

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年9月17日提出
【計算期間】	第1期(自 平成27年2月27日至 平成27年6月29日)
【ファンド名】	マイターゲット2050（確定拠出年金向け）
【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
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「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。

国内および外国の各株式、国内および外国の各債券等を投資対象とする別に定める親投資信託証券（マザーファンド）を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行なうことを基本とします。

投資対象とする別に定める親投資信託証券とは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「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」とします。

## 信託金の限度額

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

## &lt;商品分類&gt;

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

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

(マイターゲット2050(確定拠出年金向け))

## 《商品分類表》

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

## 《属性区分表》

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

#### <商品分類表定義>

##### [単位型投信・追加型投信の区分]

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

##### [投資対象地域による区分]

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

##### [投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1)株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載

があるものをいう。

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### 株式

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

##### 債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

#### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

#### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載が

あるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [投資形態による属性区分]

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

#### [為替ヘッジによる属性区分]

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

#### [インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

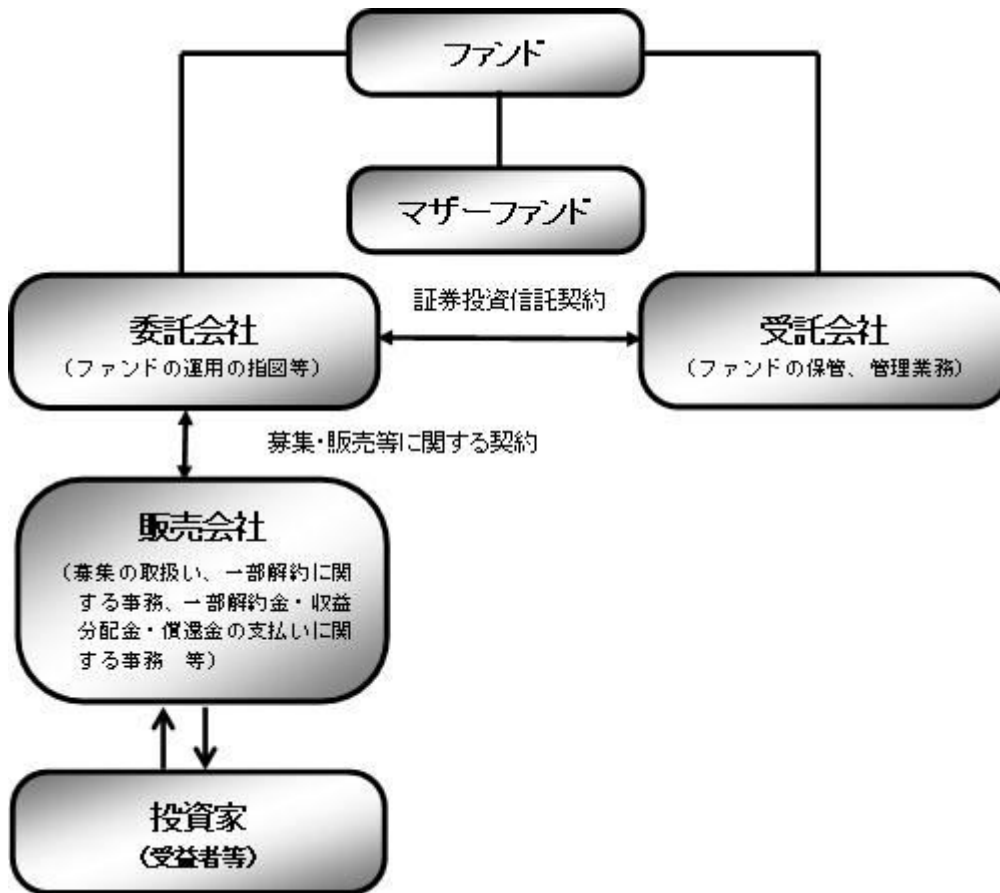
#### [特殊型]

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

## (2)【ファンドの沿革】

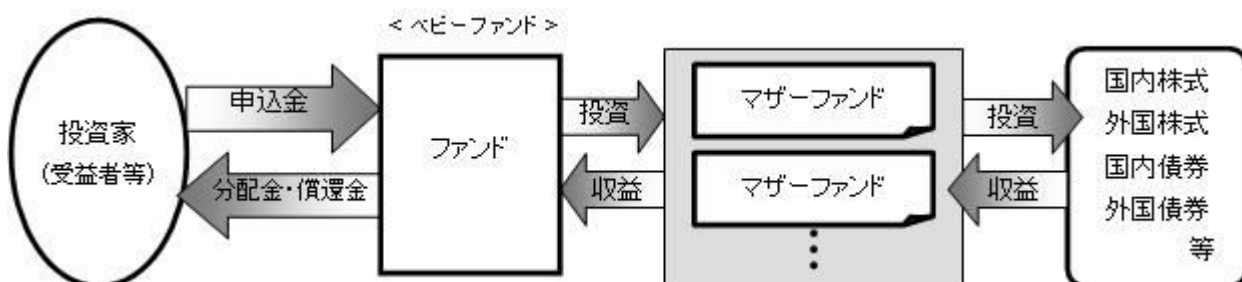
平成27年2月27日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】



#### 《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	マイターゲット2050（確定拠出年金向け）
マザーファンド* (親投資信託)	国内株式マザーファンド
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド
	外国債券マザーファンド
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

上記のマザーファンドの他、「新興国株式マザーファンド」、「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」に投資する場合があります。

\*当初設定時に投資するマザーファンド

## 委託会社の概況(平成27年7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 野村證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】

2050年をターゲットイヤーとし、定期的に各資産（国内株式、外国株式、国内債券、外国債券等）への基本投資割合を変更することで、ターゲットイヤーの5年前となる2045年7月に近づくにしたい、リスクの漸減を図ることを基本とします。

定期的な基本投資割合の変更は、家計や市場の構造変化等を考慮し、当面、原則年1回行なうことを基本とします。

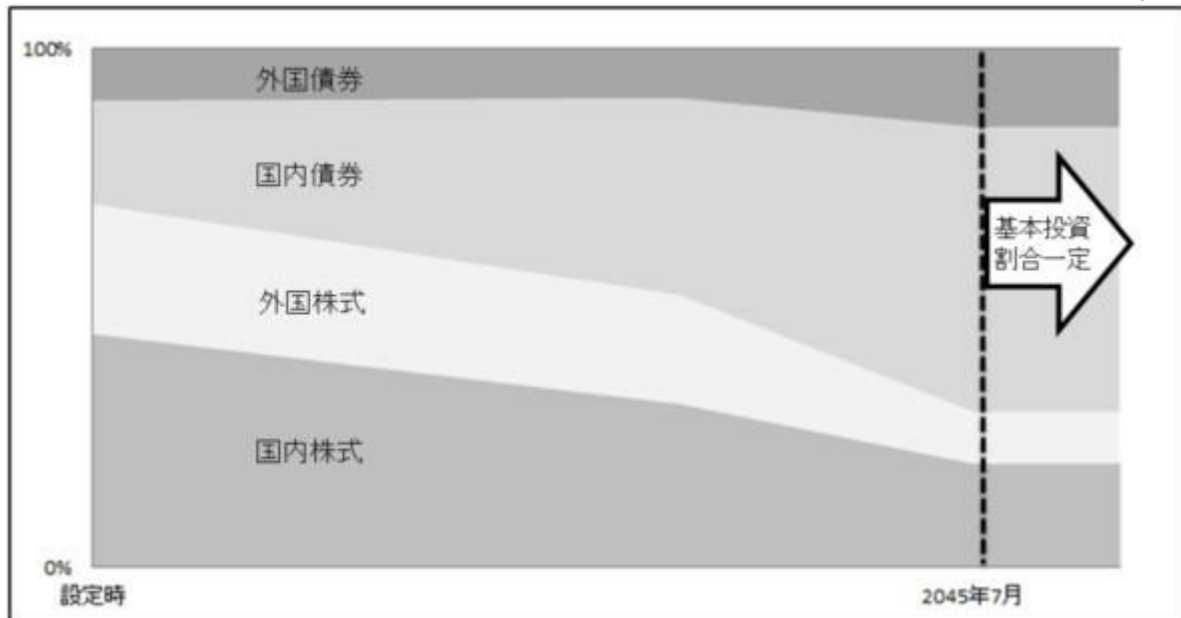
当初設定時および2045年7月以降の各資産への基本投資割合はそれぞれ以下を基本とします。

## 基本投資割合

	当初設定時	2045年7月以降
国内株式	45%	20%
外国株式	25%	10%
国内債券	20%	55%
外国債券	10%	15%

上記の基本投資割合は、2015年9月現在のものです。

## 基本投資割合のイメージ図



投資を行なうマザーファンドは、原則として、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すものとし、別に定めるマザーファンドの中から、市場構造等を勘案し、各マザーファンドへの投資比率を決定します。

一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。また、基本投資割合の変更に際し、新たにマザーファンドを投資対象に追加する場合があります。

当初設定時に投資するマザーファンドは、以下の通りです。各マザーファンドは、各々以下の対象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。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし）*
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI 総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）
外国債券マザーファンド	外国の公社債	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）

ファンドは上記のマザーファンドの他、「新興国株式マザーファンド」、「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」に投資する場合があります。

\* MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

ファンドは、投資対象とする各マザーファンドが連動を目指す対象指数の月次リターンに、各資産への基本投資割合を掛け合わせた合成指数をベンチマークとします。

2045年7月以降、マザーファンドを通じた各資産への基本投資割合を一定とします。また、各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する各資産への実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する安定運用を行ないます。

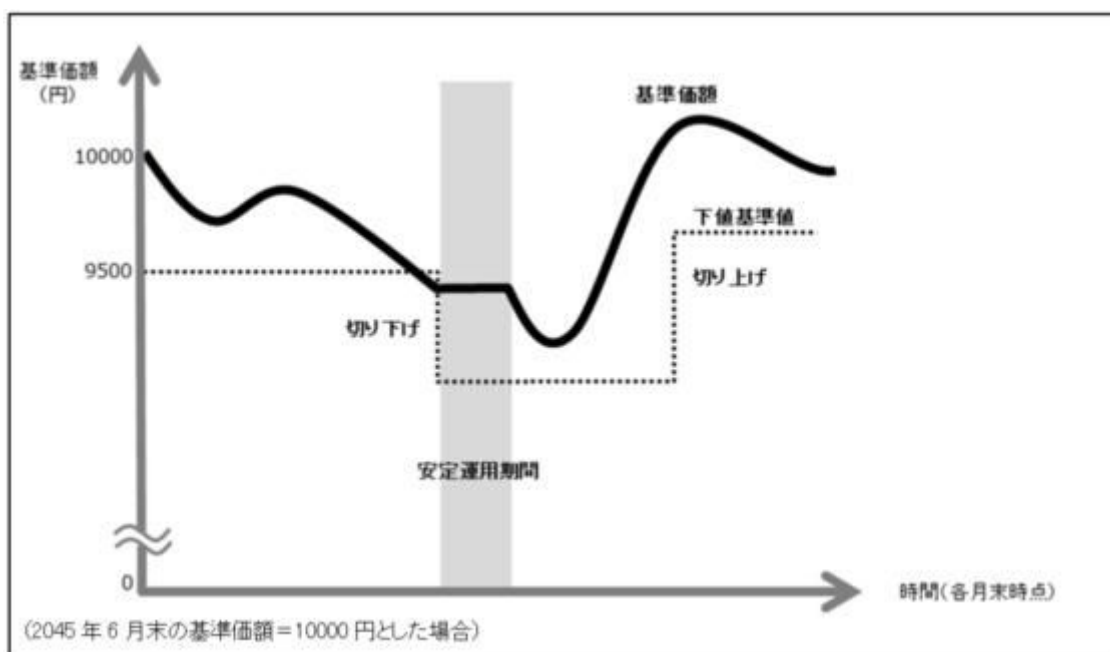


安定運用を行なうにあたっては、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の売建てを行なう場合があります。

- ・委託会社の定める下値基準値は、当初、2045年6月末の基準価額の95%程度とします。毎月末の基準価額を勘案して下値基準値を見直すことを基本とし、原則として、月末の基準価額が下値基準値を下回った場合には切り下げを行ない、月末の基準価額が直近の下値基準値改定時（一度も改定されていない場合は2045年6月末）の基準価額を一定水準上回った場合には切り上げを行ないます。
- ・安定運用に切り替えた場合の、安定運用を行なう一定期間は、3ヵ月程度を基本とします。なお、当該期間は、市況動向等により見直される場合があります。

当ファンドにおいては、上記のような運用を「下値保全に配慮した運用」という場合があります。

#### 基準価額と下値保全に配慮した運用（イメージ図）



実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。ただし、2045年7月以降、安定運用を行なう場合においては為替ヘッジを行なう場合があります。

#### 当初設定時に投資する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 ]

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

## 東証株価指数（TOPIX）の著作権等について

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。

## [ 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。

## MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の著作権等について

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

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

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

#### [ 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド ]

- ・主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

「NOMURA-BPI総合」は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

##### NOMURA-BPI総合の著作権等について

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

#### [ 外国債券マザーファンド ]

- ・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。

##### 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)の著作権等について

- ・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)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。

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】

別に定めるマザーファンドを主要投資対象とし、実質的に国内および外国の各株式、国内および外国の各債券等に投資を行いません。なお、株式、公社債および短期有価証券等に直接投資する場合があります。また、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等を取引対象とします。

当初設定時に投資するマザーファンドと、主要投資対象は以下の通りです。

マザーファンド名	主要投資対象
国内株式マザーファンド	わが国の株式
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債
外国債券マザーファンド	外国の公社債

ファンドは上記のマザーファンドの他、「新興国株式マザーファンド」、「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」に投資する場合があります。

### 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。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ．有価証券
  - ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（５）投資制限 および 」に定めるものに限ります。）に係る権利
  - ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ．為替手形

### 有価証券の指図範囲等(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別に定める親投資信託証券（以下「各マザーファンド」といいます。）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. 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。）
8. 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。）

す。)

9. 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。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 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。）
14. 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。）
15. 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。）
16. 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。）
17. 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。）
18. 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。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 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17号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
21. 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12号、第17号および第18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6号までの証券ならびに第12号、第17号および第18号の証券または証書のうち第2号から第6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13号および第14号の証券ならびに第17号の証券または証書のうち第13号および第14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

#### その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引

(参考)当初設定時に投資する各マザーファンドの概要

「国内株式マザーファンド」

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1.基本方針

この投資信託は、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

## 2.運用方法

## (1)投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

## (2)投資態度

主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。

非株式割合(株式以外の資産への投資割合)は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1.基本方針

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

## 2.運用方法

## (1)投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

## (2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1.基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合(NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

### 2.運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3)投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

## 「外国債券マザーファンド」

### 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1.基本方針

この投資信託は、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

#### 2.運用方法

##### (1)投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

##### (3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

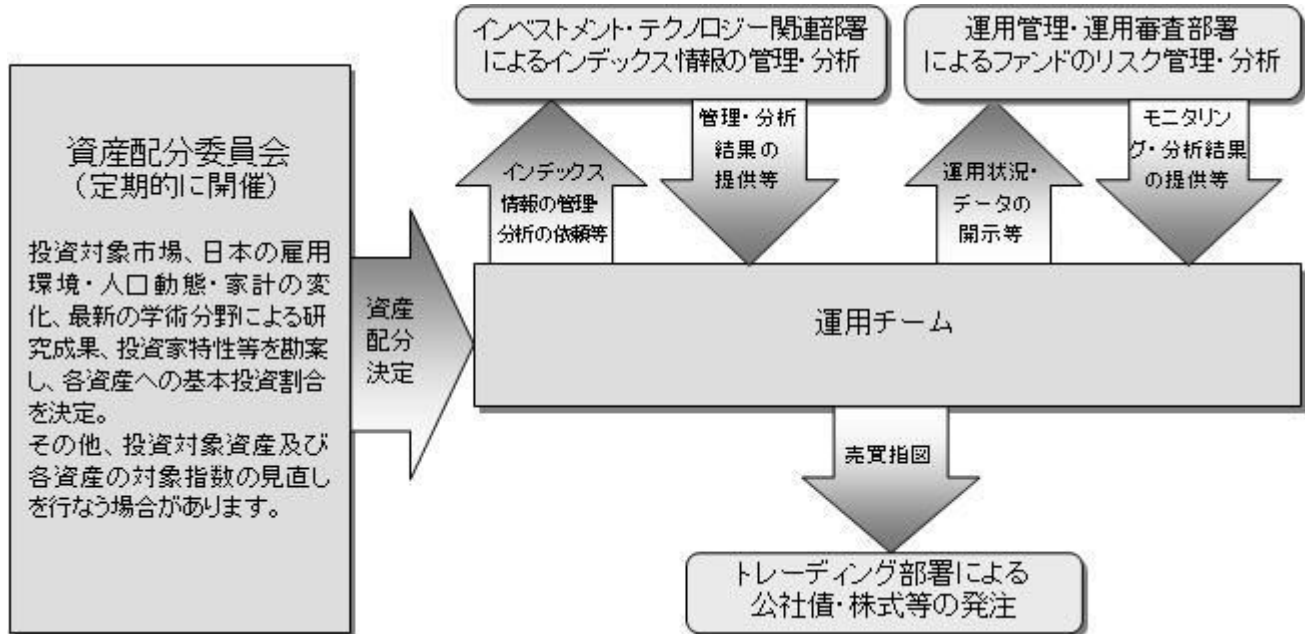
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エ



クロスボーダ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】

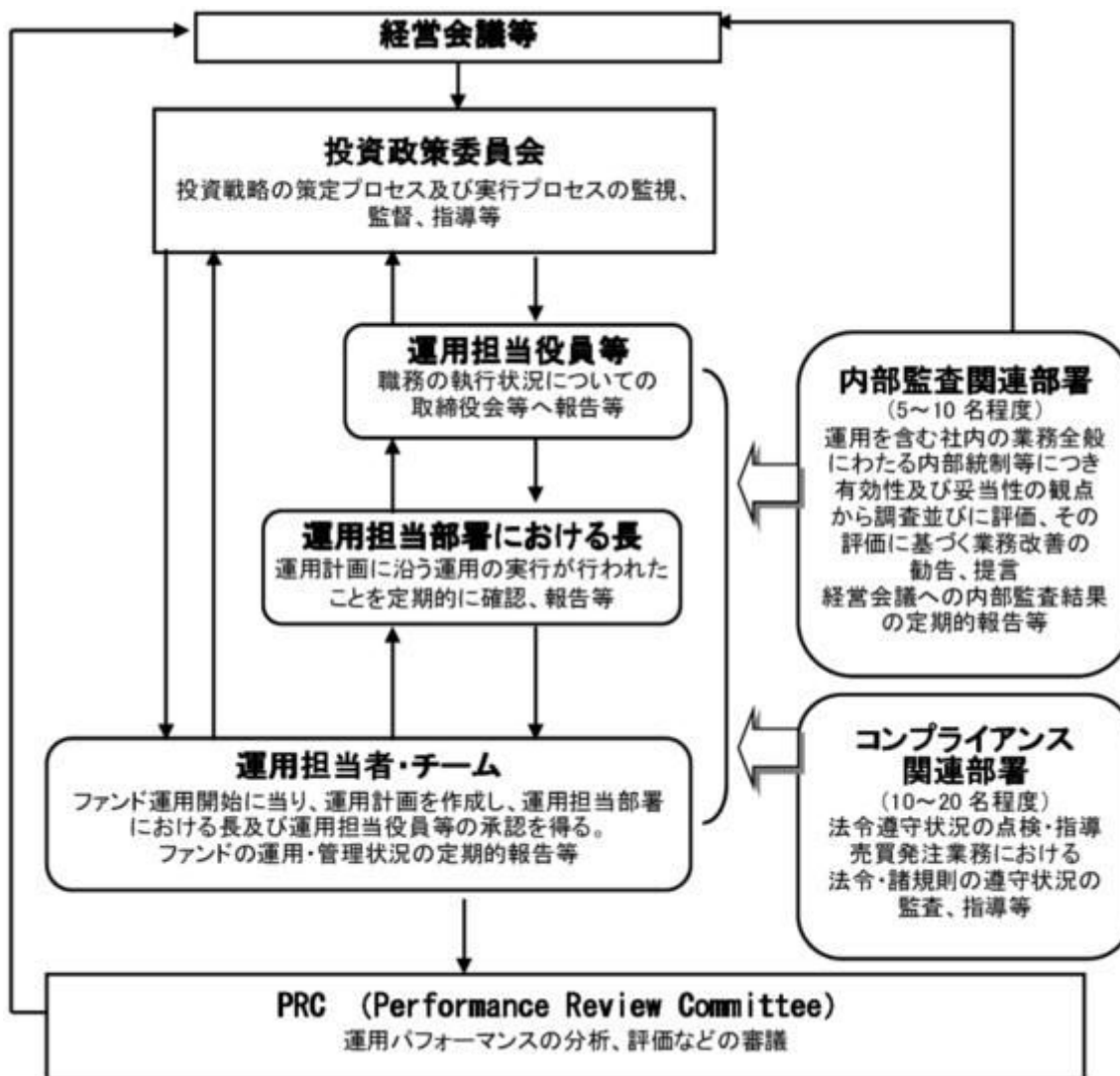
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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6月28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(信託約款)

- ・ 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。
- ・ 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。
- ・ 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。

##### 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

株予約権に限りません。)の行使により取得可能な株券

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。

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(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。

### 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。

### 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、投資者の皆様は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。

## [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。

## [為替変動リスク]

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

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。

ファンドの基準価額とファンドのベンチマークである合成指数は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が合成指数に連動または上回ることを保証するものではありません。なお、安定運用期間中は、ファンドの基準価額は合成指数には連動しません。

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。

2045年7月以降の運用においては、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、安定運用への切り替えを行なうことで、基準価額の大幅な下落を回避することを目指しますが、必ずしもある一定水準の基準価額が保全されることを示唆するものではありません。

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。

## 委託会社におけるリスクマネジメント体制

## リスク管理関連の委員会

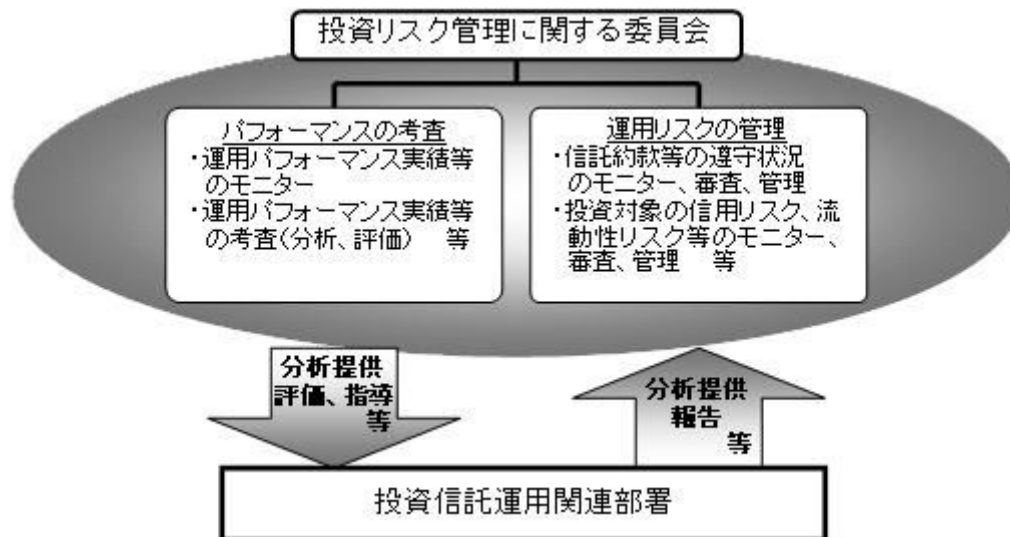
### パフォーマンスの考査

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

### 運用リスクの管理

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

## リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

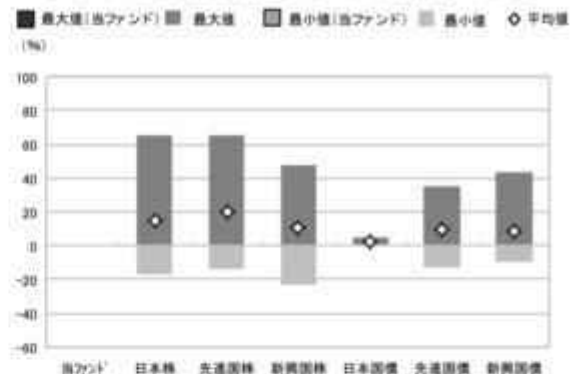
## リスクの定量的比較

(2010年8月末～2015年7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(%)	—	65.0	65.7	47.4	4.5	34.9	43.7
最小値(%)	—	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△12.7	△10.1
平均値(%)	—	14.9	20.1	10.6	2.4	9.3	8.5

- 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。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、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。また、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク(合成指数)の騰落率は掲載しておりません。

- 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。
- 2010年8月から2015年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク(合成指数)の騰落率は掲載しておりません。

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

## ＜代表的な資産クラスの指数＞

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

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 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・ショート両方を合わせてポジションを持って、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。証券または金融商品全般、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成りまたはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ、NYSE、SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA、JPSI、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下記の信託報酬率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。

信託報酬率の配分については次の通り(税抜)とします。

計算期間	信託報酬率	<委託会社>	<販売会社>	<受託会社>
1期～21期 (設定日～ 2035年決算日)	年0.3888% (税抜年0.36%)	年0.16%	年0.16%	年0.04%
22期～31期 (2035年決算日翌日～ 2045年決算日)	年0.3672% (税抜年0.34%)	年0.15%	年0.15%	年0.04%
32期以降 (2045年決算日翌日以降)	年0.3456% (税抜年0.32%)	年0.14%	年0.14%	年0.04%

## 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等は、受益者の負担とし、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、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。

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。

\* 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。

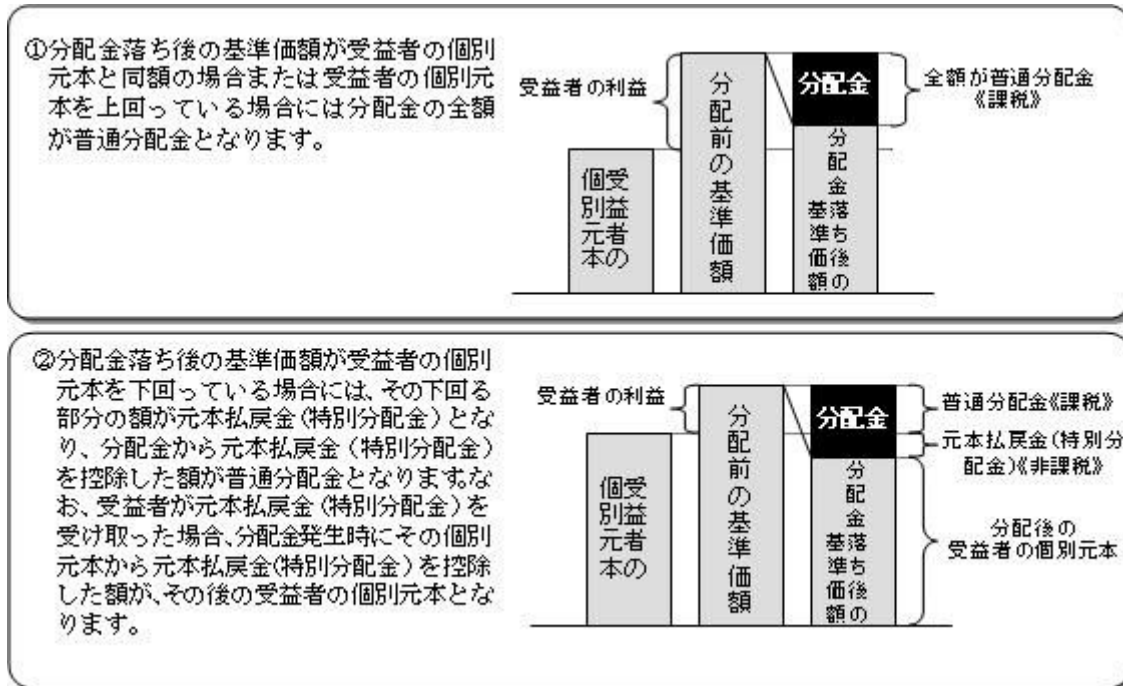
#### 換金(解約)時および償還時の課税について

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27年7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27年 7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】

マイターゲット2050（確定拠出年金向け）

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	16,595,886	99.74
現金・預金・その他資産(負債控除後)		43,223	0.25
合計(純資産総額)		16,639,109	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	278,711,526,420	98.83
現金・預金・その他資産(負債控除後)		3,281,704,071	1.16
合計(純資産総額)		281,993,230,491	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	3,270,200,000	1.15

(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	209,933,223,676	60.21
	カナダ	12,507,043,282	3.58
	ドイツ	12,812,952,321	3.67
	イタリア	3,519,323,839	1.00
	フランス	13,536,046,945	3.88
	オランダ	4,048,652,214	1.16
	スペイン	5,115,818,386	1.46
	ベルギー	1,863,226,850	0.53
	オーストリア	247,210,999	0.07
	ルクセンブルグ	158,288,980	0.04
	フィンランド	1,205,509,955	0.34
	アイルランド	538,416,673	0.15
	ポルトガル	216,186,355	0.06
	イギリス	28,746,305,369	8.24
	スイス	13,783,073,095	3.95
	スウェーデン	4,178,986,992	1.19
	ノルウェー	895,513,294	0.25
	デンマーク	2,480,108,455	0.71
	オーストラリア	8,852,438,821	2.53
	ニュージーランド	182,420,878	0.05
香港	4,371,528,882	1.25	
シンガポール	1,785,895,389	0.51	
イスラエル	966,873,788	0.27	
小計		331,945,045,438	95.21
投資信託受益証券	アメリカ	37,566,134	0.01
投資証券	アメリカ	5,967,507,874	1.71
	カナダ	57,873,723	0.01
	フランス	479,653,959	0.13
	イギリス	496,984,307	0.14
	オーストラリア	816,828,563	0.23
	香港	143,840,000	0.04
	シンガポール	137,042,166	0.03
小計		8,099,730,592	2.32

現金・預金・その他資産(負債控除後)		8,560,306,481	2.45
合計(純資産総額)		348,642,648,645	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	5,714,786,380	1.63
	買建	カナダ	322,650,405	0.09
	買建	ドイツ	1,155,998,130	0.33
	買建	イギリス	781,503,396	0.22
	買建	スイス	360,629,081	0.10

## (参考)国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	451,024,223,610	77.45
地方債証券	日本	42,308,761,624	7.26
特殊債券	日本	55,720,243,505	9.56
社債券	日本	30,772,475,680	5.28
現金・預金・その他資産(負債控除後)		2,514,300,181	0.43
合計(純資産総額)		582,340,004,600	100.00

## (参考)外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	249,995,676,110	42.12
	カナダ	12,424,184,449	2.09
	メキシコ	5,770,541,895	0.97
	ドイツ	29,676,786,205	5.00
	イタリア	66,478,450,942	11.20
	フランス	53,637,708,252	9.03
	オランダ	13,587,462,500	2.28
	スペイン	39,632,234,572	6.67
	ベルギー	14,312,851,887	2.41
	オーストリア	8,821,192,579	1.48
	フィンランド	3,139,032,432	0.52
	アイルランド	6,771,167,566	1.14
	イギリス	51,134,995,454	8.61
	スイス	1,742,844,430	0.29

	スウェーデン	2,804,764,777	0.47
	ノルウェー	1,694,219,231	0.28
	デンマーク	4,026,297,928	0.67
	ポーランド	3,373,614,962	0.56
	オーストラリア	9,393,064,927	1.58
	シンガポール	2,192,418,909	0.36
	マレーシア	3,038,770,309	0.51
	南アフリカ	3,049,919,138	0.51
	小計	586,698,199,454	98.85
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,814,547,497	1.14
合計（純資産総額）		593,512,746,951	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## マイターゲット2050（確定拠出年金向け）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	4,927,343	1.4858	7,321,133	1.5171	7,475,272	44.92
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	1,807,195	2.3046	4,164,891	2.3208	4,194,138	25.20
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総 合マザーファンド	2,623,069	1.2452	3,266,461	1.2479	3,273,327	19.67
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	697,561	2.3291	1,624,734	2.3699	1,653,149	9.93

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.74
合計	99.74

## (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	1,579,600	8,236.19	13,009,900,004	8,253.00	13,036,438,800	4.62
2	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	9,066,300	872.81	7,913,235,507	900.00	8,159,670,000	2.89
3	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	854,600	5,385.19	4,602,189,642	5,544.00	4,737,902,400	1.68
4	日本	株式	みずほフィナンシ ャルグループ	銀行業	15,850,700	235.23	3,728,560,170	267.90	4,246,402,530	1.50

5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	884,300	4,107.18	3,631,986,930	4,763.50	4,212,363,050	1.49
6	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	597,500	7,384.54	4,412,268,475	6,881.00	4,111,397,500	1.45
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,030,300	4,200.98	4,328,273,420	3,979.50	4,100,078,850	1.45
8	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	758,400	4,310.70	3,269,238,493	4,813.50	3,650,558,400	1.29
9	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,147,900	2,876.67	3,302,138,655	3,150.50	3,616,458,950	1.28
10	日本	株式	ソニー	電気機器	804,600	3,709.67	2,984,802,210	3,533.00	2,842,651,800	1.00
11	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	449,300	6,204.66	2,787,757,512	6,240.00	2,803,632,000	0.99
12	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	472,700	5,159.97	2,439,120,422	5,724.00	2,705,734,800	0.95
13	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	209,800	10,999.77	2,307,752,175	12,250.00	2,570,050,000	0.91
14	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,342,700	1,812.48	2,433,621,860	1,867.00	2,506,820,900	0.88
15	日本	株式	ファナック	電気機器	119,200	25,388.00	3,026,250,308	20,680.00	2,465,056,000	0.87
16	日本	株式	キヤノン	電気機器	616,400	4,250.87	2,620,238,200	3,972.00	2,448,340,800	0.86
17	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	457,800	4,998.33	2,288,237,130	5,165.00	2,364,537,000	0.83
18	日本	株式	三菱商事	卸売業	866,000	2,647.30	2,292,566,487	2,679.50	2,320,447,000	0.82
19	日本	株式	三菱地所	不動産業	840,000	2,749.07	2,309,226,720	2,755.00	2,314,200,000	0.82
20	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	871,500	2,188.16	1,906,982,315	2,614.50	2,278,536,750	0.80
21	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	102,500	21,348.96	2,188,268,610	21,720.00	2,226,300,000	0.78
22	日本	株式	日立製作所	電気機器	2,749,000	823.69	2,264,347,800	804.40	2,211,295,600	0.78
23	日本	株式	村田製作所	電気機器	120,100	18,122.47	2,176,509,129	18,400.00	2,209,840,000	0.78
24	日本	株式	三井不動産	不動産業	599,000	3,516.75	2,106,537,600	3,528.50	2,113,571,500	0.74
25	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	2,310,100	807.08	1,864,450,160	881.40	2,036,122,140	0.72
26	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,395,400	1,697.29	2,368,408,770	1,457.00	2,033,097,800	0.72
27	日本	株式	花王	化学	322,500	5,642.30	1,819,644,963	6,291.00	2,028,847,500	0.71
28	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,607,100	1,254.76	2,016,533,044	1,198.50	1,926,109,350	0.68
29	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	404,700	4,880.41	1,975,103,600	4,678.00	1,893,186,600	0.67
30	日本	株式	第一生命保険	保険業	724,000	2,051.49	1,485,285,521	2,522.00	1,825,928,000	0.64

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.37
		建設業	2.59
		食料品	4.45
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.23
		化学	5.83
		医薬品	4.90
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.91
		ガラス・土石製品	0.92

鉄鋼	1.27
非鉄金属	0.90
金属製品	0.57
機械	4.50
電気機器	11.69
輸送用機器	10.88
精密機器	1.41
その他製品	1.57
電気・ガス業	2.29
陸運業	4.15
海運業	0.26
空運業	0.68
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	6.95
卸売業	4.00
小売業	4.82
銀行業	9.62
証券、商品先物取引業	1.41
保険業	2.74
その他金融業	1.32
不動産業	2.82
サービス業	3.17
合 計	98.83

## (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	512,800	15,675.08	8,038,185,843	15,178.77	7,783,675,717	2.23
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフ トウ ェ ア	686,400	5,090.98	3,494,452,814	5,814.99	3,991,412,705	1.14
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石 油・ガ ス・消 耗燃 料	369,400	10,613.30	3,920,556,525	10,296.56	3,803,549,412	1.09
4	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	431,200	6,797.89	2,931,254,312	7,212.92	3,110,213,691	0.89
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	244,900	12,586.91	3,082,534,687	12,384.15	3,032,879,217	0.86
6	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コン グロ マ リ ッ ト	886,700	3,120.18	2,766,669,838	3,239.92	2,872,841,320	0.82
7	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	328,400	7,579.66	2,489,161,067	8,563.72	2,812,326,173	0.80
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	284,100	9,502.22	2,699,582,505	9,346.50	2,655,343,207	0.76
9	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	202,700	12,526.89	2,539,201,467	12,821.00	2,598,816,700	0.74
10	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	540,100	4,336.55	2,342,174,192	4,431.94	2,393,695,763	0.68
11	アメリカ	株式	AT & T INC	各 種電 気通 信サ ービ ス	541,174	4,072.51	2,203,941,042	4,316.59	2,336,027,359	0.67



12	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・カタログ販売	34,790	46,636.79	1,622,493,981	66,579.71	2,316,308,125	0.66
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	237,900	10,252.03	2,438,958,300	9,599.45	2,283,710,487	0.65
14	スイス	株式	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	医薬品	61,910	33,972.08	2,103,211,490	35,732.12	2,212,175,983	0.63
15	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	インターネットソフトウェア・サービス	27,100	68,083.67	1,845,067,615	78,466.46	2,126,441,164	0.60
16	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	366,200	6,088.04	2,229,440,558	5,788.94	2,119,912,318	0.60
17	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	メディア	142,300	13,187.01	1,876,512,521	14,888.52	2,118,636,567	0.60
18	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	177,400	10,329.07	1,832,377,939	11,809.84	2,095,067,106	0.60
19	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	927,200	1,929.51	1,789,047,922	2,248.84	2,085,129,269	0.59
20	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	インターネットソフトウェア・サービス	25,290	69,553.32	1,759,003,600	82,432.02	2,084,705,847	0.59
21	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	267,400	6,415.66	1,715,549,570	7,303.47	1,952,949,268	0.56
22	アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	バイオテクノロジー	131,200	12,534.51	1,644,528,308	14,624.31	1,918,710,259	0.55
23	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	165,700	13,231.22	2,192,413,485	11,539.44	1,912,085,407	0.54
24	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,694,000	1,127.61	1,910,171,677	1,116.34	1,891,083,755	0.54
25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	365,600	5,025.05	1,837,160,360	5,031.06	1,839,356,413	0.52
26	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	250,200	7,234.29	1,810,020,642	7,258.82	1,816,156,964	0.52
27	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	101,830	18,084.00	1,841,494,370	17,719.11	1,804,337,379	0.51
28	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	116,200	14,210.52	1,651,262,827	14,445.69	1,678,590,154	0.48
29	アメリカ	株式	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	情報技術サービス	82,780	20,182.57	1,670,713,192	19,965.47	1,652,742,302	0.47
30	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	173,200	8,150.40	1,411,649,722	9,474.17	1,640,927,145	0.47

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー設備・サービス	0.84
		石油・ガス・消耗燃料	6.39
		化学	2.62
		建設資材	0.31
		容器・包装	0.23
		金属・鉱業	1.20
		紙製品・林産品	0.14
		航空宇宙・防衛	2.01
		建設関連製品	0.22
		建設・土木	0.29
		電気設備	0.73
		コングロマリット	1.88
		機械	1.34

商社・流通業	0.28
商業サービス・用品	0.38
航空貨物・物流サービス	0.56
旅客航空輸送業	0.15
海運業	0.08
陸運・鉄道	0.86
運送インフラ	0.19
自動車部品	0.56
自動車	1.10
家庭用耐久財	0.44
レジャー用品	0.08
繊維・アパレル・贅沢品	1.26
ホテル・レストラン・レジャー	1.71
メディア	3.12
販売	0.08
インターネット販売・カタログ販売	1.10
複合小売り	0.58
専門小売り	1.87
食品・生活必需品小売り	2.15
飲料	2.16
食品	2.17
タバコ	1.38
家庭用品	1.39
パーソナル用品	0.66
ヘルスケア機器・用品	1.57
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.90
バイオテクノロジー	2.37
医薬品	7.64
銀行	9.43
各種金融サービス	1.31
保険	4.23
不動産管理・開発	0.64
インターネットソフトウェア・サービス	2.24
情報技術サービス	2.44
ソフトウェア	2.82
通信機器	1.17
コンピュータ・周辺機器	2.77
電子装置・機器・部品	0.32
半導体・半導体製造装置	1.62
各種電気通信サービス	2.64
無線通信サービス	0.47
電力	1.55

	ガス	0.14
	総合公益事業	1.14
	水道	0.08
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.04
	消費者金融	0.50
	資本市場	2.23
	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	0.09
	ヘルスケア・テクノロジー	0.07
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.44
	専門サービス	0.49
投資信託受益証券		0.01
投資証券		2.32
合 計		97.54

## (参考) 国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	7,300,000,000	100.46	7,333,937,000	100.56	7,341,026,000	0.2	2018/9/20	1.26
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	99.93	7,295,091,000	100.09	7,306,716,000	0.1	2020/3/20	1.25
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	6,800,000,000	99.91	6,794,243,000	100.13	6,808,840,000	0.1	2019/12/20	1.16
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	6,400,000,000	100.43	6,427,776,000	100.57	6,437,056,000	0.2	2019/3/20	1.10
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	6,100,000,000	100.45	6,127,714,000	100.57	6,134,953,000	0.2	2018/12/20	1.05
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,600,000,000	104.31	5,841,892,000	104.24	5,837,888,000	0.8	2023/6/20	1.00
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,500,000,000	102.73	5,650,580,000	102.77	5,652,460,000	0.6	2023/3/20	0.97
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 6回	5,600,000,000	100.38	5,621,392,000	100.41	5,623,240,000	0.2	2017/9/20	0.96
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	100.40	5,522,000,000	100.57	5,531,680,000	0.2	2019/9/20	0.94
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,200,000,000	102.47	5,328,830,000	102.53	5,331,820,000	0.6	2023/12/20	0.91
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	5,200,000,000	101.26	5,265,536,000	101.37	5,271,292,000	0.5	2024/9/20	0.90
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,900,000,000	104.25	5,108,345,000	104.32	5,112,023,000	0.8	2022/9/20	0.87

13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 3回	5,000,000,000	100.77	5,038,500,000	100.81	5,040,950,000	0.3	2018/6/20	0.86
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 8回	5,000,000,000	100.41	5,020,950,000	100.58	5,029,000,000	0.2	2019/6/20	0.86
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,650,000,000	106.01	4,929,558,000	105.85	4,922,257,500	1.2	2020/12/20	0.84
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	4,900,000,000	100.21	4,910,436,000	100.13	4,906,811,000	0.4	2025/3/20	0.84
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	4,500,000,000	102.39	4,607,826,000	102.43	4,609,620,000	0.6	2024/3/20	0.79
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 5回	4,500,000,000	100.35	4,516,185,000	100.37	4,516,875,000	0.2	2017/6/20	0.77
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	4,100,000,000	105.53	4,326,935,000	105.36	4,320,088,000	1.3	2019/12/20	0.74
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第34 9回	4,300,000,000	100.13	4,305,633,000	100.15	4,306,579,000	0.1	2017/2/15	0.73
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第34 8回	4,200,000,000	100.12	4,205,250,000	100.14	4,206,048,000	0.1	2017/1/15	0.72
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	4,100,000,000	102.36	4,197,129,000	102.32	4,195,448,000	0.6	2024/6/20	0.72
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 9回	4,000,000,000	100.00	4,000,000,000	100.19	4,007,720,000	0.1	2019/6/20	0.68
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (40年)第1 回	3,160,000,000	124.06	3,920,427,400	124.20	3,924,814,800	2.4	2048/3/20	0.67
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 10回	3,700,000,000	104.69	3,873,751,000	104.59	3,869,904,000	1	2020/9/20	0.66
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第10 7回	3,800,000,000	100.40	3,815,466,000	100.46	3,817,594,000	0.2	2017/12/20	0.65
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 20回	3,500,000,000	105.54	3,694,210,000	105.46	3,691,415,000	1	2021/12/20	0.63
28	日本	特殊債券	銀行等保有株式 取得機構債券 政府保証第27 回	3,500,000,000	100.03	3,501,310,000	100.02	3,500,875,000	0.1	2017/4/21	0.60
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 21回	3,000,000,000	116.00	3,480,159,000	115.70	3,471,090,000	1.9	2030/9/20	0.59
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 27回	3,300,000,000	104.28	3,441,306,000	104.32	3,442,692,000	0.8	2022/12/20	0.59

