1,233,648.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	41,400	24.24	1,003,536.00
NETFLIX INC	38,400	89.05	3,419,520.00
PRICELINE GROUP INC/THE	4,800	1,110.68	5,331,264.00
TRIPADVISOR INC	11,500	63.32	728,180.00
DOLLAR GENERAL CORP	27,500	73.04	2,008,600.00
DOLLAR TREE INC	21,300	78.55	1,673,115.00
KOHL'S CORP	19,100	42.62	814,042.00
MACYS INC	30,700	40.47	1,242,429.00
NORDSTROM INC	13,700	50.90	697,330.00
TARGET CORP	56,600	71.50	4,046,900.00
ADVANCE AUTO PARTS	6,800	146.00	992,800.00
AUTONATION INC	7,100	49.23	349,533.00
AUTOZONE	2,940	757.69	2,227,608.60
BED BATH & BEYOND	15,600	44.61	695,916.00
BEST BUY COMPANY INC	30,500	29.50	899,750.00
CARMAX INC	19,300	46.04	888,572.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,300	39.04	324,032.00
FOOT LOCKER INC	13,400	67.68	906,912.00

GAMESTOP CORP-CLASS A	10,000	28.00	280,000.00	
GAP INC	22,900	24.52	561,508.00	
HOME DEPOT	121,400	119.43	14,498,802.00	
L BRANDS, INC	23,300	83.31	1,941,123.00	
LOWES COS INC	87,600	67.43	5,906,868.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,400	255.76	2,404,144.00	
ROSS STORES INC	39,400	55.00	2,167,000.00	
SIGNET JEWELERS LTD	7,100	104.15	739,465.00	
STAPLES INC	62,000	8.85	548,700.00	
TIFFANY & CO	11,900	63.24	752,556.00	
TJX COS INC	63,600	71.37	4,539,132.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12,600	85.54	1,077,804.00	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,630	159.02	895,282.60	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	41,620	149.11	6,205,958.20	
CVS HEALTH CORP	105,400	96.94	10,217,476.00	
KROGER CO	87,400	38.49	3,364,026.00	
RITE AID CORP	93,000	7.83	728,190.00	
SYSCO CORP	56,300	43.76	2,463,688.00	
WAL-MART STORES INC	152,300	65.90	10,036,570.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	82,700	76.55	6,330,685.00	
WHOLE FOODS MARKET INC	34,100	30.90	1,053,690.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	11,000	98.22	1,080,420.00	
COCA COLA CO	390,500	43.36	16,932,080.00	
COCA COLA ENTERPRISES	20,700	48.77	1,009,539.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,370	139.29	2,280,177.30	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	18,100	92.01	1,665,381.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	17,400	84.66	1,473,084.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	13,730	124.31	1,706,776.30	
PEPSICO INC	138,800	98.60	13,685,680.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	56,800	33.62	1,909,616.00	
BUNGE LIMITED	13,800	52.16	719,808.00	
CAMPBELL SOUP CO	17,500	59.44	1,040,200.00	
CONAGRA INC	40,400	41.77	1,687,508.00	
GENERAL MILLS	56,300	57.66	3,246,258.00	
HERSHEY CO/THE	14,500	90.39	1,310,655.00	

HORMEL FOODS CORP	27,600	44.44	1,226,544.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,800	127.70	1,379,160.00
KELLOGG CO	25,000	75.19	1,879,750.00
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	10,600	90.46	958,876.00
KRAFT HEINZ CO/THE	57,200	72.31	4,136,132.00
MCCORMICK & CO INC.	10,800	90.38	976,104.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	19,200	72.53	1,392,576.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	152,600	39.12	5,969,712.00
TYSON FOODS INC-CL A	28,900	61.81	1,786,309.00
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	16,200	37.30	604,260.00
ALTRIA GROUP INC	185,400	60.30	11,179,620.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146,400	90.12	13,193,568.00
REYNOLDS AMERICAN INC	81,400	48.28	3,929,992.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,300	89.64	1,102,572.00
CLOROX CO	12,200	128.12	1,563,064.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	81,000	65.81	5,330,610.00
KIMBERLY-CLARK CORP	34,300	128.71	4,414,753.00
PROCTER & GAMBLE CO	256,300	81.47	20,880,761.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	6,100	76.36	465,796.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,100	88.62	1,869,882.00
ABBOTT LABORATORIES	141,200	37.99	5,364,188.00
BARD (C R)	7,030	187.44	1,317,703.20
BAXTER INTERNATIONAL INC.	51,400	37.41	1,922,874.00
BECTON, DICKINSON	19,740	142.12	2,805,448.80
BOSTON SCIENTIFIC CORP	127,300	17.16	2,184,468.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	13,200	55.70	735,240.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,500	84.45	1,731,225.00
HOLOGIC INC	23,100	33.83	781,473.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,490	535.16	1,867,708.40
MEDTRONIC PLC	133,900	74.74	10,007,686.00
RESMED INC	13,200	59.03	779,196.00
ST JUDE MEDICAL INC	27,000	51.94	1,402,380.00
STRYKER CORP	31,800	97.40	3,097,320.00
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,700	137.89	648,083.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,500	78.03	741,285.00

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,900	93.62	1,675,798.00	
AETNA INC	32,700	102.18	3,341,286.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,100	85.61	1,635,151.00	
ANTHEM INC	24,500	124.83	3,058,335.00	
CARDINAL HEALTH INC	31,000	79.77	2,472,870.00	
CENTENE CORP	10,600	55.15	584,590.00	
CIGNA CORP	24,160	134.18	3,241,788.80	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	16,000	62.64	1,002,240.00	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	16,500	19.88	328,020.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	64,100	68.65	4,400,465.00	
HCA HOLDINGS INC	31,300	65.60	2,053,280.00	
HENRY SCHEIN INC	7,740	161.86	1,252,796.40	
HUMANA INC	14,030	166.64	2,337,959.20	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,400	104.50	982,300.00	
MCKESSON CORP	21,790	152.59	3,324,936.10	
MEDNAX INC	9,100	64.97	591,227.00	
PATTERSON COS INC	8,700	43.57	379,059.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,300	63.22	840,826.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	90,200	115.15	10,386,530.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,700	106.10	923,070.00	
ABBVIE INC	156,600	53.51	8,379,666.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,220	142.39	3,021,515.80	
ALKERMES PLC	13,800	33.31	459,678.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,200	63.90	460,080.00	
AMGEN INC	71,700	147.15	10,550,655.00	
BAXALTA INC	57,500	39.00	2,242,500.00	
BIOGEN INC	22,270	256.52	5,712,700.40	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,300	74.26	1,136,178.00	
CELGENE CORP	74,800	104.49	7,815,852.00	
GILEAD SCIENCES INC	138,700	91.15	12,642,505.00	
INCYTE CORP	15,500	71.67	1,110,885.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,900	36.04	392,836.00	
MEDIVATION INC	15,400	31.58	486,332.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,160	391.76	2,805,001.60	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,340	129.83	563,462.20	



VERTEX PHARMACEUTICALS	23,000	85.37	1,963,510.00
ALLERGAN PLC	37,220	284.45	10,587,229.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	157,700	62.18	9,805,786.00
ELI LILLY & CO.	94,400	73.33	6,922,352.00
ENDO INTERNATIONAL PLC	20,500	51.58	1,057,390.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,800	119.00	690,200.00
JOHNSON & JOHNSON	261,500	102.32	26,756,680.00
MALLINCKRODT PLC	11,100	64.22	712,842.00
MERCK & CO INC	266,200	49.78	13,251,436.00
MYLAN NV	39,300	43.15	1,695,795.00
PERRIGO CO PLC	13,650	141.21	1,927,516.50
PFIZER INC	582,700	29.81	17,370,287.00
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	800	134.92	107,936.00
ZOETIS INC	44,700	40.43	1,807,221.00
BANK OF AMERICA CORP	986,700	12.25	12,087,075.00
BB&T CORPORATION	74,200	32.58	2,417,436.00
CIT GROUP INC	15,500	27.30	423,150.00
CITIGROUP	284,600	38.89	11,068,094.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,100	19.36	969,936.00
COMERICA INC	17,300	34.25	592,525.00
FIFTH THIRD BANCORP	76,700	15.58	1,194,986.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,700	59.81	819,397.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,000	8.74	655,500.00
JPMORGAN CHASE & CO	349,400	58.35	20,387,490.00
KEYCORP	81,000	10.91	883,710.00
M & T BANK CORP	13,600	108.88	1,480,768.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	30,500	14.83	452,315.00
PNC FINANCIAL	48,700	83.27	4,055,249.00
REGIONS FINANCIAL CORP	126,000	7.84	987,840.00
SIGNATURE BANK	4,890	131.12	641,176.80
SUNTRUST BKS INC.	48,000	34.29	1,645,920.00
US BANCORP	166,700	40.19	6,699,673.00
WELLS FARGO CO	460,700	48.24	22,224,168.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	112,000	128.56	14,398,720.00
CME GROUP INC	30,100	90.71	2,730,371.00

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,220	237.89	2,669,125.80
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,200	14.79	476,238.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	25,800	87.32	2,252,856.00
MOODYS CORP	16,900	83.72	1,414,868.00
NASDAQ INC	11,100	61.66	684,426.00
VOYA FINANCIAL INC	21,100	28.17	594,387.00
AFLAC INC	40,800	58.13	2,371,704.00
ALLEGHANY CORP	1,510	462.90	698,979.00
ALLSTATE CORP	37,900	64.57	2,447,203.00
AMERICAN INTL GROUP	122,500	52.06	6,377,350.00
AON PLC	26,300	94.15	2,476,145.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,400	68.61	782,154.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,900	39.00	620,100.00
ASSURANT INC	6,200	67.25	416,950.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,900	52.81	522,819.00
CHUBB LTD	43,700	115.67	5,054,779.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,700	62.11	913,017.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,020	184.69	742,453.80
FNF GROUP	24,400	32.50	793,000.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	39,400	41.17	1,622,098.00
LINCOLN NATIONAL CORP	23,900	33.92	810,688.00
LOEWS CORP	26,900	36.53	982,657.00
MARKEL CORP	1,300	833.88	1,084,044.00
MARSH & MCLENNAN COS	50,100	56.50	2,830,650.00
METLIFE INC	89,000	38.02	3,383,780.00
PARTNERRE LTD	4,480	140.50	629,440.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	28,000	36.46	1,020,880.00
PROGRESSIVE CO	55,300	31.65	1,750,245.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,600	63.44	2,702,544.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,400	113.23	498,212.00
TORCHMARK CORP	12,200	51.09	623,298.00
TRAVELERS COS INC/THE	29,400	107.37	3,156,678.00
UNUM GROUP	22,700	26.58	603,366.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,400	110.77	1,373,548.00
WR BERKLEY CORP	8,900	51.81	461,109.00

XL GROUP PLC	28,800	34.65	997,920.00
CBRE GROUP INC	27,600	24.32	671,232.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	56,000	5.78	323,680.00
JONES LANG LASALLE INC	4,210	103.17	434,345.70
REALOGY HOLDINGS CORP	13,000	29.60	384,800.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	16,700	52.55	877,585.00
ALPHABET INC-CL A	27,390	717.64	19,656,159.60
ALPHABET INC-CL C	29,240	691.00	20,204,840.00
EBAY INC	104,100	22.95	2,389,095.00
FACEBOOK INC-A	202,800	101.61	20,606,508.00
LINKEDIN CORP - A	10,870	106.00	1,152,220.00
TWITTER INC	53,700	16.36	878,532.00
VERISIGN INC	9,900	79.68	788,832.00
YAHOO! INC	84,100	29.28	2,462,448.00
ZILLOW GROUP INC - C	8,600	18.83	161,938.00
ACCENTURE PLC-CL A	59,100	96.91	5,727,381.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,870	187.49	1,100,566.30
AUTOMATIC DATA PROCESS	43,700	83.78	3,661,186.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	57,100	55.01	3,141,071.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,300	58.65	1,542,495.00
FISERV INC	21,900	94.35	2,066,265.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,400	124.61	922,114.00
GARTNER INC	8,100	81.50	660,150.00
GLOBAL PAYMENTS INC	12,400	58.10	720,440.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	88,000	122.74	10,801,120.00
MASTERCARD INC-CLASS A	94,500	86.18	8,144,010.00
PAYCHEX INC	30,700	49.99	1,534,693.00
PAYPAL HOLDINGS INC	104,200	35.46	3,694,932.00
SABRE CORP	17,600	26.17	460,592.00
TERADATA CORP	13,200	23.64	312,048.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	15,200	40.83	620,616.00
VANTIV INC - CL A	15,100	48.81	737,031.00
VISA INC-CLASS A SHARES	184,400	71.10	13,110,840.00
WESTERN UNION CO	49,100	18.40	903,440.00
XEROX CORP	97,000	9.02	874,940.00

ACTIVISION BLIZZARD INC	47,700	29.42	1,403,334.00
ADOBE SYSTEMS INC.	47,200	78.88	3,723,136.00
ANSYS INC	8,400	84.05	706,020.00
AUTODESK INC.	21,000	44.89	942,690.00
CA INC	30,900	28.36	876,324.00
CDK GLOBAL INC	12,800	42.89	548,992.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,700	80.40	538,680.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,900	65.67	978,483.00
ELECTRONIC ARTS	29,100	59.36	1,727,376.00
FIREEYE INC	12,400	13.21	163,804.00
FORTINET INC	12,800	25.42	325,376.00
INTUIT INC	24,900	95.36	2,374,464.00
MICROSOFT CORP	717,500	51.09	36,657,075.00
MOBILEYE NV	7,100	27.47	195,037.00
NETSUITE INC	3,900	53.74	209,586.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,500	17.65	397,125.00
ORACLE CORPORATION	328,000	35.70	11,709,600.00
RED HAT INC	17,000	63.84	1,085,280.00
SALESFORCE.COM INC	58,700	59.72	3,505,564.00
SERVICENOW INC	14,300	52.04	744,172.00
SPLUNK INC	11,600	32.24	373,984.00
SYMANTEC CORP	65,200	19.55	1,274,660.00
SYNOPSIS INC	14,900	42.96	640,104.00
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	4,900	40.17	196,833.00
VMWARE INC - CLASS A	7,400	46.13	341,362.00
WORKDAY INC-CLASS A	10,100	50.53	510,353.00
CISCO SYSTEMS	480,900	25.84	12,426,456.00
F5 NETWORKS INC	6,500	89.51	581,815.00
HARRIS CORP	11,400	73.46	837,444.00
JUNIPER NETWORKS INC	33,500	23.21	777,535.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,100	63.42	957,642.00
PALO ALTO NETWORKS INC	6,810	127.74	869,909.40
QUALCOMM INC	148,700	46.73	6,948,751.00
APPLE INC	538,400	96.64	52,030,976.00
EMC CORP	181,400	24.60	4,462,440.00

HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	171,000	12.33	2,108,430.00
HP INC	168,700	9.81	1,654,947.00
NETAPP INC	27,900	23.09	644,211.00
SAN DISK CORPORATION	19,600	68.17	1,336,132.00
SEAGATE TECHNOLOGY	29,000	31.33	908,570.00
WESTERN DIGITAL CORP	22,000	42.78	941,160.00
AMPHENOL CORP-CL A	29,600	50.73	1,501,608.00
ARROW ELECTRS INC	9,300	55.69	517,917.00
AVNET	12,200	40.02	488,244.00
CDW CORPORATION	14,100	36.26	511,266.00
CORNING INC	116,800	18.64	2,177,152.00
FLEXTRONICS INTL LTD	51,000	10.50	535,755.00
FLIR SYSTEMS INC	12,600	30.26	381,276.00
TE CONNECTIVITY LTD	38,400	55.50	2,131,200.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,200	22.37	518,984.00
ANALOG DEVICES INC	29,400	52.07	1,530,858.00
APPLIED MATERIALS	114,500	16.72	1,914,440.00
BROADCOM LTD	36,653	126.24	4,627,074.72
INTEL CORP	449,500	28.78	12,936,610.00
KLA TENCOR CORP	15,000	64.74	971,100.00
LAM RESEARCH	14,700	67.58	993,426.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	22,500	42.73	961,425.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	41,000	9.12	373,920.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,100	33.42	905,682.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	19,800	41.63	824,274.00
MICRON TECHNOLOGY	103,100	10.81	1,114,511.00
NVIDIA CORP	51,000	26.99	1,376,490.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	12,574	69.44	873,138.56
QORVO INC	14,600	40.78	595,388.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,600	61.44	1,081,344.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	97,300	52.54	5,112,142.00
XILINX INC	24,000	48.08	1,153,920.00
AT & T INC	581,100	36.65	21,297,315.00
CENTURYLINK INC	53,900	28.92	1,558,788.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	114,000	4.25	484,500.00

LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	29,000	47.97	1,391,130.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	12,100	90.53	1,095,413.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	384,100	50.24	19,297,184.00	
SPRINT CORP	71,000	2.79	198,090.00	
T-MOBILE US INC	27,100	36.45	987,795.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	46,600	61.09	2,846,794.00	
DUKE ENERGY CORP	65,200	76.29	4,974,108.00	
EDISON INTERNATIONAL	30,400	62.38	1,896,352.00	
ENTERGY CORP	16,700	70.77	1,181,859.00	
EVERSOURCE ENERGY	29,900	53.86	1,610,414.00	
EXELON CORPORATION	81,500	31.02	2,528,130.00	
FIRSTENERGY CORP	39,200	33.46	1,311,632.00	
NEXTERA ENERGY INC	42,600	112.35	4,786,110.00	
OGE ENERGY CORP	19,600	26.21	513,716.00	
PEPCO HOLDINGS INC	24,600	26.64	655,344.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	10,500	67.25	706,125.00	
PPL CORPORATION	63,000	36.03	2,269,890.00	
SOUTHERN CO.	86,100	48.09	4,140,549.00	
XCEL ENERGY INC	47,400	38.83	1,840,542.00	
AGL RESOURCES INC	11,500	64.61	743,015.00	
ALLIANT ENERGY CORP	10,800	66.97	723,276.00	
AMEREN CORPORATION	23,100	45.58	1,052,898.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	38,900	18.10	704,090.00	
CMS ENERGY CORP	25,900	39.18	1,014,762.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,800	70.97	1,972,966.00	
DOMINION RESOURCES INC/VA	56,400	69.15	3,900,060.00	
DTE ENERGY COMPANY	17,000	84.54	1,437,180.00	
PG&E CORP	46,300	55.75	2,581,225.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	47,200	42.07	1,985,704.00	
SCANA CORP	13,100	64.78	848,618.00	
SEMPRA ENERGY	22,400	94.44	2,115,456.00	
WEC ENERGY GROUP INC	30,200	55.73	1,683,046.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,100	65.15	1,114,065.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	47,100	15.55	732,405.00	
ALLY FINANCIAL INC	42,100	17.01	716,121.00	

AMERICAN EXPRESS CO	84,900	53.18	4,514,982.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	50,900	64.21	3,268,289.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	40,600	45.67	1,854,202.00	
NAVIENT CORP	33,900	9.66	327,474.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	78,400	26.14	2,049,376.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,200	126.62	658,424.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,800	82.92	1,393,056.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	105,100	34.55	3,631,205.00	
BLACKROCK INC	11,510	314.47	3,619,549.70	
E*TRADE FINANCIAL CORP	27,100	21.86	592,406.00	
EATON VANCE CORP	11,700	29.47	344,799.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	38,300	33.85	1,296,455.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	36,900	149.02	5,498,838.00	
INVESCO LTD	41,200	26.70	1,100,040.00	
LEGG MASON INC	9,200	27.22	250,424.00	
MORGAN STANLEY	137,400	23.72	3,259,128.00	
NORTHERN TRUST CORP	20,500	58.25	1,194,125.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,000	42.22	506,640.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	111,200	23.58	2,622,096.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,900	36.67	473,043.00	
STATE STREET CORP	38,400	56.64	2,174,976.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	24,000	68.47	1,643,280.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,400	27.07	687,578.00	
H & R BLOCK INC	22,400	34.59	774,816.00	
AES CORP	65,000	9.38	609,700.00	
CALPINE CORP	31,000	12.99	402,690.00	
NRG ENERGY INC	29,400	9.70	285,180.00	
CERNER CORP	29,300	55.46	1,624,978.00	
IMS HEALTH HOLDINGS INC	16,300	24.74	403,262.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	31,100	37.08	1,153,188.00	
ILLUMINA INC	13,710	149.11	2,044,298.10	
METTLER-TOLEDO INTL	2,540	312.69	794,232.60	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	8,800	61.79	543,752.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,800	127.42	4,816,476.00	
WATERS CORP	7,600	120.02	912,152.00	

	DUN & BRADSTREET CORP	3,600	93.78	337,608.00	
	EQUIFAX INC	11,000	99.17	1,090,870.00	
	IHS INC-CLASS A	6,600	98.16	647,856.00	
	MANPOWERGROUP INC	7,000	75.07	525,490.00	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	33,400	47.99	1,602,866.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	12,100	38.07	460,647.00	
	VERISK ANALYTICS INC	15,200	68.22	1,036,944.00	
小計	銘柄数：601			1,600,379,115.78	
				(182,907,329,142)	
	組入時価比率：61.7%			64.8%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	14,100	31.57	445,137.00	
	ARC RESOURCES LTD	33,500	18.23	610,705.00	
	CAMECO CORP	38,600	15.99	617,214.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	103,600	27.85	2,885,260.00	
	CENOVUS ENERGY INC	79,000	14.55	1,149,450.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	44,800	14.94	669,312.00	
	ENBRIDGE INC	80,800	45.27	3,657,816.00	
	ENCANA CORP	79,000	4.99	394,210.00	
	HUSKY ENERGY INC	30,745	12.55	385,849.75	
	IMPERIAL OIL	28,300	41.17	1,165,111.00	
	INTER PIPELINE LTD	30,400	21.19	644,176.00	
	KEYERA CORP	16,100	35.56	572,516.00	
	MEG ENERGY CORP	13,600	3.81	51,816.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,300	31.27	1,010,021.00	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	15,100	29.90	451,490.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	12,600	19.59	246,834.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	17,000	15.33	260,610.00	
	SUNCOR ENERGY INC	147,360	31.01	4,569,633.60	
	TOURMALINE OIL CORP	17,300	25.35	438,555.00	
	TRANSCANADA CORP	67,100	48.96	3,285,216.00	
	VERESEN INC	24,800	7.25	179,800.00	
	VERMILION ENERGY INC	10,500	33.73	354,165.00	
	AGRIUM INC	12,600	115.28	1,452,528.00	
	METHANEX CORP	8,200	38.11	312,502.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	79,100	21.74	1,719,634.00	



CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,660	190.63	507,075.80
AGNICO EAGLE MINES LTD	20,600	47.41	976,646.00
BARRICK GOLD	109,000	16.11	1,755,990.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	62,800	3.92	246,176.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	59,400	3.91	232,254.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,700	72.78	1,069,866.00
GOLDCORP INC	80,000	20.55	1,644,000.00
KINROSS GOLD CORP	104,600	3.77	394,342.00
SILVER WHEATON CORP	39,200	20.45	801,640.00
TECK RESOURCES LTD	49,200	7.10	349,320.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,000	2.77	240,990.00
YAMANA GOLD INC	97,000	3.46	335,620.00
WEST FRASER TIMBER	6,800	40.35	274,380.00
BOMBARDIER B SHEARS	167,000	0.90	150,300.00
CAE INC	26,000	13.96	362,960.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,500	41.27	598,415.00
FINNING INTERNATIONAL INC	14,900	18.19	271,031.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	75,800	77.13	5,846,454.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	14,600	173.98	2,540,108.00
LINAMAR CORP	4,800	53.65	257,520.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	38,800	46.88	1,818,944.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,200	33.15	702,780.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,400	46.91	863,144.00
SHAW COMMUNICATIONS-B	37,500	23.41	877,875.00
THOMSON REUTERS CORP	33,000	49.72	1,640,760.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,000	114.14	798,980.00
DOLLARAMA INC	11,500	74.60	857,900.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	40,100	56.69	2,273,269.00
EMPIRE CO LTD A	16,200	24.81	401,922.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	19.53	183,582.00
LOBLAW COMPANIES	21,400	64.33	1,376,662.00
METRO INC	23,200	40.45	938,440.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,800	104.06	499,488.00
SAPUTO INC	23,900	37.80	903,420.00
VALEANT PHARMACEUTICALS	30,600	127.00	3,886,200.00

INTERNATIONAL				
BANK OF MONTREAL	60,700	73.18	4,442,026.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	114,500	55.07	6,305,515.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	37,600	89.01	3,346,776.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	31,500	37.60	1,184,400.00	
ROYAL BANK OF CANADA	140,500	69.41	9,752,105.00	
TORONTO DOMINION BANK	175,500	51.88	9,104,940.00	
ELEMENT FINANCIAL CORP	36,000	13.28	478,080.00	
ONEX CORP	8,000	79.71	637,680.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,070	778.83	1,612,178.10	
GREAT-WEST LIFE CO INC	28,000	34.15	956,200.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,900	37.33	369,567.00	
INTACT FINANCIAL CORP	12,700	85.06	1,080,262.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	187,600	16.63	3,119,788.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	35,000	28.31	990,850.00	
POWER FINANCIAL CORP	24,300	30.80	748,440.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	57,100	39.60	2,261,160.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	81,200	41.25	3,349,500.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,300	19.27	217,751.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	21,400	56.58	1,210,812.00	
CONSTELLATION SOFTWARE	1,790	505.00	903,950.00	
OPEN TEXT CORP	11,100	67.16	745,476.00	
BLACKBERRY LTD	43,900	9.67	424,513.00	
BCE INC	14,100	58.12	819,492.00	
TELUS CORP	19,300	38.80	748,840.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	34,800	48.31	1,681,188.00	
FORTIS INC	25,500	36.50	930,750.00	
ATCO LTD CL1	6,800	37.90	257,720.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	12,400	34.25	424,700.00	
CI FINANCIAL CORP	22,600	28.60	646,360.00	
IGM FINANCIAL INC	8,500	33.61	285,685.00	
小計 銘柄数 : 90			123,444,719.25	
			(10,173,079,313)	
組入時価比率 : 3.4%			3.6%	
ユ一ロ	SAIPEM	549,700	0.30	169,857.30

TECHNIP SA	9,800	39.71	389,207.00
TENARIS SA	46,000	9.24	425,270.00
ENI SPA	241,600	11.85	2,862,960.00
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	36,500	10.50	383,432.50
NESTE OYJ	12,500	26.85	335,625.00
OMV AG	14,000	23.80	333,200.00
REPSOL SA	104,318	8.77	914,868.86
TOTAL SA	205,600	38.77	7,972,140.00
VOPAK	7,100	40.01	284,106.50
AIR LIQUIDE	32,300	91.83	2,966,109.00
AKZO NOBEL	23,200	52.15	1,209,880.00
ARKEMA	5,900	50.37	297,183.00
BASF SE	87,000	58.36	5,077,320.00
EVONIK INDUSTRIES AG	13,800	26.42	364,665.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	35.17	225,120.00
K+S AG	17,300	18.16	314,168.00
KONINKLIJKE DSM NV	17,500	43.66	764,137.50
LANXESS	8,300	34.74	288,342.00
LINDE AG	17,580	118.35	2,080,593.00
OCI	8,000	14.03	112,240.00
SOLVAY SA	6,800	76.25	518,500.00
SYMRISE AG	11,500	56.28	647,220.00
UMICORE	8,800	37.69	331,672.00
CRH PLC	80,900	22.22	1,797,598.00
HEIDELBERGCEMENT AG	13,100	64.03	838,793.00
IMERYS	3,000	54.27	162,810.00
ARCELORMITTAL	96,000	2.96	284,640.00
THYSSENKRUPP AG	33,300	13.57	451,881.00
VOESTALPINE AG	11,000	26.10	287,155.00
STORA ENSO OYJ-R	54,000	7.15	386,100.00
UPM-KYMMENE OYJ	50,500	14.59	736,795.00
AIRBUS GROUP SE	55,400	53.78	2,979,412.00
FINMECCANICA SPA	37,000	9.19	340,030.00
SAFRAN SA	29,200	52.30	1,527,160.00
THALES (EX THOMSON-CSF)	9,900	63.98	633,402.00

ZODIAC AEROSPACE	19,500	19.16	373,620.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	45,500	33.86	1,540,630.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,525	20.50	379,762.50
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,100	33.28	269,568.00
BOUYGUES	18,700	33.71	630,470.50
FERROVIAL SA	42,892	18.19	780,419.94
VINCI	44,900	61.39	2,756,411.00
LEGRAND SA	25,300	43.80	1,108,140.00
OSRAM LICHT AG	8,850	38.51	340,813.50
PRYSMIAN SPA	19,400	17.02	330,188.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	52,800	48.03	2,535,984.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	89,600	21.61	1,936,256.00
SIEMENS AG	74,600	82.15	6,128,390.00
ALSTOM	20,300	20.78	421,935.50
ANDRITZ AG	7,300	40.77	297,657.50
CNH INDUSTRIAL NV	92,000	5.69	523,480.00
GEA GROUP AG	17,500	39.41	689,675.00
KONE OYJ	31,900	38.30	1,221,770.00
MAN SE	3,200	94.03	300,896.00
METSO OYJ	10,400	19.34	201,136.00
WARTSILA OYJ	13,600	37.26	506,736.00
ZARDOYA OTIS S.A	16,872	8.67	146,280.24
BRENNTAG AG	14,290	42.20	603,038.00
REXEL SA	28,600	9.17	262,347.80
BIC	2,810	140.25	394,102.50
EDENRED	18,700	14.71	275,077.00
BOLLORE	87,000	3.58	311,982.00
DEUTSCHE POST AG-REG	91,800	21.16	1,942,947.00
TNT EXPRESS NV	43,000	7.91	340,345.00
DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	22,600	12.54	283,517.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	74,000	6.65	492,544.00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	50,200	12.98	651,847.00
ADP	2,800	105.00	294,000.00
AENA SA	6,500	98.45	639,925.00
ATLANTIA SPA	39,300	23.19	911,367.00

FRAPORT AG	3,800	51.41	195,358.00
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	45,000	9.64	433,935.00
CONTINENTAL AG	10,350	182.75	1,891,462.50
MICHELIN B	17,800	84.43	1,502,854.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	11,300	32.65	368,945.00
VALEO	7,630	112.85	861,045.50
BAYER MOTOREN WERK	31,100	72.82	2,264,702.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	5,300	61.63	326,639.00
DAIMLER AG	91,200	62.33	5,684,496.00
FERRARI NV	11,540	31.21	360,163.40
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	82,400	5.58	460,204.00
PEUGEOT CITROEN	40,200	12.79	514,158.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,200	39.73	564,237.00
RENAULT	18,200	74.06	1,347,892.00
VOLKSWAGEN AG	3,450	117.75	406,237.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	17,430	100.15	1,745,614.50
ADIDAS AG	19,700	91.14	1,795,458.00
CHRISTIAN DIOR SE	5,100	157.85	805,035.00
HERMES INTERNATIONAL	2,470	309.65	764,835.50
HUGO BOSS AG	6,300	66.57	419,391.00
KERING	7,230	154.10	1,114,143.00
LUXOTTICA GROUP SPA	15,700	51.10	802,270.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	26,490	149.35	3,956,281.50
ACCOR SA	19,200	32.68	627,456.00
PADDY POWER PLC	8,100	117.00	947,700.00
SODEXO	9,000	88.63	797,670.00
ALTICE NV - A	33,630	12.61	424,242.45
ALTICE NV - B	10,010	12.83	128,428.30
AXEL SPRINGER SE	4,400	44.65	196,482.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,300	28.59	466,017.00
JC DECAUX SA	6,800	33.70	229,194.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,080	115.00	239,200.00
LAGARDERE S.C.A	11,600	25.76	298,874.00
NUMERICABLE-SFR	9,600	31.68	304,128.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	20,900	44.20	923,780.00

PUBLICIS GROUPE	17,600	57.67	1,014,992.00
RELX NV	94,000	14.34	1,348,430.00
RTL GROUP	3,900	73.35	286,065.00
SES FDR	31,600	22.82	721,112.00
TELENET GROUP HOLDING NV	5,200	46.62	242,424.00
VIVENDI SA	110,700	17.87	1,978,762.50
WOLTERS KLUWER	28,900	29.93	864,977.00
ZALANDO SE	8,100	27.71	224,451.00
INDITEX SA	103,600	27.22	2,819,992.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	51,900	23.29	1,208,751.00
CASINO GUICHARD	4,900	41.21	201,953.50
COLRUYT SA	7,000	48.58	340,095.00
DELHAIZE GROUP	9,800	90.91	890,918.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	57,000	4.90	279,699.00
JERONIMO MARTINS	25,200	12.47	314,244.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	78,700	19.69	1,549,996.50
METRO AG	16,600	23.52	390,515.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	76,000	104.40	7,934,400.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,700	64.98	630,306.00
HEINEKEN NV	22,000	73.32	1,613,040.00
PERNOD-RICARD	20,000	93.98	1,879,600.00
REMY COINTREAU	2,300	60.71	139,633.00
DANONE	55,900	59.96	3,351,764.00
KERRY GROUP PLC-A	15,700	72.69	1,141,233.00
HENKEL AG & CO KGAA	10,000	81.86	818,600.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,900	95.40	1,612,260.00
BEIERSDORF AG	9,400	81.51	766,194.00
LOREAL-ORD	23,890	154.35	3,687,421.50
UNILEVER NV-CVA	154,200	38.26	5,899,692.00
ESSILOR INTERNATIONAL	19,400	108.60	2,106,840.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	20,900	75.55	1,578,995.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	36,300	55.09	1,999,767.00
GRIFOLS SA	28,800	18.60	535,824.00
BAYER AG	78,200	95.30	7,452,460.00
MERCK KGAA	11,900	74.85	890,715.00

