

【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28年9月21日提出
【計算期間】	第2期(自 平成27年6月30日至 平成28年6月28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。

<商品分類>

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

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

(マイターゲット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	インデックス型
	海外	債券	
追加型	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

《属性区分表》

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

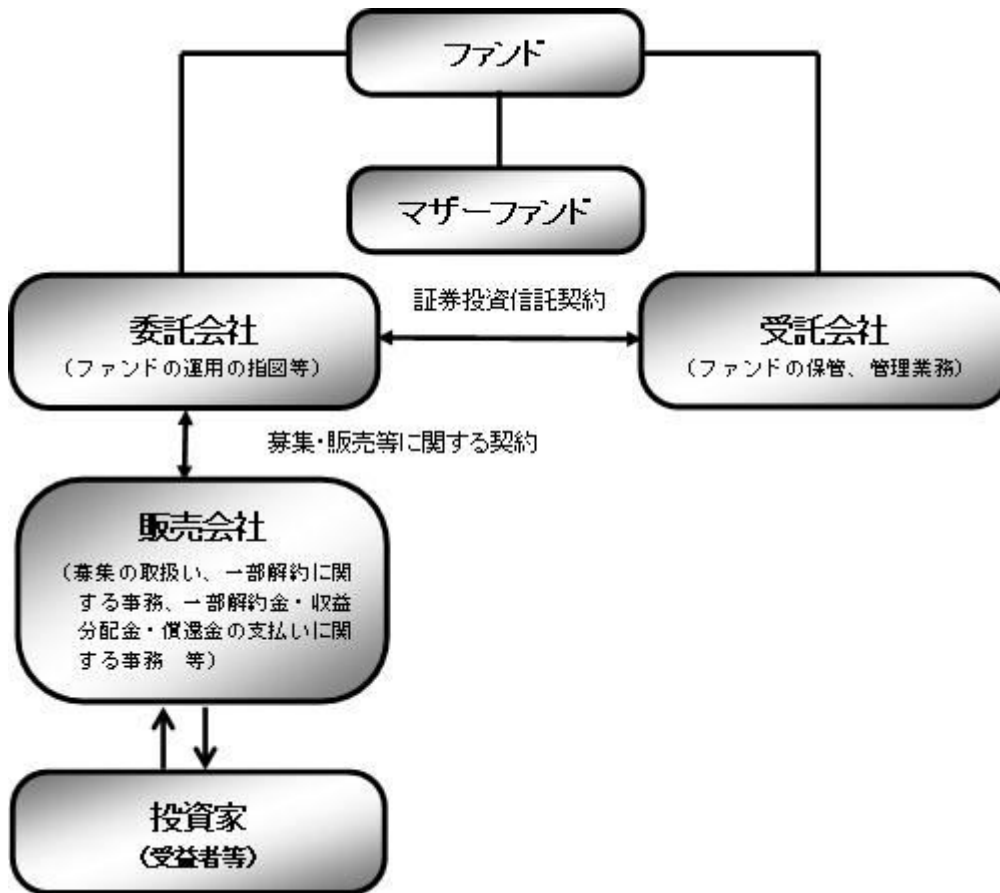
[特殊型]

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

(2) 【ファンドの沿革】

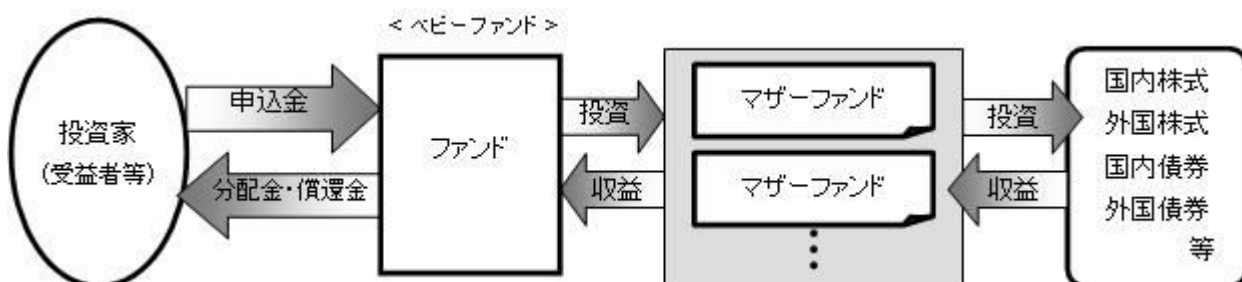
平成27年2月27日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(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28年8月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立

平成9年(1997年)10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

平成12年(2000年)11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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。

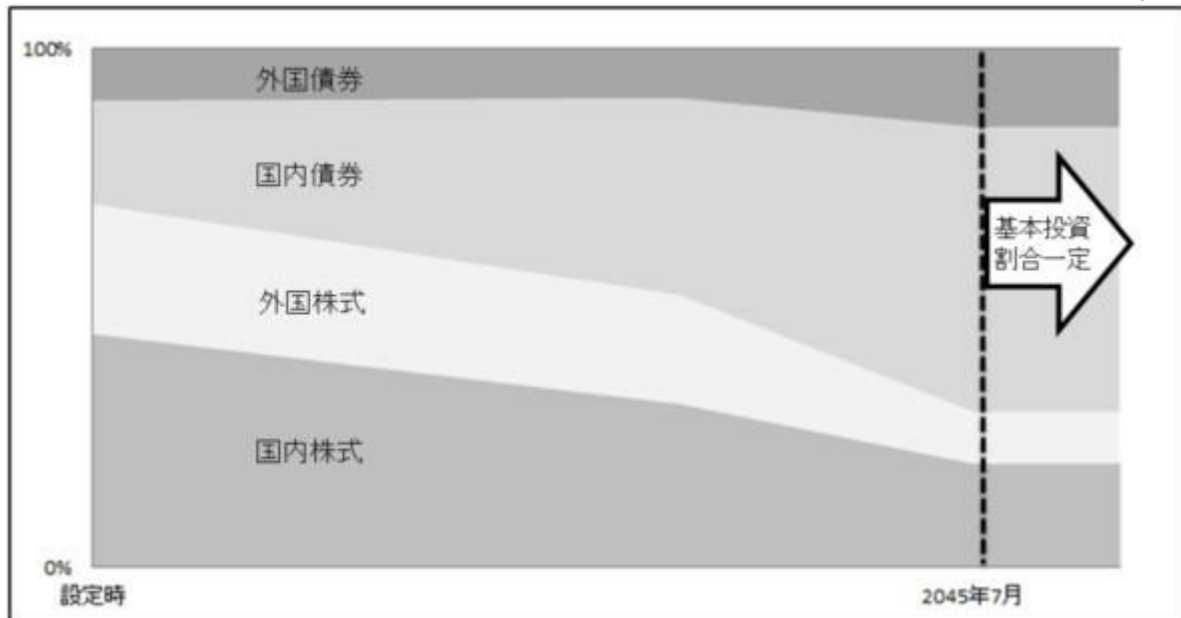
定期的な基本投資割合の変更は、家計や市場の構造変化等を考慮し、当面、原則年1回行なうことを基本とします。

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	2016年9月現在
国内株式	45%	20%	44.3%
外国株式	25%	10%	24.8%
国内債券	20%	55%	20.9%
外国債券	10%	15%	10%

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。

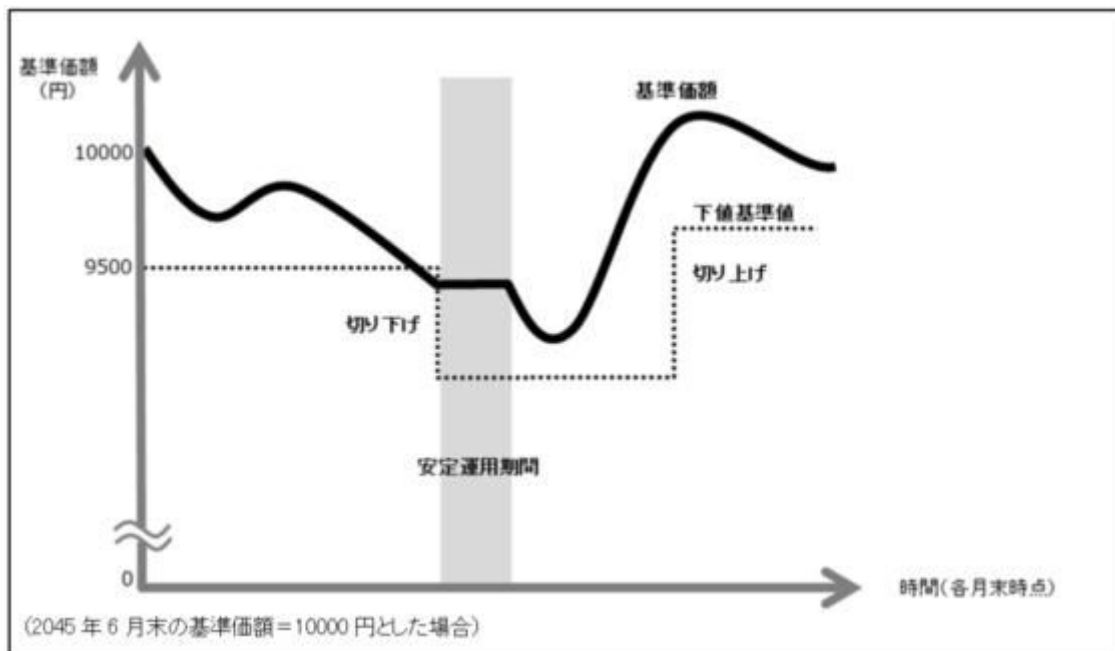
各資産への実質的なエクスポージャーをゼロに近づけることを基本とします。

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。

*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。

- ・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。
- ・安定運用期間終了後は、安定運用に切り替える前の基本投資割合となるよう、各資産への実質的なエクスポージャーを引き上げます。

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

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

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

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

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

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

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

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

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

[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。

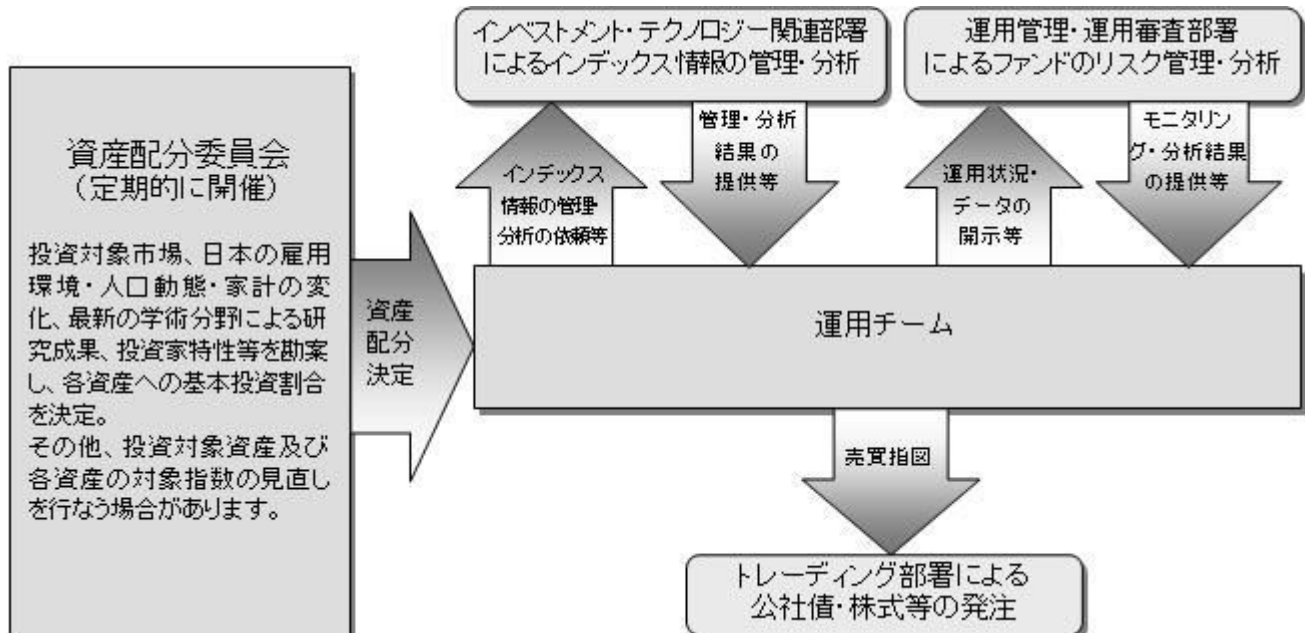
一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。

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

クロスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（３）【運用体制】

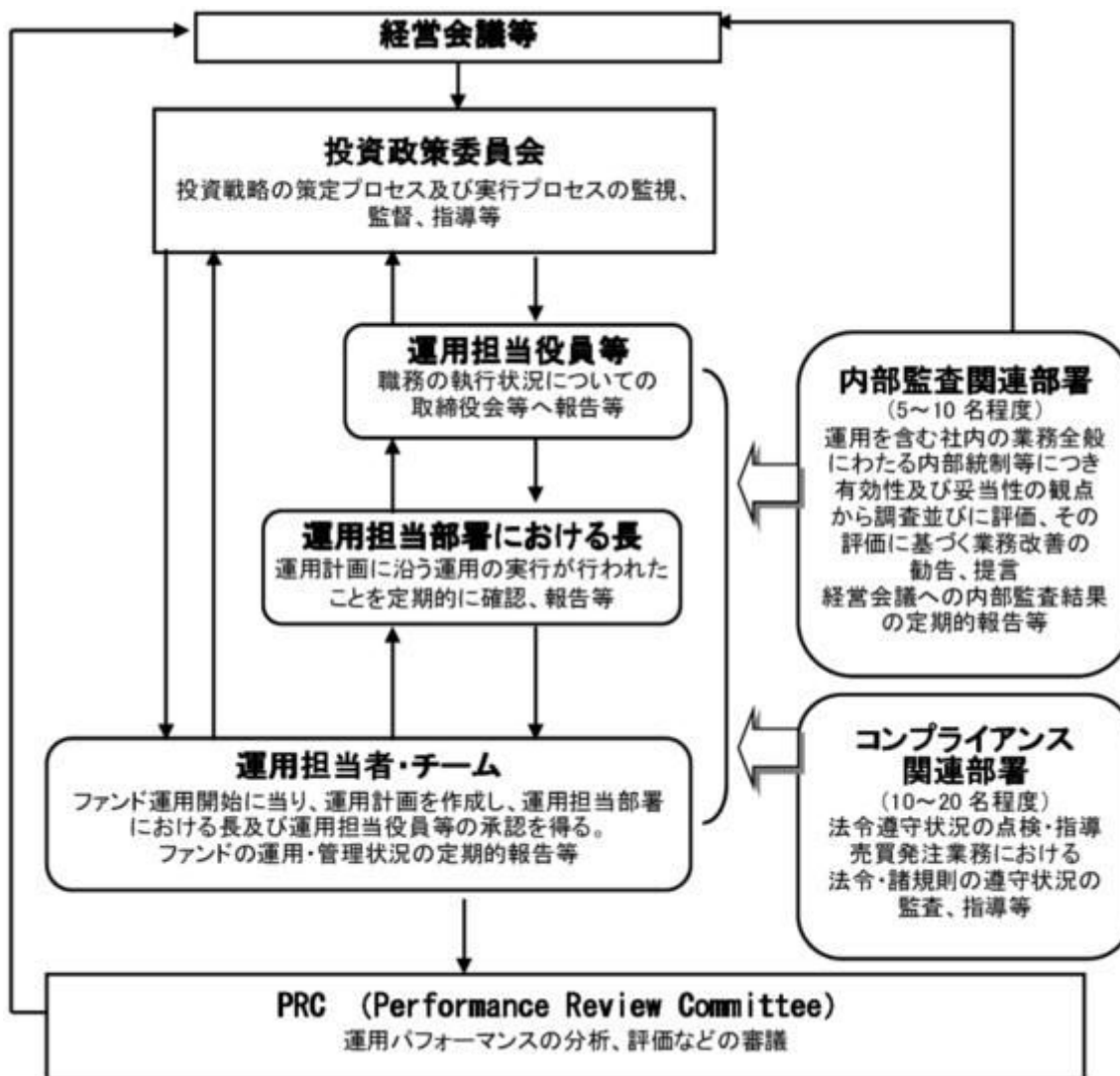
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

当社では、ファンドの運用に関する社内規程として、運用担当者に関する規程並びにスワップ取引、信用リスク管理、資金の借入、外国為替の予約取引等、信用取引等に関して各々、取扱い基準を設けております。

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みません。）等の全額とします。

収益分配金額は、上記の範囲内で、基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

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

ファンドの決算日

原則として**毎年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

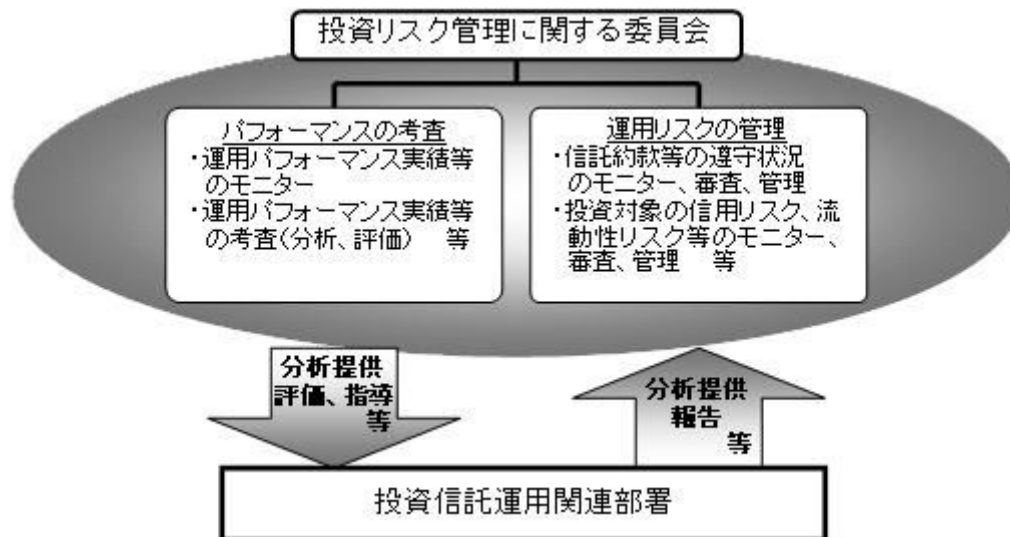
パフォーマンスの考査

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

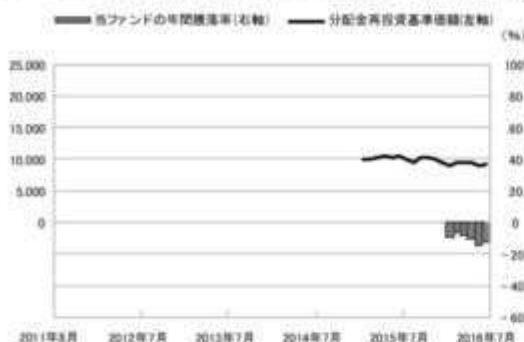


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

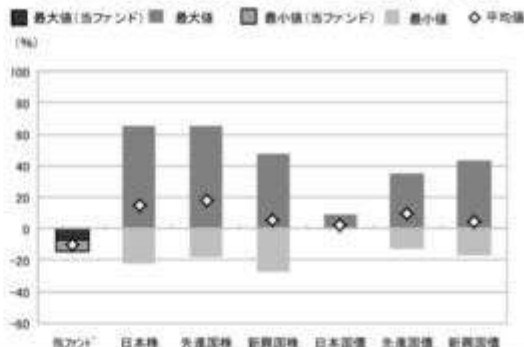
リスクの定量的比較

(2011年8月末～2016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(%)	△ 6.6	65.0	45.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	△ 14.6	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	0.4	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	△ 10.3	15.2	18.0	5.0	2.8	9.9	4.9

- 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、2016年2月から2016年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、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いません。

- 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。
- 2011年8月から2016年7月の5年間(当ファンドは2016年2月から2016年7月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- 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いません。

※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・ディバーシファイド(円ベース)

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社(株)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、サービスに關し一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファIRMーション、或いは指数に關連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスも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見られますが、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予測するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性があります。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、指数に關する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての提供、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または承認を行うものでもありません。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、トレーディングに關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, JPSC, JP Morgan Securities PLC, またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に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。

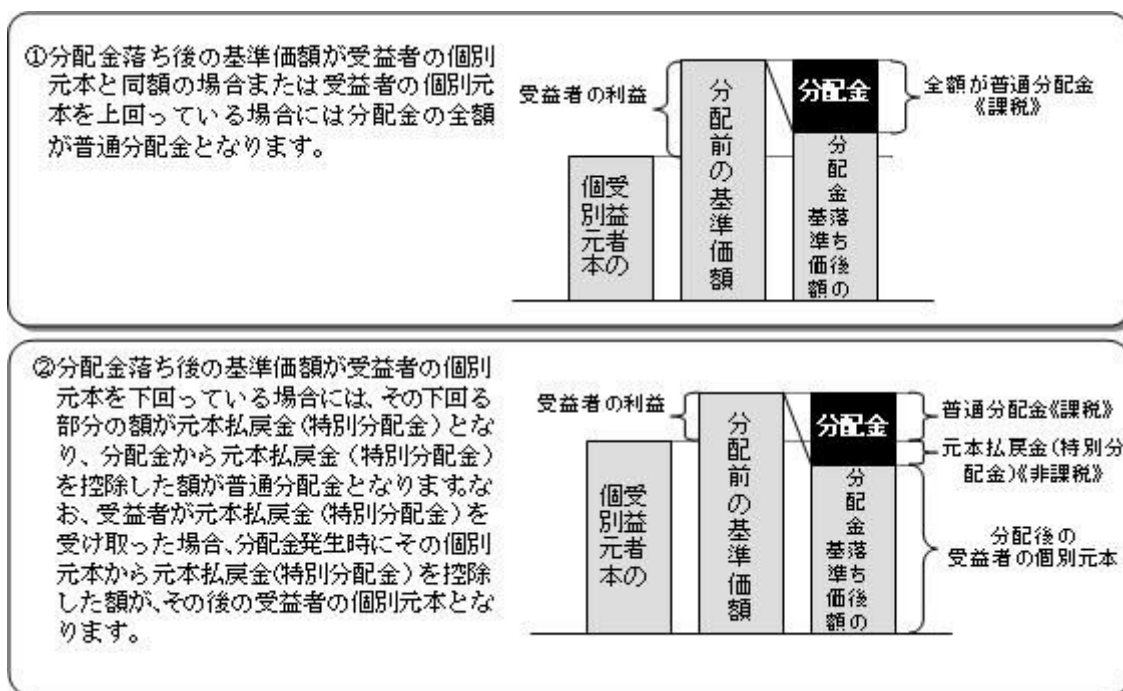
換金(解約)時および償還時の課税について

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28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28年 7月29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	314,326,378	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		312,780	0.09
合計（純資産総額）		314,639,158	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	281,270,813,450	98.92
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,058,951,706	1.07
合計（純資産総額）		284,329,765,156	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	1,700,480,000	0.59

(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	197,317,603,884	62.20
	カナダ	11,806,481,378	3.72
	ドイツ	10,966,981,811	3.45
	イタリア	2,381,963,931	0.75
	フランス	11,432,151,287	3.60
	オランダ	3,764,400,386	1.18
	スペイン	3,667,247,629	1.15
	ベルギー	1,620,522,126	0.51

	オーストリア	208,616,281	0.06
	ルクセンブルグ	34,374,811	0.01
	フィンランド	1,226,873,403	0.38
	アイルランド	560,849,707	0.17
	ポルトガル	186,809,652	0.05
	イギリス	85,215,940	0.02
	イギリス	23,608,515,433	7.44
	スイス	11,221,483,741	3.53
	スウェーデン	3,398,071,618	1.07
	ノルウェー	763,656,989	0.24
	デンマーク	2,456,410,594	0.77
	オーストラリア	8,429,053,424	2.65
	ニュージーランド	243,203,493	0.07
	香港	3,857,256,456	1.21
	シンガポール	1,499,057,584	0.47
	イスラエル	772,367,393	0.24
	小計	301,509,168,951	95.04
投資信託受益証券	アメリカ	25,777,643	0.00
投資証券	アメリカ	6,824,586,022	2.15
	カナダ	78,999,847	0.02
	フランス	493,951,962	0.15
	イギリス	335,079,054	0.10
	オーストラリア	934,519,668	0.29
	香港	198,170,234	0.06
	シンガポール	137,841,962	0.04
	小計	9,003,148,749	2.83
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,686,480,018	2.10
合計（純資産総額）		317,224,575,361	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,588,676,853	1.44
	買建	カナダ	268,437,563	0.08
	買建	ドイツ	824,495,760	0.25
	買建	イギリス	542,357,801	0.17
	買建	スイス	250,133,715	0.07

（参考）国内債券NOMURA - B P I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	537,543,658,350	79.25
地方債証券	日本	49,951,428,068	7.36
特殊債券	日本	57,776,642,878	8.51
社債券	日本	29,586,250,770	4.36
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,405,547,606	0.50
合計（純資産総額）		678,263,527,672	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	271,339,020,315	42.70
	カナダ	12,653,460,458	1.99
	メキシコ	5,388,681,920	0.84
	ドイツ	35,479,142,176	5.58
	イタリア	67,658,784,113	10.64
	フランス	57,729,200,168	9.08
	オランダ	14,019,048,550	2.20
	スペイン	45,142,415,450	7.10
	ベルギー	16,131,861,375	2.53
	オーストリア	8,874,401,733	1.39
	フィンランド	3,582,346,933	0.56
	アイルランド	6,065,044,424	0.95
	イギリス	49,398,289,595	7.77
	スイス	1,454,727,498	0.22
	スウェーデン	3,130,823,578	0.49
	ノルウェー	1,584,049,820	0.24
	デンマーク	4,313,290,784	0.67
	ポーランド	3,684,929,815	0.57
	オーストラリア	12,331,887,578	1.94
	シンガポール	2,379,325,228	0.37
マレーシア	2,983,525,940	0.46	
南アフリカ	3,030,085,389	0.47	
	小計	628,354,342,840	98.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,033,409,633	1.10
合計（純資産総額）		635,387,752,473	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	114,792,897	1.1474	131,722,899	1.2350	141,769,227	45.05
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	40,763,824	1.7508	71,372,952	1.9500	79,489,456	25.26
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	46,763,980	1.3499	63,130,883	1.3352	62,439,266	19.84
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	14,495,234	2.0383	29,546,152	2.1130	30,628,429	9.73