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	77.45
地方債証券	7.26
特殊債券	9.56
社債券	5.28
合計	99.56

## （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	30,500,000	13,729.19	4,187,403,714	13,625.01	4,155,630,719	3.625	2021/2/15	0.70
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	28,200,000	13,633.01	3,844,510,297	13,535.86	3,817,113,930	3.625	2020/2/15	0.64
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	29,300,000	13,047.45	3,822,905,048	12,962.18	3,797,918,740	2.625	2020/11/15	0.63
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	27,600,000	13,463.84	3,716,020,160	13,376.93	3,692,035,094	3.375	2019/11/15	0.62
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,600,000	13,592.37	3,615,572,470	13,485.95	3,587,264,697	3.5	2020/5/15	0.60
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,400,000	13,376.24	3,531,328,639	13,287.78	3,507,975,240	3.125	2021/5/15	0.59
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,400,000	13,295.53	3,510,021,900	13,224.79	3,491,345,882	3.125	2019/5/15	0.58
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	25,300,000	13,564.50	3,431,819,498	13,489.35	3,412,805,550	3.625	2019/8/15	0.57
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,000,000	13,101.81	3,406,472,504	13,041.64	3,390,827,053	2.75	2019/2/15	0.57
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	24,500,000	13,048.84	3,196,967,585	12,979.13	3,179,888,690	2.625	2020/8/15	0.53
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	24,600,000	12,938.12	3,182,778,300	12,871.08	3,166,287,526	2.75	2017/5/31	0.53
12	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,500,000	20,630.26	3,197,691,708	20,317.70	3,149,243,889	6	2025/10/25	0.53
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	24,300,000	13,095.46	3,182,198,021	12,946.67	3,146,042,025	2.75	2024/2/15	0.53
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	23,300,000	13,183.12	3,071,668,416	13,061.02	3,043,218,535	4.625	2016/11/15	0.51
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000	17,206.31	3,011,104,688	16,917.16	2,960,503,875	3.5	2026/4/25	0.49
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	17,500,000	17,135.93	2,998,787,970	16,916.92	2,960,461,657	8	2021/11/15	0.49
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	21,600,000	13,523.66	2,921,112,700	13,441.86	2,903,442,841	3.75	2018/11/15	0.48
18	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,200,000	17,629.85	2,856,036,107	17,458.80	2,828,326,817	4.25	2023/10/25	0.47
19	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,400,000	23,179.01	2,874,198,369	22,431.33	2,781,484,920	5.75	2032/10/25	0.46
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	21,400,000	12,946.67	2,770,589,341	12,880.29	2,756,382,864	3.125	2017/1/31	0.46
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	21,900,000	12,635.92	2,767,267,876	12,543.54	2,747,036,355	2.375	2024/8/15	0.46
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	13,700,000	20,233.65	2,772,010,385	19,804.56	2,713,225,748	6.5	2027/11/1	0.45
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	20,400,000	13,300.86	2,713,376,717	13,169.07	2,686,491,047	4.625	2017/2/15	0.45
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,300,000	13,291.44	2,698,162,931	13,211.71	2,681,977,639	3.5	2018/2/15	0.45
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,800,000	12,955.91	2,694,829,967	12,876.41	2,678,294,841	3.25	2016/12/31	0.45
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,800,000	12,861.05	2,675,100,291	12,805.67	2,663,580,660	2.375	2017/7/31	0.44

27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,700,000	12,804.41	2,650,514,763	12,686.96	2,626,202,014	2.5	2024/5/15	0.44
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,500,000	21,277.06	2,659,633,617	20,762.48	2,595,310,922	5.5	2029/4/25	0.43
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,500,000	13,101.72	2,554,836,375	12,969.93	2,529,136,837	2.75	2023/11/15	0.42
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,700,000	14,094.63	2,494,749,525	14,052.37	2,487,270,375	3.625	2044/2/15	0.41

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.85
合 計	98.85

## 【投資不動産物件】

マイターゲット2050(確定拠出年金向け)

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

マイターゲット2050(確定拠出年金向け)

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(2015年09月限)	買建	197	日本円	3,245,937,742	3,270,200,000	1.15

## (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(2015 年09月限)	買建	438	米ドル	45,522,902.5	5,646,660,825	46,072,125	5,714,786,380	1.63
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2015年09 月限)	買建	20	カナダ ドル	3,361,370	320,909,994	3,379,600	322,650,405	0.09
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指 数先物(2015年09 月限)	買建	238	ユーロ	8,331,660	1,131,022,849	8,515,640	1,155,998,130	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(2015年09月限)	買建	61	英ポンド	4,013,660	776,402,392	4,040,030	781,503,396	0.22
	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 (2015年09月限)	買建	30	スイス フラン	2,710,140	347,467,050	2,812,800	360,629,081	0.10

## (参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

## (参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

マイターゲット2050(確定拠出年金向け)

平成27年7月末日及び同日前1年以内における各月末(設定来)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	(2015年 6月29日)	13	13	1.0406	1.0411
	2015年 2月末日	1		1.0000	
	3月末日	3		1.0082	
	4月末日	8		1.0257	

5月末日	9		1.0615	
6月末日	14		1.0366	
7月末日	16		1.0539	

## 【分配の推移】

マイターゲット2050(確定拠出年金向け)

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2015年 2月27日～2015年 6月29日	0.0005円

## 【収益率の推移】

マイターゲット2050(確定拠出年金向け)

	計算期間	収益率
第1計算期間	2015年 2月27日～2015年 6月29日	4.1%

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

## (4)【設定及び解約の実績】

マイターゲット2050(確定拠出年金向け)

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2015年 2月27日～2015年 6月29日	13,077,212	120,638	12,956,574

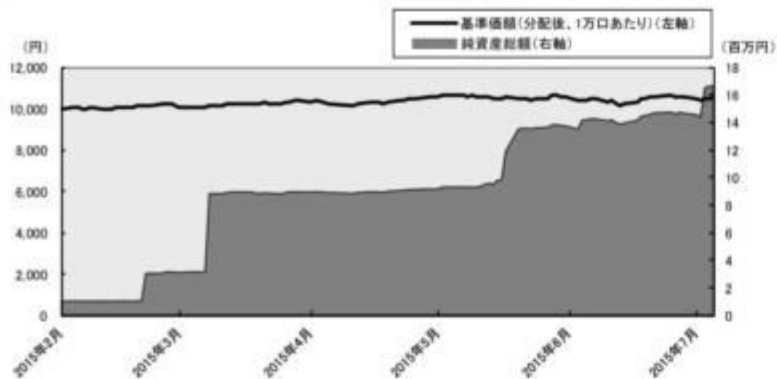
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

## 参考情報



**運用実績** (2015年7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)

2015年6月	5 円
---	---
---	---
---	---
---	---
設定来累計	5 円

**主要な資産の状況**

## 銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内株式マザーファンド	44.9
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	25.2
3	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	19.7
4	外国債券マザーファンド	9.9

## 実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2.1
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.3
3	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.8
4	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	0.7
5	日本電信電話	情報・通信業	0.7

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.6
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3
3	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.3
4	WELLS FARGO CO	銀行	0.2
5	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.2

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付(5年)第115回	国債証券	0.2
2	国庫債券 利付(5年)第123回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付(5年)第122回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付(5年)第117回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付(5年)第116回	国債証券	0.2

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1

**年間収益率の推移**

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、年1回基本投資割合を変更するため、暦年ベースで収益率を表示した場合、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマークは掲載していません。
- ・2015年は設定日(2015年2月27日)から運用実績作成基準日までの収益率。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- ・申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・取得申込みの受付については、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)とします。
- ・受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・取得申込日から起算して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。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。
- ・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号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があります。取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

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付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続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、換金申込日の翌営業日の基準価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
- ・金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

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

### 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1万口当たりの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時  
インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## （２）【保管】

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

## （３）【信託期間】

無期限とします(平成27年2月27日設定)。

## （４）【計算期間】

原則として、毎年6月29日から翌年6月28日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、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、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、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なうことが困難な場合には適用しません。

( )委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

( )委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の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つても、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」にしたがい、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の請求を行な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なう場合は、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1期計算期間(平成27年2月27日から平成27年6月29日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】



## 【マイターゲット2050（確定拠出年金向け）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 (平成27年 6月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		23,078
親投資信託受益証券		13,475,639
未収入金		33,548
流動資産合計		13,532,265
資産合計		13,532,265
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金		6,478
未払解約金		33,058
未払受託者報酬		1,100
未払委託者報酬		8,706
その他未払費用		100
流動負債合計		49,442
負債合計		49,442
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		12,956,574
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		526,249
（分配準備積立金）		235,052
元本等合計		13,482,823
純資産合計		13,482,823
負債純資産合計		13,532,265

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期
	自 平成27年 2月27日
	至 平成27年 6月29日
営業収益	
受取利息	4
有価証券売買等損益	253,811
営業収益合計	253,815
営業費用	
受託者報酬	1,100
委託者報酬	8,706
その他費用	100
営業費用合計	9,906
営業利益又は営業損失（ ）	243,909
経常利益又は経常損失（ ）	243,909
当期純利益又は当期純損失（ ）	243,909
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（ ）	2,379
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	292,684
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	292,684
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,487
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,487
分配金	6,478
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	526,249

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成27年 2月27日から平成27年 6月29日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

第1期 平成27年 6月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	12,956,574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	1.0406円
(10,000口当たり純資産額)	(10,406円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第1期 自 平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日		
1. 分配金の計算過程		
項目	項目	
費用控除後の配当等収益額	A	35,853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	205,677円
収益調整金額	C	291,197円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	532,727円
当ファンドの期末残存口数	F	12,956,574口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	411円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	6,478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1期 自 平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成27年 6月29日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>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>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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日
<p>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。</p>

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第1期 自 平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	13,077,212円
期中一部解約元本額	120,638円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日	
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	244,866	
合計	244,866	

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成27年 6月29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27年 6月29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		6,005,522	
		外国債券マザーファンド		1,344,364	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド		3,378,501	

		国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド		2,747,252	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.9%		13,475,639	100.0%
	合計			13,475,639	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### (参考)

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド」、「国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成27年 6月29日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,053,321,112
株式	264,084,459,460
派生商品評価勘定	1,387,710
未収配当金	294,114,597
未収利息	10,041
その他未収収益	3,650,835
差入委託証拠金	89,895,000
流動資産合計	282,526,838,755
資産合計	282,526,838,755
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	113,228,922
未払解約金	287,935,319
未払利息	280,471
有価証券貸借取引受入金	12,463,469,718
流動負債合計	12,864,914,430
負債合計	12,864,914,430
純資産の部	
元本等	
元本	181,561,219,970
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	88,100,704,355
元本等合計	269,661,924,325
純資産合計	269,661,924,325
負債純資産合計	282,526,838,755

## 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 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27年 6月29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	1,4852円
(10,000口当たり純資産額)	(14,852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	11,574,845,770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27日 至 平成27年 6月29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	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成27年 6月29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27年 6月29日現在	
期首	平成27年 2月27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	180,566,673,341円
同期中における追加設定元本額	18,494,308,699円
同期中における一部解約元本額	17,499,762,070円
期末元本額	181,561,219,970円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	175,799,601円
バランスセレクト50	426,394,203円
バランスセレクト70	497,181,797円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,205,103,655円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	5,096,435,791円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	9,011,834,420円



野村資産設計ファンド2015	105,445,155円
野村資産設計ファンド2020	114,214,073円
野村資産設計ファンド2025	124,069,669円
野村資産設計ファンド2030	122,712,939円
野村資産設計ファンド2035	90,642,885円
野村資産設計ファンド2040	313,321,943円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	51,889,759,023円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	890,816,158円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	2,418,340,268円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	975,727,843円
野村資産設計ファンド2045	30,758,323円
野村インデックスファンド・TOPIX	764,778,856円
マイ・ロード	2,091,008,726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	209,648,525円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	300,922,052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）	1,648,453,383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）	741,165,931円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	5,049,127,914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）	1,214,000,139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）	13,586,125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）	43,526,216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）	22,156,356円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,154,836,141円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	511,577,951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）	3,319,633,654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）	1,247,301,408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）	2,180,251,942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）	510,415,093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）	76,116,814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）	409,570,595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）	6,498,192,394円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	896,899,078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）	795,630,907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）	3,125,897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）	100,451,091円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	9,612,234円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	33,373,201円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	34,221,817円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	80,276,353円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	3,364,060,641円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	10,606,682,142円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	15,111,530,411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）	30,129,659,812円
マイバランスDC30	1,745,469,663円
マイバランスDC50	2,299,602,721円
マイバランスDC70	2,166,797,761円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	6,684,491,629円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	4,043,578円

マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	208,980円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	254,093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27年 6月29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	53,000	283.00	14,999,000	貸付有価証券 19,000株(19,000株)
		日本水産	152,900	347.00	53,056,300	
		マルハニチロ	25,400	1,948.00	49,479,200	貸付有価証券 1,100株
		サカタのタネ	20,000	2,305.00	46,100,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
		ホクト	13,800	2,513.00	34,679,400	
		住石ホールディングス	34,500	119.00	4,105,500	貸付有価証券 14,200株(12,600株)
		日鉄鉱業	35,000	585.00	20,475,000	
		三井松島産業	81,000	131.00	10,611,000	貸付有価証券 7,000株
		国際石油開発帝石	655,200	1,393.50	913,021,200	
		日本海洋掘削	3,700	3,540.00	13,098,000	貸付有価証券 1,600株(200株)
		石油資源開発	17,700	3,870.00	68,499,000	
		K&Oエナジーグループ	8,400	1,838.00	15,439,200	
		ショーボンドホールディングス	12,000	5,090.00	61,080,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
		ミライト・ホールディングス	38,300	1,418.00	54,309,400	
		タマホーム	9,300	530.00	4,929,000	貸付有価証券 4,000株(1,300株)
		サンヨーホームズ	1,700	636.00	1,081,200	貸付有価証券 700株
ダイセキ環境ソリューション	1,400	1,956.00	2,738,400	貸付有価証券 100株		

安藤・間	83,000	662.00	54,946,000	
東急建設	44,200	834.00	36,862,800	貸付有価証券 19,400株
コムシスホールディングス	55,300	1,803.00	99,705,900	
ミサワホーム	14,700	1,059.00	15,567,300	
高松コンストラクショングループ	9,400	2,676.00	25,154,400	
東建コーポレーション	4,600	7,650.00	35,190,000	
ヤマウラ	5,800	498.00	2,888,400	
大成建設	646,000	703.00	454,138,000	貸付有価証券 15,000株(15,000株)
大林組	373,000	890.00	331,970,000	
清水建設	380,000	1,013.00	384,940,000	
飛島建設	85,100	207.00	17,615,700	貸付有価証券 37,400株
長谷工コーポレーション	155,500	1,417.00	220,343,500	
松井建設	14,000	655.00	9,170,000	
銭高組	18,000	353.00	6,354,000	貸付有価証券 2,000株
鹿島建設	547,000	575.00	314,525,000	
不動テトラ	94,100	198.00	18,631,800	貸付有価証券 41,400株
大末建設	4,800	771.00	3,700,800	貸付有価証券 200株(200株)
鉄建建設	76,000	363.00	27,588,000	貸付有価証券 33,000株
日鉄住金テックスエンジ	23,000	662.00	15,226,000	
西松建設	134,000	455.00	60,970,000	
三井住友建設	504,600	161.00	81,240,600	貸付有価証券 151,900株(134,100株)
大豊建設	34,000	602.00	20,468,000	貸付有価証券 14,000株
前田建設工業	83,000	835.00	69,305,000	貸付有価証券 32,000株(30,000株)
佐田建設	43,000	130.00	5,590,000	
ナカノフドー建設	9,500	554.00	5,263,000	
奥村組	118,000	626.00	73,868,000	
大和小田急建設	6,700	1,126.00	7,544,200	貸付有価証券

				2,900株(2,500株)
東鉄工業	14,900	2,553.00	38,039,700	
イチケン	14,000	269.00	3,766,000	貸付有価証券 6,000株
浅沼組	40,000	179.00	7,160,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
戸田建設	156,000	547.00	85,332,000	
熊谷組	156,000	363.00	56,628,000	
青木あすなろ建設	8,100	851.00	6,893,100	
北野建設	26,000	321.00	8,346,000	
植木組	15,000	243.00	3,645,000	
三井ホーム	16,000	568.00	9,088,000	
矢作建設工業	15,400	856.00	13,182,400	
ピーエス三菱	13,100	412.00	5,397,200	貸付有価証券 5,700株(1,100株)
日本ハウスホールディングス	20,600	563.00	11,597,800	貸付有価証券 9,000株
大東建託	46,500	12,470.00	579,855,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
新日本建設	14,800	548.00	8,110,400	
N I P P O	29,000	2,090.00	60,610,000	
東亜道路工業	23,000	464.00	10,672,000	
前田道路	39,000	2,275.00	88,725,000	
日本道路	37,000	614.00	22,718,000	
東亜建設工業	93,000	197.00	18,321,000	
若築建設	71,000	175.00	12,425,000	
東洋建設	37,300	458.00	17,083,400	貸付有価証券 16,400株
五洋建設	138,000	497.00	68,586,000	
大林道路	15,000	649.00	9,735,000	
世紀東急工業	18,100	550.00	9,955,000	
福田組	19,000	788.00	14,972,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
住友林業	91,700	1,499.00	137,458,300	
日本基礎技術	14,900	417.00	6,213,300	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
日成ビルド工業	34,000	379.00	12,886,000	貸付有価証券 10,000株
ヤマダ・エスバイエル	56,000	95.00	5,320,000	貸付有価証券

ホーム				23,000株
巴コーポレーション	15,500	416.00	6,448,000	貸付有価証券 6,800株
パナホーム	46,000	872.00	40,112,000	
大和ハウス工業	364,200	2,849.50	1,037,787,900	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
ライト工業	19,900	988.00	19,661,200	
積水ハウス	390,900	1,951.00	762,645,900	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
日特建設	16,700	476.00	7,949,200	貸付有価証券 400株(400株)
北陸電気工事	6,000	1,159.00	6,954,000	
ユアテック	20,000	873.00	17,460,000	
西部電気工業	10,000	457.00	4,570,000	
四電工	11,000	444.00	4,884,000	
中電工	18,000	2,378.00	42,804,000	
関電工	57,000	767.00	43,719,000	
きんでん	83,000	1,620.00	134,460,000	
東京エネシス	14,000	1,244.00	17,416,000	
トーエネック	17,000	754.00	12,818,000	
住友電設	9,800	1,692.00	16,581,600	
日本電設工業	20,300	2,168.00	44,010,400	
協和エクシオ	52,800	1,413.00	74,606,400	
新日本空調	10,500	1,080.00	11,340,000	貸付有価証券 800株
N D S	20,000	327.00	6,540,000	
九電工	23,000	2,127.00	48,921,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
三機工業	25,300	963.00	24,363,900	
日揮	125,000	2,306.50	288,312,500	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
中外炉工業	38,000	277.00	10,526,000	貸付有価証券 13,000株(13,000株)
ヤマト	11,000	409.00	4,499,000	
太平電業	17,000	1,201.00	20,417,000	
高砂熱学工業	34,200	1,470.00	50,274,000	
三晃金属工業	12,000	243.00	2,916,000	
朝日工業社	14,000	439.00	6,146,000	
明星工業	20,500	628.00	12,874,000	

大気社	17,700	2,958.00	52,356,600	
ダイダン	17,000	822.00	13,974,000	
日比谷総合設備	16,000	1,644.00	26,304,000	貸付有価証券 800株
東芝プラントシステム	20,200	1,472.00	29,734,400	貸付有価証券 8,700株
OSJBホールディングス	16,900	249.00	4,208,100	貸付有価証券 7,400株
東洋エンジニアリング	60,000	291.00	17,460,000	貸付有価証券 26,000株（1,000株）
千代田化工建設	90,000	1,084.00	97,560,000	
新興プランテック	25,500	1,045.00	26,647,500	
日本製粉	76,000	726.00	55,176,000	
日清製粉グループ本社	136,400	1,608.00	219,331,200	
日東富士製粉	10,000	341.00	3,410,000	
昭和産業	51,000	492.00	25,092,000	
鳥越製粉	9,900	710.00	7,029,000	貸付有価証券 400株
中部飼料	11,900	906.00	10,781,400	
フィード・ワンホールディングス	74,800	131.00	9,798,800	
東洋精糖	19,000	103.00	1,957,000	
日本甜菜製糖	63,000	198.00	12,474,000	
三井製糖	49,000	491.00	24,059,000	
塩水港精糖	13,300	263.00	3,497,900	
森永製菓	112,000	510.00	57,120,000	
中村屋	29,000	450.00	13,050,000	
江崎グリコ	28,700	5,920.00	169,904,000	
名糖産業	5,500	1,282.00	7,051,000	
不二家	71,000	193.00	13,703,000	
山崎製パン	91,000	2,041.00	185,731,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
第一屋製パン	17,000	122.00	2,074,000	貸付有価証券 6,000株（6,000株）
モロゾフ	19,000	394.00	7,486,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
亀田製菓	6,900	4,730.00	32,637,000	
寿スピリッツ	2,900	3,485.00	10,106,500	貸付有価証券 1,000株

カルビー	46,100	5,090.00	234,649,000	
森永乳業	112,000	444.00	49,728,000	
六甲バター	5,500	1,535.00	8,442,500	貸付有価証券 700株（700株）
ヤクルト本社	66,700	7,240.00	482,908,000	貸付有価証券 200株
明治ホールディングス	36,800	15,530.00	571,504,000	
雪印メグミルク	29,300	1,545.00	45,268,500	
プリマハム	74,000	373.00	27,602,000	貸付有価証券 13,000株（13,000株）
日本ハム	91,000	2,827.00	257,257,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
伊藤ハム	68,000	659.00	44,812,000	貸付有価証券 26,000株（26,000株）
林兼産業	40,000	125.00	5,000,000	貸付有価証券 17,000株（16,000株）
丸大食品	64,000	461.00	29,504,000	
米久	4,000	2,175.00	8,700,000	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
S Foods	7,800	2,393.00	18,665,400	貸付有価証券 3,400株（3,300株）
サッポロホールディングス	204,000	451.00	92,004,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
アサヒグループホールディングス	250,000	3,897.50	974,375,000	
キリンホールディングス	504,100	1,681.50	847,644,150	
宝ホールディングス	97,500	950.00	92,625,000	
オエノンホールディングス	32,000	218.00	6,976,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
養命酒製造	8,000	1,011.00	8,088,000	
コカ・コーラウエスト	42,100	2,200.00	92,620,000	貸付有価証券 18,500株（18,500株）
コカ・コーライースト ジャパン	37,800	2,219.00	83,878,200	貸付有価証券 5,500株（5,500株）
サントリー食品インター ナショナル	74,600	4,860.00	362,556,000	
ダイドードリンコ	6,300	5,300.00	33,390,000	貸付有価証券 2,700株
伊藤園	36,900	2,562.00	94,537,800	貸付有価証券 16,100株（1,600株）
キーコーヒー	10,900	2,031.00	22,137,900	

ユニカフェ	3,300	906.00	2,989,800	
ジャパンフーズ	1,600	1,118.00	1,788,800	貸付有価証券 700株
日清オイリオグループ	60,000	523.00	31,380,000	
不二製油	33,200	2,113.00	70,151,600	
かどや製油	1,200	2,705.00	3,246,000	貸付有価証券 400株
J - オイルミルズ	52,000	432.00	22,464,000	
キッコーマン	102,000	3,730.00	380,460,000	
味の素	287,000	2,644.50	758,971,500	
キュービー	63,300	2,605.00	164,896,500	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
ハウス食品グループ本社	46,000	2,327.00	107,042,000	貸付有価証券 16,100株
カゴメ	48,100	1,942.00	93,410,200	貸付有価証券 21,100株(11,600株)
焼津水産化学工業	5,900	1,010.00	5,959,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
アリアケジャパン	11,300	4,855.00	54,861,500	
エバラ食品工業	2,100	2,026.00	4,254,600	貸付有価証券 900株
ニチレイ	133,000	834.00	110,922,000	
東洋水産	65,000	4,400.00	286,000,000	貸付有価証券 5,000株
イトアンド	1,400	1,989.00	2,784,600	貸付有価証券 600株
日清食品ホールディングス	52,600	5,310.00	279,306,000	貸付有価証券 3,200株(2,600株)
永谷園	12,000	1,100.00	13,200,000	
一正蒲鉾	4,300	1,093.00	4,699,900	貸付有価証券 1,900株
フジッコ	12,000	2,388.00	28,656,000	
ロック・フィールド	6,500	2,855.00	18,557,500	貸付有価証券 2,700株(200株)
日本たばこ産業	689,400	4,309.50	2,970,969,300	貸付有価証券 24,600株(24,600株)
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,660.00	6,640,000	
わらべや日洋	7,300	2,980.00	21,754,000	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
なとり	5,700	1,480.00	8,436,000	貸付有価証券



				2,400株(1,800株)
ユーグレナ	41,600	1,766.00	73,465,600	貸付有価証券 6,600株
ミヨシ油脂	43,000	145.00	6,235,000	
理研ビタミン	3,700	3,915.00	14,485,500	貸付有価証券 100株
片倉工業	14,600	1,316.00	19,213,600	貸付有価証券 4,100株
グンゼ	94,000	333.00	31,302,000	
東洋紡	460,000	195.00	89,700,000	
ユニチカ	338,000	58.00	19,604,000	
富士紡ホールディングス	57,000	286.00	16,302,000	
日清紡ホールディングス	74,000	1,363.00	100,862,000	
倉敷紡績	119,000	264.00	31,416,000	
シキボウ	67,000	127.00	8,509,000	
日本毛織	37,000	924.00	34,188,000	
大東紡織	18,000	73.00	1,314,000	
トーア紡コーポレーション	5,200	714.00	3,712,800	
ダイドーリミテッド	13,000	505.00	6,565,000	貸付有価証券 1,400株
帝国繊維	12,200	1,715.00	20,923,000	貸付有価証券 5,300株(5,200株)
帝人	475,000	473.00	224,675,000	貸付有価証券 21,000株(21,000株)
東レ	900,000	1,016.50	914,850,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
サカイオーボックス	31,000	209.00	6,479,000	
住江織物	29,000	334.00	9,686,000	
日本フェルト	6,200	526.00	3,261,200	
イチカワ	8,000	369.00	2,952,000	
日本バイリーン	16,000	787.00	12,592,000	
日東製網	13,000	161.00	2,093,000	貸付有価証券 2,000株
芦森工業	25,000	215.00	5,375,000	貸付有価証券 11,000株
アツギ	97,000	115.00	11,155,000	
ダイニック	22,000	185.00	4,070,000	
セーレン	29,000	1,299.00	37,671,000	

東海染工	16,000	134.00	2,144,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
小松精練	19,300	558.00	10,769,400	貸付有価証券 2,600株
ワコールホールディングス	69,000	1,425.00	98,325,000	
ホギメディカル	7,300	6,250.00	45,625,000	貸付有価証券 600株(100株)
レナウン	27,900	201.00	5,607,900	貸付有価証券 12,200株(10,900株)
クラウディア	3,000	618.00	1,854,000	貸付有価証券 1,000株
T S Iホールディングス	51,900	831.00	43,128,900	貸付有価証券 6,400株(6,400株)
三陽商会	61,000	332.00	20,252,000	貸付有価証券 19,000株(13,000株)
ナイガイ	42,000	67.00	2,814,000	貸付有価証券 6,000株
オンワードホールディングス	83,000	839.00	69,637,000	貸付有価証券 13,000株
ルック	20,000	221.00	4,420,000	貸付有価証券 2,000株
キムラタン	517,000	9.00	4,653,000	貸付有価証券 112,000株(49,000株)
ゴールドウイン	27,000	875.00	23,625,000	
デサント	26,500	1,789.00	47,408,500	
キング	5,800	435.00	2,523,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
ヤマトインターナショナル	7,600	423.00	3,214,800	貸付有価証券 2,900株(100株)
特種東海製紙	68,000	305.00	20,740,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
王子ホールディングス	477,000	530.00	252,810,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
日本製紙	56,100	2,071.00	116,183,100	貸付有価証券 24,400株
三菱製紙	177,000	93.00	16,461,000	貸付有価証券 76,000株(76,000株)
北越紀州製紙	72,100	665.00	47,946,500	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
中越パルプ工業	44,000	234.00	10,296,000	貸付有価証券

				15,000株(15,000株)
巴川製紙所	18,000	246.00	4,428,000	貸付有価証券 8,000株(6,000株)
大王製紙	51,000	1,224.00	62,424,000	
レンゴー	103,000	511.00	52,633,000	貸付有価証券 45,000株(1,000株)
トーモク	37,000	281.00	10,397,000	
ザ・パック	8,200	2,435.00	19,967,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
クラレ	197,900	1,481.00	293,089,900	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
旭化成	725,000	1,013.00	734,425,000	
共和レザー	7,600	975.00	7,410,000	
コープケミカル	17,000	93.00	1,581,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
昭和電工	774,000	162.00	125,388,000	貸付有価証券 55,000株(28,000株)
住友化学	856,000	739.00	632,584,000	
日本化成	22,000	151.00	3,322,000	
住友精化	24,000	797.00	19,128,000	
日産化学工業	76,200	2,709.00	206,425,800	
ラサ工業	44,000	147.00	6,468,000	貸付有価証券 7,000株
クレハ	81,000	478.00	38,718,000	貸付有価証券 35,000株(15,000株)
多木化学	7,000	713.00	4,991,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
テイカ	19,000	492.00	9,348,000	
石原産業	195,000	125.00	24,375,000	
片倉チッカリン	7,000	289.00	2,023,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
日本曹達	74,000	780.00	57,720,000	
東ソー	290,000	766.00	222,140,000	
トクヤマ	181,000	243.00	43,983,000	貸付有価証券 79,000株
セントラル硝子	119,000	522.00	62,118,000	
東亜合成	73,000	1,023.00	74,679,000	
ダイソー	46,000	445.00	20,470,000	貸付有価証券 20,000株
関東電化工業	28,000	835.00	23,380,000	貸付有価証券

				12,000株(11,000株)
電気化学工業	241,000	543.00	130,863,000	
信越化学工業	208,500	7,585.00	1,581,472,500	貸付有価証券 800株(800株)
日本カーバイド工業	40,000	222.00	8,880,000	貸付有価証券 12,000株
堺化学工業	47,000	436.00	20,492,000	
エア・ウォーター	103,000	2,253.00	232,059,000	
大陽日酸	149,300	1,486.00	221,859,800	貸付有価証券 29,200株(11,000株)
日本化学工業	43,000	236.00	10,148,000	
日本パーカライズン	54,800	1,243.00	68,116,400	
高圧ガス工業	17,000	630.00	10,710,000	
チタン工業	14,000	228.00	3,192,000	貸付有価証券 5,000株
四国化成工業	17,000	1,056.00	17,952,000	
戸田工業	23,000	338.00	7,774,000	貸付有価証券 10,000株
ステラ ケミファ	5,900	1,303.00	7,687,700	貸付有価証券 200株(200株)
保土谷化学工業	35,000	185.00	6,475,000	
日本触媒	91,000	1,683.00	153,153,000	
大日精化学工業	48,000	615.00	29,520,000	
カネカ	157,000	908.00	142,556,000	
三菱瓦斯化学	200,000	691.00	138,200,000	
三井化学	528,000	452.00	238,656,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
J S R	114,800	2,185.00	250,838,000	
東京応化工業	24,100	3,485.00	83,988,500	
大阪有機化学工業	8,300	595.00	4,938,500	
三菱ケミカルホールディングス	726,900	776.40	564,365,160	貸付有価証券 24,900株(24,900株)
日本合成化学工業	27,000	832.00	22,464,000	
ダイセル	163,500	1,570.00	256,695,000	
住友ベークライト	109,000	563.00	61,367,000	
積水化学工業	269,000	1,501.00	403,769,000	
日本ゼオン	100,000	1,137.00	113,700,000	貸付有価証券 41,000株(41,000株)
アイカ工業	34,900	2,752.00	96,044,800	

宇部興産	586,000	231.00	135,366,000	
積水樹脂	17,900	1,555.00	27,834,500	
タキロン	24,000	544.00	13,056,000	
旭有機材工業	41,000	260.00	10,660,000	
日立化成	57,500	2,204.00	126,730,000	
ニチバン	11,000	600.00	6,600,000	
リケンテクノス	18,800	486.00	9,136,800	貸付有価証券 2,000株
大倉工業	28,000	344.00	9,632,000	
積水化成成品工業	33,000	448.00	14,784,000	
群栄化学工業	31,000	331.00	10,261,000	
タイガースポリマー	5,700	836.00	4,765,200	
ミライアル	4,200	1,367.00	5,741,400	貸付有価証券 1,800株
ダイキアクシス	1,700	1,202.00	2,043,400	
ダイキョーニシカワ	3,700	4,065.00	15,040,500	
日本化薬	75,000	1,309.00	98,175,000	
カーリットホールディングス	9,200	622.00	5,722,400	
日本精化	9,600	930.00	8,928,000	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
A D E K A	53,600	1,707.00	91,495,200	
日油	95,000	984.00	93,480,000	
新日本理化	18,300	238.00	4,355,400	貸付有価証券 8,000株
ハリマ化成グループ	9,900	495.00	4,900,500	
花王	312,700	5,646.00	1,765,504,200	
第一工業製薬	25,000	360.00	9,000,000	貸付有価証券 11,000株
ニイタカ	1,700	1,556.00	2,645,200	
三洋化成工業	37,000	868.00	32,116,000	
大日本塗料	67,000	181.00	12,127,000	
日本ペイントホールディングス	100,600	3,515.00	353,609,000	貸付有価証券 8,900株（8,900株）
関西ペイント	141,000	1,979.00	279,039,000	
神東塗料	9,000	220.00	1,980,000	
中国塗料	33,000	911.00	30,063,000	
日本特殊塗料	9,000	871.00	7,839,000	

藤倉化成	15,800	583.00	9,211,400	
太陽ホールディングス	9,500	5,060.00	48,070,000	
D I C	466,000	310.00	144,460,000	
サカティンクス	23,700	1,101.00	26,093,700	
東洋インキ S C ホール ディングス	115,000	487.00	56,005,000	
T & K T O K A	3,900	2,278.00	8,884,200	
富士フィルムホールディ ングス	266,100	4,377.50	1,164,852,750	
資生堂	206,800	2,719.50	562,392,600	貸付有価証券 6,800株(5,100株)
ライオン	134,000	930.00	124,620,000	貸付有価証券 58,000株(56,000株)
高砂香料工業	38,000	515.00	19,570,000	
マンダム	11,600	5,370.00	62,292,000	
ミルボン	6,800	3,830.00	26,044,000	
ファンケル	27,000	1,712.00	46,224,000	貸付有価証券 11,800株(10,600株)
コーセー	18,800	9,750.00	183,300,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
コタ	4,000	1,392.00	5,568,000	
ドクターシーラボ	7,900	4,220.00	33,338,000	貸付有価証券 900株
シーボン	1,300	2,679.00	3,482,700	貸付有価証券 500株(500株)
ポーラ・オルビスホール ディングス	13,800	6,750.00	93,150,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
ノエビアホールディング ス	7,300	2,641.00	19,279,300	
アジュバンコスメジャパ ン	2,200	899.00	1,977,800	貸付有価証券 700株(700株)
エステー	7,900	1,084.00	8,563,600	
アグロ カネショウ	3,100	889.00	2,755,900	貸付有価証券 1,300株(1,000株)
コニシ	9,100	2,304.00	20,966,400	
長谷川香料	14,700	1,751.00	25,739,700	
星光 P M C	6,400	963.00	6,163,200	貸付有価証券 2,800株(100株)
小林製薬	19,100	8,230.00	157,193,000	
荒川化学工業	9,800	1,471.00	14,415,800	

メック	9,000	912.00	8,208,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
日本高純度化学	3,300	2,528.00	8,342,400	
J C U	3,200	5,090.00	16,288,000	
新田ゼラチン	7,000	736.00	5,152,000	貸付有価証券 2,800株(2,000株)
アース製薬	8,400	4,580.00	38,472,000	貸付有価証券 3,600株
イハラケミカル工業	17,900	1,499.00	26,832,100	貸付有価証券 7,800株(7,800株)
北興化学工業	12,000	502.00	6,024,000	
大成ラミック	3,300	2,862.00	9,444,600	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
クミアイ化学工業	24,000	958.00	22,992,000	貸付有価証券 10,500株(10,300株)
日本農薬	26,600	1,184.00	31,494,400	貸付有価証券 11,700株
アキレス	99,000	155.00	15,345,000	貸付有価証券 1,000株
有沢製作所	19,600	909.00	17,816,400	
日東電工	89,800	9,960.00	894,408,000	貸付有価証券 600株(600株)
レック	3,900	1,357.00	5,292,300	
きもと	20,800	284.00	5,907,200	
藤森工業	10,000	3,680.00	36,800,000	
前澤化成工業	8,100	1,245.00	10,084,500	
J S P	8,700	1,971.00	17,147,700	
エフピコ	10,300	4,410.00	45,423,000	貸付有価証券 3,200株
天馬	8,900	2,065.00	18,378,500	
信越ポリマー	22,800	580.00	13,224,000	
東リ	30,000	322.00	9,660,000	
ニフコ	25,900	5,230.00	135,457,000	貸付有価証券 11,300株
日本バルカー工業	48,000	328.00	15,744,000	
ユニ・チャーム	235,400	2,881.00	678,187,400	
協和発酵キリン	139,000	1,612.00	224,068,000	
武田薬品工業	435,600	5,836.00	2,542,161,600	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
アステラス製薬	1,324,100	1,743.00	2,307,906,300	貸付有価証券

				4,500株(4,500株)
大日本住友製薬	82,300	1,325.00	109,047,500	貸付有価証券 35,900株
塩野義製薬	181,500	4,400.00	798,600,000	
田辺三菱製薬	135,500	1,828.00	247,694,000	
わかもと製薬	13,000	282.00	3,666,000	
あすか製薬	13,700	1,328.00	18,193,600	
日本新薬	27,000	3,770.00	101,790,000	
バイオフェルミン製薬	1,900	2,850.00	5,415,000	
中外製薬	115,700	4,150.00	480,155,000	貸付有価証券 800株(800株)
科研製薬	40,000	4,245.00	169,800,000	
エーザイ	153,300	8,208.00	1,258,286,400	貸付有価証券 300株(300株)
ロート製薬	52,800	2,015.00	106,392,000	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
小野薬品工業	52,800	13,300.00	702,240,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
久光製薬	32,800	4,705.00	154,324,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
有機合成薬品工業	8,000	275.00	2,200,000	
持田製薬	8,000	6,820.00	54,560,000	
参天製薬	213,700	1,724.00	368,418,800	
扶桑薬品工業	39,000	292.00	11,388,000	
日本ケミファ	15,000	627.00	9,405,000	
ツムラ	36,600	2,611.00	95,562,600	貸付有価証券 14,200株
日医工	27,200	3,260.00	88,672,000	
キッセイ薬品工業	21,600	3,075.00	66,420,000	
生化学工業	22,200	1,985.00	44,067,000	
栄研化学	9,800	2,443.00	23,941,400	
日水製薬	4,700	1,384.00	6,504,800	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
鳥居薬品	7,900	3,260.00	25,754,000	貸付有価証券 3,400株
JCRファーマ	8,900	3,030.00	26,967,000	貸付有価証券 2,600株(2,500株)
東和薬品	5,900	7,850.00	46,315,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
富士製薬工業	3,200	2,200.00	7,040,000	



				貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	18,400	7,100.00	130,640,000	
ゼリア新薬工業	23,800	1,777.00	42,292,600	貸付有価証券 10,200株(8,000株)
第一三共	391,000	2,280.50	891,675,500	貸付有価証券 170,400株
キョーリン製薬ホールディングス	31,000	2,508.00	77,748,000	
大幸薬品	5,100	1,760.00	8,976,000	貸付有価証券 2,200株
ダイト	5,200	2,632.00	13,686,400	
大塚ホールディングス	230,700	3,865.00	891,655,500	
大正製薬ホールディングス	28,000	8,370.00	234,360,000	貸付有価証券 10,400株
日本コークス工業	104,200	117.00	12,191,400	
昭和シェル石油	103,900	1,088.00	113,043,200	
コスモ石油	321,000	206.00	66,126,000	貸付有価証券 43,000株(43,000株)
ニチレキ	14,000	1,013.00	14,182,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
東燃ゼネラル石油	175,000	1,130.00	197,750,000	
ユシロ化学工業	6,200	1,460.00	9,052,000	
ピーピー・カストロール	4,800	1,318.00	6,326,400	貸付有価証券 1,000株
富士石油	26,900	471.00	12,669,900	
MORESCO	3,000	2,233.00	6,699,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
出光興産	55,100	2,398.00	132,129,800	
JXホールディングス	1,290,200	532.50	687,031,500	貸付有価証券 13,400株(13,400株)
横浜ゴム	64,500	2,474.00	159,573,000	
東洋ゴム工業	52,600	2,605.00	137,023,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
ブリヂストン	364,300	4,543.50	1,655,197,050	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
住友ゴム工業	90,700	1,906.00	172,874,200	貸付有価証券 23,300株(23,300株)
藤倉ゴム工業	9,700	702.00	6,809,400	貸付有価証券 4,200株
オカモト	40,000	456.00	18,240,000	

フコク	4,900	1,223.00	5,992,700	
ニッタ	11,500	3,380.00	38,870,000	
住友理工	21,500	984.00	21,156,000	
三ツ星ベルト	28,000	967.00	27,076,000	
バンドー化学	42,000	512.00	21,504,000	
日東紡績	85,000	531.00	45,135,000	
旭硝子	573,000	732.00	419,436,000	
日本板硝子	561,000	130.00	72,930,000	貸付有価証券 20,000株
石塚硝子	15,000	236.00	3,540,000	貸付有価証券 6,000株
日本山村硝子	46,000	189.00	8,694,000	
日本電気硝子	223,000	611.00	136,253,000	
オハラ	4,400	631.00	2,776,400	貸付有価証券 1,700株
住友大阪セメント	216,000	449.00	96,984,000	
太平洋セメント	725,000	357.00	258,825,000	貸付有価証券 18,000株
デイ・シイ	11,900	439.00	5,224,100	
日本ヒューム	12,100	816.00	9,873,600	
日本コンクリート工業	19,900	480.00	9,552,000	貸付有価証券 9,000株
三谷セキサン	5,800	1,710.00	9,918,000	貸付有価証券 100株
ジャパンパイル	15,500	712.00	11,036,000	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	101,000	383.00	38,683,000	
日本カーボン	61,000	399.00	24,339,000	貸付有価証券 14,000株（4,000株）
東洋炭素	6,400	2,006.00	12,838,400	貸付有価証券 1,700株
ノリタケカンパニーリミ テド	66,000	287.00	18,942,000	
TOTO	171,000	2,220.00	379,620,000	
日本碍子	147,000	3,160.00	464,520,000	
日本特殊陶業	100,200	3,415.00	342,183,000	貸付有価証券 1,700株
ダントーホールディング ス	16,000	179.00	2,864,000	貸付有価証券 7,000株（6,000株）
MARUWA	3,400	2,583.00	8,782,200	貸付有価証券