ORION OYJ	9,600	29.10	279,360.00	
SANOFI	111,700	69.45	7,757,565.00	
U.C.B. SA	11,700	74.85	875,745.00	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	226,000	0.56	127,012.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	600,242	5.61	3,368,558.10	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD	3,400,000	0.03	112,200.00	
BANCO DE SABADELL SA	484,505	1.45	703,501.26	
BANCO POPOLARE SPA	33,900	7.97	270,352.50	
BANCO SANTANDER SA	1,368,815	3.60	4,931,840.44	
BANK OF IRELAND	2,740,000	0.26	720,620.00	
BANKIA SA	430,000	0.76	328,520.00	
BANKINTER S.A.	65,000	5.98	389,025.00	
BCO POPULAR ESPANOL	160,916	2.11	340,337.34	
BNP PARIBAS	99,800	40.30	4,021,940.00	
CAIXABANK	244,409	2.57	630,330.81	
COMMERZBANK AG	102,000	7.35	750,108.00	
CREDIT AGRICOLE SA	98,000	8.38	821,632.00	
ERSTE GROUP BANK AG	26,800	24.81	664,908.00	
ING GROEP NV	365,000	10.20	3,724,825.00	
INTESA SANPAOLO	1,197,000	2.44	2,920,680.00	
INTESA SANPAOLO-RSP	92,000	2.29	211,232.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROUPE NV	24,000	48.35	1,160,400.00	
NATIXIS	87,000	4.70	409,683.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	11.42	125,620.00	
SOCIETE GENERALE	68,200	29.50	2,011,900.00	
UNICREDIT SPA	453,000	3.42	1,549,260.00	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	90,000	3.49	314,820.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	18,200	72.38	1,317,316.00	
EURAZEO	3,876	50.93	197,404.68	
EXOR SPA	9,800	27.00	264,600.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	7,800	67.92	529,776.00	
WENDEL	2,900	83.43	241,947.00	
AEGON NV	171,000	4.23	724,014.00	
AGEAS	18,800	33.49	629,612.00	

ALLIANZ SE	43,260	130.45	5,643,267.00
ASSICURAZIONI GENERALI	110,200	11.64	1,282,728.00
AXA	185,500	20.02	3,713,710.00
CNP ASSURANCES	16,500	11.12	183,480.00
HANNOVER RUECK SE	5,700	88.24	502,968.00
MAPFRE SA	93,000	1.72	160,332.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	15,760	168.85	2,661,076.00
NN GROUP NV	23,200	27.76	644,032.00
SAMPO OYJ-A	42,100	39.41	1,659,161.00
SCOR SE	14,000	30.45	426,370.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	1.80	192,814.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	31,100	24.20	752,620.00
IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00
VONOVIA SE	43,700	26.74	1,168,538.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,600	42.53	493,406.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	41,900	35.24	1,476,556.00
ATOS SE	7,900	63.23	499,517.00
CAP GEMINI SA	15,300	71.32	1,091,196.00
DASSAULT SYSTEMES SA	12,100	67.80	820,380.00
GEMALTO	7,600	53.42	405,992.00
SAP SE	93,000	67.16	6,245,880.00
NOKIA OYJ	401,000	5.30	2,125,300.00
NOKIA OYJ	143,000	5.31	760,188.00
INGENICO GROUP	5,000	100.95	504,750.00
ASML HOLDING NV	32,700	74.44	2,434,188.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	105,000	10.79	1,132,950.00
STMICROELECTRONICS NV	57,700	4.79	276,844.60
DEUTSCHE TELEKOM-REG	305,500	14.58	4,454,190.00
ELISA CORPORATION	13,700	31.33	429,221.00
ILIAD SA	2,440	218.60	533,384.00
KONINKLIJKE KPN NV	298,000	3.34	995,916.00
ORANGE	186,400	15.38	2,866,832.00
PROXIMUS	13,700	30.24	414,356.50
TELECOM ITALIA SPA	1,070,000	0.82	877,400.00
TELECOM ITALIA-RNC	570,000	0.65	370,785.00



	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	56,600	4.39	248,813.60	
	TELEFONICA SA	424,617	9.14	3,880,999.38	
	ELECTRICITE DE FRANCE	22,800	11.28	257,184.00	
	ENDESA S.A.	29,400	16.03	471,429.00	
	ENEL SPA	662,000	3.63	2,405,708.00	
	ENERGIAS DE PORTUGAL	220,000	2.78	613,140.00	
	FORTUM OYJ	40,500	11.78	477,090.00	
	IBERDROLA SA	520,709	5.97	3,109,153.43	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,200	70.97	723,894.00	
	TERNA SPA	142,000	4.66	662,856.00	
	ENAGAS	19,700	25.39	500,281.50	
	GAS NATURAL SDG	32,800	15.66	513,812.00	
	SNAM SPA	197,000	4.87	959,390.00	
	E.ON SE	188,000	8.83	1,660,040.00	
	ENGIE	137,500	13.91	1,912,625.00	
	RWE AG	46,200	11.80	545,160.00	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	27,000	16.52	446,175.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	41,700	20.77	866,317.50	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	130,600	15.21	1,987,079.00	
	MEDIOBANCA SPA-ORD	53,000	6.09	322,770.00	
	ENEL GREEN POWER SPA	160,000	1.75	280,320.00	
	QIAGEN NV	20,100	18.54	372,754.50	
	BUREAU VERITAS SA	25,500	17.11	436,432.50	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,800	43.20	509,760.00	
小計	銘柄数：235			279,191,660.43	
				(35,524,346,873)	
	組入時価比率：12.0%			12.6%	
英ポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC PLC	33,200	3.51	116,830.80	
	PETROFAC LTD	22,700	7.30	165,710.00	
	BP PLC	1,730,000	3.37	5,837,020.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	370,800	15.67	5,810,436.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	374,120	15.64	5,853,107.40	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	12,700	27.80	353,060.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	17,850	23.51	419,653.50	
	REXAM PLC	65,555	5.97	391,691.12	

ANGLO AMERICAN PLC	129,000	3.97	513,355.50
ANTOFAGASTA PLC	34,900	4.40	153,769.40
BHP BILLITON PLC	199,300	6.93	1,381,149.00
FRESNILLO PLC	20,900	8.78	183,502.00
GLENCORE PLC	1,160,000	1.02	1,194,220.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	9,000	60.05	540,450.00
RIO TINTO PLC-REG	117,700	18.52	2,179,804.00
MONDI PLC	34,200	12.67	433,314.00
BAE SYSTEMS PLC	298,000	4.88	1,454,240.00
COBHAM PLC	113,000	2.44	275,720.00
MEGGITT PLC	70,600	3.79	268,209.40
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	171,000	6.31	1,079,865.00
SMITHS GROUP PLC	37,500	9.45	354,562.50
IMI PLC	25,900	8.03	207,977.00
WEIR GROUP PLC	18,200	9.14	166,439.00
ASHTED GROUP PLC	46,800	8.36	391,248.00
BUNZLE	31,400	18.52	581,528.00
TRAVIS PERKINS PLC	22,600	17.50	395,500.00
WOLSELEY PLC	24,200	34.97	846,274.00
AGGREKO PLC	23,033	8.41	193,822.69
BABCOCK INTL GROUP PLC	21,900	8.93	195,567.00
G4S PLC	152,000	1.97	300,656.00
ROYAL MAIL PLC	88,000	4.41	388,168.00
EASYJET PLC	14,200	15.38	218,396.00
GKN PLC	156,000	2.67	417,144.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	91,000	5.54	504,595.00
PERSIMMON PLC	29,500	19.52	575,840.00
TAYLOR WIMPEY PLC	300,000	1.73	520,200.00
BURBERRY GROUP PLC	42,300	12.12	512,676.00
CARNIVAL PLC	17,700	31.94	565,338.00
COMPASS GROUP PLC	155,800	12.15	1,892,970.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	22,900	23.06	528,074.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	69,000	4.15	286,350.00
TUI AG-DI	46,652	10.28	479,582.56
WHITBREAD PLC	17,500	37.78	661,150.00

WILLIAM HILL PLC	85,000	3.80	323,000.00
ITV PLC	365,000	2.44	893,885.00
PEARSON	79,000	7.78	615,015.00
RELX PLC	106,600	11.83	1,261,078.00
SKY PLC	96,100	10.06	966,766.00
WPP PLC	121,700	14.42	1,754,914.00
MARKS & SPENCER PLC	155,000	4.28	664,795.00
NEXT PLC	13,500	68.95	930,825.00
DIXONS CARPHONE PLC	92,000	4.30	396,152.00
KINGFISHER PLC	217,000	3.33	724,346.00
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	25,300	3.94	99,707.30
MORRISON SUPERMARKETS	213,000	1.78	379,566.00
SAINSBURY	123,800	2.49	309,004.80
TESCO PLC	767,000	1.80	1,384,818.50
COCA-COLA HBC AG-CDI	19,800	13.44	266,112.00
DIAGEO PLC	238,200	18.11	4,314,993.00
SABMILLER PLC	91,900	41.75	3,836,825.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,100	31.53	1,043,643.00
TATE & LYLE ORD.	42,500	5.47	232,475.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	176,300	38.44	6,776,972.00
IMPERIAL BRANDS PLC	90,700	36.94	3,350,458.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,600	64.10	3,884,460.00
UNILEVER PLC	121,600	30.15	3,666,240.00
SMITH & NEPHEW PLC	85,800	11.12	954,096.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	8.91	334,125.00
ASTRAZENECA PLC	119,700	41.84	5,008,248.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	460,300	14.17	6,524,752.50
SHIRE PLC	55,900	37.40	2,090,660.00
BARCLAYS PLC	1,582,000	1.61	2,554,139.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,849,000	4.48	8,287,218.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,410,000	0.60	3,275,755.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	325,000	2.50	812,500.00
STANDARD CHARTERED PLC	307,428	4.28	1,318,404.97
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	30,200	23.40	706,680.00
ADMIRAL GROUP PLC	19,800	17.00	336,600.00

	AVIVA PLC	380,000	4.29	1,631,340.00	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	128,083	3.65	468,527.61	
	LEGAL & GENERAL	560,000	2.11	1,185,520.00	
	OLD MUTUAL PLC	468,000	1.66	779,220.00	
	PRUDENTIAL PLC	242,300	11.83	2,867,620.50	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	98,750	4.00	395,098.75	
	ST JAMES S PLACE PLC	49,900	8.60	429,140.00	
	STANDARD LIFE PLC	186,000	3.41	635,376.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	74,000	3.61	267,362.00	
	SAGE GROUP PLC (THE)	100,000	5.64	564,000.00	
	ARM HOLDINGS PLC	134,000	8.98	1,203,320.00	
	BT GROUP PLC	793,000	4.56	3,616,080.00	
	INMARSAT PLC	42,500	9.71	412,887.50	
	VODAFONE GROUP PLC	2,513,000	2.11	5,302,430.00	
	SSE PLC	92,600	13.58	1,257,508.00	
	CENTRICA PLC	470,000	1.91	900,990.00	
	NATIONAL GRID PLC	354,800	9.55	3,390,114.00	
	SEVERN TRENT PLC	22,100	21.24	469,404.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	63,800	9.18	585,684.00	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	14,300	30.92	442,156.00	
	3I GROUP PLC	90,000	4.09	368,460.00	
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	83,000	2.26	187,995.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,000	11.82	295,500.00	
	ICAP PLC	54,000	4.04	218,538.00	
	INVESTEC PLC	55,000	4.51	248,545.00	
	SCHRODERS PLC	11,800	23.89	281,902.00	
	CAPITA PLC	64,000	10.99	703,360.00	
	EXPERIAN PLC	91,900	11.26	1,034,794.00	
	INTERTEK GROUP PLC	15,100	27.67	417,817.00	
小計	銘柄数：107			140,629,083.30	
				(22,970,354,466)	
	組入時価比率：7.8%			8.1%	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	35,500	8.56	304,057.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	730	452.50	330,325.00	
	GIVAUDAN-REG	864	1,824.00	1,575,936.00	

SIKA AG-BR	209	3,679.00	768,911.00
SYNGENTA AG	8,720	398.50	3,474,920.00
LAFARGEHOLCIM LTD	43,100	36.24	1,561,944.00
GEBERIT AG-REG	3,520	358.10	1,260,512.00
ABB LTD	206,200	17.19	3,544,578.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	160.00	308,800.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,310	160.60	692,186.00
SULZER AG-REG	1,300	90.05	117,065.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,250	130.00	682,500.00
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	49,000	64.70	3,170,300.00
THE SWATCH GROUP AG-B	2,950	340.50	1,004,475.00
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	66.55	306,130.00
DUFREY AG-REG	3,560	97.55	347,278.00
ARYZTA AG	8,500	44.51	378,335.00
BARRY CALLEBAUT AG	190	1,059.00	201,210.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	95	5,570.00	529,150.00
LINDT&SPRUENGLI AG-REG	10	67,200.00	672,000.00
NESTLE SA-REG	301,200	73.05	22,002,660.00
SONOVA HOLDING AG-REG	5,030	116.20	584,486.00
ACTELION LTD	9,770	133.70	1,306,249.00
GALENICA AG-REG	368	1,329.00	489,072.00
NOVARTIS-REG	215,000	72.30	15,544,500.00
ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	66,390	248.50	16,497,915.00
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	3,200	57.40	183,680.00
BALOISE HOLDING AG	4,600	118.30	544,180.00
SWISS LIFE HOLDING AG	2,980	230.60	687,188.00
SWISS RE LTD	33,200	89.15	2,959,780.00
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,110	209.30	2,953,223.00
SWISS PRIME SITE-REG	6,300	81.20	511,560.00
SWISSCOM AG-REG	2,460	479.00	1,178,340.00
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	169,600	13.26	2,248,896.00
JULIUS BAER GROUP LTD	20,700	39.69	821,583.00
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,530	345.25	528,232.50
UBS GROUP AG	346,400	14.67	5,081,688.00
LONZA AG-REG	5,020	140.50	705,310.00
	15,500	55.50	860,250.00

	ADECCO SA-REG				
	SGS SA-REG	523	1,932.00	1,010,436.00	
小計	銘柄数：40			97,929,841.00	
				(11,318,731,022)	
	組入時価比率：3.8%			4.0%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	20,100	127.90	2,570,790.00	
	BOLIDEN AB	26,000	116.90	3,039,400.00	
	ASSA ABLOY AB-B	94,400	155.70	14,698,080.00	
	SKANSKA AB-B SHS	35,500	169.00	5,999,500.00	
	ALFA LAVAL AB	27,700	132.70	3,675,790.00	
	ATLAS COPCO AB-A	62,800	185.00	11,618,000.00	
	ATLAS COPCO AB-B	36,200	172.90	6,258,980.00	
	SANDVIK AB	103,000	77.20	7,951,600.00	
	SKF AB-B SHARES	38,800	143.60	5,571,680.00	
	VOLVO AB-B SHS	146,000	82.70	12,074,200.00	
	SECURITAS AB-B SHS	29,400	118.40	3,480,960.00	
	ELECTROLUX AB-B	23,300	187.50	4,368,750.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	52.85	2,008,300.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	89,100	275.50	24,547,050.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,800	247.50	1,930,500.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,900	287.70	5,437,530.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	56,300	246.40	13,872,320.00	
	GETINGE AB-B SHS	19,100	181.10	3,459,010.00	
	NORDEA BANK AB	287,000	83.20	23,878,400.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	142,000	82.25	11,679,500.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	142,000	109.20	15,506,400.00	
	SWEDBANK AB	86,500	165.20	14,289,800.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,800	130.60	2,194,080.00	
	INVESTOR AB-B SHS	43,100	271.00	11,680,100.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	21,900	200.20	4,384,380.00	
	ERICSSON LM-B	287,000	76.35	21,912,450.00	
	HEXAGON AB-B SHS	24,400	276.40	6,744,160.00	
	TELIA AB	241,000	38.90	9,374,900.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR- SDR	6,100	364.40	2,222,840.00	

	TELE 2 AB-B SHS	28,400	69.00	1,959,600.00	
小計	銘柄数：30			258,389,050.00	
	組入時価比率：1.2%			(3,470,164,941)	1.2%
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	105,500	117.00	12,343,500.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,800	319.00	5,359,200.00	
	NORSK HYDRO	130,000	28.71	3,732,300.00	
	SCHIBSTED ASA	6,400	235.30	1,505,920.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,100	222.00	2,020,200.00	
	ORKLA ASA	74,800	69.90	5,228,520.00	
	DNB ASA	91,600	96.15	8,807,340.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,700	132.20	2,604,340.00	
	TELENOR ASA	71,900	119.80	8,613,620.00	
	小計	銘柄数：9			50,214,940.00
	組入時価比率：0.2%			(665,347,955)	0.2%
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,300	399.60	3,716,280.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,500	284.50	6,401,250.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	20,700	429.00	8,880,300.00	
	ISS A/S	14,100	232.80	3,282,480.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	375	8,050.00	3,018,750.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	660	8,225.00	5,428,500.00	
	DSV A/S	18,200	264.90	4,821,180.00	
	PANDORA A/S	10,420	816.50	8,507,930.00	
	CARLSBERG B	10,000	604.50	6,045,000.00	
	COLOPLAST-B	10,500	510.00	5,355,000.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,100	566.00	1,188,600.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	185,300	331.50	61,426,950.00	
	DANSKE BANK AS	67,000	187.00	12,529,000.00	
	TRYG A/S	11,800	120.80	1,425,440.00	
	TDC A/S	76,800	29.26	2,247,168.00	
小計	銘柄数：15			134,273,828.00	
	組入時価比率：0.8%			(2,289,368,767)	0.8%

豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	25,500	35.40	902,700.00	
	OIL SEARCH LTD	130,000	7.33	952,900.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	160,000	3.96	633,600.00	
	SANTOS LTD.	147,000	3.41	501,270.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	71,100	29.54	2,100,294.00	
	INCITEC PIVOT LTD	161,000	2.86	460,460.00	
	ORICA LTD	32,600	13.37	435,862.00	
	BORAL LTD	67,000	5.80	388,600.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	44,000	16.50	726,000.00	
	AMCOR	113,000	13.58	1,534,540.00	
	ALUMINA LTD	233,000	1.21	281,930.00	
	BHP BILLITON LIMITED	304,400	16.59	5,049,996.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,000	1.87	266,250.00	
	ILUKA RESOURCES LTD	37,800	6.73	254,394.00	
	NEWCREST MINING	72,000	15.30	1,101,600.00	
	RIO TINTO LTD	39,300	43.20	1,697,760.00	
	SOUTH32 LTD	500,000	1.21	607,500.00	
	CIMIC GROUP LTD	8,938	27.96	249,906.48	
	BRAMBLES LTD	149,000	10.82	1,612,180.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	44,133	3.92	173,001.36	
	ASCIANO LTD	61,000	8.90	542,900.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	193,000	3.67	708,310.00	
	SYDNEY AIRPORT	107,900	6.47	698,113.00	
	TRANSURBAN GROUP	189,004	10.91	2,062,033.64	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,000	9.66	502,320.00	
	CROWN RESORTS LTD	36,000	11.68	420,480.00	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	39.19	203,788.00	
	TABCORP HOLDINGS	78,000	4.21	328,380.00	
	TATTS GROUP LTD	131,000	3.96	518,760.00	
	REA GROUP LTD	5,400	51.08	275,832.00	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	4.43	234,790.00	
	WESFARMERS LIMITED	106,100	43.13	4,576,093.00	
WOOLWORTHS LIMITED	120,000	22.83	2,739,600.00		
COCA-COLA AMATIL LTD	52,000	8.45	439,400.00		
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	8.72	627,840.00		



	COCHLEAR LTD	5,200	106.67	554,684.00	
	HEALTHSCOPE LTD	176,000	2.17	381,920.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	13,100	58.61	767,791.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,300	18.13	676,249.00	
	CSL LIMITED	43,600	106.00	4,621,600.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	272,600	23.27	6,343,402.00	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,115	11.04	387,669.60	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	44,300	8.80	389,840.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	160,700	72.60	11,666,820.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	249,000	24.98	6,220,020.00	
	WESTPAC BANKING CORP	314,500	28.97	9,111,065.00	
	ASX LTD	18,200	41.00	746,200.00	
	CHALLENGER LIMITED	56,000	7.18	402,080.00	
	AMP LIMITED	285,000	5.21	1,484,850.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	232,000	5.25	1,218,000.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	261,000	2.51	655,110.00	
	QBE INSURANCE	127,000	10.01	1,271,270.00	
	SUNCORP GROUP LTD	120,000	11.46	1,375,200.00	
	COMPUTERSHARE LTD	47,000	9.26	435,220.00	
	TELSTRA CORP LTD	404,000	5.42	2,189,680.00	
	TPG TELECOM LTD	27,000	9.96	268,920.00	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	43,000	7.99	343,570.00	
	AUSNET SERVICES	163,400	1.47	241,015.00	
	APA GROUP	107,000	8.75	936,250.00	
	AGL ENERGY LTD	64,500	18.45	1,190,025.00	
	DUET GROUP	229,000	2.31	528,990.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,900	63.24	1,764,396.00	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	25,000	6.14	153,500.00	
	SEEK LTD	28,800	12.83	369,504.00	
小計	銘柄数：64			91,504,224.08	
				(7,436,548,290)	
	組入時価比率：2.5%			2.6%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	69,000	6.85	472,650.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	88,110	5.80	511,038.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,000	8.03	281,050.00	

	SPARK NEW ZEALAND LTD	170,000	3.25	552,500.00	
	CONTACT ENERGY LTD	76,000	4.45	338,200.00	
	MIGHTY RIVER POWER	60,000	2.73	163,800.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	120,000	2.29	275,400.00	
小計	銘柄数：7			2,594,638.00	
				(195,090,831)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	253,540	94.90	24,060,946.00	
	NWS HOLDINGS LTD	135,500	11.00	1,490,500.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	11.90	1,273,300.00	
	MTR CORP	139,500	36.00	5,022,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	128,000	27.25	3,488,000.00	
	LI & FUNG LTD	563,600	4.49	2,530,564.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	75,000	26.70	2,002,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	223,000	24.65	5,496,950.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	78,000	9.25	721,500.00	
	SANDS CHINA LTD	234,800	25.60	6,010,880.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	108,333	7.07	765,914.31	
	SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	5.30	879,800.00	
	WYNN MACAU LTD	132,400	8.51	1,126,724.00	
	WH GROUP LIMITED	590,000	4.24	2,501,600.00	
	BANK OF EAST ASIA	107,860	22.25	2,399,885.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	345,500	19.74	6,820,170.00	
	HANG SENG BANK	73,000	126.10	9,205,300.00	
	FIRST PACIFIC CO	226,000	5.49	1,240,740.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	107,000	169.00	18,083,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,141,400	38.55	44,000,970.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	255,540	40.70	10,400,478.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	13.60	2,896,800.00	
	HENDERSON LAND	111,017	40.95	4,546,146.15	
	HYSAN DEVELOPMENT	65,000	30.15	1,959,750.00	
	KERRY PROPERTIES	57,000	18.34	1,045,380.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	516,666	6.14	3,172,329.24	
	SINO LAND CO.LTD	286,000	10.38	2,968,680.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	164,000	84.10	13,792,400.00	

	SWIRE PACIFIC-A	53,500	74.80	4,001,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	19.50	2,277,600.00	
	WHARF(HOLDING)	133,000	37.55	4,994,150.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	87,000	29.05	2,527,350.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	61.00	1,335,900.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	259,600	10.48	2,720,608.00	
	PCCW LTD	386,000	4.67	1,802,620.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	60,000	75.00	4,500,000.00	
	CLP HLDGS	180,500	66.70	12,039,350.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	130,000	72.40	9,412,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	662,554	13.90	9,209,500.60	
小計	銘柄数：39			234,724,085.30	
				(3,443,402,331)	
	組入時価比率：1.2%				1.2%
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	141,000	2.74	386,340.00	
	KEPPEL CORP.	142,700	5.20	742,040.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	99,040	2.51	248,590.40	
	SEMBCORP MARINE	72,600	1.57	113,982.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	0.95	155,665.00	
	NOBLE GROUP LTD	412,481	0.33	138,181.13	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	49,040	11.21	549,738.40	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	207,000	3.01	623,070.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	614,600	0.69	424,074.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	151,000	3.76	567,760.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	11,800	40.32	475,776.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	615,320	0.37	230,745.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	184,000	3.10	570,400.00	
	DBS GROUP HLDGS	166,000	13.68	2,270,880.00	
	OCBC-ORD	289,500	7.77	2,249,415.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	121,500	17.81	2,163,915.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	7.18	552,860.00	
	CAPITALAND LIMITED	246,000	2.90	713,400.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	6.93	256,410.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	294,000	1.65	485,100.00	
	UOL GROUP LIMITED	48,700	5.63	274,181.00	

		SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	751,000	3.80	2,853,800.00	
		STARHUB LTD	53,000	3.80	201,400.00	
	小計	銘柄数：23			17,247,722.93	(1,401,205,010)
		組入時価比率：0.5%				0.5%
	新スケジュール	DELEK GROUP LTD	470	642.00	301,740.00	
		ISRAEL CHEMICALS LIMITED	44,000	15.34	674,960.00	
		TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	86,100	220.90	19,019,490.00	
		BANK HAPOALIM BM	102,000	18.20	1,856,400.00	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	138,000	12.43	1,715,340.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,000	42.99	558,870.00	
		AZRIELI GROUP	3,100	142.50	441,750.00	
		NICE SYSTEMS LTD	5,300	225.80	1,196,740.00	
		BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	186,000	8.46	1,574,862.00	
	小計	銘柄数：9			27,340,152.00	(800,793,052)
		組入時価比率：0.3%				0.3%
	合計				282,595,761,993	(282,595,761,993)

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額/口数	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST		218,870.00	
	小計	銘柄数：1		218,870.00	
		組入時価比率：0.0%			0.3%
	合計			25,014,652	(25,014,652)
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	34,100	605,275.00	
		AMERICAN TOWER CORP	39,900	3,449,355.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	91,000	894,530.00	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,660	2,093,584.20	
	BOSTON PROPERTIES	14,300	1,577,147.00	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17,300	401,706.00	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,300	610,714.00	
	CROWN CASTLE INTL CORP	31,600	2,654,400.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	12,600	1,013,040.00	
	DUKE REALTY CORP	31,600	625,048.00	
	EQUINIX INC	6,320	1,841,016.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	34,400	2,482,992.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,300	1,251,369.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	11,000	912,780.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,520	970,893.20	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	54,400	1,396,992.00	
	HCP INC	44,000	1,184,480.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	70,800	1,050,672.00	
	IRON MOUNTAIN INC	19,000	543,970.00	
	KIMCO REALTY CORP	38,700	1,026,324.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	13,300	381,045.00	
	MACERICH CO /THE	12,600	951,300.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	17,000	645,490.00	
	PROLOGIS INC	49,400	1,835,704.00	
	PUBLIC STORAGE	13,790	3,284,502.20	
	REALTY INCOME CORP	22,300	1,333,986.00	
	REGENCY CENTERS CORP	8,800	621,896.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	29,310	5,461,918.50	
	SL GREEN REALTY CORP	9,300	769,389.00	
	UDR INC	24,100	816,026.00	
	VENTAS INC	30,900	1,536,348.00	
	VEREIT INC	88,000	659,120.00	
	VORNADO REALTY TRUST	16,000	1,318,720.00	
	WELLTOWER INC	32,800	1,835,488.00	
	WEYERHAEUSER CO	48,800	1,159,976.00	
小計	銘柄数：35	1,001,200	49,197,196.10	
			(5,622,747,542)	
	組入時価比率：1.9%		73.5%	

カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	255,544.00		
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,400	358,128.00		
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	206,862.00		
	小計	銘柄数 : 3	34,900	820,534.00	(67,620,206)
	組入時価比率 : 0.0%			0.9%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	3,100	224,657.00		
	GECINA SA	3,400	372,810.00		
	ICADE	3,000	183,390.00		
	KLEPIERRE	21,200	789,594.00		
	UNIBAIL RODAMCO-NA	9,390	2,067,208.50		
	小計	銘柄数 : 5	40,090	3,637,659.50	(462,855,794)
	組入時価比率 : 0.2%				6.1%
英ポンド	BRITISH LAND	94,000	635,440.00		
	HAMMERSON PLC	73,000	404,055.00		
	INTU PROPERTIES PLC	88,000	249,040.00		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	73,800	750,546.00		
	SEGRO PLC	70,000	293,160.00		
	小計	銘柄数 : 5	398,800	2,332,241.00	(380,948,244)
	組入時価比率 : 0.1%			5.0%	
豪ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	92,000	694,600.00		
	GOODMAN GROUP	163,000	1,051,350.00		
	GPT GROUP	165,000	826,650.00		
	LENDLEASE GROUP	53,000	650,310.00		
	MIRVAC GROUP	350,000	649,250.00		
	SCENTRE GROUP	496,000	2,251,840.00		
	STOCKLAND TRUST GROUP	230,000	933,800.00		
	VICINITY CENTRES	306,704	929,313.12		
	WESTFIELD CORP	187,000	1,832,600.00		
	小計	銘柄数 : 9	2,042,704	9,819,713.12	(798,048,085)
	組入時価比率 : 0.3%			10.4%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,677,000.00		

	小計	LINK REIT	210,000	9,030,000.00	
		銘柄数：2	470,000	10,707,000.00	(157,071,690)
		組入時価比率：0.1%			2.1%
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	213,000	506,940.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	192,000	264,960.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	219,900	461,790.00	
		SUNTEC REIT	243,000	392,445.00	
		小計	銘柄数：4	867,900	1,626,135.00
		組入時価比率：0.0%			1.7%
	合計			7,621,398,768	(7,621,398,768)
合計			7,646,413,420	(7,646,413,420)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年 2月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	5,729,538,686	-	5,640,283,031	89,255,655
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	42,688,600	-	42,524,000	164,600
米ドル	34,368,600	-	34,284,000	84,600
カナダドル	8,320,000	-	8,240,000	80,000
合計	-	-	-	89,091,055

(注)時価の算定方法

### 1 先物取引

外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（平成28年 2月17日現在）

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

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）



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

## (貸借対照表に関する注記)

平成28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2,2387円
(10,000口当たり純資産額)	(22,387円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

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

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

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

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在	
期首	平成27年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	202,645,501,722円
同期中における追加設定元本額	110,486,426,186円
同期中における一部解約元本額	29,086,625,709円
期末元本額	284,045,302,199円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	82,177,177円
バランスセレクト50	85,952,090円
バランスセレクト70	64,533,575円
野村外国債券インデックスファンド	282,689,441円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,589,877,995円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	29,598,435,768円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,439,690,199円
野村資産設計ファンド2015	44,789,624円
野村資産設計ファンド2020	51,762,498円
野村資産設計ファンド2025	43,372,729円
野村資産設計ファンド2030	37,239,090円
野村資産設計ファンド2035	24,168,464円

野村資産設計ファンド2040	68,992,687円
野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け）	174,126,989,729円
のむらップ・ファンド（保守型）	3,321,571,166円
のむらップ・ファンド（普通型）	5,458,235,034円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,311,682,202円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	2,323,951,101円
野村資産設計ファンド2045	5,225,503円
野村インデックスファンド・外国債券	537,772,480円
マイ・ロード	7,506,929,580円
ネクストコア	541,686,561円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	75,579,184円
野村外国債券インデックス（野村SMA・EW向け）	1,982,471,670円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	741,430,370円
野村資産設計ファンド2050	1,116,992円
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	43,588,415円
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	2,796,766,749円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	637,179,373円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	9,723,472,747円
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,671,807,984円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	7,662,479円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	36,140,409円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	4,378,940円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	6,811,997,808円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	510,345,700円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	1,855,423,699円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	202,558,692円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	100,357,066円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	228,759,372円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	2,061,299,103円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,086,098,829円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,137,169,359円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	118,503,718円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	4,486,822円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	6,893,621円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	4,731,916円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	518,164,100円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,738,915,112円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	2,342,752,600円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	2,161,942,945円
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	12,074,223,183円
マイバランスDC30	926,349,445円
マイバランスDC50	531,496,969円
マイバランスDC70	329,778,737円
野村DC外国債券インデックスファンド	2,352,994,360円
野村DC運用戦略ファンド	653,115,361円
野村DC運用戦略ファンドM	5,427,640円
野村DC運用戦略ファンドA	3,771,964円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	8,243,251円

マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	58,791円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	122,031円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	4,000,000.00	4,404,843.60	
		US TREASURY BOND	10,500,000.00	12,987,187.50	
		US TREASURY BOND	9,300,000.00	11,581,406.25	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	16,907,866.87	
		US TREASURY BOND	18,500,000.00	25,307,420.95	
		US TREASURY BOND	19,400,000.00	25,856,562.50	
		US TREASURY BOND	31,200,000.00	32,896,500.00	
		US TREASURY BOND	34,500,000.00	47,801,364.60	
		US TREASURY BOND	8,800,000.00	12,799,187.28	
		US TREASURY BOND	17,700,000.00	25,575,115.86	
		US TREASURY BOND	3,500,000.00	4,875,117.10	
		US TREASURY BOND	7,000,000.00	9,588,359.20	
		US TREASURY BOND	2,800,000.00	3,845,406.04	
		US TREASURY BOND	2,200,000.00	2,981,859.32	
		US TREASURY BOND	21,700,000.00	22,913,843.75	
		US TREASURY BOND	16,600,000.00	20,687,750.00	
		US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,505,644.00	
		US TREASURY N/B	12,500,000.00	12,811,035.00	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,030,078.00	
		US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,111,370.65	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,924,238.10			
US TREASURY N/B	11,500,000.00	11,549,862.85			