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	99.90
合計	99.90

(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	1,787,500	5,655.64	10,109,473,600	5,894.00	10,535,525,000	3.70
2	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	11,380,600	506.67	5,766,247,370	522.00	5,940,673,200	2.08
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	1,096,400	5,024.64	5,509,022,040	4,881.00	5,351,528,400	1.88
4	日本	株式	ソフトバンクグル ープ	情報・通 信業	803,700	5,979.39	4,805,643,032	5,703.00	4,583,501,100	1.61
5	日本	株式	KDDI	情報・通 信業	1,403,200	3,268.54	4,586,425,805	3,145.00	4,413,064,000	1.55
6	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	1,135,800	3,340.99	3,794,696,480	3,308.00	3,757,226,400	1.32
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,293,300	3,027.07	3,914,922,470	2,841.50	3,674,911,950	1.29
8	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	892,500	4,578.13	4,085,981,025	4,025.00	3,592,312,500	1.26
9	日本	株式	みずほフィナン シャルグループ	銀行業	20,177,400	165.09	3,331,234,780	167.10	3,371,643,540	1.18
10	日本	株式	ソニー	電気機器	1,014,200	2,692.18	2,730,417,060	3,282.00	3,328,604,400	1.17
11	日本	株式	NTTドコモ	情報・通 信業	1,059,800	2,799.37	2,966,774,970	2,749.50	2,913,920,100	1.02
12	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,633,900	1,483.11	2,423,253,429	1,721.50	2,812,758,850	0.98
13	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	599,500	5,254.70	3,150,192,700	4,588.00	2,750,506,000	0.96
14	日本	株式	セブン&アイ・ホ ールディングス	小売業	593,300	4,745.45	2,815,477,850	4,303.00	2,552,969,900	0.89
15	日本	株式	ファナック	電気機器	145,700	16,191.03	2,359,033,071	17,325.00	2,524,252,500	0.88
16	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	262,700	9,830.67	2,582,517,080	9,485.00	2,491,709,500	0.87
17	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	128,700	19,406.25	2,497,584,500	19,220.00	2,473,614,000	0.86
18	日本	株式	キーエンス	電気機器	32,600	66,276.99	2,160,630,180	72,920.00	2,377,192,000	0.83

19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	574,600	3,697.98	2,124,864,360	4,040.00	2,321,384,000	0.81
20	日本	株式	キヤノン	電気機器	773,700	3,067.70	2,373,482,750	2,935.00	2,270,809,500	0.79
21	日本	株式	花王	化学	382,300	6,096.58	2,330,722,534	5,553.00	2,122,911,900	0.74
22	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,055,000	2,137.91	2,255,500,200	1,929.00	2,035,095,000	0.71
23	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,959,300	1,001.38	1,962,003,834	1,012.00	1,982,811,600	0.69
24	日本	株式	村田製作所	電気機器	151,600	12,810.97	1,942,144,500	12,825.00	1,944,270,000	0.68
25	日本	株式	信越化学工業	化学	269,900	6,204.73	1,674,656,880	7,064.00	1,906,573,600	0.67
26	日本	株式	任天堂	その他製品	88,500	15,177.62	1,343,219,740	21,505.00	1,903,192,500	0.66
27	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,064,300	1,796.98	1,912,535,370	1,778.50	1,892,857,550	0.66
28	日本	株式	ダイキン工業	機械	209,300	8,803.10	1,842,489,000	9,012.00	1,886,211,600	0.66
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,533,000	1,236.26	1,895,196,500	1,217.50	1,866,427,500	0.65
30	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	508,000	4,104.17	2,084,921,530	3,601.00	1,829,308,000	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.28
		建設業	3.28
		食料品	5.03
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.18
		医薬品	5.70
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.85
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.14
		非鉄金属	0.86
		金属製品	0.65
		機械	4.76
		電気機器	11.84
		輸送用機器	9.48
		精密機器	1.49
		その他製品	1.77
		電気・ガス業	1.86
		陸運業	4.53
		海運業	0.21
空運業	0.58		
倉庫・運輸関連業	0.20		
情報・通信業	8.33		
卸売業	4.01		
小売業	4.83		

	銀行業	7.44
	証券、商品先物取引業	0.98
	保険業	2.38
	その他金融業	1.25
	不動産業	2.58
	サービス業	3.81
合 計		98.92

(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	546,000	11,412.23	6,231,081,226	10,895.18	5,948,769,809	1.87
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	740,000	5,739.79	4,247,444,909	5,869.44	4,343,391,668	1.36
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消 耗燃 料	409,000	8,840.39	3,615,722,100	9,418.68	3,852,241,756	1.21
4	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	271,800	11,400.14	3,098,559,634	12,996.11	3,532,343,568	1.11
5	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット 販売・ カタログ 販売	39,420	62,808.49	2,475,910,935	78,587.53	3,097,920,677	0.97
6	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コング ロマ リット	919,100	3,321.73	3,053,005,354	3,263.12	2,999,138,187	0.94
7	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	226,100	11,981.33	2,708,980,008	13,052.50	2,951,170,250	0.93
8	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電 気通 信サ ービス	606,000	4,117.83	2,495,406,974	4,446.20	2,694,399,382	0.84
9	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	314,100	7,708.90	2,421,366,743	8,231.83	2,585,619,688	0.81
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	361,600	6,237.10	2,255,335,456	6,693.32	2,420,305,235	0.76
11	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	475,200	5,076.66	2,412,429,118	5,025.73	2,388,229,082	0.75
12	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インター ネット ソフト ウェア・ サービス	30,640	78,242.40	2,397,347,338	77,887.92	2,386,485,936	0.75
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品	266,500	8,635.58	2,301,384,730	8,855.86	2,360,086,743	0.74
14	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	608,300	3,150.10	1,916,207,447	3,829.08	2,329,230,216	0.73
15	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インター ネット ソフト ウェア・ サービス	28,830	80,078.21	2,308,654,869	79,969.01	2,305,506,639	0.72
16	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電 気通 信サ ービス	401,400	5,644.81	2,265,827,732	5,728.48	2,299,412,354	0.72
17	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消 耗燃 料	185,600	9,962.51	1,849,042,547	10,628.91	1,972,726,030	0.62
18	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	224,200	7,488.43	1,678,907,276	8,562.38	1,919,687,614	0.60
19	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	405,300	4,860.26	1,969,864,564	4,557.93	1,847,330,245	0.58
20	スイス	株式	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	医薬品	69,240	25,292.90	1,751,280,903	26,177.66	1,812,541,525	0.57
21	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小 売り	125,000	13,920.91	1,740,113,885	14,405.78	1,800,722,900	0.56

22	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	117,390	14,875.84	1,746,275,731	15,080.33	1,770,280,690	0.55
23	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	239,800	6,355.05	1,523,942,864	7,085.94	1,699,208,700	0.53
24	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	465,700	3,413.80	1,589,809,450	3,630.68	1,690,809,259	0.53
25	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	273,500	5,564.47	1,521,882,563	6,101.26	1,668,694,774	0.52
26	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	142,500	10,725.51	1,528,385,190	11,290.93	1,608,958,180	0.50
27	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	496,100	2,971.37	1,474,101,416	3,186.89	1,581,020,296	0.49
28	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	タバコ	152,700	10,307.24	1,573,916,380	10,348.02	1,580,142,959	0.49
29	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	189,200	8,015.51	1,516,535,421	8,269.01	1,564,498,546	0.49
30	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,018,000	1,406.94	1,432,267,568	1,532.88	1,560,477,541	0.49

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	0.70
		石油・ガス・消耗燃料	6.23
		化学	2.53
		建設資材	0.34
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.42
		紙製品・林産品	0.08
		航空宇宙・防衛	2.05
		建設関連製品	0.27
		建設・土木	0.32
		電気設備	0.73
		コングロマリット	2.08
		機械	1.35
		商社・流通業	0.29
		商業サービス・用品	0.45
		航空貨物・物流サービス	0.56
		旅客航空輸送業	0.12
		海運業	0.06
		陸運・鉄道	0.84
		運送インフラ	0.22
		自動車部品	0.52
		自動車	0.94
		家庭用耐久財	0.45
レジャー用品	0.08		
繊維・アパレル・贅沢品	1.17		
ホテル・レストラン・レジャー	1.79		
メディア	2.74		
販売	0.09		

インターネット販売・カタログ販売	1.43
複合小売り	0.49
専門小売り	1.93
食品・生活必需品小売り	2.08
飲料	2.42
食品	2.41
タバコ	1.63
家庭用品	1.55
パーソナル用品	0.70
ヘルスケア機器・用品	1.83
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.96
バイオテクノロジー	2.51
医薬品	6.68
銀行	7.81
各種金融サービス	1.51
保険	3.82
不動産管理・開発	0.65
インターネットソフトウェア・サービス	2.83
情報技術サービス	2.62
ソフトウェア	3.30
通信機器	0.83
コンピュータ・周辺機器	2.36
電子装置・機器・部品	0.38
半導体・半導体製造装置	2.31
各種電気通信サービス	2.85
無線通信サービス	0.39
電力	1.96
ガス	0.21
総合公益事業	1.20
水道	0.10
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02
消費者金融	0.49
資本市場	1.71
各種消費者サービス	0.01
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06
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	0.47
専門サービス	0.43
投資信託受益証券	0.00
投資証券	2.83
合 計	97.89

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	8,200,000,000	101.32	8,308,896,000	101.48	8,321,606,000	0.1	2020/9/20	1.22
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	8,100,000,000	101.27	8,203,194,000	101.41	8,214,291,000	0.1	2020/6/20	1.21
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	8,100,000,000	101.17	8,195,013,000	101.11	8,190,315,000	0.2	2018/12/20	1.20
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	7,800,000,000	101.15	7,890,402,000	101.22	7,895,784,000	0.1	2019/12/20	1.16
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	7,500,000,000	102.03	7,652,257,000	102.89	7,717,125,000	0.1	2026/3/20	1.13
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	7,200,000,000	103.67	7,464,702,000	104.83	7,547,832,000	0.3	2025/12/20	1.11
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	101.21	7,388,841,000	101.31	7,396,287,000	0.1	2020/3/20	1.09
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	7,300,000,000	101.05	7,376,796,000	100.99	7,372,854,000	0.2	2018/9/20	1.08
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 3回	7,000,000,000	101.16	7,081,620,000	101.05	7,074,130,000	0.3	2018/6/20	1.04
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	6,000,000,000	104.57	6,274,560,000	105.73	6,343,800,000	0.4	2025/9/20	0.93
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	5,900,000,000	104.55	6,168,509,000	105.71	6,237,008,000	0.4	2025/6/20	0.91
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	101.58	6,095,240,000	101.66	6,099,780,000	0.1	2021/3/20	0.89
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	5,900,000,000	101.28	5,975,579,000	101.23	5,972,629,000	0.2	2019/3/20	0.88
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,500,000,000	105.49	5,802,280,000	105.94	5,826,920,000	0.6	2023/3/20	0.85
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	105.89	5,718,096,000	106.63	5,758,236,000	0.6	2023/12/20	0.84
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	107.08	5,675,293,000	107.57	5,701,634,000	0.8	2023/6/20	0.84
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	5,500,000,000	101.38	5,575,960,000	101.57	5,586,515,000	0.1	2020/12/20	0.82
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	101.44	5,579,585,000	101.45	5,579,915,000	0.2	2019/9/20	0.82
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	5,000,000,000	105.99	5,299,500,000	106.81	5,340,950,000	0.6	2024/3/20	0.78
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	106.60	5,277,145,500	106.40	5,266,948,500	1.2	2020/12/20	0.77

21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,900,000,000	106.47	5,217,373,000	106.67	5,227,026,000	0.8	2022/9/20	0.77
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	4,900,000,000	104.56	5,123,783,000	105.64	5,176,360,000	0.4	2025/3/20	0.76
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 8回	5,000,000,000	101.37	5,068,700,000	101.35	5,067,500,000	0.2	2019/6/20	0.74
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	4,700,000,000	105.34	4,951,215,000	106.27	4,994,737,000	0.5	2024/9/20	0.73
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 9回	4,700,000,000	101.06	4,750,146,000	101.06	4,749,820,000	0.1	2019/6/20	0.70
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	4,100,000,000	106.10	4,350,182,000	106.96	4,385,483,000	0.6	2024/6/20	0.64
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (40年)第1 回	2,660,000,000	153.41	4,080,706,000	163.74	4,355,510,600	2.4	2048/3/20	0.64
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	4,100,000,000	105.64	4,331,609,000	105.30	4,317,587,000	1.3	2019/12/20	0.63
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	4,200,000,000	102.29	4,296,598,000	101.78	4,274,760,000	0.1	2021/6/20	0.63
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第36 0回	4,200,000,000	100.55	4,223,268,000	100.52	4,222,050,000	0.1	2018/1/15	0.62

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.25
地方債証券	7.36
特殊債券	8.51
社債券	4.36
合計	99.49

(参考)外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	43,200,000	14,466.41	6,249,492,728	14,655.50	6,331,180,274	6	2026/2/15	0.99
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,800,000	11,451.93	5,932,103,193	11,433.99	5,922,806,820	3.625	2020/2/15	0.93
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	11,112.57	5,845,212,025	11,136.63	5,857,871,243	2.625	2020/11/15	0.92
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	11,306.72	5,574,216,965	11,292.04	5,566,977,465	3.375	2019/11/15	0.87
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,700,000	11,431.78	5,452,963,770	11,426.64	5,450,510,707	3.5	2020/5/15	0.85
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,600,000	11,008.55	5,460,245,734	10,932.69	5,422,614,988	4.25	2017/11/15	0.85
7	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	26,900,000	19,700.33	5,299,390,397	20,102.98	5,407,702,513	6.5	2027/7/4	0.85
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	11,614.39	5,319,391,846	11,627.73	5,325,503,606	3.625	2021/2/15	0.83
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,500,000	11,096.25	4,715,908,817	11,116.24	4,724,403,306	2.625	2020/8/15	0.74
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,200,000	10,604.05	4,474,912,575	10,732.41	4,529,080,450	1.75	2023/5/15	0.71

11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,500,000	15,167.62	4,474,448,730	15,337.84	4,524,663,390	4.25	2023/10/25	0.71
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,000,000	10,953.08	4,490,765,597	10,891.90	4,465,680,217	3.5	2018/2/15	0.70
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	23,100,000	18,292.05	4,225,464,428	19,207.50	4,436,932,704	5.5	2029/4/25	0.69
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,400,000	11,304.03	4,114,667,478	12,170.63	4,430,112,846	3	2044/11/15	0.69
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,500,000	15,020.37	4,130,603,461	15,380.63	4,229,675,972	3.5	2026/4/25	0.66
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	33,900,000	12,472.66	4,228,233,336	12,364.77	4,191,659,060	4.5	2018/2/1	0.65
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,000,000	11,355.67	4,201,599,750	11,319.37	4,188,167,767	3.625	2019/8/15	0.65
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,400,000	11,404.62	4,151,282,362	11,438.88	4,163,753,836	3.125	2021/5/15	0.65
19	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,500,000	13,269.80	4,047,289,505	13,286.04	4,052,242,588	4	2020/4/30	0.63
20	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	21,550,000	16,481.59	3,551,783,765	18,779.72	4,047,029,983	3.25	2044/1/22	0.63
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,400,000	11,212.32	3,969,162,997	11,158.66	3,950,166,948	3.75	2018/11/15	0.62
22	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,000,000	17,381.09	3,476,218,045	19,720.42	3,944,085,340	3.5	2045/1/22	0.62
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	13,347.25	3,897,397,129	13,291.63	3,881,158,794	4.25	2020/3/1	0.61
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	30,600,000	11,592.64	3,547,350,001	12,459.42	3,812,584,592	3.125	2044/8/15	0.60
25	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,700,000	12,477.28	3,830,525,081	12,378.36	3,800,158,734	4.5	2018/1/31	0.59
26	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000	19,979.35	3,516,366,843	21,223.43	3,735,324,092	5.75	2032/10/25	0.58
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	10,932.57	3,717,074,243	10,953.49	3,724,187,981	2.125	2021/6/30	0.58
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	10,825.41	3,648,165,416	10,904.13	3,674,695,162	2	2022/2/15	0.57
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	10,617.80	3,663,141,161	10,593.32	3,654,697,645	1.875	2017/9/30	0.57
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	23,700,000	15,034.29	3,563,128,762	15,363.60	3,641,175,101	6.125	2027/11/15	0.57

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.89
合計	98.89

【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 - B P I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(2016年09月限)	買建	128	日本円	1,645,894,808	1,700,480,000	0.59

(参考)外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2016 年09月限)	買建	406	米ドル	42,514,625	4,439,377,141	43,944,425	4,588,676,853	1.44
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2016年09 月限)	買建	20	カナダ ドル	3,273,080	259,915,285	3,380,400	268,437,563	0.08
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指数 先物(2016年09月 限)	買建	240	ユーロ	6,874,180	795,136,406	7,128,000	824,495,760	0.25
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2016年09月限)	買建	59	英ポンド	3,699,500	508,792,236	3,943,560	542,357,801	0.17
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取 引所	SMI株価指数先物 (2016年09月限)	買建	29	スイス フラン	2,284,480	243,594,100	2,345,810	250,133,715	0.07

(参考)国内債券NOMURA - B P I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28年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間	(2015年 6月29日)	13	13	1.0406	1.0411
第2計算期間	(2016年 6月28日)	267	267	0.8664	0.8664
	2015年 7月末日	16		1.0539	
	8月末日	18		0.9966	
	9月末日	18		0.9460	
	10月末日	32		1.0166	
	11月末日	39		1.0256	
	12月末日	194		1.0100	
	2016年 1月末日	192		0.9577	
	2月末日	182		0.9055	
	3月末日	246		0.9409	
	4月末日	253		0.9361	
	5月末日	277		0.9525	
	6月末日	286		0.8856	
	7月末日	314		0.9233	

【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
第2計算期間	2015年 6月30日～2016年 6月28日	0.0000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%
第2計算期間	2015年 6月30日～2016年 6月28日	16.7%

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
第2計算期間	2015年 6月30日～2016年 6月28日	306,751,364	10,372,772	309,335,166

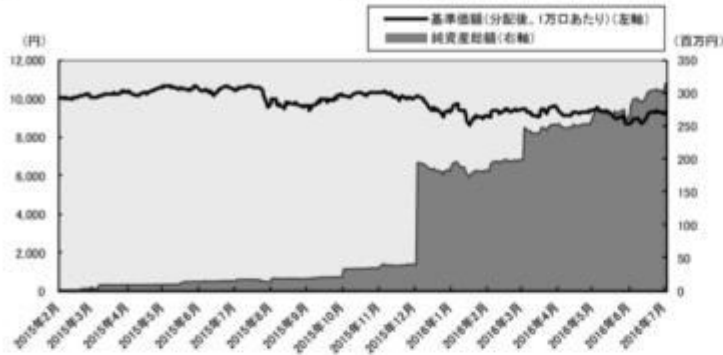
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

運用実績 (2016年7月29日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次・設定来)



分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2016年6月	0 円
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	45.1
2	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	25.3
3	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	19.8
4	外国債券マザーファンド	9.7

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1.7
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.9
3	日本電信電話	情報・通信業	0.8
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.7
5	KDDI	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	0.5
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	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.3
5	AMAZON.COM INC	インターネット販売・カタログ販売	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

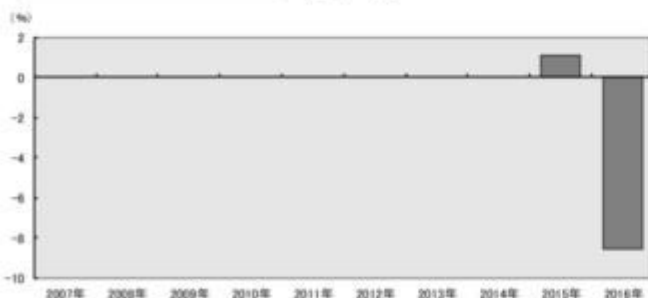
順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付(5年)第125回	国債証券	0.2
2	国庫債券 利付(5年)第124回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付(5年)第116回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付(5年)第122回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付(10年)第342回	国債証券	0.2

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	US TREASURY BOND	国債証券	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
4	US TREASURY 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)から年末までの収益率。
- ・2016年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)とします。
- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 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号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、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きが完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・ 換金価額は、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 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） 価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。

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、
- () 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て)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2期計算期間(平成27年6月30日から平成28年6月28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)	第2期 (平成28年 6月28日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,078	1,040,050
親投資信託受益証券	13,475,639	267,383,860
未収入金	33,548	-
流動資産合計	13,532,265	268,423,910
資産合計	13,532,265	268,423,910
負債の部		
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	47,451
未払委託者報酬	8,706	379,535
未払利息	-	1
その他未払費用	100	3,503
流動負債合計	49,442	430,490
負債合計	49,442	430,490
純資産の部		
元本等		
元本	12,956,574	309,335,166
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	526,249	41,341,746
（分配準備積立金）	235,052	2,491,362
元本等合計	13,482,823	267,993,420
純資産合計	13,482,823	267,993,420
負債純資産合計	13,532,265	268,423,910

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日	自	平成27年 6月30日 至 平成28年 6月28日
営業収益				
受取利息		4		3
有価証券売買等損益		253,811		34,768,847
営業収益合計		253,815		34,768,844
営業費用				
支払利息		-		45
受託者報酬		1,100		52,475
委託者報酬		8,706		419,646
その他費用		100		3,817
営業費用合計		9,906		475,983
営業利益又は営業損失（ ）		243,909		35,244,827
経常利益又は経常損失（ ）		243,909		35,244,827
当期純利益又は当期純損失（ ）		243,909		35,244,827
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		361,031
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		526,249
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		6,984,199
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		48,598
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		6,935,601
分配金		6,478		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		526,249		41,341,746

(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 6月30日から平成28年 6月28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	第2期 平成28年 6月28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	1. 計算期間の末日における受益権の総数 309,335,166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)	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 41,341,746円 3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.8664円 (10,000口当たり純資産額) (8,664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	第2期 自 平成27年 6月30日 至 平成28年 6月28日																																																
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>35,853円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>205,677円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>291,197円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>532,727円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>12,956,574口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>411円</td> </tr> </tbody> </table>	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	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,303,288円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>6,381,799円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>188,074円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>8,873,161円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>309,335,166口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>286円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,303,288円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	6,381,799円	分配準備積立金額	D	188,074円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,873,161円	当ファンドの期末残存口数	F	309,335,166口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	286円
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																																															
項目																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	2,303,288円																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																															
収益調整金額	C	6,381,799円																																															
分配準備積立金額	D	188,074円																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,873,161円																																															
当ファンドの期末残存口数	F	309,335,166口																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	286円																																															

10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	6,478円

10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

2. 追加情報

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

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第1期 自 平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日	第2期 自 平成27年 6月30日 至 平成28年 6月28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>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成27年 6月29日現在	第2期 平成28年 6月28日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日	第2期 自 平成27年 6月30日 至 平成28年 6月28日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第1期 自 平成27年 2月27日 至 平成27年 6月29日	第2期 自 平成27年 6月30日 至 平成28年 6月28日
期首元本額 - 円	期首元本額 12,956,574円
期中追加設定元本額 13,077,212円	期中追加設定元本額 306,751,364円
期中一部解約元本額 120,638円	期中一部解約元本額 10,372,772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	第2期 自 平成27年 6月30日 至 平成28年 6月28日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	244,866	34,372,862
合計	244,866	34,372,862

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28年 6月28日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 6月28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		117,565,411	
		外国債券マザーファンド		27,152,479	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド		63,000,259	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド		59,665,711	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.8%		267,383,860 100.0%	
合計			267,383,860		

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 6月28日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	31,625,258,944
株式	254,722,770,560
未収配当金	1,368,954,524
未収利息	2,124,536
その他未収収益	6,259,902
差入委託証拠金	896,217,059
流動資産合計	288,621,585,525
資産合計	288,621,585,525
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	295,697,293
未払金	3,322,938,036
未払解約金	189,898,912
未払利息	49,777
有価証券貸借取引受入金	25,702,807,681
流動負債合計	29,511,391,699
負債合計	29,511,391,699
純資産の部	
元本等	
元本	226,666,850,290
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	32,443,343,536
元本等合計	259,110,193,826
純資産合計	259,110,193,826
負債純資産合計	288,621,585,525

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2.費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

（貸借対照表に関する注記）

平成28年 6月28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	1.1431円
(10,000口当たり純資産額)	(11,431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	24,856,022,660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 6月30日 至 平成28年 6月28日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6月28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>

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 6月28日現在	
期首	平成27年 6月30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	181,561,219,970円
同期中における追加設定元本額	72,492,026,290円
同期中における一部解約元本額	27,386,395,970円
期末元本額	226,666,850,290円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	204,332,752円
バランスセレクト50	471,903,307円
バランスセレクト70	540,920,438円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,498,548,265円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	5,138,802,933円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	9,096,967,562円
野村資産設計ファンド2015	96,718,877円
野村資産設計ファンド2020	105,365,474円
野村資産設計ファンド2025	135,252,387円
野村資産設計ファンド2030	124,644,750円
野村資産設計ファンド2035	91,550,040円
野村資産設計ファンド2040	305,247,988円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	78,806,838,539円
のむらップ・ファンド（保守型）	1,914,646,265円
のむらップ・ファンド（普通型）	4,188,255,798円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,301,974,140円
野村資産設計ファンド2045	29,757,590円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,683,762,426円
マイ・ロード	3,254,517,145円
ネクストコア	41,988,073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	334,080,032円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,374,922,431円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	461,466,559円
野村資産設計ファンド2050	18,742,155円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	8,019,551円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,070,012円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	684,582円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	693,984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）	885,298,578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)	684,470,220円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	4,417,561,481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)	1,208,593,737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)	13,069,307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)	40,334,824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)	15,860,385円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,402,428,796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)	494,043,998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)	3,242,504,719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)	1,340,550,849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)	2,410,251,884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)	475,226,172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)	77,043,489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)	414,577,775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)	6,341,819,287円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	954,060,091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)	600,801,941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)	618,091,002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)	44,589,696円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	9,913,337円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	38,220,855円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	37,955,133円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	100,282,778円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,313,985,820円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,776,462,075円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	17,199,979,988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)	32,119,001,116円
マイバランスDC30	2,398,607,313円
マイバランスDC50	3,120,492,615円
マイバランスDC70	2,798,284,772円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,671,878,609円
野村DC運用戦略ファンド	62,281,838円
野村DC運用戦略ファンドM	314,962円
野村DC運用戦略ファンドA	629,090円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	102,847,880円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,210,578円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,649,245円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 6月28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	67,000	262.00	17,554,000	貸付有価証券 6,000株
		日本水産	181,400	529.00	95,960,600	
		マルハニチロ	32,200	2,911.00	93,734,200	貸付有価証券 100株
		サカタのタネ	23,200	2,245.00	52,084,000	
		ホクト	16,000	1,921.00	30,736,000	
		ホクリヨウ	1,700	807.00	1,371,900	貸付有価証券 600株（500株）
		住石ホールディングス	46,200	81.00	3,742,200	貸付有価証券 14,200株（12,600株）
		日鉄鉱業	44,000	325.00	14,300,000	
		三井松島産業	103,000	95.00	9,785,000	
		国際石油開発帝石	829,200	762.10	631,933,320	貸付有価証券 5,100株
		日本海洋掘削	4,700	2,142.00	10,067,400	貸付有価証券 2,200株（300株）
		石油資源開発	24,900	1,970.00	49,053,000	
		K & Oエナジーグループ	10,600	1,269.00	13,451,400	
		ショーボンドホールディングス	16,500	4,765.00	78,622,500	貸付有価証券 7,700株
		ミライト・ホールディングス	48,400	985.00	47,674,000	
		タマホーム	11,800	407.00	4,802,600	貸付有価証券 4,900株（1,300株）
		サンヨーホームズ	3,300	476.00	1,570,800	貸付有価証券 200株
		ダイセキ環境ソリューション	3,700	1,050.00	3,885,000	貸付有価証券 1,500株
		安藤・間	105,000	549.00	57,645,000	
		東急建設	51,200	907.00	46,438,400	貸付有価証券 23,700株
コムシスホールディングス	67,700	1,618.00	109,538,600	貸付有価証券 400株		
ミサワホーム	18,600	682.00	12,685,200	貸付有価証券 1,700株		
ピーアールホールディングス	6,200	405.00	2,511,000	貸付有価証券 100株		