				400株
品川リフクトリーズ	29,000	288.00	8,352,000	
黒崎播磨	25,000	263.00	6,575,000	
ヨータイ	7,000	369.00	2,583,000	貸付有価証券 1,000株
イソライト工業	5,700	232.00	1,322,400	
東京窯業	14,000	218.00	3,052,000	
ニッカトー	4,100	424.00	1,738,400	
フジミインコーポレー テッド	11,300	1,858.00	20,995,400	貸付有価証券 1,300株
エーアンドエーマテリア ル	24,000	111.00	2,664,000	
ニチアス	52,000	749.00	38,948,000	貸付有価証券 22,000株（22,000株）
ニチハ	15,400	1,895.00	29,183,000	
新日鐵住金	4,913,000	317.40	1,559,386,200	貸付有価証券 286,000株（286,000 株）
神戸製鋼所	2,009,000	207.00	415,863,000	貸付有価証券 89,000株（89,000株）
中山製鋼所	87,000	91.00	7,917,000	貸付有価証券 23,000株
合同製鐵	59,000	222.00	13,098,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	296,500	2,798.50	829,755,250	
日新製鋼	49,200	1,512.00	74,390,400	
東京製鐵	58,800	909.00	53,449,200	
共英製鋼	12,400	2,246.00	27,850,400	貸付有価証券 4,200株（800株）
大和工業	26,400	2,882.00	76,084,800	
東京鐵鋼	23,000	622.00	14,306,000	
大阪製鐵	7,300	2,349.00	17,147,700	
淀川製鋼所	80,000	538.00	43,040,000	
東洋鋼鈑	27,800	609.00	16,930,200	
丸一鋼管	35,600	3,080.00	109,648,000	貸付有価証券 15,600株
モリ工業	19,000	396.00	7,524,000	
大同特殊鋼	195,000	515.00	100,425,000	貸付有価証券 40,000株（40,000株）
日本高周波鋼業	46,000	116.00	5,336,000	

日本冶金工業	90,800	232.00	21,065,600	貸付有価証券 39,900株
山陽特殊製鋼	69,000	572.00	39,468,000	
愛知製鋼	69,000	544.00	37,536,000	
日立金属	118,000	1,882.00	222,076,000	貸付有価証券 39,000株（39,000株）
日本金属	30,000	156.00	4,680,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
大平洋金属	74,000	375.00	27,750,000	貸付有価証券 32,000株（6,000株）
新日本電工	70,800	289.00	20,461,200	
栗本鐵工所	60,000	249.00	14,940,000	
虹技	16,000	208.00	3,328,000	
日本鑄鉄管	11,000	226.00	2,486,000	
三菱製鋼	76,000	264.00	20,064,000	
日亜鋼業	16,100	308.00	4,958,800	
日本精線	9,000	601.00	5,409,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	12,000	590.00	7,080,000	
新家工業	23,000	179.00	4,117,000	
大紀アルミニウム工業所	20,000	397.00	7,940,000	
日本軽金属ホールディング グス	281,800	210.00	59,178,000	貸付有価証券 46,500株（35,200株）
三井金属鉱業	316,000	329.00	103,964,000	貸付有価証券 5,000株
東邦亜鉛	66,000	377.00	24,882,000	
三菱マテリアル	725,000	470.00	340,750,000	
住友金属鉱山	321,000	1,884.00	604,764,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
DOWAホールディング グス	139,000	1,136.00	157,904,000	
古河機械金属	181,000	218.00	39,458,000	
大阪チタニウムテクノ ロジーズ	11,400	3,240.00	36,936,000	貸付有価証券 5,000株
東邦チタニウム	19,700	1,381.00	27,205,700	貸付有価証券 200株
UACJ	133,000	309.00	41,097,000	貸付有価証券 10,000株
古河電気工業	341,000	217.00	73,997,000	
住友電気工業	437,800	1,944.00	851,083,200	

フジクラ	162,000	684.00	110,808,000	貸付有価証券 43,000株(43,000株)
昭和電線ホールディングス	128,000	94.00	12,032,000	貸付有価証券 56,000株
東京特殊電線	1,600	1,289.00	2,062,400	貸付有価証券 700株
タツタ電線	21,800	504.00	10,987,200	貸付有価証券 100株
沖電線	12,000	293.00	3,516,000	貸付有価証券 4,000株
カナレ電気	1,800	2,191.00	3,943,800	貸付有価証券 700株(700株)
平河ヒューテック	2,700	1,357.00	3,663,900	貸付有価証券 300株
リョービ	65,000	468.00	30,420,000	
アーレスティ	13,500	1,009.00	13,621,500	
アサヒホールディングス	17,500	2,081.00	36,417,500	
稲葉製作所	6,200	1,518.00	9,411,600	貸付有価証券 2,700株
宮地エンジニアリンググループ	33,000	178.00	5,874,000	貸付有価証券 14,000株
トーカロ	7,600	2,819.00	21,424,400	
アルファC o	3,900	1,326.00	5,171,400	
SUMCO	90,500	1,570.00	142,085,000	貸付有価証券 27,800株
川田テクノロジーズ	2,200	4,265.00	9,383,000	貸付有価証券 900株
東洋製罐グループホールディングス	82,600	1,957.00	161,648,200	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ホッカンホールディングス	28,000	296.00	8,288,000	
コロナ	6,100	1,195.00	7,289,500	
横河ブリッジホールディングス	22,000	1,223.00	26,906,000	
駒井ハルテック	21,000	252.00	5,292,000	貸付有価証券 1,000株
高田機工	10,000	247.00	2,470,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
三和ホールディングス	109,300	1,030.00	112,579,000	
文化シャッター	32,300	978.00	31,589,400	
三協立山	15,200	2,027.00	30,810,400	貸付有価証券

				4,900株
アルインコ	4,900	1,125.00	5,512,500	
東洋シャッター	2,900	987.00	2,862,300	
L I X I Lグループ	172,600	2,452.00	423,215,200	貸付有価証券 26,800株(22,500株)
日本ファイルコン	8,400	533.00	4,477,200	
ノーリツ	22,800	2,294.00	52,303,200	貸付有価証券 900株(900株)
長府製作所	12,400	2,896.00	35,910,400	
リンナイ	21,600	9,680.00	209,088,000	貸付有価証券 3,100株(2,300株)
ダイニチ工業	5,900	775.00	4,572,500	
日東精工	17,000	338.00	5,746,000	
三洋工業	15,000	216.00	3,240,000	
岡部	22,900	955.00	21,869,500	貸付有価証券 10,000株(8,400株)
ジーテクト	10,600	1,203.00	12,751,800	
中国工業	1,800	807.00	1,452,600	
東プレ	22,300	2,234.00	49,818,200	
高周波熱錬	20,000	873.00	17,460,000	
東京製綱	79,000	222.00	17,538,000	貸付有価証券 19,000株
サンコール	7,000	694.00	4,858,000	
モリテック スチール	5,800	325.00	1,885,000	
パイオラックス	5,900	6,310.00	37,229,000	
日本発條	100,900	1,346.00	135,811,400	貸付有価証券 24,300株(19,600株)
中央発條	15,000	336.00	5,040,000	
アドバネクス	21,000	174.00	3,654,000	
三益半導体工業	8,600	1,200.00	10,320,000	
日本ドライケミカル	1,600	2,382.00	3,811,200	
日本製鋼所	166,000	505.00	83,830,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
三浦工業	51,800	1,418.00	73,452,400	貸付有価証券 300株(300株)
タクマ	37,000	780.00	28,860,000	
ツガミ	34,000	664.00	22,576,000	貸付有価証券 14,000株
オークマ	76,000	1,381.00	104,956,000	

東芝機械	63,000	557.00	35,091,000	
アマダホールディングス	173,200	1,303.00	225,679,600	
アイダエンジニアリング	25,400	1,351.00	34,315,400	
滝澤鉄工所	36,000	236.00	8,496,000	
富士機械製造	37,900	1,266.00	47,981,400	
牧野フライス製作所	58,000	1,247.00	72,326,000	貸付有価証券 25,000株（6,000株）
オーエスジー	52,900	2,601.00	137,592,900	貸付有価証券 23,100株（23,100株）
ダイジェット工業	13,000	216.00	2,808,000	
旭ダイヤモンド工業	31,800	1,385.00	44,043,000	貸付有価証券 13,900株
D M G 森精機	73,300	2,298.00	168,443,400	
ソディック	22,100	993.00	21,945,300	貸付有価証券 9,700株
ディスコ	13,500	10,140.00	136,890,000	
日東工器	6,800	2,740.00	18,632,000	
パンチ工業	4,100	1,311.00	5,375,100	
豊和工業	6,500	736.00	4,784,000	
大阪機工	45,000	190.00	8,550,000	貸付有価証券 3,000株
東洋機械金属	7,800	514.00	4,009,200	貸付有価証券 1,100株
津田駒工業	28,000	145.00	4,060,000	貸付有価証券 12,000株
エンシュウ	28,000	118.00	3,304,000	貸付有価証券 9,000株（3,000株）
島精機製作所	16,400	1,970.00	32,308,000	
日阪製作所	14,700	1,118.00	16,434,600	
やまびこ	4,600	5,560.00	25,576,000	貸付有価証券 100株
ペガサスミシン製造	10,200	586.00	5,977,200	貸付有価証券 4,400株（400株）
ナプテスコ	70,700	3,065.00	216,695,500	貸付有価証券 4,500株（4,500株）
三井海洋開発	11,700	1,882.00	22,019,400	貸付有価証券 5,100株
レオン自動機	8,800	560.00	4,928,000	
S M C	34,800	37,000.00	1,287,600,000	貸付有価証券 200株（200株）

新川	9,700	1,099.00	10,660,300	貸付有価証券 4,200株(4,100株)
ホソカワミクロン	19,000	598.00	11,362,000	貸付有価証券 2,000株
ユニオンツール	5,700	3,915.00	22,315,500	貸付有価証券 500株(500株)
オイレス工業	13,800	2,342.00	32,319,600	
日精エー・エス・ビー機 械	4,200	2,360.00	9,912,000	貸付有価証券 1,800株
サトーホールディングス	14,400	3,395.00	48,888,000	
日本エアーテック	3,400	706.00	2,400,400	貸付有価証券 1,400株
日精樹脂工業	8,400	1,098.00	9,223,200	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
ワイエイシイ	4,700	1,000.00	4,700,000	
小松製作所	569,500	2,449.50	1,394,990,250	貸付有価証券 25,800株(18,900株)
住友重機械工業	318,000	718.00	228,324,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
日立建機	51,900	2,144.00	111,273,600	貸付有価証券 7,000株
日工	16,000	439.00	7,024,000	
巴工業	4,400	1,674.00	7,365,600	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
井関農機	119,000	238.00	28,322,000	貸付有価証券 28,000株(2,000株)
T O W A	9,500	1,000.00	9,500,000	貸付有価証券 700株(700株)
丸山製作所	24,000	228.00	5,472,000	
北川鉄工所	53,000	310.00	16,430,000	
クボタ	558,000	1,934.50	1,079,451,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
荏原実業	3,500	1,425.00	4,987,500	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
三菱化工機	38,000	372.00	14,136,000	貸付有価証券 16,000株
月島機械	20,400	1,295.00	26,418,000	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
帝国電機製作所	7,700	1,047.00	8,061,900	
東京機械製作所	44,000	76.00	3,344,000	貸付有価証券 2,000株



新東工業	27,300	1,099.00	30,002,700	
澁谷工業	9,700	2,102.00	20,389,400	貸付有価証券 4,200株（500株）
アイチ コーポレーショ ン	16,400	714.00	11,709,600	
小森コーポレーション	28,200	1,674.00	47,206,800	
鶴見製作所	8,600	1,877.00	16,142,200	
住友精密工業	18,000	453.00	8,154,000	貸付有価証券 7,000株（7,000株）
酒井重工業	22,000	264.00	5,808,000	
荏原製作所	241,000	592.00	142,672,000	貸付有価証券 30,000株（23,000株）
石井鐵工所	17,000	215.00	3,655,000	貸付有価証券 3,000株
西島製作所	11,300	960.00	10,848,000	貸付有価証券 4,800株（1,300株）
北越工業	11,400	907.00	10,339,800	貸付有価証券 2,100株
ダイキン工業	161,600	8,767.00	1,416,747,200	貸付有価証券 700株
オルガノ	22,000	517.00	11,374,000	
トーヨーカネツ	67,000	225.00	15,075,000	
栗田工業	65,700	2,846.00	186,982,200	
椿本チエイン	59,000	1,189.00	70,151,000	
大同工業	23,000	245.00	5,635,000	
日本コンベヤ	36,000	197.00	7,092,000	貸付有価証券 15,000株
木村化工機	10,700	491.00	5,253,700	
アネスト岩田	17,300	763.00	13,199,900	
ダイフク	54,900	1,890.00	103,761,000	貸付有価証券 24,100株（16,700株）
サムコ	1,600	1,171.00	1,873,600	貸付有価証券 700株
加藤製作所	24,000	722.00	17,328,000	
油研工業	22,000	268.00	5,896,000	
タダノ	54,000	1,833.00	98,982,000	
フジテック	32,300	1,503.00	48,546,900	
C K D	31,100	1,391.00	43,260,100	
キトー	12,100	1,188.00	14,374,800	貸付有価証券

				5,300株
平和	24,100	2,434.00	58,659,400	貸付有価証券 7,500株
理想科学工業	13,500	2,302.00	31,077,000	貸付有価証券 1,500株
SANKYO	30,900	4,350.00	134,415,000	貸付有価証券 200株
日本金銭機械	10,200	1,655.00	16,881,000	貸付有価証券 4,400株(1,100株)
マースエンジニアリング	6,300	2,161.00	13,614,300	
福島工業	6,100	2,232.00	13,615,200	貸付有価証券 200株
オーイズミ	3,900	771.00	3,006,900	貸付有価証券 1,700株(100株)
ダイコク電機	4,600	1,719.00	7,907,400	貸付有価証券 2,000株(1,300株)
竹内製作所	4,600	7,010.00	32,246,000	
アマノ	37,000	1,578.00	58,386,000	
JUKI	16,400	1,676.00	27,486,400	貸付有価証券 25,000株
サンデンホールディングス	68,000	570.00	38,760,000	
蛇の目ミシン工業	108,000	130.00	14,040,000	貸付有価証券 43,000株
マックス	17,000	1,276.00	21,692,000	
グローリー	35,500	3,590.00	127,445,000	
新晃工業	7,700	1,221.00	9,401,700	貸付有価証券 700株(400株)
大和冷機工業	16,000	799.00	12,784,000	
セガサミーホールディングス	119,300	1,600.00	190,880,000	貸付有価証券 23,200株(23,200株)
日本ピストンリング	43,000	228.00	9,804,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
リケン	48,000	471.00	22,608,000	
T P R	12,400	3,715.00	46,066,000	貸付有価証券 200株
ホシザキ電機	24,300	7,180.00	174,474,000	
大豊工業	8,900	1,629.00	14,498,100	貸付有価証券 300株(300株)
日本精工	228,000	1,897.00	432,516,000	
NTN	257,000	760.00	195,320,000	貸付有価証券

				6,000株(6,000株)
ジェイテクト	118,300	2,318.00	274,219,400	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
不二越	103,000	719.00	74,057,000	
日本トムソン	38,000	686.00	26,068,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
T H K	73,800	2,664.00	196,603,200	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
ユーシン精機	4,900	2,770.00	13,573,000	貸付有価証券 1,800株(1,000株)
前澤給装工業	4,200	1,622.00	6,812,400	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
イーグル工業	15,400	2,867.00	44,151,800	
前澤工業	8,100	502.00	4,066,200	
日本ピラー工業	12,100	1,095.00	13,249,500	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
キッツ	49,800	595.00	29,631,000	貸付有価証券 5,100株
日立工機	29,700	1,018.00	30,234,600	
マキタ	72,400	6,610.00	478,564,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
日立造船	86,800	686.00	59,544,800	貸付有価証券 8,000株
三菱重工業	1,861,000	740.80	1,378,628,800	貸付有価証券 38,000株(38,000株)
I H I	800,000	571.00	456,800,000	
イビデン	72,800	2,112.00	153,753,600	貸付有価証券 3,600株
コニカミノルタ	264,500	1,411.00	373,209,500	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
ブラザー工業	143,500	1,750.00	251,125,000	
ミネベア	165,000	2,003.00	330,495,000	
日立製作所	2,666,000	807.70	2,153,328,200	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
東芝	2,337,000	415.90	971,958,300	
三菱電機	1,110,000	1,586.00	1,760,460,000	
富士電機	309,000	524.00	161,916,000	
東洋電機製造	22,000	441.00	9,702,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
安川電機	135,500	1,570.00	212,735,000	貸付有価証券

				57,300株(14,000株)
シンフォニアテクノロジー	77,000	238.00	18,326,000	
明電舎	102,000	464.00	47,328,000	
オリジン電気	16,000	434.00	6,944,000	
山洋電気	25,000	988.00	24,700,000	
デンヨー	9,500	1,957.00	18,591,500	
東芝テック	79,000	667.00	52,693,000	
芝浦メカトロニクス	18,000	283.00	5,094,000	貸付有価証券 7,000株
マブチモーター	31,800	7,760.00	246,768,000	
日本電産	121,900	9,111.00	1,110,630,900	
東光高岳	5,600	1,625.00	9,100,000	貸付有価証券 100株(100株)
ダイヘン	61,000	638.00	38,918,000	
田淵電機	12,600	1,131.00	14,250,600	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
ヤーマン	1,400	1,564.00	2,189,600	貸付有価証券 600株(600株)
JVCケンウッド	81,400	338.00	27,513,200	貸付有価証券 35,800株
ミマキエンジニアリング	6,600	939.00	6,197,400	貸付有価証券 2,900株
第一精工	4,000	2,016.00	8,064,000	貸付有価証券 1,700株(500株)
日新電機	26,000	848.00	22,048,000	
大崎電気工業	20,000	667.00	13,340,000	貸付有価証券 8,000株
オムロン	119,900	5,350.00	641,465,000	
日東工業	17,800	2,739.00	48,754,200	
I D E C	13,200	1,098.00	14,493,600	
不二電機工業	1,000	1,510.00	1,510,000	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサコーポレーション	214,000	482.00	103,148,000	貸付有価証券 28,000株
サクサホールディングス	28,000	234.00	6,552,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
メルコホールディングス	6,100	2,302.00	14,042,200	貸付有価証券 2,000株
テクノメディカ	2,500	2,872.00	7,180,000	

日本電気	1,436,000	368.00	528,448,000	
富士通	1,070,000	699.50	748,465,000	貸付有価証券 87,000株（87,000株）
沖電気工業	391,000	255.00	99,705,000	貸付有価証券 9,000株（9,000株）
岩崎通信機	49,000	92.00	4,508,000	
電気興業	32,000	586.00	18,752,000	
サンケン電気	56,000	764.00	42,784,000	
ナカヨ	11,000	364.00	4,004,000	貸付有価証券 4,000株
アイホン	6,400	2,127.00	13,612,800	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
ルネサスエレクトロニクス	57,500	890.00	51,175,000	貸付有価証券 25,300株
セイコーエプソン	151,500	2,180.00	330,270,000	
ワコム	87,400	447.00	39,067,800	貸付有価証券 38,300株
アルバック	18,700	1,871.00	34,987,700	
アクセル	5,100	1,687.00	8,603,700	貸付有価証券 2,200株（1,900株）
E I Z O	10,200	2,815.00	28,713,000	貸付有価証券 2,900株
ジャパンディスプレイ	228,000	466.00	106,248,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
日本信号	30,600	1,336.00	40,881,600	
京三製作所	26,000	376.00	9,776,000	
能美防災	14,700	1,450.00	21,315,000	
ホーチキ	8,000	862.00	6,896,000	
エレコム	4,600	2,960.00	13,616,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
日本無線	24,000	415.00	9,960,000	貸付有価証券 4,000株
パナソニック	1,352,800	1,709.00	2,311,935,200	
シャープ	938,000	154.00	144,452,000	貸付有価証券 412,000株（1,000株）
アンリツ	66,600	828.00	55,144,800	貸付有価証券 20,900株（7,700株）
富士通ゼネラル	34,000	1,560.00	53,040,000	貸付有価証券 14,000株（14,000株）
日立国際電気	29,000	1,892.00	54,868,000	

ソニー	725,800	3,773.00	2,738,443,400	
T D K	67,000	9,340.00	625,780,000	
帝国通信工業	26,000	227.00	5,902,000	
ミツミ電機	39,200	824.00	32,300,800	貸付有価証券 1,900株
タムラ製作所	43,000	487.00	20,941,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
アルプス電気	87,600	3,755.00	328,938,000	貸付有価証券 21,300株
池上通信機	38,000	178.00	6,764,000	貸付有価証券 15,000株
パイオニア	166,800	221.00	36,862,800	
日本電波工業	10,000	912.00	9,120,000	貸付有価証券 4,400株(3,700株)
鈴木	2,800	735.00	2,058,000	貸付有価証券 600株(600株)
日本トリム	2,700	3,200.00	8,640,000	貸付有価証券 1,100株(300株)
ローランド ディー . ジー .	4,500	3,525.00	15,862,500	
フォスター電機	13,000	2,742.00	35,646,000	
クラリオン	58,000	355.00	20,590,000	貸付有価証券 25,000株(1,000株)
S M K	33,000	495.00	16,335,000	
ヨコオ	8,600	696.00	5,985,600	
東光	26,000	326.00	8,476,000	貸付有価証券 11,000株(11,000株)
ティアック	60,000	46.00	2,760,000	貸付有価証券 26,000株
ホシデン	33,600	755.00	25,368,000	
ヒロセ電機	18,800	17,460.00	328,248,000	貸付有価証券 4,200株(1,000株)
日本航空電子工業	32,000	3,300.00	105,600,000	
T O A	11,900	1,289.00	15,339,100	貸付有価証券 5,200株(5,000株)
日立マクセル	22,100	1,981.00	43,780,100	貸付有価証券 1,900株
古野電気	13,200	905.00	11,946,000	貸付有価証券 1,500株
ユニデン	30,000	236.00	7,080,000	
アルパイン	26,500	2,348.00	62,222,000	貸付有価証券

				11,600株(11,600株)
スミダコーポレーション	9,900	897.00	8,880,300	貸付有価証券 4,200株
アイコム	6,100	3,105.00	18,940,500	
リオン	4,200	1,792.00	7,526,400	
船井電機	11,200	1,378.00	15,433,600	貸付有価証券 1,000株
横河電機	111,100	1,575.00	174,982,500	
新電元工業	43,000	625.00	26,875,000	貸付有価証券 18,000株(16,000株)
アズビル	36,200	3,175.00	114,935,000	
東亜ディーケーケー	4,600	575.00	2,645,000	
日本光電工業	47,300	2,989.00	141,379,700	
チノー	4,000	1,242.00	4,968,000	貸付有価証券 1,300株
共和電業	13,500	501.00	6,763,500	
日本電子材料	4,800	784.00	3,763,200	
堀場製作所	20,500	4,840.00	99,220,000	
アドバンテスト	75,700	1,248.00	94,473,600	貸付有価証券 6,100株(700株)
小野測器	5,400	995.00	5,373,000	貸付有価証券 100株
エスペック	12,300	1,377.00	16,937,100	
パナソニック デバイス SUNX	9,700	842.00	8,167,400	
キーエンス	25,100	66,050.00	1,657,855,000	
日置電機	5,800	2,534.00	14,697,200	貸付有価証券 900株(900株)
シスメックス	86,000	7,260.00	624,360,000	
メガチップス	11,600	1,567.00	18,177,200	貸付有価証券 4,100株(4,100株)
OBARA GROUP	7,200	6,630.00	47,736,000	貸付有価証券 3,100株(3,000株)
澤藤電機	7,000	240.00	1,680,000	貸付有価証券 2,000株
コーセル	16,100	1,481.00	23,844,100	貸付有価証券 7,000株(6,600株)
新日本無線	8,000	729.00	5,832,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
オブテックス	7,600	2,523.00	19,174,800	

千代田インテグレ	5,800	3,370.00	19,546,000	
レーザーテック	11,400	1,670.00	19,038,000	貸付有価証券 4,900株（4,800株）
スタンレー電気	79,700	2,541.00	202,517,700	貸付有価証券 2,000株
岩崎電気	38,000	271.00	10,298,000	
ウシオ電機	67,400	1,613.00	108,716,200	貸付有価証券 1,600株
岡谷電機産業	5,900	420.00	2,478,000	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
ヘリオス テクノ ホー ルディング	10,200	421.00	4,294,200	貸付有価証券 4,400株（4,300株）
日本セラミック	6,300	1,699.00	10,703,700	貸付有価証券 2,700株（1,300株）
遠藤照明	5,100	1,350.00	6,885,000	
日本デジタル研究所	9,400	1,704.00	16,017,600	
古河電池	8,000	840.00	6,720,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
双信電機	5,400	405.00	2,187,000	
山一電機	12,800	1,292.00	16,537,600	貸付有価証券 4,200株（3,900株）
図研	8,000	1,222.00	9,776,000	貸付有価証券 300株（300株）
日本電子	47,000	549.00	25,803,000	
カシオ計算機	111,300	2,426.00	270,013,800	貸付有価証券 48,900株
ファナック	115,600	25,005.00	2,890,578,000	
日本シイエムケイ	28,300	321.00	9,084,300	貸付有価証券 300株（300株）
エンプラス	5,000	4,960.00	24,800,000	
大真空	20,000	301.00	6,020,000	貸付有価証券 8,000株
ローム	54,700	8,200.00	448,540,000	
浜松ホトニクス	86,600	3,620.00	313,492,000	
三井ハイテック	14,600	865.00	12,629,000	
新光電気工業	41,900	911.00	38,170,900	
京セラ	182,200	6,306.00	1,148,953,200	貸付有価証券 200株（200株）
太陽誘電	58,100	1,709.00	99,292,900	貸付有価証券 100株



村田製作所	116,500	21,155.00	2,464,557,500	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
ユーシン	15,800	730.00	11,534,000	貸付有価証券 6,900株(6,000株)
双葉電子工業	19,000	2,234.00	42,446,000	
北陸電気工業	48,000	177.00	8,496,000	
ニチコン	35,000	986.00	34,510,000	貸付有価証券 4,000株
日本ケミコン	90,000	373.00	33,570,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
K O A	15,300	1,314.00	20,104,200	
市光工業	26,000	313.00	8,138,000	貸付有価証券 6,000株(1,000株)
小糸製作所	66,500	4,750.00	315,875,000	
ミツバ	20,400	3,195.00	65,178,000	
スター精密	21,100	2,062.00	43,508,200	
S C R E E Nホールディングス	105,000	767.00	80,535,000	
キャノン電子	10,200	2,397.00	24,449,400	
キャノン	643,600	3,965.00	2,551,874,000	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
リコー	333,800	1,255.50	419,085,900	貸付有価証券 4,200株
M U T O Hホールディングス	15,000	381.00	5,715,000	貸付有価証券 6,000株
東京エレクトロン	93,400	7,752.00	724,036,800	
トヨタ紡織	38,800	2,053.00	79,656,400	貸付有価証券 16,700株
鬼怒川ゴム工業	26,000	662.00	17,212,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
ユニプレス	21,300	2,564.00	54,613,200	
豊田自動織機	101,100	6,960.00	703,656,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
モリタホールディングス	19,400	1,183.00	22,950,200	
三櫻工業	14,100	820.00	11,562,000	
デンソー	274,200	6,146.00	1,685,233,200	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
東海理化電機製作所	29,200	3,055.00	89,206,000	
三井造船	430,000	213.00	91,590,000	
川崎重工業	806,000	567.00	457,002,000	貸付有価証券

				40,000株(35,000株)
名村造船所	30,900	1,038.00	32,074,200	
サノヤスホールディングス	13,500	256.00	3,456,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
日本車輛製造	40,000	333.00	13,320,000	貸付有価証券 17,000株(8,000株)
ニチュ三菱フォークリフト	12,800	628.00	8,038,400	
近畿車輛	17,000	338.00	5,746,000	貸付有価証券 7,000株
日産自動車	1,558,200	1,260.50	1,964,111,100	
いすゞ自動車	350,900	1,618.50	567,931,650	貸付有価証券 5,800株(5,200株)
トヨタ自動車	1,531,500	8,151.00	12,483,256,500	
日野自動車	158,400	1,509.00	239,025,600	
三菱自動車工業	406,900	1,027.00	417,886,300	貸付有価証券 161,600株(161,600株)
エフテック	6,400	1,236.00	7,910,400	貸付有価証券 2,700株(2,300株)
レシップホールディングス	3,600	861.00	3,099,600	貸付有価証券 400株
G M B	1,600	1,266.00	2,025,600	
ファルテック	1,600	1,569.00	2,510,400	
武蔵精密工業	11,800	2,373.00	28,001,400	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日産車体	48,800	1,657.00	80,861,600	
新明和工業	45,000	1,121.00	50,445,000	
極東開発工業	20,600	1,321.00	27,212,600	
日信工業	20,300	1,964.00	39,869,200	貸付有価証券 900株
トピー工業	91,000	312.00	28,392,000	
ティラド	43,000	242.00	10,406,000	
曙ブレーキ工業	46,900	396.00	18,572,400	貸付有価証券 20,600株
タチエス	17,600	1,763.00	31,028,800	貸付有価証券 4,900株(2,700株)
N O K	53,700	3,830.00	205,671,000	貸付有価証券 4,900株(4,900株)
フタバ産業	33,800	592.00	20,009,600	

カヤバ工業	124,000	424.00	52,576,000	貸付有価証券 8,000株
シロキ工業	25,000	371.00	9,275,000	
大同メタル工業	15,500	1,184.00	18,352,000	
プレス工業	55,000	571.00	31,405,000	貸付有価証券 21,700株
ミクニ	10,600	574.00	6,084,400	
カルソニックカンセイ	85,000	883.00	75,055,000	
太平洋工業	22,600	1,201.00	27,142,600	貸付有価証券 9,900株（100株）
ケーヒン	25,500	1,790.00	45,645,000	
河西工業	13,600	1,255.00	17,068,000	
アイシン精機	101,600	5,230.00	531,368,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
富士機工	12,800	675.00	8,640,000	
マツダ	330,800	2,384.00	788,627,200	
ダイハツ工業	132,500	1,760.00	233,200,000	貸付有価証券 58,300株（11,200株）
今仙電機製作所	9,400	1,307.00	12,285,800	貸付有価証券 200株
本田技研工業	999,000	3,927.50	3,923,572,500	貸付有価証券 11,100株（11,100株）
スズキ	232,100	4,028.00	934,898,800	貸付有価証券 8,400株（8,400株）
富士重工業	377,800	4,412.00	1,666,853,600	貸付有価証券 7,200株（7,200株）
安永	3,700	572.00	2,116,400	貸付有価証券 1,400株
ヤマハ発動機	168,800	2,706.00	456,772,800	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
ショーワ	26,200	1,242.00	32,540,400	
T B K	14,200	562.00	7,980,400	
エクセディ	15,100	3,055.00	46,130,500	
豊田合成	35,800	3,005.00	107,579,000	貸付有価証券 15,600株（15,600株）
愛三工業	17,200	1,156.00	19,883,200	
盟和産業	9,000	150.00	1,350,000	
ヨロズ	10,400	2,660.00	27,664,000	
エフ・シー・シー	16,300	1,875.00	30,562,500	貸付有価証券 5,100株

シマノ	47,900	16,630.00	796,577,000	貸付有価証券 17,500株(17,500株)
タカタ	20,100	1,342.00	26,974,200	貸付有価証券 8,800株(500株)
テイ・エス テック	23,400	3,165.00	74,061,000	
ジャムコ	4,200	3,900.00	16,380,000	
テルモ	170,200	2,895.00	492,729,000	
クリエートメディック	3,700	1,010.00	3,737,000	
日機装	36,000	1,271.00	45,756,000	
島津製作所	133,000	1,654.00	219,982,000	
JMS	20,000	306.00	6,120,000	
クボテック	2,400	848.00	2,035,200	貸付有価証券 1,000株(900株)
ショットモリテックス	2,400	248.00	595,200	貸付有価証券 900株
長野計器	7,100	797.00	5,658,700	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
ブイ・テクノロジー	2,100	3,920.00	8,232,000	貸付有価証券 900株
東京計器	38,000	262.00	9,956,000	貸付有価証券 10,000株
愛知時計電機	15,000	352.00	5,280,000	貸付有価証券 5,000株
オーバル	10,800	301.00	3,250,800	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
東京精密	19,900	2,682.00	53,371,800	
マニー	3,400	8,040.00	27,336,000	
ニコン	207,300	1,436.00	297,682,800	貸付有価証券 91,200株(1,700株)
トプコン	33,500	2,903.00	97,250,500	
オリンパス	165,400	4,235.00	700,469,000	
理研計器	9,800	1,383.00	13,553,400	
タムロン	8,500	2,683.00	22,805,500	
H O Y A	264,200	4,875.00	1,287,975,000	貸付有価証券 15,200株(15,200株)
ノーリツ鋼機	10,000	691.00	6,910,000	
エー・アンド・デイ	10,100	510.00	5,151,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
シチズンホールディングス	136,600	860.00	117,476,000	

リズム時計工業	48,000	167.00	8,016,000	
大研医器	7,700	1,218.00	9,378,600	貸付有価証券 3,300株(200株)
松風	5,400	1,318.00	7,117,200	貸付有価証券 2,200株
セイコーホールディングス	78,000	619.00	48,282,000	貸付有価証券 34,000株(8,000株)
ニプロ	70,900	1,253.00	88,837,700	
パラマウントベッドホールディングス	11,700	3,530.00	41,301,000	
トランザクション	800	1,334.00	1,067,200	
S H O - B I	3,700	411.00	1,520,700	貸付有価証券 600株
前田工織	12,200	1,067.00	13,017,400	貸付有価証券 5,300株(2,800株)
永大産業	16,000	464.00	7,424,000	
アートネイチャー	8,000	1,136.00	9,088,000	
ダンロップスポーツ	7,000	1,187.00	8,309,000	
バンダイナムコホールディングス	122,400	2,374.00	290,577,600	
共立印刷	20,100	297.00	5,969,700	
フランスベッドホールディングス	77,000	189.00	14,553,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
パイロットコーポレーション	19,400	4,530.00	87,882,000	貸付有価証券 100株
萩原工業	2,300	2,070.00	4,761,000	
トッパン・フォームズ	19,800	1,676.00	33,184,800	
フジシールインターナショナル	13,500	3,635.00	49,072,500	貸付有価証券 4,900株
タカラトミー	39,800	637.00	25,352,600	貸付有価証券 17,500株(4,800株)
廣濟堂	10,300	586.00	6,035,800	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
A s - m e エステール	3,000	785.00	2,355,000	
アーク	35,000	132.00	4,620,000	貸付有価証券 15,400株
タカノ	4,900	893.00	4,375,700	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
プロネクサス	11,300	778.00	8,791,400	
ホクシン	8,800	153.00	1,346,400	

ウッドワン	19,000	277.00	5,263,000	
大建工業	45,000	305.00	13,725,000	
凸版印刷	313,000	1,024.00	320,512,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
大日本印刷	338,000	1,255.00	424,190,000	貸付有価証券 140,000株(140,000 株)
図書印刷	18,000	405.00	7,290,000	貸付有価証券 7,000株
共同印刷	34,000	351.00	11,934,000	貸付有価証券 6,000株
日本写真印刷	18,600	2,083.00	38,743,800	貸付有価証券 6,800株(1,100株)
光村印刷	10,000	264.00	2,640,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
宝印刷	5,800	1,126.00	6,530,800	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
アシックス	110,300	3,175.00	350,202,500	貸付有価証券 7,000株(3,300株)
ツツミ	5,500	2,760.00	15,180,000	
小松ウオール工業	3,400	2,426.00	8,248,400	
ヤマハ	81,600	2,499.00	203,918,400	
河合楽器製作所	3,800	2,230.00	8,474,000	貸付有価証券 1,400株
クリナップ	10,100	876.00	8,847,600	
ピジョン	62,900	3,780.00	237,762,000	
兼松日産農林	14,000	157.00	2,198,000	貸付有価証券 6,000株
キングジム	9,200	857.00	7,884,400	貸付有価証券 500株
リンテック	26,400	2,769.00	73,101,600	
T A S A K I	2,100	2,831.00	5,945,100	貸付有価証券 900株
イトーキ	23,400	697.00	16,309,800	貸付有価証券 200株(200株)
任天堂	68,400	20,990.00	1,435,716,000	
三菱鉛筆	9,100	5,710.00	51,961,000	
タカラスタンダード	46,000	861.00	39,606,000	
コクヨ	57,700	1,053.00	60,758,100	貸付有価証券 9,300株(9,300株)
ナカバヤシ	23,000	238.00	5,474,000	

グローブライド	54,000	168.00	9,072,000	貸付有価証券 4,000株
岡村製作所	42,600	1,052.00	44,815,200	
美津濃	60,000	581.00	34,860,000	
アデランス	12,800	1,043.00	13,350,400	
東京電力	941,600	664.00	625,222,400	
中部電力	339,600	1,805.00	612,978,000	貸付有価証券 14,400株（14,400株）
関西電力	453,000	1,349.50	611,323,500	貸付有価証券 2,400株
中国電力	153,500	1,766.00	271,081,000	
北陸電力	108,700	1,827.00	198,594,900	
東北電力	277,300	1,661.00	460,595,300	
四国電力	100,000	1,811.00	181,100,000	
九州電力	245,200	1,418.00	347,693,600	貸付有価証券 83,700株（1,900株）
北海道電力	103,900	1,367.00	142,031,300	
沖縄電力	10,900	3,055.00	33,299,500	
電源開発	80,500	4,310.00	346,955,000	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
東京瓦斯	1,349,000	657.00	886,293,000	
大阪瓦斯	1,149,000	485.50	557,839,500	貸付有価証券 67,000株（67,000株）
東邦瓦斯	282,000	727.00	205,014,000	
北海道瓦斯	24,000	288.00	6,912,000	貸付有価証券 10,000株
広島ガス	17,600	489.00	8,606,400	
西部瓦斯	125,000	288.00	36,000,000	
静岡ガス	31,500	856.00	26,964,000	
メタウォーター	6,900	3,135.00	21,631,500	
SBSホールディングス	10,900	960.00	10,464,000	貸付有価証券 4,700株
東武鉄道	593,000	528.00	313,104,000	
相鉄ホールディングス	190,000	630.00	119,700,000	
東京急行電鉄	603,000	823.00	496,269,000	
京浜急行電鉄	304,000	929.00	282,416,000	貸付有価証券 23,000株
小田急電鉄	356,000	1,177.00	419,012,000	
京王電鉄	310,000	880.00	272,800,000	

京成電鉄	166,000	1,459.00	242,194,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
富士急行	30,000	1,075.00	32,250,000	貸付有価証券 13,000株(3,000株)
新京成電鉄	14,000	414.00	5,796,000	
東日本旅客鉄道	203,400	10,900.00	2,217,060,000	
西日本旅客鉄道	106,800	7,767.00	829,515,600	
東海旅客鉄道	99,400	21,945.00	2,181,333,000	
西武ホールディングス	88,400	2,876.00	254,238,400	
鴻池運輸	13,700	1,457.00	19,960,900	
西日本鉄道	144,000	555.00	79,920,000	貸付有価証券 44,000株(44,000株)
ハマキョウレックス	3,500	4,825.00	16,887,500	
サカイ引越センター	1,900	4,795.00	9,110,500	貸付有価証券 200株(200株)
近鉄グループホールディングス	1,117,000	414.00	462,438,000	貸付有価証券 488,000株(217,000株)
阪急阪神ホールディングス	745,000	724.00	539,380,000	
南海電気鉄道	249,000	546.00	135,954,000	
京阪電気鉄道	249,000	709.00	176,541,000	貸付有価証券 102,000株
神戸電鉄	27,000	359.00	9,693,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
名糖運輸	4,500	747.00	3,361,500	貸付有価証券 900株
名古屋鉄道	404,000	457.00	184,628,000	貸付有価証券 106,000株(67,000株)
山陽電気鉄道	40,000	469.00	18,760,000	
日本通運	429,000	619.00	265,551,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
ヤマトホールディングス	195,200	2,359.00	460,476,800	
山九	135,000	652.00	88,020,000	
丸運	6,000	265.00	1,590,000	
丸全昭和運輸	37,000	425.00	15,725,000	
センコー	49,000	767.00	37,583,000	貸付有価証券 21,000株(1,000株)
トナミホールディングス	23,000	382.00	8,786,000	



日本梱包運輸倉庫	36,300	2,144.00	77,827,200	
日本石油輸送	13,000	241.00	3,133,000	
福山通運	67,000	680.00	45,560,000	貸付有価証券 29,000株（28,000株）
セイノーホールディングス	85,900	1,365.00	117,253,500	
神奈川中央交通	13,000	587.00	7,631,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
日立物流	23,100	2,017.00	46,592,700	
丸和運輸機関	1,000	3,220.00	3,220,000	貸付有価証券 400株（400株）
日本郵船	938,000	342.00	320,796,000	
商船三井	582,000	391.00	227,562,000	貸付有価証券 148,000株
川崎汽船	486,000	293.00	142,398,000	貸付有価証券 90,000株
N S ユナイテッド海運	48,000	268.00	12,864,000	貸付有価証券 4,000株
明治海運	9,900	409.00	4,049,100	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
飯野海運	57,400	588.00	33,751,200	
共栄タンカー	9,000	218.00	1,962,000	
第一中央汽船	128,000	39.00	4,992,000	貸付有価証券 55,000株（1,000株）
日本航空	212,500	4,200.00	892,500,000	
A N A ホールディングス	2,182,000	322.90	704,567,800	
パスコ	10,000	340.00	3,400,000	貸付有価証券 3,000株
トランコム	3,200	6,700.00	21,440,000	貸付有価証券 400株
日新	42,000	358.00	15,036,000	
三菱倉庫	73,000	1,615.00	117,895,000	
三井倉庫ホールディングス	64,000	384.00	24,576,000	貸付有価証券 3,000株
住友倉庫	81,000	688.00	55,728,000	
澁澤倉庫	29,000	347.00	10,063,000	
東陽倉庫	19,000	286.00	5,434,000	
乾汽船	7,400	961.00	7,111,400	貸付有価証券 3,200株
日本トランスシティ	25,000	420.00	10,500,000	

ケイヒン	20,000	202.00	4,040,000	
中央倉庫	6,400	961.00	6,150,400	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
安田倉庫	8,600	996.00	8,565,600	
東洋埠頭	35,000	208.00	7,280,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	9,000	540.00	4,860,000	
上組	132,000	1,142.00	150,744,000	貸付有価証券 4,000株(1,000株)
サンリツ	2,700	561.00	1,514,700	
キムラユニティー	2,800	1,216.00	3,404,800	
キューソー流通システム	3,100	2,045.00	6,339,500	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
郵船ロジスティクス	10,200	1,396.00	14,239,200	貸付有価証券 800株
近鉄エクスプレス	9,900	5,490.00	54,351,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
東海運	6,000	286.00	1,716,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
エーアイティー	5,100	1,148.00	5,854,800	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
内外トランスライン	2,400	1,230.00	2,952,000	
NEC ネットエスアイ	13,700	2,664.00	36,496,800	
システナ	10,700	1,022.00	10,935,400	
デジタルアーツ	5,800	1,454.00	8,433,200	
新日鉄住金ソリューションズ	9,100	3,900.00	35,490,000	
キューブシステム	4,700	674.00	3,167,800	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
コア	4,600	856.00	3,937,600	貸付有価証券 2,000株(1,600株)
ソフトクリエイイトホールディングス	3,600	928.00	3,340,800	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ITホールディングス	36,300	2,585.00	93,835,500	
ネオス	2,900	793.00	2,299,700	貸付有価証券 900株(800株)
電算システム	3,800	1,688.00	6,414,400	貸付有価証券 900株(600株)
グリー	66,400	728.00	48,339,200	貸付有価証券 23,200株
コーエーテクモホール	24,800	2,090.00	51,832,000	