US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,030,078.00	
US TREASURY N/B	18,300,000.00	18,844,710.48	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	25,137,187.20	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,219,968.48	
US TREASURY N/B	24,600,000.00	25,242,866.88	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,495,682.85	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,012,695.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,219,726.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,007,500.00	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	16,941,589.21	
US TREASURY N/B	22,300,000.00	22,833,980.19	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,390,039.02	
US TREASURY N/B	29,800,000.00	31,607,787.20	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	22,283,250.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,984,765.00	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	21,484,908.31	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,986,562.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,002,460.90	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,851,209.55	
US TREASURY N/B	49,600,000.00	52,597,308.16	
US TREASURY N/B	18,600,000.00	19,096,240.56	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,638,163.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,002,343.60	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	17,523,846.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,009,687.20	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	42,078,911.07	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,383,722.39	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,000,703.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,319,062.40	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,088,791.98	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,178,320.00	
US TREASURY N/B	13,500,000.00	13,564,335.60	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	30,395,316.04	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,618,535.05	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,903,687.50	

US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,446,750.00	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	5,184,374.88	
US TREASURY N/B	20,600,000.00	20,950,842.72	
US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,692,576.52	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,167,617.10	
US TREASURY N/B	30,600,000.00	33,013,333.26	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,050,781.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,588,866.70	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,594,101.15	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,152,194.93	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,034,375.00	
US TREASURY N/B	27,500,000.00	28,986,718.75	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,559,589.45	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,068,437.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,067,812.40	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	26,027,929.05	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	9,698,163.35	
US TREASURY N/B	26,400,000.00	28,221,185.52	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,778,875.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,001,015.60	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	8,064,788.47	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,800,194.95	
US TREASURY N/B	37,000,000.00	40,318,437.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,997,421.80	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,982,187.28	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,994,960.90	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,916,819.66	
US TREASURY N/B	47,500,000.00	51,526,366.00	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,774,561.84	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,828,406.16	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,015,937.20	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,875,406.06	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,021,093.60	
US TREASURY N/B	51,100,000.00	56,106,200.57	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,713,500.00	

US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,999,374.80	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,134,530.20	
US TREASURY N/B	40,100,000.00	43,972,156.25	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,935,000.00	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,389,296.60	
US TREASURY N/B	31,500,000.00	33,468,750.00	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,284,921.70	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,213,750.00	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,638,249.92	
US TREASURY N/B	41,300,000.00	43,939,326.06	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	7,162,843.24	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,521,109.11	
US TREASURY N/B	33,300,000.00	37,082,670.21	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,178,125.00	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,762,109.10	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,039,109.23	
US TREASURY N/B	36,400,000.00	39,732,875.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,210,937.20	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	9,062,952.69	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	10,168,327.64	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,909,686.16	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,549,796.51	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,651,249.60	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,371,250.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,215,000.00	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,900,843.44	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,023,828.00	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	34,857,119.83	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,432,882.63	
US TREASURY N/B	5,900,000.00	6,007,859.08	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,086,328.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,173,437.00	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,940,226.32	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	28,063,125.00	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,697,284.00	

US TREASURY N/B	12,800,000.00	12,910,999.04	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,563,125.00	
US TREASURY N/B	28,600,000.00	29,020,062.50	
US TREASURY N/B	16,300,000.00	17,400,250.00	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	18,241,124.16	
US TREASURY N/B	27,300,000.00	29,614,100.88	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	32,373,622.72	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	23,984,687.50	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	5,487,750.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	715,937.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,751,406.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,469,062.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	689,375.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,790,859.30	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	6,641,406.00	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	7,561,210.80	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	10,404,022.86	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	11,185,000.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,813,124.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,065,000.00	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	10,366,077.54	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,987,577.60	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,492,655.90	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	7,254,101.40	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,905,234.20	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,897,616.85	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	9,624,772.74	
US TREASURY N/B	9,600,000.00	9,912,749.76	
US TREASURY N/B	18,200,000.00	20,182,092.84	
US TREASURY N/B	15,700,000.00	19,134,375.00	
US TREASURY N/B	23,200,000.00	28,236,935.76	
US TREASURY N/B	15,900,000.00	18,437,787.87	
US TREASURY N/B	18,600,000.00	20,541,375.00	
US TREASURY N/B	32,000,000.00	34,450,000.00	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	8,933,343.52	



小計	US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,909,921.60	
	US TREASURY NOTE	26,400,000.00	27,458,061.84	
	US TREASURY NOTE	25,100,000.00	26,204,987.34	
	銘柄数：165 組入時価比率：42.8%	2,198,500,000.00	2,380,527,904.85 (272,070,534,245) 43.1%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	4,600,000.00	5,147,906.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	7,472,594.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,233,984.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,762,972.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,600,000.00	6,675,900.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,300,000.00	4,368,585.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,600,000.00	8,733,300.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,251,808.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,019,088.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	7,651,575.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,948,162.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	5,089,624.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,178,480.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,741,876.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,446,050.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,019,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	8,738,961.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,052,178.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,351,624.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,916,510.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	3,721,014.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,180,000.00	7,775,387.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	4,764,690.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	10,726,310.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	8,977,536.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	9,154,568.00	
CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,125,818.00		
小計	銘柄数：27	133,280,000.00	154,045,900.20 (12,694,922,635)	

	組入時価比率：2.0%		2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,400,000.00	6,519,379.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	60,800,000.00	65,158,083.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	108,800,000.00	109,699,232.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	89,500,000.00	98,775,869.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	29,000,000.00	28,992,460.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	60,700,000.00	67,529,539.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	61,800,000.00	65,449,475.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	27,400,000.00	28,851,241.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,700,000.00	39,536,503.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	75,672,674.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	34,600,000.00	41,332,398.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	41,000,000.00	45,865,388.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,178,250.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	62,631,576.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	36,501,729.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,200,000.00	53,537,186.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	94,668,223.00	
	小計	銘柄数：17	836,600,000.00	931,899,208.00 (5,647,309,200)
		組入時価比率：0.9%		0.9%
	ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,791,060.50
BELGIUM KINGDOM		4,000,000.00	4,157,304.00	
BELGIUM KINGDOM		3,100,000.00	3,469,210.00	
BELGIUM KINGDOM		7,000,000.00	8,283,205.00	
BELGIUM KINGDOM		7,200,000.00	8,937,360.00	
BELGIUM KINGDOM		5,000,000.00	6,215,085.00	
BELGIUM KINGDOM		6,400,000.00	8,145,920.00	
BELGIUM KINGDOM		3,000,000.00	3,439,398.00	
BELGIUM KINGDOM		7,300,000.00	8,581,150.00	
BELGIUM KINGDOM		6,400,000.00	8,795,564.80	
BELGIUM KINGDOM		3,500,000.00	4,905,481.00	
BELGIUM KINGDOM		6,800,000.00	10,605,715.20	
BELGIUM KINGDOM		2,800,000.00	4,149,748.40	
BELGIUM KINGDOM GOVT		2,000,000.00	2,191,680.00	
			2,500,000.00	2,733,000.00

BELGIUM KINGDOM GOVT			
BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,907,876.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	7,600,000.00	11,596,619.60	
BELGIUM KINGDOM GOVT	9,500,000.00	15,300,548.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	16,500,000.00	16,909,414.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,600,000.00	18,726,480.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,700,000.00	22,462,874.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,301,950.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	16,100,000.00	17,635,698.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,100,000.00	18,725,885.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,900,000.00	8,504,373.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	10,408,425.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,800,000.00	23,706,800.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,000,000.00	21,652,761.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,600,000.00	13,804,348.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,500,000.00	9,277,230.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	11,771,252.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,800,000.00	16,330,841.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	5,720,299.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	8,871,506.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,300,000.00	9,757,480.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,200,000.00	14,034,160.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,397,520.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,800,000.00	6,433,920.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	6,388,945.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,400,000.00	5,846,332.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,900,000.00	5,555,179.50	
BUNDESobligation	1,700,000.00	1,743,690.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,239,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,700,000.00	9,952,365.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,048,950.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000.00	3,474,790.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	8,322,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,344,350.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	3,995,425.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,000,000.00	15,857,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,600,000.00	10,799,040.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,552,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,796,960.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,200,000.00	4,692,660.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	6,246,450.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,100,000.00	16,630,020.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,507,405.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,683,975.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,157,710.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,900,000.00	31,969,350.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,678,300.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,189,080.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	6,218,275.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	9,014,505.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,600,000.00	11,175,476.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,400,000.00	15,086,642.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	9,249,098.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,900,000.00	9,043,734.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	8,517,899.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	6,536,374.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	9,802,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,000,000.00	13,496,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	19,344,381.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	4,563,045.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,500,000.00	19,624,245.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,300,000.00	11,083,315.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	20,014,722.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	10,637,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	19,882,584.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,900,000.00	10,668,467.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	18,592,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,738,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,000,000.00	19,028,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,903,700.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	17,400,000.00	18,638,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	520,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	25,900,000.00	29,448,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	9,864,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,800,000.00	15,910,020.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,600,000.00	14,556,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000.00	12,676,334.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	8,087,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	9,041,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,400,000.00	12,624,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,700,000.00	15,735,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	12,307,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,900,000.00	17,857,330.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000.00	5,654,398.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	9,012,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	16,420,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	14,471,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,719,290.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	19,225,470.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	6,944,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,300,000.00	12,738,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	23,984,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	9,575,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	16,737,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,700,000.00	18,981,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	9,543,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	11,712,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,356,370.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	11,388,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,400,000.00	17,580,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,807,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	662,100.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,137,626.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,559,485.50	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,507,252.50	

FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,299,200.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,372,770.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,524,572.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,403,500.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,164,880.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,279,485.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	668,742.20	
FINNISH GOVERNMENT	1,400,000.00	1,838,592.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,336,984.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,500,000.00	8,740,006.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,500,000.00	4,140,080.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,700,000.00	10,466,785.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,576,942.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	4,640,310.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	12,138,681.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	6,842,715.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	13,171,479.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,294,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	12,403,335.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,107,038.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,300,000.00	19,443,470.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	14,144,660.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	17,899,087.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,487,680.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,700,000.00	19,042,325.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	13,094,112.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,500,000.00	29,299,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,877,240.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	30,006,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,500,000.00	26,151,850.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,674,560.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	31,311,599.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,600,000.00	27,965,057.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,400,000.00	11,637,476.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,800,000.00	14,496,708.80	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,400,000.00	11,947,729.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,100,000.00	12,423,684.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	7,607,025.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,800,000.00	6,238,095.20	
FRENCH TREASURY NOTE	1,000,000.00	1,020,320.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	3,600,000.00	4,130,452.80	
IRISH GOVERNMENT	7,500,000.00	8,222,070.00	
IRISH GOVERNMENT	5,600,000.00	6,289,348.80	
IRISH GOVERNMENT	3,400,000.00	4,134,250.40	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,285,916.60	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,301,398.50	
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	8,339,124.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	1,500,000.00	1,695,883.50	
IRISH TSY 2% 2045	1,500,000.00	1,520,550.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	1,300,000.00	1,573,089.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,279,600.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,646,637.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	7,197,950.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,620,377.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	8,161,095.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,045,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,774,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,992,373.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,720,689.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,417,480.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,524,820.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,568,879.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,466,464.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,300,000.00	9,838,080.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	4,631,704.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	7,857,130.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,200,000.00	8,398,686.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	4,976,436.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,036,562.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,612,800.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,294,762.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,395,910.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,034,920.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000.00	1,828,180.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,400,000.00	2,446,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,600,000.00	5,436,280.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,200,000.00	6,244,160.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	4,040,850.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	6,106,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,780,990.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,314,400.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,616,700.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,800,000.00	6,088,025.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,600,000.00	8,569,019.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,500,000.00	6,340,950.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,400,000.00	4,209,978.60	
	SPANISH GOVERNMENT	18,400,000.00	19,847,951.20	
	SPANISH GOVERNMENT	9,800,000.00	14,043,331.40	
	SPANISH GOVERNMENT	7,300,000.00	10,624,420.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	6,432,764.00	
小計	銘柄数：209	1,612,300,000.00	2,011,660,486.10 (255,963,680,251)	
	組入時価比率：40.3%		40.6%	
英債券	UK TREASURY	5,900,000.00	5,959,590.00	
	UK TREASURY	6,000,000.00	6,581,400.00	
	UK TREASURY	18,000,000.00	18,349,200.00	
	UK TREASURY	4,600,000.00	5,166,260.00	
	UK TREASURY	13,900,000.00	14,433,760.00	
	UK TREASURY	3,000,000.00	3,338,700.00	
	UK TREASURY	6,400,000.00	7,456,000.00	
	UK TREASURY	13,300,000.00	14,008,890.00	
	UK TREASURY	7,200,000.00	8,184,240.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	6,998,730.00	
	UK TREASURY	7,300,000.00	8,435,880.00	
	UK TREASURY	4,650,000.00	5,496,300.00	



	UK TREASURY	8,300,000.00	8,662,710.00	
	UK TREASURY	7,200,000.00	7,741,440.00	
	UK TREASURY	8,600,000.00	9,583,840.00	
	UK TREASURY	12,100,000.00	15,904,240.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	8,614,860.00	
	UK TREASURY	3,750,000.00	5,658,750.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	9,243,990.00	
	UK TREASURY	7,250,000.00	9,579,425.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	9,216,520.00	
	UK TREASURY	6,900,000.00	9,282,570.00	
	UK TREASURY	4,900,000.00	7,133,910.00	
	UK TREASURY	4,200,000.00	5,742,240.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,871,700.00	
	UK TREASURY	6,100,000.00	8,843,780.00	
	UK TREASURY	14,000,000.00	17,554,600.00	
	UK TREASURY	5,950,000.00	8,584,660.00	
	UK TREASURY	4,250,000.00	6,295,950.00	
	UK TREASURY	7,250,000.00	10,057,925.00	
	UK TREASURY	5,000,000.00	7,123,000.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	18,000,000.00	21,537,000.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,400,000.00	9,992,320.00	
小計	銘柄数：33	251,300,000.00	308,634,380.00	
			(50,412,339,629)	
	組入時価比率：7.9%		8.0%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	8,800,000.00	10,094,480.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,600,000.00	5,466,600.00	
小計	銘柄数：2	12,400,000.00	15,561,080.00	
			(1,798,549,626)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	7,000,000.00	7,457,625.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,200,000.00	18,554,281.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	49,400,000.00	61,579,718.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	48,700,000.00	58,883,170.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,900,000.00	19,500,832.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	31,300,000.00	36,827,580.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,300,000.00	22,213,493.30	

小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.5%	186,800,000.00	225,016,700.50 (3,021,974,287) 0.5%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	21,900,000.00	22,898,640.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	24,100,000.00	27,134,190.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	31,644,504.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	15,173,730.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	31,600,000.00	35,884,960.00
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.3%	119,500,000.00	132,736,024.00 (1,758,752,318) 0.3%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	25,100,000.00	29,116,000.00
	KINGDOM OF DENMARK	52,100,000.00	60,831,960.00
	KINGDOM OF DENMARK	31,100,000.00	34,001,630.00
	KINGDOM OF DENMARK	14,500,000.00	22,902,750.00
	KINGDOM OF DENMARK	18,600,000.00	20,601,360.00
	KINGDOM OF DENMARK	39,300,000.00	67,393,565.70
小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.6%	180,700,000.00	234,847,265.70 (4,004,145,880) 0.6%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,550,740.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	9,031,250.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,100,000.00	8,503,380.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,500,000.00	9,690,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	6,086,143.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	12,504,150.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,200,000.00	5,097,040.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	16,800,000.00	19,168,800.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,730,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	11,265,054.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,600,000.00	10,466,400.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,100,000.00	13,514,523.30
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,662,000.00
小計	銘柄数：13 組入時価比率：0.6%	111,100,000.00	121,269,480.30 (3,501,049,896) 0.6%

豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,300,000.00	6,536,124.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,900,000.00	6,091,891.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,329,393.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,871,785.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	11,449,016.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,987,078.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	13,994,650.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	888,346.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	11,099,266.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	9,528,585.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	8,827,320.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,395,160.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	13,508,139.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	8,881,950.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,800,000.00	5,799,643.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,800,000.00	5,056,492.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,351,388.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,712,149.20	
	小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	4,936,698.00
銘柄数：19 組入時価比率：1.8%		124,300,000.00	137,245,079.50 (11,153,907,610) 1.8%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	304,890.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,185,360.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,357,300.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,200,000.00	3,321,280.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,000,000.00	4,278,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,580,000.00	2,632,322.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,281,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,291,300.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,592,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,654,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,479,848.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	550,835.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,800,000.00	1,802,034.00	

小計	銘柄数：13  組入時価比率：0.4%	26,380,000.00	27,731,769.40  (2,252,928,946)  0.4%
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,327,600.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,923,200.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,300,000.00	4,391,332.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,372,200.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,707,400.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,027,126.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	12,298,650.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	10,005,000.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,438,611.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,143,634.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,852,250.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,503,400.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,276,070.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,885,637.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,023,581.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,740,000.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,718,037.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,967,343.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,581,475.00
	小計	銘柄数：22  組入時価比率：0.5%	105,700,000.00
ランド		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,300,000.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,800,000.00	23,564,820.30
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,800,000.00	22,739,676.68
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	23,944,609.80
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,200,000.00	23,580,295.20
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	61,900,000.00	67,594,670.01
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,300,000.00	21,410,839.35
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	23,538,000.00