高松コンストラクション グループ	11,900	2,390.00	28,441,000	
東建コーポレーション	6,500	8,080.00	52,520,000	
ソネック	1,700	586.00	996,200	
ヤマウラ	7,400	515.00	3,811,000	
大成建設	817,000	819.00	669,123,000	
大林組	472,100	1,059.00	499,953,900	
清水建設	482,000	935.00	450,670,000	貸付有価証券 33,000株
飛鳥建設	126,300	167.00	21,092,100	貸付有価証券 58,600株（1,400株）
長谷工コーポレーション	183,700	970.00	178,189,000	貸付有価証券 85,000株
松井建設	17,300	1,104.00	19,099,200	
銭高組	22,000	301.00	6,622,000	貸付有価証券 4,000株
鹿島建設	738,000	692.00	510,696,000	
不動テトラ	111,200	149.00	16,568,800	貸付有価証券 49,500株
大末建設	6,000	944.00	5,664,000	
鉄建建設	96,000	286.00	27,456,000	貸付有価証券 44,000株（1,000株）
西松建設	182,000	463.00	84,266,000	貸付有価証券 75,000株
三井住友建設	603,100	85.00	51,263,500	貸付有価証券 65,300株
大豊建設	61,000	434.00	26,474,000	貸付有価証券 14,000株
前田建設工業	97,000	776.00	75,272,000	
佐田建設	10,800	342.00	3,693,600	貸付有価証券 200株
ナカノフドー建設	12,000	413.00	4,956,000	
奥村組	149,000	547.00	81,503,000	
東鉄工業	18,900	2,805.00	53,014,500	貸付有価証券 900株
イチケン	17,000	259.00	4,403,000	貸付有価証券 3,000株
浅沼組	51,000	203.00	10,353,000	貸付有価証券 23,000株
戸田建設	183,000	434.00	79,422,000	

熊谷組	231,000	280.00	64,680,000	
青木あすなろ建設	10,300	680.00	7,004,000	
北野建設	33,000	250.00	8,250,000	
植木組	19,000	199.00	3,781,000	
三井ホーム	20,000	421.00	8,420,000	
矢作建設工業	21,400	818.00	17,505,200	貸付有価証券 6,800株（700株）
ピーエス三菱	18,600	361.00	6,714,600	貸付有価証券 6,500株（1,100株）
日本ハウスホールディングス	32,100	309.00	9,918,900	貸付有価証券 5,200株
大東建託	57,900	16,560.00	958,824,000	貸付有価証券 200株
新日本建設	18,700	666.00	12,454,200	
N I P P O	36,000	1,708.00	61,488,000	
東亜道路工業	30,000	260.00	7,800,000	
前田道路	49,000	1,728.00	84,672,000	
日本道路	47,000	384.00	18,048,000	
東亜建設工業	137,000	148.00	20,276,000	貸付有価証券 15,000株（4,000株）
若築建設	90,000	137.00	12,330,000	貸付有価証券 41,000株（2,000株）
東洋建設	49,400	437.00	21,587,800	貸付有価証券 500株
五洋建設	174,700	532.00	92,940,400	貸付有価証券 5,100株
大林道路	18,400	627.00	11,536,800	
世紀東急工業	24,700	486.00	12,004,200	
福田組	25,000	1,045.00	26,125,000	
住友林業	108,300	1,405.00	152,161,500	
日本基礎技術	17,500	342.00	5,985,000	
日成ビルド工業	43,000	531.00	22,833,000	貸付有価証券 20,000株
ヤマダ・エスバイエルホーム	80,000	68.00	5,440,000	貸付有価証券 25,000株
巴コーポレーション	19,600	323.00	6,330,800	貸付有価証券 100株
パナホーム	59,000	800.00	47,200,000	
大和ハウス工業	465,000	2,902.00	1,349,430,000	

ライト工業	30,300	1,069.00	32,390,700	貸付有価証券 13,900株
積水ハウス	526,200	1,764.00	928,216,800	貸付有価証券 5,100株
日特建設	17,200	391.00	6,725,200	
北陸電気工事	7,600	716.00	5,441,600	
ユアテック	25,000	700.00	17,500,000	
西部電気工業	13,000	393.00	5,109,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
四電工	12,000	384.00	4,608,000	
中電工	22,700	1,988.00	45,127,600	貸付有価証券 10,000株
関電工	63,000	839.00	52,857,000	
きんでん	95,200	1,085.00	103,292,000	
東京エネシス	18,000	1,010.00	18,180,000	
トーエネック	22,000	518.00	11,396,000	
住友電設	12,400	1,099.00	13,627,600	
日本電設工業	25,600	1,674.00	42,854,400	
協和エクシオ	61,700	1,270.00	78,359,000	
新日本空調	13,200	981.00	12,949,200	貸付有価証券 800株
N D S	25,000	253.00	6,325,000	
九電工	28,800	3,125.00	90,000,000	貸付有価証券 13,400株(11,000株)
三機工業	34,900	816.00	28,478,400	貸付有価証券 1,900株
日揮	158,000	1,396.00	220,568,000	貸付有価証券 19,000株
中外炉工業	48,000	208.00	9,984,000	貸付有価証券 6,000株
ヤマト	14,100	540.00	7,614,000	
太平電業	23,000	1,035.00	23,805,000	貸付有価証券 5,000株
高砂熱学工業	46,900	1,200.00	56,280,000	貸付有価証券 13,100株
三晃金属工業	16,000	281.00	4,496,000	
朝日工業社	18,000	485.00	8,730,000	
明星工業	28,500	449.00	12,796,500	
大気社	19,300	2,528.00	48,790,400	貸付有価証券

				900株
ダイダン	21,000	761.00	15,981,000	
日比谷総合設備	18,900	1,524.00	28,803,600	貸付有価証券 400株
東芝プラントシステム	25,600	1,565.00	40,064,000	貸付有価証券 11,800株(4,400株)
OSJBホールディングス	32,100	187.00	6,002,700	貸付有価証券 14,800株
東洋エンジニアリング	84,000	335.00	28,140,000	貸付有価証券 24,000株
千代田化工建設	114,000	665.00	75,810,000	貸付有価証券 4,000株
新興プランテック	32,300	779.00	25,161,700	
日本製粉	101,000	784.00	79,184,000	
日清製粉グループ本社	172,600	1,667.00	287,724,200	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
日東富士製粉	12,000	339.00	4,068,000	
昭和産業	65,000	442.00	28,730,000	貸付有価証券 8,000株
鳥越製粉	12,500	636.00	7,950,000	
中部飼料	14,600	726.00	10,599,600	
フィード・ワン	94,700	116.00	10,985,200	
東洋精糖	24,000	99.00	2,376,000	
日本甜菜製糖	80,000	176.00	14,080,000	
三井製糖	62,000	508.00	31,496,000	
塩水港精糖	16,800	210.00	3,528,000	貸付有価証券 400株
日新製糖	6,700	1,346.00	9,018,200	
森永製菓	142,000	651.00	92,442,000	
中村屋	36,000	454.00	16,344,000	
江崎グリコ	36,300	6,020.00	218,526,000	
名糖産業	7,000	1,274.00	8,918,000	
不二家	90,000	195.00	17,550,000	
山崎製パン	115,000	2,908.00	334,420,000	貸付有価証券 53,000株
第一屋製パン	24,000	107.00	2,568,000	
モロゾフ	24,000	429.00	10,296,000	貸付有価証券 11,000株
亀田製菓	8,800	5,970.00	52,536,000	

寿スピリッツ	11,200	3,110.00	34,832,000	貸付有価証券 5,100株
カルビー	58,300	4,370.00	254,771,000	貸付有価証券 27,000株（8,700株）
森永乳業	141,000	734.00	103,494,000	貸付有価証券 65,000株
六甲バター	7,000	2,353.00	16,471,000	貸付有価証券 2,900株
ヤクルト本社	84,400	5,310.00	448,164,000	貸付有価証券 35,000株（17,100株）
明治ホールディングス	93,200	10,420.00	971,144,000	
雪印メグミルク	37,000	3,645.00	134,865,000	貸付有価証券 1,000株
プリマハム	99,000	314.00	31,086,000	
日本ハム	116,000	2,483.00	288,028,000	貸付有価証券 16,000株（1,000株）
林兼産業	51,000	84.00	4,284,000	貸付有価証券 6,000株
丸大食品	81,000	481.00	38,961,000	
S Foods	9,900	2,773.00	27,452,700	貸付有価証券 4,400株（3,300株）
伊藤ハム米久ホールディングス	94,000	994.00	93,436,000	貸付有価証券 15,900株
サッポロホールディングス	48,100	2,931.00	140,981,100	貸付有価証券 4,000株
アサヒグループホールディングス	295,300	3,284.00	969,765,200	
キリンホールディングス	637,900	1,714.00	1,093,360,600	
宝ホールディングス	113,900	929.00	105,813,100	
オエノンホールディングス	43,000	199.00	8,557,000	
養命酒製造	4,900	1,745.00	8,550,500	
コカ・コーラウエスト	53,300	2,869.00	152,917,700	貸付有価証券 700株
コカ・コーライースト ジャパン	55,700	1,922.00	107,055,400	
サントリー食品インター ナショナル	107,800	4,465.00	481,327,000	
ダイドードリンコ	7,900	5,500.00	43,450,000	貸付有価証券 100株（100株）
伊藤園	46,700	3,955.00	184,698,500	貸付有価証券

				5,500株(1,600株)
キーコーヒー	13,900	1,879.00	26,118,100	貸付有価証券 100株
ユニカフェ	4,200	863.00	3,624,600	
ジャパンフーズ	2,000	1,174.00	2,348,000	貸付有価証券 900株
日清オイリオグループ	83,000	477.00	39,591,000	
不二製油グループ本社	42,000	1,935.00	81,270,000	
かどや製油	1,500	2,824.00	4,236,000	貸付有価証券 300株
J - オイルミルズ	66,000	342.00	22,572,000	
キッコーマン	119,000	3,750.00	446,250,000	
味の素	331,000	2,478.50	820,383,500	貸付有価証券 23,800株
キューピー	80,100	3,420.00	273,942,000	
ハウス食品グループ本社	53,800	2,395.00	128,851,000	貸付有価証券 22,200株
カゴメ	56,500	2,716.00	153,454,000	貸付有価証券 26,200株(14,300株)
焼津水産化学工業	7,400	979.00	7,244,600	
アリアケジャパン	12,900	6,400.00	82,560,000	
ピエトロ	1,600	1,619.00	2,590,400	貸付有価証券 600株(300株)
エバラ食品工業	3,800	1,894.00	7,197,200	
ニチレイ	168,000	950.00	159,600,000	
東洋水産	77,400	4,205.00	325,467,000	貸付有価証券 17,400株
イトアンド	1,700	2,044.00	3,474,800	貸付有価証券 600株
日清食品ホールディングス	66,600	5,560.00	370,296,000	貸付有価証券 31,300株
永谷園ホールディングス	15,000	1,255.00	18,825,000	
一正蒲鉾	5,500	988.00	5,434,000	貸付有価証券 2,500株
フジッコ	15,300	2,930.00	44,829,000	貸付有価証券 400株
ロック・フィールド	16,400	1,576.00	25,846,400	
日本たばこ産業	930,500	4,147.00	3,858,783,500	
ケンコーマヨネーズ	5,100	2,958.00	15,085,800	
わらべや日洋	8,500	1,923.00	16,345,500	

なとり	7,900	1,534.00	12,118,600	
北の達人コーポレーション	2,900	466.00	1,351,400	
ユーグレナ	50,400	1,406.00	70,862,400	貸付有価証券 23,400株(1,500株)
ミヨシ油脂	54,000	117.00	6,318,000	貸付有価証券 1,000株
理研ビタミン	4,600	4,750.00	21,850,000	貸付有価証券 2,100株
片倉工業	18,400	1,136.00	20,902,400	
グンゼ	119,000	286.00	34,034,000	貸付有価証券 1,000株
東洋紡	583,000	193.00	112,519,000	貸付有価証券 269,000株
ユニチカ	428,000	55.00	23,540,000	貸付有価証券 133,000株
富士紡ホールディングス	72,000	251.00	18,072,000	
倉敷紡績	151,000	180.00	27,180,000	
シキボウ	90,000	102.00	9,180,000	
日本毛織	45,300	704.00	31,891,200	貸付有価証券 21,000株
大東紡織	21,000	62.00	1,302,000	
トーア紡コーポレーション	6,200	454.00	2,814,800	貸付有価証券 1,600株
ダイドーリミテッド	16,400	430.00	7,052,000	貸付有価証券 200株
帝国繊維	15,400	1,258.00	19,373,200	
帝人	601,000	350.00	210,350,000	貸付有価証券 56,000株(56,000株)
東レ	1,067,000	873.90	932,451,300	貸付有価証券 341,000株
サカイオーベックス	39,000	143.00	5,577,000	
住江織物	37,000	194.00	7,178,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
日本フェルト	7,800	458.00	3,572,400	
イチカワ	10,000	255.00	2,550,000	
日東製網	16,000	140.00	2,240,000	貸付有価証券 4,000株
芦森工業	32,000	155.00	4,960,000	貸付有価証券 14,000株
アツギ	113,000	106.00	11,978,000	

ダイニック	28,000	147.00	4,116,000	
セーレン	36,700	955.00	35,048,500	
東海染工	20,000	113.00	2,260,000	
小松精練	22,600	597.00	13,492,200	貸付有価証券 8,200株
ワコールホールディングス	88,000	991.00	87,208,000	貸付有価証券 2,000株
ホギメディカル	9,300	7,380.00	68,634,000	貸付有価証券 2,500株（2,400株）
レナウン	39,800	100.00	3,980,000	貸付有価証券 18,400株（7,000株）
クラウドシア	3,400	489.00	1,662,600	貸付有価証券 1,400株
T S Iホールディングス	65,700	548.00	36,003,600	貸付有価証券 200株
三陽商会	83,000	182.00	15,106,000	貸付有価証券 38,000株
ナイガイ	54,000	40.00	2,160,000	貸付有価証券 23,000株
オンワードホールディングス	95,000	615.00	58,425,000	貸付有価証券 43,000株
ルック	27,000	125.00	3,375,000	貸付有価証券 5,000株
キムラタン	620,000	7.00	4,340,000	貸付有価証券 63,000株
ゴールドウイン	6,200	4,365.00	27,063,000	貸付有価証券 2,900株（900株）
デサント	33,600	1,073.00	36,052,800	貸付有価証券 700株
キング	7,300	345.00	2,518,500	
ヤマトインターナショナル	9,100	379.00	3,448,900	貸付有価証券 2,800株
特種東海製紙	85,000	345.00	29,325,000	
王子ホールディングス	604,000	383.00	231,332,000	
日本製紙	76,100	1,831.00	139,339,100	貸付有価証券 35,200株
三菱製紙	224,000	70.00	15,680,000	
北越紀州製紙	91,300	688.00	62,814,400	貸付有価証券 9,600株（800株）
中越パルプ工業	58,000	203.00	11,774,000	貸付有価証券 25,000株（18,000株）

巴川製紙所	23,000	167.00	3,841,000	
大王製紙	65,100	1,124.00	73,172,400	貸付有価証券 28,800株（8,000株）
レンゴー	130,000	646.00	83,980,000	
トーモク	46,000	281.00	12,926,000	
ザ・パック	10,400	2,701.00	28,090,400	貸付有価証券 4,800株
クラレ	232,200	1,216.00	282,355,200	
旭化成	918,000	696.80	639,662,400	貸付有価証券 422,000株（12,000 株）
共和レザー	9,600	747.00	7,171,200	
昭和電工	98,000	921.00	90,258,000	貸付有価証券 30,400株
住友化学	1,083,000	413.00	447,279,000	
日本化成	28,000	101.00	2,828,000	
住友精化	30,000	551.00	16,530,000	貸付有価証券 13,000株
日産化学工業	88,500	2,937.00	259,924,500	
ラサ工業	55,000	95.00	5,225,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
クレハ	111,000	354.00	39,294,000	
多木化学	9,000	631.00	5,679,000	
テイカ	25,000	500.00	12,500,000	
石原産業	264,000	62.00	16,368,000	
片倉コープアグリ	18,000	195.00	3,510,000	
日東エフシー	8,600	812.00	6,983,200	貸付有価証券 600株
日本曹達	95,000	410.00	38,950,000	
東ソー	397,000	458.00	181,826,000	
トクヤマ	244,000	272.00	66,368,000	貸付有価証券 62,000株
セントラル硝子	159,000	442.00	70,278,000	
東亜合成	92,100	923.00	85,008,300	
大阪ソーダ	63,000	411.00	25,893,000	貸付有価証券 24,000株
関東電化工業	35,000	855.00	29,925,000	貸付有価証券 16,000株
デンカ	305,000	403.00	122,915,000	

信越化学工業	263,900	5,825.00	1,537,217,500	貸付有価証券 32,900株
日本カーバイド工業	50,000	133.00	6,650,000	貸付有価証券 23,000株
堺化学工業	60,000	273.00	16,380,000	
エア・ウォーター	121,000	1,473.00	178,233,000	
大陽日酸	113,300	955.00	108,201,500	貸付有価証券 52,400株
日本化学工業	54,000	197.00	10,638,000	
日本パーカライジング	75,200	1,045.00	78,584,000	
高圧ガス工業	22,000	593.00	13,046,000	
チタン工業	17,000	164.00	2,788,000	
四国化成工業	21,000	799.00	16,779,000	
戸田工業	29,000	271.00	7,859,000	貸付有価証券 13,000株
ステラ ケミファ	7,500	3,080.00	23,100,000	
保土谷化学工業	44,000	281.00	12,364,000	貸付有価証券 2,000株
日本触媒	21,400	5,910.00	126,474,000	貸付有価証券 700株
大日精化工業	57,000	403.00	22,971,000	
カネカ	198,000	671.00	132,858,000	
三菱瓦斯化学	253,000	520.00	131,560,000	
三井化学	624,000	352.00	219,648,000	
J S R	138,100	1,326.00	183,120,600	貸付有価証券 7,300株
東京応化工業	29,500	2,555.00	75,372,500	
大阪有機化学工業	10,500	535.00	5,617,500	
三菱ケミカルホールディングス	985,500	449.40	442,883,700	
日本合成化学工業	34,000	521.00	17,714,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
ダイセル	206,900	1,012.00	209,382,800	
住友ベークライト	130,000	484.00	62,920,000	
積水化学工業	334,000	1,250.00	417,500,000	
日本ゼオン	124,000	656.00	81,344,000	
アイカ工業	44,200	2,332.00	103,074,400	貸付有価証券 400株
宇部興産	787,000	168.00	132,216,000	

積水樹脂	22,700	1,460.00	33,142,000	
タキロン	34,000	450.00	15,300,000	
旭有機材	48,000	188.00	9,024,000	
日立化成	72,700	1,869.00	135,876,300	
ニチバン	14,000	783.00	10,962,000	
リケンテクノス	31,700	418.00	13,250,600	貸付有価証券 14,600株（500株）
大倉工業	35,000	275.00	9,625,000	貸付有価証券 16,000株
積水化成成品工業	38,000	309.00	11,742,000	
群栄化学工業	39,000	268.00	10,452,000	
タイガースポリマー	7,200	535.00	3,852,000	
ミライアル	5,300	712.00	3,773,600	
ダイキアクシス	2,700	812.00	2,192,400	
ダイキョーニシカワ	18,900	1,255.00	23,719,500	貸付有価証券 8,800株
日本化薬	96,000	1,014.00	97,344,000	
カーリットホールディングス	13,600	451.00	6,133,600	
日本精化	12,200	712.00	8,686,400	
扶桑化学工業	9,300	1,384.00	12,871,200	貸付有価証券 600株
A D E K A	72,300	1,242.00	89,796,600	
日油	110,000	808.00	88,880,000	
新日本理化	23,200	135.00	3,132,000	貸付有価証券 7,300株（6,800株）
ハリマ化成グループ	12,500	490.00	6,125,000	
花王	395,700	6,065.00	2,399,920,500	
第一工業製薬	33,000	307.00	10,131,000	貸付有価証券 9,000株
ニイタカ	2,100	1,259.00	2,643,900	
三洋化成工業	46,000	778.00	35,788,000	
大日本塗料	84,000	189.00	15,876,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
日本ペイントホールディングス	113,500	2,378.00	269,903,000	貸付有価証券 11,900株
関西ペイント	166,500	2,007.00	334,165,500	貸付有価証券 67,100株
神東塗料	11,000	159.00	1,749,000	

中国塗料	42,000	610.00	25,620,000	貸付有価証券 1,000株
日本特殊塗料	10,300	1,064.00	10,959,200	
藤倉化成	20,000	554.00	11,080,000	
太陽ホールディングス	10,800	3,095.00	33,426,000	
D I C	58,100	2,058.00	119,569,800	
サカタインクス	30,000	1,170.00	35,100,000	貸付有価証券 400株
東洋インキ S C ホール ディングス	145,000	421.00	61,045,000	
T & K T O K A	10,600	717.00	7,600,200	
富士フイルムホールディ ングス	336,700	3,928.00	1,322,557,600	貸付有価証券 57,700株
資生堂	279,200	2,558.50	714,333,200	貸付有価証券 2,300株
ライオン	170,000	1,682.00	285,940,000	
高砂香料工業	9,700	2,653.00	25,734,100	
マンダム	13,700	4,715.00	64,595,500	
ミルボン	8,700	4,580.00	39,846,000	貸付有価証券 200株
ファンケル	34,100	1,402.00	47,808,200	貸付有価証券 8,000株
コーセー	23,800	8,130.00	193,494,000	貸付有価証券 200株
コタ	5,000	1,102.00	5,510,000	
シーズ・ホールディング ス	18,500	2,227.00	41,199,500	
シーボン	1,700	2,072.00	3,522,400	貸付有価証券 700株
ポーラ・オルビスホール ディングス	15,000	9,150.00	137,250,000	
ノエビアホールディング ス	9,300	3,045.00	28,318,500	
アジュバンコスメジャパ ン	2,800	889.00	2,489,200	
エステー	10,000	1,084.00	10,840,000	
アグロ カネショウ	5,700	998.00	5,688,600	貸付有価証券 300株
コニシ	23,100	1,351.00	31,208,100	
長谷川香料	18,600	1,845.00	34,317,000	貸付有価証券

				100株
星光PMC	8,000	980.00	7,840,000	貸付有価証券 3,700株(200株)
小林製薬	44,500	4,615.00	205,367,500	貸付有価証券 2,200株
荒川化学工業	12,500	941.00	11,762,500	
メック	11,400	919.00	10,476,600	貸付有価証券 600株
日本高純度化学	4,100	1,987.00	8,146,700	貸付有価証券 1,900株
タカラバイオ	31,500	1,293.00	40,729,500	
JCU	4,300	3,155.00	13,566,500	貸付有価証券 100株
新田ゼラチン	9,600	741.00	7,113,600	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
OATアグリオ	1,700	1,182.00	2,009,400	貸付有価証券 700株
デクセリアルズ	44,000	702.00	30,888,000	貸付有価証券 12,600株(100株)
アース製薬	10,600	4,975.00	52,735,000	貸付有価証券 4,800株(2,900株)
イハラケミカル工業	22,600	965.00	21,809,000	貸付有価証券 3,100株
北興化学工業	16,000	279.00	4,464,000	
大成ラミック	4,100	2,785.00	11,418,500	
クミアイ化学工業	30,400	609.00	18,513,600	貸付有価証券 12,900株(10,600株)
日本農薬	33,600	440.00	14,784,000	貸付有価証券 15,600株(500株)
アキレス	120,000	125.00	15,000,000	
有沢製作所	21,700	501.00	10,871,700	
日東電工	113,700	6,151.00	699,368,700	貸付有価証券 22,100株
レック	4,600	1,685.00	7,751,000	
きもと	23,900	147.00	3,513,300	
藤森工業	12,600	1,959.00	24,683,400	貸付有価証券 100株
前澤化成工業	10,300	992.00	10,217,600	
JSP	9,600	2,043.00	19,612,800	
エフピコ	13,000	4,890.00	63,570,000	貸付有価証券

				100株
天馬	11,300	1,451.00	16,396,300	貸付有価証券 300株
信越ポリマー	28,800	591.00	17,020,800	
東リ	38,000	277.00	10,526,000	
ニフコ	28,100	5,260.00	147,806,000	貸付有価証券 100株
日本バルカー工業	57,000	259.00	14,763,000	
ユニ・チャーム	297,900	2,231.00	664,614,900	貸付有価証券 40,000株(32,100株)
協和発酵キリン	176,000	1,703.00	299,728,000	貸付有価証券 6,500株
武田薬品工業	586,000	4,343.00	2,544,998,000	貸付有価証券 116,600株
アステラス製薬	1,647,500	1,610.00	2,652,475,000	貸付有価証券 5,600株
大日本住友製薬	104,100	1,744.00	181,550,400	貸付有価証券 46,600株
塩野義製薬	214,400	5,555.00	1,190,992,000	貸付有価証券 16,900株(900株)
田辺三菱製薬	171,400	1,813.00	310,748,200	貸付有価証券 1,500株
わかもと製薬	17,000	233.00	3,961,000	
あすか製薬	18,700	1,737.00	32,481,900	貸付有価証券 4,700株
日本新薬	33,700	5,220.00	175,914,000	貸付有価証券 100株
ピオフェルミン製薬	2,400	2,684.00	6,441,600	
中外製薬	146,500	3,610.00	528,865,000	
科研製薬	25,400	6,610.00	167,894,000	貸付有価証券 1,100株
エーザイ	181,100	5,762.00	1,043,498,200	貸付有価証券 200株
ロート製薬	72,000	1,560.00	112,320,000	
小野薬品工業	334,100	4,381.00	1,463,692,100	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
久光製薬	45,700	5,800.00	265,060,000	貸付有価証券 2,300株(1,800株)
有機合成薬品工業	10,000	217.00	2,170,000	
持田製薬	10,100	8,230.00	83,123,000	
参天製薬	271,000	1,593.00	431,703,000	