ディングス				
三菱総合研究所	4,200	2,810.00	11,802,000	
ボルテージ	1,900	2,478.00	4,708,200	貸付有価証券 800株
電算	1,200	2,253.00	2,703,600	貸付有価証券 300株（200株）
A G S	1,800	1,059.00	1,906,200	貸付有価証券 700株
ファインデックス	6,300	1,364.00	8,593,200	貸付有価証券 2,700株（2,400株）
ヒト・コミュニケーションズ	1,200	2,010.00	2,412,000	貸付有価証券 500株
ブレインパッド	1,600	992.00	1,587,200	貸付有価証券 700株（300株）
K L a b	11,600	1,816.00	21,065,600	貸付有価証券 4,900株（100株）
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	7,200	1,201.00	8,647,200	貸付有価証券 100株
イーブックイニシアティブジャパン	2,500	983.00	2,457,500	貸付有価証券 1,000株（900株）
ネクソン	104,600	1,697.00	177,506,200	
アイスタイル	4,600	1,158.00	5,326,800	
エムアップ	3,100	740.00	2,294,000	
エイチーム	4,000	2,394.00	9,576,000	貸付有価証券 1,700株（400株）
e n i s h	2,900	1,420.00	4,118,000	貸付有価証券 1,200株
コロプラ	30,100	2,448.00	73,684,800	貸付有価証券 13,200株（2,800株）
モバイルクリエイト	6,400	760.00	4,864,000	貸付有価証券 2,800株
オルトプラス	4,000	807.00	3,228,000	貸付有価証券 1,700株
ブロードリーフ	9,000	1,596.00	14,364,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
ハーツユニテッドグループ	3,300	1,819.00	6,002,700	貸付有価証券 1,400株（1,300株）
ベリサーブ	1,300	1,135.00	1,475,500	貸付有価証券 400株（400株）
ティーガイア	10,900	1,891.00	20,611,900	貸付有価証券 4,700株（4,700株）
豆蔵ホールディングス	8,600	622.00	5,349,200	貸付有価証券

				3,700株
テクマトリックス	4,700	944.00	4,436,800	貸付有価証券 100株
GMOペイメントゲート ウェイ	9,500	3,800.00	36,100,000	貸付有価証券 4,100株(2,700株)
ザッパラス	6,100	585.00	3,568,500	貸付有価証券 2,600株
インターネットイニシア ティブ	17,700	2,124.00	37,594,800	貸付有価証券 6,800株(6,800株)
GMOクラウド	2,400	944.00	2,265,600	
ビットアイル	12,400	481.00	5,964,400	貸付有価証券 5,300株
SRAホールディングス	5,800	2,331.00	13,519,800	
システムインテグレータ	1,500	590.00	885,000	貸付有価証券 600株
パイブドピッツ	1,400	1,771.00	2,479,400	貸付有価証券 600株
朝日ネット	11,200	524.00	5,868,800	
コムチュア	1,800	2,244.00	4,039,200	
gumi	11,000	1,374.00	15,114,000	貸付有価証券 4,800株
パナソニック インフォ メーションシステム	2,600	4,265.00	11,089,000	
フェイス	3,300	1,532.00	5,055,600	貸付有価証券 1,400株
ハイマックス	1,400	1,152.00	1,612,800	
野村総合研究所	62,000	4,765.00	295,430,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
サイバネットシステム	8,900	460.00	4,094,000	貸付有価証券 3,600株(3,400株)
CEホールディングス	1,700	1,240.00	2,108,000	
インテージホールディン グス	6,200	1,912.00	11,854,400	
東邦システムサイエンス	3,200	626.00	2,003,200	
ソースネクスト	5,500	725.00	3,987,500	貸付有価証券 2,300株(1,200株)
ティー・ワイ・オー	15,000	201.00	3,015,000	
クレスコ	2,500	1,849.00	4,622,500	
フジ・メディア・ホール ディングス	114,100	1,585.00	180,848,500	貸付有価証券 35,300株
オービック	37,800	5,300.00	200,340,000	

ジャストシステム	19,900	777.00	15,462,300	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
TDCソフトウェアエンジニアリング	2,400	1,292.00	3,100,800	
ヤフー	785,200	495.00	388,674,000	貸付有価証券 343,500株
トレンドマイクロ	58,000	4,135.00	239,830,000	
インフォメーション・ディベロプメント	2,100	981.00	2,060,100	
日本オラクル	17,600	5,110.00	89,936,000	
アルファシステムズ	3,600	1,933.00	6,958,800	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
フューチャーアーキテクト	11,500	787.00	9,050,500	貸付有価証券 4,500株
CAC Holdings	7,400	1,110.00	8,214,000	貸付有価証券 2,100株
ソフトバンク・テクノロジー	2,900	1,395.00	4,045,500	
トーセ	2,900	872.00	2,528,800	貸付有価証券 700株
オービックビジネスコンサルティング	7,000	4,555.00	31,885,000	貸付有価証券 200株(200株)
伊藤忠テクノソリューションズ	24,800	2,954.00	73,259,200	
アイティフォー	13,200	476.00	6,283,200	
東計電算	1,900	1,967.00	3,737,300	貸付有価証券 800株(800株)
エクスネット	1,000	1,534.00	1,534,000	
大塚商会	29,500	5,700.00	168,150,000	
サイボウズ	14,500	335.00	4,857,500	貸付有価証券 6,100株(6,100株)
ソフトブレーン	14,900	180.00	2,682,000	貸付有価証券 3,600株
電通国際情報サービス	6,700	1,354.00	9,071,800	
EMシステムズ	1,700	2,201.00	3,741,700	貸付有価証券 500株(100株)
ウェザーニューズ	3,300	3,720.00	12,276,000	
C I J	9,900	532.00	5,266,800	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,440.00	1,584,000	

日本エンタープライズ	9,700	343.00	3,327,100	貸付有価証券 4,200株
WOWOW	5,200	3,790.00	19,708,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
フュージョンパートナー	6,200	690.00	4,278,000	貸付有価証券 1,900株
日本コロムビア	3,700	399.00	1,476,300	貸付有価証券 1,300株
イマジカ・ロボット ホールディングス	7,700	554.00	4,265,800	貸付有価証券 1,800株
ネットワンシステムズ	44,500	858.00	38,181,000	
アルゴグラフィックス	4,500	1,973.00	8,878,500	
マーベラス	18,500	1,538.00	28,453,000	貸付有価証券 8,100株(100株)
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	21,700	2,178.00	47,262,600	貸付有価証券 9,500株(9,500株)
日本ユニシス	30,200	1,208.00	36,481,600	貸付有価証券 13,200株(4,100株)
兼松エレクトロニクス	6,900	2,007.00	13,848,300	
東京放送ホールディング ス	65,600	1,645.00	107,912,000	貸付有価証券 28,800株
日本テレビホールディン グス	100,000	2,152.00	215,200,000	貸付有価証券 12,400株
朝日放送	10,800	978.00	10,562,400	
テレビ朝日ホールディン グス	29,900	2,060.00	61,594,000	貸付有価証券 13,100株(3,200株)
スカパーJ S A Tホール ディングス	83,100	659.00	54,762,900	
テレビ東京ホールディン グス	8,900	1,919.00	17,079,100	貸付有価証券 3,900株
日本BS放送	1,800	1,109.00	1,996,200	貸付有価証券 700株(700株)
コネクシオ	7,700	1,332.00	10,256,400	
クロップス	1,300	519.00	674,700	
日本電信電話	857,400	4,382.00	3,757,126,800	
K D D I	1,113,000	2,892.50	3,219,352,500	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
光通信	9,900	8,100.00	80,190,000	
N T T ドコモ	845,000	2,338.00	1,975,610,000	
エムティーアイ	13,900	797.00	11,078,300	
G M O インターネット	36,500	1,616.00	58,984,000	

KADOKAWA・DW ANGO	26,900	1,563.00	42,044,700	貸付有価証券 2,600株
学研ホールディングス	37,000	250.00	9,250,000	
ゼンリン	14,500	1,596.00	23,142,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
昭文社	6,600	845.00	5,577,000	貸付有価証券 2,900株(2,600株)
インプレスホールディン グス	7,700	237.00	1,824,900	貸付有価証券 3,300株
アイネット	5,600	1,115.00	6,244,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
松竹	72,000	1,089.00	78,408,000	
東宝	78,200	3,040.00	237,728,000	
東映	41,000	869.00	35,629,000	貸付有価証券 16,000株(16,000株)
AOI Pro.	5,100	1,051.00	5,360,100	貸付有価証券 1,100株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	67,700	5,300.00	358,810,000	貸付有価証券 300株(300株)
ピー・シー・エー	1,400	1,533.00	2,146,200	
DTS	11,300	2,721.00	30,747,300	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	42,100	2,706.00	113,922,600	
シーイーシー	7,100	1,162.00	8,250,200	
カブコン	28,000	2,370.00	66,360,000	
アイ・エス・ピー	1,200	887.00	1,064,400	貸付有価証券 500株
ジャステック	6,300	1,051.00	6,621,300	
SCSK	26,100	3,645.00	95,134,500	
日本システムウエア	4,100	999.00	4,095,900	貸付有価証券 500株
アイネス	14,900	1,318.00	19,638,200	
TKC	10,100	3,345.00	33,784,500	
富士ソフト	15,100	2,473.00	37,342,300	
NSD	25,600	1,610.00	41,216,000	
コナミ	44,500	2,252.00	100,214,000	
福井コンピュータホール ディングス	3,000	837.00	2,511,000	
JBCCHホールディング ス	9,200	792.00	7,286,400	

ミロク情報サービス	7,200	771.00	5,551,200	
ソフトバンク	579,400	7,245.00	4,197,753,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
ハウスイ	9,000	147.00	1,323,000	貸付有価証券 3,000株
高千穂交易	4,200	1,086.00	4,561,200	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
伊藤忠食品	2,700	4,200.00	11,340,000	
エレマテック	5,100	2,921.00	14,897,100	
JALUX	3,100	2,316.00	7,179,600	貸付有価証券 400株
あらた	25,000	406.00	10,150,000	
トーメンデバイス	1,600	2,106.00	3,369,600	
東京エレクトロン デバ イス	2,900	1,673.00	4,851,700	貸付有価証券 900株
フィールズ	7,200	1,985.00	14,292,000	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
双日	733,300	295.00	216,323,500	
アルフレッサ ホール ディングス	129,600	1,906.00	247,017,600	
横浜冷凍	27,100	947.00	25,663,700	貸付有価証券 1,800株(200株)
神栄	16,000	186.00	2,976,000	
山下医科器械	900	1,780.00	1,602,000	貸付有価証券 300株(300株)
ラサ商事	5,100	613.00	3,126,300	
アルコニックス	6,200	2,028.00	12,573,600	
神戸物産	3,500	6,350.00	22,225,000	貸付有価証券 200株
あい ホールディングス	17,600	2,184.00	38,438,400	貸付有価証券 7,700株
ディー・ブイエックス	3,200	1,187.00	3,798,400	
ダイワボウホールディン グス	100,000	238.00	23,800,000	
マクニカ・富士エレホー ルディングス	19,700	1,503.00	29,609,100	
バイタルケーエスケー・ ホールディングス	20,600	878.00	18,086,800	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
八洲電機	8,400	595.00	4,998,000	
UKCホールディングス	7,000	2,573.00	18,011,000	



OCHIホールディングス	2,800	1,332.00	3,729,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
TOKAIホールディングス	53,500	497.00	26,589,500	貸付有価証券 20,500株(13,100株)
三洋貿易	6,000	1,721.00	10,326,000	
ウイン・パートナーズ	3,500	1,581.00	5,533,500	貸付有価証券 300株
ミタチ産業	2,500	786.00	1,965,000	
シップヘルスケアホールディングス	20,000	2,580.00	51,600,000	
明治電機工業	3,100	1,299.00	4,026,900	貸付有価証券 1,300株
デリカフーズ	1,900	1,024.00	1,945,600	
スターティア	1,200	1,685.00	2,022,000	
富士興産	4,200	564.00	2,368,800	
協栄産業	13,000	207.00	2,691,000	
小野建	9,500	1,207.00	11,466,500	貸付有価証券 4,100株
佐鳥電機	8,700	866.00	7,534,200	
エコトレーディング	2,500	674.00	1,685,000	貸付有価証券 1,100株(100株)
伯東	7,500	1,468.00	11,010,000	
コンドーテック	7,900	779.00	6,154,100	
中山福	6,300	872.00	5,493,600	貸付有価証券 300株
ナガイレーベン	15,800	2,394.00	37,825,200	
三菱食品	12,000	2,727.00	32,724,000	
松田産業	8,000	1,482.00	11,856,000	
メディカルホールディングス	109,600	1,972.00	216,131,200	
アドヴァン	5,600	1,621.00	9,077,600	
S P K	2,300	2,380.00	5,474,000	
萩原電気	3,000	2,016.00	6,048,000	貸付有価証券 1,300株
アズワン	7,800	4,215.00	32,877,000	
スズデン	3,500	911.00	3,188,500	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
尾家産業	3,500	890.00	3,115,000	
シモジマ	6,700	1,044.00	6,994,800	貸付有価証券

				900株(900株)
ドウシシャ	14,200	2,129.00	30,231,800	貸付有価証券 100株
小津産業	2,200	2,110.00	4,642,000	貸付有価証券 900株
高速	6,500	888.00	5,772,000	
たけびし	3,800	1,085.00	4,123,000	貸付有価証券 1,600株
黒田電気	19,000	2,256.00	42,864,000	
丸文	9,700	965.00	9,360,500	
ハビネット	6,600	1,292.00	8,527,200	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
橋本総業	2,000	1,418.00	2,836,000	
エクセル	5,000	1,401.00	7,005,000	貸付有価証券 2,200株
マルカキカイ	3,500	1,993.00	6,975,500	貸付有価証券 900株(900株)
ガリバーインターナショナル	33,200	1,129.00	37,482,800	貸付有価証券 14,900株(14,900株)
日本エム・ディ・エム	9,100	504.00	4,586,400	
進和	6,500	2,177.00	14,150,500	
エスケイジャパン	2,600	233.00	605,800	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
ダイトエレクトロン	5,000	896.00	4,480,000	
シークス	6,900	3,195.00	22,045,500	貸付有価証券 3,000株(2,000株)
田中商事	3,300	764.00	2,521,200	
オーハシテクニカ	6,700	1,621.00	10,860,700	貸付有価証券 2,300株(2,300株)
白銅	3,500	1,491.00	5,218,500	
伊藤忠商事	917,100	1,625.00	1,490,287,500	貸付有価証券 13,100株(13,100株)
丸紅	958,400	703.70	674,426,080	貸付有価証券 59,900株(59,900株)
高島	20,000	273.00	5,460,000	
長瀬産業	61,500	1,663.00	102,274,500	
蝶理	7,000	1,908.00	13,356,000	
豊田通商	122,000	3,225.00	393,450,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
三共生興	18,600	504.00	9,374,400	

兼松	218,000	213.00	46,434,000	
ツカモトコーポレーション	20,000	150.00	3,000,000	
三井物産	928,800	1,652.00	1,534,377,600	
日本紙パルプ商事	57,000	334.00	19,038,000	
日立ハイテクノロジーズ	38,000	3,425.00	130,150,000	
カメイ	14,300	1,132.00	16,187,600	
東都水産	18,000	200.00	3,600,000	
OUGホールディングス	17,000	252.00	4,284,000	
スターゼン	42,000	367.00	15,414,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
山善	42,000	1,102.00	46,284,000	
椿本興業	12,000	377.00	4,524,000	
住友商事	646,600	1,409.00	911,059,400	
内田洋行	27,000	436.00	11,772,000	
三菱商事	839,600	2,691.00	2,259,363,600	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
第一実業	27,000	642.00	17,334,000	
キャノンマーケティング ジャパン	31,200	2,041.00	63,679,200	
西華産業	36,000	325.00	11,700,000	
佐藤商事	9,800	806.00	7,898,800	
菱洋エレクトロ	12,600	1,566.00	19,731,600	貸付有価証券 5,400株(5,400株)
東京産業	10,900	489.00	5,330,100	
ユアサ商事	9,600	2,853.00	27,388,800	
神鋼商事	27,000	278.00	7,506,000	
小林産業	8,000	246.00	1,968,000	
阪和興業	109,000	584.00	63,656,000	
カナデン	9,400	980.00	9,212,000	
菱電商事	17,000	971.00	16,507,000	
フルサト工業	6,000	1,756.00	10,536,000	
岩谷産業	121,000	776.00	93,896,000	貸付有価証券 3,000株(2,000株)
すてきナイスグループ	47,000	205.00	9,635,000	
昭光通商	39,000	117.00	4,563,000	貸付有価証券 17,000株
二チモウ	17,000	195.00	3,315,000	

極東貿易	13,000	323.00	4,199,000	貸付有価証券 5,000株
イワキ	16,000	234.00	3,744,000	
三愛石油	28,000	796.00	22,288,000	
稲畑産業	26,300	1,326.00	34,873,800	
G S I クレオス	29,000	138.00	4,002,000	貸付有価証券 7,000株（7,000株）
明和産業	8,600	420.00	3,612,000	
ワキタ	23,300	1,247.00	29,055,100	
東邦ホールディングス	37,800	2,744.00	103,723,200	貸付有価証券 9,500株（7,100株）
サンゲツ	38,300	1,842.00	70,548,600	
ミツウロコグループホー ルディングス	17,600	606.00	10,665,600	
シナネン	23,000	475.00	10,925,000	
伊藤忠エネクス	24,200	1,179.00	28,531,800	
サンリオ	30,700	3,380.00	103,766,000	貸付有価証券 13,500株
サンワテクノス	7,000	1,365.00	9,555,000	
リョーサン	18,500	3,170.00	58,645,000	
新光商事	12,900	1,291.00	16,653,900	
トーヨー	25,000	496.00	12,400,000	貸付有価証券 10,000株（8,000株）
三信電気	15,100	1,266.00	19,116,600	
東陽テクニカ	16,000	1,026.00	16,416,000	貸付有価証券 800株
モスフードサービス	14,300	2,527.00	36,136,100	貸付有価証券 100株（100株）
加賀電子	9,900	1,562.00	15,463,800	
ソーダニッカ	11,300	531.00	6,000,300	
立花エレテック	8,100	1,417.00	11,477,700	
フォーバル	2,200	1,578.00	3,471,600	
P a l t a c	17,500	2,113.00	36,977,500	
三谷産業	11,600	489.00	5,672,400	貸付有価証券 5,100株
太平洋興発	43,000	96.00	4,128,000	貸付有価証券 6,000株
ヤマタネ	55,000	207.00	11,385,000	
丸紅建材リース	9,000	261.00	2,349,000	

日鉄住金物産	72,000	451.00	32,472,000	
トラスコ中山	13,700	4,135.00	56,649,500	
オートバックスセブン	40,300	2,031.00	81,849,300	貸付有価証券 3,000株(1,000株)
加藤産業	17,100	2,843.00	48,615,300	
イノテック	10,000	480.00	4,800,000	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	10,300	2,349.00	24,194,700	
J Kホールディングス	11,000	588.00	6,468,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
日伝	4,500	3,025.00	13,612,500	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
北沢産業	9,000	186.00	1,674,000	
杉本商事	5,900	1,477.00	8,714,300	
因幡電機産業	16,300	4,250.00	69,275,000	
バイテック	3,700	1,318.00	4,876,600	貸付有価証券 1,500株
ミスミグループ本社	123,000	1,714.00	210,822,000	
アルテック	8,000	231.00	1,848,000	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
タキヒヨー	18,000	475.00	8,550,000	貸付有価証券 7,000株(7,000株)
蔵王産業	1,500	1,447.00	2,170,500	
スズケン	49,900	3,875.00	193,362,500	
ジェコス	7,500	1,254.00	9,405,000	
ルネサスイーストン	5,400	603.00	3,256,200	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
ローソン	41,500	8,210.00	340,715,000	貸付有価証券 5,600株(4,600株)
サンエー	8,300	5,350.00	44,405,000	
ダイユーエイト	2,600	807.00	2,098,200	貸付有価証券 200株
カワチ薬品	8,500	1,844.00	15,674,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
エービーシー・マート	15,600	7,350.00	114,660,000	貸付有価証券 5,300株(3,700株)
ハードオフコーポレーション	5,300	1,398.00	7,409,400	
アスクル	11,400	3,710.00	42,294,000	貸付有価証券 3,500株

ゲオホールディングス	20,600	1,476.00	30,405,600	
アダストリア	9,300	4,285.00	39,850,500	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	14,000	120.00	1,680,000	貸付有価証券 2,000株
くらコーポレーション	6,400	3,930.00	25,152,000	貸付有価証券 100株(100株)
キャンドウ	5,200	1,541.00	8,013,200	貸付有価証券 2,200株(1,800株)
パル	6,400	3,935.00	25,184,000	
エディオン	50,200	872.00	43,774,400	貸付有価証券 22,000株(8,900株)
サーラコーポレーション	9,400	593.00	5,574,200	貸付有価証券 200株(200株)
ワッツ	4,300	1,016.00	4,368,800	貸付有価証券 1,800株
あみやき亭	1,900	4,880.00	9,272,000	貸付有価証券 700株(700株)
ひらまつ	15,100	818.00	12,351,800	貸付有価証券 600株
ゲンキー	1,100	9,730.00	10,703,000	貸付有価証券 400株(400株)
サッポロドラッグスト アー	900	1,766.00	1,589,400	貸付有価証券 300株
大黒天物産	2,600	4,690.00	12,194,000	貸付有価証券 100株
ハニーズ	9,600	1,025.00	9,840,000	貸付有価証券 4,200株
ファーマライズホール ディングス	2,500	572.00	1,430,000	
アルペン	9,800	1,937.00	18,982,600	貸付有価証券 4,300株
クオール	11,100	1,602.00	17,782,200	
ジェイアイエヌ	7,400	5,240.00	38,776,000	貸付有価証券 2,900株(2,800株)
ビックカメラ	53,800	1,520.00	81,776,000	貸付有価証券 23,600株(100株)
D C Mホールディングス	53,000	1,204.00	63,812,000	
M o n o t a R O	21,400	5,310.00	113,634,000	貸付有価証券 6,800株(6,600株)
きちり	2,900	701.00	2,032,900	貸付有価証券 1,200株(800株)

アークランドサービス	1,300	5,270.00	6,851,000	貸付有価証券 500株(200株)
J・フロントリテイリング	138,600	2,328.00	322,660,800	
ドトール・日レスホールディングス	19,200	2,218.00	42,585,600	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
マツモトキヨシホールディングス	24,500	5,600.00	137,200,000	
ブロンコピリー	3,800	2,601.00	9,883,800	貸付有価証券 800株(300株)
スタートトゥデイ	34,100	3,425.00	116,792,500	
トレジャー・ファクトリー	2,700	1,421.00	3,836,700	
物語コーポレーション	3,100	3,985.00	12,353,500	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
ココカラファイン	11,400	4,195.00	47,823,000	
三越伊勢丹ホールディングス	217,800	2,174.00	473,497,200	
ウエルシアホールディングス	9,400	5,490.00	51,606,000	貸付有価証券 600株
クリエイティブSDホールディングス	5,400	5,430.00	29,322,000	
丸善CHIホールディングス	12,800	398.00	5,094,400	貸付有価証券 5,600株(2,500株)
ミサワ	1,300	637.00	828,100	貸付有価証券 500株(500株)
エー・ピーカンパニー	1,500	2,015.00	3,022,500	貸付有価証券 600株
チムニー	2,700	3,035.00	8,194,500	貸付有価証券 1,100株(800株)
ネクステージ	1,400	833.00	1,166,200	貸付有価証券 400株
ジョイフル本田	16,000	2,532.00	40,512,000	貸付有価証券 4,800株
キリン堂ホールディングス	3,500	1,459.00	5,106,500	
すかいらーく	53,600	1,568.00	84,044,800	貸付有価証券 23,500株(1,100株)
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	36,000	1,032.00	37,152,000	
ブックオフコーポレーション	6,200	879.00	5,449,800	

あさひ	7,200	1,270.00	9,144,000	貸付有価証券 3,100株
日本調剤	1,400	5,830.00	8,162,000	貸付有価証券 600株
コスモス薬品	5,500	16,480.00	90,640,000	貸付有価証券 2,000株(1,900株)
トーエル	5,800	744.00	4,315,200	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
一六堂	2,600	438.00	1,138,800	
セブン & アイ・ホールディングス	458,300	5,208.00	2,386,826,400	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
薬王堂	1,500	3,290.00	4,935,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	7,600	2,731.00	20,755,600	
ツルハホールディングス	23,400	9,320.00	218,088,000	
サンマルクホールディングス	7,900	4,110.00	32,469,000	
フェリシモ	2,800	1,238.00	3,466,400	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
トリドール	11,700	1,613.00	18,872,100	
クスリのアオキ	8,600	5,260.00	45,236,000	
メディカルシステムネットワーク	11,100	480.00	5,328,000	貸付有価証券 400株
総合メディカル	5,300	3,360.00	17,808,000	
はるやま商事	4,500	756.00	3,402,000	
カッパ・クリエイトホールディングス	17,100	1,152.00	19,699,200	
ライトオン	8,200	1,012.00	8,298,400	貸付有価証券 3,500株
ジーンズメイト	3,500	269.00	941,500	貸付有価証券 600株(100株)
良品計画	13,500	23,400.00	315,900,000	
三城ホールディングス	13,500	476.00	6,426,000	
アルビス	2,500	2,069.00	5,172,500	
コナカ	12,900	715.00	9,223,500	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,429.00	1,714,800	貸付有価証券 500株(500株)
G - 7ホールディングス	2,300	1,500.00	3,450,000	
イオン北海道	6,900	654.00	4,512,600	貸付有価証券 2,900株(2,900株)



コジマ	16,100	373.00	6,005,300	
ヒマラヤ	3,400	1,113.00	3,784,200	貸付有価証券 300株
コーナン商事	16,700	1,563.00	26,102,100	
エコス	3,800	981.00	3,727,800	
ワタミ	12,900	1,013.00	13,067,700	貸付有価証券 5,600株(5,400株)
マルシェ	2,700	886.00	2,392,200	貸付有価証券 1,100株
ドンキホーテホールディングス	70,800	5,090.00	360,372,000	貸付有価証券 600株
西松屋チェーン	21,600	1,191.00	25,725,600	貸付有価証券 2,500株
ゼンショーホールディングス	56,300	1,154.00	64,970,200	貸付有価証券 11,200株
幸楽苑	6,900	1,544.00	10,653,600	貸付有価証券 2,900株(1,800株)
ハークスレイ	3,000	981.00	2,943,000	
サイゼリヤ	18,000	2,700.00	48,600,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
魚力	3,000	2,165.00	6,495,000	
ポブラ	2,700	550.00	1,485,000	貸付有価証券 1,100株(500株)
ユナイテッドアローズ	14,300	3,855.00	55,126,500	貸付有価証券 3,800株(1,700株)
ハイデイ日高	8,300	2,990.00	24,817,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
京都きもの友禅	6,400	1,020.00	6,528,000	貸付有価証券 2,900株
コロワイド	36,300	1,823.00	66,174,900	貸付有価証券 15,800株(100株)
壱番屋	5,000	5,050.00	25,250,000	貸付有価証券 1,300株
トップカルチャー	4,400	524.00	2,305,600	貸付有価証券 1,900株(1,600株)
P L A N T	2,500	1,488.00	3,720,000	貸付有価証券 1,100株
スギホールディングス	19,600	6,230.00	122,108,000	
スクロール	14,200	298.00	4,231,600	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
ヨンドシーホールディング	8,300	2,882.00	23,920,600	貸付有価証券

グス				1,800株(1,800株)
ファミリーマート	37,000	5,500.00	203,500,000	貸付有価証券 11,600株(11,400株)
木曽路	13,400	2,012.00	26,960,800	貸付有価証券 5,800株(5,500株)
サトレストランシステムズ	12,000	908.00	10,896,000	貸付有価証券 5,200株(1,300株)
千趣会	19,700	851.00	16,764,700	貸付有価証券 8,600株(8,100株)
タカキュー	7,600	212.00	1,611,200	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
ケーヨー	20,500	560.00	11,480,000	貸付有価証券 9,000株
上新電機	24,000	928.00	22,272,000	
日本瓦斯	17,600	3,805.00	66,968,000	貸付有価証券 3,200株
ベスト電器	35,300	152.00	5,365,600	貸付有価証券 15,400株(14,100株)
ロイヤルホールディングス	18,300	2,050.00	37,515,000	貸付有価証券 8,000株(100株)
東天紅	8,000	180.00	1,440,000	貸付有価証券 1,000株
いなげや	12,200	1,465.00	17,873,000	
島忠	28,300	3,455.00	97,776,500	
チヨダ	12,900	2,838.00	36,610,200	
ライフコーポレーション	6,900	2,742.00	18,919,800	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
リンガーハット	10,600	2,549.00	27,019,400	貸付有価証券 300株(300株)
さが美	8,000	202.00	1,616,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
MrMax	10,900	449.00	4,894,100	貸付有価証券 4,700株
テンアライド	9,200	388.00	3,569,600	貸付有価証券 4,000株
AOKIホールディングス	25,200	1,765.00	44,478,000	
オークワ	17,000	1,017.00	17,289,000	
コメリ	18,800	2,793.00	52,508,400	
青山商事	27,500	4,855.00	133,512,500	
しまむら	12,700	12,750.00	161,925,000	

C F S コーポレーション	7,200	1,092.00	7,862,400	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
はせがわ	3,800	545.00	2,071,000	
高島屋	159,000	1,114.00	177,126,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
松屋	22,000	2,262.00	49,764,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,800	2,542.00	131,675,600	
近鉄百貨店	42,000	342.00	14,364,000	
丸栄	18,000	135.00	2,430,000	貸付有価証券 7,000株
ニッセンホールディング ス	23,000	252.00	5,796,000	貸付有価証券 10,100株(5,900株)
パルコ	10,500	1,192.00	12,516,000	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
丸井グループ	115,300	1,646.00	189,783,800	貸付有価証券 5,500株(5,500株)
アクシアル リテイリン グ	8,500	3,420.00	29,070,000	貸付有価証券 100株
井筒屋	59,000	83.00	4,897,000	
イオン	451,800	1,627.50	735,304,500	貸付有価証券 102,400株(27,300 株)
ユニグループ・ホール ディングス	104,900	757.00	79,409,300	貸付有価証券 11,100株(5,700株)
イズミ	24,500	5,060.00	123,970,000	
東武ストア	14,000	318.00	4,452,000	貸付有価証券 6,000株(5,000株)
平和堂	22,200	3,010.00	66,822,000	貸付有価証券 200株(200株)
フジ	12,200	2,270.00	27,694,000	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
ヤオコー	12,400	5,650.00	70,060,000	
ゼビオ	14,900	2,371.00	35,327,900	貸付有価証券 3,400株(2,800株)
ケーズホールディングス	25,200	4,380.00	110,376,000	貸付有価証券 11,000株
O l y m p i c グループ	6,400	783.00	5,011,200	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
日産東京販売ホールディ ングス	18,400	355.00	6,532,000	

インファーマシーズ	13,200	5,430.00	71,676,000	
元気寿司	3,400	2,456.00	8,350,400	
ヤマダ電機	433,100	499.00	216,116,900	貸付有価証券 169,300株（32,300株）
アークランドサカモト	7,800	2,721.00	21,223,800	
ニトリホールディングス	47,300	9,630.00	455,499,000	
グルメ杵屋	8,000	974.00	7,792,000	貸付有価証券 2,000株
愛眼	8,700	247.00	2,148,900	貸付有価証券 3,500株（3,500株）
ケーユーホールディングス	5,700	751.00	4,280,700	貸付有価証券 500株
吉野家ホールディングス	30,900	1,469.00	45,392,100	貸付有価証券 9,500株（3,300株）
松屋フーズ	5,300	2,334.00	12,370,200	
サガミチェーン	14,000	1,248.00	17,472,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
関西スーパーマーケット	8,200	811.00	6,650,200	
王将フードサービス	8,000	4,240.00	33,920,000	
プレナス	12,200	2,217.00	27,047,400	
ミニストップ	8,100	2,115.00	17,131,500	
アークス	19,000	2,634.00	50,046,000	
パロー	23,600	2,996.00	70,705,600	
藤久	900	1,722.00	1,549,800	貸付有価証券 300株（300株）
ベルク	4,900	3,860.00	18,914,000	貸付有価証券 400株
大庄	5,100	1,523.00	7,767,300	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
ファーストリテイリング	21,900	54,560.00	1,194,864,000	貸付有価証券 300株（100株）
サンドラッグ	23,200	7,070.00	164,024,000	
サックスパーホールディングス	8,200	2,170.00	17,794,000	貸付有価証券 2,700株（600株）
ヤマザワ	2,300	1,741.00	4,004,300	貸付有価証券 200株
やまや	1,900	2,040.00	3,876,000	
ベルーナ	27,300	657.00	17,936,100	
島根銀行	2,300	1,560.00	3,588,000	

じもとホールディングス	78,600	218.00	17,134,800	貸付有価証券 1,100株
足利ホールディングス	68,900	523.00	36,034,700	
東京ＴＹフィナンシャル グループ	14,100	4,115.00	58,021,500	
新生銀行	1,043,000	245.00	255,535,000	
あおぞら銀行	739,000	456.00	336,984,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャ ル・グループ	8,790,600	885.80	7,786,713,480	貸付有価証券 94,900株(94,900株)
りそなホールディングス	1,281,700	674.40	864,378,480	貸付有価証券 62,800株(62,800株)
三井住友トラスト・ホー ルディングス	2,422,000	565.50	1,369,641,000	貸付有価証券 69,000株(69,000株)
三井住友フィナンシャル グループ	828,600	5,413.00	4,485,211,800	貸付有価証券 28,400株(28,400株)
第四銀行	139,000	514.00	71,446,000	
北越銀行	118,000	255.00	30,090,000	
西日本シティ銀行	384,000	349.00	134,016,000	
千葉銀行	422,000	930.00	392,460,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
横浜銀行	735,000	758.50	557,497,500	
常陽銀行	396,000	676.00	267,696,000	貸付有価証券 54,000株(54,000株)
群馬銀行	260,000	910.00	236,600,000	
武蔵野銀行	17,500	4,800.00	84,000,000	
千葉興業銀行	22,700	930.00	21,111,000	
筑波銀行	45,500	403.00	18,336,500	貸付有価証券 6,600株(6,600株)
七十七銀行	185,000	744.00	137,640,000	
青森銀行	86,000	401.00	34,486,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
秋田銀行	72,000	387.00	27,864,000	
山形銀行	66,000	530.00	34,980,000	貸付有価証券 29,000株(8,000株)
岩手銀行	7,700	5,490.00	42,273,000	貸付有価証券 3,300株(800株)
東邦銀行	98,000	546.00	53,508,000	
東北銀行	59,000	168.00	9,912,000	
みちのく銀行	55,000	212.00	11,660,000	貸付有価証券 24,000株(18,000株)

ふくおかフィナンシャルグループ	445,000	628.00	279,460,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
静岡銀行	321,000	1,284.00	412,164,000	
十六銀行	137,000	494.00	67,678,000	
スルガ銀行	115,700	2,626.00	303,828,200	貸付有価証券 3,300株
八十二銀行	198,000	928.00	183,744,000	
山梨中央銀行	68,000	582.00	39,576,000	
大垣共立銀行	137,000	443.00	60,691,000	
福井銀行	94,000	271.00	25,474,000	
北國銀行	122,000	445.00	54,290,000	
清水銀行	3,700	3,335.00	12,339,500	
滋賀銀行	110,000	659.00	72,490,000	貸付有価証券 47,000株
南都銀行	106,000	434.00	46,004,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
百五銀行	105,000	602.00	63,210,000	
京都銀行	209,000	1,411.00	294,899,000	
紀陽銀行	43,000	1,862.00	80,066,000	
三重銀行	49,000	287.00	14,063,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	745,000	289.00	215,305,000	
広島銀行	323,000	732.00	236,436,000	貸付有価証券 31,000株(31,000株)
山陰合同銀行	66,000	1,184.00	78,144,000	
中国銀行	77,700	1,943.00	150,971,100	
鳥取銀行	35,000	229.00	8,015,000	
伊予銀行	117,200	1,515.00	177,558,000	
百十四銀行	120,000	434.00	52,080,000	
四国銀行	85,000	278.00	23,630,000	貸付有価証券 11,000株
阿波銀行	90,000	781.00	70,290,000	
鹿児島銀行	76,000	885.00	67,260,000	
大分銀行	67,000	521.00	34,907,000	貸付有価証券 29,000株
宮崎銀行	73,000	458.00	33,434,000	
肥後銀行	89,000	796.00	70,844,000	
佐賀銀行	66,000	313.00	20,658,000	

十八銀行	67,000	370.00	24,790,000	
沖縄銀行	8,700	5,230.00	45,501,000	
琉球銀行	22,600	1,816.00	41,041,600	
セブン銀行	369,500	566.00	209,137,000	
みずほフィナンシャルグループ	15,279,100	265.10	4,050,489,410	貸付有価証券 3,315,400株（140,200株）
高知銀行	42,000	169.00	7,098,000	貸付有価証券 4,000株
山口フィナンシャルグループ	109,000	1,532.00	166,988,000	貸付有価証券 47,000株（24,000株）
長野銀行	36,000	232.00	8,352,000	貸付有価証券 15,000株
名古屋銀行	99,000	479.00	47,421,000	貸付有価証券 43,000株
北洋銀行	165,100	534.00	88,163,400	
愛知銀行	4,000	6,620.00	26,480,000	
第三銀行	62,000	196.00	12,152,000	貸付有価証券 26,000株
中京銀行	45,000	229.00	10,305,000	
東日本銀行	48,000	443.00	21,264,000	
大光銀行	39,000	239.00	9,321,000	
愛媛銀行	64,000	267.00	17,088,000	貸付有価証券 28,000株（26,000株）
トマト銀行	42,000	198.00	8,316,000	
みなと銀行	99,000	318.00	31,482,000	貸付有価証券 4,000株
京葉銀行	90,000	636.00	57,240,000	
関西アーバン銀行	15,300	1,453.00	22,230,900	
栃木銀行	55,000	690.00	37,950,000	貸付有価証券 6,000株（6,000株）
北日本銀行	3,400	3,505.00	11,917,000	
東和銀行	154,000	117.00	18,018,000	
福島銀行	135,000	101.00	13,635,000	貸付有価証券 56,000株（56,000株）
大東銀行	70,000	177.00	12,390,000	貸付有価証券 11,000株（3,000株）
トモニホールディングス	84,100	556.00	46,759,600	
フィデアホールディングス	65,400	263.00	17,200,200	貸付有価証券 28,200株（1,300株）

池田泉州ホールディングス	104,400	552.00	57,628,800	貸付有価証券 29,800株(29,800株)
F P G	32,400	909.00	29,451,600	貸付有価証券 14,200株(12,000株)
S B Iホールディングス	131,600	1,682.00	221,351,200	
日本アジア投資	83,000	62.00	5,146,000	
ジャフコ	15,000	4,725.00	70,875,000	貸付有価証券 100株
大和証券グループ本社	1,025,000	930.60	953,865,000	
野村ホールディングス	2,239,800	825.00	1,847,835,000	
岡三証券グループ	93,000	859.00	79,887,000	
丸三証券	34,800	1,306.00	45,448,800	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
東洋証券	42,000	379.00	15,918,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	125,700	888.00	111,621,600	
光世証券	26,000	223.00	5,798,000	貸付有価証券 11,000株(10,000株)
水戸証券	33,900	433.00	14,678,700	
いちよし証券	23,000	1,184.00	27,232,000	貸付有価証券 10,100株
松井証券	55,700	1,068.00	59,487,600	貸付有価証券 1,000株
だいこう証券ビジネス	5,300	989.00	5,241,700	貸付有価証券 2,200株
マネックスグループ	128,900	341.00	43,954,900	貸付有価証券 45,800株(27,700株)
カブドットコム証券	97,200	409.00	39,754,800	貸付有価証券 13,800株(1,900株)
極東証券	14,700	1,782.00	26,195,400	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
岩井コスモホールディングス	11,200	1,556.00	17,427,200	
藍澤證券	15,400	803.00	12,366,200	
マネースクウェアHD	4,500	1,338.00	6,021,000	貸付有価証券 1,900株
マネーパートナーズグループ	11,200	408.00	4,569,600	貸付有価証券 100株
小林洋行	3,100	333.00	1,032,300	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
損保ジャパン日本興亜	243,400	4,462.50	1,086,172,500	



ホールディングス				
アニコム ホールディングス	6,200	2,227.00	13,807,400	貸付有価証券 2,700株(2,300株)
MS & A Dインシュアランスグループホール	349,200	3,782.50	1,320,849,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	105,000	2,075.00	217,875,000	
第一生命保険	702,000	2,387.50	1,676,025,000	貸付有価証券 9,300株(9,300株)
東京海上ホールディングス	443,900	5,031.00	2,233,260,900	
T & Dホールディングス	399,300	1,837.00	733,514,100	
全国保証	28,500	4,180.00	119,130,000	
クレディセゾン	89,500	2,631.00	235,474,500	
アクリーティブ	7,500	736.00	5,520,000	貸付有価証券 3,300株(2,400株)
芙蓉総合リース	11,500	5,090.00	58,535,000	
興銀リース	20,600	2,793.00	57,535,800	
東京センチュリーリース	25,700	3,915.00	100,615,500	
日本証券金融	48,300	711.00	34,341,300	
アイフル	183,300	396.00	72,586,800	貸付有価証券 80,600株(2,500株)
ポケットカード	8,200	540.00	4,428,000	貸付有価証券 3,600株
リコーリース	8,600	3,735.00	32,121,000	貸付有価証券 3,000株
イオンフィナンシャルサービス	71,900	3,335.00	239,786,500	貸付有価証券 31,600株(1,400株)
アコム	220,100	453.00	99,705,300	貸付有価証券 94,900株
ジャックス	60,000	584.00	35,040,000	
オリエントコーポレーション	253,200	215.00	54,438,000	貸付有価証券 101,300株
日立キャピタル	21,500	3,205.00	68,907,500	
アプラスフィナンシャル	52,500	133.00	6,982,500	貸付有価証券 23,100株
オリックス	775,600	1,832.50	1,421,287,000	
三菱UFJリース	277,900	662.00	183,969,800	
日本取引所グループ	160,900	3,945.00	634,750,500	
イー・ギャランティ	3,200	2,389.00	7,644,800	貸付有価証券

				1,400株
アサックス	1,900	1,580.00	3,002,000	
NECキャピタルソリューション	4,500	1,862.00	8,379,000	
日本駐車場開発	119,000	178.00	21,182,000	貸付有価証券 50,200株
ヒューリック	203,500	1,105.00	224,867,500	貸付有価証券 600株
東京建物不動産販売	5,700	539.00	3,072,300	
三栄建築設計	4,400	1,049.00	4,615,600	
野村不動産ホールディングス	65,900	2,576.00	169,758,400	
三重交通グループホールディングス	19,400	469.00	9,098,600	貸付有価証券 8,500株(8,400株)
日本商業開発	3,500	2,155.00	7,542,500	貸付有価証券 1,500株
プレサンスコーポレーション	3,700	4,105.00	15,188,500	
常和ホールディングス	6,000	5,370.00	32,220,000	
日本管理センター	7,100	1,665.00	11,821,500	貸付有価証券 2,300株
サンセイランディック	1,700	806.00	1,370,200	貸付有価証券 600株
エストラスト	1,500	615.00	922,500	
フージャースホールディングス	16,300	498.00	8,117,400	貸付有価証券 7,000株(100株)
オープンハウス	15,800	2,052.00	32,421,600	貸付有価証券 1,400株
東急不動産ホールディングス	287,100	935.00	268,438,500	
飯田グループホールディングス	71,000	1,926.00	136,746,000	貸付有価証券 2,000株
パーク24	55,100	2,065.00	113,781,500	貸付有価証券 9,500株(1,300株)
パラカ	3,800	1,434.00	5,449,200	
三井不動産	581,000	3,417.50	1,985,567,500	貸付有価証券 32,000株(32,000株)
三菱地所	815,000	2,633.00	2,145,895,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
平和不動産	20,700	1,675.00	34,672,500	
東京建物	119,500	1,714.00	204,823,000	貸付有価証券