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	28,000,000.00	24,737,652.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	47,100,000.00	32,784,652.08	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,700,000.00	14,711,030.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,600,000.00	17,022,132.36	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,300,000.00	10,913,846.58	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	40,300,000.00	35,692,738.77	
	小計	銘柄数：14	394,400,000.00	352,572,990.50	
				(2,552,628,451)	
		組入時価比率：0.4%			0.4%
	合計			629,732,479,193	
				(629,732,479,193)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年 2月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	569,985,614	-	568,607,800	1,377,814
米ドル	284,186,952	-	284,557,200	370,248
ユーロ	249,383,523	-	248,118,000	1,265,523
英ポンド	36,415,139	-	35,932,600	482,539
合計	569,985,614	-	568,607,800	1,377,814

(注)時価の算定方法

### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)	
(平成28年 2月17日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	84,477,396
コール・ローン	39,702,634
国債証券	6,139,403,079
派生商品評価勘定	191,204
未収入金	9,657,685
未収利息	99,832,676
前払費用	5,076,628
流動資産合計	6,378,341,302
<b>資産合計</b>	<b>6,378,341,302</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	83,573,420
未払解約金	4,132,874
その他未払費用	140,900
流動負債合計	87,847,194
<b>負債合計</b>	<b>87,847,194</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	3,866,356,460
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,424,137,648
元本等合計	6,290,494,108
<b>純資産合計</b>	<b>6,290,494,108</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>6,378,341,302</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	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.6270円
(10,000口当たり純資産額)	(16,270円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

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

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在	
期首	平成27年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	3,732,589,536円
同期中における追加設定元本額	806,308,856円
同期中における一部解約元本額	672,541,932円
期末元本額	3,866,356,460円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	1,185,961,557円
ネクストコア	78,678,870円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	153,560,830円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	91,173,873円
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,591,778円
野村新興国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	2,256,373,778円
野村DC運用戦略ファンド	95,141,710円
野村DC運用戦略ファンドM	605,341円
野村DC運用戦略ファンドA	1,268,723円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	BOLIVARIAN REP OF VZLA	400,000.00	121,920.00	
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	500,000.00	172,725.00	
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	350,000.00	103,250.00	



BOLIVARIAN REP OF VZLA	400,000.00	115,400.00	
BOLIVARIAN REP OF VZLA	300,000.00	87,000.00	
BRAZIL GLOBAL	150,000.00	171,750.00	
BRAZIL GLOBAL	250,000.00	274,375.00	
BRAZIL GLOBAL	150,000.00	166,875.00	
BRAZIL GLOBAL	300,000.00	369,000.00	
BRAZIL GLOBAL	600,000.00	591,000.00	
BRAZIL GLOBAL	1,000,000.00	880,000.00	
COLOMBIA GLOBAL	350,000.00	389,375.00	
COLOMBIA GLOBAL	150,000.00	192,000.00	
COLOMBIA GLOBAL	300,000.00	351,450.00	
COLOMBIA GLOBAL	300,000.00	313,500.00	
CROATIA	300,000.00	312,939.00	
CROATIA	200,000.00	217,744.00	
CROATIA	400,000.00	431,400.00	
CROATIA	200,000.00	208,960.00	
CROATIA	200,000.00	215,140.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	418,000.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	430,000.00	410,650.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000.00	469,500.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000.00	491,250.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	300,000.00	217,500.00	
HUNGARY	200,000.00	207,823.80	
HUNGARY	200,000.00	207,956.40	
HUNGARY	400,000.00	438,760.00	
HUNGARY	300,000.00	338,049.00	
HUNGARY	300,000.00	331,125.00	
INDONESIA GLOBAL	200,000.00	219,030.40	
INDONESIA GLOBAL	700,000.00	878,150.00	
INDONESIA GLOBAL	200,000.00	212,193.60	
MEXICO GLOBAL	200,000.00	291,500.00	
MEXICO GLOBAL	499,000.00	643,710.00	
MEXICO GLOBAL	150,000.00	179,625.00	
PANAMA GLOBAL	200,000.00	248,500.00	
PANAMA GLOBAL	600,000.00	834,000.00	

PANAMA GLOBAL	150,000.00	215,625.00	
PANAMA GLOBAL	250,000.00	301,250.00	
PERU GLOBAL	400,000.00	501,400.00	
PERU GLOBAL	220,000.00	254,100.00	
PHILIPPINES GLOBAL	150,000.00	185,738.55	
PHILIPPINES GLOBAL	700,000.00	1,124,711.70	
PHILIPPINES GLOBAL	400,000.00	662,181.60	
PHILIPPINES GLOBAL	300,000.00	444,340.20	
PHILIPPINES GLOBAL	600,000.00	801,606.60	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	398,000.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	174,000.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	373,000.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000.00	642,250.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000.00	607,250.00	
REPUBLIC OF CROATIA	400,000.00	435,080.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	320,000.00	356,054.40	
REPUBLIC OF HUNGARY	500,000.00	567,250.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	250,000.00	343,276.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	432,000.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	350,000.00	440,720.35	
REPUBLIC OF INDONESIA	350,000.00	386,990.45	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	316,720.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	296,042.70	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	191,526.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	250,000.00	266,727.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	826,513.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	372,941.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	649,580.40	
REPUBLIC OF PANAMA	150,000.00	162,562.50	
REPUBLIC OF PERU	300,000.00	341,250.00	
REPUBLIC OF PERU	550,000.00	759,000.00	
REPUBLIC OF PERU	400,000.00	409,000.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	590,550.50	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	219,902.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	223,693.40	

REPUBLIC OF PHILIPPINES	400,000.00	549,587.20	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	242,778.80	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	218,000.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	420,466.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	150,000.00	159,744.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	196,110.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	350,000.00	367,857.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	186,500.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	150,000.00	156,162.00	
REPUBLIC OF TURKEY	300,000.00	321,713.10	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	423,256.00	
REPUBLIC OF TURKEY	200,000.00	206,303.00	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	435,260.00	
REPUBLIC OF TURKEY	500,000.00	550,555.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	604,464.60	
REPUBLIC OF TURKEY	200,000.00	174,357.00	
REPUBLIC OF TURKEY	500,000.00	555,875.00	
REPUBLIC OF VENEZUELA	450,000.00	151,200.00	
REPUBLIC OF VENEZUELA	700,000.00	234,500.00	
REPUBLIC OF VENEZUELA	200,000.00	62,800.00	
ROMANIA	400,000.00	478,300.40	
ROMANIA	200,000.00	213,150.00	
ROMANIA	300,000.00	329,745.00	
ROMANIA	150,000.00	180,401.25	
RUSSIA	400,000.00	470,000.00	
RUSSIA	420,000.00	666,750.00	
RUSSIA	1,844,500.00	2,232,121.67	
RUSSIA FOREIGN BOND	600,000.00	623,280.00	
RUSSIAN FEDERATION	400,000.00	399,410.40	
RUSSIAN FEDERATION	400,000.00	403,203.20	
RUSSIAN FEDERATION	600,000.00	610,719.60	
RUSSIAN FEDERATION	400,000.00	376,349.20	
RUSSIAN FEDERATION	400,000.00	384,000.00	
TURKEY GLOBAL	350,000.00	376,117.70	
TURKEY GLOBAL	400,000.00	437,707.20	

	TURKEY GLOBAL	300,000.00	334,410.00	
	TURKEY GLOBAL	400,000.00	422,000.00	
	TURKEY GLOBAL	850,000.00	991,101.70	
	TURKEY GLOBAL	350,000.00	573,421.10	
	TURKEY GLOBAL	400,000.00	496,580.00	
	TURKEY GLOBAL	320,000.00	355,489.60	
	TURKEY GLOBAL	150,000.00	174,386.25	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	465,000.00	417,918.75	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	209,000.00	185,349.56	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	209,000.00	183,606.50	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	200,000.00	173,760.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	500,000.00	430,000.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	500,000.00	418,750.00	
	UNITED MEXICAN STATES	900,000.00	821,250.00	
	UNITED MEXICAN STATES	350,000.00	386,662.50	
	UNITED MEXICAN STATES	500,000.00	543,250.00	
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	705,250.00	
	UNITED MEXICAN STATES	600,000.00	605,100.00	
	UNITED MEXICAN STATES	600,000.00	581,250.00	
	UNITED MEXICAN STATES	550,000.00	586,437.50	
	UNITED MEXICAN STATES	800,000.00	714,000.00	
	UNITED MEXICAN STATES	800,000.00	802,000.00	
	VENEZUELA GLOBAL	150,000.00	51,975.00	
	VENEZUELA GLOBAL	200,000.00	59,548.00	
	VENEZUELA GLOBAL	100,000.00	29,960.00	
	VENEZUELA GLOBAL	600,000.00	214,200.00	
	VENEZUELA GLOBAL	200,000.00	65,400.00	
小計	銘柄数：135	52,336,500.00	53,717,762.53	
			(6,139,403,079)	
	組入時価比率：97.6%		100.0%	
合計			6,139,403,079	
			(6,139,403,079)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	29,623,395
コール・ローン	1,173,233
国債証券	1,550,842,457
未収利息	25,294,116
前払費用	4,148,203
流動資産合計	1,611,081,404
資産合計	1,611,081,404
負債の部	
流動負債	

(平成28年 2月17日現在)

未払金	21,445,563
未払解約金	52,806
その他未払費用	344,900
流動負債合計	21,843,269
負債合計	21,843,269
純資産の部	
元本等	
元本	1,395,188,317
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	194,049,818
元本等合計	1,589,238,135
純資産合計	1,589,238,135
負債純資産合計	1,611,081,404

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<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28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1391円
(10,000口当たり純資産額)	(11,391円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

<p>自 平成27年 2月18日</p> <p>至 平成28年 2月17日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p>

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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なっております。

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年 2月17日現在

### 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2.時価の算定方法

#### 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

### 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在

期首	平成27年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	1,498,838,630円
同期中における追加設定元本額	1,010,944,496円
同期中における一部解約元本額	1,114,594,809円
期末元本額	1,395,188,317円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	20,679,027円
野村資産設計ファンド2020	24,417,177円
野村資産設計ファンド2025	20,458,223円
野村資産設計ファンド2030	17,554,869円
野村資産設計ファンド2035	11,404,734円
野村資産設計ファンド2040	32,558,526円
野村資産設計ファンド2045	2,445,131円
野村インデックスファンド・新興国債券	393,821,813円
ネクストコア	28,090,118円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	148,632,730円

野村資産設計ファンド2050	515,849円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券(適格機関投資家専用)	445,838,471円
野村DC新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド	212,943,060円
野村DC運用戦略ファンド	33,334,558円
野村DC運用戦略ファンドM	402,827円
野村DC運用戦略ファンドA	2,091,204円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,050,000.00	1,125,262.95		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,350,000.00	5,394,217.75		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,350,000.00	2,614,405.55		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,600,000.00	1,694,484.80		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,400,000.00	1,474,151.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,700,000.00	2,189,317.80		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,250,000.00	2,496,532.50		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,700,000.00	1,901,735.60		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	200,000.00	272,311.20		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,500,000.00	2,991,945.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,332,876.00		
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	1,200,000.00	1,368,697.20		
		小計	銘柄数：12	22,500,000.00	24,855,937.35	(150,626,980)
			組入時価比率：9.5%		9.7%	
		リアル	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	480,000.00	398,946.72
			LETRA TESOURO NACIONAL	2,100,000.00	1,625,053.50	
	LETRA TESOURO NACIONAL		300,000.00	215,291.40		
	LETRA TESOURO NACIONAL		820,000.00	544,593.98		



小計	LETRA TESOURO NACIONAL	1,310,000.00	806,412.42	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	85,000.00	711,332.70	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	50,000.00	394,612.50	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	112,000.00	839,330.24	
	銘柄数：8	5,257,000.00	5,535,573.46	(155,549,614)
	組入時価比率：9.8%			10.0%
小計	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,720,000,000.00	1,692,136,000.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	810,000,000.00	872,856,000.00	
	銘柄数：2	2,530,000,000.00	2,564,992,000.00	(85,927,232)
	組入時価比率：5.4%			5.5%
小計	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	181,376.80	
	PERU BONO SOBERANO	130,000.00	137,180.29	
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	446,637.00	
	銘柄数：3	830,000.00	765,194.09	(24,914,719)
	組入時価比率：1.6%			1.6%
小計	TURKEY GOVERNMENT BOND	300,000.00	277,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	300,000.00	286,050.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	800,000.00	766,800.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	610,000.00	611,220.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	330,000.00	315,150.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	550,000.00	498,300.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	570,000.00	473,955.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	220,000.00	218,130.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	210,000.00	193,620.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	340,000.00	291,805.00	
	銘柄数：10	4,230,000.00	3,932,230.00	(150,997,632)
	組入時価比率：9.5%		9.7%	
フォロント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	38,000,000.00	41,408,600.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	44,000,000.00	50,527,400.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	40,597,260.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	24,000,000.00	30,061,440.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	18,000,000.00	21,841,650.00	

小計	HUNGARY GOVERNMENT BOND	27,000,000.00	32,214,780.00	
	銘柄数：6	184,000,000.00	216,651,130.00	(88,675,307)
	組入時価比率：5.6%			5.7%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	580,000.00	616,250.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	620,000.00	650,876.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	280,000.00	315,420.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,030,000.00	1,009,606.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	764,470.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	591,250.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	280,000.00	335,554.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	310,000.00	337,977.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	700,000.00	722,150.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	247,973.96	
小計	銘柄数：10	5,230,000.00	5,591,528.36	(161,427,423)
	組入時価比率：10.2%			10.5%
ルーブル	RUSSIA FOREIGN BOND	50,000,000.00	48,142,100.00	
小計	銘柄数：1	50,000,000.00	48,142,100.00	(70,768,887)
	組入時価比率：4.5%			4.6%
レイ	ROMANIA	620,000.00	666,159.00	
	ROMANIA	870,000.00	1,034,803.23	
小計	銘柄数：2	1,490,000.00	1,700,962.23	(48,511,442)
	組入時価比率：3.1%			3.1%
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	200,000.00	202,133.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	612,600.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	750,000.00	756,781.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,080,000.00	1,116,180.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	620,000.00	634,842.18	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	750,000.00	734,250.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	550,000.00	537,377.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	160,000.00	164,065.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	570,000.00	544,045.05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	350,000.00	339,396.75	

小計	銘柄数：10 組入時価比率：9.6%	5,630,000.00	5,641,671.90 (153,227,808) 9.9%
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,021,599.00
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,100,000.00	5,483,535.29
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,200,000.00	5,502,593.20
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,700,000.00	9,363,488.10
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,800,000.00	11,938,968.00
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,461,327.60
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	7,543,597.00
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,891,519.00
小計	銘柄数：8 組入時価比率：9.3%	41,700,000.00	46,206,627.19 (147,861,207) 9.5%
フィリピン	REPUBLIC OF PHILIPPINES	5,000,000.00	5,149,000.00
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.8%	5,000,000.00	5,149,000.00 (12,409,090) 0.8%
ルビア	INDONESIA GOVERNMENT	650,000,000.00	671,221,850.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,900,000,000.00	2,126,936,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,000,000,000.00	1,199,138,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,050,000,000.00	992,250,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,800,000,000.00	2,862,524,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,390,000,000.00	2,821,514,500.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,450,000,000.00	1,322,357,950.00
	INDONESIA GOVERNMENT	830,000,000.00	870,769,600.00
	INDONESIA GOVERNMENT	780,000,000.00	917,361,900.00
	INDONESIA GOVERNMENT	500,000,000.00	544,520,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000.00	2,251,159,500.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,000,000,000.00	1,990,898,000.00
小計	銘柄数：12 組入時価比率：10.0%	17,650,000,000.00	18,570,651,300.00 (159,707,601) 10.4%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,300,000.00	1,287,154.05
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,380,000.00	2,273,967.66
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,640,000.00	1,504,565.52

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,400,000.00	1,310,016.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,800,000.00	4,149,592.02	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,360,000.00	3,420,856.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,000,000.00	1,392,129.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,100,000.00	968,990.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,250,000.00	1,556,902.35	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,700,000.00	1,505,649.03	
小計	銘柄数：10	21,930,000.00	19,369,822.63	
			(140,237,515)	
	組入時価比率：8.8%		9.0%	
合計			1,550,842,457	
			(1,550,842,457)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	107,562,134
コール・ローン	160,773,123
投資証券	18,508,726,800
派生商品評価勘定	15,580,320
未収入金	25,045,600
未収配当金	121,508,324
未収利息	4
差入委託証拠金	2,142,000
流動資産合計	18,941,338,305
資産合計	18,941,338,305
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	12,632,100
未払解約金	41,405,486
流動負債合計	54,037,586
負債合計	54,037,586
<b>純資産の部</b>	
元本等	

(平成28年 2月17日現在)

元本	9,858,123,946
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,029,176,773
元本等合計	18,887,300,719
純資産合計	18,887,300,719
負債純資産合計	18,941,338,305

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。 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28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.9159円
(10,000口当たり純資産額)	(19,159円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