扶桑薬品工業	49,000	269.00	13,181,000	貸付有価証券 1,000株
日本ケミファ	20,000	461.00	9,220,000	
ツムラ	46,300	2,823.00	130,704,900	貸付有価証券 21,400株
日医工	34,400	2,073.00	71,311,200	
キッセイ薬品工業	26,100	2,033.00	53,061,300	
生化学工業	28,100	1,561.00	43,864,100	貸付有価証券 1,800株
栄研化学	12,300	2,303.00	28,326,900	貸付有価証券 1,000株
日水製薬	5,900	1,126.00	6,643,400	
鳥居薬品	10,000	2,291.00	22,910,000	
J C R ファーマ	11,300	3,020.00	34,126,000	貸付有価証券 100株
東和薬品	6,700	5,500.00	36,850,000	貸付有価証券 3,100株（300株）
富士製薬工業	4,800	2,260.00	10,848,000	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	25,000	7,740.00	193,500,000	
ゼリア新薬工業	30,100	1,481.00	44,578,100	貸付有価証券 1,600株
第一三共	494,800	2,465.50	1,219,929,400	貸付有価証券 10,700株
キョーリン製薬ホールディングス	39,200	2,040.00	79,968,000	
大幸薬品	7,200	1,526.00	10,987,200	貸付有価証券 3,300株
ダイト	8,200	2,723.00	22,328,600	
大塚ホールディングス	316,300	4,711.00	1,490,089,300	
大正製薬ホールディングス	35,400	10,810.00	382,674,000	
ペプチドリーム	24,500	5,840.00	143,080,000	貸付有価証券 11,400株
日本コークス工業	118,700	60.00	7,122,000	
昭和シェル石油	147,900	954.00	141,096,600	貸付有価証券 2,800株
ニチレキ	18,000	636.00	11,448,000	
東燃ゼネラル石油	222,000	905.00	200,910,000	
ユシロ化学工業	7,900	1,300.00	10,270,000	

ビーピー・カストロール	6,000	1,187.00	7,122,000	貸付有価証券 2,700株
富士石油	34,100	338.00	11,525,800	
MORESCO	4,600	1,071.00	4,926,600	貸付有価証券 200株
出光興産	76,800	2,302.00	176,793,600	貸付有価証券 35,600株
JXホールディングス	1,741,600	381.60	664,594,560	貸付有価証券 67,000株
コスモエネルギーホールディングス	44,400	1,222.00	54,256,800	
横浜ゴム	88,700	1,228.00	108,923,600	貸付有価証券 5,300株
東洋ゴム工業	66,600	1,007.00	67,066,200	
ブリヂストン	496,500	3,204.00	1,590,786,000	
住友ゴム工業	137,700	1,340.00	184,518,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
藤倉ゴム工業	12,300	387.00	4,760,100	
オカモト	46,000	1,082.00	49,772,000	
フコク	5,400	714.00	3,855,600	貸付有価証券 100株
ニッタ	15,800	2,329.00	36,798,200	
住友理工	31,800	805.00	25,599,000	
三ツ星ベルト	36,000	763.00	27,468,000	
バンドー化学	54,000	500.00	27,000,000	
日東紡績	97,000	329.00	31,913,000	
旭硝子	776,000	536.00	415,936,000	貸付有価証券 30,000株(30,000株)
日本板硝子	709,000	62.00	43,958,000	貸付有価証券 333,000株
石塚硝子	21,000	148.00	3,108,000	
日本山村硝子	58,000	153.00	8,874,000	
日本電気硝子	304,000	416.00	126,464,000	
オハラ	5,600	488.00	2,732,800	貸付有価証券 2,500株(800株)
住友大阪セメント	291,000	437.00	127,167,000	
太平洋セメント	918,000	230.00	211,140,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
デイ・シイ	13,600	315.00	4,284,000	貸付有価証券 100株

日本ヒューム	14,100	531.00	7,487,100	
日本コンクリート工業	30,200	278.00	8,395,600	貸付有価証券 500株
三谷セキサン	7,400	2,022.00	14,962,800	
アジアパイルホールディングス	18,100	358.00	6,479,800	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	128,000	251.00	32,128,000	
日本カーボン	72,000	189.00	13,608,000	貸付有価証券 33,000株（7,000株）
東洋炭素	8,100	1,277.00	10,343,700	貸付有価証券 1,300株
ノリタケカンパニーリミテド	83,000	229.00	19,007,000	貸付有価証券 18,000株
TOTO	108,100	3,995.00	431,859,500	貸付有価証券 14,300株
日本碍子	186,000	1,935.00	359,910,000	
日本特殊陶業	126,800	1,502.00	190,453,600	貸付有価証券 56,000株
ダントーホールディングス	17,000	189.00	3,213,000	貸付有価証券 8,000株（4,000株）
MARUWA	5,400	2,965.00	16,011,000	
品川リフラクトリーズ	37,000	192.00	7,104,000	
黒崎播磨	32,000	234.00	7,488,000	
ヨータイ	8,000	271.00	2,168,000	貸付有価証券 1,000株
イソライト工業	7,200	191.00	1,375,200	
東京窯業	17,900	150.00	2,685,000	
ニッカトー	5,200	351.00	1,825,200	
フジインコーポレーテッド	13,000	1,492.00	19,396,000	貸付有価証券 6,100株
エーアンドエーマテリアル	31,000	80.00	2,480,000	
ニチアス	75,000	777.00	58,275,000	貸付有価証券 11,000株
ニチハ	19,500	1,556.00	30,342,000	
新日鐵住金	663,200	1,861.00	1,234,215,200	
神戸製鋼所	2,702,000	82.00	221,564,000	貸付有価証券 690,000株（507,000株）
中山製鋼所	165,000	50.00	8,250,000	貸付有価証券

				11,000株
合同製鐵	82,000	143.00	11,726,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	402,000	1,242.00	499,284,000	貸付有価証券 34,600株
日新製鋼	67,100	1,307.00	87,699,700	貸付有価証券 2,100株
東京製鐵	81,200	556.00	45,147,200	
共英製鋼	15,700	1,506.00	23,644,200	貸付有価証券 1,800株
大和工業	32,500	2,288.00	74,360,000	貸付有価証券 2,100株
東京鐵鋼	31,000	384.00	11,904,000	
大阪製鐵	9,200	1,718.00	15,805,600	
淀川製鋼所	21,900	2,495.00	54,640,500	貸付有価証券 200株
東洋鋼鈹	35,200	243.00	8,553,600	
丸一鋼管	49,200	3,560.00	175,152,000	貸付有価証券 1,400株
モリ工業	23,000	280.00	6,440,000	
大同特殊鋼	246,000	338.00	83,148,000	
日本高周波鋼業	58,000	65.00	3,770,000	貸付有価証券 26,000株
日本冶金工業	108,200	116.00	12,551,200	貸付有価証券 50,200株
山陽特殊製鋼	87,000	449.00	39,063,000	貸付有価証券 22,000株
愛知製鋼	87,000	434.00	37,758,000	貸付有価証券 1,000株
日立金属	168,400	997.00	167,894,800	貸付有価証券 13,700株(13,700株)
日本金属	38,000	89.00	3,382,000	貸付有価証券 4,000株
大平洋金属	102,000	273.00	27,846,000	貸付有価証券 42,000株(7,000株)
新日本電工	83,200	154.00	12,812,800	貸付有価証券 14,300株
栗本鐵工所	70,000	157.00	10,990,000	貸付有価証券 6,000株
虹技	21,000	140.00	2,940,000	
日本鑄鉄管	16,000	125.00	2,000,000	
三菱製鋼	102,000	149.00	15,198,000	貸付有価証券

				1,000株
日亜鋼業	20,300	208.00	4,222,400	
日本精線	10,000	404.00	4,040,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	13,200	549.00	7,246,800	
新家工業	29,000	123.00	3,567,000	
大紀アルミニウム工業所	23,000	282.00	6,486,000	
日本軽金属ホールディング グス	332,900	220.00	73,238,000	貸付有価証券 154,200株
三井金属鉱業	375,000	168.00	63,000,000	
東邦亜鉛	77,000	290.00	22,330,000	貸付有価証券 29,000株
三菱マテリアル	918,000	236.00	216,648,000	
住友金属鉱山	406,000	998.60	405,431,600	
DOWAホールディング グス	189,000	513.00	96,957,000	貸付有価証券 43,000株
古河機械金属	229,000	138.00	31,602,000	貸付有価証券 1,000株
大阪チタニウムテクノ ロジーズ	14,400	1,190.00	17,136,000	貸付有価証券 6,700株
東邦チタニウム	24,900	637.00	15,861,300	貸付有価証券 11,100株
UACJ	205,000	246.00	50,430,000	貸付有価証券 38,000株(1,000株)
古河電気工業	462,000	234.00	108,108,000	
住友電気工業	588,700	1,322.00	778,261,400	
フジクラ	205,000	454.00	93,070,000	
昭和電線ホールディング グス	175,000	54.00	9,450,000	貸付有価証券 82,000株
東京特殊電線	2,100	713.00	1,497,300	
タツタ電線	30,600	289.00	8,843,400	
沖電線	17,000	162.00	2,754,000	貸付有価証券 5,000株(1,000株)
カナレ電気	2,300	1,827.00	4,202,100	貸付有価証券 1,000株
平河ヒューテック	6,900	828.00	5,713,200	
リョービ	90,000	433.00	38,970,000	
アーレスティ	17,000	694.00	11,798,000	
アサヒホールディングス	22,100	1,485.00	32,818,500	
稲葉製作所	7,800	1,305.00	10,179,000	

				貸付有価証券 3,600株
宮地エンジニアリンググループ	45,000	124.00	5,580,000	貸付有価証券 21,000株
トーカロ	10,300	1,631.00	16,799,300	貸付有価証券 800株(800株)
アルファC o	4,900	912.00	4,468,800	
SUMCO	115,100	627.00	72,167,700	貸付有価証券 54,100株
川田テクノロジーズ	2,800	3,275.00	9,170,000	貸付有価証券 1,200株
東洋製罐グループホールディングス	104,500	1,927.00	201,371,500	
ホッカンホールディングス	38,000	290.00	11,020,000	
コロナ	7,700	1,014.00	7,807,800	
横河ブリッジホールディングス	27,800	997.00	27,716,600	貸付有価証券 6,900株
駒井ハルテック	26,000	192.00	4,992,000	
高田機工	13,000	177.00	2,301,000	
三和ホールディングス	145,900	899.00	131,164,100	
文化シャッター	40,900	822.00	33,619,800	貸付有価証券 500株
三協立山	19,300	1,435.00	27,695,500	貸付有価証券 1,500株
アルインコ	11,000	949.00	10,439,000	貸付有価証券 1,800株
東洋シャッター	3,600	533.00	1,918,800	
LIXILグループ	204,800	1,751.00	358,604,800	貸付有価証券 3,800株
日本フィルコン	10,600	408.00	4,324,800	貸付有価証券 300株(300株)
ノーリツ	28,800	1,818.00	52,358,400	貸付有価証券 600株
長府製作所	15,700	2,471.00	38,794,700	貸付有価証券 3,400株
リンナイ	27,300	8,990.00	245,427,000	
ダイニチ工業	7,500	608.00	4,560,000	
日東精工	21,000	276.00	5,796,000	
三洋工業	18,000	162.00	2,916,000	
岡部	30,500	733.00	22,356,500	貸付有価証券

				14,100株
ジーテクト	15,300	1,218.00	18,635,400	
中国工業	2,200	630.00	1,386,000	貸付有価証券 900株
東プレ	28,300	2,133.00	60,363,900	貸付有価証券 13,100株(11,800株)
高周波熱錬	27,300	704.00	19,219,200	貸付有価証券 500株
東京製綱	99,000	145.00	14,355,000	貸付有価証券 4,000株
サンコール	7,800	446.00	3,478,800	
モリテック スチール	7,400	238.00	1,761,200	
パイオラックス	7,400	4,650.00	34,410,000	貸付有価証券 100株
日本発條	138,400	800.00	110,720,000	
中央発條	19,000	268.00	5,092,000	
アドバネクス	2,700	1,131.00	3,053,700	
立川ブラインド工業	6,100	712.00	4,343,200	貸付有価証券 2,800株
三益半導体工業	10,800	925.00	9,990,000	
日本ドライケミカル	1,900	2,052.00	3,898,800	貸付有価証券 200株
日本製鋼所	243,000	459.00	111,537,000	
三浦工業	65,600	2,285.00	149,896,000	
タクマ	54,000	879.00	47,466,000	
ツガミ	42,000	390.00	16,380,000	貸付有価証券 19,000株
オークマ	96,000	659.00	63,264,000	貸付有価証券 15,000株(4,000株)
東芝機械	80,000	312.00	24,960,000	貸付有価証券 2,000株
アマダホールディングス	214,400	1,026.00	219,974,400	
アイダエンジニアリング	38,500	818.00	31,493,000	
滝澤鉄工所	46,000	119.00	5,474,000	
富士機械製造	48,000	927.00	44,496,000	貸付有価証券 20,300株(5,400株)
牧野フライス製作所	73,000	512.00	37,376,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
オーエスジー	67,000	1,653.00	110,751,000	貸付有価証券 31,300株(28,200株)

ダイジェット工業	17,000	118.00	2,006,000	
旭ダイヤモンド工業	39,600	762.00	30,175,200	貸付有価証券 2,100株
D M G 森精機	81,200	926.00	75,191,200	
ソディック	37,300	775.00	28,907,500	貸付有価証券 3,000株(2,800株)
ディスコ	18,700	9,270.00	173,349,000	貸付有価証券 3,900株
日東工器	8,600	2,133.00	18,343,800	
パンチ工業	5,800	755.00	4,379,000	
豊和工業	8,200	508.00	4,165,600	貸付有価証券 800株
O K K	57,000	95.00	5,415,000	
東洋機械金属	10,800	345.00	3,726,000	
津田駒工業	36,000	100.00	3,600,000	貸付有価証券 11,000株
エンシュウ	36,000	56.00	2,016,000	貸付有価証券 3,000株
島精機製作所	20,800	1,952.00	40,601,600	貸付有価証券 1,200株
N C ホールディングス	4,800	827.00	3,969,600	貸付有価証券 800株(800株)
フリーー	2,900	2,555.00	7,409,500	
ヤマシンフィルタ	2,800	424.00	1,187,200	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
日阪製作所	18,600	787.00	14,638,200	
やまびこ	26,900	729.00	19,610,100	貸付有価証券 500株
ペガサスマシン製造	15,200	436.00	6,627,200	貸付有価証券 500株(400株)
ナプテスコ	76,400	2,435.00	186,034,000	貸付有価証券 3,900株(3,900株)
三井海洋開発	17,200	1,532.00	26,350,400	貸付有価証券 5,400株(400株)
レオン自動機	12,400	538.00	6,671,200	貸付有価証券 700株
S M C	44,100	24,530.00	1,081,773,000	貸付有価証券 4,100株
新川	13,100	442.00	5,790,200	貸付有価証券 1,000株(200株)
ホソカワミクロン	24,000	513.00	12,312,000	

ユニオンツール	6,300	2,768.00	17,438,400	貸付有価証券 2,900株
オイレス工業	19,000	1,614.00	30,666,000	
日精エー・エス・ビー機 械	4,700	1,747.00	8,210,900	貸付有価証券 2,100株（100株）
サトーホールディングス	19,800	1,832.00	36,273,600	
日本エアータック	5,100	610.00	3,111,000	貸付有価証券 500株
日精樹脂工業	10,700	613.00	6,559,100	貸付有価証券 400株
オカダアイヨン	2,800	718.00	2,010,400	
ワイエイシイ	5,900	1,068.00	6,301,200	貸付有価証券 2,700株
小松製作所	720,700	1,717.50	1,237,802,250	
住友重機械工業	429,000	445.00	190,905,000	
日立建機	65,700	1,434.00	94,213,800	貸付有価証券 6,000株
日工	22,000	295.00	6,490,000	
巴工業	6,000	1,430.00	8,580,000	
井関農機	150,000	217.00	32,550,000	貸付有価証券 70,000株（17,000株）
TOWA	14,200	833.00	11,828,600	
丸山製作所	31,000	157.00	4,867,000	
北川鉄工所	67,000	168.00	11,256,000	
タカキタ	4,900	497.00	2,435,300	貸付有価証券 200株
クボタ	705,900	1,312.50	926,493,750	
荏原実業	4,400	1,204.00	5,297,600	
三菱化工機	48,000	176.00	8,448,000	貸付有価証券 16,000株
月島機械	27,900	937.00	26,142,300	貸付有価証券 8,800株（8,800株）
帝国電機製作所	10,700	753.00	8,057,100	
東京機械製作所	55,000	35.00	1,925,000	貸付有価証券 23,000株
新東工業	33,300	765.00	25,474,500	貸付有価証券 300株
澁谷工業	12,300	1,596.00	19,630,800	貸付有価証券 500株（500株）
アイチ コーポレーショ	20,800	704.00	14,643,200	

ン				
小森コーポレーション	35,700	1,109.00	39,591,300	貸付有価証券 3,300株
鶴見製作所	10,900	1,215.00	13,243,500	
住友精密工業	23,000	291.00	6,693,000	
酒井重工業	28,000	164.00	4,592,000	
荏原製作所	325,000	540.00	175,500,000	
石井鐵工所	21,000	142.00	2,982,000	
西島製作所	15,600	1,002.00	15,631,200	貸付有価証券 6,300株（1,300株）
北越工業	15,800	565.00	8,927,000	
ダイキン工業	204,600	8,112.00	1,659,715,200	貸付有価証券 15,800株
オルガノ	25,000	379.00	9,475,000	
トーヨーカネツ	79,000	193.00	15,247,000	
栗田工業	88,400	2,242.00	198,192,800	
椿本チエイン	83,000	616.00	51,128,000	
大同工業	29,000	186.00	5,394,000	
木村化工機	12,600	288.00	3,628,800	
アネスト岩田	23,700	862.00	20,429,400	
ダイフク	75,500	1,712.00	129,256,000	貸付有価証券 400株
サムコ	3,500	814.00	2,849,000	貸付有価証券 500株
加藤製作所	33,000	390.00	12,870,000	貸付有価証券 15,000株
油研工業	28,000	161.00	4,508,000	
タダノ	67,800	828.00	56,138,400	
フジテック	40,900	856.00	35,010,400	貸付有価証券 14,700株（13,100株）
C K D	39,100	768.00	30,028,800	
キトー	17,700	774.00	13,699,800	貸付有価証券 5,000株
平和	43,500	2,002.00	87,087,000	
理想科学工業	15,500	1,374.00	21,297,000	貸付有価証券 100株
SANKYO	39,100	3,760.00	147,016,000	
日本金銭機械	12,900	776.00	10,010,400	貸付有価証券 6,000株（1,200株）

マースエンジニアリング	7,900	2,024.00	15,989,600	
福島工業	8,700	2,929.00	25,482,300	
オーイズミ	5,900	384.00	2,265,600	貸付有価証券 2,700株
ダイコク電機	5,800	1,413.00	8,195,400	貸付有価証券 2,600株
竹内製作所	27,800	1,261.00	35,055,800	貸付有価証券 5,200株（1,300株）
アマノ	43,500	1,767.00	76,864,500	
J U K I	20,800	896.00	18,636,800	貸付有価証券 8,700株
サンデンホールディングス	86,000	269.00	23,134,000	貸付有価証券 39,000株（23,000株）
蛇の目ミシン工業	13,600	558.00	7,588,800	貸付有価証券 1,300株
マックス	22,000	1,142.00	25,124,000	
グローリー	47,900	2,685.00	128,611,500	
新晃工業	9,800	1,166.00	11,426,800	
大和冷機工業	22,600	855.00	19,323,000	
セガサミーホールディングス	151,000	1,101.00	166,251,000	貸付有価証券 2,600株
日本ピストンリング	5,800	1,372.00	7,957,600	
リケン	65,000	308.00	20,020,000	
T P R	17,300	1,932.00	33,423,600	貸付有価証券 2,000株
ツバキ・ナカシマ	17,400	1,129.00	19,644,600	貸付有価証券 8,000株
ホシザキ電機	30,800	9,780.00	301,224,000	貸付有価証券 400株
大豊工業	11,300	1,037.00	11,718,100	
日本精工	288,500	721.00	208,008,500	貸付有価証券 5,100株
N T N	348,000	266.00	92,568,000	貸付有価証券 16,000株（16,000株）
ジェイテクト	149,700	1,106.00	165,568,200	
不二越	130,000	303.00	39,390,000	貸付有価証券 53,000株
日本トムソン	48,100	312.00	15,007,200	貸付有価証券 1,500株
T H K	93,400	1,719.00	160,554,600	貸付有価証券

				43,500株
ユーシン精機	5,400	1,788.00	9,655,200	貸付有価証券 2,500株(700株)
前澤給装工業	5,700	1,319.00	7,518,300	
イーグル工業	17,400	1,145.00	19,923,000	
前澤工業	10,300	244.00	2,513,200	
日本ピラー工業	14,200	894.00	12,694,800	
キッツ	62,600	484.00	30,298,400	貸付有価証券 21,900株
日立工機	37,600	596.00	22,409,600	貸付有価証券 8,000株
マキタ	91,600	6,590.00	603,644,000	貸付有価証券 16,100株
日立造船	111,400	491.00	54,697,400	
三菱重工業	2,502,000	378.30	946,506,600	
I H I	1,080,000	253.00	273,240,000	貸付有価証券 497,000株(8,000株)
日清紡ホールディングス	78,000	908.00	70,824,000	
イビデン	86,000	1,094.00	94,084,000	貸付有価証券 36,300株(30,700株)
コニカミノルタ	350,800	725.00	254,330,000	
ブラザー工業	181,600	1,061.00	192,677,600	貸付有価証券 84,300株
ミネベア	226,300	650.00	147,095,000	
日立製作所	3,584,000	410.50	1,471,232,000	
東芝	2,957,000	259.90	768,524,300	貸付有価証券 1,374,000株(12,000株)
三菱電機	1,499,000	1,177.00	1,764,323,000	貸付有価証券 71,000株
富士電機	423,000	402.00	170,046,000	
東洋電機製造	28,000	266.00	7,448,000	
安川電機	174,500	1,292.00	225,454,000	貸付有価証券 77,300株
シンフォニアテクノロジー	91,000	167.00	15,197,000	貸付有価証券 42,000株(42,000株)
明電舎	129,000	324.00	41,796,000	
オリジン電気	20,000	253.00	5,060,000	
山洋電気	37,000	461.00	17,057,000	
デンヨー	13,000	1,042.00	13,546,000	

東芝テック	101,000	355.00	35,855,000	貸付有価証券 10,000株
芝浦メカトロニクス	23,000	187.00	4,301,000	貸付有価証券 7,000株
マブチモーター	39,700	4,125.00	163,762,500	
日本電産	169,100	7,604.00	1,285,836,400	貸付有価証券 77,100株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	1,600	2,119.00	3,390,400	
東光高岳	7,800	1,678.00	13,088,400	貸付有価証券 3,600株
ダブル・スコープ	12,100	2,757.00	33,359,700	貸付有価証券 5,400株
ダイヘン	83,000	434.00	36,022,000	貸付有価証券 18,000株
田淵電機	15,900	336.00	5,342,400	貸付有価証券 7,400株
ヤーマン	1,800	1,840.00	3,312,000	貸付有価証券 700株
JVCケンウッド	103,100	210.00	21,651,000	貸付有価証券 47,800株（200株）
ミマキエンジニアリング	12,600	439.00	5,531,400	貸付有価証券 3,400株
第一精工	5,800	955.00	5,539,000	貸付有価証券 2,600株（400株）
日新電機	32,900	1,550.00	50,995,000	
大崎電気工業	26,000	739.00	19,214,000	貸付有価証券 10,000株
オムロン	158,700	3,275.00	519,742,500	貸付有価証券 56,000株（3,200株）
日東工業	22,500	1,222.00	27,495,000	
I D E C	18,300	900.00	16,470,000	貸付有価証券 100株
不二電機工業	1,300	1,380.00	1,794,000	貸付有価証券 200株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	271,000	374.00	101,354,000	貸付有価証券 1,000株
サクサホールディングス	35,000	181.00	6,335,000	貸付有価証券 12,000株（12,000株）
メルコホールディングス	7,800	2,097.00	16,356,600	貸付有価証券 3,200株（3,200株）
テクノメディカ	3,200	1,512.00	4,838,400	

日本電気	1,931,000	227.00	438,337,000	貸付有価証券 382,000株
富士通	1,354,000	355.00	480,670,000	
沖電気工業	609,000	133.00	80,997,000	貸付有価証券 38,000株(9,000株)
岩崎通信機	66,000	60.00	3,960,000	貸付有価証券 8,000株
電気興業	37,000	437.00	16,169,000	貸付有価証券 17,000株
サンケン電気	77,000	304.00	23,408,000	貸付有価証券 35,000株
ナカヨ	14,000	299.00	4,186,000	
アイホン	7,900	1,711.00	13,516,900	
ルネサスエレクトロニクス	72,700	571.00	41,511,700	貸付有価証券 500株
セイコーエプソン	209,200	1,621.00	339,113,200	貸付有価証券 85,800株
ワコム	110,600	383.00	42,359,800	貸付有価証券 51,300株
アルバック	25,800	2,978.00	76,832,400	
アクセル	6,300	685.00	4,315,500	貸付有価証券 800株
E I Z O	13,900	2,710.00	37,669,000	
ジャパンディスプレイ	262,300	161.00	42,230,300	貸付有価証券 102,200株(59,600株)
日本信号	38,800	766.00	29,720,800	
京三製作所	33,000	350.00	11,550,000	
能美防災	15,900	1,368.00	21,751,200	
ホーチキ	10,200	1,145.00	11,679,000	
エレコム	12,200	2,057.00	25,095,400	
日本無線	41,000	249.00	10,209,000	
パナソニック	1,605,000	853.20	1,369,386,000	貸付有価証券 90,600株
シャープ	1,187,000	102.00	121,074,000	貸付有価証券 218,000株
アンリツ	84,300	581.00	48,978,300	貸付有価証券 39,100株(11,800株)
富士通ゼネラル	43,000	2,173.00	93,439,000	
日立国際電気	32,100	1,719.00	55,179,900	貸付有価証券