				4,000株(4,000株)
ダイビル	28,200	1,115.00	31,443,000	
京阪神ビルディング	18,100	750.00	13,575,000	
住友不動産	263,000	4,325.00	1,137,475,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
大京	174,000	191.00	33,234,000	
テーオーシー	37,700	871.00	32,836,700	
東京楽天地	18,000	503.00	9,054,000	貸付有価証券 7,000株
レオパレス21	119,800	722.00	86,495,600	
スターツコーポレーション	12,600	1,889.00	23,801,400	
フジ住宅	14,000	685.00	9,590,000	貸付有価証券 6,100株
空港施設	13,200	656.00	8,659,200	
明和地所	6,300	638.00	4,019,400	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
住友不動産販売	7,900	3,050.00	24,095,000	
ゴールドクレスト	9,900	2,404.00	23,799,600	
日本エスリード	4,300	1,252.00	5,383,600	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
日神不動産	14,600	435.00	6,351,000	
タカラレーベン	48,500	722.00	35,017,000	貸付有価証券 21,100株(21,100株)
サンヨーハウジング名古屋	6,200	1,254.00	7,774,800	
イオンモール	70,700	2,202.00	155,681,400	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
ファースト住建	4,100	1,406.00	5,764,600	貸付有価証券 1,800株(200株)
トーセイ	15,000	882.00	13,230,000	貸付有価証券 500株(500株)
穴吹興産	10,000	252.00	2,520,000	貸付有価証券 4,000株
エヌ・ティ・ティ都市開発	68,100	1,213.00	82,605,300	
サンフロンティア不動産	11,800	993.00	11,717,400	貸付有価証券 5,100株(5,100株)
エフ・ジェー・ネクスト	8,400	629.00	5,283,600	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ランドビジネス	7,400	391.00	2,893,400	

グランディハウス	9,600	362.00	3,475,200	
日本空港ビルデング	37,900	6,650.00	252,035,000	貸付有価証券 16,600株(100株)
日本工営	39,000	481.00	18,759,000	貸付有価証券 2,000株
ネクスト	27,300	853.00	23,286,900	貸付有価証券 1,000株
日本M&Aセンター	17,900	4,915.00	87,978,500	
ノバレーゼ	3,000	903.00	2,709,000	貸付有価証券 1,200株(1,000株)
アコーディア・ゴルフ	43,600	1,156.00	50,401,600	
タケエイ	11,300	1,230.00	13,899,000	貸付有価証券 2,000株
トラスト・テック	2,000	2,285.00	4,570,000	貸付有価証券 600株
パソナグループ	8,600	1,115.00	9,589,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
CDS	2,600	986.00	2,563,600	貸付有価証券 200株
リンクアンドモチベー ション	15,600	167.00	2,605,200	貸付有価証券 6,800株
GCAサヴィアン	9,200	1,504.00	13,836,800	貸付有価証券 2,000株
エス・エム・エス	13,000	1,586.00	20,618,000	貸付有価証券 100株
テンプホールディングス	22,800	4,285.00	97,698,000	貸付有価証券 10,000株
リニカル	3,000	1,297.00	3,891,000	
クックパッド	22,200	2,086.00	46,309,200	貸付有価証券 3,100株(700株)
エスクリ	4,100	1,109.00	4,546,900	貸付有価証券 1,800株
アイ・ケイ・ケイ	6,200	623.00	3,862,600	貸付有価証券 2,400株
学情	4,300	1,258.00	5,409,400	貸付有価証券 1,800株(200株)
スタジオアリス	5,300	2,112.00	11,193,600	貸付有価証券 2,300株(200株)
シミックホールディング ス	5,200	1,688.00	8,777,600	貸付有価証券 2,200株(1,800株)
NJS	2,600	1,537.00	3,996,200	

総合警備保障	38,700	4,775.00	184,792,500	
カカクコム	76,400	1,763.00	134,693,200	貸付有価証券 33,500株(33,300株)
ルネサンス	5,900	1,305.00	7,699,500	貸付有価証券 700株
ディップ	2,600	11,960.00	31,096,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
オプトホールディング	5,200	668.00	3,473,600	貸付有価証券 200株
新日本科学	11,000	725.00	7,975,000	貸付有価証券 4,800株
ツクイ	13,700	945.00	12,946,500	貸付有価証券 6,000株(1,500株)
総合臨床ホールディングス	5,900	488.00	2,879,200	貸付有価証券 100株
キャリアデザインセンター	3,200	1,270.00	4,064,000	
エムスリー	100,400	2,424.00	243,369,600	貸付有価証券 900株
ツカダ・グローバルホールディング	8,400	771.00	6,476,400	貸付有価証券 3,600株(2,000株)
アウトソーシング	4,400	2,125.00	9,350,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
ウェルネット	4,100	2,885.00	11,828,500	
ディー・エヌ・エー	57,200	2,403.00	137,451,600	貸付有価証券 24,700株
博報堂DYホールディングス	160,700	1,287.00	206,820,900	
ぐるなび	13,400	1,968.00	26,371,200	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
エスアールジータカミヤ	9,300	717.00	6,668,100	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
一休	9,100	2,557.00	23,268,700	貸付有価証券 1,100株
ジャパンベストレスキューシステム	13,200	252.00	3,326,400	貸付有価証券 5,800株
ファンコミュニケーションズ	26,700	925.00	24,697,500	貸付有価証券 11,700株(5,800株)
ジェイコムホールディングス	2,700	924.00	2,494,800	貸付有価証券 1,100株(400株)
PGMホールディングス	16,300	1,306.00	21,287,800	貸付有価証券 1,000株(300株)

W D Bホールディングス	4,100	1,230.00	5,043,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ティア	4,900	651.00	3,189,900	
バリューコマース	9,500	559.00	5,310,500	貸付有価証券 3,000株
J Pホールディングス	28,800	337.00	9,705,600	貸付有価証券 12,600株
E P Sホールディングス	10,600	1,460.00	15,476,000	貸付有価証券 400株
プレステージ・インター ナショナル	8,900	942.00	8,383,800	
アミューズ	3,500	4,185.00	14,647,500	
ドリームインキュベータ	3,800	2,462.00	9,355,600	貸付有価証券 1,600株
クイック	5,300	1,074.00	5,692,200	
T A C	5,700	215.00	1,225,500	
ケネディクス	164,800	475.00	78,280,000	貸付有価証券 34,500株
電通	129,200	6,200.00	801,040,000	
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	4,500	790.00	3,555,000	貸付有価証券 1,500株(100株)
ぴあ	3,400	2,271.00	7,721,400	貸付有価証券 1,400株(100株)
イオンファンタジー	3,800	2,344.00	8,907,200	貸付有価証券 200株
ネクシィーズ	4,200	736.00	3,091,200	貸付有価証券 500株(500株)
みらかホールディングス	29,600	6,060.00	179,376,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
アルプス技研	4,700	2,408.00	11,317,600	貸付有価証券 1,800株
ダイオーズ	2,400	1,168.00	2,803,200	
日本空調サービス	5,700	1,029.00	5,865,300	
オリエンタルランド	125,400	7,770.00	974,358,000	
ダスキン	32,800	2,096.00	68,748,800	
明光ネットワークジャ パン	13,400	1,444.00	19,349,600	貸付有価証券 4,500株(4,200株)
ファルコホールディング ス	5,100	1,507.00	7,685,700	
秀英予備校	2,300	900.00	2,070,000	貸付有価証券 1,000株

田谷	1,900	790.00	1,501,000	貸付有価証券 800株
ラウンドワン	32,900	590.00	19,411,000	
リゾートトラスト	43,900	2,955.00	129,724,500	
ビー・エム・エル	6,800	3,855.00	26,214,000	
ワタベウェディング	3,800	485.00	1,843,000	
もしもしホットライン	21,600	1,358.00	29,332,800	
リソー教育	17,900	312.00	5,584,800	貸付有価証券 5,500株(1,600株)
早稲田アカデミー	1,700	866.00	1,472,200	
ユー・エス・エス	140,400	2,242.00	314,776,800	
東京個別指導学院	5,600	640.00	3,584,000	貸付有価証券 2,400株(200株)
サイバーエージェント	28,300	5,890.00	166,687,000	貸付有価証券 12,400株(12,400株)
楽天	520,100	1,939.50	1,008,733,950	
テー・オー・ダブリュー	7,000	543.00	3,801,000	貸付有価証券 700株
セントラルスポーツ	4,000	2,292.00	9,168,000	
フルキャストホールディングス	11,900	763.00	9,079,700	
リゾートソリューション	12,000	319.00	3,828,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
テクノプロ・ホールディングス	16,400	3,005.00	49,282,000	
リブセンス	6,800	677.00	4,603,600	貸付有価証券 3,000株(2,400株)
ジャパンマテリアル	4,800	1,666.00	7,996,800	貸付有価証券 2,100株
ベクトル	2,500	1,762.00	4,405,000	
ウチヤマホールディングス	6,700	503.00	3,370,100	
サクセスホールディングス	1,300	1,267.00	1,647,100	貸付有価証券 500株(500株)
キャリアリンク	1,500	1,877.00	2,815,500	貸付有価証券 600株
アサンテ	3,800	1,506.00	5,722,800	
N・フィールド	2,700	1,926.00	5,200,200	貸付有価証券 1,100株
M&Aキャピタルパート	500	3,145.00	1,572,500	

ナーズ				
E R Iホールディングス	3,000	957.00	2,871,000	貸付有価証券 900株
アピスト	1,200	1,431.00	1,717,200	
ウィルグループ	1,300	1,774.00	2,306,200	
リクルートホールディングス	175,400	3,665.00	642,841,000	貸付有価証券 12,600株(12,600株)
リロ・ホールディング	4,000	11,830.00	47,320,000	
東祥	2,500	2,808.00	7,020,000	
エイチ・アイ・エス	18,900	4,060.00	76,734,000	貸付有価証券 1,800株
共立メンテナンス	6,900	7,420.00	51,198,000	貸付有価証券 3,000株
イチネンホールディングス	12,100	1,140.00	13,794,000	
建設技術研究所	6,800	1,150.00	7,820,000	貸付有価証券 2,400株
スペース	6,300	1,212.00	7,635,600	
燦ホールディングス	2,300	1,725.00	3,967,500	
スバル興業	8,000	433.00	3,464,000	貸付有価証券 3,000株
東京テアトル	44,000	141.00	6,204,000	
よみうりランド	23,000	434.00	9,982,000	
東京都競馬	79,000	289.00	22,831,000	貸付有価証券 34,000株(34,000株)
常磐興産	43,000	154.00	6,622,000	貸付有価証券 2,000株(1,000株)
カナモト	16,200	3,120.00	50,544,000	
東京ドーム	79,000	505.00	39,895,000	
西尾レントオール	9,300	3,065.00	28,504,500	
トランス・コスモス	15,100	3,260.00	49,226,000	
乃村工藝社	22,700	1,444.00	32,778,800	
藤田観光	42,000	405.00	17,010,000	貸付有価証券 18,000株(15,000株)
日本管財	5,700	2,700.00	15,390,000	
トーカイ	5,100	4,430.00	22,593,000	
白洋舎	12,000	282.00	3,384,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
セコム	112,600	7,904.00	889,990,400	
セントラル警備保障	5,100	1,368.00	6,976,800	貸付有価証券



					2,000株（2,000株）
	丹青社	13,400	1,340.00	17,956,000	貸付有価証券 5,500株（5,500株）
	メイテック	15,500	4,485.00	69,517,500	
	アサツー ディ・ケイ	21,800	2,887.00	62,936,600	
	応用地質	12,200	1,607.00	19,605,400	
	船井総研ホールディングス	12,500	1,422.00	17,775,000	貸付有価証券 5,500株（5,500株）
	進学会	4,800	602.00	2,889,600	
	ベネッセホールディングス	42,400	3,090.00	131,016,000	貸付有価証券 12,100株（3,700株）
	イオンディライト	11,200	3,690.00	41,328,000	
	ナック	7,700	1,020.00	7,854,000	貸付有価証券 3,300株
	ニチイ学館	22,700	1,009.00	22,904,300	貸付有価証券 9,100株（5,400株）
	ダイセキ	18,700	2,375.00	44,412,500	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
	ステップ	3,900	1,016.00	3,962,400	
	小計 銘柄数：1,871			264,084,459,460	
	組入時価比率：97.9%			100.0%	
	合計			264,084,459,460	

(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27年 6月29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27年 6月29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	5,665,755,000	-	5,554,080,000	111,841,212

合計	5,665,755,000	-	5,554,080,000	111,841,212
----	---------------	---	---------------	-------------

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成27年 6月29日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	3,917,728,076
コール・ローン	795,570,987
株式	325,488,369,204
投資信託受益証券	39,742,516
投資証券	7,700,520,687
派生商品評価勘定	94,999,007
未収入金	639,639
未収配当金	539,245,027
未収利息	1,413
差入委託証拠金	1,525,391,790
流動資産合計	340,102,208,346
資産合計	340,102,208,346
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,006,471
未払金	494,440,256
未払解約金	211,561,030
その他未払費用	3,277,700
流動負債合計	715,285,457
負債合計	715,285,457
純資産の部	
元本等	
元本	146,805,170,327
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	192,581,752,562
元本等合計	339,386,922,889
純資産合計	339,386,922,889
負債純資産合計	340,102,208,346

## 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
-------------------	----

	<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>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27年 6月29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	2.3118円
(10,000口当たり純資産額)	(23,118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27日

至 平成27年 6月29日

## 1.金融商品に対する取組方針

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

## 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

## 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成27年 6月29日現在

## 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2.時価の算定方法

## 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## (その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成27年 6月29日現在

期首

平成27年 2月27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	149,090,082,908円
同期中における追加設定元本額	9,117,197,421円
同期中における一部解約元本額	11,402,110,002円
期末元本額	146,805,170,327円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	57,658,402円
バランスセレクト50	185,143,930円
バランスセレクト70	180,202,014円
野村外国株式インデックスファンド	575,223,611円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,351,941,322円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	9,946,471,383円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	5,862,656,818円
野村資産設計ファンド2015	41,880,837円
野村資産設計ファンド2020	45,509,919円
野村資産設計ファンド2025	49,215,667円
野村資産設計ファンド2030	48,939,890円
野村資産設計ファンド2035	36,061,126円
野村資産設計ファンド2040	124,303,919円
野村外国株インデックス（野村投資一任口座向け）	12,578,425,439円
のむらップ・ファンド（保守型）	496,787,895円
のむらップ・ファンド（普通型）	3,077,177,835円
のむらップ・ファンド（積極型）	3,142,284,041円
野村資産設計ファンド2045	12,248,471円
野村インデックスファンド・外国株式	1,789,005,765円
マイ・ロード	1,103,525,609円
ネクストコア	109,108,173円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	74,836,476円
野村外国株インデックス（野村SMA・EW向け）	154,766,439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）	1,072,402,633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）	482,172,847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）	9,819,599,986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）	3,935,002,318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）	8,837,692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）	34,605,386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）	31,705,288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）	133,131,533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）	1,439,746,488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）	545,278,111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）	249,037,690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）	33,011,009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）	266,440,218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）	4,831,212,957円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	582,793,564円
野村MSCI-KOKUSAインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,920,301,197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）	938,002円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,078,782円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	14,302,799円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	12,338,053円

野村外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I (確定拠出年金向け)	55,147,828,914円
マイバランス30 (確定拠出年金向け)	1,094,142,344円
マイバランス50 (確定拠出年金向け)	4,592,306,865円
マイバランス70 (確定拠出年金向け)	5,467,560,605円
マイバランスDC30	567,345,576円
マイバランスDC50	993,982,300円
マイバランスDC70	782,341,621円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I	10,582,906,554円
野村DC運用戦略ファンド	113,917,480円
野村DC運用戦略ファンドM	350,893円
野村DC運用戦略ファンドA	1,524,154円
マイターゲット2050 (確定拠出年金向け)	1,461,416円
マイターゲット2030 (確定拠出年金向け)	90,716円
マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)	99,355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27年 6月29日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES	38,000	61.90	2,352,200.00	
		CAMERON INTERNATIONAL CORP	16,800	53.01	890,568.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	3,830	114.00	436,620.00	
		DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,500	26.89	174,785.00	
		ENSCO PLC-CL A	19,900	22.52	448,148.00	
		FMC TECHNOLOGIES INC	19,800	42.00	831,600.00	
		HALLIBURTON CO	73,200	43.12	3,156,384.00	
		HELMERICH & PAYNE	9,100	70.95	645,645.00	
		NABORS INDUSTRIES INC	26,100	14.40	375,840.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	35,100	49.41	1,734,291.00	
		OCEANEERING INTL INC	8,300	47.39	393,337.00	
		SCHLUMBERGER LTD	110,100	86.67	9,542,367.00	
		WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	66,400	12.51	830,664.00	
		ANADARKO PETE	43,800	81.36	3,563,568.00	
ANTERO RESOURCES CORP	5,700	35.12	200,184.00			

APACHE CORPORATION	32,400	58.48	1,894,752.00
CABOT OIL & GAS CORP	35,200	31.98	1,125,696.00
CHENIERE ENERGY INC	19,700	70.24	1,383,728.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	51,600	11.16	575,856.00
CHEVRON CORP	162,500	98.60	16,022,500.00
CIMAREX ENERGY CO	8,080	112.72	910,777.60
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	23,600	10.07	237,652.00
CONCHO RESOURCES INC	10,230	112.59	1,151,795.70
CONOCOPHILLIPS	106,000	62.18	6,591,080.00
CONSOL ENERGY INC	19,800	22.39	443,322.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,000	43.31	346,480.00
DEVON ENERGY CORP	33,700	60.46	2,037,502.00
ENERGEN CORP	6,800	68.25	464,100.00
EOG RESOURCES INC	47,400	88.06	4,174,044.00
EQT CORP	13,400	81.99	1,098,666.00
EXXON MOBIL CORP	362,300	83.86	30,382,478.00
HESS CORP	22,000	68.43	1,505,460.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	41.84	694,544.00
KINDER MORGAN INC	157,100	38.96	6,120,616.00
MARATHON OIL CORP	59,300	27.75	1,645,575.00
MARATHON PETROLEUM CORP	46,800	51.97	2,432,196.00
MURPHY OIL CORP	15,000	42.22	633,300.00
NOBLE ENERGY INC	33,300	44.81	1,492,173.00
OCCIDENTAL PETE CORP	66,300	79.21	5,251,623.00
ONEOK INC	18,300	39.92	730,536.00
PHILLIPS 66	46,700	79.62	3,718,254.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,810	140.00	1,793,400.00
RANGE RESOURCES CORP	14,300	49.62	709,566.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	33,600	23.32	783,552.00
SPECTRA ENERGY CORP	58,100	32.80	1,905,680.00
TESORO CORP	11,300	85.72	968,636.00
VALERO ENERGY CORP	44,200	60.90	2,691,780.00
WHITING PETROLEUM CORP	17,800	35.46	631,188.00
WILLIAMS COS	61,000	57.12	3,484,320.00
AIR PRODUCTS	17,460	142.08	2,480,716.80

AIRGAS INC	5,900	106.77	629,943.00
ALBEMARLE CORP	9,600	59.10	567,360.00
ASHLAND INC	5,900	125.55	740,745.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9,900	34.35	340,065.00
CELANESE CORP-SERIES A	12,900	72.99	941,571.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,450	63.81	1,304,914.50
DOW CHEM CO	99,600	52.67	5,245,932.00
DU PONT E I DE NEMOURS	77,900	65.60	5,110,240.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	12,600	83.75	1,055,250.00
ECOLAB INC	23,100	115.73	2,673,363.00
FMC CORP	11,800	53.48	631,064.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	6,800	112.62	765,816.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34,800	104.63	3,641,124.00
MONSANTO CO	41,600	105.21	4,376,736.00
MOSAIC CO/THE	28,100	46.55	1,308,055.00
PPG INDUSTRIES	23,800	118.01	2,808,638.00
PRAXAIR INC	24,800	121.58	3,015,184.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,010	283.09	1,984,460.90
SIGMA-ALDRICH	10,300	139.51	1,436,953.00
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,100	70.65	289,665.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,100	144.88	738,888.00
VULCAN MATERIALS CO	11,700	86.48	1,011,816.00
AVERY DENNISON CORP	8,300	62.20	516,260.00
BALL CORP	11,700	72.60	849,420.00
CROWN HOLDINGS INC	12,100	54.62	660,902.00
MEADWESTVACO CORP	14,000	47.73	668,220.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	8,500	63.81	542,385.00
ROCK-TENN COMPANY CL-A	11,800	61.39	724,402.00
SEALED AIR CORP	17,900	52.60	941,540.00
ALCOA INC	107,000	11.69	1,250,830.00
FREEMONT-MCMORAN INC	89,400	19.94	1,782,636.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	45,600	23.83	1,086,648.00
NUCOR CORP	28,100	46.25	1,299,625.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	34,600	48.25	1,669,450.00
B/E AEROSPACE INC	9,000	55.91	503,190.00



BOEING CO	57,610	142.48	8,208,272.80
GENERAL DYNAMICS	24,220	145.74	3,529,822.80
HONEYWELL INTERNATIONAL	64,000	103.54	6,626,560.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	7,000	114.70	802,900.00
LOCKHEED MARTIN	23,060	188.64	4,350,038.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,170	161.77	2,615,820.90
PRECISION CASTPARTS CORP	12,390	203.20	2,517,648.00
RAYTHEON COMPANY	26,400	97.79	2,581,656.00
ROCKWELL COLLINS INC	11,500	94.73	1,089,395.00
TEXTRON INC	23,500	45.63	1,072,305.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,550	229.17	1,042,723.50
UNITED TECHNOLOGIES	70,300	113.52	7,980,456.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,700	46.64	638,968.00
MASCO CORP	31,000	27.30	846,300.00
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	8,400	52.62	442,008.00
FLUOR CORP	12,500	54.56	682,000.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,000	42.23	506,760.00
QUANTA SERVICES INC	18,600	29.70	552,420.00
ACUITY BRANDS INC	3,750	182.27	683,512.50
AMETEK INC	21,300	55.11	1,173,843.00
EATON CORP PLC	40,900	68.28	2,792,652.00
EMERSON ELEC	58,900	56.58	3,332,562.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,900	124.72	1,484,168.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	14,900	53.76	801,024.00
3M CORP	54,740	157.09	8,599,106.60
DANAHER CORP	54,700	85.76	4,691,072.00
GENERAL ELEC CO	869,600	27.09	23,557,464.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,670	175.98	1,525,746.60
AGCO CORP	6,600	56.33	371,778.00
CATERPILLAR INC DEL	49,500	86.82	4,297,590.00
CUMMINS INC	14,900	133.54	1,989,746.00
DEERE & COMPANY	27,700	96.44	2,671,388.00
DOVER CORP	14,500	71.17	1,031,965.00
FLOWSERVE CORP	12,300	52.38	644,274.00
	29,300	92.78	2,718,454.00

ILLINOIS TOOL WORKS INC			
INGERSOLL-RAND PLC	22,500	68.43	1,539,675.00
PACCAR	30,600	64.82	1,983,492.00
PALL CORP	9,500	124.59	1,183,605.00
PARKER HANNIFIN CORP	12,200	118.17	1,441,674.00
PENTAIR PLC	15,500	63.75	988,125.00
SNAP-ON INC	4,980	162.19	807,706.20
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,600	106.39	1,446,904.00
WABCO HOLDINGS INC	4,800	123.61	593,328.00
WABTEC CORP	8,200	95.52	783,264.00
XYLEM INC	15,400	36.94	568,876.00
FASTENAL CO	24,700	43.09	1,064,446.50
GRAINGER(W.W.) INC	5,360	240.33	1,288,168.80
UNITED RENTALS INC	8,600	89.97	773,742.00
ADT CORP/THE	15,800	33.97	536,726.00
CINTAS CORP	8,900	85.41	760,149.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	21,000	39.92	838,320.00
STERICYCLE INC	7,550	135.73	1,024,761.50
TYCO INTERNATIONAL PLC	35,800	39.39	1,410,162.00
WASTE MANAGEMENT INC	39,600	47.03	1,862,388.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	12,800	63.04	806,912.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	17,300	46.97	812,581.00
FEDEX CORPORATION	23,250	173.66	4,037,595.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60,400	99.35	6,000,740.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,700	41.44	609,168.00
DELTA AIR LINES INC	17,900	42.35	758,065.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	34.32	525,096.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	8,300	54.48	452,184.00
CSX CORP	85,000	33.67	2,861,950.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	32,900	19.08	627,732.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,000	83.82	670,560.00
KANSAS CITY SOUTHERN	9,700	92.95	901,615.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,400	88.87	2,346,168.00
UNION PAC CORP	75,900	96.77	7,344,843.00
AUTOLIV INC	7,500	120.35	902,625.00

BORGWARNER INC	19,500	59.49	1,160,055.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	24,900	88.61	2,206,389.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	23,300	31.39	731,503.50
JOHNSON CONTROLS INC	56,400	51.11	2,882,604.00
LEAR CORP	6,700	116.40	779,880.00
FORD MOTOR COMPANY	318,300	15.40	4,901,820.00
GENERAL MOTORS CO	125,000	34.38	4,297,500.00
HARLEY-DAVIDSON INC	18,000	56.91	1,024,380.00
TESLA MOTORS INC	8,130	267.09	2,171,441.70
DR HORTON INC	28,100	27.97	785,957.00
GARMIN LTD	10,200	45.57	464,814.00
HARMAN INTERNATIONAL	5,900	126.12	744,108.00
JARDEN CORP	15,600	53.86	840,216.00
LEGGETT & PLATT INC	12,300	49.72	611,556.00
LENNAR CORP-A	15,600	51.98	810,888.00
MOHAWK INDUSTRIES	5,410	193.17	1,045,049.70
NEWELL RUBBERMAID INC	24,100	41.37	997,017.00
PULTEGROUP INC	29,500	20.48	604,160.00
TOLL BROTHERS INC	14,700	38.39	564,333.00
WHIRLPOOL CORP	6,800	177.81	1,209,108.00
HASBRO INC	9,400	77.69	730,286.00
MATTEL INC	30,100	26.90	809,690.00
POLARIS INDUSTRIES INC	5,610	149.88	840,826.80
COACH INC	24,300	36.12	877,716.00
HANESBRANDS INC	34,000	34.35	1,167,900.00
LULULEMON ATHLETICA INC	9,800	67.09	657,482.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	17,600	44.91	790,416.00
NIKE INC-B	59,100	109.71	6,483,861.00
PVH CORP	7,160	115.50	826,980.00
RALPH LAUREN CORPORATION	5,230	136.86	715,777.80
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,300	85.93	1,314,729.00
V F CORP	29,700	70.78	2,102,166.00
ARAMARK	17,500	31.65	553,875.00
CARNIVAL CORP	35,800	50.60	1,811,480.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,660	609.46	1,621,163.60

DARDEN RESTAURANTS INC	9,400	72.96	685,824.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	42,600	28.08	1,196,208.00
LAS VEGAS SANDS CORP	34,400	51.20	1,761,280.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	19,400	76.02	1,474,788.00
MCDONALD'S CORP	82,700	97.29	8,045,883.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,600	18.38	617,568.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	11,900	56.60	673,540.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,200	79.80	1,212,960.00
STARBUCKS CORP	129,100	54.62	7,051,442.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	14,600	82.69	1,207,274.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,200	83.40	850,680.00
WYNN RESORTS LTD	6,950	96.50	670,675.00
YUM BRANDS INC	37,200	92.75	3,450,300.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	16,700	25.19	420,673.00
CBS CORP-CL B	39,400	57.00	2,245,800.00
CHARTER COMMUNICATION-A	7,240	171.50	1,241,660.00
COMCAST CORP SPECIAL CL-A	34,300	61.14	2,097,102.00
COMCAST CORP-CL A	183,600	61.27	11,249,172.00
DIRECTV	41,200	93.70	3,860,440.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	12,500	33.84	423,000.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	24,600	31.55	776,130.00
DISH NETWORK CORP-A	19,000	69.73	1,324,870.00
DISNEY (WALT) CO	139,500	114.99	16,041,105.00
GANNETT INC	18,700	37.16	694,892.00
INTERPUBRIC GROUP	36,900	19.70	726,930.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	53,700	52.80	2,835,360.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	21,200	56.12	1,189,744.00
LIBERTY MEDIA CORP-A	8,170	37.26	304,414.20
LIBERTY MEDIA CORP-C	17,940	36.64	657,321.60
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	33,600	15.20	510,720.00
OMNICOM GROUP	21,300	70.84	1,508,892.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,100	67.01	475,771.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	222,000	3.86	856,920.00
TIME WARNER CABLE-A	24,230	179.50	4,349,285.00
TIME WARNER INC	71,500	88.13	6,301,295.00

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	114,100	32.94	3,758,454.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	37,900	32.80	1,243,120.00	
VIACOM INC-CLASS B	30,900	66.43	2,052,687.00	
GENUINE PARTS CO	13,600	92.07	1,252,152.00	
LKQ CORP	26,300	30.79	809,777.00	
AMAZON.COM INC	34,120	438.10	14,947,972.00	
EXPEDIA INC	8,900	110.71	985,319.00	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	38,100	28.78	1,096,518.00	
NETFLIX INC	4,960	651.62	3,232,035.20	
PRICELINE GROUP INC/THE	4,470	1,140.90	5,099,823.00	
TRIPADVISOR INC	10,300	88.84	915,052.00	
DOLLAR GENERAL CORP	26,600	79.55	2,116,030.00	
DOLLAR TREE INC	17,900	81.66	1,461,714.00	
FAMILY DOLLAR STORES	8,200	79.59	652,638.00	
KOHL'S CORP	17,200	63.37	1,089,964.00	
MACYS INC	29,700	69.85	2,074,545.00	
NORDSTROM INC	12,100	76.20	922,020.00	
TARGET CORP	52,800	84.08	4,439,424.00	
ADVANCE AUTO PARTS	6,350	164.28	1,043,178.00	
AUTONATION INC	6,200	64.85	402,070.00	
AUTOZONE	2,750	677.47	1,863,042.50	
BED BATH & BEYOND	16,500	71.11	1,173,315.00	
BEST BUY COMPANY INC	26,400	33.97	896,808.00	
CARMAX INC	18,400	68.41	1,258,744.00	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,800	52.93	412,854.00	
FOOT LOCKER INC	12,300	67.31	827,913.00	
GAMESTOP CORP-CLASS A	10,000	44.04	440,400.00	
GAP INC	21,200	38.88	824,256.00	
HOME DEPOT	113,900	112.60	12,825,140.00	
L BRANDS, INC	21,300	88.06	1,875,678.00	
LOWES COS INC	83,700	68.61	5,742,657.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	8,720	232.41	2,026,615.20	
ROSS STORES INC	35,400	50.27	1,779,558.00	
SIGNET JEWELERS LTD	6,500	130.78	850,070.00	

STAPLES INC	55,000	16.05	882,750.00
TIFFANY & CO	11,200	94.24	1,055,488.00
TJX COS INC	58,700	68.02	3,992,774.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,800	92.75	1,094,450.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,300	157.98	837,294.00
URBAN OUTFITTERS INC	9,600	35.66	342,384.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	38,220	138.06	5,276,653.20
CVS HEALTH CORP	96,900	105.84	10,255,896.00
KROGER CO	40,200	73.11	2,939,022.00
RITE AID CORP	85,000	8.56	727,600.00
SYSCO CORP	50,500	38.37	1,937,685.00
WAL-MART STORES INC	138,800	72.12	10,010,256.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	75,000	86.77	6,507,750.00
WHOLE FOODS MARKET INC	30,800	40.35	1,242,780.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	10,700	100.93	1,079,951.00
COCA COLA CO	357,700	40.00	14,308,000.00
COCA COLA ENTERPRISES	19,000	44.91	853,290.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,700	117.40	1,725,780.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,600	74.87	1,242,842.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	13,500	72.29	975,915.00
MONSTER BEVERAGE CORP	12,220	139.41	1,703,590.20
PEPSICO INC	127,700	94.91	12,120,007.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	54,400	49.57	2,696,608.00
BUNGE LIMITED	12,800	89.44	1,144,832.00
CAMPBELL SOUP CO	15,900	47.85	760,815.00
CONAGRA INC	36,700	44.00	1,614,800.00
GENERAL MILLS	51,800	56.93	2,948,974.00
HERSHEY CO/THE	13,300	88.55	1,177,715.00
HORMEL FOODS CORP	13,100	57.72	756,132.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,700	110.62	962,394.00
KELLOGG CO	23,500	63.05	1,481,675.00
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	10,600	77.96	826,376.00
KRAFT FOODS GROUP INC	50,900	86.98	4,427,282.00
MCCORMICK & CO INC.	10,100	81.46	822,746.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,300	91.49	1,582,777.00

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	141,900	41.11	5,833,509.00	
TYSON FOODS INC-CL A	26,600	43.60	1,159,760.00	
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	15,100	49.90	753,490.00	
ALTRIA GROUP INC	169,600	49.48	8,391,808.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,700	81.35	10,876,495.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	36,763	76.56	2,814,575.28	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,700	82.82	968,994.00	
CLOROX CO	11,200	107.12	1,199,744.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	74,100	66.50	4,927,650.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,500	135.35	744,425.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	31,400	107.90	3,388,060.00	
PROCTER & GAMBLE CO	233,300	79.34	18,510,022.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,700	88.00	1,733,600.00	
ABBOTT LABORATORIES	129,900	49.97	6,491,103.00	
BARD (C R)	6,590	173.54	1,143,628.60	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	47,200	71.92	3,394,624.00	
BECTON,DICKINSON	18,030	142.04	2,560,981.20	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	114,700	18.09	2,074,923.00	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	12,400	52.33	648,892.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,200	146.08	1,343,936.00	
HOLOGIC INC	19,900	38.25	761,175.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,160	497.15	1,570,994.00	
MEDTRONIC PLC	122,000	75.16	9,169,520.00	
RESMED INC	12,200	55.89	681,858.00	
ST JUDE MEDICAL INC	24,100	74.38	1,792,558.00	
STRYKER CORP	29,700	97.34	2,890,998.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,130	178.88	738,774.40	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,800	85.29	750,552.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,700	113.56	1,669,332.00	
AETNA INC	30,200	130.05	3,927,510.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,900	107.84	1,930,336.00	
ANTHEM INC	22,920	164.68	3,774,465.60	
CARDINAL HEALTH INC	28,300	86.03	2,434,649.00	
CENTENE CORP	9,700	80.36	779,492.00	
CIGNA CORP	22,200	168.06	3,730,932.00	

DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	14,900	81.08	1,208,092.00
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	15,900	40.11	637,749.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	62,500	90.85	5,678,125.00
HCA HOLDINGS INC	29,000	91.84	2,663,360.00
HENRY SCHEIN INC	7,440	145.45	1,082,148.00
HUMANA INC	12,820	195.50	2,506,310.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,700	121.62	1,058,094.00
MCKESSON CORP	20,020	227.92	4,562,958.40
OMNICARE INC	8,600	94.28	810,808.00
PATTERSON COS INC	7,500	48.81	366,075.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	12,600	72.75	916,650.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,500	123.25	10,168,125.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,900	142.69	1,127,251.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,440	184.45	3,585,708.00
ALKERMES PLC	13,000	65.75	854,750.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,500	117.67	764,855.00
AMGEN INC	65,350	158.02	10,326,607.00
BIOGEN INC	20,200	408.73	8,256,346.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,600	134.84	1,833,824.00
CELGENE CORP	69,200	117.92	8,160,064.00
GILEAD SCIENCES INC	128,700	119.50	15,379,650.00
INCYTE CORP	13,500	104.05	1,404,675.00
ISIS PHARMACEUTICALS INC	9,900	58.89	583,011.00
MEDIVATION INC	6,600	112.31	741,246.00
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	2,480	115.72	286,985.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,480	520.63	3,373,682.40
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,020	175.43	705,228.60
VERTEX PHARMACEUTICALS	21,100	126.87	2,676,957.00
ABBVIE INC	148,334	70.46	10,451,613.64
ALLERGAN PLC	32,430	306.60	9,943,038.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	143,800	67.54	9,712,252.00
ELI LILLY & CO.	86,100	85.85	7,391,685.00
ENDO INTERNATIONAL PLC	17,500	80.81	1,414,175.00
HOSPIRA INC	14,800	88.81	1,314,388.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,160	174.12	898,459.20



JOHNSON & JOHNSON	240,200	99.64	23,933,528.00
MALLINCKRODT PLC	10,000	116.78	1,167,800.00
MERCK & CO INC	245,300	58.49	14,347,597.00
MYLAN NV	36,200	69.06	2,499,972.00
PERRIGO CO PLC	12,300	190.55	2,343,765.00
PFIZER INC	529,700	33.92	17,967,424.00
ZOETIS INC	40,700	48.62	1,978,834.00
BANK OF AMERICA CORP	909,200	17.41	15,829,172.00
BB&T CORPORATION	63,500	41.29	2,621,915.00
CIT GROUP INC	14,900	47.07	701,343.00
CITIGROUP	262,200	56.34	14,772,348.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	28,300	27.54	779,382.00
COMERICA INC	15,900	52.63	836,817.00
FIFTH THIRD BANCORP	70,500	21.27	1,499,535.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,200	64.33	784,826.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	70,000	11.46	802,200.00
JPMORGAN CHASE & CO	322,100	68.95	22,208,795.00
KEYCORP	76,500	15.36	1,175,040.00
M & T BANK CORP	10,200	127.96	1,305,192.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	27,000	16.59	447,930.00
PNC FINANCIAL	44,800	97.62	4,373,376.00
REGIONS FINANCIAL CORP	114,000	10.53	1,200,420.00
SUNTRUST BKS INC.	44,800	43.87	1,965,376.00
US BANCORP	153,300	44.51	6,823,383.00
WELLS FARGO CO	422,900	57.44	24,291,376.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	99,860	139.78	13,958,430.80
CME GROUP INC	27,600	93.83	2,589,708.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,820	226.16	2,220,891.20
LEUCADIA NATIONAL CORP	29,200	24.57	717,444.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	23,700	103.60	2,455,320.00
MOODYS CORP	15,600	110.55	1,724,580.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	10,100	49.70	501,970.00
VOYA FINANCIAL INC	19,800	47.81	946,638.00
ACE LTD	28,100	103.47	2,907,507.00
AFLAC INC	37,600	63.69	2,394,744.00

ALLEGHANY CORP	1,410	474.67	669,284.70
ALLSTATE CORP	35,700	65.83	2,350,131.00
AMERICAN INTL GROUP	118,100	62.73	7,408,413.00
AON PLC	24,300	102.75	2,496,825.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,400	67.45	768,930.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,200	48.17	684,014.00
ASSURANT INC	6,200	68.37	423,894.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,000	53.25	479,250.00
CHUBB CORP	19,800	96.45	1,909,710.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,700	50.91	697,467.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,020	184.51	741,730.20
FNF GROUP	21,100	36.87	777,957.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	37,000	42.07	1,556,590.00
LINCOLN NATIONAL CORP	22,300	60.92	1,358,516.00
LOEWS CORP	25,400	38.97	989,838.00
MARSH & MCLENNAN COS	46,200	58.31	2,693,922.00
METLIFE INC	81,700	57.37	4,687,129.00
PARTNERRE LTD	4,100	129.25	529,925.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,600	52.44	1,342,464.00
PROGRESSIVE CO	50,800	28.32	1,438,656.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,700	90.72	3,601,584.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,000	103.21	412,840.00
TORCHMARK CORP	11,250	59.15	665,437.50
TRAVELERS COS INC/THE	27,600	97.92	2,702,592.00
UNUM GROUP	22,700	36.77	834,679.00
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	14,000	46.62	652,680.00
WR BERKLEY CORP	8,400	52.62	442,008.00
XL GROUP PLC	26,700	37.68	1,006,056.00
CBRE GROUP INC	26,000	37.49	974,740.00
JONES LANG LASALLE INC	3,870	173.92	673,070.40
REALOGY HOLDINGS CORP	13,000	46.94	610,220.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,400	71.13	1,095,402.00
EBAY INC	93,700	61.03	5,718,979.50
FACEBOOK INC-A	173,600	88.01	15,278,536.00
GOOGLE INC-CL A	24,800	553.06	13,715,888.00

GOOGLE INC-CL C	26,510	531.69	14,095,101.90	
LINKEDIN CORP - A	9,500	215.93	2,051,335.00	
RACKSPACE HOSTING INC	9,400	37.55	352,970.00	
TWITTER INC	41,900	35.26	1,477,394.00	
VERISIGN INC	9,600	62.95	604,320.00	
YAHOO! INC	76,400	40.06	3,060,584.00	
ZILLOW GROUP INC	4,300	87.39	375,798.50	
ACCENTURE PLC-CL A	54,000	99.00	5,346,000.00	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,370	302.95	1,626,841.50	
AUTOMATIC DATA PROCESS	40,800	83.31	3,399,048.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	52,500	63.83	3,351,075.00	
COMPUTER SCIENCE	12,600	66.76	841,176.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	24,300	63.37	1,539,891.00	
FISERV INC	20,400	85.01	1,734,204.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,650	159.30	1,059,345.00	
GARTNER INC	7,500	87.62	657,150.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	81,180	165.46	13,432,042.80	
MASTERCARD INC-CLASS A	86,100	94.51	8,137,311.00	
PAYCHEX INC	28,800	47.99	1,382,112.00	
TERADATA CORP	12,200	37.30	455,060.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,800	42.72	589,536.00	
VANTIV INC - CL A	12,700	38.62	490,474.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	169,200	68.75	11,632,500.00	
WESTERN UNION CO	46,300	20.61	954,243.00	
XEROX CORP	90,000	10.98	988,200.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,600	25.04	1,091,744.00	
ADOBE SYSTEMS INC.	43,200	82.74	3,574,368.00	
ANSYS INC	7,800	92.19	719,082.00	
AUTODESK INC.	19,600	52.20	1,023,120.00	
CA INC	28,900	29.89	863,821.00	
CDK GLOBAL INC	11,800	55.70	657,260.00	
CITRIX SYSTEMS INC	14,300	70.96	1,014,728.00	
ELECTRONIC ARTS	26,600	67.63	1,798,958.00	
FIREEYE INC	9,400	48.86	459,284.00	
INTUIT INC	22,500	103.24	2,322,900.00	

MICROSOFT CORP	673,300	45.26	30,473,558.00
NETSUITE INC	3,300	92.25	304,425.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	20,900	17.75	370,975.00
ORACLE CORPORATION	303,700	40.99	12,448,663.00
RED HAT INC	15,600	77.48	1,208,688.00
SALESFORCE.COM INC	51,800	72.34	3,747,212.00
SERVICENOW INC	12,300	77.02	947,346.00
SPLUNK INC	10,800	70.38	760,104.00
SYMANTEC CORP	60,100	23.75	1,427,375.00
SYNOPSYS INC	13,100	50.24	658,144.00
VMWARE INC - CLASS A	7,400	87.59	648,166.00
WORKDAY INC-CLASS A	8,900	78.60	699,540.00
CISCO SYSTEMS	441,300	28.28	12,479,964.00
F5 NETWORKS INC	6,500	123.57	803,205.00
HARRIS CORP	10,700	78.27	837,489.00
JUNIPER NETWORKS INC	32,700	26.59	869,493.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17,500	58.38	1,021,650.00
PALO ALTO NETWORKS INC	5,800	175.26	1,016,508.00
QUALCOMM INC	142,100	64.67	9,189,607.00
APPLE INC	503,000	126.75	63,755,250.00
EMC CORP	170,900	26.45	4,520,305.00
HEWLETT PACKARD CO	157,200	30.53	4,799,316.00
NETAPP INC	27,900	32.36	902,844.00
SAN DISK CORPORATION	18,800	62.12	1,167,856.00
SEAGATE TECHNOLOGY	28,200	50.06	1,411,692.00
WESTERN DIGITAL CORP	19,900	84.45	1,680,555.00
AMPHENOL CORP-CL A	26,500	55.68	1,475,520.00
ARROW ELECTRS INC	8,300	57.67	478,661.00
AVNET	11,800	42.09	496,662.00
CORNING INC	109,000	20.33	2,215,970.00
FLEXTRONICS INTL LTD	51,000	11.84	603,840.00
FLIR SYSTEMS INC	12,600	31.55	397,530.00
TE CONNECTIVITY LTD	35,400	66.12	2,340,648.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,200	23.48	544,736.00
ALTERA CORP.	26,000	51.30	1,333,800.00