<p>自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

## 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28年 2月17日現在

## 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2.時価の算定方法

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在

期首	平成27年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	8,427,201,678円
同期中における追加設定元本額	3,896,424,085円
同期中における一部解約元本額	2,465,501,817円
期末元本額	9,858,123,946円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	980,553,910円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,650,954,794円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	887,925,906円
野村資産設計ファンド2015	34,103,518円
野村資産設計ファンド2020	26,379,576円

野村資産設計ファンド2025	22,106,455円
野村資産設計ファンド2030	28,469,982円
野村資産設計ファンド2035	18,477,595円
野村資産設計ファンド2040	35,166,058円
野村資産設計ファンド2045	3,190,916円
野村インデックスファンド・J-REIT	2,511,885,208円
ネクストコア	101,202,407円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	199,372,579円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	262,512,745円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	405,211,887円
野村資産設計ファンド2050	850,467円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用）	481,497,215円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	83,657,577円
野村DC運用戦略ファンド	122,038,434円
野村DC運用戦略ファンドM	470,162円
野村DC運用戦略ファンドA	2,096,555円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	日本円	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	816	344,352,000	
		MCUBS MidCity投資法人 投資証券	448	146,048,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	2,936	471,521,600	
		産業ファンド投資法人 投資証券	594	323,730,000	
		大和ハウスリート投資法人 投資証券	591	277,474,500	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,191	597,704,800	
		ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	588	180,516,000	

アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,010	563,580,000	
GLP投資法人 投資証券	4,371	529,328,100	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	862	196,536,000	
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	2,917	683,161,400	
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	131	166,239,000	
SIA不動産投資法人 投資証券	127	54,229,000	
イオンリート投資法人 投資証券	2,189	287,853,500	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,316	228,720,800	
日本リート投資法人 投資証券	660	183,084,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	914	90,303,200	
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	126	21,029,400	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,338	169,524,600	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	271	30,162,300	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	599	157,596,900	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	203	20,503,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	275	23,677,500	
ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	143	19,333,600	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	6,272	930,137,600	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	233	28,775,500	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,379	1,508,286,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,206	1,433,900,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	4,301	1,110,948,300	
オリックス不動産投資法人 投資証券	3,911	641,404,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,471	632,530,000	



	投資証券			
	プレミア投資法人 投資証券	2,219	288,691,900	
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,647	256,932,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	327	146,659,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	4,636	779,311,600	
	森トラスト総合リート投資法人 投 資証券	2,224	434,792,000	
	インヴィンシブル投資法人 投資証 券	5,382	373,510,800	
	フロンティア不動産投資法人 投資 証券	836	428,868,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証 券	1,710	152,019,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法 人 投資証券	1,483	355,326,800	
	福岡リート投資法人 投資証券	1,259	245,756,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	682	426,250,000	
	積水ハウス・S Iレジデンシャル投 資法人 投資証券	1,716	195,280,800	
	いちごオフィスリート投資法人 投 資証券	2,387	196,211,400	
	大和証券オフィス投資法人 投資証 券	816	551,616,000	
	阪急リート投資法人 投資証券	1,007	130,507,200	
	スターツプロシード投資法人 投資 証券	293	47,759,000	
	トップリート投資法人 投資証券	297	124,740,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法 人 投資証券	1,260	301,644,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	5,585	494,272,500	
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	2,764	229,964,800	
	ジャパンエクセレント投資法人 投 資証券	2,131	296,422,100	
	小計	87,050	18,508,726,800	
	銘柄数：52			
	組入時価比率：98.0%		100.0%	
	合計		18,508,726,800	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年 2月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	361,557,000	-	377,160,000	15,580,320
合計	361,557,000	-	377,160,000	15,580,320

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 海外REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

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

(平成28年 2月17日現在)

純資産合計	16,183,981,876
負債純資産合計	16,213,821,269

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。</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 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.8891円
(10,000口当たり純資産額)	(18,891円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 2月18日

至 平成28年 2月17日

## 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。

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年 2月17日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在

期首	平成27年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	8,588,642,760円
同期中における追加設定元本額	2,483,803,584円

同期中における一部解約元本額	2,505,255,244円
期末元本額	8,567,191,100円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	912,993,849円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,399,404,359円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	826,747,902円
野村資産設計ファンド2015	31,753,677円
野村資産設計ファンド2020	24,559,768円
野村資産設計ファンド2025	20,579,627円
野村資産設計ファンド2030	26,508,140円
野村資産設計ファンド2035	17,204,037円
野村資産設計ファンド2040	32,742,185円
野村資産設計ファンド2045	2,971,062円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,609,846,064円
ネクストコア	48,509,370円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	173,515,572円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	456,017,046円
野村資産設計ファンド2050	791,868円
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA（適格機関投資家専用）	654,656,448円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT（適格機関投資家専用）	269,147,173円
野村DC運用戦略ファンド	58,052,230円
野村DC運用戦略ファンドM	376,307円
野村DC運用戦略ファンドA	814,416円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	10,500	349,125.00	
		AGREE REALTY CORP	2,900	107,967.00	
		ALEXANDERS INC	580	217,500.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,900	806,600.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,900	207,975.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19,200	835,584.00	

AMERICAN HOMES 4 RENT-A	23,800	325,584.00	
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	4,700	72,709.00	
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	23,500	860,570.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	23,800	459,578.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,100	44,116.00	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	3,595	36,489.25	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,100	61,831.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,700	3,423,159.00	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,700	25,272.00	
BOSTON PROPERTIES	23,200	2,558,728.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,600	311,486.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	25,600	594,432.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	963,898.00	
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	10,100	70,195.00	
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	12,800	313,984.00	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	7,200	74,592.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	22,600	229,616.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	10,900	75,428.00	
CHATHAM LODGING TRUST	5,900	117,705.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8,900	219,652.00	
CITY OFFICE REIT INC	1,700	19,363.00	
COLONY STARWOOD HOMES	5,900	127,145.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,800	378,068.00	
CORESITE REALTY CORP	4,700	282,940.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,100	303,150.00	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	17,700	520,734.00	
COUSINS PROPERTIES INC	30,500	252,540.00	
CUBESMART	26,000	742,040.00	
CYRUSONE INC	9,700	347,357.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13,400	468,464.00	
DDR CORP	45,800	744,250.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	30,800	257,796.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	22,100	1,776,840.00	
DOUGLAS EMMETT INC	21,000	532,770.00	

DUKE REALTY CORP	52,400	1,036,472.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	10,000	340,400.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	1,800	30,942.00	
EASTGROUP PROPERTIES	4,900	253,820.00	
EDUCATION REALTY TRUST INC	9,200	357,880.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	18,000	271,980.00	
EPR PROPERTIES	9,500	582,825.00	
EQUITY COMMONWEALTH	19,200	502,080.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,100	815,782.00	
EQUITY ONE INC	13,800	371,634.00	
EQUITY RESIDENTIAL	55,000	3,969,900.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,000	1,986,300.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	18,600	1,543,428.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,500	1,563,555.00	
FELCOR LODGING TRUST INC	20,100	141,102.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16,900	337,662.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,400	70,224.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5,800	93,206.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,000	116,740.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	14,000	364,140.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	88,000	2,259,840.00	
GEO GROUP INC/THE	11,000	304,150.00	
GETTY REALTY CORP	3,921	70,970.10	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,100	42,532.00	
GLOBAL NET LEASE INC	25,600	186,624.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	10,500	143,640.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	64,000	454,400.00	
HCP INC	70,300	1,892,476.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	15,200	436,696.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	19,200	513,216.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,900	130,548.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14,400	609,552.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	23,100	533,841.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	113,700	1,687,308.00	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	11,000	258,500.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,285	27,681.10	
INLAND REAL ESTATE CORP	13,600	144,432.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	18,300	113,460.00	
IRON MOUNTAIN INC	28,900	827,407.00	
KILROY REALTY CORP	13,900	692,359.00	
KIMCO REALTY CORP	62,500	1,657,500.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	12,700	335,788.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	17,200	409,876.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	31,700	219,998.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	22,300	638,895.00	
LTC PROPERTIES INC	5,300	224,720.00	
MACERICH CO /THE	20,300	1,532,650.00	
MACK-CALI REALTY CORP	13,700	250,847.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	36,300	379,698.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,400	1,006,848.00	
MONMOUTH REIT-CLASS A	9,100	96,278.00	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	24,600	199,506.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	20,500	917,990.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,500	58,205.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,200	300,612.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,700	109,982.00	
NEW YORK REIT INC	25,000	233,750.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	33,870.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,500	82,555.00	
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	28,890	271,277.10	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	24,800	716,968.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,100	42,735.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	12,300	151,905.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,000	277,310.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,400	186,264.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	16,200	272,322.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,200	388,056.00	
POST PROPERTIES INC	8,200	448,458.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES	3,500	39,690.00	



INC			
PROLOGIS INC	79,200	2,943,072.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,900	258,825.00	
PUBLIC STORAGE	22,250	5,299,505.00	
QTS REALTY TRUST INC CL A	5,900	245,912.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12,200	205,570.00	
REALTY INCOME CORP	37,800	2,261,196.00	
REGENCY CENTERS CORP	14,200	1,003,514.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14,800	269,360.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	35,800	530,198.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	8,600	144,050.00	
RLJ LODGING TRUST	19,200	358,656.00	
ROUSE PROPERTIES INC	5,600	97,048.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,800	379,314.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9,800	157,584.00	
SAUL CENTERS INC	1,700	82,756.00	
SELECT INCOME REIT	9,700	182,166.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	35,900	512,293.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	2,300	91,356.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5,100	65,484.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	46,750	8,711,862.50	
SL GREEN REALTY CORP	15,100	1,249,223.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	5,800	597,052.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,500	710,220.00	
STAG INDUSTRIAL INC	10,100	159,580.00	
STORE CAPITAL CORP	12,300	313,896.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,500	133,245.00	
SUN COMMUNITIES INC	8,700	572,982.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,547	402,564.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14,400	447,552.00	
TAUBMAN CENTERS INC	9,100	610,337.00	
TERRENO REALTY CORP	6,700	141,839.00	
UDR INC	39,700	1,344,242.00	
UMH PROPERTIES INC	3,600	33,552.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,800	90,180.00	

	URBAN EDGE PROPERTIES	14,100	334,593.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	3,900	77,103.00	
	VENTAS INC	50,300	2,500,916.00	
	VEREIT INC	136,100	1,019,389.00	
	VORNADO REALTY TRUST	26,800	2,208,856.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	10,200	253,776.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17,200	598,904.00	
	WELLTOWER INC	53,400	2,988,264.00	
	WHITESTONE REIT	4,200	42,420.00	
	WINTHROP REALTY TRUST	5,400	68,580.00	
	WP CAREY INC	14,600	787,232.00	
	WP GLIMCHER INC	28,400	221,236.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,600	238,874.00	
小計	銘柄数：156	2,965,818	99,627,818.05	
			(11,386,463,324)	
	組入時価比率：70.4%		71.0%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	5,700	176,814.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,000	113,100.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,500	147,000.00	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	2,000	52,600.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,600	275,808.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5,600	223,440.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	83,930.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,200	178,486.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	6,000	78,120.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	69,482.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	65,940.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	3,400	25,398.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	132,384.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,400	127,806.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	21,000	394,590.00	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	10,400	52,832.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,200	33,748.00	

	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,600	48,576.00	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ES	5,300	81,408.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	18,768.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	57,104.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	3,100	50,933.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	3,400	30,056.00	
	ONEREIT	6,570	20,498.40	
	PLAZA RETAIL REIT	7,500	33,600.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,600	58,616.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,400	581,958.00	
	SLATE RETAIL REIT	1,600	21,296.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,700	290,806.00	
小計	銘柄数：29	211,470	3,525,097.40	
			(290,503,276)	
	組入時価比率：1.8%		1.8%	
ユ-口	AEDIFICA	2,078	116,388.78	
	AFFINE	900	13,275.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	15,300	175,491.00	
	ALTAREA	320	52,320.00	
	ANF IMMOBILIER	1,300	24,856.00	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	8,860	98,346.00	
	BEFIMMO S.C.A.	3,200	157,888.00	
	BENI STABILI SPA	162,000	97,200.00	
	COFINIMMO	3,110	300,021.70	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	7,080	266,172.60	
	FONCIERE DES MURS	1,300	33,150.00	
	FONCIERE DES REGIONS	6,670	483,374.90	
	GECINA SA	5,490	601,978.50	
	GREEN REIT PLC	99,709	133,310.93	
	HAMBORNER REIT AG	9,826	86,576.88	
	HIBERNIA REIT PLC	108,000	132,300.00	
	ICADE	5,330	325,822.90	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	43,604	30,522.80	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,140	26,442.30	

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	52,800	57,235.20	
	KLEPIERRE	28,416	1,058,353.92	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,630	69,989.30	
	MERCIALYS	2,580	48,865.20	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	46,555	424,255.71	
	NSI NV	20,070	74,941.38	
	RETAIL ESTATES	770	58,905.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	14,830	3,264,824.50	
	VASTNED RETAIL NV	2,850	108,513.75	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,070	147,342.60	
	WERELDHAVE BELGIUM	290	29,493.00	
	WERELDHAVE NV	6,160	275,352.00	
小計	銘柄数：31	671,238	8,773,509.85	
			(1,116,341,393)	
	組入時価比率：6.9%		7.0%	
英ポンド	ASSURA PLC	238,700	124,362.70	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,200	176,784.00	
	BRITISH LAND	154,000	1,041,040.00	
	DERWENT LONDON PLC	16,900	508,690.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	55,200	60,720.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	52,200	366,705.00	
	HAMMERSON PLC	118,500	655,897.50	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	108,500	115,010.00	
	INTU PROPERTIES PLC	125,400	354,882.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	120,400	1,224,468.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	92,000	142,876.00	
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	14,200	33,458.75	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	66,800	71,142.00	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	150,000	64,185.00	
	REGIONAL REIT LTD	26,000	26,780.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,540	104,941.50	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	78,700	44,859.00	
	SEGRO PLC	112,500	471,150.00	
	SHAFTESBURY PLC	42,600	359,331.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	97,600	123,756.80	

	WORKSPACE GROUP PLC	17,800	131,809.00	
小計	銘柄数：21	1,743,740	6,202,848.25	
			(1,013,173,233)	
	組入時価比率：6.3%		6.3%	
豪ドル	360 CAPITAL GROUP LTD	42,450	39,903.00	
	360 CAPITAL OFFICE FUND	11,100	22,200.00	
	ABACUS PROPERTY GROUP	39,000	116,220.00	
	ALE PROPERTY GROUP	26,000	98,280.00	
	ARENA REIT	35,220	59,169.60	
	ASPEN GROUP	13,000	14,950.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	7,000	38,010.00	
	BWP TRUST	73,000	229,950.00	
	CHARTER HALL GROUP	46,000	201,020.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	49,000	208,740.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	183,000	181,170.00	
	DEXUS PROPERTY GROUP	146,000	1,102,300.00	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	33,250	72,485.00	
	GALILEO JAPAN TRUST	18,170	35,976.60	
	GDI PROPERTY GROUP	70,300	59,052.00	
	GOODMAN GROUP	240,000	1,548,000.00	
	GPT GROUP	273,000	1,367,730.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,550	82,836.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	56,926.80	
	INDUSTRIA REIT	18,400	39,744.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	22,285	58,163.85	
	INVESTA OFFICE FUND	94,000	372,240.00	
	MIRVAC GROUP	552,000	1,023,960.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	44,860	67,514.30	
	SCENTRE GROUP	805,000	3,654,700.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	109,100	245,475.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	358,000	1,453,480.00	
	VICINITY CENTRES	492,000	1,490,760.00	
	WESTFIELD CORP	289,400	2,836,120.00	
小計	銘柄数：29	4,139,765	16,777,076.15	
			(1,363,472,978)	
	組入時価比率：8.4%		8.5%	

ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	119,000	135,065.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	150,000	188,250.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	190,000	257,450.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	158,571	195,042.33	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	67,525	109,390.50	
	STRIDE PROPERTY LTD	58,000	123,540.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	39,300	73,491.00	
小計	銘柄数：7	782,396	1,082,228.83	
			(81,372,785)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
香港ドル	CHAMPION REIT	339,000	1,159,380.00	
	FORTUNE REIT	210,000	1,659,000.00	
	LINK REIT	339,500	14,598,500.00	
	NEW CENTURY REIT	65,000	184,600.00	
	PROSPERITY REIT	180,000	477,000.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	120,000	213,600.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	105,000	309,750.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	150,000	558,000.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	160,000	625,600.00	
	小計	銘柄数：9	1,668,500	19,785,430.00
			(290,252,258)	
	組入時価比率：1.8%		1.8%	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	77,700	101,787.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	129,000	101,910.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	322,800	768,264.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	124,000	137,640.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	127,000	104,775.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	153,300	75,883.50	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	309,300	426,834.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	406,200	853,020.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	100,800	138,096.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	99,000	125,730.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	118,000	75,520.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	83,500	97,277.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	90,100	171,190.00	