				14,800株
ソニー	991,300	2,825.50	2,800,918,150	貸付有価証券 13,400株(5,700株)
T D K	84,800	5,540.00	469,792,000	貸付有価証券 15,800株
帝国通信工業	33,000	138.00	4,554,000	
ミツミ電機	53,400	391.00	20,879,400	貸付有価証券 16,400株(9,000株)
タムラ製作所	54,000	283.00	15,282,000	
アルプス電気	121,000	1,876.00	226,996,000	
池上通信機	44,000	112.00	4,928,000	貸付有価証券 17,000株
パイオニア	227,300	172.00	39,095,600	貸付有価証券 105,500株(300株)
日本電波工業	12,700	817.00	10,375,900	
鈴木	5,400	506.00	2,732,400	貸付有価証券 2,400株
日本トリム	3,800	7,090.00	26,942,000	
ローランド ディー ジー	6,900	1,817.00	12,537,300	
フォスター電機	17,600	1,580.00	27,808,000	
クラリオン	74,000	236.00	17,464,000	貸付有価証券 6,000株
S M K	41,000	330.00	13,530,000	
ヨコオ	10,000	453.00	4,530,000	
ティアック	101,000	31.00	3,131,000	貸付有価証券 47,000株
ホシデン	42,600	625.00	26,625,000	
ヒロセ電機	22,700	12,480.00	283,296,000	貸付有価証券 600株(500株)
日本航空電子工業	40,000	1,378.00	55,120,000	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
T O A	16,600	908.00	15,072,800	貸付有価証券 4,000株
日立マクセル	23,300	1,376.00	32,060,800	
古野電気	16,700	511.00	8,533,700	
ユニデンホールディング ス	44,000	116.00	5,104,000	貸付有価証券 12,000株
アルパイン	33,500	921.00	30,853,500	貸付有価証券 3,800株

スミダコーポレーション	11,500	643.00	7,394,500	貸付有価証券 3,700株(900株)
アイコム	7,800	1,909.00	14,890,200	
リオン	5,400	1,355.00	7,317,000	
本多通信工業	3,700	719.00	2,660,300	貸付有価証券 1,700株(800株)
船井電機	14,200	890.00	12,638,000	貸付有価証券 6,600株
横河電機	140,600	1,103.00	155,081,800	貸付有価証券 15,600株(6,400株)
新電元工業	50,000	311.00	15,550,000	貸付有価証券 2,000株
アズビル	45,900	2,891.00	132,696,900	
東亜ディーケーケー	7,800	440.00	3,432,000	
日本光電工業	58,700	2,825.00	165,827,500	貸付有価証券 2,900株(2,300株)
チノー	5,000	950.00	4,750,000	
共和電業	17,100	320.00	5,472,000	
日本電子材料	5,600	388.00	2,172,800	
堀場製作所	26,000	4,460.00	115,960,000	貸付有価証券 8,300株
アドバンテスト	95,800	1,122.00	107,487,600	貸付有価証券 38,100株(9,100株)
小野測器	6,800	768.00	5,222,400	貸付有価証券 100株
エスペック	14,500	1,203.00	17,443,500	
パナソニック デバイス SUNX	12,300	606.00	7,453,800	
キーエンス	31,800	67,590.00	2,149,362,000	
日置電機	7,300	1,937.00	14,140,100	貸付有価証券 3,400株
シスメックス	109,100	7,000.00	763,700,000	貸付有価証券 100株
日本マイクロニクス	26,200	857.00	22,453,400	貸付有価証券 12,200株(5,200株)
メガチップス	14,100	1,090.00	15,369,000	貸付有価証券 6,400株(100株)
OBARA GROUP	8,200	3,775.00	30,955,000	
澤藤電機	8,000	169.00	1,352,000	貸付有価証券 1,000株
コーセル	19,500	997.00	19,441,500	貸付有価証券

				4,000株
新日本無線	10,200	357.00	3,641,400	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
オプテックス	10,400	2,653.00	27,591,200	貸付有価証券 2,500株
千代田インテグレ	7,400	1,877.00	13,889,800	
アイ・オー・データ機器	4,400	619.00	2,723,600	
レーザーテック	16,500	1,231.00	20,311,500	貸付有価証券 400株
スタンレー電気	100,400	2,158.00	216,663,200	貸付有価証券 6,800株
岩崎電気	48,000	131.00	6,288,000	貸付有価証券 3,000株
ウシオ電機	85,300	1,161.00	99,033,300	
岡谷電機産業	7,500	357.00	2,677,500	貸付有価証券 400株(100株)
ヘリオス テクノ ホールディング	11,900	330.00	3,927,000	貸付有価証券 500株
日本セラミック	8,000	1,906.00	15,248,000	貸付有価証券 2,200株(2,000株)
遠藤照明	7,100	916.00	6,503,600	貸付有価証券 500株
日本デジタル研究所	11,800	1,345.00	15,871,000	貸付有価証券 500株
古河電池	10,000	617.00	6,170,000	貸付有価証券 4,000株(3,000株)
双信電機	6,800	258.00	1,754,400	
山一電機	12,200	523.00	6,380,600	貸付有価証券 5,600株
図研	10,100	876.00	8,847,600	貸付有価証券 300株(300株)
日本電子	55,000	382.00	21,010,000	貸付有価証券 1,000株
カシオ計算機	140,800	1,393.00	196,134,400	貸付有価証券 58,300株
ファナック	143,700	15,915.00	2,286,985,500	貸付有価証券 14,400株
日本シイエムケイ	30,300	405.00	12,271,500	貸付有価証券 1,100株
エンプラス	7,200	2,614.00	18,820,800	貸付有価証券 200株(200株)
大真空	26,000	252.00	6,552,000	貸付有価証券

				8,000株
ローム	69,200	3,905.00	270,226,000	
浜松ホトニクス	109,600	2,809.00	307,866,400	貸付有価証券 51,500株
三井ハイテック	20,400	621.00	12,668,400	貸付有価証券 200株
新光電気工業	53,100	491.00	26,072,100	貸付有価証券 8,900株
京セラ	230,600	4,781.00	1,102,498,600	貸付有価証券 9,600株
太陽誘電	68,300	863.00	58,942,900	貸付有価証券 1,700株
村田製作所	148,200	10,905.00	1,616,121,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ユーシン	18,600	647.00	12,034,200	貸付有価証券 8,600株(5,200株)
双葉電子工業	23,000	1,894.00	43,562,000	貸付有価証券 900株
北陸電気工業	56,000	109.00	6,104,000	
ニチコン	44,200	655.00	28,951,000	
日本ケミコン	114,000	121.00	13,794,000	貸付有価証券 12,000株
K O A	19,400	694.00	13,463,600	貸付有価証券 900株
市光工業	34,000	258.00	8,772,000	貸付有価証券 15,000株(1,000株)
小糸製作所	84,200	4,605.00	387,741,000	
ミツバ	23,900	1,091.00	26,074,900	
スター精密	26,700	1,068.00	28,515,600	貸付有価証券 12,300株
S C R E E Nホールディングス	144,000	1,113.00	160,272,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
キャノン電子	12,900	1,434.00	18,498,600	
キャノン	756,300	2,861.00	2,163,774,300	
リコー	454,900	858.00	390,304,200	貸付有価証券 191,700株(1,200株)
M U T O Hホールディングス	17,000	216.00	3,672,000	貸付有価証券 6,000株
東京エレクトロン	115,300	8,079.00	931,508,700	貸付有価証券 13,000株
トヨタ紡織	49,100	2,034.00	99,869,400	貸付有価証券

				8,800株
鬼怒川ゴム工業	32,000	774.00	24,768,000	貸付有価証券 1,000株
ユニプレス	29,100	1,632.00	47,491,200	
豊田自動織機	127,900	3,930.00	502,647,000	
モリタホールディングス	24,600	1,318.00	32,422,800	
三櫻工業	17,800	538.00	9,576,400	
デンソー	347,100	3,448.00	1,196,800,800	
東海理化電機製作所	41,100	1,490.00	61,239,000	
三井造船	544,000	138.00	75,072,000	
川崎重工業	1,093,000	271.00	296,203,000	
名村造船所	42,100	585.00	24,628,500	貸付有価証券 200株(200株)
サノヤスホールディングス	17,100	155.00	2,650,500	貸付有価証券 100株
日本車輛製造	58,000	255.00	14,790,000	貸付有価証券 26,000株(8,000株)
ニチユ三菱フォークリフト	16,200	536.00	8,683,200	
近畿車輛	21,000	250.00	5,250,000	貸付有価証券 9,000株
日産自動車	1,960,500	909.40	1,782,878,700	貸付有価証券 35,400株
いすゞ自動車	407,100	1,204.00	490,148,400	貸付有価証券 66,100株
トヨタ自動車	1,747,200	4,975.00	8,692,320,000	貸付有価証券 622,700株(2,100株)
日野自動車	200,500	972.00	194,886,000	
三菱自動車工業	557,800	465.00	259,377,000	貸付有価証券 28,900株
エフテック	7,400	934.00	6,911,600	貸付有価証券 2,300株(1,700株)
レシップホールディングス	4,600	795.00	3,657,000	貸付有価証券 1,900株
GMB	2,300	919.00	2,113,700	
ファルテック	2,400	1,130.00	2,712,000	
武蔵精密工業	15,000	1,975.00	29,625,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日産車体	68,600	980.00	67,228,000	貸付有価証券 17,300株

新明和工業	61,000	621.00	37,881,000	貸付有価証券 3,000株
極東開発工業	28,000	889.00	24,892,000	
日信工業	31,400	1,301.00	40,851,400	貸付有価証券 9,400株
トピー工業	116,000	206.00	23,896,000	
ティラド	55,000	176.00	9,680,000	
曙ブレーキ工業	71,200	217.00	15,450,400	貸付有価証券 33,000株
タチエス	22,300	1,476.00	32,914,800	貸付有価証券 800株
N O K	68,000	1,654.00	112,472,000	貸付有価証券 14,900株（1,600株）
フタバ産業	42,800	478.00	20,458,400	貸付有価証券 13,600株
K Y B	157,000	321.00	50,397,000	貸付有価証券 23,000株
大同メタル工業	19,600	944.00	18,502,400	貸付有価証券 4,900株
プレス工業	74,600	324.00	24,170,400	
ミクニ	17,800	273.00	4,859,400	
カルソニックカンセイ	107,000	781.00	83,567,000	貸付有価証券 42,000株
太平洋工業	31,200	947.00	29,546,400	貸付有価証券 14,500株（12,000株）
ケーヒン	32,300	1,533.00	49,515,900	
河西工業	17,200	897.00	15,428,400	
アイシン精機	144,000	4,045.00	582,480,000	貸付有価証券 14,500株
富士機工	16,200	321.00	5,200,200	
マツダ	444,800	1,369.50	609,153,600	
ダイハツ工業	167,700	1,304.00	218,680,800	貸付有価証券 40,500株（26,900株）
今仙電機製作所	12,900	815.00	10,513,500	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,264,200	2,523.50	3,190,208,700	貸付有価証券 5,800株（5,800株）
スズキ	257,000	2,649.00	680,793,000	
富士重工業	443,900	3,450.00	1,531,455,000	
安永	4,700	462.00	2,171,400	貸付有価証券

				1,400株
ヤマハ発動機	198,400	1,490.00	295,616,000	
ショーワ	36,500	580.00	21,170,000	
T B K	16,700	340.00	5,678,000	
エクセディ	19,100	2,166.00	41,370,600	貸付有価証券 5,800株(2,900株)
豊田合成	51,000	1,766.00	90,066,000	貸付有価証券 4,000株(1,400株)
愛三工業	24,600	648.00	15,940,800	
盟和産業	2,300	965.00	2,219,500	
ヨロズ	13,100	1,409.00	18,457,900	
エフ・シー・シー	23,000	1,633.00	37,559,000	
シマノ	56,600	15,010.00	849,566,000	貸付有価証券 13,400株
タカタ	25,400	375.00	9,525,000	貸付有価証券 11,900株(2,600株)
テイ・エス テック	32,600	2,458.00	80,130,800	貸付有価証券 3,300株
ジャムコ	8,200	1,739.00	14,259,800	貸付有価証券 3,800株
テルモ	215,300	4,345.00	935,478,500	貸付有価証券 18,300株(300株)
クリエートメディック	4,600	800.00	3,680,000	
日機装	50,600	644.00	32,586,400	貸付有価証券 5,200株
島津製作所	181,000	1,506.00	272,586,000	
J M S	26,000	263.00	6,838,000	
クボテック	3,000	416.00	1,248,000	貸付有価証券 1,100株(1,000株)
長野計器	8,500	556.00	4,726,000	貸付有価証券 100株
ブイ・テクノロジー	3,400	12,180.00	41,412,000	貸付有価証券 1,500株
東京計器	45,000	147.00	6,615,000	
愛知時計電機	18,000	302.00	5,436,000	
オーバル	13,700	217.00	2,972,900	貸付有価証券 6,100株
東京精密	27,100	2,410.00	65,311,000	貸付有価証券 4,400株
マニー	18,700	1,725.00	32,257,500	貸付有価証券

				8,600株(200株)
ニコン	262,300	1,338.00	350,957,400	貸付有価証券 121,700株(6,600株)
トプコン	47,100	978.00	46,063,800	貸付有価証券 21,900株(100株)
オリンパス	209,300	3,675.00	769,177,500	貸付有価証券 48,100株
理研計器	11,400	1,059.00	12,072,600	
タムロン	11,300	1,350.00	15,255,000	貸付有価証券 5,300株(5,300株)
H O Y A	317,700	3,603.00	1,144,673,100	
ノーリツ銅機	12,600	712.00	8,971,200	貸付有価証券 5,900株
エー・アンド・デイ	12,700	364.00	4,622,800	
シチズンホールディングス	172,900	488.00	84,375,200	貸付有価証券 47,400株(2,500株)
リズム時計工業	61,000	167.00	10,187,000	
大研医器	11,100	777.00	8,624,700	貸付有価証券 5,100株(400株)
メニコン	9,400	2,753.00	25,878,200	貸付有価証券 700株
松風	6,900	1,234.00	8,514,600	貸付有価証券 2,200株
セイコーホールディングス	90,000	301.00	27,090,000	貸付有価証券 23,000株(10,000株)
ニプロ	104,700	1,208.00	126,477,600	貸付有価証券 800株
スノーピーク	1,500	4,180.00	6,270,000	貸付有価証券 700株(500株)
パラマウントベッドホールディングス	14,800	4,985.00	73,778,000	
トランザクション	2,800	931.00	2,606,800	
S H O - B I	4,700	398.00	1,870,600	
ニホンフラッシュ	5,500	1,130.00	6,215,000	貸付有価証券 1,600株(100株)
前田工織	14,100	929.00	13,098,900	貸付有価証券 2,500株
永大産業	20,000	391.00	7,820,000	
アートネイチャー	15,000	797.00	11,955,000	
ダンロップスポーツ	8,900	989.00	8,802,100	貸付有価証券 100株(100株)

バンダイナムコホールディングス	145,300	2,546.00	369,933,800	貸付有価証券 1,700株
アイフィスジャパン	3,100	352.00	1,091,200	
共立印刷	23,300	288.00	6,710,400	
S H O E I	6,300	1,476.00	9,298,800	
フランスベッドホールディングス	19,600	948.00	18,580,800	
パイロットコーポレーション	24,500	4,380.00	107,310,000	
萩原工業	3,900	2,492.00	9,718,800	
トッパン・フォームズ	25,100	1,030.00	25,853,000	
フジシールインターナショナル	17,100	3,505.00	59,935,500	貸付有価証券 500株
タカラトミー	46,200	822.00	37,976,400	貸付有価証券 21,400株(4,600株)
廣濟堂	13,000	299.00	3,887,000	
A s - m e エステール	3,700	564.00	2,086,800	
アーク	59,100	69.00	4,077,900	貸付有価証券 16,900株
タカノ	6,200	592.00	3,670,400	
プロネクサス	13,100	1,024.00	13,414,400	
ホクシン	11,100	107.00	1,187,700	貸付有価証券 200株
ウッドワン	26,000	221.00	5,746,000	
大建工業	55,000	310.00	17,050,000	
凸版印刷	397,000	876.00	347,772,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
大日本印刷	416,000	1,075.00	447,200,000	
図書印刷	26,000	485.00	12,610,000	貸付有価証券 6,000株
共同印刷	47,000	306.00	14,382,000	貸付有価証券 7,000株
日本写真印刷	23,600	1,920.00	45,312,000	貸付有価証券 10,900株
光村印刷	14,000	177.00	2,478,000	
宝印刷	6,800	1,305.00	8,874,000	貸付有価証券 3,100株
アシックス	130,800	1,652.00	216,081,600	貸付有価証券 57,500株(3,800株)
ツツミ	7,000	1,991.00	13,937,000	

小松ウオール工業	4,800	1,513.00	7,262,400	
ヤマハ	103,200	2,882.00	297,422,400	貸付有価証券 1,000株（100株）
河合楽器製作所	5,200	1,844.00	9,588,800	貸付有価証券 1,400株（300株）
クリナップ	16,500	711.00	11,731,500	
ビジョン	79,600	3,005.00	239,198,000	貸付有価証券 35,800株
兼松日産農林	14,000	135.00	1,890,000	
キングジム	11,700	815.00	9,535,500	貸付有価証券 1,200株
リンテック	33,400	1,929.00	64,428,600	
T A S A K I	2,600	1,301.00	3,382,600	貸付有価証券 1,200株（100株）
イトーキ	29,600	564.00	16,694,400	貸付有価証券 11,100株（11,100株）
任天堂	86,500	13,835.00	1,196,727,500	貸付有価証券 6,500株
三菱鉛筆	10,500	4,605.00	48,352,500	貸付有価証券 4,800株
タカラスタANDARD	58,000	926.00	53,708,000	
コクヨ	73,000	1,466.00	107,018,000	
ナカバヤシ	29,000	241.00	6,989,000	
グローブライド	6,800	1,659.00	11,281,200	
岡村製作所	49,000	1,018.00	49,882,000	
美津濃	75,000	480.00	36,000,000	
アデランス	24,400	498.00	12,151,200	貸付有価証券 5,700株（5,700株）
東京電力ホールディングス	1,191,600	415.00	494,514,000	貸付有価証券 546,700株
中部電力	429,800	1,433.00	615,903,400	貸付有価証券 31,200株（31,200株）
関西電力	573,300	976.80	559,999,440	貸付有価証券 258,500株
中国電力	194,200	1,275.00	247,605,000	貸付有価証券 65,500株（59,300株）
北陸電力	137,600	1,265.00	174,064,000	
東北電力	351,000	1,273.00	446,823,000	貸付有価証券 37,100株（8,500株）
四国電力	126,500	1,195.00	151,167,500	貸付有価証券

				48,300株(4,600株)
九州電力	310,300	992.00	307,817,600	貸付有価証券 71,900株(50,500株)
北海道電力	131,500	829.00	109,013,500	貸付有価証券 13,900株(13,900株)
沖縄電力	22,400	2,195.00	49,168,000	貸付有価証券 10,300株(10,200株)
電源開発	119,800	2,330.00	279,134,000	
ファーストエスコ	5,700	679.00	3,870,300	貸付有価証券 2,600株
イーレックス	4,200	1,970.00	8,274,000	貸付有価証券 1,900株(100株)
東京瓦斯	1,568,000	406.10	636,764,800	貸付有価証券 150,000株
大阪瓦斯	1,454,000	386.80	562,407,200	貸付有価証券 349,000株
東邦瓦斯	354,000	805.00	284,970,000	
北海道瓦斯	34,000	276.00	9,384,000	貸付有価証券 14,000株
広島ガス	24,500	309.00	7,570,500	貸付有価証券 4,700株(2,700株)
西部瓦斯	158,000	247.00	39,026,000	
静岡ガス	39,900	699.00	27,890,100	
メタウォーター	9,000	2,703.00	24,327,000	貸付有価証券 4,200株
SBSホールディングス	13,900	722.00	10,035,800	貸付有価証券 500株
東武鉄道	751,000	552.00	414,552,000	貸付有価証券 28,000株(28,000株)
相鉄ホールディングス	241,000	574.00	138,334,000	貸付有価証券 40,000株
東京急行電鉄	818,000	880.00	719,840,000	
京浜急行電鉄	385,000	1,012.00	389,620,000	
小田急電鉄	450,000	1,167.00	525,150,000	貸付有価証券 19,000株
京王電鉄	393,000	944.00	370,992,000	貸付有価証券 7,000株
京成電鉄	211,000	1,301.00	274,511,000	貸付有価証券 2,000株
富士急行	38,000	1,418.00	53,884,000	貸付有価証券 3,000株(3,000株)

新京成電鉄	18,000	393.00	7,074,000	
東日本旅客鉄道	256,800	9,313.00	2,391,578,400	貸付有価証券 45,400株(14,700株)
西日本旅客鉄道	135,200	6,378.00	862,305,600	
東海旅客鉄道	125,800	18,020.00	2,266,916,000	
西武ホールディングス	149,200	1,710.00	255,132,000	貸付有価証券 2,300株
鴻池運輸	19,900	1,024.00	20,377,600	
西日本鉄道	182,000	520.00	94,640,000	
ハマキョウレックス	10,800	1,813.00	19,580,400	
サカイ引越センター	5,500	2,775.00	15,262,500	貸付有価証券 1,800株
近鉄グループホールディングス	1,414,000	426.00	602,364,000	
阪急阪神ホールディングス	943,000	744.00	701,592,000	貸付有価証券 6,000株
南海電気鉄道	315,000	575.00	181,125,000	貸付有価証券 2,000株
京阪ホールディングス	315,000	710.00	223,650,000	貸付有価証券 7,000株
神戸電鉄	34,000	360.00	12,240,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
名古屋鉄道	512,000	574.00	293,888,000	貸付有価証券 22,000株(17,000株)
山陽電気鉄道	51,000	502.00	25,602,000	
日本通運	543,000	450.00	244,350,000	
ヤマトホールディングス	251,200	2,264.00	568,716,800	貸付有価証券 1,400株
山九	185,000	542.00	100,270,000	
丸運	7,600	233.00	1,770,800	
丸全昭和運輸	47,000	366.00	17,202,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
センコー	63,200	606.00	38,299,200	貸付有価証券 17,300株(1,000株)
トナミホールディングス	29,000	256.00	7,424,000	
ニッコンホールディングス	44,600	1,822.00	81,261,200	
日本石油輸送	16,000	218.00	3,488,000	
福山通運	85,000	534.00	45,390,000	貸付有価証券 39,000株(29,000株)

セイノーホールディングス	99,600	910.00	90,636,000	
神奈川中央交通	16,000	593.00	9,488,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
日立物流	29,300	1,660.00	48,638,000	
丸和運輸機関	4,200	3,070.00	12,894,000	貸付有価証券 1,900株
C & F ロジホールディングス	13,400	1,005.00	13,467,000	
日本郵船	1,261,000	176.00	221,936,000	
商船三井	684,000	205.00	140,220,000	貸付有価証券 277,000株
川崎汽船	615,000	231.00	142,065,000	貸付有価証券 288,000株（1,000株）
N S ユナイテッド海運	63,000	126.00	7,938,000	貸付有価証券 1,000株
明治海運	12,600	292.00	3,679,200	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
飯野海運	72,700	367.00	26,680,900	貸付有価証券 1,300株
共栄タンカー	12,000	159.00	1,908,000	
乾汽船	11,100	925.00	10,267,500	貸付有価証券 1,900株
日本航空	269,000	3,260.00	876,940,000	
A N A ホールディングス	2,607,000	287.80	750,294,600	
パスコ	13,000	299.00	3,887,000	貸付有価証券 6,000株
トランコム	4,100	6,620.00	27,142,000	
日新	57,000	297.00	16,929,000	
三菱倉庫	100,000	1,363.00	136,300,000	貸付有価証券 10,000株
三井倉庫ホールディングス	81,000	263.00	21,303,000	貸付有価証券 26,000株（9,000株）
住友倉庫	103,000	497.00	51,191,000	貸付有価証券 8,000株
澁澤倉庫	37,000	270.00	9,990,000	
東陽倉庫	24,000	214.00	5,136,000	
日本トランスシティ	32,000	327.00	10,464,000	
ケイヒン	26,000	129.00	3,354,000	
中央倉庫	8,100	889.00	7,200,900	

安田倉庫	10,900	614.00	6,692,600	
東洋埠頭	41,000	136.00	5,576,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	11,400	292.00	3,328,800	
上組	168,000	938.00	157,584,000	
サンリツ	3,400	492.00	1,672,800	
キムラユニティー	3,600	1,000.00	3,600,000	
キューソー流通システム	3,900	2,627.00	10,245,300	
郵船ロジスティクス	12,900	978.00	12,616,200	
近鉄エクスプレス	25,100	1,202.00	30,170,200	
東海運	7,600	256.00	1,945,600	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
エーアイティー	8,600	823.00	7,077,800	貸付有価証券 2,600株
内外トランスライン	4,700	909.00	4,272,300	
NEC ネットエスアイ	17,400	1,803.00	31,372,200	
システナ	13,500	1,363.00	18,400,500	
デジタルアーツ	6,800	2,842.00	19,325,600	貸付有価証券 2,800株(2,600株)
新日鉄住金ソリューションズ	23,100	1,604.00	37,052,400	
キューブシステム	6,000	669.00	4,014,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
コア	5,800	978.00	5,672,400	貸付有価証券 2,700株
ソフトクリエイトホールディングス	6,600	953.00	6,289,800	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
ITホールディングス	46,000	2,285.00	105,110,000	
ネオス	4,100	564.00	2,312,400	貸付有価証券 1,900株(800株)
電算システム	4,800	1,440.00	6,912,000	貸付有価証券 800株
グリー	84,100	564.00	47,432,400	貸付有価証券 5,300株(4,000株)
コーエーテックモホールディングス	32,900	1,760.00	57,904,000	貸付有価証券 700株(100株)
三菱総合研究所	5,400	3,080.00	16,632,000	貸付有価証券 600株
ボルテージ	2,700	1,154.00	3,115,800	貸付有価証券 200株

電算	1,500	1,806.00	2,709,000	
A G S	3,100	978.00	3,031,800	貸付有価証券 700株
ファインデックス	9,100	1,259.00	11,456,900	貸付有価証券 3,600株(2,800株)
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	1,996.00	6,187,600	貸付有価証券 1,400株(400株)
ブレインパッド	2,100	1,125.00	2,362,500	貸付有価証券 900株(500株)
K L a b	21,500	597.00	12,835,500	貸付有価証券 9,400株
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	9,100	740.00	6,734,000	
イーブックイニシアティブジャパン	3,000	830.00	2,490,000	貸付有価証券 1,400株(100株)
ネクソン	132,900	1,505.00	200,014,500	
アイスタイル	21,100	660.00	13,926,000	貸付有価証券 5,000株
エムアップ	3,600	558.00	2,008,800	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
エイチーム	7,600	1,811.00	13,763,600	貸付有価証券 200株(200株)
テクノスジャパン	4,000	2,011.00	8,044,000	貸付有価証券 1,800株
e n i s h	4,100	523.00	2,144,300	貸付有価証券 1,800株
コロプラ	38,500	1,928.00	74,228,000	貸付有価証券 200株
モバイルクリエイト	9,100	346.00	3,148,600	貸付有価証券 4,200株(400株)
オルトプラス	5,100	313.00	1,596,300	貸付有価証券 2,300株(700株)
ブロードリーフ	13,900	937.00	13,024,300	
ハーツユナイテッドグループ	4,200	2,872.00	12,062,400	貸付有価証券 1,900株(1,100株)
メディアドゥ	2,900	1,473.00	4,271,700	貸付有価証券 1,300株
ブイキューブ	9,100	970.00	8,827,000	貸付有価証券 4,200株(200株)
サイバーリンクス	2,100	1,023.00	2,148,300	貸付有価証券 700株
ディー・エル・イー	3,800	844.00	3,207,200	貸付有価証券