ANALOG DEVICES INC	27,000	65.80	1,776,600.00
APPLIED MATERIALS	105,800	19.78	2,092,724.00
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	22,000	135.15	2,973,300.00
BROADCOM CORP-CL A	47,800	52.11	2,490,858.00
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	9,300	40.71	378,603.00
INTEL CORP	409,400	31.02	12,699,588.00
KLA TENCOR CORP	14,200	57.14	811,459.00
LAM RESEARCH	14,000	82.86	1,160,040.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	21,300	45.37	966,381.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	35,300	13.93	491,729.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,900	34.75	830,525.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	17,800	48.42	861,876.00
MICRON TECHNOLOGY	92,500	19.66	1,818,550.00
NVIDIA CORP	48,000	20.74	995,520.00
QORVO INC	12,500	80.41	1,005,125.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,300	106.90	1,742,470.00
SUNEDISON INC	23,600	31.39	740,804.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	90,100	52.90	4,766,290.00
XILINX INC	22,900	44.80	1,025,920.00
AT & T INC	448,600	36.12	16,203,432.00
CENTURYLINK INC	50,000	29.99	1,499,500.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	103,000	5.01	516,030.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,600	53.79	1,377,024.00
VERIZON COMMUNICATIONS	359,100	47.62	17,100,342.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	11,400	117.31	1,337,334.00
SPRINT CORP	65,000	4.56	296,400.00
T-MOBILE US INC	24,400	39.10	954,040.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,400	52.91	2,243,384.00
DUKE ENERGY CORP	60,800	71.00	4,316,800.00
EDISON INTERNATIONAL	28,100	56.23	1,580,063.00
ENTERGY CORP	15,900	70.51	1,121,109.00
EVERSOURCE ENERGY	27,800	45.99	1,278,522.00
EXELON CORPORATION	74,500	32.11	2,392,195.00
FIRSTENERGY CORP	36,600	32.75	1,198,650.00
NEXTERA ENERGY INC	38,200	98.70	3,770,340.00

OGE ENERGY CORP	16,600	28.95	480,570.00	
PEPCO HOLDINGS INC	22,700	26.75	607,225.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,800	56.89	557,522.00	
PPL CORPORATION	57,200	29.75	1,701,700.00	
SOUTHERN CO.	78,900	41.89	3,305,121.00	
XCEL ENERGY INC	43,700	32.24	1,408,888.00	
ALLIANT ENERGY CORP	9,500	57.84	549,480.00	
AMEREN CORPORATION	20,600	37.73	777,238.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	34,500	19.35	667,575.00	
CMS ENERGY CORP	23,700	31.81	753,897.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,100	58.10	1,458,310.00	
DOMINION RESOURCES INC/VA	50,400	67.27	3,390,408.00	
DTE ENERGY COMPANY	15,700	74.96	1,176,872.00	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,000	70.67	494,690.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	15,100	19.88	300,188.00	
NISOURCE INC	27,300	46.25	1,262,625.00	
PG&E CORP	40,900	49.70	2,032,730.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	43,400	39.59	1,718,206.00	
SCANA CORP	11,300	50.79	573,927.00	
SEMPRA ENERGY	20,100	99.44	1,998,744.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	19,600	46.21	905,716.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,400	49.70	765,380.00	
HUDSON CITY BANCORP INC	39,000	10.14	395,460.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,900	18.54	739,746.00	
ALLY FINANCIAL INC	38,100	23.34	889,254.00	
AMERICAN EXPRESS CO	78,900	79.88	6,302,532.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	47,400	89.06	4,221,444.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,300	59.12	2,264,296.00	
NAVIENT CORP	33,900	18.44	625,116.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	14,300	32.70	467,610.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,810	226.76	1,090,715.60	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,600	128.42	2,003,352.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	95,700	42.98	4,113,186.00	
BLACKROCK INC	10,660	354.47	3,778,650.20	
E*TRADE FINANCIAL CORP	25,000	30.71	767,875.00	

EATON VANCE CORP	10,000	40.78	407,800.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	35,200	50.48	1,776,896.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	33,740	213.17	7,192,355.80	
INVESCO LTD	37,600	38.56	1,449,856.00	
LEGG MASON INC	9,200	51.87	477,204.00	
MORGAN STANLEY	126,200	39.50	4,984,900.00	
NORTHERN TRUST CORP	18,900	78.64	1,486,296.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,100	61.08	677,988.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	102,400	33.53	3,433,472.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,900	50.29	648,741.00	
STATE STREET CORP	35,400	78.98	2,795,892.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	22,300	79.40	1,770,620.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,000	38.15	915,600.00	
H & R BLOCK INC	23,400	30.58	715,572.00	
AES CORP	58,200	13.46	783,372.00	
CALPINE CORP	30,000	18.62	558,600.00	
NRG ENERGY INC	29,400	24.20	711,480.00	
CERNER CORP	26,600	69.11	1,838,326.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,000	40.02	1,160,580.00	
ILLUMINA INC	12,490	218.06	2,723,569.40	
METTLER-TOLEDO INTL	2,380	343.12	816,625.60	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	6,800	73.25	498,100.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,100	132.21	4,508,361.00	
WATERS CORP	7,300	130.78	954,694.00	
DUN & BRADSTREET CORP	3,100	126.69	392,739.00	
EQUIFAX INC	10,600	99.90	1,058,940.00	
IHS INC-CLASS A	6,100	131.90	804,590.00	
MANPOWERGROUP INC	7,000	91.72	642,040.00	
NIELSEN NV	29,900	46.22	1,381,978.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	12,100	56.64	685,344.00	
TOWERS WATSON & CO-CL A	5,900	141.26	833,434.00	
VERISK ANALYTICS INC	13,800	74.51	1,028,238.00	
小計	銘柄数：605		1,660,585,162.32	
			(204,185,551,558)	
	組入時価比率：60.2%			62.6%

カナダドル	ALTAGAS LTD	12,100	38.71	468,391.00
	ARC RESOURCES LTD	30,000	21.66	649,800.00
	BAYTEX ENERGY CORP	18,500	20.06	371,110.00
	CAMECO CORP	34,600	17.94	620,724.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	93,700	34.70	3,251,390.00
	CANADIAN OIL SANDS LTD	42,000	10.20	428,400.00
	CENOVUS ENERGY INC	71,100	20.77	1,476,747.00
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	35,900	26.22	941,298.00
	ENBRIDGE INC	73,900	59.23	4,377,097.00
	ENCANA CORP	72,000	13.84	996,480.00
	ENERPLUS CORP	18,700	11.13	208,131.00
	HUSKY ENERGY INC	30,100	24.34	732,634.00
	IMPERIAL OIL	25,300	49.30	1,247,290.00
	INTER PIPELINE LTD	28,000	29.63	829,640.00
	KEYERA CORP	14,400	42.57	613,008.00
	MEG ENERGY CORP	13,600	20.39	277,304.00
	PARAMOUNT RESOURCES LTD.	4,900	29.45	144,305.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	28,600	41.29	1,180,894.00
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,900	31.70	408,930.00
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	12,600	31.60	398,160.00
	SUNCOR ENERGY INC	125,400	34.37	4,309,998.00
	TOURMALINE OIL CORP	15,300	38.60	590,580.00
	TRANSCANADA CORP	61,100	52.01	3,177,811.00
	VERESEN INC	24,800	17.33	429,784.00
	VERMILION ENERGY INC	9,300	54.92	510,756.00
	AGRIUM INC	11,600	128.44	1,489,904.00
	METHANEX CORP	8,200	70.08	574,656.00
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	72,000	38.61	2,779,920.00
	AGNICO EAGLE MINES LTD	18,600	35.93	668,298.00
	BARRICK GOLD	101,500	13.43	1,363,145.00
	ELDORADO GOLD CORPORATION	62,800	4.94	310,232.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	59,400	17.10	1,015,740.00
FRANCO-NEVADA CORP	13,500	59.83	807,705.00	
GOLDCORP INC	70,700	20.32	1,436,624.00	
KINROSS GOLD CORP	104,600	2.87	300,202.00	



SILVER WHEATON CORP	35,100	21.83	766,233.00	
TECK RESOURCES LTD	49,200	13.00	639,600.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,000	4.79	416,730.00	
YAMANA GOLD INC	79,000	3.73	294,670.00	
WEST FRASER TIMBER	5,600	69.79	390,824.00	
BOMBARDIER B SHEARS	167,000	2.41	402,470.00	
CAE INC	21,200	15.23	322,876.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,800	43.27	553,856.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	14,900	23.81	354,769.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69,500	72.66	5,049,870.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,400	198.95	2,665,930.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	35,100	71.37	2,505,087.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	19,400	41.89	812,666.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,995	48.06	816,779.70	
SHAW COMMUNICATIONS-B	35,100	27.61	969,111.00	
THOMSON REUTERS CORP	31,600	48.22	1,523,752.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	6,400	134.86	863,104.00	
DOLLARAMA INC	10,800	75.64	816,912.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	36,400	54.36	1,978,704.00	
EMPIRE CO LTD A	4,600	90.10	414,460.00	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	6,200	23.07	143,034.00	
LOBLAW COMPANIES	19,300	64.77	1,250,061.00	
METRO INC	21,300	33.98	723,774.00	
WESTON(GEORGE)LTD	4,200	102.00	428,400.00	
SAPUTO INC	21,600	30.98	669,168.00	
CATAMARAN CORP	17,700	75.22	1,331,394.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	27,610	282.20	7,791,542.00	
BANK OF MONTREAL	55,600	75.79	4,213,924.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	105,300	66.64	7,017,192.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	34,500	94.66	3,265,770.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,000	48.15	1,348,200.00	
ROYAL BANK OF CANADA	124,200	78.26	9,719,892.00	
TORONTO DOMINION BANK	159,600	54.34	8,672,664.00	

	ONEX CORP	8,000	69.34	554,720.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,770	641.00	1,134,570.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	26,100	37.25	972,225.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,300	42.62	353,746.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	11,100	87.85	975,135.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	169,100	23.88	4,038,108.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	33,000	33.00	1,089,000.00	
	POWER FINANCIAL CORP	22,300	36.68	817,964.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	53,100	42.97	2,281,707.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	73,000	45.26	3,303,980.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	7,700	17.91	137,907.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	18,800	51.22	962,936.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,670	516.22	862,087.40	
	OPEN TEXT CORP	11,100	50.24	557,664.00	
	BLACKBERRY LTD	43,900	10.53	462,267.00	
	BCE INC	13,000	54.22	704,860.00	
	TELUS CORP	19,300	43.05	830,865.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	32,000	43.58	1,394,560.00	
	FORTIS INC	23,500	35.55	835,425.00	
	ATCO LTD CL1	6,800	39.67	269,756.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,600	36.02	381,812.00	
	CI FINANCIAL CORP	20,500	34.17	700,485.00	
	IGM FINANCIAL INC	8,500	40.92	347,820.00	
	TRANSALTA CORP	24,300	10.04	243,972.00	
小計	銘柄数：92			132,734,078.10	
				(13,226,950,882)	
	組入時価比率：3.9%			4.1%	
ユ-口	SAIPEM	23,900	9.91	236,849.00	
	TECHNIP SA	8,800	57.00	501,600.00	
	TENARIS SA	41,700	12.48	520,416.00	
	ENI SPA	219,900	16.83	3,700,917.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	33,500	10.97	367,495.00	
	NESTE OYJ	10,700	23.40	250,380.00	
	OMV AG	12,500	25.41	317,687.50	
	REPSOL SA	88,900	16.56	1,472,184.00	

REPSOL SA-RTS	88,876	0.48	43,460.36
TOTAL SA	184,300	46.42	8,555,206.00
VOPAK	6,100	46.42	283,162.00
AIR LIQUIDE	29,600	119.95	3,550,520.00
AKZO NOBEL	21,000	69.36	1,456,560.00
ARKEMA	5,900	66.92	394,828.00
BASF SE	79,100	83.15	6,577,165.00
EVONIK INDUSTRIES AG	8,000	35.42	283,400.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	38.84	248,608.00
K+S AG	15,700	37.65	591,183.50
KONINKLIJKE DSM NV	15,600	55.11	859,716.00
LANXESS	8,300	55.59	461,397.00
LINDE AG	16,030	176.95	2,836,508.50
OCI	8,000	26.41	211,320.00
SOLVAY SA	5,100	129.50	660,450.00
SYMRISE AG	10,600	57.56	610,136.00
UMICORE	8,800	43.71	384,692.00
CRH PLC	72,700	26.24	1,907,648.00
HEIDELBERGCEMENT AG	12,300	74.69	918,687.00
IMERYS	3,000	70.71	212,130.00
LAFARGE SA	16,000	61.63	986,080.00
ARCELORMITTAL	87,100	9.29	809,507.40
THYSSENKRUPP AG	31,200	24.46	763,308.00
VOESTALPINE AG	9,600	39.44	378,672.00
STORA ENSO OYJ-R	49,400	9.68	478,439.00
UPM-KYMMENE OYJ	45,200	16.55	748,060.00
AIRBUS GROUP SE	50,600	61.51	3,112,406.00
FINMECCANICA SPA	37,000	11.84	438,080.00
SAFRAN SA	25,700	63.51	1,632,207.00
THALES (EX THOMSON-CSF)	9,100	56.27	512,057.00
ZODIAC AEROSPACE	17,400	31.23	543,402.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	41,200	42.82	1,764,390.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	16,316	30.09	490,948.44
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	7,100	45.22	321,097.50
BOUYGUES	17,400	34.80	605,520.00
FERROVIAL SA	39,300	20.30	797,790.00

VINCI	40,500	55.05	2,229,525.00
ALSTOM	18,700	26.51	495,737.00
LEGRAND SA	23,200	53.15	1,233,080.00
OSRAM LICHT AG	7,750	44.79	347,122.50
PRYSMIAN SPA	17,400	20.83	362,442.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,900	65.59	3,141,761.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	80,500	23.52	1,893,762.50
SIEMENS AG	68,600	95.10	6,523,860.00
ANDRITZ AG	6,500	52.37	340,405.00
CNH INDUSTRIAL NV	80,100	8.40	672,840.00
GEA GROUP AG	16,300	41.58	677,754.00
KONE OYJ	27,300	38.06	1,039,038.00
MAN SE	3,200	93.43	298,976.00
METSO OYJ	10,400	25.85	268,840.00
VALLOUREC	9,300	18.54	172,422.00
WARTSILA OYJ	12,300	43.17	530,991.00
ZARDOYA OTIS S.A	16,224	10.22	165,809.28
ZARDOYA OTIS SA - RTS	16,224	0.41	6,700.51
BRENNTAG AG	13,290	53.96	717,128.40
REXEL SA	25,200	15.18	382,536.00
BIC	2,500	150.65	376,625.00
EDENRED	18,700	22.74	425,331.50
BOLLORE	75,000	5.11	383,550.00
DEUTSCHE POST AG-REG	83,400	27.20	2,268,480.00
TNT EXPRESS NV	43,000	7.64	328,649.00
DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	19,200	11.83	227,232.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	74,000	7.24	536,204.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	38,700	15.35	594,045.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS-RIGHTS	38,700	0.77	29,992.50
ADP	2,400	106.00	254,400.00
AENA SA	5,500	94.40	519,200.00
ATLANTIA SPA	35,100	23.09	810,459.00
FRAPORT AG	3,800	58.59	222,642.00
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	41,000	13.69	561,290.00
CONTINENTAL AG	9,470	220.30	2,086,241.00

MICHELIN B	16,200	98.57	1,596,834.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,200	29.30	298,860.00
PIRELLI&CO	21,100	15.39	324,729.00
VALEO	6,930	147.55	1,022,521.50
BAYER MOTOREN WERK	28,600	103.50	2,960,100.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,700	79.59	374,073.00
DAIMLER AG	82,900	86.61	7,179,969.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	78,000	14.03	1,094,340.00
PEUGEOT CITROEN	37,300	19.34	721,382.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	13,400	79.98	1,071,732.00
RENAULT	16,800	98.11	1,648,248.00
VOLKSWAGEN AG	3,050	217.35	662,917.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	14,040	219.35	3,079,674.00
ADIDAS AG	17,900	70.44	1,260,876.00
CHRISTIAN DIOR SE	4,780	190.40	910,112.00
HERMES INTERNATIONAL	2,330	357.65	833,324.50
HUGO BOSS AG	5,800	104.20	604,360.00
KERING	6,630	163.30	1,082,679.00
LUXOTTICA GROUP SPA	14,800	62.60	926,480.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	24,010	171.20	4,110,512.00
ACCOR SA	18,200	47.68	867,776.00
SODEXO	8,000	88.77	710,160.00
ALTICE SA	7,400	132.65	981,610.00
AXEL SPRINGER SE	3,500	48.81	170,852.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14,700	30.83	453,274.50
JC DECAUX INTERNATIONAL	6,800	38.59	262,446.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,080	123.65	257,192.00
LAGARDERE S.C.A	9,700	26.78	259,766.00
NUMERICABLE-SFR	8,500	50.83	432,055.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	18,700	46.00	860,200.00
PUBLICIS GROUPE	16,100	69.57	1,120,077.00
REED ELSEVIER NV	56,600	22.24	1,258,784.00
RTL GROUP	3,300	84.50	278,850.00
SES FDR	27,700	31.74	879,198.00
TELENET GROUP HOLDING NV	4,300	50.65	217,795.00

VIVENDI SA	98,700	23.55	2,324,878.50
WOLTERS KLUWER	25,900	28.24	731,545.50
INDITEX SA	94,100	30.71	2,890,281.50
CARREFOUR SUPERMARCHE	48,300	30.27	1,462,041.00
CASINO GUICHARD	4,900	70.94	347,606.00
COLRUYT SA	6,100	41.57	253,577.00
DELHAIZE GROUP	8,700	80.05	696,435.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	57,000	7.11	405,441.00
JERONIMO MARTINS	22,400	12.30	275,632.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	78,600	17.99	1,414,407.00
METRO AG	13,400	29.84	399,856.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	69,500	112.60	7,825,700.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,100	64.89	590,499.00
HEINEKEN NV	20,000	70.37	1,407,400.00
PERNOD-RICARD	18,300	108.20	1,980,060.00
REMY COINTREAU	2,300	68.31	157,113.00
DANONE	50,000	60.66	3,033,000.00
KERRY GROUP PLC-A	14,700	67.64	994,308.00
UNILEVER NV-CVA	140,200	39.11	5,483,222.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,800	87.57	770,616.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,400	104.40	1,607,760.00
BEIERSDORF AG	8,700	78.91	686,517.00
LOREAL-ORD	21,730	168.65	3,664,764.50
ESSILOR INTERNATIONAL	17,600	112.95	1,987,920.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	18,800	76.91	1,445,908.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	32,600	59.31	1,933,506.00
GRIFOLS SA	13,200	37.02	488,664.00
BAYER AG	71,530	132.95	9,509,913.50
MERCK KGAA	11,300	93.09	1,051,917.00
ORION OYJ	8,700	32.53	283,011.00
SANOFI	102,300	92.96	9,509,808.00
U.C.B. SA	11,000	66.44	730,840.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	226,000	1.97	445,672.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	544,771	9.38	5,114,310.14
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD	3,040,000	0.08	257,184.00

BANCO DE SABADELL SA	421,394	2.28	963,728.07
BANCO DE SABADELL SA-RIGHTS	419,549	0.03	16,261.71
BANCO POPOLARE SPA	30,300	15.76	477,528.00
BANCO SANTANDER SA	1,238,891	6.77	8,398,442.08
BANK OF IRELAND	2,530,000	0.38	963,930.00
BANKIA SA	385,000	1.17	452,760.00
BANKINTER S.A.	58,000	6.96	403,912.00
BCO POPULAR ESPANOL	145,903	4.70	687,057.22
BNP PARIBAS	91,700	57.63	5,284,671.00
CAIXABANK	197,978	4.35	861,996.21
COMMERZBANK AG	90,800	12.16	1,104,128.00
CREDIT AGRICOLE SA	88,200	14.13	1,246,707.00
ERSTE GROUP BANK AG	25,100	26.63	668,413.00
ING GROEP NV	334,200	15.48	5,175,087.00
INTESA SANPAOLO	1,089,000	3.47	3,787,542.00
INTESA SANPAOLO-RSP	76,000	3.01	229,064.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROUPE NV	21,400	62.13	1,329,582.00
NATIXIS	79,000	6.79	536,963.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	13.84	152,295.00
SOCIETE GENERALE	62,500	44.45	2,778,437.50
UNICREDIT SPA	413,000	6.46	2,667,980.00
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	75,000	7.73	580,125.00
DEUTSCHE BOERSE AG	16,800	77.05	1,294,440.00
EURAZEO	3,176	62.19	197,515.44
EXOR SPA	8,600	44.85	385,710.00
GROUPE BRUXELLES LAM	7,200	74.97	539,784.00
WENDEL	2,400	115.60	277,440.00
AEGON NV	159,000	6.82	1,084,380.00
AGEAS	17,600	35.01	616,264.00
ALLIANZ SE	39,580	146.50	5,798,470.00
ASSICURAZIONI GENERALI	101,100	17.13	1,731,843.00
AXA	168,500	23.85	4,019,567.50
CNP ASSURANCES	13,500	15.78	213,097.50
DELTA LLOYD NV	18,300	15.34	280,813.50

HANNOVER RUECK SE	5,300	90.05	477,265.00
MAPFRE SA	93,000	3.21	298,995.00
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	14,840	164.80	2,445,632.00
NN GROUP NV	16,600	25.59	424,794.00
SAMPO OYJ-A	38,800	43.75	1,697,500.00
SCOR SE	14,000	32.44	454,230.00
UNIPOLSAI SPA	80,000	2.34	187,360.00
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN SE	38,700	26.50	1,025,550.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	29,000	21.65	627,850.00
IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	10,500	41.41	434,857.50
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	38,400	36.85	1,415,232.00
ATOS	7,100	70.48	500,408.00
CAP GEMINI SA	13,400	82.75	1,108,850.00
DASSAULT SYSTEMES SA	11,400	68.20	777,480.00
GEMALTO	6,800	84.87	577,116.00
SAP SE	84,800	65.67	5,568,816.00
ALCATEL-LUCENT	246,000	3.47	855,342.00
NOKIA OYJ	315,000	6.50	2,047,500.00
ASML HOLDING NV	30,100	98.74	2,972,074.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	96,000	11.83	1,136,160.00
STMICROELECTRONICS NV	57,700	7.71	445,270.90
DEUTSCHE TELEKOM-REG	273,000	16.28	4,445,805.00
ELISA CORPORATION	12,500	29.24	365,500.00
ILIAD SA	2,190	206.50	452,235.00
KONINKLIJKE KPN NV	272,000	3.48	948,192.00
ORANGE	159,800	14.67	2,344,266.00
PROXIMUS	13,700	32.91	450,935.50
TELECOM ITALIA SPA	860,000	1.18	1,017,380.00
TELECOM ITALIA-RNC	520,000	0.95	494,000.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	47,600	5.34	254,469.60
TELEFONICA SA	384,100	13.47	5,173,827.00
ELECTRICITE DE FRANCE	20,300	20.93	424,980.50
ENDESA S.A.	26,300	17.77	467,351.00



	ENEL SPA	608,000	4.36	2,650,880.00	
	ENERGIAS DE PORTUGAL	200,000	3.54	709,800.00	
	FORTUM OYJ	37,600	16.56	622,656.00	
	IBERDROLA SA	468,000	6.35	2,972,736.00	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,600	74.72	717,312.00	
	TERNA SPA	135,000	4.15	561,330.00	
	ENAGAS	17,500	25.61	448,262.50	
	GAS NATURAL SDG	30,500	21.12	644,160.00	
	SNAM SPA	178,000	4.47	797,084.00	
	E.ON SE	174,200	12.44	2,167,919.00	
	GDF SUEZ	127,000	17.49	2,221,230.00	
	RWE AG	43,200	19.89	859,248.00	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	27,000	17.68	477,360.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,300	19.18	753,970.50	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	118,500	28.83	3,416,355.00	
	MEDIOBANCA SPA-ORD	47,000	9.45	444,385.00	
	ENEL GREEN POWER SPA	160,000	1.85	296,000.00	
	QIAGEN NV	20,100	22.31	448,531.50	
	BUREAU VERITAS SA	23,100	20.94	483,714.00	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,000	58.77	646,470.00	
	小計銘柄数：238			316,718,976.76	
				(42,912,254,161)	
	組入時価比率：12.6%			13.1%	
英bond	AMEC FOSTER WHEELER PLC PLC	33,200	8.42	279,544.00	
	PETROFAC LTD	22,700	9.50	215,763.50	
	BG GROUP PLC	295,400	10.93	3,230,199.00	
	BP PLC	1,578,000	4.37	6,904,539.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	336,800	18.58	6,257,744.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	210,000	18.86	3,960,600.00	
	TULLOW OIL PLC	78,200	3.49	273,465.40	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,500	28.36	326,140.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	17,700	31.30	554,010.00	
	REXAM PLC	59,555	5.64	336,187.97	
	ANGLO AMERICAN PLC	119,600	9.59	1,147,681.60	
	ANTOFAGASTA PLC	34,900	7.12	248,662.50	

BHP BILLITON PLC		182,600	13.01	2,376,539.00
FRESNILLO PLC		20,900	6.98	145,882.00
GLENCORE PLC		962,000	2.66	2,564,211.00
RANDGOLD RESOURCES LTD		8,200	43.74	358,668.00
RIO TINTO PLC-REG		109,400	27.08	2,963,099.00
MONDI PLC		31,700	14.29	452,993.00
BAE SYSTEMS PLC		271,000	4.68	1,268,822.00
COBHAM PLC		99,000	2.72	269,973.00
MEGGITT PLC		70,600	4.71	333,161.40
ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT		23,532,900	0.00	23,532.90
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		159,400	8.98	1,431,412.00
SMITHS GROUP PLC		33,900	11.48	389,172.00
IMI PLC		22,600	11.42	258,092.00
MELROSE INDUSTRIES PLC		86,427	2.53	218,746.73
WEIR GROUP PLC		18,200	17.48	318,136.00
ASHTAD GROUP PLC		43,100	11.32	487,892.00
BUNZLE		29,500	17.87	527,165.00
TRAVIS PERKINS PLC		20,900	21.71	453,739.00
WOLSELEY PLC		22,300	41.94	935,262.00
AGGREKO PLC		23,033	14.49	333,748.17
BABCOCK INTL GROUP PLC		21,900	11.06	242,214.00
G4S PLC		136,800	2.78	381,398.40
ROYAL MAIL PLC		69,000	5.25	362,250.00
EASYJET PLC		14,200	15.77	223,934.00
GKN PLC		143,000	3.47	496,496.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		86,000	6.27	539,220.00
PERSIMMON PLC		26,000	19.81	515,060.00
TAYLOR WIMPEY PLC		281,000	1.90	535,586.00
BURBERRY GROUP PLC		39,300	16.29	640,197.00
CARNIVAL PLC		15,600	33.52	522,912.00
COMPASS GROUP PLC		145,100	10.90	1,581,590.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC		20,123	27.03	543,924.69
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI		59,000	4.41	260,721.00
TUI AG-DI		39,852	11.13	443,552.76

WHITBREAD PLC	15,800	51.65	816,070.00
WILLIAM HILL PLC	76,000	4.07	309,928.00
ITV PLC	334,000	2.75	920,504.00
PEARSON	72,000	12.57	905,040.00
REED ELSEVIER PLC	97,400	10.72	1,044,128.00
SKY PLC	89,200	10.66	950,872.00
WPP PLC	112,700	14.74	1,661,198.00
MARKS & SPENCER PLC	141,000	5.60	790,305.00
NEXT PLC	12,400	75.60	937,440.00
DIXONS CARPHONE PLC	85,000	4.65	395,845.00
KINGFISHER PLC	206,000	3.62	746,750.00
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	21,300	7.25	154,425.00
MORRISON SUPERMARKETS	192,000	1.84	353,664.00
SAINSBURY	111,800	2.76	308,903.40
TESCO PLC	705,000	2.23	1,576,732.50
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,400	14.29	248,646.00
DIAGEO PLC	217,600	18.99	4,132,224.00
SABMILLER PLC	83,400	34.23	2,855,199.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,400	29.87	908,048.00
TATE & LYLE ORD.	42,500	5.36	228,012.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	161,200	35.46	5,716,958.00
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	82,700	31.92	2,639,784.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	55,500	56.59	3,140,745.00
UNILEVER PLC	110,400	28.32	3,126,528.00
SMITH & NEPHEW PLC	76,400	10.99	839,636.00
ASTRAZENECA PLC	109,300	41.93	4,583,495.50
GLAXOSMITHKLINE PLC	420,800	13.67	5,754,440.00
SHIRE PLC	51,000	52.70	2,687,700.00
BARCLAYS PLC	1,420,000	2.72	3,867,370.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,661,000	5.89	9,798,239.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,940,000	0.87	4,300,764.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	221,000	3.67	811,512.00
STANDARD CHARTERED PLC	213,500	10.55	2,252,425.00
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	27,209	24.52	667,164.68
ADMIRAL GROUP PLC	17,500	14.08	246,400.00

	AVIVA PLC	348,240	5.10	1,777,765.20	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	131,000	3.41	447,758.00	
	LEGAL & GENERAL	515,000	2.55	1,314,795.00	
	OLD MUTUAL PLC	427,000	2.09	894,138.00	
	PRUDENTIAL PLC	220,900	15.80	3,490,220.00	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	90,750	4.07	369,806.25	
	STANDARD LIFE PLC	167,000	4.76	795,254.00	
	SAGE GROUP PLC (THE)	95,000	5.30	503,500.00	
	ARM HOLDINGS PLC	123,000	10.90	1,340,700.00	
	BT GROUP PLC	722,000	4.64	3,351,163.00	
	INMARSAT PLC	38,900	9.31	362,159.00	
	VODAFONE GROUP PLC	2,283,000	2.37	5,416,417.50	
	SSE PLC	85,900	15.89	1,364,951.00	
	CENTRICA PLC	426,000	2.74	1,167,666.00	
	NATIONAL GRID PLC	321,500	8.47	2,725,355.50	
	SEVERN TRENT PLC	20,300	21.47	435,841.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	60,100	9.39	564,639.50	
	3I GROUP PLC	82,000	5.35	438,700.00	
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	83,000	4.17	346,774.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	22,000	11.95	262,900.00	
	ICAP PLC	46,000	5.35	246,100.00	
	INVESTEC PLC	47,000	5.83	274,245.00	
	SCHRODERS PLC	10,500	33.08	347,340.00	
	CAPITA PLC	58,100	12.60	732,060.00	
	EXPERIAN PLC	86,000	11.93	1,025,980.00	
	INTERTEK GROUP PLC	13,700	24.22	331,814.00	
小計	銘柄数：107			148,138,976.55	
				(28,595,266,643)	
	組入時価比率：8.4%			8.8%	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	31,500	15.26	480,690.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	730	397.50	290,175.00	
	GIVAUDAN-REG	798	1,653.00	1,319,094.00	
	SIKA AG-BR	194	3,349.00	649,706.00	
	SYNGENTA AG	7,980	390.00	3,112,200.00	
	HOLCIM LTD-REG	20,100	71.75	1,442,175.00	

GEBERIT AG-REG	3,340	320.80	1,071,472.00
ABB LTD	189,000	20.28	3,832,920.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	157.40	303,782.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,970	158.40	628,848.00
SULZER AG-REG	2,000	98.15	196,300.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,530	124.20	562,626.00
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	45,100	78.90	3,558,390.00
THE SWATCH GROUP AG-B	2,650	377.80	1,001,170.00
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	73.00	335,800.00
DUFREY AG-REG	2,200	136.00	299,200.00
ARYZTA AG	7,200	47.37	341,064.00
BARRY CALLEBAUT AG	190	1,065.00	202,350.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	87	5,015.00	436,305.00
LINDT&SPRUENGLI AG-REG	9	58,965.00	530,685.00
NESTLE SA-REG	278,600	69.80	19,446,280.00
SONOVA HOLDING AG-REG	4,560	128.90	587,784.00
ACTELION LTD	8,900	139.80	1,244,220.00
NOVARTIS-REG	198,700	93.30	18,538,710.00
ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	60,540	268.60	16,261,044.00
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	2,440	65.70	160,308.00
BALOISE HOLDING AG	4,090	117.10	478,939.00
SWISS LIFE HOLDING AG	2,710	218.90	593,219.00
SWISS RE LTD	30,400	84.70	2,574,880.00
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,920	292.90	3,784,268.00
SWISS PRIME SITE-REG	5,800	72.70	421,660.00
SWISSCOM AG-REG	2,230	533.00	1,188,590.00
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	131,200	26.39	3,462,368.00
JULIUS BAER GROUP LTD	19,800	53.20	1,053,360.00
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,340	288.00	385,920.00
UBS GROUP AG	314,300	20.50	6,443,150.00
LONZA AG-REG	4,600	127.30	585,580.00
ADECCO SA-REG	14,800	78.90	1,167,720.00
SGS SA-REG	465	1,695.00	788,175.00
小計銘柄数：39			99,761,127.00 (13,089,657,473)

	組入時価比率：3.9%			4.0%
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	20,100	143.80	2,890,380.00
	BOLIDEN AB	23,000	158.30	3,640,900.00
	ASSA ABLOY AB-B	85,800	162.50	13,942,500.00
	SKANSKA AB-B SHS	32,900	176.50	5,806,850.00
	ALFA LAVAL AB	24,600	151.00	3,714,600.00
	ATLAS COPCO AB-A	58,400	240.00	14,016,000.00
	ATLAS COPCO AB-B	34,400	213.30	7,337,520.00
	SANDVIK AB	92,700	95.55	8,857,485.00
	SKF AB-B SHARES	33,600	197.10	6,622,560.00
	VOLVO AB-B SHS	132,000	108.70	14,348,400.00
	SECURITAS AB-B SHS	25,800	113.60	2,930,880.00
	ELECTROLUX AB-B	20,800	268.40	5,582,720.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	63.30	2,405,400.00
	HENNES&MAURITZ AB-B	82,000	332.60	27,273,200.00
	ICA GRUPPEN AB	6,600	298.10	1,967,460.00
	SWEDISH MATCH AB	17,400	244.80	4,259,520.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	50,200	219.80	11,033,960.00
	ELEKTA AB-B SHS	31,700	52.50	1,664,250.00
	GETINGE AB-B SHS	17,100	204.90	3,503,790.00
	NORDEA BANK AB	262,000	108.10	28,322,200.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	132,000	110.30	14,559,600.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	129,900	127.20	16,523,280.00
	SWEDBANK AB	78,700	201.60	15,865,920.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,000	164.60	2,304,400.00
	INVESTOR AB-B SHS	39,700	322.60	12,807,220.00
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	20,300	274.90	5,580,470.00
	ERICSSON LM-B	264,000	90.70	23,944,800.00
HEXAGON AB-B SHS	21,700	310.30	6,733,510.00	
TELIA AB	222,000	50.30	11,166,600.00	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR- SDR	5,500	625.00	3,437,500.00	
TELE 2 AB-B SHS	28,400	102.80	2,919,520.00	
小計	銘柄数：31			285,963,395.00 (4,203,661,906)

		組入時価比率：1.2%			1.3%
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD		33,800	82.00	2,771,600.00
	SUBSEA 7 SA		22,000	75.45	1,659,900.00
	STATOIL ASA		95,500	144.80	13,828,400.00
	YARA INTERNATIONAL ASA		15,700	421.70	6,620,690.00
	NORSK HYDRO		116,000	34.87	4,044,920.00
	ORKLA ASA		68,800	63.65	4,379,120.00
	DNB ASA		83,700	133.90	11,207,430.00
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		17,200	124.90	2,148,280.00
	TELENOR ASA		65,600	175.50	11,512,800.00
小計	銘柄数：9				58,173,140.00 (903,428,864)
		組入時価比率：0.3%			0.3%
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES		21,200	328.50	6,964,200.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S		18,900	338.20	6,391,980.00
	ISS A/S		12,800	221.30	2,832,640.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A		335	12,030.00	4,030,050.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S		622	12,440.00	7,737,680.00
	DSV A/S		16,000	222.50	3,560,000.00
	PANDORA A/S		9,800	726.50	7,119,700.00
	CARLSBERG B		9,300	614.00	5,710,200.00
	COLOPLAST-B		9,900	441.50	4,370,850.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING		2,100	522.00	1,096,200.00
	NOVO NORDISK A/S-B		163,700	372.60	60,994,620.00
	DANSKE BANK AS		60,900	203.20	12,374,880.00
	TRYG A/S		9,500	141.70	1,346,150.00
	TDC A/S		68,800	50.25	3,457,200.00
小計	銘柄数：14				127,986,350.00 (2,324,232,116)
		組入時価比率：0.7%			0.7%
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD		18,000	10.10	181,800.00
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED		23,500	32.92	773,620.00
	ORIGIN ENERGY LTD		98,000	11.70	1,146,600.00
	SANTOS LTD.		84,600	8.05	681,030.00

WOODSIDE PETROLEUM	64,600	34.82	2,249,372.00
INCITEC PIVOT LTD	143,000	3.89	556,270.00
ORICA LTD	32,600	21.75	709,050.00
BORAL LTD	67,000	5.98	400,660.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	40,000	17.79	711,600.00
AMCOR	103,000	13.74	1,415,220.00
ALUMINA LTD	233,000	1.51	352,995.00
BHP BILLITON LIMITED	276,400	27.50	7,601,000.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,000	1.99	282,580.00
ILUKA RESOURCES LTD	37,800	7.84	296,352.00
NEWCREST MINING	65,000	12.97	843,050.00
RIO TINTO LTD	38,000	54.08	2,055,040.00
SOUTH32 LTD	460,800	1.82	840,960.00
CIMIC GROUP LTD	8,938	21.60	193,060.80
BRAMBLES LTD	136,000	10.53	1,432,080.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	47,000	3.12	146,640.00
ASCIANO LTD	85,000	6.52	554,200.00
AURIZON HOLDINGS LTD	180,000	5.10	918,000.00
SYDNEY AIRPORT	97,900	4.99	488,521.00
TRANSURBAN GROUP	164,604	9.53	1,568,676.12
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,000	7.66	352,360.00
CROWN RESORTS LTD	29,700	12.33	366,201.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	35.20	183,040.00
TABCORP HOLDINGS	78,000	4.59	358,020.00
TATTS GROUP LTD	131,000	3.74	489,940.00
REA GROUP LTD	4,100	40.32	165,312.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	4.80	254,400.00
WESFARMERS LIMITED	96,500	39.48	3,809,820.00
WOOLWORTHS LIMITED	108,800	27.39	2,980,032.00
COCA-COLA AMATIL LTD	52,000	9.23	479,960.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	54,000	5.06	273,240.00
COCHLEAR LTD	5,200	80.61	419,172.00
HEALTHSCOPE LTD	96,000	2.70	259,200.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,900	61.92	736,848.00
SONIC HEALTHCARE LTD	33,900	21.44	726,816.00



	CSL LIMITED	41,200	87.77	3,616,124.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	238,700	33.10	7,900,970.00	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,115	12.86	387,278.90	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,300	12.50	491,250.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	139,600	86.65	12,096,340.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	225,520	34.09	7,687,976.80	
	WESTPAC BANKING CORP	269,400	33.01	8,892,894.00	
	ASX LTD	16,300	40.10	653,630.00	
	AMP LIMITED	260,000	6.12	1,591,200.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	204,000	5.65	1,152,600.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	230,000	2.03	466,900.00	
	QBE INSURANCE	117,000	13.80	1,614,600.00	
	SUNCORP GROUP LTD	110,000	13.60	1,496,000.00	
	COMPUTERSHARE LTD	41,000	12.04	493,640.00	
	TELSTRA CORP LTD	366,000	6.20	2,269,200.00	
	TPG TELECOM LTD	27,000	9.15	247,050.00	
	AUSNET SERVICES	163,400	1.43	234,479.00	
	APA GROUP	99,000	8.38	829,620.00	
	AGL ENERGY LTD	56,640	15.82	896,044.80	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,800	82.50	2,046,000.00	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	17,000	7.66	130,220.00	
	SEEK LTD	28,800	13.87	399,456.00	
小計	銘柄数：61			93,846,211.42	
				(8,812,159,252)	
	組入時価比率：2.6%			2.7%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,000	8.15	505,300.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	88,110	4.96	437,025.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	30,000	7.99	239,700.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	163,000	2.80	456,400.00	
	CONTACT ENERGY LTD	31,800	4.97	158,046.00	
	MIGHTY RIVER POWER	60,000	2.64	158,400.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	100,000	2.10	210,500.00	
小計	銘柄数：7			2,165,371.60	
				(182,086,097)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	

香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	232,540	114.20	26,556,068.00	
	NWS HOLDINGS LTD	135,500	11.40	1,544,700.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	19.48	2,084,360.00	
	MTR CORP	130,500	36.20	4,724,100.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	115,000	26.15	3,007,250.00	
	LI & FUNG LTD	493,600	6.23	3,075,128.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	62,000	26.25	1,627,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	206,000	32.85	6,767,100.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	78,000	13.42	1,046,760.00	
	SANDS CHINA LTD	208,000	27.95	5,813,600.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	108,333	11.22	1,215,496.26	
	SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	8.81	1,462,460.00	
	WYNN MACAU LTD	132,400	13.64	1,805,936.00	
	WH GROUP LIMITED	510,000	5.39	2,748,900.00	
	BANK OF EAST ASIA	96,860	34.75	3,365,885.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	315,500	32.35	10,206,425.00	
	HANG SENG BANK	67,000	152.30	10,204,100.00	
	FIRST PACIFIC CO	226,000	6.80	1,536,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	95,900	284.20	27,254,780.00	
	AIA GROUP LTD	1,042,400	51.80	53,996,320.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	232,540	63.85	14,847,679.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	192,000	23.30	4,473,600.00	
	HENDERSON LAND	103,017	53.35	5,495,956.95	
	HYSAN DEVELOPMENT	54,000	33.60	1,814,400.00	
	KERRY PROPERTIES	57,000	30.30	1,727,100.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	466,666	10.14	4,731,993.24	
	SINO LAND CO.LTD	256,000	12.98	3,322,880.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	146,000	126.50	18,469,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	49,500	97.85	4,843,575.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	100,800	25.05	2,525,040.00	
	WHARF(HOLDING)	116,000	52.10	6,043,600.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	77,000	40.80	3,141,600.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	78.85	1,726,815.00		
HKT TRUST AND HKT LTD	219,600	9.09	1,996,164.00		
PCCW LTD	386,000	4.79	1,848,940.00		

	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	55,000	60.95	3,352,250.00	
	CLP HLDGS	161,500	65.70	10,610,550.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	118,000	71.25	8,407,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	606,554	16.08	9,753,388.32	
小計	銘柄数：39			279,175,699.77	
				(4,427,726,598)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	141,000	3.35	472,350.00	
	KEPPEL CORP.	123,700	8.32	1,029,184.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	83,040	3.96	328,838.40	
	SEMBCORP MARINE	72,600	2.87	208,362.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	1.41	229,830.00	
	NOBLE GROUP LTD	412,481	0.76	313,485.56	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	49,040	10.59	519,333.60	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	185,000	3.21	593,850.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	524,600	0.91	477,386.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	134,000	4.11	550,740.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	9,000	34.04	306,360.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD- RIGHTS	1,000	8.04	8,040.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	615,320	0.41	252,281.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	160,000	3.30	528,000.00	
	DBS GROUP HLDGS	149,400	20.52	3,065,688.00	
	OCBC-ORD	256,500	10.22	2,621,430.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	111,900	23.11	2,586,009.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,000	7.88	535,840.00	
	CAPITALAND LIMITED	229,000	3.50	801,500.00	
	CITY DEVELOPMENT	37,000	9.82	363,340.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	264,000	2.58	681,120.00	
	UOL GROUP LIMITED	38,700	6.96	269,352.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	686,000	4.13	2,833,180.00	
	STARHUB LTD	53,000	3.97	210,410.00	
小計	銘柄数：24			19,785,909.76	
				(1,798,341,338)	

		組入時価比率：0.5%			0.6%
新シェケル	DELEK GROUP LTD		470	1,155.00	542,850.00
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED		44,000	25.64	1,128,160.00
	ISRAEL CORP LIMITED/THE		210	1,306.00	274,260.00
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		74,200	221.90	16,464,980.00
	BANK HAPOALIM BM		93,000	20.25	1,883,250.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL		115,000	15.80	1,817,000.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		13,000	45.35	589,550.00
	AZRIELI GROUP		3,100	148.00	458,800.00
	NICE SYSTEMS LTD		5,300	241.60	1,280,480.00
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP		165,000	6.54	1,079,100.00
	小計	銘柄数：10			
		組入時価比率：0.2%			0.3%
合計					325,488,369,204 (325,488,369,204)