	FRASERS COMMERCIAL TRUST	85,000	102,000.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	88,000	65,560.00	
	KEPPEL DC REIT	130,600	133,212.00	
	KEPPEL REIT	275,300	251,899.50	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	282,800	86,254.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	193,200	273,378.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	271,900	227,036.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	174,300	268,422.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	230,900	217,046.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	62,350	41,151.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	117,100	85,483.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	59,000	131,570.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	94,200	59,346.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	97,000	68,870.00	
	SPH REIT	120,500	111,462.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	209,900	155,326.00	
	SUNTEC REIT	385,300	622,259.50	
小計	銘柄数：30	5,018,050	6,078,203.00	
			(493,793,211)	
	組入時価比率：3.1%		3.1%	
新シケル	REIT 1 LTD	22,490	222,201.20	
小計	銘柄数：1	22,490	222,201.20	
			(6,508,273)	
	組入時価比率：0.0%		0.0%	
合計			16,041,880,731	
			(16,041,880,731)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年 2月17日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超		
			評価損益(円)
市場取引			

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

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 野村マネー マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 2月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,984,505,119
コール・ローン	4,460,939,831
地方債証券	3,346,981,884
特殊債券	6,761,067,014
社債券	2,405,624,145
コマーシャル・ペーパー	2,399,711,871
未収利息	24,191,998
前払費用	7,692,811
流動資産合計	22,390,714,673
資産合計	22,390,714,673
負債の部	
流動負債	



(平成28年 2月17日現在)

未払金	214,773,009
未払解約金	934,000
流動負債合計	215,707,009
負債合計	215,707,009
純資産の部	
元本等	
元本	21,717,696,368
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	457,311,296
元本等合計	22,175,007,664
純資産合計	22,175,007,664
負債純資産合計	22,390,714,673

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 2月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0211円
(10,000口当たり純資産額)	(10,211円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成27年 2月18日 至 平成28年 2月17日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年 2月17日現在

### 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2.時価の算定方法

地方債証券、特殊債券、社債券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コマーシャル・ペーパー

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### (その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 2月17日現在

期首	平成27年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	14,738,082,536円
同期中における追加設定元本額	13,056,517,064円
同期中における一部解約元本額	6,076,903,232円
期末元本額	21,717,696,368円
期末元本額の内訳*	
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09	98,039,216円
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06	146,986,772円
野村アフリカ株投資 マネープール・ファンド	4,323,817円
野村米国ハイ・イールド債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	54,908,910円
野村新中国株投資 マネープール・ファンド	19,445,120円
野村日本ブランド株投資(マネープールファンド)年2回決算型	218,543,313円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	9,867,582円
野村ピクテ・ジェネリック&ゲノム マネープール・ファンド	38,481,729円

野村・グリーン・テクノロジー マネープール・ファンド	1,511,406円
野村新興国消費関連株投信 マネープール・ファンド	6,245,303円
野村世界業種別投資シリーズ(マネープール・ファンド)	21,174,299円
ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド)	1,998,458,414円
野村新エマージング債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	5,595,320円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	8,788,959円
野村グローバルC B投信(マネープールファンド)年2回決算型	6,395,351円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネープールファンド)年2回決算型	146,989,156円
野村日本スマートシティ株投資 マネープールファンド	17,294,315円
ネクストコア	343,183,624円
野村世界高金利通貨投信	151,953,753円
野村新世界高金利通貨投信	982,608円
コインの未来(毎月分配型)	3,965,894円
コインの未来(年2回分配型)	991,474円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826円
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260円
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,261円
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,607円
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260円
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円

野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260円
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース	982,608円
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース	98,260円
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)	49,354,623円
野村アジアC B投信(毎月分配型)	982,608円
野村グローバルC B投信(円コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(円コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	984,252円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607円

野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672円
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381円
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261円
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	983,381円
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	983,381円
野村高金利国際機関債投信(年2回決算型)	1,967円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,262円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091円
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Aコース)	982,995円
ノムラ・アジア・コレクション(短期アジア現地通貨建て債券 Bコース)	98,260円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801円
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029円

野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029円
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547円
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547円
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	1,963円
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	588,871円
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	196,291円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	294,436円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092円
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	4,908円
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	196,925円
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	98,146円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	196,291円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	294,436円
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741円
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451円
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451円
ノムラ THE USA Aコース	981,258円
ノムラ THE USA Bコース	981,258円
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117円
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117円
米国変動好金利ファンド Aコース	8,829,589円
米国変動好金利ファンド Bコース	981,066円
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809円
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808円
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807円
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049円

野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803円
野村新興国高配当株トリプルウイング ブラジルリアル毎月分配型	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	9,803円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801円
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801円
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992円
ノムラ THE ASIA Bコース	979,912円
グローバル・ストック Aコース	97,953円
グローバル・ストック Bコース	979,528円
グローバル・ストック Cコース	97,953円
グローバル・ストック Dコース	979,528円
第1回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第2回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第3回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第4回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第5回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第6回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第7回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第9回 野村短期公社債ファンド	98,260円
第10回 野村短期公社債ファンド	98,260円
第11回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第12回 野村短期公社債ファンド	982,607円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	5,276,885,002円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	3,422,819,779円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Zプライス(適格機関投資家専用)	2,296,160,091円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用)	4,635,437,085円
野村日経225 ショート・ファンド2(適格機関投資家専用)	636,818円
日本株インカムプラス(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家転売制限付)	1,186,053,936円
日本株インカムプラス(公社債運用移行型)1308(適格機関投資家転売制限付)	1,019,201,436円
野村DC運用戦略ファンド	379,067,282円
野村DCテンプレート・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
野村DC運用戦略ファンドM	4,553,821円
野村DC運用戦略ファンドA	4,396,962円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成28年 2月17日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(平成28年 2月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	日本円	東京都 公募第634回	1,000,000	1,005,956	
		東京都 公募第636回	101,500,000	102,167,940	
		北海道 公募平成17年度第12回	50,000,000	50,015,977	
		北海道 公募平成18年度第7回	1,500,000	1,519,712	
		北海道 公募(5年)平成23年度第2回	7,200,000	7,208,480	
		神奈川県 公募第138回	11,000,000	11,017,380	
		神奈川県 公募第45回	200,000,000	200,087,234	
		神奈川県 公募第46回	115,500,000	115,551,184	
		神奈川県 公募第47回	450,000,000	450,153,960	
		神奈川県 公募(5年)第49回	101,700,000	101,886,693	
		大阪府 公募第287回	80,000,000	80,031,164	
		大阪府 公募第288回	200,000,000	200,368,488	
		大阪府 公募第294回	12,000,000	12,136,860	
		大阪府 公募第295回	1,000,000	1,012,249	
		大阪府 公募(5年)第71回	430,000,000	430,333,404	
		大阪府 公募(5年)第72回	3,000,000	3,003,026	
		大阪府 公募(5年)第73回	102,000,000	102,121,920	
		大阪府 公募(5年)第77回	100,000,000	100,241,724	
		京都府 公募平成23年度第1回	7,000,000	7,009,838	
		兵庫県 公募平成18年度第7回	80,000,000	80,707,924	



	静岡県	公募平成17年度第7回	14,100,000	14,121,009	
	埼玉県	公募平成18年度第1回	13,500,000	13,543,684	
	福岡県	公募平成18年度第3回	1,000,000	1,012,586	
	千葉県	公募平成18年度第4回	8,600,000	8,700,010	
	千葉県	公募平成22年度第13回	66,000,000	66,009,038	
	新潟県	公募平成18年度第1回	6,500,000	6,555,219	
	群馬県	公募第3回	9,000,000	9,121,997	
	大分県	公募平成18年度第1回	23,000,000	23,274,075	
	共同発行市場地方債	公募第35回	300,000,000	300,102,580	
	共同発行市場地方債	公募第36回	2,000,000	2,003,092	
	共同発行市場地方債	公募第38回	5,000,000	5,025,302	
	共同発行市場地方債	公募第39回	2,000,000	2,012,516	
	共同発行市場地方債	公募第40回	8,000,000	8,068,236	
	共同発行市場地方債	公募第41回	6,000,000	6,058,628	
	共同発行市場地方債	公募第43回	4,000,000	4,045,760	
	福島県	公募平成22年度第2回	400,000,000	400,031,236	
	熊本県	公募平成18年度第2回	7,500,000	7,587,521	
	大阪市	公募平成17年度第13回	200,000,000	200,307,125	
	名古屋市	公募第455回	1,000,000	1,006,104	
	名古屋市	公募第456回	16,000,000	16,160,340	
	京都市	公募平成17年度第4回	1,000,000	1,001,886	
	京都市	公募平成23年度第1回	90,000,000	90,181,320	
	京都市	公募平成23年度第3回	4,000,000	4,006,596	
	札幌市	公募（5年）平成23年度第5回	12,900,000	12,922,367	
	川崎市	公募（5年）第29回	12,200,000	12,218,288	
	北九州市	公募（5年）平成23年度第1回	7,000,000	7,011,706	
	仙台市	公募平成23年度第1回	57,410,000	57,559,802	
	鹿児島県	公募平成18年度第1回	3,200,000	3,240,131	
	鹿児島県	公募（5年）平成23年度第1回	6,500,000	6,512,617	
小計	銘柄数：49		3,341,810,000	3,346,981,884	
	組入時価比率：15.1%			22.4%	
合計				3,346,981,884	
特殊債券	日本円	日本政策投資銀行社債 財投機関債第34回	200,000,000	200,115,470	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第13回	100,000,000	100,624,075	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第5回	558,000,000	558,226,076	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第11回	170,000,000	170,549,695	
公営企業債券 政府保証第861回	29,000,000	29,036,380	
公営企業債券 政府保証第862回	117,000,000	117,350,015	
地方公共団体金融機構債券 2年第1回	800,000,000	800,036,752	
公営企業債券 第19回財投機関債	100,000,000	100,189,395	
首都高速道路 第8回	140,000,000	140,287,721	
首都高速道路債券 政府保証第1回	400,000,000	400,678,724	
都市再生債券 財投機関債第75回	100,000,000	100,047,192	
関西国際空港社債 財投機関債第31回	70,000,000	70,169,490	
中部国際空港債券 政府保証第17回	300,000,000	300,000,000	
商工債券 利付第733回い号	300,000,000	300,502,790	
商工債券 利付第734回い号	170,000,000	170,351,600	
商工債券 利付第736回い号	300,000,000	300,680,199	
商工債券 利付第737回い号	100,000,000	100,253,197	
農林債券 利付第729回い号	200,000,000	200,037,953	
農林債券 利付第731回い号	100,000,000	100,127,648	
農林債券 利付第733回い号	180,000,000	180,303,250	
農林債券 利付第735回い号	100,000,000	100,188,870	
農林債券 利付第736回い号	100,000,000	100,252,245	
農林債券 利付第737回い号	30,000,000	30,072,846	
しんきん中金債券 利付第258回	200,000,000	200,251,769	
商工債券 利付(3年)第158回	100,000,000	100,008,625	
商工債券 利付(3年)第160回	100,000,000	100,050,230	
商工債券 利付(3年)第161回	200,000,000	200,122,243	
商工債券 利付(3年)第164回	200,000,000	200,145,759	
商工債券 利付(10年)第2回	100,000,000	100,010,170	
中日本高速道路社債 財投機関債第37回	400,000,000	400,042,411	
中日本高速道路社債 第40回	400,000,000	400,095,380	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債	390,000,000	390,258,844	

		券 財投機関債第46回		
	小計	銘柄数：32 組入時価比率：30.5%	6,754,000,000	6,761,067,014 45.4%
	合計			6,761,067,014
社債券	日本円	みずほコーポレート銀行 第25回 特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,336,658
		みずほコーポレート銀行 第26回 特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,562,666
		みずほコーポレート銀行 第27回 特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,652,000
		三菱東京UFJ銀行 第126回特 定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,198,048
		三菱東京UFJ銀行 第129回特 定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,288,872
		トヨタファイナンス 第19回社債 間限定同等特約付	200,000,000	200,320,640
		三菱UFJリース 第13回社債間 限定同順位特約付	500,000,000	500,629,818
		三菱UFJリース 第15回社債間 限定同順位特約付	400,000,000	401,838,388
		三菱UFJリース 第22回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,003,250
		三井不動産 第25回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,129,355
		東邦瓦斯 第30回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,664,450
		小計	銘柄数：11 組入時価比率：10.8%	2,400,000,000
	合計			2,405,624,145
コマーシャル・ ペーパー	日本円	フォレストコープ	100,000,000	99,993,991
		フォレストコープ	100,000,000	99,978,739
		フォレストコープ	100,000,000	99,964,964
		フォレストコープ	100,000,000	99,948,727
		みずほ証券	100,000,000	99,998,036
		みずほ証券	100,000,000	99,991,535
		みずほ証券	200,000,000	199,979,920
		三井住友F&L	200,000,000	199,991,544
		三井住友F&L	200,000,000	199,956,139
		三井住友F&L	200,000,000	199,972,868
		三井住友F&L	200,000,000	199,991,287

	三井住友信託銀行	100,000,000	99,996,259	
	三井住友信託銀行	200,000,000	199,989,150	
	三井住友信託銀行	200,000,000	199,986,451	
	三井住友信託銀行	200,000,000	199,973,435	
	三井住友信託銀行	100,000,000	99,998,826	
小計	銘柄数：16 組入時価比率：10.8%	2,400,000,000	2,399,711,871 16.1%	
	合計		2,399,711,871	
	合計		14,913,384,914	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 野村DC運用戦略ファンドA

平成28年 3月31日現在

資産総額	52,239,879円
負債総額	17,066,373円
純資産総額（ - ）	35,173,506円
発行済口数	35,000,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0050円

## （参考）国内株式マザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

## （参考）国内債券マザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

## （参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

## （参考）外国債券マザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

## （参考）新興国株式マザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

## （参考）新興国債券マザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

平成28年 3月31日現在

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

（参考）野村マネー マザーファンド

平成28年 3月31日現在

資産総額	21,880,961,237円
負債総額	802,171,000円
純資産総額（ - ）	21,078,790,237円
発行済口数	20,643,201,487口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0211円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

##### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

##### (3) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託者は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

#### (5) 受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

#### (6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱い

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額

平成28年3月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)会社の機構

###### (a)会社の意思決定機構

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

###### 代表執行役・執行役

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

###### 委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成28年2月29日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	892	17,121,747
単位型株式投資信託	52	228,903
追加型公社債投資信託	18	6,407,538
単位型公社債投資信託	197	1,442,408
合計	1,159	25,200,596

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

#### (1)【貸借対照表】

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

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

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

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

## ( 2 ) 【損益計算書】

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]



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

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

## [会計方針の変更]

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

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成26年3月31日)	当事業年度末 (平成27年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払金 4,601百万円 未払費用 1,607	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払金 4,979百万円 未払費用 1,411
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 565百万円 器具備品 2,849 合計 3,414	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 607百万円 器具備品 3,052 合計 3,659

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 3,568百万円 支払利息 5	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 3,966百万円 支払利息 -

2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されて おります。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損 器具備品 6百万円 ソフトウェア 11	3. 固定資産除却損 器具備品 15百万円 ソフトウェア 342
合計 17	合計 357

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成25年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	10,043百万円
--------	-----------

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

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

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

## 金融商品関係

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

### 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

    その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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

### (2) 金銭の信託

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

### (3) 未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成26年3月31日)



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

## 4．その他有価証券(平成26年3月31日)

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

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

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

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

## 当事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

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

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

## 4．その他有価証券(平成27年3月31日)

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

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

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

## 退職給付関係

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

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

## 及び前払年金費用の調整表

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.6%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、170百万円でした。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。

## 税効果会計関係

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

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

## セグメント情報等

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品・サービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

##### 売上高

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

##### 有形固定資産

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

#### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品・サービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

## (イ) 子会社等

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

## (ウ) 兄弟会社等

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

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

㈱野村総合研究所

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)



## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

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

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

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

#### 1株当たり情報

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

#### 中間財務諸表

##### 中間貸借対照表

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

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

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

## 中間損益計算書

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

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

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

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

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

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

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

## 中間損益計算書関係

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

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

## 中間株主資本等変動計算書関係

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

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

## 注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 未収委託者報酬、(4) 未収収益

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

## その他有価証券

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

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

## (6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

## (7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

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

## 有価証券関係

当中間会計期間末（平成27年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(平成27年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(平成27年9月30日)



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

### 3. その他有価証券(平成27年9月30日)

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

## 企業結合等関係

### 会社分割について

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

#### 1. 企業結合の概要

##### (1) 会社分割の目的

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

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

##### (2) 会社分割日程

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

## (3) 会社分割の方法

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

## 2. 実施した会計処理の概要

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

## セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 1 株当たり情報

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1) 受託者

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

\* 平成28年2月末現在

###### (2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
--------	------------------------	-----------

野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
------------	-----------	--------------------

\* 平成28年2月末現在

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託者

ファンドの受託会社(受託者)として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行ないます。

### (2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いを行ない、信託契約の一部解約に関する事務、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」と称して使用する場合があります。
- (6) 目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含む)も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載する場合があります。
- (7) 目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8) 目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年6月12日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

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

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

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

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年4月8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Aの平成27年2月18日から平成28年2月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村DC運用戦略ファンドAの平成28年2月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月20日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

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

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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



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

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

#### 中間監査意見

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

#### 利害関係

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

以 上

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