				1,700株
VOYAGE GROUP	4,700	1,034.00	4,859,800	貸付有価証券 2,100株(1,500株)
オブティム	1,200	4,365.00	5,238,000	貸付有価証券 500株(100株)
ベリサーブ	1,600	3,220.00	5,152,000	貸付有価証券 700株(400株)
ティーガイア	13,800	1,444.00	19,927,200	貸付有価証券 1,500株
日本アジアグループ	15,700	409.00	6,421,300	
豆蔵ホールディングス	10,900	929.00	10,126,100	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	5,900	2,164.00	12,767,600	貸付有価証券 2,700株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	323,000	272.00	87,856,000	貸付有価証券 151,500株(1,400株)
GMOペイメントゲート ウェイ	11,300	5,520.00	62,376,000	
ザッパラス	7,700	365.00	2,810,500	貸付有価証券 2,600株
インターネットイニシア ティブ	22,400	2,001.00	44,822,400	
さくらインターネット	9,100	925.00	8,417,500	貸付有価証券 4,100株(2,200株)
GMOクラウド	3,100	1,025.00	3,177,500	貸付有価証券 1,400株(700株)
SRAホールディングス	8,000	2,025.00	16,200,000	
Minorityソリューションズ	2,700	825.00	2,227,500	
システムインテグレータ	1,900	613.00	1,164,700	貸付有価証券 200株
朝日ネット	12,600	448.00	5,644,800	
コムチュア	2,300	3,255.00	7,486,500	
サイバーコム	1,600	799.00	1,278,400	貸付有価証券 700株
gumi	14,300	881.00	12,598,300	貸付有価証券 6,600株
パイプドHD	1,800	971.00	1,747,800	貸付有価証券 400株
フェイス	3,700	1,037.00	3,836,900	貸付有価証券 100株
ハイマックス	1,800	1,105.00	1,989,000	

野村総合研究所	97,200	3,680.00	357,696,000	貸付有価証券 10,000株(100株)
サイバネットシステム	11,300	709.00	8,011,700	貸付有価証券 5,300株(4,900株)
C Eホールディングス	2,100	950.00	1,995,000	貸付有価証券 900株
インテージホールディングス	7,200	1,557.00	11,210,400	
東邦システムサイエンス	4,100	563.00	2,308,300	
ソースネクスト	6,900	424.00	2,925,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
ティー・ワイ・オー	27,200	158.00	4,297,600	貸付有価証券 600株(600株)
フォーカスシステムズ	5,300	450.00	2,385,000	
クレスコ	3,100	2,068.00	6,410,800	
フジ・メディア・ホールディングス	144,400	1,136.00	164,038,400	
オービック	47,800	5,540.00	264,812,000	貸付有価証券 2,000株
ジャストシステム	25,200	852.00	21,470,400	
T D C ソフトウェアエンジニアリング	6,000	598.00	3,588,000	
ヤフー	993,700	449.00	446,171,300	貸付有価証券 460,100株
トレンドマイクロ	67,300	3,515.00	236,559,500	貸付有価証券 14,100株
インフォメーション・ディベロプメント	2,600	1,013.00	2,633,800	
日本オラクル	22,200	5,700.00	126,540,000	
アルファシステムズ	4,500	1,629.00	7,330,500	
フューチャー	16,600	740.00	12,284,000	
C A C H o l d i n g s	10,300	775.00	7,982,500	
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	1,973.00	7,300,100	
トーセ	3,700	651.00	2,408,700	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルタント	7,000	4,580.00	32,060,000	貸付有価証券 3,100株
伊藤忠テクノソリューションズ	31,400	2,178.00	68,389,200	

アイティフォー	18,000	491.00	8,838,000	
東計電算	2,400	1,725.00	4,140,000	
エクスネット	1,300	1,500.00	1,950,000	
大塚商会	37,300	4,730.00	176,429,000	
サイボウズ	18,400	386.00	7,102,400	
ソフトブレーン	20,300	317.00	6,435,100	貸付有価証券 9,400株
電通国際情報サービス	8,500	1,552.00	13,192,000	貸付有価証券 700株
E Mシステムズ	4,700	1,214.00	5,705,800	貸付有価証券 1,000株(200株)
ウェザーニューズ	4,600	3,660.00	16,836,000	貸付有価証券 100株(100株)
C I J	12,600	451.00	5,682,600	
東洋ビジネスエンジニア リング	1,400	1,396.00	1,954,400	貸付有価証券 600株
日本エンタープライズ	14,200	304.00	4,316,800	貸付有価証券 4,900株(400株)
WOWOW	6,600	2,412.00	15,919,200	貸付有価証券 3,000株(1,200株)
フュージョンパートナー	8,600	513.00	4,411,800	貸付有価証券 900株
日本コロムビア	4,700	440.00	2,068,000	貸付有価証券 1,500株
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,700	430.00	5,031,000	貸付有価証券 1,800株
ネットワンシステムズ	60,000	613.00	36,780,000	貸付有価証券 19,300株
アルゴグラフィックス	6,300	1,578.00	9,941,400	
マーベラス	23,400	793.00	18,556,200	貸付有価証券 10,900株(800株)
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	25,500	1,156.00	29,478,000	貸付有価証券 1,200株
日本ユニシス	38,300	1,197.00	45,845,100	貸付有価証券 10,400株(10,300株)
兼松エレクトロニクス	8,700	1,795.00	15,616,500	
東京放送ホールディング ス	83,100	1,345.00	111,769,500	貸付有価証券 22,200株
日本テレビホールディン グス	126,600	1,634.00	206,864,400	貸付有価証券 8,200株
朝日放送	13,700	599.00	8,206,300	

テレビ朝日ホールディングス	37,900	1,585.00	60,071,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	105,200	464.00	48,812,800	
テレビ東京ホールディングス	12,600	1,985.00	25,011,000	貸付有価証券 4,600株(4,200株)
日本BS放送	3,100	972.00	3,013,200	貸付有価証券 1,000株(700株)
U-NEXT	4,300	785.00	3,375,500	貸付有価証券 2,000株
ワイヤレスゲート	4,100	1,686.00	6,912,600	貸付有価証券 1,800株
コネクシオ	12,200	1,280.00	15,616,000	貸付有価証券 4,600株(3,500株)
日本通信	98,100	218.00	21,385,800	貸付有価証券 27,900株(14,300株)
クロップス	2,500	502.00	1,255,000	
日本電信電話	1,071,700	4,784.00	5,127,012,800	
KDDI	1,408,500	3,074.00	4,329,729,000	貸付有価証券 225,800株
光通信	16,700	8,440.00	140,948,000	
NTTドコモ	1,036,000	2,742.50	2,841,230,000	
エムティーアイ	21,100	644.00	13,588,400	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
GMOインターネット	50,600	1,003.00	50,751,800	
カドカワ	43,300	1,366.00	59,147,800	貸付有価証券 1,300株
学研ホールディングス	46,000	249.00	11,454,000	
ゼンリン	18,300	1,964.00	35,941,200	
昭文社	7,500	546.00	4,095,000	
インプレスホールディングス	11,400	128.00	1,459,200	貸付有価証券 2,000株(100株)
アイネット	7,700	1,036.00	7,977,200	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
松竹	91,000	1,043.00	94,913,000	貸付有価証券 42,000株
東宝	98,900	2,755.00	272,469,500	
東映	52,000	947.00	49,244,000	
AOI Pro.	7,000	844.00	5,908,000	
エヌ・ティ・ティ・デー	85,600	4,785.00	409,596,000	貸付有価証券

タ				21,400株
ピー・シー・エー	1,800	1,140.00	2,052,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,100	893.00	1,875,300	
D T S	15,400	1,898.00	29,229,200	貸付有価証券 2,000株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58,700	3,155.00	185,198,500	貸付有価証券 500株
シーイーシー	9,000	1,293.00	11,637,000	
カプコン	35,400	2,248.00	79,579,200	
アイ・エス・ビー	2,200	790.00	1,738,000	貸付有価証券 400株
ジャステック	8,800	941.00	8,280,800	貸付有価証券 3,900株
S C S K	33,000	3,680.00	121,440,000	
日本システムウエア	5,200	1,022.00	5,314,400	貸付有価証券 1,100株
アイネス	19,600	985.00	19,306,000	貸付有価証券 600株
T K C	12,800	2,551.00	32,652,800	
富士ソフト	20,600	2,290.00	47,174,000	
N S D	29,400	1,588.00	46,687,200	
コナミホールディングス	62,600	3,755.00	235,063,000	貸付有価証券 4,500株
福井コンピュータホールディングス	4,000	1,875.00	7,500,000	
J B C Cホールディングス	11,600	648.00	7,516,800	
ミロク情報サービス	10,200	1,389.00	14,167,800	
ソフトバンクグループ	785,600	5,668.00	4,452,780,800	貸付有価証券 76,500株
ハウスイ	11,000	106.00	1,166,000	貸付有価証券 2,000株
高千穂交易	5,300	875.00	4,637,500	
伊藤忠食品	3,400	4,125.00	14,025,000	
エレマテック	6,500	1,937.00	12,590,500	
J A L U X	4,500	1,647.00	7,411,500	貸付有価証券 1,600株(900株)
あらた	6,200	2,222.00	13,776,400	貸付有価証券 1,500株

トーメンデバイス	2,100	1,820.00	3,822,000	
東京エレクトロン デバイス	5,000	1,480.00	7,400,000	
フィールズ	12,100	1,245.00	15,064,500	貸付有価証券 3,100株
双日	873,400	233.00	203,502,200	
アルフレッサ ホールディングス	174,300	2,160.00	376,488,000	
横浜冷凍	34,300	1,024.00	35,123,200	貸付有価証券 15,800株（12,900株）
神栄	19,000	107.00	2,033,000	貸付有価証券 8,000株
山下医科器械	1,100	1,634.00	1,797,400	貸付有価証券 400株
ラサ商事	6,500	462.00	3,003,000	貸付有価証券 200株
ラクーン	6,000	506.00	3,036,000	貸付有価証券 2,700株
アルコニックス	7,900	1,421.00	11,225,900	
神戸物産	9,000	2,040.00	18,360,000	貸付有価証券 4,100株（200株）
あい ホールディングス	24,700	2,281.00	56,340,700	貸付有価証券 5,800株（200株）
ディービーエックス	4,900	1,110.00	5,439,000	
ダイワボウホールディングス	126,000	214.00	26,964,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,000	1,048.00	26,200,000	貸付有価証券 1,600株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,000	997.00	23,928,000	貸付有価証券 9,300株（9,300株）
八洲電機	10,700	505.00	5,403,500	
U K C ホールディングス	8,900	1,546.00	13,759,400	
O C H I ホールディングス	4,000	1,000.00	4,000,000	
T O K A I ホールディングス	60,900	649.00	39,524,100	貸付有価証券 28,600株（13,100株）
三洋貿易	7,600	1,142.00	8,679,200	
ウイン・パートナーズ	5,000	1,433.00	7,165,000	貸付有価証券 300株
ミタチ産業	3,500	546.00	1,911,000	
シップヘルスケアホール	28,100	3,140.00	88,234,000	貸付有価証券

ディングス				100株
明治電機工業	4,300	965.00	4,149,500	貸付有価証券 1,800株
デリカフーズ	2,900	935.00	2,711,500	貸付有価証券 1,300株
スターティア	2,700	475.00	1,282,500	貸付有価証券 1,200株(1,100株)
富士興産	5,300	378.00	2,003,400	
協栄産業	18,000	123.00	2,214,000	
小野建	12,000	1,160.00	13,920,000	貸付有価証券 5,600株
佐鳥電機	11,000	662.00	7,282,000	貸付有価証券 400株
エコトレーディング	3,200	565.00	1,808,000	貸付有価証券 100株
伯東	10,500	841.00	8,830,500	
コンドーテック	11,000	739.00	8,129,000	
中山福	8,600	778.00	6,690,800	貸付有価証券 100株
ナガイレーベン	20,000	2,458.00	49,160,000	貸付有価証券 2,900株
三菱食品	15,200	2,723.00	41,389,600	貸付有価証券 100株
松田産業	10,100	1,255.00	12,675,500	貸付有価証券 100株
第一興商	24,500	4,240.00	103,880,000	
メディカルホールディングス	138,700	1,668.00	231,351,600	
アドヴァン	14,100	1,090.00	15,369,000	貸付有価証券 700株
S P K	3,200	1,881.00	6,019,200	
萩原電気	4,700	1,856.00	8,723,200	
アズワン	10,800	4,020.00	43,416,000	貸付有価証券 1,200株
スズデン	4,500	870.00	3,915,000	貸付有価証券 300株
尾家産業	4,400	866.00	3,810,400	
シモジマ	9,500	1,030.00	9,785,000	
ドウシシャ	16,300	1,979.00	32,257,700	
小津産業	3,000	1,990.00	5,970,000	貸付有価証券 1,400株

高速	8,200	820.00	6,724,000	
たけびし	4,800	996.00	4,780,800	貸付有価証券 1,200株
黒田電気	25,800	1,687.00	43,524,600	
丸文	12,200	575.00	7,015,000	
ハピネット	12,600	873.00	10,999,800	貸付有価証券 2,800株
橋本総業ホールディングス	2,800	1,423.00	3,984,400	
エクセル	6,700	1,276.00	8,549,200	貸付有価証券 2,300株
マルカキカイ	4,500	1,108.00	4,986,000	
ガリバーインターナショナル	37,300	848.00	31,630,400	貸付有価証券 17,500株（14,000株）
日本エム・ディ・エム	11,500	645.00	7,417,500	貸付有価証券 4,900株
進和	8,200	1,326.00	10,873,200	
エスケイジャパン	3,300	206.00	679,800	貸付有価証券 200株
ダイトエレクトロン	6,300	567.00	3,572,100	
シークス	8,800	3,270.00	28,776,000	貸付有価証券 1,800株
田中商事	4,200	631.00	2,650,200	
オーハシテクニカ	7,800	1,210.00	9,438,000	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
白銅	4,000	1,046.00	4,184,000	
伊藤忠商事	1,088,000	1,207.50	1,313,760,000	貸付有価証券 7,700株（7,700株）
丸紅	1,364,500	441.50	602,426,750	貸付有価証券 128,500株
高島	26,000	154.00	4,004,000	
長瀬産業	83,400	1,095.00	91,323,000	
蝶理	8,800	1,315.00	11,572,000	
豊田通商	154,400	2,122.00	327,636,800	貸付有価証券 300株
三共生興	20,900	333.00	6,959,700	貸付有価証券 100株
兼松	295,000	158.00	46,610,000	
ツカモトコーポレーション	25,000	99.00	2,475,000	

三井物産	1,253,800	1,184.50	1,485,126,100	貸付有価証券 28,500株
日本紙パルプ商事	72,000	331.00	23,832,000	
日立ハイテクノロジーズ	48,100	2,716.00	130,639,600	
カメイ	18,000	808.00	14,544,000	
東都水産	23,000	154.00	3,542,000	
OUGホールディングス	20,000	232.00	4,640,000	
スターゼン	5,000	3,750.00	18,750,000	
山善	53,200	823.00	43,783,600	
椿本興業	16,000	253.00	4,048,000	
住友商事	872,800	999.00	871,927,200	貸付有価証券 10,300株
内田洋行	34,000	446.00	15,164,000	
三菱商事	1,040,400	1,728.00	1,797,811,200	
第一実業	31,000	435.00	13,485,000	
キャノンマーケティング ジャパン	39,500	1,922.00	75,919,000	
西華産業	44,000	245.00	10,780,000	
佐藤商事	12,400	594.00	7,365,600	
菱洋エレクトロ	15,700	1,315.00	20,645,500	貸付有価証券 1,800株
東京産業	13,800	341.00	4,705,800	
ユアサ商事	13,100	2,050.00	26,855,000	
神鋼商事	31,000	163.00	5,053,000	
小林産業	9,200	243.00	2,235,600	貸付有価証券 4,200株
阪和興業	138,000	509.00	70,242,000	
カナデン	13,200	853.00	11,259,600	
菱電商事	22,000	618.00	13,596,000	
フルサト工業	7,600	1,204.00	9,150,400	
岩谷産業	164,000	569.00	93,316,000	貸付有価証券 3,000株
すてきナイスグループ	59,000	138.00	8,142,000	
昭光通商	49,000	70.00	3,430,000	貸付有価証券 11,000株
ニチモウ	21,000	157.00	3,297,000	貸付有価証券 9,000株(1,000株)
極東貿易	20,000	177.00	3,540,000	

イワキ	21,000	179.00	3,759,000	
三愛石油	34,100	600.00	20,460,000	貸付有価証券 100株
稲畑産業	33,200	915.00	30,378,000	貸付有価証券 600株
G S Iクレオス	37,000	93.00	3,441,000	
明和産業	12,800	290.00	3,712,000	
ワキタ	29,500	653.00	19,263,500	
東邦ホールディングス	44,400	2,512.00	111,532,800	貸付有価証券 20,200株（17,900株）
サンゲツ	48,300	1,879.00	90,755,700	
ミツウロコグループホールディングス	22,300	489.00	10,904,700	
シナネンホールディングス	30,000	388.00	11,640,000	
伊藤忠エネクス	35,700	914.00	32,629,800	貸付有価証券 500株
サンリオ	42,700	1,752.00	74,810,400	貸付有価証券 20,100株
サンワテクノス	8,800	691.00	6,080,800	
リョーサン	22,000	2,416.00	53,152,000	貸付有価証券 100株
新光商事	16,300	960.00	15,648,000	
トーヨー	6,200	2,389.00	14,811,800	貸付有価証券 2,900株
三信電気	19,200	829.00	15,916,800	貸付有価証券 1,900株
東陽テクニカ	18,400	968.00	17,811,200	
モスフードサービス	18,200	2,979.00	54,217,800	貸付有価証券 100株（100株）
加賀電子	12,500	1,136.00	14,200,000	貸付有価証券 100株
ソーダニッカ	14,300	447.00	6,392,100	
立花エレテック	10,200	1,051.00	10,720,200	
フォーバル	7,300	696.00	5,080,800	
P A L T A C	22,200	2,105.00	46,731,000	
三谷産業	14,700	307.00	4,512,900	貸付有価証券 6,700株（100株）
太平洋興発	58,000	67.00	3,886,000	貸付有価証券 12,000株

ヤマタネ	64,000	136.00	8,704,000	
丸紅建材リース	12,000	168.00	2,016,000	
日鉄住金物産	122,000	325.00	39,650,000	貸付有価証券 8,000株
トラスコ中山	15,800	4,980.00	78,684,000	
オートバックスセブン	53,100	1,441.00	76,517,100	貸付有価証券 23,800株
加藤産業	21,600	2,418.00	52,228,800	
イノテック	12,700	415.00	5,270,500	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	13,100	2,412.00	31,597,200	
J Kホールディングス	13,900	445.00	6,185,500	
日伝	5,700	3,095.00	17,641,500	
北沢産業	11,400	148.00	1,687,200	
杉本商事	8,000	1,102.00	8,816,000	
因幡電機産業	19,500	3,465.00	67,567,500	貸付有価証券 100株
バイテックホールディングス	5,600	1,010.00	5,656,000	貸付有価証券 2,600株
ミスミグループ本社	155,700	1,804.00	280,882,800	貸付有価証券 67,200株（2,700株）
アルテック	11,800	124.00	1,463,200	
タキヒヨー	23,000	431.00	9,913,000	
蔵王産業	2,300	1,283.00	2,950,900	
スズケン	63,100	3,230.00	203,813,000	
ジェコス	9,500	1,004.00	9,538,000	
ルネサスイーストン	11,500	367.00	4,220,500	
ローソン	52,500	8,430.00	442,575,000	
サンエー	9,400	5,110.00	48,034,000	貸付有価証券 400株
ダイユーエイト	3,600	644.00	2,318,400	貸付有価証券 1,400株
カワチ薬品	10,700	2,472.00	26,450,400	
エービーシー・マート	18,000	7,040.00	126,720,000	貸付有価証券 3,000株（2,600株）
ハードオフコーポレーション	6,700	1,206.00	8,080,200	
アスクル	16,900	3,510.00	59,319,000	貸付有価証券 600株

ゲオホールディングス	23,200	1,378.00	31,969,600	貸付有価証券 9,900株（200株）
アダストリア	25,500	4,160.00	106,080,000	
ジーフット	8,300	709.00	5,884,700	
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	20,000	71.00	1,420,000	
くらコーポレーション	8,100	6,200.00	50,220,000	
キャンドウ	7,300	1,640.00	11,972,000	貸付有価証券 2,200株（1,800株）
パル	8,100	2,376.00	19,245,600	貸付有価証券 3,800株
エディオン	58,600	838.00	49,106,800	貸付有価証券 26,100株（8,900株）
サーラコーポレーション	13,300	585.00	7,780,500	貸付有価証券 300株
ワッツ	5,900	1,018.00	6,006,200	貸付有価証券 1,300株
ハローズ	4,500	2,001.00	9,004,500	
あみやき亭	2,700	4,435.00	11,974,500	
ひらまつ	19,100	627.00	11,975,700	貸付有価証券 8,800株（600株）
ゲンキー	2,800	3,380.00	9,464,000	貸付有価証券 1,300株（800株）
サッポロドラッグストア	1,800	1,977.00	3,558,600	貸付有価証券 300株
大黒天物産	3,300	4,790.00	15,807,000	貸付有価証券 1,500株
ハニーズ	12,200	1,037.00	12,651,400	貸付有価証券 5,600株
ファーマライズホール ディングス	3,100	519.00	1,608,900	貸付有価証券 200株
アルペン	12,400	1,683.00	20,869,200	貸付有価証券 5,700株
クオール	14,100	1,365.00	19,246,500	貸付有価証券 4,700株
ジェイアイエヌ	9,400	3,960.00	37,224,000	貸付有価証券 4,400株（3,400株）
ビックカメラ	79,600	948.00	75,460,800	
DCMホールディングス	68,200	807.00	55,037,400	貸付有価証券 31,600株（15,000株）
Monotaro	49,000	3,305.00	161,945,000	貸付有価証券

				22,700株(4,400株)
東京一番フーズ	3,400	544.00	1,849,600	貸付有価証券 800株(800株)
ダイヤモンドダイニング	2,900	962.00	2,789,800	貸付有価証券 1,300株
きちり	3,700	596.00	2,205,200	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
アークランドサービス	4,300	2,874.00	12,358,200	貸付有価証券 2,000株
J.フロントリテイリング	175,400	1,119.00	196,272,600	貸付有価証券 3,600株
ドトール・日レスホールディングス	24,300	1,815.00	44,104,500	
マツモトキヨシホールディングス	28,600	5,200.00	148,720,000	貸付有価証券 200株
ブロンコピリー	7,200	3,400.00	24,480,000	貸付有価証券 3,300株(700株)
スタートトゥデイ	42,200	5,390.00	227,458,000	貸付有価証券 1,600株
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,018.00	3,970,200	
物語コーポレーション	3,700	5,310.00	19,647,000	貸付有価証券 1,600株
ココカラファイン	14,400	5,330.00	76,752,000	
三越伊勢丹ホールディングス	275,800	913.00	251,805,400	貸付有価証券 62,000株(17,400株)
ウエルシアホールディングス	12,000	6,340.00	76,080,000	
クリエイトSDホールディングス	20,400	2,929.00	59,751,600	
丸善CHIホールディングス	16,100	376.00	6,053,600	貸付有価証券 1,100株
ミサワ	2,200	499.00	1,097,800	
エー・ピーカンパニー	2,300	840.00	1,932,000	貸付有価証券 600株
チムニー	3,400	2,764.00	9,397,600	貸付有価証券 1,500株
シュッピン	5,200	1,177.00	6,120,400	貸付有価証券 2,400株(100株)
ネクステージ	2,200	630.00	1,386,000	貸付有価証券 900株
ジョイフル本田	22,500	2,316.00	52,110,000	

鳥貴族	3,400	2,019.00	6,864,600	貸付有価証券 1,500株(700株)
キリン堂ホールディングス	4,400	899.00	3,955,600	
ホットランド	4,800	920.00	4,416,000	貸付有価証券 2,200株
すかいらーく	42,400	1,278.00	54,187,200	貸付有価証券 19,700株(100株)
綿半ホールディングス	5,200	1,482.00	7,706,400	貸付有価証券 2,300株(500株)
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	46,000	1,064.00	48,944,000	
ブックオフコーポレーション	7,900	840.00	6,636,000	貸付有価証券 1,900株(800株)
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	955.00	3,724,500	貸付有価証券 1,700株
あさひ	10,300	1,588.00	16,356,400	
日本調剤	3,500	4,970.00	17,395,000	貸付有価証券 1,600株(400株)
コスモス薬品	7,000	21,010.00	147,070,000	貸付有価証券 3,000株(2,400株)
トーエル	6,700	737.00	4,937,900	貸付有価証券 2,300株
一六堂	3,300	306.00	1,009,800	
セブン&アイ・ホールディングス	580,000	4,381.00	2,540,980,000	貸付有価証券 236,300株(6,900株)
薬王堂	2,600	4,560.00	11,856,000	貸付有価証券 1,200株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	37,200	948.00	35,265,600	貸付有価証券 600株
ツルハホールディングス	31,900	12,650.00	403,535,000	
サンマルクホールディングス	10,900	2,956.00	32,220,400	
フェリシモ	3,900	1,008.00	3,931,200	
トリドール	17,000	2,808.00	47,736,000	貸付有価証券 7,800株
クスリのアオキ	12,300	6,590.00	81,057,000	貸付有価証券 400株(400株)
メディカルシステムネットワーク	15,600	464.00	7,238,400	貸付有価証券 7,300株
総合メディカル	6,700	3,870.00	25,929,000	貸付有価証券 1,900株