(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27年 6月29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		323,215.00	
	小計	銘柄数：1		323,215.00 (39,742,516)	
		組入時価比率：0.0%		0.5%	
	合計			39,742,516 (39,742,516)	
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	29,500	552,240.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	81,000	669,870.00	
		AMERICAN TOWER CORP	36,300	3,420,912.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,000	744,800.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,340	1,836,172.80	
		BOSTON PROPERTIES	13,280	1,639,150.40	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15,400	357,126.00	

	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,600	568,100.00	
	COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	10,200	263,058.00	
	CROWN CASTLE INTL CORP	28,700	2,340,198.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800	784,936.00	
	DUKE REALTY CORP	28,600	539,110.00	
	EQUINIX INC	4,870	1,260,696.90	
	EQUITY RESIDENTIAL	31,400	2,235,680.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,700	1,220,769.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	9,500	623,580.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,800	756,900.00	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	49,600	1,303,984.00	
	HCP INC	39,800	1,468,222.00	
	HEALTH CARE REIT INC	30,300	2,011,314.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	65,900	1,327,226.00	
	IRON MOUNTAIN INC	17,200	547,992.00	
	KIMCO REALTY CORP	36,900	853,497.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	12,500	417,625.00	
	MACERICH CO /THE	11,400	879,738.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	15,400	634,788.00	
	PROLOGIS INC	43,800	1,674,912.00	
	PUBLIC STORAGE	12,640	2,344,088.00	
	REALTY INCOME CORP	19,300	867,342.00	
	REGENCY CENTERS CORP	8,000	482,080.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	27,150	4,721,656.50	
	SL GREEN REALTY CORP	8,600	960,792.00	
	UDR INC	22,600	736,534.00	
	VENTAS INC	28,300	1,776,957.00	
	VORNADO REALTY TRUST	14,900	1,440,681.00	
	WEYERHAEUSER CO	45,900	1,472,013.00	
小計	銘柄数：36	921,180	45,734,740.60	
			(5,623,543,704)	
	組入時価比率：1.7%		72.7%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	10,500	234,675.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,400	386,784.00	
小計	銘柄数：2	24,900	621,459.00	

			(61,928,389)	
	組入時価比率：0.0%		0.8%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,500	198,300.00	
	GECINA SA	2,970	343,035.00	
	ICADE	3,000	199,710.00	
	KLEPIERRE	14,300	582,653.50	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	8,440	2,017,160.00	
小計	銘柄数：5	31,210	3,340,858.50	
			(452,652,918)	
	組入時価比率：0.1%		5.8%	
英ポンド	BRITISH LAND	84,000	683,760.00	
	HAMMERSON PLC	67,000	422,100.00	
	INTU PROPERTIES PLC	77,000	243,089.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	68,000	843,200.00	
	SEGRO PLC	62,000	258,416.00	
小計	銘柄数：5	358,000	2,450,565.00	
			(473,032,561)	
	組入時価比率：0.1%		6.1%	
豪ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	83,000	609,220.00	
	FEDERATION CENTRES	283,704	836,926.80	
	GOODMAN GROUP	150,000	954,000.00	
	GPT GROUP	148,000	636,400.00	
	LEND LEASE GROUP	48,000	732,000.00	
	MIRVAC GROUP	310,000	571,950.00	
	SCENTRE GROUP	455,000	1,751,750.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	197,000	823,460.00	
	WESTFIELD CORP	171,400	1,592,306.00	
小計	銘柄数：9	1,846,104	8,508,012.80	
			(798,902,401)	
	組入時価比率：0.2%		10.3%	
香港ドル	LINK REIT	200,000	9,250,000.00	
小計	銘柄数：1	200,000	9,250,000.00	
			(146,705,000)	
	組入時価比率：0.0%		1.9%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	187,000	458,150.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	192,000	299,520.00	

小計	CAPITALAND MALL TRUST	219,900	472,785.00
	SUNTEC REIT	203,000	351,190.00
	銘柄数：4	801,900	1,581,645.00
	組入時価比率：0.0%		(143,755,714) 1.9%
合計			7,700,520,687 (7,700,520,687)
合計			7,740,263,203 (7,740,263,203)

(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27年 6月29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				
株値指数先物取引				
買建	5,817,841,350	-	5,911,304,452	93,463,102
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	544,216,466	-	539,745,900	4,470,566
米ドル	357,289,968	-	355,325,500	1,964,468
カナダドル	19,960,680	-	19,928,000	32,680
ユーロ	74,806,388	-	73,159,200	1,647,188
英ポンド	52,405,560	-	52,115,400	290,160
スイスフラン	19,874,700	-	19,681,500	193,200
豪ドル	14,352,630	-	14,083,500	269,130
シンガポールドル	5,526,540	-	5,452,800	73,740
合計	-	-	-	88,992,536

(注)時価の算定方法

### 1 先物取引

外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成27年 6月29日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,190,986,348
国債証券	437,987,656,720
地方債証券	37,598,448,885
特殊債券	55,607,406,570
社債券	31,875,215,100
未収利息	1,041,039,624
前払費用	59,366,582
流動資産合計	570,360,119,829
資産合計	570,360,119,829
負債の部	
流動負債	
未払金	3,441,810,000
未払解約金	313,803,300
流動負債合計	3,755,613,300
負債合計	3,755,613,300
純資産の部	
元本等	
元本	455,050,709,296
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	111,553,797,233
元本等合計	566,604,506,529
純資産合計	566,604,506,529
負債純資産合計	570,360,119,829

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券
--------------------	---------------------



2.費用・収益の計上基準	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。 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27年 6月29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	1.2451円
(10,000口当たり純資産額)	(12,451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27日 至 平成27年 6月29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27年 6月29日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成27年 6月29日現在	
期首	平成27年 2月27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	387,283,453,102円
同期中における追加設定元本額	79,264,823,063円
同期中における一部解約元本額	11,497,566,869円
期末元本額	455,050,709,296円
期末元本額の内訳*	
野村国内債券インデックスファンド	356,578,750円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	17,754,837,532円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	25,028,664,460円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,161,231,456円
野村資産設計ファンド2015	764,520,962円
野村資産設計ファンド2020	376,859,139円
野村資産設計ファンド2025	245,209,279円
野村資産設計ファンド2030	157,211,718円
野村資産設計ファンド2035	81,325,213円
野村資産設計ファンド2040	182,882,030円
野村日本債券インデックスファンド	1,585,313,902円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	207,390,054,506円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	6,020,589,727円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	3,029,319,421円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	626,012,024円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	23,374,996,661円
野村資産設計ファンド2045	13,732,235円
野村円債投資インデックスファンド	1,876,716,041円
野村インデックスファンド・国内債券	856,993,479円
マイ・ロード	29,347,849,306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	171,597,829円
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	109,990,771円
野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	87,474,964円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	2,407,449,794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)	2,428,672,970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)	364,019,029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)	15,497,710,061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)	2,235,739,300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)	61,226,789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)	47,531,374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)	10,881,712円

野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	8,784,373,882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)	502,511,922円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	2,717,371,463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)	1,253,327,180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)	249,233,886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)	502,885,987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)	1,139,834,565円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,202,658,585円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,315,960,609円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用)	5,212,902円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	11,382,335,149円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	17,368,431,501円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,213,297,528円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け)	36,482,337,449円
マイバランスDC30	5,850,662,240円
マイバランスDC50	3,739,344,258円
マイバランスDC70	1,169,587,787円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	6,515,406,340円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	2,206,451円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	304,668円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	232,510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27年 6月29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27年 6月29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342回	1,500,000,000	1,501,635,000	
		国庫債券 利付(2年)第343回	2,100,000,000	2,102,457,000	
		国庫債券 利付(2年)第344回	1,900,000,000	1,902,394,000	
		国庫債券 利付(2年)第345回	1,900,000,000	1,902,565,000	
		国庫債券 利付(2年)第347回	3,000,000,000	3,004,590,000	
		国庫債券 利付(2年)第348回	4,200,000,000	4,206,762,000	

国庫債券	利付(2年)第349回	4,300,000,000	4,307,310,000
国庫債券	利付(2年)第350回	2,300,000,000	2,304,094,000
国庫債券	利付(2年)第351回	1,600,000,000	1,602,992,000
国庫債券	利付(5年)第99回	1,900,000,000	1,909,386,000
国庫債券	利付(5年)第100回	1,000,000,000	1,003,720,000
国庫債券	利付(5年)第101回	1,600,000,000	1,609,520,000
国庫債券	利付(5年)第102回	3,200,000,000	3,214,336,000
国庫債券	利付(5年)第103回	2,100,000,000	2,110,983,000
国庫債券	利付(5年)第104回	1,000,000,000	1,003,520,000
国庫債券	利付(5年)第105回	4,500,000,000	4,518,135,000
国庫債券	利付(5年)第106回	5,600,000,000	5,624,864,000
国庫債券	利付(5年)第107回	3,800,000,000	3,818,278,000
国庫債券	利付(5年)第108回	1,800,000,000	1,804,212,000
国庫債券	利付(5年)第109回	2,800,000,000	2,806,832,000
国庫債券	利付(5年)第110回	1,000,000,000	1,007,870,000
国庫債券	利付(5年)第111回	1,400,000,000	1,414,826,000
国庫債券	利付(5年)第112回	2,200,000,000	2,225,454,000
国庫債券	利付(5年)第113回	5,000,000,000	5,043,050,000
国庫債券	利付(5年)第114回	1,500,000,000	1,514,010,000
国庫債券	利付(5年)第115回	6,300,000,000	6,337,485,000
国庫債券	利付(5年)第116回	5,600,000,000	5,633,936,000
国庫債券	利付(5年)第117回	6,400,000,000	6,439,168,000
国庫債券	利付(5年)第118回	5,000,000,000	5,029,700,000
国庫債券	利付(5年)第119回	4,000,000,000	4,007,920,000
国庫債券	利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,532,395,000
国庫債券	利付(5年)第121回	2,900,000,000	2,904,872,000
国庫債券	利付(5年)第122回	6,800,000,000	6,807,548,000
国庫債券	利付(5年)第123回	7,300,000,000	7,303,358,000
国庫債券	利付(5年)第124回	2,000,000,000	1,999,500,000
国庫債券	利付(40年)第1回	2,660,000,000	3,286,376,800
国庫債券	利付(40年)第2回	800,000,000	947,672,000
国庫債券	利付(40年)第3回	700,000,000	828,891,000
国庫債券	利付(40年)第4回	1,100,000,000	1,303,324,000
国庫債券	利付(40年)第5回	1,050,000,000	1,185,523,500
国庫債券	利付(40年)第6回	1,100,000,000	1,210,363,000
国庫債券	利付(40年)第7回	1,100,000,000	1,145,463,000

国庫債券 利付(40年)第8回	300,000,000	285,081,000	
国庫債券 利付(10年)第282回	1,300,000,000	1,327,079,000	
国庫債券 利付(10年)第283回	1,400,000,000	1,430,870,000	
国庫債券 利付(10年)第284回	2,200,000,000	2,255,176,000	
国庫債券 利付(10年)第285回	2,620,000,000	2,696,739,800	
国庫債券 利付(10年)第286回	800,000,000	828,440,000	
国庫債券 利付(10年)第287回	1,550,000,000	1,608,156,000	
国庫債券 利付(10年)第288回	1,850,000,000	1,919,874,500	
国庫債券 利付(10年)第289回	2,000,000,000	2,074,120,000	
国庫債券 利付(10年)第290回	1,250,000,000	1,297,200,000	
国庫債券 利付(10年)第291回	1,400,000,000	1,449,070,000	
国庫債券 利付(10年)第292回	1,600,000,000	1,673,456,000	
国庫債券 利付(10年)第293回	750,000,000	789,855,000	
国庫債券 利付(10年)第294回	500,000,000	525,085,000	
国庫債券 利付(10年)第295回	1,600,000,000	1,670,768,000	
国庫債券 利付(10年)第297回	1,100,000,000	1,152,448,000	
国庫債券 利付(10年)第298回	1,500,000,000	1,566,315,000	
国庫債券 利付(10年)第299回	1,400,000,000	1,465,744,000	
国庫債券 利付(10年)第300回	1,000,000,000	1,054,390,000	
国庫債券 利付(10年)第301回	1,500,000,000	1,586,475,000	
国庫債券 利付(10年)第302回	700,000,000	737,583,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	1,600,000,000	1,689,920,000	

国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,051,990,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,323,778,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,184,620,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,796,628,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,200,000,000	1,270,896,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,147,570,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,000,000,000	3,138,600,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,864,476,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,650,000,000	4,922,955,000	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,412,480,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	1,700,000,000	1,793,585,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	2,600,000,000	2,763,982,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,479,996,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,905,984,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,368,704,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,961,999,000	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,689,455,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	2,900,000,000	3,059,848,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,516,352,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,832,840,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	2,700,000,000	2,814,237,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,900,000,000	5,103,840,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,170,896,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,300,000,000	3,435,630,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,500,000,000	5,639,315,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,600,000,000	5,826,968,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,300,000,000	3,432,363,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,600,000,000	1,638,512,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,200,000,000	5,320,068,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	4,500,000,000	4,599,045,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,185,485,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	5,200,000,000	5,255,588,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,700,000,000	2,724,624,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,000,000,000	2,972,610,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	4,900,000,000	4,890,837,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	127,657,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	244,826,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	193,724,800	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,168,569,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	179,343,000	
国庫債券 利付(30年)第6回	500,000,000	612,365,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	725,778,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	112,857,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	69,123,600	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	253,000,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	177,195,200	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	257,697,000	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	334,691,900	

国庫債券 利付（30年）第14回	800,000,000	975,048,000	
国庫債券 利付（30年）第15回	700,000,000	865,347,000	
国庫債券 利付（30年）第16回	915,000,000	1,129,906,050	
国庫債券 利付（30年）第17回	1,700,000,000	2,067,659,000	
国庫債券 利付（30年）第18回	2,000,000,000	2,394,700,000	
国庫債券 利付（30年）第19回	1,300,000,000	1,554,137,000	
国庫債券 利付（30年）第20回	1,400,000,000	1,722,798,000	
国庫債券 利付（30年）第21回	1,400,000,000	1,672,314,000	
国庫債券 利付（30年）第22回	600,000,000	737,994,000	
国庫債券 利付（30年）第23回	540,000,000	664,286,400	
国庫債券 利付（30年）第24回	300,000,000	369,087,000	
国庫債券 利付（30年）第25回	500,000,000	596,440,000	
国庫債券 利付（30年）第26回	850,000,000	1,030,157,500	
国庫債券 利付（30年）第27回	950,000,000	1,170,770,500	
国庫債券 利付（30年）第28回	700,000,000	863,989,000	
国庫債券 利付（30年）第29回	800,000,000	972,576,000	
国庫債券 利付（30年）第30回	900,000,000	1,077,804,000	
国庫債券 利付（30年）第31回	1,000,000,000	1,177,720,000	
国庫債券 利付（30年）第32回	1,700,000,000	2,038,980,000	
国庫債券 利付（30年）第33回	1,800,000,000	2,047,086,000	
国庫債券 利付（30年）第34回	1,900,000,000	2,242,532,000	
国庫債券 利付（30年）第35回	1,700,000,000	1,932,696,000	
国庫債券 利付（30年）第36回	1,800,000,000	2,045,790,000	
国庫債券 利付（30年）第37回	2,000,000,000	2,227,840,000	
国庫債券 利付（30年）第38回	1,600,000,000	1,745,216,000	
国庫債券 利付（30年）第39回	1,600,000,000	1,780,464,000	
国庫債券 利付（30年）第40回	1,100,000,000	1,197,482,000	
国庫債券 利付（30年）第41回	1,000,000,000	1,064,320,000	
国庫債券 利付（30年）第42回	1,200,000,000	1,276,344,000	
国庫債券 利付（30年）第43回	1,300,000,000	1,381,796,000	
国庫債券 利付（30年）第44回	1,600,000,000	1,699,536,000	
国庫債券 利付（30年）第45回	1,400,000,000	1,418,844,000	
国庫債券 利付（30年）第46回	500,000,000	506,240,000	
国庫債券 利付（20年）第33回	410,000,000	429,060,900	
国庫債券 利付（20年）第34回	190,000,000	201,439,900	
国庫債券 利付（20年）第35回	228,000,000	240,943,560	



国庫債券 利付(20年)第36回	380,000,000	405,327,000	
国庫債券 利付(20年)第37回	320,000,000	342,038,400	
国庫債券 利付(20年)第38回	170,000,000	182,423,600	
国庫債券 利付(20年)第39回	511,000,000	546,959,070	
国庫債券 利付(20年)第40回	525,000,000	563,629,500	
国庫債券 利付(20年)第41回	255,000,000	268,869,450	
国庫債券 利付(20年)第42回	683,000,000	748,042,090	
国庫債券 利付(20年)第43回	400,000,000	447,836,000	
国庫債券 利付(20年)第44回	150,000,000	167,020,500	
国庫債券 利付(20年)第45回	242,000,000	268,324,760	
国庫債券 利付(20年)第46回	90,000,000	99,356,400	
国庫債券 利付(20年)第47回	230,000,000	255,035,500	
国庫債券 利付(20年)第48回	200,000,000	225,886,000	
国庫債券 利付(20年)第49回	200,000,000	222,446,000	
国庫債券 利付(20年)第50回	183,000,000	201,457,380	
国庫債券 利付(20年)第51回	310,000,000	344,354,200	
国庫債券 利付(20年)第52回	100,000,000	112,094,000	
国庫債券 利付(20年)第53回	250,000,000	281,152,500	
国庫債券 利付(20年)第54回	250,000,000	282,845,000	
国庫債券 利付(20年)第55回	231,000,000	259,172,760	
国庫債券 利付(20年)第56回	120,000,000	134,986,800	
国庫債券 利付(20年)第57回	210,000,000	234,782,100	
国庫債券 利付(20年)第58回	180,000,000	201,711,600	
国庫債券 利付(20年)第59回	230,000,000	254,833,100	
国庫債券 利付(20年)第60回	780,000,000	846,713,400	
国庫債券 利付(20年)第61回	300,000,000	316,914,000	
国庫債券 利付(20年)第62回	440,000,000	457,833,200	
国庫債券 利付(20年)第63回	300,000,000	335,811,000	
国庫債券 利付(20年)第64回	400,000,000	451,896,000	
国庫債券 利付(20年)第65回	455,000,000	515,351,200	
国庫債券 利付(20年)第66回	300,000,000	337,314,000	
国庫債券 利付(20年)第67回	310,000,000	351,540,000	
国庫債券 利付(20年)第68回	290,000,000	336,379,700	
国庫債券 利付(20年)第69回	560,000,000	644,537,600	
国庫債券 利付(20年)第70回	540,000,000	637,102,800	
国庫債券 利付(20年)第71回	200,000,000	232,480,000	

国庫債券 利付（20年）第72回	670,000,000	774,399,400	
国庫債券 利付（20年）第73回	1,600,000,000	1,837,792,000	
国庫債券 利付（20年）第74回	1,300,000,000	1,505,790,000	
国庫債券 利付（20年）第75回	600,000,000	696,384,000	
国庫債券 利付（20年）第76回	910,000,000	1,038,655,800	
国庫債券 利付（20年）第77回	700,000,000	805,518,000	
国庫債券 利付（20年）第78回	800,000,000	914,608,000	
国庫債券 利付（20年）第79回	860,000,000	991,924,000	
国庫債券 利付（20年）第80回	900,000,000	1,046,187,000	
国庫債券 利付（20年）第81回	360,000,000	415,746,000	
国庫債券 利付（20年）第82回	820,000,000	955,488,600	
国庫債券 利付（20年）第83回	370,000,000	431,912,100	
国庫債券 利付（20年）第84回	1,200,000,000	1,388,772,000	
国庫債券 利付（20年）第85回	400,000,000	467,720,000	
国庫債券 利付（20年）第86回	1,400,000,000	1,665,664,000	
国庫債券 利付（20年）第87回	500,000,000	589,765,000	
国庫債券 利付（20年）第88回	1,100,000,000	1,311,354,000	
国庫債券 利付（20年）第89回	470,000,000	555,399,000	
国庫債券 利付（20年）第90回	1,500,000,000	1,775,670,000	
国庫債券 利付（20年）第91回	250,000,000	298,767,500	
国庫債券 利付（20年）第92回	1,550,000,000	1,820,041,000	
国庫債券 利付（20年）第93回	300,000,000	349,230,000	
国庫債券 利付（20年）第94回	200,000,000	235,030,000	
国庫債券 利付（20年）第95回	700,000,000	839,930,000	
国庫債券 利付（20年）第96回	400,000,000	470,684,000	
国庫債券 利付（20年）第97回	1,300,000,000	1,546,532,000	
国庫債券 利付（20年）第98回	300,000,000	353,454,000	
国庫債券 利付（20年）第99回	2,100,000,000	2,475,543,000	
国庫債券 利付（20年）第100回	1,220,000,000	1,454,081,400	
国庫債券 利付（20年）第101回	250,000,000	304,070,000	
国庫債券 利付（20年）第102回	500,000,000	609,030,000	
国庫債券 利付（20年）第103回	600,000,000	723,174,000	
国庫債券 利付（20年）第104回	400,000,000	472,200,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,245,002,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	477,812,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	354,759,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,851,168,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,041,030,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,300,882,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	956,960,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,128,806,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	1,800,000,000	2,128,680,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	2,500,000,000	2,956,000,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	598,155,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	700,000,000	837,305,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	2,400,000,000	2,836,968,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	584,115,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	912,432,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	500,000,000	556,075,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	3,000,000,000	3,461,880,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	700,000,000	797,692,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	1,800,000,000	2,127,996,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	600,000,000	700,566,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	1,400,000,000	1,674,820,000	

国庫債券 利付(20年)第126回	600,000,000	700,038,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	500,000,000	575,985,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,400,000,000	1,611,218,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	500,000,000	567,985,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	2,000,000,000	2,269,240,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	500,000,000	559,790,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,000,000,000	1,118,770,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,587,572,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	400,000,000	452,968,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	400,000,000	446,824,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	770,637,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,115,300,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	600,000,000	650,124,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	769,867,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,560,981,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	1,889,618,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	1,000,000,000	1,127,360,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,500,000,000	1,639,155,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,615,305,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,547,181,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,200,000,000	2,431,726,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,300,000,000	2,499,571,000	

		回			
		国庫債券 利付(20年)第148回	2,300,000,000	2,454,215,000	
		国庫債券 利付(20年)第149回	2,600,000,000	2,767,570,000	
		国庫債券 利付(20年)第150回	2,530,000,000	2,642,028,400	
		国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	2,717,145,000	
		国庫債券 利付(20年)第152回	2,600,000,000	2,608,294,000	
		ポーランド共和国 第12回円貨債券(2012)	100,000,000	101,612,000	
		ポーランド共和国 第15回円貨債券(2013)	100,000,000	101,439,000	
	小計	銘柄数:267 組入時価比率:77.3%	410,063,000,000	437,987,656,720	77.7%
	合計			437,987,656,720	
地方債証券	日本円	東京都 公募第639回	100,000,000	102,159,000	
		東京都 公募第640回	100,000,000	102,538,000	
		東京都 公募第642回	100,000,000	102,612,000	
		東京都 公募第644回	60,000,000	61,753,800	
		東京都 公募第648回	300,000,000	310,512,000	
		東京都 公募第660回	100,000,000	104,514,000	
		東京都 公募第671回	100,000,000	105,226,000	
		東京都 公募第685回	100,000,000	104,786,000	
		東京都 公募第690回	200,000,000	212,080,000	
		東京都 公募第703回	100,000,000	104,984,000	
		東京都 公募第707回	100,000,000	104,302,000	
		東京都 公募第708回	100,000,000	104,459,000	
		東京都 公募第710回	100,000,000	103,911,000	
		東京都 公募第712回	100,000,000	103,579,000	
		東京都 公募第715回	100,000,000	103,426,000	
		東京都 公募第716回	200,000,000	206,998,000	
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	120,296,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	232,962,000	
		東京都 公募第1回	300,000,000	328,179,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	116,377,000	

東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	232,138,000	
東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	234,246,000	
東京都 公募第23回	100,000,000	117,449,000	
東京都 公募(20年)第26回	300,000,000	332,937,000	
北海道 公募平成18年度第6回	100,000,000	102,307,000	
北海道 公募平成19年度第2回	500,000,000	516,440,000	
北海道 公募平成19年度第4回	100,000,000	103,703,000	
北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	105,908,000	
北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	105,776,000	
北海道 公募(5年)平成23年度 第14回	100,000,000	100,399,000	
北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	103,673,000	
北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	103,253,000	
北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	304,566,000	
北海道 公募(5年)平成26年度 第8回	200,000,000	199,990,000	
北海道 公募(5年)平成26年度 第10回	100,000,000	99,832,000	
神奈川県 公募第143回	120,900,000	123,923,709	
神奈川県 公募第184回	100,000,000	104,837,000	
神奈川県 公募第188回	200,000,000	210,846,000	
神奈川県 公募第196回	100,000,000	102,659,000	
神奈川県 公募第200回	100,000,000	103,673,000	
神奈川県 公募第205回	100,000,000	102,184,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	199,750,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	121,937,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	353,991,000	
大阪府 公募第291回	100,000,000	101,889,000	
大阪府 公募第300回	100,000,000	102,950,000	
大阪府 公募第301回	200,000,000	206,268,000	
大阪府 公募第303回	300,000,000	310,890,000	
大阪府 公募第304回	150,000,000	155,827,500	
大阪府 公募第337回	200,000,000	211,912,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	105,664,000	
大阪府 公募第356回	100,000,000	105,146,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	106,411,760	
大阪府 公募(2年)第26回	1,130,000,000	1,129,062,100	

大阪府 公募第5回	100,000,000	117,339,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	111,983,000	
大阪府 公募（5年）第79回	100,000,000	100,404,000	
大阪府 公募第98回	100,000,000	100,582,000	
大阪府 公募第102回	100,000,000	100,314,000	
京都府 公募平成18年度第1回	160,000,000	163,851,200	
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	104,525,000	
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	103,683,000	
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	104,458,000	
兵庫県 公募平成20年度第3回	100,000,000	104,793,000	
兵庫県 公募平成21年度第13回	100,000,000	105,359,000	
兵庫県 公募平成22年度第1回	100,000,000	106,036,000	
兵庫県 公募（30年）第2回	100,000,000	116,370,000	
兵庫県 公募（15年）第3回	100,000,000	107,783,000	
兵庫県 公募（12年）第3回	300,000,000	300,972,000	
兵庫県 公募第2回	100,000,000	119,672,000	
兵庫県 公募第9回	100,000,000	118,637,000	
静岡県 公募平成18年度第6回	100,000,000	102,597,000	
静岡県 公募平成19年度第1回	100,000,000	103,248,000	
静岡県 公募平成19年度第4回	200,000,000	208,056,000	
静岡県 公募平成19年度第7回	100,000,000	104,185,000	
静岡県 公募平成21年度第2回	100,000,000	106,117,000	
静岡県 公募平成21年度第7回	100,000,000	106,153,000	
静岡県 公募平成24年度第10回	100,000,000	102,661,000	
静岡県 公募平成26年度第3回	165,000,000	168,672,900	
静岡県 公募平成26年度第9回	100,000,000	100,888,000	
静岡県 公募（20年）第11回	100,000,000	113,432,000	
静岡県 公募（20年）第14回	100,000,000	110,840,000	
愛知県 公募平成19年度第3回	111,000,000	115,289,040	
愛知県 公募平成19年度第4回	100,000,000	104,129,000	
愛知県 公募平成20年度第8回	100,000,000	116,437,000	
愛知県 公募平成21年度第3回	114,000,000	121,023,540	
愛知県 公募平成21年度第17回	100,000,000	105,834,000	
愛知県 公募平成22年度第3回	100,000,000	105,842,000	
愛知県 公募平成22年度第9回	100,000,000	105,093,000	
愛知県 公募平成23年度第19回	100,000,000	105,088,000	

愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	104,998,000
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	430,232,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	111,904,000
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	105,084,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	102,405,000
広島県	公募平成22年度第6回	200,000,000	211,768,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	103,689,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	206,876,000
埼玉県	公募平成18年度第5回	138,000,000	141,571,440
埼玉県	公募平成19年度第7回	200,000,000	208,422,000
埼玉県	公募平成21年度第5回	100,000,000	105,401,000
埼玉県	公募平成22年度第2回	200,000,000	211,730,000
埼玉県	公募平成24年度第4回	100,000,000	104,004,000
埼玉県	公募(5年)平成24年度第8回	200,000,000	200,676,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	104,478,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	153,224,400
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	102,069,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	201,854,000
福岡県	公募平成18年度第1回	200,000,000	204,736,000
福岡県	公募平成19年度第6回	100,000,000	103,658,000
福岡県	公募平成19年度第8回	100,000,000	103,819,000
福岡県	公募平成20年度第3回	100,000,000	104,513,000
福岡県	公募平成22年度第5回	100,000,000	104,013,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	105,035,000
福岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	100,282,000
福岡県	公募平成26年度第4回	100,000,000	100,003,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	109,829,000
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	122,036,000
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	105,447,000
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	116,560,000
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	109,131,000
千葉県	公募平成18年度第6回	400,000,000	409,600,000



千葉県	公募平成20年度第6回	100,000,000	105,170,000	
千葉県	公募平成21年度第11回	180,000,000	190,384,200	
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	105,449,000	
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	104,505,000	
千葉県	公募平成24年度第4回	100,000,000	100,309,000	
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	103,898,000	
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	104,232,000	
千葉県	公募(20年)第8回	100,000,000	118,267,000	
千葉県	公募(20年)第17回	100,000,000	103,186,000	
新潟県	公募平成18年度第2回	128,100,000	131,333,244	
新潟県	公募平成21年度第2回	150,000,000	159,202,500	
群馬県	公募第8回	100,000,000	105,109,000	
岐阜県	公募平成26年度第1回	186,670,000	188,318,296	
大分県	公募平成18年度第1回	111,000,000	113,556,330	
共同発行市場地方債	公募第42回	100,000,000	102,124,000	
共同発行市場地方債	公募第43回	200,000,000	204,550,000	
共同発行市場地方債	公募第56回	400,000,000	415,800,000	
共同発行市場地方債	公募第58回	270,500,000	281,025,155	
共同発行市場地方債	公募第62回	100,000,000	104,840,000	
共同発行市場地方債	公募第63回	100,000,000	105,398,000	
共同発行市場地方債	公募第64回	100,000,000	105,240,000	
共同発行市場地方債	公募第65回	200,000,000	209,720,000	
共同発行市場地方債	公募第75回	310,000,000	328,838,700	
共同発行市場地方債	公募第82回	300,000,000	317,307,000	
共同発行市場地方債	公募第84回	500,000,000	528,795,000	
共同発行市場地方債	公募第85回	100,000,000	106,120,000	
共同発行市場地方債	公募第88回	100,000,000	105,000,000	
共同発行市場地方債	公募第89回	100,000,000	104,421,000	
共同発行市場地方債	公募第92回	110,000,000	114,976,400	
共同発行市場地方債	公募第93回	300,000,000	317,364,000	
共同発行市場地方債	公募第94回	300,000,000	317,409,000	
共同発行市場地方債	公募第96回	100,000,000	106,244,000	
共同発行市場地方債	公募第101回	300,000,000	315,315,000	
共同発行市場地方債	公募第102回	150,000,000	157,576,500	
共同発行市場地方債	公募第103回	100,000,000	104,877,000	

回			
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	210,352,000	
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	208,738,000	
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	208,792,000	
共同発行市場地方債 公募第113回	200,000,000	206,998,000	
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	103,688,000	
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	207,302,000	
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	103,898,000	
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	207,186,000	
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	307,917,000	
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	101,792,000	
共同発行市場地方債 公募第122回	100,000,000	102,117,000	
共同発行市場地方債 公募第124回	100,000,000	104,393,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	103,559,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	306,972,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	103,053,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	102,111,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	156,238,450	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	538,401,600	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	115,016,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	100,903,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	104,710,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	200,276,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,163,000	

栃木県	公募平成25年度第1回	100,000,000	102,163,000
熊本県	公募平成18年度第2回	173,000,000	176,951,320
新潟市	公募平成25年度第1回	233,200,000	239,717,940
大阪市	公募平成20年度第3回	110,000,000	115,782,700
大阪市	公募平成21年度第6回	100,000,000	106,144,000
大阪市	公募平成25年度第1回	100,000,000	100,869,000
大阪市	公募平成25年度第6回	100,000,000	102,349,000
大阪市	公募(15年)第1回	100,000,000	112,223,000
大阪市	公募(20年)第5回	100,000,000	121,350,000
大阪市	公募(20年)第6回	100,000,000	118,163,000
大阪市	公募(20年)第17回	100,000,000	109,669,000
名古屋市	公募第460回	200,000,000	207,404,000
名古屋市	公募第464回	100,000,000	104,942,000
名古屋市	公募第469回	100,000,000	105,341,000
名古屋市	公募第478回	100,000,000	105,509,000
名古屋市	公募第488回	200,000,000	202,720,000
名古屋市	公募(12年)第1回	200,000,000	210,308,000
名古屋市	公募(15年)第2回	100,000,000	101,064,000
京都市	公募平成19年度第4回	190,000,000	197,814,700
京都市	公募平成23年度第4回	100,000,000	105,380,000
京都市	公募(20年)第2回	100,000,000	115,763,000
京都市	公募(20年)第13回	100,000,000	101,786,000
神戸市	公募平成21年度第7回	100,000,000	106,232,000
神戸市	公募平成23年度第12回	100,000,000	100,466,000
横浜市	公募公債平成20年度5回	200,000,000	210,328,000
横浜市	公募平成21年度第4回	200,000,000	210,260,000
横浜市	公募平成22年度第5回	100,000,000	105,827,000
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	207,570,000
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	204,978,000
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	204,556,000
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	200,112,000
横浜市	公募(20年)第30回	100,000,000	102,765,000
札幌市	公募平成19年度第3回	100,000,000	103,758,000
札幌市	公募平成22年度第4回	100,000,000	104,314,000
札幌市	公募(5年)平成24年度第8回	200,000,000	200,592,000

	札幌市	公募平成26年度第4回	100,000,000	100,911,000	
	札幌市	公募平成26年度第9回	200,000,000	199,278,000	
	川崎市	公募第82回	100,000,000	105,845,000	
	川崎市	公募第85回	100,000,000	103,021,000	
	川崎市	公募(20年)第17回	100,000,000	106,700,000	
	川崎市	公募第32回	150,000,000	150,430,500	
	北九州市	公募平成18年度第2回	170,000,000	174,277,200	
	北九州市	公募(20年)第14回	100,000,000	110,102,000	
	福岡市	公募平成20年度第3回	100,000,000	104,289,000	
	福岡市	公募平成24年度第5回	100,000,000	100,275,000	
	福岡市	公募平成26年度第2回	100,000,000	104,811,000	
	福岡市	公募平成26年度第5回	100,000,000	100,710,000	
	福岡市	公募平成26年度第8回	160,000,000	159,550,400	
	広島市	公募平成18年度第1回	120,900,000	124,030,101	
	広島市	公募平成21年度第3回	100,000,000	105,310,000	
	千葉市	公募平成24年度第1回	100,000,000	105,414,000	
	鹿児島県	公募平成18年度第1回	178,200,000	182,530,260	
	福井県	公募平成24年度第4回	100,000,000	100,879,000	
	徳島県	公募平成22年度第1回	400,000,000	418,120,000	
	山梨県	公募平成19年度第1回	200,000,000	208,304,000	
	岡山県	公募平成21年度第2回	100,000,000	105,776,000	
	愛知県・名古屋市	折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	118,812,000	
	福岡北九州	高速道路債券 第117回	100,000,000	117,840,000	
	東京都住宅供給公社	債券 第4回	300,000,000	306,459,000	
	東京都住宅供給公社	債券 第5回	200,000,000	207,680,000	
小計		銘柄数:240 組入時価比率:6.6%	35,877,470,000	37,598,448,885 6.7%	
合計				37,598,448,885	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	100,000,000	101,045,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	156,896,550	
		新関西国際空港社債 財投機関債第10回	100,000,000	100,091,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	101,885,000	

原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第2回	200,000,000	200,480,000	
原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第3回	2,100,000,000	2,104,368,000	
韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	100,000,000	100,792,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第18回	100,000,000	103,936,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	114,732,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第25回	100,000,000	100,622,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回	100,000,000	101,671,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	102,022,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第5回	100,000,000	104,979,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	141,000,000	147,198,360	
日本政策投資銀行社債 政府保証第10回	100,000,000	100,894,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	106,116,720	
日本政策投資銀行債券 財投機関債第29回	200,000,000	205,162,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第344回	200,000,000	214,570,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第4回	100,000,000	120,464,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8回	200,000,000	238,112,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	200,000,000	238,782,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回	200,000,000	251,824,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第38回	100,000,000	105,235,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	100,000,000	120,391,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	208,556,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,449,000	

券 財投機関債第 8 9 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 2 回	100,000,000	102,109,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 5 回	100,000,000	111,076,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 2 7 回	300,000,000	300,402,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 3 0 回	200,000,000	201,300,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 3 4 回	200,000,000	200,768,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 4 5 回	300,000,000	291,351,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 回	100,000,000	109,755,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 回	100,000,000	109,865,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 回	100,000,000	102,105,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 回	100,000,000	102,286,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 0 回	137,000,000	140,201,690	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 回	3,000,000,000	3,074,430,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 5 回	100,000,000	102,777,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 4 2 回	100,000,000	104,090,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 5 6 回	205,000,000	212,818,700	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 5 8 回	136,000,000	142,557,920	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 0 回	283,000,000	297,880,140	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 2 回	100,000,000	105,103,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 7 回	341,000,000	358,500,120	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 2 回	200,000,000	235,110,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 7 回	200,000,000	235,002,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第98回	300,000,000	316,095,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	237,826,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第100回	400,000,000	423,568,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	235,104,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	229,476,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	114,306,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	440,000,000	466,787,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	147,137,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	104,536,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	146,389,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	108,321,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	104,185,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	109,573,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	226,521,620	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	108,291,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	331,302,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	208,026,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	207,558,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	206,638,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	400,000,000	416,212,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	110,608,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	196,000,000	199,386,880	

券 政府保証債第189回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第190回	400,000,000	408,808,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第193回	200,000,000	208,684,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第197回	272,000,000	282,814,720	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第207回	300,000,000	308,229,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第211回	137,000,000	140,234,570	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第213回	145,000,000	148,192,900	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第216回	100,000,000	105,564,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第219回	100,000,000	105,426,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承 継 財投機関債第33回	100,000,000	127,657,000	
公営企業債券 政府保証第865回	102,000,000	104,097,120	
公営企業債券 政府保証第875回	100,000,000	103,117,000	
公営企業債券 政府保証第880回	131,000,000	136,152,230	
公営企業債券 政府保証第881回	200,000,000	207,462,000	
公営企業債券 政府保証第886回	203,000,000	213,574,270	
公営企業債券 30年第4回財投機 関債	100,000,000	128,577,000	
公営企業債券 政府保証15年第1 回	300,000,000	321,585,000	
地方公共団体金融機構債券 第1回	100,000,000	105,953,000	
地方公共団体金融機構債券 第2回	100,000,000	105,073,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保 証第5回	200,000,000	209,356,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第4回	100,000,000	116,549,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第6回	300,000,000	354,495,000	
地方公共団体金融機構債券 F24 回	100,000,000	109,907,000	
地方公共団体金融機構債券 第13 回	200,000,000	210,502,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保	100,000,000	104,396,000	



証第16回			
地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	104,899,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	314,178,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第1回	100,000,000	100,785,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	106,874,000	
地方公共団体金融機構債券 第37回	300,000,000	311,361,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	103,916,000	
地方公共団体金融機構債券 第41回	100,000,000	103,365,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	104,684,000	
地方公共団体金融機構債券 F144回	200,000,000	203,552,000	
地方公共団体金融機構債券 F145回	200,000,000	209,956,000	
地方公共団体金融機構債券 第42回	100,000,000	103,325,000	
地方公共団体金融機構債券 第44回	100,000,000	103,195,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	100,000,000	103,891,000	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	103,530,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	104,589,000	
地方公共団体金融機構債券(3年) 第1回	200,000,000	200,128,000	
地方公共団体金融機構債券 第51回	300,000,000	310,335,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(4年) 第6回	400,000,000	401,332,000	
地方公共団体金融機構債券 第52回	300,000,000	311,046,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	118,801,400	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第14回	300,000,000	300,732,000	

地方公共団体金融機構債券(20年)第38回	100,000,000	103,981,000	
地方公共団体金融機構債券第64回	100,000,000	100,704,000	
地方公共団体金融機構債券(20年)第39回	100,000,000	102,727,000	
地方公共団体金融機構債券(2年)第2回	500,000,000	499,875,000	
公営企業債券(20年)第2回財投機関債	100,000,000	108,073,000	
公営企業債券(20年)第25回財投機関債	100,000,000	121,199,000	
公営企業債券第24回財投機関債	100,000,000	102,699,000	
公営企業債券第29回財投機関債	500,000,000	520,500,000	
首都高速道路社債第12回	100,000,000	100,529,000	
首都高速道路債券政府保証第8回	100,000,000	105,331,000	
阪神高速道路債券政府保証第2回	265,000,000	272,486,250	
阪神高速道路債券政府保証第5回	100,000,000	105,484,000	
水資源債券財投機関債第11回	100,000,000	100,070,000	
日本政策金融公庫社債第20回財投機関債	100,000,000	100,443,000	
中小企業債券第6回財投機関債	100,000,000	101,874,000	
国際協力銀行債券第27回財投機関債	200,000,000	205,704,000	
都市再生債券財投機関債第21回	300,000,000	315,531,000	
都市再生債券財投機関債第55回	100,000,000	105,014,000	
都市再生債券財投機関債第97回	100,000,000	101,895,000	
本州四国連絡橋債券財投機関債第7回	100,000,000	116,199,000	
民間都市開発推進機構政府保証第16回	120,000,000	123,432,000	
東京交通債券第342回	200,000,000	228,684,000	
東京交通債券第347回	157,000,000	177,923,390	
関西国際空港社債財投機関債第26回	300,000,000	314,013,000	
福祉医療機構債券第31回財投機関債	100,000,000	104,412,000	
中部国際空港債券政府保証第18回	264,000,000	271,336,560	
預金保険機構債券政府保証第19回	400,000,000	400,280,000	

1回			
預金保険機構債券 政府保証第194回	300,000,000	300,369,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回	200,000,000	209,560,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	114,014,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第25回	300,000,000	316,044,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回	100,000,000	105,888,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	113,326,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	113,915,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	100,000,000	105,947,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	115,270,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	115,044,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	100,000,000	104,984,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	209,686,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	100,000,000	112,977,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	198,974,000	
私学振興債券 財投機関債第7回	300,000,000	310,662,000	
日本学生支援債券 財投機関債第38回	500,000,000	499,925,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回	100,000,000	105,727,000	
商工債券 利付第734回い号	100,000,000	100,431,000	
商工債券 利付第739回い号	100,000,000	100,523,000	
商工債券 利付第740回い号	100,000,000	100,474,000	
商工債券 利付第742回い号	100,000,000	100,436,000	
商工債券 利付第753回い号	100,000,000	100,285,000	
農林債券 利付第741回い号	150,000,000	150,799,500	
農林債券 利付第743回い号	100,000,000	100,493,000	
農林債券 利付第745回い号	100,000,000	100,340,000	

農林債券 利付第751回	200,000,000	200,600,000	
農林債券 利付第752回	100,000,000	100,305,000	
農林債券 利付第756回	100,000,000	100,361,000	
農林債券 利付第759回	100,000,000	100,691,000	
農林債券 利付第760回	100,000,000	100,693,000	
農林債券 利付第761回	100,000,000	100,363,000	
農林債券 利付第764回	100,000,000	100,514,000	
農林債券 利付第765回	300,000,000	300,981,000	
農林債券 利付第767回	300,000,000	300,990,000	
農林債券 利付第773回	300,000,000	299,970,000	
しんきん中金債券 利付第271回	350,000,000	351,470,000	
しんきん中金債券 利付第277回	100,000,000	100,275,000	
しんきん中金債券 利付第284回	100,000,000	100,796,000	
しんきん中金債券 利付第286回	100,000,000	100,662,000	
しんきん中金債券 利付第287回	100,000,000	100,496,000	
しんきん中金債券 利付第290回	100,000,000	100,479,000	
しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	99,934,000	
商工債券 利付(3年)第171回	300,000,000	300,276,000	
商工債券 利付(3年)第172回	200,000,000	200,192,000	
商工債券 利付(3年)第174回	200,000,000	199,988,000	
商工債券 利付(3年)第178回	1,000,000,000	999,990,000	
商工債券 利付(3年)第182回	100,000,000	99,986,000	
商工債券 利付(10年)第5回	600,000,000	624,426,000	
あおぞら債券 利付(3年)第71回	400,000,000	399,664,000	
韓国ガス公社 第6回円貨債券(支配権変更ブットオプション条項)	100,000,000	100,977,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	100,000,000	116,259,000	
東日本高速道路 第21回	100,000,000	101,378,000	
東日本高速道路 第26回	100,000,000	100,572,000	
東日本高速道路 第27回	100,000,000	100,347,000	
中日本高速道路債券 政府保証第13回	138,000,000	142,297,320	
中日本高速道路債券 政府保証第14回	100,000,000	103,633,000	
中日本高速道路債券 財投機関債第3回	100,000,000	104,022,000	

中日本高速道路社債 第32回	200,000,000	203,342,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	101,495,000	
中日本高速道路社債 第46回	1,500,000,000	1,508,025,000	
中日本高速道路社債 第47回	100,000,000	100,453,000	
中日本高速道路社債 第53回	100,000,000	100,222,000	
西日本高速道路債券 政府保証第2回	176,000,000	180,063,840	
西日本高速道路債券 政府保証第3回	151,000,000	154,731,210	
西日本高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	103,114,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	205,068,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	100,838,000	
銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第24回	300,000,000	300,168,000	
銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第25回	400,000,000	400,244,000	
銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第27回	3,500,000,000	3,500,665,000	
銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第28回	400,000,000	400,080,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回	200,000,000	209,868,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	100,000,000	103,195,000	
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	16,690,000	17,533,011	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	60,834,000	63,749,773	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	111,155,000	117,447,484	
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	108,648,000	112,758,153	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	68,832,000	73,042,453	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	94,002,000	102,511,061	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	23,950,000	25,926,833	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	63,364,000	67,503,570	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫	33,755,000	36,193,123	

債券			
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	64,836,000	68,226,922	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	140,808,000	148,960,783	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	117,090,000	125,250,002	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	117,384,000	127,945,038	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	68,338,000	73,166,763	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	34,542,000	37,174,445	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	45,017,000	48,942,482	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	154,311,000	165,597,306	
貸付債権担保5種第16回住宅金融支援機構債券	39,852,000	41,824,275	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	152,870,000	159,975,397	
貸付債権担保5種第17回住宅金融支援機構債券	81,436,000	85,714,647	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	222,645,000	237,675,763	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	158,272,000	166,394,519	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	89,406,000	97,457,010	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	218,691,000	234,620,452	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	219,162,000	228,193,666	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	255,918,000	264,199,506	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	250,884,000	261,167,735	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	167,630,000	173,622,772	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	77,278,000	81,831,219	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	154,760,000	163,539,534	

貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	91,360,000	93,339,771	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	87,982,000	90,011,744	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	48,048,000	50,937,126	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	87,851,000	90,969,710	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	57,403,000	61,235,798	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	58,179,000	61,994,378	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	63,070,000	67,241,449	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	74,138,000	79,410,694	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	166,326,000	173,918,781	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	164,280,000	171,871,378	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	82,665,000	86,589,107	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	175,508,000	181,217,275	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	22,330,000	23,742,372	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	186,640,000	195,712,570	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	75,260,000	78,781,415	
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券	29,216,000	30,382,010	
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	63,324,000	66,028,568	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	166,238,000	173,697,099	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	261,426,000	268,983,825	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	174,436,000	180,677,320	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	96,753,000	97,704,081	
貸付債権担保第89回住宅金融支援	97,330,000	98,421,069	

		機構債券			
		貸付債権担保第90回住宅金融支援 機構債券	97,394,000	97,952,067	
		貸付債権担保第92回住宅金融支援 機構債券	196,490,000	195,342,498	
		貸付債権担保第93回住宅金融支援 機構債券	197,040,000	193,548,451	
		貸付債権担保第94回住宅金融支援 機構債券	99,026,000	98,958,662	
		貸付債権担保第96回住宅金融支援 機構債券	99,751,000	99,079,675	
		貸付債権担保第97回住宅金融支援 機構債券	300,000,000	300,045,000	
		貸付債権担保第98回住宅金融支援 機構債券	300,000,000	301,326,000	
	小計	銘柄数：273 組入時価比率：9.8%	53,638,824,000	55,607,406,570 9.9%	
	合計			55,607,406,570	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFC M) 第11回円貨社債	100,000,000	100,529,000	
		ノルデア・バンク 第6回円貨社債 (2014)	100,000,000	100,145,000	
		新韓銀行 第5回円貨社債(201 4)	200,000,000	199,542,000	
		クレディ・アグリコル・エス・ エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	100,283,000	
		ザ・ホンコン・アンド・シャンハ イ・バンキング 第2回円貨社債	200,000,000	200,488,000	
		マラヤン・バンキング・ベルハッ ド 第2回円貨社債(2015)	200,000,000	199,550,000	
		スタンダード・チャータード 第2 回円貨社債(2015)	100,000,000	99,867,000	
		スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債(2015)	100,000,000	99,712,000	
		成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	206,268,000	
		韓国輸出入銀行 第13回円貨債券 (2014)	100,000,000	100,344,000	
		GEキャピタルコーポレーション 第23回円貨社債	100,000,000	100,375,000	
		JPMorgan・チェース・アンド・ カンパニー 第9回円貨社債	100,000,000	101,831,000	



エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第12回	100,000,000	110,422,000	
ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク 第9回円貨社債	200,000,000	205,520,000	
ドイツ銀行AGロンドン支店 第8回円貨社債(2014)	100,000,000	100,183,000	
バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション 第8回円貨社債	100,000,000	104,037,000	
パークレイズ・バンク・ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	100,288,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第4回円貨社債(2013)	100,000,000	100,380,000	
ナショナル・オーストラリア銀行 第6回円貨社債(2011)	100,000,000	100,904,000	
ナショナル・オーストラリア銀行 第11回円貨社債(2015)	200,000,000	199,896,000	
ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第9回円貨社債	200,000,000	203,528,000	
オーストラリア・ニュージーランド銀行 第7回円貨社債	100,000,000	101,783,000	
ラボバンク・ネーデルランド 第16回円貨社債(2012)(コー	100,000,000	101,693,000	
ラボバンク・ネーデルランド 第18回円貨社債(2012)(コー	100,000,000	101,180,000	
ラボバンク・ネーデルランド 第25回円貨社債(2014)(コー	100,000,000	100,325,000	
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債(2014)	200,000,000	201,168,000	
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,631,000	
大和ハウス工業 第5回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,915,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,268,000	
サッポロホールディングス 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,729,000	
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特	100,000,000	99,946,000	
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	99,841,000	
キリンホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,140,000	
伊藤園 第1回	100,000,000	100,596,000	

ニチレイ 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,435,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,162,000	
野村不動産ホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,092,000	
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,469,000	
東急不動産ホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,410,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,373,000	
日本製紙グループ本社 第8回日本製紙株式会社保証付	100,000,000	103,069,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,334,000	
住友化学 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,935,000	
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,755,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,919,000	
三菱ケミカルホールディングス 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,992,000	
宇部興産 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,035,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,923,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,201,000	
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,308,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,063,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,558,000	
住友大阪セメント 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,011,000	
新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,639,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,266,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同	100,000,000	99,918,000	

順位特約付			
神戸製鋼所 第63回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,910,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第16回(JFEス保証)	100,000,000	101,322,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFEス保証)	100,000,000	100,573,000	
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,186,000	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,454,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,821,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,465,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,189,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,554,000	
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,164,000	
ソニー 第26回	100,000,000	105,638,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,845,000	
川崎重工業 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,774,000	
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債	300,000,000	300,861,000	
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,256,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	104,372,000	
エクセディ 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,530,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,627,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,807,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,619,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,616,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位	100,000,000	103,109,000	

位特約付			
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,594,000	
三井物産 第58回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,669,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,229,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,636,000	
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	104,062,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	105,924,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,428,000	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,326,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,226,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,888,000	
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,529,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	101,191,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	199,658,000	
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	119,534,000	
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	1,000,000,000	1,003,860,000	
みずほコーポレート銀行 第28回特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,611,000	
みずほコーポレート銀行 第29回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,038,000	
みずほコーポレート銀行 第31回特定社債間限定同順位特約付	2,000,000,000	2,007,160,000	
みずほコーポレート銀行 第32回特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,738,000	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	108,393,000	
三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,405,000	

東京三菱銀行 第57回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	113,220,000	
三菱東京UFJ銀行 第93回特定 社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,208,000	
三菱東京UFJ銀行 第119回特 定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,968,000	
三菱東京UFJ銀行 第140回特 定社債間限定同順位特約付	500,000,000	501,200,000	
三菱東京UFJ銀行 第11回(劣 後特約付)	100,000,000	102,753,000	
三菱東京UFJ銀行 第12回(劣 後特約付)	300,000,000	312,096,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	300,183,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	99,638,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	99,541,400	
りそな銀行 第4回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	109,493,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	322,980,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特 約付	100,000,000	107,332,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約 付	300,000,000	318,027,000	
三井住友信託銀行 第7回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,335,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	102,798,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,818,000	
みずほフィナンシャルグループ 第 1回劣後特約付	200,000,000	201,130,000	
三井住友銀行 第57回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,321,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	107,018,000	
みずほ銀行 第6回劣後特約付	200,000,000	205,306,000	
みずほ銀行 第35回特定社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,292,000	
興銀リース 第4回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,559,000	
NTTファイナンス 第45回社債	100,000,000	100,134,000	

間限定同順位特約付			
NTTファイナンス 第46回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,515,000	
日産フィナンシャルサービス 第2 0回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,728,000	
ホンダファイナンス 第26回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,626,000	
ホンダファイナンス 第30回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,277,000	
トヨタファイナンス 第27回社債 間限定同等特約付	200,000,000	205,928,000	
ジャックス 第12回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,604,000	
日立キャピタル 第52回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,824,000	
日立キャピタル 第56回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,738,000	
日立キャピタル 第57回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,114,000	
オリックス 第144回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	103,249,000	
オリックス 第148回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,780,000	
オリックス 第164回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	103,374,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,868,000	
三菱UFJリース 第19回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,697,000	
三菱UFJリース 第30回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,363,000	
大和証券グループ本社 第17回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,224,000	
野村ホールディングス 第6回	100,000,000	102,842,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	106,757,000	
野村ホールディングス 第41回	200,000,000	203,166,000	
第1回財政融資マスタートラスト特 定目的会社 第1回特定社債	100,000,000	103,771,000	
三井不動産 第34回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	107,137,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等 財務上特約無	100,000,000	114,109,000	

三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	104,658,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,556,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,847,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,978,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,256,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,962,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,905,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	104,191,000	
オリックス不動産投資法人 第5回特定投資法人債間限定同順位特	100,000,000	101,222,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	100,331,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,162,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,391,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,724,000	
京成電鉄 第42回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,166,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	112,273,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	227,164,000	
東日本旅客鉄道 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	210,354,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,413,000	
東日本旅客鉄道 第76回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,900,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,413,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	117,844,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,399,000	

東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,000,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	235,232,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,901,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,775,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	100,946,000	
住友倉庫 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,050,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	105,719,000	
KDDI 第5回2号	100,000,000	105,600,000	
NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,401,000	
東京電力 第455回	100,000,000	103,936,000	
東京電力 第459回	100,000,000	106,216,000	
東京電力 第524回	100,000,000	101,831,000	
東京電力 第525回	100,000,000	101,760,000	
東京電力 第542回	100,000,000	102,227,000	
東京電力 第544回	100,000,000	103,448,000	
東京電力 第547回	100,000,000	104,124,000	
東京電力 第548回	100,000,000	104,941,000	
東京電力 第559回	100,000,000	101,284,000	
東京電力 第560回	100,000,000	101,845,000	
東京電力 第565回	300,000,000	302,958,000	
中部電力 第482回	200,000,000	214,912,000	
中部電力 第500回	200,000,000	203,712,000	
関西電力 第448回	200,000,000	210,596,000	
関西電力 第469回	100,000,000	104,263,000	
関西電力 第482回	100,000,000	103,077,000	
関西電力 第484回	100,000,000	102,018,000	
関西電力 第496回	100,000,000	99,633,000	
関西電力 第497回	200,000,000	201,046,000	
中国電力 第314回	100,000,000	107,385,000	
中国電力 第330回	100,000,000	109,565,000	
中国電力 第377回	200,000,000	208,266,000	
中国電力 第378回	100,000,000	103,205,000	



	北陸電力 第301回	100,000,000	104,394,000	
	北陸電力 第304回	100,000,000	102,883,000	
	北陸電力 第308回	100,000,000	100,563,000	
	東北電力 第431回	400,000,000	419,588,000	
	東北電力 第473回	100,000,000	100,819,000	
	東北電力 第475回	100,000,000	99,958,000	
	四国電力 第281回	200,000,000	208,110,000	
	九州電力 第400回	100,000,000	106,208,000	
	九州電力 第409回	100,000,000	104,331,000	
	九州電力 第420回	300,000,000	304,152,000	
	九州電力 第424回	200,000,000	205,940,000	
	北海道電力 第296回	100,000,000	105,053,000	
	北海道電力 第316回	107,000,000	110,648,700	
	北海道電力 第323回	100,000,000	99,282,000	
	電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,695,000	
	電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,226,000	
	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,787,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,254,000	
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,349,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,278,000	
	大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,160,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,619,000	
	東京都競馬 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,930,000	
小計	銘柄数：221	31,107,000,000	31,875,215,100	
	組入時価比率：5.6%		5.7%	
合計			31,875,215,100	
合計			563,068,727,275	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成27年 6月29日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	964,082,743
コール・ローン	2,442,163,270
国債証券	555,683,844,310
未収利息	5,181,537,587
前払費用	779,528,506
流動資産合計	565,051,156,416
資産合計	565,051,156,416
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,146,620
未払金	2,892,615,106
未払解約金	364,099,711
その他未払費用	6,237,100
流動負債合計	3,287,098,537
負債合計	3,287,098,537
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	241,741,257,937
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	320,022,799,942
元本等合計	561,764,057,879
純資産合計	561,764,057,879
負債純資産合計	565,051,156,416

### 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27年 6月29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	2.3238円
(10,000口当たり純資産額)	(23,238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27日 至 平成27年 6月29日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成27年 6月29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27年 6月29日現在	
期首	平成27年 2月27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	204,672,827,198円
同期中における追加設定元本額	44,994,904,409円
同期中における一部解約元本額	7,926,473,670円
期末元本額	241,741,257,937円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	84,590,624円
バランスセレクト50	91,560,746円
バランスセレクト70	70,814,324円
野村外国債券インデックスファンド	286,462,329円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,551,745,005円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	32,812,015,927円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,657,721,457円
野村資産設計ファンド2015	54,303,845円
野村資産設計ファンド2020	55,150,108円
野村資産設計ファンド2025	46,758,410円
野村資産設計ファンド2030	41,220,216円
野村資産設計ファンド2035	26,934,477円
野村資産設計ファンド2040	76,721,239円
野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け）	129,093,244,022円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	2,416,598,380円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	3,999,348,104円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	1,224,219,002円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	2,573,269,055円
野村資産設計ファンド2045	5,760,855円
野村インデックスファンド・外国債券	482,796,937円
マイ・ロード	6,139,054,445円
ネクストコア	489,491,590円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	74,062,515円
野村外国債券インデックス（野村SMA・EW向け）	542,321,287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）	46,791,591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）	5,094,296,759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）	763,633,572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）	11,377,606,033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）	1,954,003,341円

ワールド・インデックス・ファンドV A安定型(適格機関投資家専用)	8,748,211円
ワールド・インデックス・ファンドV Aバランス型(適格機関投資家専用)	37,373,904円
ワールド・インデックス・ファンドV A積極型(適格機関投資家専用)	5,705,223円
野村インデックス・バランス60V A(適格機関投資家専用)	7,677,410,427円
野村ワールド・インデックス・バランス35V A(適格機関投資家専用)	592,824,517円
野村ワールド・インデックス・バランス50V A(適格機関投資家専用)	2,137,666,312円
野村世界インデックス・バランス40V A(適格機関投資家専用)	246,462,139円
野村グローバル・インデックス・バランス25V A(適格機関投資家専用)	114,320,533円
野村グローバル・インデックス・バランス50V A(適格機関投資家専用)	263,703,291円
野村グローバル・インデックス・バランス75V A(適格機関投資家専用)	2,390,752,399円
野村世界バランス25V A(適格機関投資家専用)	1,153,058,076円
ノムラ外国債券インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)	1,977,897,410円
ノムラF O F s用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	1,138,797円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	4,534,685円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,115,825円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	4,863,035円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	503,535,458円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,623,802,802円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	2,260,786,721円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,157,986,044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)	11,297,459,877円
マイバランスD C 30	838,814,641円
マイバランスD C 50	489,416,484円
マイバランスD C 70	307,283,546円
野村D C外国債券インデックスファンド	1,980,072,513円
野村D C運用戦略ファンド	516,505,331円
野村D C運用戦略ファンドM	4,732,841円
野村D C運用戦略ファンドA	4,131,176円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	578,520円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	40,080円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	40,924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27年 6月29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27年 6月29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	7,000,000.00	7,674,569.70	
		US TREASURY BOND	4,000,000.00	4,602,343.60	
		US TREASURY BOND	10,500,000.00	13,316,132.55	
		US TREASURY BOND	9,300,000.00	11,764,500.00	
		US TREASURY BOND	12,200,000.00	16,370,875.00	
		US TREASURY BOND	17,500,000.00	23,724,804.25	
		US TREASURY BOND	13,400,000.00	17,346,718.08	
		US TREASURY BOND	21,200,000.00	21,074,125.00	
		US TREASURY BOND	10,500,000.00	13,941,210.15	
		US TREASURY BOND	7,800,000.00	10,843,827.54	
		US TREASURY BOND	6,600,000.00	9,043,030.92	
		US TREASURY BOND	3,500,000.00	4,592,929.60	
		US TREASURY BOND	4,000,000.00	5,148,124.80	
		US TREASURY BOND	2,800,000.00	3,606,531.04	
		US TREASURY BOND	2,200,000.00	2,643,952.96	
		US TREASURY BOND	15,200,000.00	14,093,250.00	
		US TREASURY BOND	16,600,000.00	18,191,264.38	
		US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,511,425.70	
		US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,403,046.00	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,115,234.00	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,009,843.60	
		US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,024,257.70	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,310,546.00	
		US TREASURY N/B	16,500,000.00	16,700,448.60	
		US TREASURY N/B	11,500,000.00	12,079,491.90	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,009,843.60	
		US TREASURY N/B	16,900,000.00	17,410,959.67	
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,034,179.50	
		US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,067,538.90	
		US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,962,753.00	
		US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,097,343.40	
		US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,811,554.18	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	18,115,917.75			
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,067,578.00			
US TREASURY N/B	23,300,000.00	24,620,634.68			

US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,606,046.56
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,501,873.60
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,326,500.00
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,507,089.50
US TREASURY N/B	20,800,000.00	21,639,311.20
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,045,702.90
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,415,398.10
US TREASURY N/B	18,500,000.00	19,236,385.10
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,511,914.00
US TREASURY N/B	12,500,000.00	12,996,581.25
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,046,484.00
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,013,085.50
US TREASURY N/B	14,500,000.00	15,163,260.45
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,523,515.45
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,019,726.50
US TREASURY N/B	18,300,000.00	19,128,503.22
US TREASURY N/B	15,200,000.00	16,286,561.36
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,218,890.56
US TREASURY N/B	24,600,000.00	25,561,896.90
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,489,706.50
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,016,992.00
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,320,976.00
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,005,936.80
US TREASURY N/B	8,900,000.00	8,923,988.17
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,569,100.50
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,487,402.25
US TREASURY N/B	15,000,000.00	16,265,625.00
US TREASURY N/B	13,800,000.00	14,123,437.50
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,965,234.00
US TREASURY N/B	11,500,000.00	11,767,284.15
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,963,124.80
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,000,507.80
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,234,765.00
US TREASURY N/B	15,200,000.00	16,398,779.92
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,523,124.80

US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,546,093.60	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,974,687.20	
US TREASURY N/B	10,700,000.00	11,156,839.71	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,991,874.80	
US TREASURY N/B	19,300,000.00	20,559,021.99	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,427,265.27	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,984,921.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,353,124.80	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,205,765.06	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,187,500.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,981,249.60	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,522,264.40	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,552,304.20	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,889,577.48	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,538,671.60	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	5,228,624.64	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	11,413,000.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,060,937.20	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,119,218.40	
US TREASURY N/B	21,000,000.00	22,743,982.80	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,995,312.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,514,726.40	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,531,796.60	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,082,867.06	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,009,687.40	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	25,188,748.80	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,499,120.70	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,017,812.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,015,937.20	
US TREASURY N/B	19,000,000.00	19,146,951.70	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	9,565,312.50	
US TREASURY N/B	26,400,000.00	28,067,529.60	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,710,608.89	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,963,125.00	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,432,999.68	



US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,020,312.50	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	27,428,757.18	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,934,843.60	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,023,242.10	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,930,156.10	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,236,156.12	
US TREASURY N/B	26,600,000.00	28,592,919.88	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,616,187.16	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,791,281.16	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,373,671.60	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,796,437.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,973,750.00	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	30,647,669.76	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,645,683.56	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,890,937.20	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	13,787,811.80	
US TREASURY N/B	26,000,000.00	28,130,780.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,022,656.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,032,109.30	
US TREASURY N/B	23,600,000.00	24,542,154.48	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,107,187.50	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,050,155.80	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,590,874.88	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	30,401,038.33	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,962,031.08	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,351,757.68	
US TREASURY N/B	30,500,000.00	33,237,850.80	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,010,546.50	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,580,351.15	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,939,875.00	
US TREASURY N/B	25,400,000.00	26,983,529.98	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,994,843.60	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,744,858.94	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,887,750.00	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,529,882.60	

US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,975,625.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,936,718.00	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	6,108,452.66	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,695,187.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,798,437.50	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,623,875.00	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,110,656.25	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,449,937.36	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,717,187.00	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,164,980.15	
US TREASURY N/B	9,800,000.00	9,383,882.20	
US TREASURY N/B	15,700,000.00	15,377,413.67	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	18,379,499.52	
US TREASURY N/B	16,300,000.00	16,478,281.25	
US TREASURY N/B	19,500,000.00	20,060,625.00	
US TREASURY N/B	24,300,000.00	24,962,554.08	
US TREASURY N/B	20,700,000.00	20,826,139.59	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,276,749.92	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,975,000.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,459,687.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,310,625.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	610,898.40	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,685,390.45	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,892,578.00	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	6,725,898.30	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	9,250,827.74	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,723,202.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,622,500.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,918,749.60	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	9,216,796.68	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,908,593.40	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,448,671.70	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,375,585.45	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,936,952.90	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,294,687.50	

	US TREASURY N/B	7,300,000.00	6,616,765.26	
	US TREASURY N/B	11,600,000.00	10,502,530.96	
	US TREASURY N/B	18,200,000.00	17,750,687.50	
	US TREASURY N/B	15,000,000.00	16,074,609.00	
	US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,093,562.50	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,268,124.40	
	US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,600,734.18	
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,426,757.70	
	US TREASURY NOTE	20,400,000.00	21,736,359.12	
	US TREASURY NOTE	14,100,000.00	14,808,303.63	
小計	銘柄数：185	1,820,000,000.00	1,910,666,290.53	
			(234,935,527,083)	
	組入時価比率：41.8%		42.3%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	3,600,000.00	3,899,124.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,900,000.00	7,111,554.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	3,138,192.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,710,530.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,942,680.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,909,424.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	4,968,110.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,248,000.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,833,172.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	4,253,340.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,649,426.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,844,100.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,254,368.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,533,632.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	3,160,016.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,627,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,895,396.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,625,860.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	3,166,960.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,351,339.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,896,900.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,651,123.00	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,029,061.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,687,230.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,935,638.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	4,710,288.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	4,493,250.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	9,605,522.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,600,000.00	7,228,312.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	7,331,220.00	
	銘柄数：30	116,900,000.00	130,691,167.00	(13,023,374,791)
組入時価比率：2.3%			2.3%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,700,000.00	31,544,526.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	48,728,233.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,300,000.00	40,984,052.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	42,500,000.00	45,840,032.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,800,000.00	65,003,212.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	55,000,000.00	61,258,835.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	22,000,000.00	21,771,002.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	50,200,000.00	56,184,442.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,000,000.00	34,377,552.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	24,500,000.00	25,331,015.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	27,000,000.00	34,351,992.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	50,700,000.00	55,248,297.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,500,000.00	25,319,905.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,000,000.00	38,777,445.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	62,394,124.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	36,192,733.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,200,000.00	36,602,203.20	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	62,000,000.00	69,579,934.00	
	銘柄数：18	715,400,000.00	789,489,537.90	(6,213,282,663)
組入時価比率：1.1%			1.1%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,823,675.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,150,948.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,451,850.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	8,223,705.00	

BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,372,860.00	
BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	6,090,375.00	
BELGIUM KINGDOM	4,200,000.00	5,231,520.00	
BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,293,136.00	
BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	7,341,750.00	
BELGIUM KINGDOM	5,300,000.00	6,963,770.70	
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,587,894.50	
BELGIUM KINGDOM	4,500,000.00	6,418,687.50	
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,665,090.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	2,300,000.00	2,400,878.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	1,500,000.00	1,609,830.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	2,000,000.00	2,256,800.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	2,500,000.00	2,777,875.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,954,520.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	5,600,000.00	8,129,912.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	7,200,000.00	10,797,732.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,700,000.00	10,041,925.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,800,000.00	12,461,130.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,500,000.00	14,281,974.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,100,000.00	14,587,183.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,800,000.00	13,845,678.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,200,000.00	13,474,753.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,100,000.00	12,315,672.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000,000.00	11,050,500.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,200,000.00	7,743,312.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,500,000.00	8,644,875.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	8,135,180.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,800,000.00	11,165,140.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,800,000.00	8,078,536.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,200,000.00	8,873,280.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,800,000.00	7,355,989.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,700,000.00	9,663,638.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	4,398,918.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,300,000.00	7,706,475.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,300,000.00	9,473,620.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,700,000.00	10,660,806.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,700,000.00	11,720,361.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,600,000.00	5,927,100.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	6,140,738.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	4,447,485.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,600,000.00	3,546,816.00	
BUNDESobligation	3,000,000.00	3,114,900.00	
BUNDESobligation	2,500,000.00	2,550,750.00	
BUNDESobligation	2,100,000.00	2,120,370.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	7,031,730.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,271,650.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	9,141,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	7,989,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,216,930.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	8,204,470.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,233,400.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,352,200.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	7,044,160.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	7,597,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,268,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	5,007,850.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	3,408,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	5,962,140.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	11,649,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,169,110.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,587,900.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,300,000.00	3,339,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	11,696,060.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	8,334,150.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,900,000.00	4,123,220.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	5,775,350.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000.00	7,522,560.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	9,621,927.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,800,000.00	9,725,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,200,000.00	6,359,358.60	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,900,000.00	7,986,201.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,400,000.00	5,896,528.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	5,562,492.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,900,000.00	3,437,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	12,154,311.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	15,614,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,400,000.00	9,724,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	5,091,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	15,785,209.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,800,000.00	14,934,222.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,250,185.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,500,000.00	10,309,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	10,589,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,200,000.00	9,865,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	10,585,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	11,593,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	9,122,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,200,000.00	10,320,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000.00	6,257,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000.00	12,380,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,966,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	7,676,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,300,000.00	12,878,610.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	9,850,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,196,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,500,000.00	10,879,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,300,000.00	7,157,556.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	7,032,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	8,857,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,900,000.00	11,814,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,990,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	10,151,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,100,000.00	12,663,380.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,821,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	7,515,020.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	12,249,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,554,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	2,045,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000,000.00	12,433,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	5,430,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,100,000.00	10,457,590.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,700,000.00	19,338,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,900,000.00	8,554,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	12,508,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,900,000.00	13,998,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	8,111,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	10,668,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,945,990.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,506,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	14,251,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	6,943,320.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,178,816.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,555,674.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,520,805.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,291,400.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,348,410.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,399,430.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,308,684.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,068,880.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,735,039.50	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	616,371.70	
FINNISH GOVERNMENT	1,400,000.00	1,663,316.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,207,238.40	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	7,228,186.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,500,000.00	8,589,556.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,094,767.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,600,000.00	11,326,524.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,500,000.00	8,028,750.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,700,000.00	10,684,996.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,684,744.00	



FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	4,634,712.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	12,312,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	6,813,034.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,100,000.00	11,685,629.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,429,276.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	10,937,986.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,034,992.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,000,000.00	12,218,250.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,400,000.00	13,538,070.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	13,372,775.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,100,000.00	16,241,790.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,700,000.00	10,688,148.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	12,965,954.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,200,000.00	20,399,040.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,600,000.00	2,727,829.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,500,000.00	22,630,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	21,304,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,700,000.00	7,562,290.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,000,000.00	17,684,388.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,000,000.00	19,050,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,400,000.00	9,388,160.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,200,000.00	8,367,334.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,100,000.00	10,394,208.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,700,000.00	8,118,390.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	6,672,759.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,400,000.00	3,450,182.40	
FRENCH TREASURY NOTE	6,000,000.00	6,172,350.00	
FRENCH TREASURY NOTE	4,300,000.00	4,433,730.00	
FRENCH TREASURY NOTE	3,200,000.00	3,274,080.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	2,500,000.00	2,902,120.00	
IRISH GOVERNMENT	6,600,000.00	7,421,436.00	
IRISH GOVERNMENT	3,800,000.00	4,334,280.00	
IRISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,689,868.00	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,272,444.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,277,350.00	

IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	8,018,880.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	500,000.00	521,212.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,500,000.00	1,340,017.50	
IRISH TSY 3.4% 2024	1,300,000.00	1,507,870.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,607,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,167,004.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,382,772.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,656,393.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	7,293,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,607,115.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	8,204,760.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,004,260.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,739,020.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,865,240.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,662,496.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,100,000.00	6,228,630.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,448,280.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,496,635.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,000,000.00	7,642,600.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,600,000.00	8,291,920.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,800,000.00	3,183,350.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,200,000.00	5,969,880.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	6,429,766.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,300,000.00	2,795,323.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,431,169.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,647,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,364,458.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,387,400.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	5,558,400.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000.00	1,824,100.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,503,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,720,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,200,000.00	5,023,200.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	3,964,950.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,500,000.00	4,168,500.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,702,856.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,104,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,900,000.00	5,327,400.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,800,000.00	4,315,595.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,300,000.00	6,126,777.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,700,000.00	4,697,150.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,400,000.00	4,059,518.40	
	SPANISH GOVERNMENT	12,100,000.00	13,414,665.00	
	SPANISH GOVERNMENT	8,300,000.00	11,490,022.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	7,275,320.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,500,000.00	6,495,500.00	
小計	銘柄数：225	1,371,000,000.00	1,642,209,661.10	
			(222,502,986,982)	
	組入時価比率：39.6%		40.0%	
英債券	UK TREASURY	6,500,000.00	6,766,500.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	6,607,900.00	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,876,800.00	
	UK TREASURY	9,000,000.00	9,028,800.00	
	UK TREASURY	5,600,000.00	6,205,360.00	
	UK TREASURY	10,000,000.00	10,034,000.00	
	UK TREASURY	5,400,000.00	6,032,340.00	
	UK TREASURY	8,300,000.00	8,405,410.00	
	UK TREASURY	5,300,000.00	5,805,620.00	
	UK TREASURY	5,600,000.00	6,422,080.00	
	UK TREASURY	8,700,000.00	8,850,510.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	6,308,190.00	
	UK TREASURY	3,900,000.00	5,277,090.00	
	UK TREASURY	6,400,000.00	7,141,760.00	
	UK TREASURY	4,500,000.00	5,114,250.00	
	UK TREASURY	7,500,000.00	7,395,750.00	
	UK TREASURY	7,000,000.00	7,086,100.00	
	UK TREASURY	7,500,000.00	7,845,000.00	
	UK TREASURY	7,400,000.00	9,210,780.00	
	UK TREASURY	4,000,000.00	4,791,600.00	
	UK TREASURY	3,100,000.00	4,379,990.00	

	UK TREASURY	6,250,000.00	7,993,125.00	
	UK TREASURY	6,300,000.00	7,681,590.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	8,234,200.00	
	UK TREASURY	6,100,000.00	7,534,720.00	
	UK TREASURY	4,650,000.00	6,228,210.00	
	UK TREASURY	3,500,000.00	4,388,650.00	
	UK TREASURY	3,600,000.00	4,537,080.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	8,599,500.00	
	UK TREASURY	9,900,000.00	11,181,060.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	6,629,490.00	
	UK TREASURY	3,100,000.00	4,111,530.00	
	UK TREASURY	6,400,000.00	7,830,400.00	
	UK TREASURY	2,400,000.00	2,916,960.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	11,100,000.00	11,972,460.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,400,000.00	8,777,600.00	
小計	銘柄数：36	217,300,000.00	249,202,405.00	
			(48,103,540,237)	
	組入時価比率：8.6%		8.7%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	7,600,000.00	8,660,960.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,300,000.00	4,815,690.00	
小計	銘柄数：2	10,900,000.00	13,476,650.00	
			(1,768,271,246)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	10,400,000.00	10,762,991.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,000,000.00	7,595,763.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	23,500,000.00	27,131,925.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	39,400,000.00	49,076,640.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	31,300,000.00	37,200,050.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,900,000.00	18,704,605.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	19,200,000.00	21,792,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	11,800,000.00	15,350,041.80	
小計	銘柄数：8	160,500,000.00	187,614,016.00	
			(2,757,926,035)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	21,400,000.00	22,788,902.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	18,000,000.00	20,383,200.00	

小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	20,600,000.00	23,286,652.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,664,650.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	21,800,000.00	23,949,480.00	
	銘柄数：5	96,100,000.00	105,072,884.80	(1,631,781,900)
	組入時価比率：0.3%			0.3%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	43,500,000.00	50,842,800.00	
	KINGDOM OF DENMARK	29,800,000.00	34,316,190.00	
	KINGDOM OF DENMARK	26,600,000.00	27,903,400.00	
	KINGDOM OF DENMARK	14,500,000.00	22,215,450.00	
	KINGDOM OF DENMARK	18,600,000.00	19,795,980.00	
	KINGDOM OF DENMARK	34,200,000.00	52,618,204.80	
	銘柄数：6	167,200,000.00	207,692,024.80	(3,771,687,170)
組入時価比率：0.7%			0.7%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,179,080.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,600,000.00	11,020,088.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,618,780.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	8,050,560.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,253,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,550,745.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,100,000.00	5,246,288.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	9,579,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,170,245.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,747,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,653,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,600,000.00	7,747,080.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,620,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	5,959,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	3,152,750.00	
銘柄数：15	92,100,000.00	98,548,017.60	(3,189,013,849)	
組入時価比率：0.6%			0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,390,620.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,600,000.00	8,081,080.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,600,000.00	5,847,424.80	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,500,000.00	5,968,528.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,482,920.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	8,989,420.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,448,518.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	7,793,833.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	8,224,419.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,797,820.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	8,660,851.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,300,000.00	6,192,270.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,895,514.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,824,700.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,151,289.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,165,923.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,613,129.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,312,509.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,024,962.00	
小計	銘柄数：19	96,800,000.00	104,865,733.70	
			(9,846,892,394)	
	組入時価比率：1.8%		1.8%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,500,000.00	2,583,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	615,708.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	883,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,381,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,965,550.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,175,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,402,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,252,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,229,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	307,950.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,571,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,860,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	522,470.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	942,240.00	
小計	銘柄数：14	22,000,000.00	22,695,468.00	
			(2,062,791,086)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	

リンギ	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	8,649,923.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,331,178.80		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,913,516.90		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,185,680.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,378,177.80		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,688,900.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,010,707.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,900,000.00	11,225,637.50		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,257,600.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,100,878.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,429,848.80		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,438,231.80		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,797,464.70		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,846,219.40		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,058,251.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,735,152.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,715,400.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,978,650.80		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,550,232.00		
	小計	銘柄数：22	87,300,000.00	87,945,442.00	
		組入時価比率：0.5%		(2,858,226,865)	0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,700,000.00	18,046,541.22		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,800,000.00	24,088,398.88		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,800,000.00	23,282,059.64		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	24,654,305.34		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,500,000.00	14,152,472.70		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,900,000.00	54,476,268.21		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,300,000.00	22,922,877.69		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	23,500,000.00	20,130,100.00		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,500,000.00	11,899,925.00		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	35,400,000.00	26,690,152.14		

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,100,000.00	14,545,830.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	18,600,000.00	14,114,729.04	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	33,300,000.00	32,548,988.43	
	小計	銘柄数：13	315,500,000.00	301,552,648.29	
		組入時価比率：0.5%		(3,018,542,009)	
				0.5%	
	合計			555,683,844,310	
				(555,683,844,310)	

(注1)外貨建の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、外貨建の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27年 6月29日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,059,847,320	-	2,035,700,700	24,146,620
米ドル	848,232,660	-	844,666,500	3,566,160
カナダドル	64,915,280	-	64,766,000	149,280
メキシコペソ	31,848,400	-	31,440,000	408,400
ユーロ	857,835,680	-	839,976,000	17,859,680
英ポンド	176,620,850	-	175,648,200	972,650
ノルウェークローネ	31,519,200	-	31,040,000	479,200
豪ドル	28,532,250	-	28,164,000	368,250
ランド	20,343,000	-	20,000,000	343,000
合計	2,059,847,320	-	2,035,700,700	24,146,620

### (注) 時価の算定方法

#### 1 為替予約取引

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

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

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

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



- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## マイターゲット2050（確定拠出年金向け）

平成27年 7月31日現在

資産総額	16,644,048円
負債総額	4,939円
純資産総額（ - ）	16,639,109円
発行済口数	15,788,735口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0539円

## （参考）国内株式マザーファンド

平成27年 7月31日現在

資産総額	314,029,743,053円
負債総額	32,036,512,562円
純資産総額（ - ）	281,993,230,491円
発行済口数	185,879,684,537口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5171円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成27年 7月31日現在

資産総額	349,792,792,352円
負債総額	1,150,143,707円
純資産総額（ - ）	348,642,648,645円
発行済口数	150,223,197,977口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3208円

## （参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

平成27年 7月31日現在

資産総額	587,649,742,081円
負債総額	5,309,737,481円
純資産総額（ - ）	582,340,004,600円
発行済口数	466,665,462,773口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2479円

## （参考）外国債券マザーファンド

平成27年 7月31日現在

資産総額	595,645,825,843円
負債総額	2,133,078,892円
純資産総額（ - ）	593,512,746,951円
発行済口数	250,433,414,255口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3699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。

委託者は、上記の振替について、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、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額

平成27年7月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)会社の機構

###### (a)会社の意思決定機構

当社は委員会設置会社であり、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27年6月30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	887	18,958,286
単位型株式投資信託	47	240,353
追加型公社債投資信託	18	7,534,919
単位型公社債投資信託	130	1,062,149
合計	1,082	27,795,706

### 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。
2. 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)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の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					
建物	2	442		413	
器具備品	2	1,065		909	
無形固定資産					
ソフトウェア		8,248	8,249	7,253	7,254
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)	
<b>(負債の部)</b>					
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
<b>(純資産の部)</b>					
株主資本					
資本金			80,249		90,092
資本剰余金			17,180		17,180
資本準備金		11,729	11,729	11,729	11,729
利益剰余金			51,339		61,182
利益準備金		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
経常利益			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							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	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 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金		利 益 準備金	利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
		資 本 準備金	資 本 剰余金 合 計		その他利益剰余金			
					別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		

当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249
会計方針の変更による累積的影響額						81	81	81
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	25,966	51,258	80,168
当期変動額								
剰余金の配当						10,043	10,043	10,043
当期純利益						19,967	19,967	19,967
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	9,923	9,923	9,923
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092

(単位：百万円)

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

## [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
--------------------	----------------------------------

	<p>(2) その他有価証券</p> <p>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)</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="1"> <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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>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。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p>								
5. 消費税等の会計処理方法	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理してあります。</p>								

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]

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

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成26年3月31日)	当事業年度末 (平成27年3月31日)												
<p>1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払金</td> <td style="text-align: right;">4,601百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,607</td> </tr> </table>	未払金	4,601百万円	未払費用	1,607	<p>1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払金</td> <td style="text-align: right;">4,979百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,411</td> </tr> </table>	未払金	4,979百万円	未払費用	1,411				
未払金	4,601百万円												
未払費用	1,607												
未払金	4,979百万円												
未払費用	1,411												
<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">565百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">2,849</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">3,414</td> </tr> </table>	建物	565百万円	器具備品	2,849	合計	3,414	<p>2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">607百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">3,052</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">3,659</td> </tr> </table>	建物	607百万円	器具備品	3,052	合計	3,659
建物	565百万円												
器具備品	2,849												
合計	3,414												
建物	607百万円												
器具備品	3,052												
合計	3,659												

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)								
<p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">3,568百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">5</td> </tr> </table>	受取配当金	3,568百万円	支払利息	5	<p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">3,966百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </table>	受取配当金	3,966百万円	支払利息	-
受取配当金	3,568百万円								
支払利息	5								
受取配当金	3,966百万円								
支払利息	-								
<p>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。</p>	<p>2. 役員報酬の範囲額 (同左)</p>								

3. 固定資産除却損		3. 固定資産除却損	
器具備品	6百万円	器具備品	15百万円
ソフトウェア	11	ソフトウェア	342
ア		ア	
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	
繰延税金資産	繰延税金資産
関係会社株式評価減	関係会社株式評価減
賞与引当金	賞与引当金
退職給付引当金	退職給付引当金
所有株式税務簿価通算差異	所有株式税務簿価通算差異
外国税支払損失引当金	外国税支払損失引当金
投資有価証券評価減	投資有価証券評価減
未払事業税	未払事業税
ゴルフ会員権評価減	ゴルフ会員権評価減
減価償却超過額	減価償却超過額
関連会社株式譲渡益	関連会社株式譲渡益
時効後支払損引当金	時効後支払損引当金
子会社株式売却損	子会社株式売却損
未払社会保険料	未払社会保険料
その他	その他
繰延税金資産小計	繰延税金資産小計
評価性引当額	評価性引当額
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金	その他有価証券評価差額金
前払年金費用	前払年金費用
繰延税金負債合計	繰延税金負債合計
繰延税金負債の純額	繰延税金資産の純額
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	法定実効税率
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
住民税等均等割	住民税等均等割
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
外国税額控除	外国税額控除
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正
評価性引当額	評価性引当額
その他	その他
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について、前事業年度の38%から36%に変更されております。

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

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の36%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33%に、平成28年4月1日に開始する前事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の純額は73百万円減少し、法人税等調整額が479百万円、その他有価証券評価差額金が405百万円、それぞれ増加しております。

## セグメント情報等

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品・サービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

##### 売上高

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

##### 有形固定資産

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

#### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品・サービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

## (イ) 子会社等

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

## (ウ) 兄弟会社等

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

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

## ㈱野村総合研究所

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

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

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

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

#### 1株当たり情報

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

#### 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27年6月末現在

#### (2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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27年6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・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

### 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

#### (1)受託者

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間における提出書類はありません。



## 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27年8月14日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマイターゲット2050（確定拠出年金向け）の平成27年2月27日から平成27年6月29日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マイターゲット2050（確定拠出年金向け）の平成27年6月29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。