はるやま商事	5,800	725.00	4,205,000	
カップ・クリエイト	19,400	1,293.00	25,084,200	貸付有価証券 1,300株
ライトオン	10,300	1,470.00	15,141,000	貸付有価証券 4,800株
ジーンズメイト	4,400	164.00	721,600	貸付有価証券 2,000株(1,000株)
良品計画	15,900	25,360.00	403,224,000	貸付有価証券 700株
三城ホールディングス	17,100	424.00	7,250,400	
アルビス	3,600	2,075.00	7,470,000	
コナカ	17,700	478.00	8,460,600	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,411.00	2,398,700	貸付有価証券 700株(100株)
G-7ホールディングス	4,100	1,182.00	4,846,200	
イオン北海道	9,300	509.00	4,733,700	貸付有価証券 600株
コジマ	20,400	235.00	4,794,000	貸付有価証券 900株
ヒマラヤ	4,300	912.00	3,921,600	貸付有価証券 300株
コーナン商事	19,700	1,882.00	37,075,400	貸付有価証券 9,200株
エコス	5,300	1,201.00	6,365,300	貸付有価証券 200株(100株)
ワタミ	16,400	1,059.00	17,367,600	貸付有価証券 5,700株(5,400株)
マルシェ	3,400	816.00	2,774,400	貸付有価証券 1,300株
ドンキホーテホールディングス	89,700	3,760.00	337,272,000	貸付有価証券 3,300株
西松屋チェーン	27,300	1,516.00	41,386,800	貸付有価証券 8,800株
ゼンショーホールディングス	71,300	1,480.00	105,524,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
幸楽苑ホールディングス	8,700	1,540.00	13,398,000	貸付有価証券 1,900株(1,800株)
ハークスレイ	3,800	946.00	3,594,800	
サイゼリヤ	22,800	1,845.00	42,066,000	貸付有価証券 10,700株
V Tホールディングス	46,900	469.00	21,996,100	貸付有価証券

				21,800株
魚力	4,300	1,320.00	5,676,000	
ポブラ	3,500	493.00	1,725,500	
ユナイテッドアローズ	19,800	2,940.00	58,212,000	
ハイデイ日高	12,600	2,491.00	31,386,600	
京都きもの友禅	9,500	806.00	7,657,000	貸付有価証券 3,800株
コロワイド	46,000	1,850.00	85,100,000	貸付有価証券 15,800株(100株)
ピーシーデポコーポレーション	15,300	1,414.00	21,634,200	貸付有価証券 7,000株(200株)
壱番屋	12,500	3,585.00	44,812,500	貸付有価証券 4,200株
トップカルチャー	5,000	446.00	2,230,000	
P L A N T	3,100	1,107.00	3,431,700	
スギホールディングス	24,900	5,690.00	141,681,000	
スクロール	21,000	376.00	7,896,000	貸付有価証券 8,900株
ヨンドシーホールディングス	10,600	2,091.00	22,164,600	貸付有価証券 4,900株(3,000株)
ファミリーマート	42,600	6,440.00	274,344,000	貸付有価証券 3,500株
木曽路	17,000	2,244.00	38,148,000	貸付有価証券 5,900株(5,500株)
サトレストランシステムズ	16,300	811.00	13,219,300	貸付有価証券 7,500株
千趣会	27,300	668.00	18,236,400	貸付有価証券 12,600株
タカキュー	10,700	173.00	1,851,100	
ケーヨー	23,300	517.00	12,046,100	貸付有価証券 9,900株(1,000株)
上新電機	33,000	857.00	28,281,000	
日本瓦斯	21,200	2,199.00	46,618,800	貸付有価証券 1,500株
ベスト電器	44,600	102.00	4,549,200	貸付有価証券 14,100株(14,100株)
ロイヤルホールディングス	23,000	1,818.00	41,814,000	貸付有価証券 10,600株
東天紅	10,000	127.00	1,270,000	貸付有価証券 1,000株
いなげや	15,400	1,289.00	19,850,600	

島忠	35,900	2,200.00	78,980,000	貸付有価証券 8,300株
チヨダ	16,300	2,204.00	35,925,200	
ライフコーポレーション	8,700	2,944.00	25,612,800	貸付有価証券 4,000株(100株)
リンガーハット	12,500	2,352.00	29,400,000	貸付有価証券 100株
さが美	11,000	78.00	858,000	貸付有価証券 3,000株
MrMax	12,100	272.00	3,291,200	
テンアライド	12,800	362.00	4,633,600	
AOKIホールディングス	31,600	1,047.00	33,085,200	貸付有価証券 6,500株
オークワ	22,000	1,032.00	22,704,000	
コメリ	21,400	2,573.00	55,062,200	貸付有価証券 500株
青山商事	26,600	3,650.00	97,090,000	
しまむら	16,100	15,830.00	254,863,000	
はせがわ	6,500	417.00	2,710,500	貸付有価証券 900株(900株)
高島屋	202,000	696.00	140,592,000	貸付有価証券 15,000株(15,000株)
松屋	27,900	696.00	19,418,400	貸付有価証券 13,100株(300株)
エイチ・ツー・オー リテイリング	71,000	1,393.00	98,903,000	
近鉄百貨店	53,000	342.00	18,126,000	貸付有価証券 24,000株
丸栄	28,000	80.00	2,240,000	貸付有価証券 13,000株
ニッセンホールディングス	20,400	84.00	1,713,600	貸付有価証券 9,500株(3,300株)
パルコ	13,300	819.00	10,892,700	貸付有価証券 1,900株
丸井グループ	170,200	1,377.00	234,365,400	貸付有価証券 1,800株
アクシアル リテイリング	10,700	3,540.00	37,878,000	
井筒屋	75,000	43.00	3,225,000	貸付有価証券 16,000株
イオン	570,500	1,581.00	901,960,500	貸付有価証券

				229,100株
ユニグループ・ホールディングス	132,700	885.00	117,439,500	
イズミ	27,500	4,065.00	111,787,500	貸付有価証券 1,600株
東武ストア	17,000	290.00	4,930,000	
平和堂	28,100	2,235.00	62,803,500	貸付有価証券 100株
フジ	15,400	2,489.00	38,330,600	
ヤオコー	15,700	4,565.00	71,670,500	貸付有価証券 7,000株
ゼビオホールディングス	18,800	1,441.00	27,090,800	貸付有価証券 300株
ケーズホールディングス	58,600	1,858.00	108,878,800	貸付有価証券 16,900株(5,500株)
Olympicグループ	8,100	490.00	3,969,000	
日産東京販売ホールディングス	23,300	213.00	4,962,900	
アインホールディングス	16,700	7,480.00	124,916,000	貸付有価証券 1,200株
元気寿司	3,900	2,074.00	8,088,600	
ヤマダ電機	421,600	534.00	225,134,400	貸付有価証券 106,700株(93,800株)
アークランドサカモト	23,500	1,125.00	26,437,500	
ニトリホールディングス	59,900	12,850.00	769,715,000	
グルメ杵屋	10,000	985.00	9,850,000	貸付有価証券 4,000株
愛眼	11,000	194.00	2,134,000	貸付有価証券 4,500株(3,500株)
ケーユーホールディングス	7,200	685.00	4,932,000	貸付有価証券 100株
吉野家ホールディングス	51,100	1,407.00	71,897,700	貸付有価証券 23,700株
松屋フーズ	6,700	2,741.00	18,364,700	貸付有価証券 200株(200株)
サガミチェーン	18,500	1,217.00	22,514,500	貸付有価証券 7,500株(6,000株)
関西スーパーマーケット	11,300	1,014.00	11,458,200	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
王将フードサービス	10,200	3,740.00	38,148,000	貸付有価証券

				2,800株
プレナス	15,500	1,697.00	26,303,500	貸付有価証券 7,100株
ミニストップ	10,200	1,694.00	17,278,800	
アークス	25,900	2,409.00	62,393,100	
パローホールディングス	29,900	2,753.00	82,314,700	貸付有価証券 100株
藤久	1,100	1,691.00	1,860,100	貸付有価証券 500株
ベルク	6,800	4,205.00	28,594,000	
大庄	7,400	1,508.00	11,159,200	貸付有価証券 600株
ファーストリテイリング	23,100	27,455.00	634,210,500	貸付有価証券 700株(400株)
サンドラッグ	29,300	9,460.00	277,178,000	
サックスパーホールディングス	13,000	1,021.00	13,273,000	貸付有価証券 6,000株
ヤマザワ	2,900	1,715.00	4,973,500	貸付有価証券 200株
やまや	2,800	1,611.00	4,510,800	
ベルーナ	34,600	582.00	20,137,200	
島根銀行	2,900	1,168.00	3,387,200	
じもとホールディングス	99,500	141.00	14,029,500	
足利ホールディングス	101,800	321.00	32,677,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	19,100	2,370.00	45,267,000	
九州フィナンシャルグループ	212,200	491.00	104,190,200	
ゆうちょ銀行	355,300	1,179.00	418,898,700	貸付有価証券 90,600株
富山第一銀行	35,200	470.00	16,544,000	貸付有価証券 16,400株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	965,900	396.90	383,365,710	貸付有価証券 34,700株(34,700株)
新生銀行	1,200,000	142.00	170,400,000	貸付有価証券 564,000株
あおぞら銀行	877,000	349.00	306,073,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,124,500	448.70	4,991,563,150	貸付有価証券 658,200株
りそなホールディングス	1,622,000	371.00	601,762,000	貸付有価証券 379,700株(379,700)

				株)
三井住友トラスト・ホールディングス	2,895,000	315.10	912,214,500	
三井住友フィナンシャルグループ	1,110,200	2,869.50	3,185,718,900	貸付有価証券 23,400株
第四銀行	175,000	322.00	56,350,000	
北越銀行	150,000	173.00	25,950,000	貸付有価証券 4,000株
西日本シティ銀行	452,000	177.00	80,004,000	
千葉銀行	535,000	473.00	253,055,000	
常陽銀行	501,000	375.00	187,875,000	貸付有価証券 193,000株（193,000株）
群馬銀行	308,000	366.00	112,728,000	貸付有価証券 26,000株（25,000株）
武蔵野銀行	22,100	2,297.00	50,763,700	
千葉興業銀行	38,000	371.00	14,098,000	
筑波銀行	57,600	273.00	15,724,800	
七十七銀行	217,000	362.00	78,554,000	
青森銀行	101,000	279.00	28,179,000	貸付有価証券 39,000株（34,000株）
秋田銀行	90,000	288.00	25,920,000	
山形銀行	78,000	395.00	30,810,000	貸付有価証券 23,000株（8,000株）
岩手銀行	9,700	4,010.00	38,897,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
東邦銀行	124,000	325.00	40,300,000	貸付有価証券 7,000株
東北銀行	71,000	139.00	9,869,000	
みちのく銀行	69,000	183.00	12,627,000	貸付有価証券 19,000株（18,000株）
ふくおかフィナンシャルグループ	600,000	335.00	201,000,000	貸付有価証券 34,000株（19,000株）
静岡銀行	406,000	704.00	285,824,000	貸付有価証券 2,000株
十六銀行	174,000	264.00	45,936,000	
スルガ銀行	131,600	2,258.00	297,152,800	貸付有価証券 61,100株（8,700株）
八十二銀行	250,800	433.00	108,596,400	貸付有価証券 7,000株
山梨中央銀行	86,000	351.00	30,186,000	貸付有価証券

				1,000株
大垣共立銀行	185,000	278.00	51,430,000	貸付有価証券 13,000株
福井銀行	118,000	221.00	26,078,000	
北國銀行	147,000	273.00	40,131,000	貸付有価証券 3,000株
清水銀行	4,700	2,248.00	10,565,600	
富山銀行	2,700	3,475.00	9,382,500	貸付有価証券 1,200株
滋賀銀行	130,000	442.00	57,460,000	貸付有価証券 56,000株（5,000株）
南都銀行	134,000	322.00	43,148,000	貸付有価証券 5,000株
百五銀行	125,000	352.00	44,000,000	貸付有価証券 29,000株
京都銀行	265,000	609.00	161,385,000	貸付有価証券 23,000株（23,000株）
紀陽銀行	54,400	1,242.00	67,564,800	
三重銀行	62,000	177.00	10,974,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	943,000	113.00	106,559,000	貸付有価証券 52,000株
広島銀行	409,000	332.00	135,788,000	
山陰合同銀行	83,300	667.00	55,561,100	
中国銀行	98,300	1,021.00	100,364,300	貸付有価証券 3,600株
鳥取銀行	44,000	164.00	7,216,000	
伊予銀行	148,300	610.00	90,463,000	
百十四銀行	152,000	296.00	44,992,000	貸付有価証券 9,000株
四国銀行	107,000	198.00	21,186,000	貸付有価証券 16,000株
阿波銀行	111,000	531.00	58,941,000	
大分銀行	80,000	285.00	22,800,000	貸付有価証券 35,000株
宮崎銀行	92,000	253.00	23,276,000	
佐賀銀行	84,000	213.00	17,892,000	
十八銀行	85,000	242.00	20,570,000	貸付有価証券 3,000株
沖縄銀行	12,680	2,988.00	37,887,840	
琉球銀行	28,600	1,019.00	29,143,400	貸付有価証券

				1,900株
セブン銀行	519,500	310.00	161,045,000	貸付有価証券 241,200株
みずほフィナンシャルグループ	19,656,200	146.50	2,879,633,300	
高知銀行	54,000	98.00	5,292,000	
山口フィナンシャルグループ	130,000	943.00	122,590,000	貸付有価証券 46,000株(24,000株)
長野銀行	45,000	193.00	8,685,000	貸付有価証券 21,000株(3,000株)
名古屋銀行	116,000	315.00	36,540,000	貸付有価証券 54,000株(4,000株)
北洋銀行	208,900	272.00	56,820,800	
愛知銀行	4,700	4,285.00	20,139,500	
第三銀行	78,000	153.00	11,934,000	貸付有価証券 26,000株(2,000株)
中京銀行	57,000	242.00	13,794,000	
大光銀行	49,000	174.00	8,526,000	
愛媛銀行	82,000	232.00	19,024,000	貸付有価証券 37,000株(28,000株)
トマト銀行	53,000	137.00	7,261,000	
みなと銀行	125,000	149.00	18,625,000	
京葉銀行	114,000	382.00	43,548,000	貸付有価証券 1,000株
関西アーバン銀行	19,300	885.00	17,080,500	貸付有価証券 100株
栃木銀行	72,000	349.00	25,128,000	
北日本銀行	4,300	2,443.00	10,504,900	
東和銀行	259,000	78.00	20,202,000	貸付有価証券 3,000株
福島銀行	171,000	86.00	14,706,000	貸付有価証券 31,000株
大東銀行	83,000	179.00	14,857,000	貸付有価証券 38,000株(13,000株)
トモニホールディングス	106,400	303.00	32,239,200	
フィデアホールディングス	113,100	135.00	15,268,500	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
池田泉州ホールディングス	147,100	378.00	55,603,800	貸付有価証券 2,200株
F P G	49,400	1,007.00	49,745,800	貸付有価証券 8,700株(3,900株)

S B Iホールディングス	166,500	950.00	158,175,000	
日本アジア投資	9,400	285.00	2,679,000	貸付有価証券 4,300株（100株）
ジャフコ	23,200	2,438.00	56,561,600	
大和証券グループ本社	1,297,000	521.60	676,515,200	
野村ホールディングス	2,667,800	352.30	939,865,940	
岡三証券グループ	118,000	448.00	52,864,000	貸付有価証券 11,000株
丸三証券	41,200	850.00	35,020,000	貸付有価証券 16,700株
東洋証券	53,000	184.00	9,752,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	159,100	417.00	66,344,700	貸付有価証券 38,900株
光世証券	33,000	103.00	3,399,000	貸付有価証券 1,000株
水戸証券	42,900	219.00	9,395,100	貸付有価証券 3,100株
いちよし証券	31,000	704.00	21,824,000	貸付有価証券 14,300株（3,800株）
松井証券	67,900	829.00	56,289,100	
だいこう証券ビジネス	6,700	547.00	3,664,900	貸付有価証券 200株
マネックスグループ	161,100	225.00	36,247,500	貸付有価証券 74,800株（19,200株）
カブドットコム証券	118,200	317.00	37,469,400	
極東証券	18,600	1,039.00	19,325,400	貸付有価証券 8,600株
岩井コスモホールディングス	13,100	826.00	10,820,600	貸付有価証券 200株（200株）
藍澤證券	25,900	512.00	13,260,800	貸付有価証券 1,400株
マネースクウェアHD	4,800	767.00	3,681,600	
マネーパートナーズグループ	12,900	492.00	6,346,800	貸付有価証券 6,000株（100株）
小林洋行	4,000	252.00	1,008,000	貸付有価証券 1,800株（1,500株）
かんぼ生命保険	56,400	2,014.00	113,589,600	貸付有価証券 8,000株（7,500株）
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	308,000	2,609.00	803,572,000	
アニコムホールディング	9,400	2,644.00	24,853,600	貸付有価証券

グス				3,100株(100株)
MS & A Dインシュアランスグループホール	414,400	2,449.50	1,015,072,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	132,800	1,106.00	146,876,800	
第一生命保険	888,400	1,069.50	950,143,800	
東京海上ホールディングス	561,700	3,154.00	1,771,601,800	
T & Dホールディングス	505,300	832.50	420,662,250	
全国保証	36,000	3,630.00	130,680,000	
クレディセゾン	105,200	1,686.00	177,367,200	貸付有価証券 2,800株
アクリーティブ	11,400	328.00	3,739,200	貸付有価証券 5,100株
芙蓉総合リース	15,900	4,000.00	63,600,000	
興銀リース	26,000	1,705.00	44,330,000	
東京センチュリーリース	32,600	3,250.00	105,950,000	
日本証券金融	61,100	376.00	22,973,600	貸付有価証券 6,700株
アイフル	232,100	286.00	66,380,600	貸付有価証券 109,000株(2,500株)
ポケットカード	13,800	515.00	7,107,000	貸付有価証券 900株
リコーリース	10,900	2,578.00	28,100,200	貸付有価証券 700株
イオンフィナンシャルサービス	91,000	2,092.00	190,372,000	貸付有価証券 500株
アコム	278,500	479.00	133,401,500	貸付有価証券 113,000株
ジャックス	77,000	462.00	35,574,000	貸付有価証券 1,000株
オリエントコーポレーション	599,500	185.00	110,907,500	貸付有価証券 16,600株
日立キャピタル	32,700	1,858.00	60,756,600	貸付有価証券 6,900株(1,100株)
アプラスフィナンシャル	66,500	92.00	6,118,000	貸付有価証券 31,000株
オリックス	981,800	1,256.00	1,233,140,800	貸付有価証券 41,800株
三菱UFJリース	351,700	379.00	133,294,300	
日本取引所グループ	407,100	1,116.00	454,323,600	

イー・ギャランティ	4,500	3,015.00	13,567,500	貸付有価証券 1,400株
アサックス	2,400	1,309.00	3,141,600	
NECキャピタルソ リューション	5,600	1,357.00	7,599,200	
いちごグループホール ディングス	153,500	383.00	58,790,500	貸付有価証券 58,200株
日本駐車場開発	166,700	118.00	19,670,600	貸付有価証券 77,400株(30,300株)
ヒューリック	289,000	1,028.00	297,092,000	貸付有価証券 23,500株(22,900株)
三栄建築設計	5,600	1,095.00	6,132,000	
野村不動産ホールディ ングス	92,000	1,722.00	158,424,000	
三重交通グループホール ディングス	24,600	360.00	8,856,000	貸付有価証券 8,700株
サムティ	10,000	923.00	9,230,000	貸付有価証券 4,600株(3,000株)
ディア・ライフ	9,400	307.00	2,885,800	貸付有価証券 4,300株
エー・ディー・ワークス	126,900	36.00	4,568,400	貸付有価証券 58,900株
日本商業開発	6,100	1,414.00	8,625,400	貸付有価証券 2,800株
プレサンスコーポー レーション	4,700	3,620.00	17,014,000	
ユニゾホールディングス	8,700	3,895.00	33,886,500	貸付有価証券 3,200株(1,100株)
日本管理センター	9,100	1,319.00	12,002,900	
サンセイランディック	3,200	753.00	2,409,600	貸付有価証券 1,400株
エストラスト	2,400	512.00	1,228,800	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
フージャースホールディ ングス	19,300	520.00	10,036,000	貸付有価証券 8,900株(1,200株)
オープンハウス	20,000	2,720.00	54,400,000	貸付有価証券 200株
東急不動産ホールディ ングス	335,400	613.00	205,600,200	
飯田グループホールディ ングス	128,400	2,071.00	265,916,400	貸付有価証券 2,300株
ムゲンエステート	4,000	951.00	3,804,000	貸付有価証券

				1,800株
パーク24	70,000	3,420.00	239,400,000	貸付有価証券 32,500株
パラカ	3,900	1,468.00	5,725,200	
三井不動産	735,000	2,273.00	1,670,655,000	
三菱地所	1,031,000	1,831.50	1,888,276,500	貸付有価証券 177,000株
平和不動産	26,200	1,302.00	34,112,400	
東京建物	151,400	1,175.00	177,895,000	
ダイビル	35,700	893.00	31,880,100	
京阪神ビルディング	23,000	518.00	11,914,000	
住友不動産	332,000	2,658.00	882,456,000	
大京	258,000	147.00	37,926,000	貸付有価証券 24,000株
テーオーシー	53,700	811.00	43,550,700	貸付有価証券 7,900株
東京楽天地	23,000	476.00	10,948,000	貸付有価証券 10,000株
レオパレス21	163,300	692.00	113,003,600	貸付有価証券 5,300株
スターツコーポレーション	15,900	2,034.00	32,340,600	
フジ住宅	17,700	645.00	11,416,500	貸付有価証券 7,400株
空港施設	16,800	485.00	8,148,000	
明和地所	7,600	538.00	4,088,800	
住友不動産販売	10,000	1,928.00	19,280,000	
ゴールドクレスト	10,900	1,596.00	17,396,400	貸付有価証券 800株
日本エスリード	5,400	992.00	5,356,800	
日神不動産	18,400	352.00	6,476,800	
タカラレーベン	60,500	746.00	45,133,000	貸付有価証券 16,900株（7,400株）
サンヨーハウジング名古屋	7,100	889.00	6,311,900	
イオンモール	89,500	1,286.00	115,097,000	貸付有価証券 31,800株
ファースト住建	5,200	1,164.00	6,052,800	
トーセイ	21,100	725.00	15,297,500	貸付有価証券 6,800株（500株）

穴吹興産	15,000	240.00	3,600,000	貸付有価証券 7,000株
エヌ・ティ・ティ都市開発	86,100	1,056.00	90,921,600	
サンフロンティア不動産	16,800	990.00	16,632,000	貸付有価証券 7,800株(5,800株)
エフ・ジェー・ネクスト	12,100	487.00	5,892,700	
ランドビジネス	8,200	248.00	2,033,600	
グランディハウス	12,100	309.00	3,738,900	
日本空港ビルデング	44,200	3,520.00	155,584,000	貸付有価証券 20,700株(300株)
日本工営	49,000	319.00	15,631,000	
ネクスト	41,500	898.00	37,267,000	貸付有価証券 19,500株
ジェイエイシーリクルートメント	9,000	1,626.00	14,634,000	貸付有価証券 4,100株(100株)
日本M&Aセンター	22,700	6,550.00	148,685,000	
ノバレーゼ	3,700	830.00	3,071,000	貸付有価証券 1,700株(1,000株)
アコーディア・ゴルフ	40,700	1,025.00	41,717,500	
中広	1,400	630.00	882,000	
タケエイ	12,900	860.00	11,094,000	貸付有価証券 4,300株
トラスト・テック	5,900	1,329.00	7,841,100	
パソナグループ	12,700	656.00	8,331,200	貸付有価証券 5,900株(4,500株)
CDS	3,300	777.00	2,564,100	貸付有価証券 1,500株
リンクアンドモチベーション	29,600	199.00	5,890,400	貸付有価証券 6,100株(200株)
GCAサヴィアン	13,000	833.00	10,829,000	貸付有価証券 6,000株
エス・エム・エス	18,300	2,276.00	41,650,800	貸付有価証券 8,500株(4,200株)
テンプホールディングス	102,900	1,764.00	181,515,600	貸付有価証券 2,300株
リニカル	8,600	1,643.00	14,129,800	貸付有価証券 1,300株
クックパッド	32,700	1,197.00	39,141,900	貸付有価証券 900株
エスクリ	6,200	547.00	3,391,400	貸付有価証券

				2,900株(1,900株)
アイ・ケイ・ケイ	7,800	541.00	4,219,800	貸付有価証券 1,900株
学情	5,400	1,301.00	7,025,400	貸付有価証券 2,500株
スタジオアリス	6,700	2,634.00	17,647,800	貸付有価証券 3,100株
シミックホールディングス	7,400	1,546.00	11,440,400	貸付有価証券 2,600株(2,400株)
N J S	3,000	1,128.00	3,384,000	
総合警備保障	49,000	4,915.00	240,835,000	
カカクコム	105,300	1,969.00	207,335,700	貸付有価証券 48,900株(33,700株)
ルネサンス	7,500	1,134.00	8,505,000	貸付有価証券 3,400株
ディップ	16,200	2,567.00	41,585,400	貸付有価証券 6,200株
オプトホールディング	9,200	730.00	6,716,000	
新日本科学	13,900	556.00	7,728,400	貸付有価証券 5,800株
ツクイ	17,400	1,825.00	31,755,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
キャリアデザインセンター	3,100	908.00	2,814,800	
エムスリー	127,100	3,460.00	439,766,000	貸付有価証券 51,500株
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	658.00	7,040,600	貸付有価証券 4,900株(2,200株)
アウトソーシング	6,800	4,245.00	28,866,000	貸付有価証券 1,300株
ウェルネット	11,000	2,003.00	22,033,000	貸付有価証券 600株
ディー・エヌ・エー	65,800	2,263.00	148,905,400	貸付有価証券 30,900株
博報堂D Yホールディングス	203,400	1,217.00	247,537,800	
ぐるなび	17,000	2,966.00	50,422,000	
エスアールジータカミヤ	15,800	440.00	6,952,000	貸付有価証券 7,300株
ジャパンベストレスキューシステム	18,200	217.00	3,949,400	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
ファンコミュニケーション	33,900	734.00	24,882,600	貸付有価証券

ンズ				6,400株(3,500株)
ジェイコムホールディングス	3,000	2,080.00	6,240,000	貸付有価証券 1,300株
WDBホールディングス	5,200	768.00	3,993,600	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ティア	7,000	628.00	4,396,000	貸付有価証券 500株(500株)
バリューコマース	13,500	333.00	4,495,500	
インフォマート	28,300	881.00	24,932,300	貸付有価証券 13,100株(200株)
JPHホールディングス	36,400	271.00	9,864,400	貸付有価証券 17,000株(1,400株)
EPSホールディングス	18,200	1,328.00	24,169,600	
レグス	2,800	694.00	1,943,200	
プレステージ・インターナショナル	12,300	1,447.00	17,798,100	貸付有価証券 3,500株
アミューズ	8,100	1,880.00	15,228,000	
ドリームインキュベータ	4,900	1,946.00	9,535,400	貸付有価証券 2,200株
クイック	7,500	751.00	5,632,500	貸付有価証券 3,400株
TAC	8,100	186.00	1,506,600	
ケネディクス	197,000	377.00	74,269,000	
電通	163,500	4,745.00	775,807,500	貸付有価証券 2,800株
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,800	391.00	2,658,800	貸付有価証券 3,100株
ぴあ	4,400	2,105.00	9,262,000	貸付有価証券 2,000株
イオンファンタジー	5,200	2,561.00	13,317,200	貸付有価証券 2,300株
シーティーエス	4,400	722.00	3,176,800	
ネクシィーズグループ	5,300	1,458.00	7,727,400	貸付有価証券 2,400株(1,900株)
みらかホールディングス	37,500	4,370.00	163,875,000	
アルプス技研	5,400	2,009.00	10,848,600	貸付有価証券 2,200株
ダイオーズ	2,600	952.00	2,475,200	
日本空調サービス	12,900	511.00	6,591,900	貸付有価証券 400株
オリエンタルランド	158,600	6,460.00	1,024,556,000	貸付有価証券

				73,600株(1,900株)
ダスキン	37,600	1,734.00	65,198,400	
明光ネットワークジャパン	18,200	1,239.00	22,549,800	貸付有価証券 5,400株(4,300株)
ファルコホールディングス	6,400	1,326.00	8,486,400	
秀英予備校	2,600	359.00	933,400	
田谷	2,400	674.00	1,617,600	
ラウンドワン	45,800	813.00	37,235,400	
リゾートトラスト	61,500	2,139.00	131,548,500	貸付有価証券 5,500株
ビー・エム・エル	8,600	4,810.00	41,366,000	
ワタベウェディング	4,300	405.00	1,741,500	
りらいあコミュニケーションズ	24,300	1,070.00	26,001,000	
リソー教育	27,300	376.00	10,264,800	貸付有価証券 12,600株(10,700株)
早稲田アカデミー	1,900	843.00	1,601,700	
ユー・エス・エス	177,600	1,679.00	298,190,400	貸付有価証券 79,000株
東京個別指導学院	7,100	671.00	4,764,100	貸付有価証券 100株
サイバーエージェント	38,600	6,380.00	246,268,000	貸付有価証券 14,400株(14,400株)
楽天	686,700	1,037.50	712,451,250	貸付有価証券 277,300株
テー・オー・ダブリュー	11,700	590.00	6,903,000	貸付有価証券 5,400株
セントラルスポーツ	5,000	2,336.00	11,680,000	
フルキャストホールディングス	13,400	820.00	10,988,000	
リゾートソリューション	15,000	288.00	4,320,000	
テクノプロ・ホールディングス	23,800	3,205.00	76,279,000	貸付有価証券 100株(100株)
インターワークス	2,600	1,143.00	2,971,800	
Keeper 技研	1,700	1,558.00	2,648,600	貸付有価証券 700株
ファーストロジック	800	1,880.00	1,504,000	貸付有価証券 200株
リブセンス	9,800	408.00	3,998,400	貸付有価証券 4,500株(2,400株)

ジャパンマテリアル	6,100	3,795.00	23,149,500	貸付有価証券 2,800株（100株）
ベクトル	4,500	2,740.00	12,330,000	貸付有価証券 1,200株（1,100株）
ウチヤマホールディングス	7,500	438.00	3,285,000	貸付有価証券 3,200株
サクセスホールディングス	1,400	1,177.00	1,647,800	
キャリアリンク	3,800	734.00	2,789,200	貸付有価証券 1,200株
I B J	11,400	531.00	6,053,400	貸付有価証券 1,500株
アサンテ	5,400	1,423.00	7,684,200	
N・フィールド	6,900	1,795.00	12,385,500	貸付有価証券 3,100株
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	2,123.00	3,821,400	貸付有価証券 800株
ライドオン・エクスプレス	3,200	1,249.00	3,996,800	貸付有価証券 1,400株（1,100株）
E R Iホールディングス	3,800	772.00	2,933,600	貸付有価証券 1,400株（500株）
アビスト	2,300	2,031.00	4,671,300	貸付有価証券 700株（700株）
ウィルグループ	3,300	1,010.00	3,333,000	
日本ビューホテル	2,100	1,279.00	2,685,900	貸付有価証券 500株
リクルートホールディングス	295,900	3,780.00	1,118,502,000	貸付有価証券 300株
エラン	1,600	1,133.00	1,812,800	貸付有価証券 400株
日本郵政	431,500	1,218.00	525,567,000	貸付有価証券 152,100株
ベルシステム24ホールディングス	28,700	802.00	23,017,400	貸付有価証券 11,400株
リロ・ホールディング	5,500	17,980.00	98,890,000	貸付有価証券 300株
東祥	4,400	4,420.00	19,448,000	貸付有価証券 200株
エイチ・アイ・エス	23,900	3,285.00	78,511,500	貸付有価証券 11,000株（2,300株）
ラックランド	2,100	1,541.00	3,236,100	貸付有価証券 900株

共立メンテナンス	11,000	6,580.00	72,380,000	貸付有価証券 700株
イチネンホールディングス	15,400	913.00	14,060,200	貸付有価証券 100株
建設技術研究所	8,600	779.00	6,699,400	貸付有価証券 4,000株
スペース	7,900	1,149.00	9,077,100	
燦ホールディングス	2,900	1,368.00	3,967,200	
スバル興業	10,000	378.00	3,780,000	貸付有価証券 4,000株
東京テアトル	56,000	114.00	6,384,000	
ナガワ	2,700	3,350.00	9,045,000	
よみうりランド	29,000	411.00	11,919,000	貸付有価証券 13,000株
東京都競馬	100,000	199.00	19,900,000	
常磐興産	54,000	147.00	7,938,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
カナモト	20,500	1,933.00	39,626,500	
東京ドーム	117,000	441.00	51,597,000	
西尾レントオール	11,800	2,068.00	24,402,400	貸付有価証券 500株
トランス・コスモス	17,000	2,814.00	47,838,000	貸付有価証券 4,700株
乃村工藝社	31,400	1,503.00	47,194,200	貸付有価証券 5,300株
藤田観光	53,000	399.00	21,147,000	貸付有価証券 24,000株
日本管財	12,600	1,570.00	19,782,000	
トーカイ	6,500	3,085.00	20,052,500	
白洋舎	1,500	2,406.00	3,609,000	貸付有価証券 700株
セコム	152,600	7,576.00	1,156,097,600	貸付有価証券 12,100株
セントラル警備保障	6,500	1,947.00	12,655,500	
丹青社	27,500	731.00	20,102,500	貸付有価証券 12,700株（9,400株）
メイテック	17,700	3,450.00	61,065,000	
アサツー ディ・ケイ	25,700	2,410.00	61,937,000	
応用地質	13,900	1,078.00	14,984,200	貸付有価証券 300株

	船井総研ホールディングス	20,400	1,328.00	27,091,200	貸付有価証券 800株
	進学会	7,000	513.00	3,591,000	
	オオバ	10,600	385.00	4,081,000	貸付有価証券 2,200株
	学究社	2,100	1,146.00	2,406,600	貸付有価証券 500株（300株）
	ベネッセホールディングス	49,200	2,373.00	116,751,600	貸付有価証券 22,800株
	イオンディライト	14,200	2,829.00	40,171,800	
	ナック	9,000	829.00	7,461,000	貸付有価証券 3,500株
	ニチイ学館	25,500	674.00	17,187,000	貸付有価証券 11,900株（9,100株）
	ダイセキ	27,600	1,963.00	54,178,800	
	ステップ	4,900	1,051.00	5,149,900	
小計	銘柄数：1,940			254,722,770,560	
	組入時価比率：98.3%			100.0%	
合計				254,722,770,560	

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成28年 6月28日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年 6月28日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	4,668,493,305	-	4,372,970,000	295,697,293
合計	4,668,493,305	-	4,372,970,000	295,697,293

(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28年 6月28日現在）	
資産の部	
流動資産	
預金	4,653,422,010
コール・ローン	209,669,154
株式	264,407,491,447
投資信託受益証券	21,726,461
投資証券	8,045,938,359
派生商品評価勘定	550,540
未収入金	14,416,603
未収配当金	449,089,886
差入委託証拠金	1,426,748,352
流動資産合計	279,229,052,812
資産合計	279,229,052,812
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	239,192,010
未払金	23,457,711
未払解約金	177,221,956
未払利息	330
その他未払費用	2,188,000
流動負債合計	442,060,007
負債合計	442,060,007
純資産の部	
元本等	
元本	160,391,649,821
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	118,395,342,984
元本等合計	278,786,992,805
純資産合計	278,786,992,805
負債純資産合計	279,229,052,812

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。</p>
--------------------	---

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 6月28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	1.7382円
(10,000口当たり純資産額)	(17,382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 6月30日 至 平成28年 6月28日
1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6月28日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 6月28日現在

期首	平成27年 6月30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	146,805,170,327円
同期中における追加設定元本額	37,627,104,271円
同期中における一部解約元本額	24,040,624,777円
期末元本額	160,391,649,821円

期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	64,514,528円
バランスセレクト50	197,267,747円
バランスセレクト70	189,918,569円
野村外国株式インデックスファンド	562,192,477円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,851,651,445円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	9,779,082,841円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	5,770,478,098円
野村資産設計ファンド2015	37,424,479円
野村資産設計ファンド2020	40,547,425円
野村資産設計ファンド2025	51,905,707円
野村資産設計ファンド2030	47,791,071円
野村資産設計ファンド2035	35,309,090円
野村資産設計ファンド2040	117,467,276円
野村外国株インデックス（野村投資一任口座向け）	15,631,136,962円
のむらップ・ファンド（保守型）	1,058,164,235円
のむらップ・ファンド（普通型）	5,572,199,630円
のむらップ・ファンド（積極型）	4,448,565,756円
野村資産設計ファンド2045	11,441,950円
野村インデックスファンド・外国株式	2,488,921,025円
マイ・ロード	1,726,112,462円
ネクストコア	135,058,978円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	91,859,980円
野村外国株インデックス（野村SMA・EW向け）	433,917,921円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	333,599,725円
野村資産設計ファンド2050	7,201,203円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	3,087,867円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	413,428円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	263,502円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	266,993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）	561,589,538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）	434,099,082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）	8,440,631,439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）	3,848,766,139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）	8,290,632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）	31,272,283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）	22,135,007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）	125,310,800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）	1,371,228,903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）	552,480,365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）	226,088,459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）	32,579,506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）	262,983,747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）	4,597,378,136円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	601,476,961円
野村MSCI-KOKUSAインデックスファンド（適格機関投資家専用）	895,895,426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）	229,513,782円

野村F o F s用・外国株式MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,241,593,978円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,093,035円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	16,084,527円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	13,216,855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）	56,006,081,997円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,357,488,311円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	5,398,460,378円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	6,051,624,489円
マイバランスDC30	748,418,936円
マイバランスDC50	1,310,410,244円
マイバランスDC70	985,604,653円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I	13,089,775,627円
野村DC運用戦略ファンド	200,212,343円
野村DC運用戦略ファンドM	743,491円
野村DC運用戦略ファンドA	1,973,600円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	36,244,540円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	511,956円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	628,286円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 6月28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	40,400	42.06	1,699,224.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	4,300	116.18	499,574.00	
		FMC TECHNOLOGIES INC	22,500	24.42	549,450.00	
		HALLIBURTON CO	83,200	41.88	3,484,416.00	
		HELMERICH & PAYNE	10,600	62.66	664,196.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,600	31.61	1,156,926.00	
		SCHLUMBERGER LTD	134,531	75.07	10,099,242.17	
		WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	85,000	5.29	449,650.00	
		ANADARKO PETE	49,500	49.50	2,450,250.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	14,700	26.56	390,432.00	
		APACHE CORPORATION	36,900	52.00	1,918,800.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	43,600	24.06	1,049,016.00	

CHENIERE ENERGY INC	19,500	33.75	658,125.00
CHEVRON CORP	181,900	100.36	18,255,484.00
CIMAREX ENERGY CO	9,000	109.50	985,500.00
COLUMBIA PIPELINE GROUP	38,700	25.48	986,076.00
CONCHO RESOURCES INC	12,300	115.48	1,420,404.00
CONOCOPHILLIPS	119,400	40.78	4,869,132.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	9,400	41.03	385,682.00
DEVON ENERGY CORP	44,400	33.75	1,498,500.00
EOG RESOURCES INC	53,200	78.59	4,180,988.00
EQT CORP	16,500	76.03	1,254,495.00
EXXON MOBIL CORP	401,700	88.86	35,695,062.00
HESS CORP	27,500	52.63	1,447,325.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	22.92	380,472.00
KINDER MORGAN INC	183,600	17.40	3,194,640.00
MARATHON OIL CORP	79,400	13.66	1,084,604.00
MARATHON PETROLEUM CORP	50,800	32.93	1,672,844.00
MURPHY OIL CORP	15,000	28.19	422,850.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	19,000	40.41	767,790.00
NOBLE ENERGY INC	41,100	33.99	1,396,989.00
OCCIDENTAL PETE CORP	73,800	73.12	5,396,256.00
ONEOK INC	19,800	44.62	883,476.00
PHILLIPS 66	46,000	76.90	3,537,400.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,600	146.61	2,287,116.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	24,000	9.76	234,240.00
RANGE RESOURCES CORP	16,700	42.49	709,583.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,000	12.42	471,960.00
SPECTRA ENERGY CORP	65,300	34.54	2,255,462.00
TESORO CORP	11,300	72.16	815,408.00
VALERO ENERGY CORP	45,600	51.13	2,331,528.00
WILLIAMS COS	69,500	20.00	1,390,000.00
AIR PRODUCTS	19,840	134.82	2,674,828.80
ALBEMARLE CORP	11,100	75.34	836,274.00
ASHLAND INC	5,900	110.77	653,543.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,300	25.38	439,074.00
CELANESE CORP-SERIES A	14,300	61.51	879,593.00

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,900	23.48	537,692.00
DOW CHEM CO	108,000	49.97	5,396,760.00
DU PONT E I DE NEMOURS	84,600	64.08	5,421,168.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	14,200	65.81	934,502.00
ECOLAB INC	25,600	114.47	2,930,432.00
FMC CORP	13,200	42.21	557,172.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	7,700	119.56	920,612.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	35,600	71.32	2,538,992.00
MONSANTO CO	42,700	99.98	4,269,146.00
MOSAIC CO/THE	31,300	24.69	772,797.00
PPG INDUSTRIES	25,800	98.69	2,546,202.00
PRAXAIR INC	27,600	107.01	2,953,476.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,600	280.32	2,130,432.00
VALSPAR CORP	7,200	107.06	770,832.00
WR GRACE & CO	6,700	71.68	480,256.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,910	179.24	1,059,308.40
VULCAN MATERIALS CO	12,800	113.84	1,457,152.00
AVERY DENNISON CORP	8,700	71.11	618,657.00
BALL CORP	13,000	68.34	888,420.00
CROWN HOLDINGS INC	13,300	48.36	643,188.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	37,600	39.64	1,490,464.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	8,900	62.89	559,721.00
SEALED AIR CORP	19,200	43.55	836,160.00
WESTROCK CO	24,300	35.87	871,641.00
ALCOA INC	125,000	9.10	1,137,500.00
FREEMONT-MCMORAN INC	115,000	10.13	1,164,950.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	51,700	37.69	1,948,573.00
NUCOR CORP	30,700	46.31	1,421,717.00
B/E AEROSPACE INC	10,100	42.73	431,573.00
BOEING CO	60,900	122.70	7,472,430.00
GENERAL DYNAMICS	25,730	133.06	3,423,633.80
HONEYWELL INTERNATIONAL	70,600	111.46	7,869,076.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	7,700	140.11	1,078,847.00
LOCKHEED MARTIN	26,610	239.29	6,367,506.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,600	214.15	3,554,890.00

RAYTHEON COMPANY	29,100	134.80	3,922,680.00
ROCKWELL COLLINS INC	12,800	81.15	1,038,720.00
TEXTRON INC	26,400	34.32	906,048.00
TRANSDIGM GROUP INC	5,230	251.86	1,317,227.80
UNITED TECHNOLOGIES	76,900	97.21	7,475,449.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	15,300	55.11	843,183.00
MASCO CORP	32,900	29.28	963,312.00
SMITH (A.O.) CORP	7,200	81.85	589,320.00
FLUOR CORP	13,900	46.14	641,346.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,300	47.65	586,095.00
ACUITY BRANDS INC	4,170	232.92	971,276.40
AMETEK INC	23,300	43.88	1,022,404.00
EATON CORP PLC	44,500	55.57	2,472,865.00
EMERSON ELEC	62,300	49.23	3,067,029.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,900	108.11	1,394,619.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16,900	32.07	541,983.00
3M CORP	58,540	167.19	9,787,302.60
DANAHER CORP	59,500	97.32	5,790,540.00
GENERAL ELEC CO	902,500	29.32	26,461,300.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	23,400	54.57	1,276,938.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,600	164.77	1,581,792.00
AGCO CORP	6,300	45.51	286,713.00
CATERPILLAR INC DEL	56,300	71.38	4,018,694.00
CUMMINS INC	16,100	105.75	1,702,575.00
DEERE & COMPANY	26,000	80.58	2,095,080.00
DOVER CORP	15,300	64.60	988,380.00
FLOWSERVE CORP	12,300	43.00	528,900.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	31,700	98.70	3,128,790.00
INGERSOLL-RAND PLC	25,100	59.18	1,485,418.00
PACCAR	34,100	48.88	1,666,808.00
PARKER HANNIFIN CORP	13,200	100.53	1,326,996.00
PENTAIR PLC	16,700	56.28	939,876.00
SNAP-ON INC	5,460	148.03	808,243.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,500	104.24	1,511,480.00
WABCO HOLDINGS INC	5,200	89.87	467,324.00

WABTEC CORP	9,000	67.16	604,440.00
XYLEM INC	17,000	42.72	726,240.00
AERCAP HOLDINGS NV	16,500	31.55	520,575.00
FASTENAL CO	27,900	42.70	1,191,330.00
GRAINGER(W.W.) INC	5,670	216.21	1,225,910.70
UNITED RENTALS INC	8,600	62.27	535,522.00
CINTAS CORP	8,400	91.63	769,692.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	22,900	49.39	1,131,031.00
STERICYCLE INC	8,100	99.17	803,277.00
TYCO INTERNATIONAL PLC	40,300	40.22	1,620,866.00
WASTE CONNECTIONS INC	16,707	69.46	1,160,468.22
WASTE MANAGEMENT INC	42,800	63.65	2,724,220.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,700	72.18	988,866.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	17,700	47.07	833,139.00
FEDEX CORPORATION	25,360	146.13	3,705,856.80
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	66,800	103.77	6,931,836.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,800	25.27	373,996.00
DELTA AIR LINES INC	19,100	33.36	637,176.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	36.76	562,428.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	8,800	37.75	332,200.00
AMERCO	680	361.00	245,480.00
CSX CORP	93,200	24.48	2,281,536.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,700	76.92	669,204.00
KANSAS CITY SOUTHERN	10,600	84.53	896,018.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,700	79.68	2,286,816.00
UNION PAC CORP	81,900	82.49	6,755,931.00
AUTOLIV INC	8,500	107.46	913,410.00
BORGWARNER INC	21,300	27.69	589,797.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	26,900	59.06	1,588,714.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	25,200	24.53	618,156.00
JOHNSON CONTROLS INC	61,900	41.33	2,558,327.00
LEAR CORP	7,400	97.71	723,054.00
FORD MOTOR COMPANY	358,000	12.16	4,353,280.00
GENERAL MOTORS CO	134,600	27.51	3,702,846.00
HARLEY-DAVIDSON INC	17,900	42.39	758,781.00

TESLA MOTORS INC	9,540	198.55	1,894,167.00
DR HORTON INC	34,000	29.48	1,002,320.00
GARMIN LTD	11,400	39.68	452,352.00
HARMAN INTERNATIONAL	7,000	66.22	463,540.00
LEGGETT & PLATT INC	13,400	47.89	641,726.00
LENNAR CORP-A	16,800	43.74	734,832.00
MOHAWK INDUSTRIES	6,020	177.96	1,071,319.20
NEWELL BRANDS INC	42,740	45.08	1,926,719.20
PULTEGROUP INC	29,500	18.01	531,295.00
TOLL BROTHERS INC	16,400	25.46	417,544.00
WHIRLPOOL CORP	7,500	154.46	1,158,450.00
HASBRO INC	10,800	80.61	870,588.00
MATTEL INC	33,400	28.89	964,926.00
POLARIS INDUSTRIES INC	6,200	78.21	484,902.00
COACH INC	26,500	37.41	991,365.00
HANESBRANDS INC	37,700	25.42	958,334.00
LULULEMON ATHLETICA INC	10,600	69.00	731,400.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	17,900	46.19	826,801.00
NIKE INC-B	130,600	51.89	6,776,834.00
PVH CORP	8,000	84.91	679,280.00
RALPH LAUREN CORPORATION	5,800	87.38	506,804.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	17,100	35.92	614,232.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17,221	31.90	549,349.90
V F CORP	33,100	58.29	1,929,399.00
ARAMARK	21,600	31.64	683,424.00
CARNIVAL CORP	40,300	43.64	1,758,692.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,920	388.78	1,135,237.60
DARDEN RESTAURANTS INC	11,800	64.94	766,292.00
DOMINOS PIZZA INC	4,800	122.08	585,984.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	52,500	21.13	1,109,325.00
LAS VEGAS SANDS CORP	42,300	41.82	1,768,986.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	19,900	61.21	1,218,079.00
MCDONALD'S CORP	87,200	116.30	10,141,360.00
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,400	12.06	221,904.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	42,300	21.54	911,142.00

NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	15,000	38.21	573,150.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,900	65.95	1,114,555.00
STARBUCKS CORP	143,000	53.69	7,677,670.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	16,200	69.64	1,128,168.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,900	65.40	712,860.00
WYNN RESORTS LTD	7,700	87.69	675,213.00
YUM BRANDS INC	39,600	79.33	3,141,468.00
CBS CORP-CL B	40,900	50.89	2,081,401.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	20,826	216.28	4,504,247.28
COMCAST CORP-CL A	235,400	62.46	14,703,084.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	14,300	23.73	339,339.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	23,500	22.54	529,690.00
DISH NETWORK CORP-A	22,000	49.60	1,091,200.00
DISNEY (WALT) CO	149,900	94.38	14,147,562.00
INTERPUBRIC GROUP	39,200	22.26	872,592.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	60,000	26.71	1,602,600.00
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - A	3,431	32.95	113,051.45
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	7,486	32.71	244,867.06
LIBERTY GLOBAL PLC-A	27,500	26.99	742,225.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	19,300	29.29	565,297.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	8,170	29.49	240,933.30
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	37,400	10.62	397,188.00
OMNICOM GROUP	23,100	77.57	1,791,867.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,800	59.41	463,398.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	199,000	3.76	748,240.00
TEGNA INC	20,600	21.77	448,462.00
TIME WARNER INC	76,500	69.21	5,294,565.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	108,500	26.37	2,861,145.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	42,800	26.26	1,123,928.00
VIACOM INC-CLASS B	34,100	38.88	1,325,808.00
GENUINE PARTS CO	14,500	95.31	1,381,995.00
LKQ CORP	30,000	29.52	885,600.00
AMAZON.COM INC	38,700	691.36	26,755,632.00
EXPEDIA INC	11,700	98.44	1,151,748.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	42,300	23.81	1,007,163.00

QVC GR-A			
NETFLIX INC	41,400	85.33	3,532,662.00
PRICELINE GROUP INC/THE	4,800	1,186.05	5,693,040.00
TRIPADVISOR INC	11,500	60.03	690,345.00
DOLLAR GENERAL CORP	28,100	93.51	2,627,631.00
DOLLAR TREE INC	22,700	92.56	2,101,112.00
KOHL'S CORP	18,500	36.50	675,250.00
MACYS INC	30,400	31.71	963,984.00
NORDSTROM INC	12,700	36.20	459,740.00
TARGET CORP	55,400	69.45	3,847,530.00
ADVANCE AUTO PARTS	7,150	153.78	1,099,527.00
AUTONATION INC	7,100	46.07	327,097.00
AUTOZONE	2,940	767.65	2,256,891.00
BED BATH & BEYOND	15,600	41.86	653,016.00
BEST BUY COMPANY INC	28,400	29.37	834,108.00
CARMAX INC	19,300	45.70	882,010.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,300	40.07	332,581.00
FOOT LOCKER INC	13,400	51.79	693,986.00
GAP INC	22,900	20.07	459,603.00
HOME DEPOT	122,500	124.67	15,272,075.00
L BRANDS, INC	24,000	65.26	1,566,240.00
LOWES COS INC	88,100	76.32	6,723,792.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,420	267.73	2,522,016.60
ROSS STORES INC	39,400	54.75	2,157,150.00
SIGNET JEWELERS LTD	7,100	79.26	562,746.00
STAPLES INC	62,000	8.07	500,340.00
TIFFANY & CO	12,700	57.48	729,996.00
TJX COS INC	64,300	73.53	4,727,979.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13,000	92.90	1,207,700.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,940	235.04	1,396,137.60
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	42,360	154.26	6,534,453.60
CVS HEALTH CORP	106,300	93.24	9,911,412.00
KROGER CO	89,000	36.62	3,259,180.00
RITE AID CORP	100,000	7.55	755,000.00
SYSCO CORP	52,000	49.71	2,584,920.00
	154,500	71.50	11,046,750.00

WAL-MART STORES INC			
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	88,600	79.39	7,033,954.00
WHOLE FOODS MARKET INC	31,600	31.25	987,500.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	10,800	94.02	1,015,416.00
COCA COLA CO	397,900	43.78	17,420,062.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,800	153.10	2,572,080.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	18,100	95.85	1,734,885.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	18,000	96.18	1,731,240.00
MONSTER BEVERAGE CORP	13,730	154.81	2,125,541.30
PEPSICO INC	139,800	102.13	14,277,774.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	57,700	39.14	2,258,378.00
BUNGE LIMITED	13,800	57.16	788,808.00
CAMPBELL SOUP CO	19,500	63.57	1,239,615.00
CONAGRA INC	40,000	46.96	1,878,400.00
GENERAL MILLS	57,500	66.19	3,805,925.00
HERSHEY CO/THE	14,300	97.21	1,390,103.00
HORMEL FOODS CORP	27,600	35.81	988,356.00
INGREDION INC	6,900	122.14	842,766.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	11,600	146.75	1,702,300.00
KELLOGG CO	25,700	76.83	1,974,531.00
KRAFT HEINZ CO/THE	58,600	83.63	4,900,718.00
MCCORMICK & CO INC.	11,300	101.65	1,148,645.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	18,100	84.39	1,527,459.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	151,800	41.38	6,281,484.00
TYSON FOODS INC-CL A	28,500	65.24	1,859,340.00
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	17,500	43.34	758,450.00
ALTRIA GROUP INC	188,900	67.93	12,831,977.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	149,700	98.20	14,700,540.00
REYNOLDS AMERICAN INC	82,500	52.01	4,290,825.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,800	98.74	1,263,872.00
CLOROX CO	12,600	137.03	1,726,578.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	82,100	69.99	5,746,179.00
KIMBERLY-CLARK CORP	35,100	130.75	4,589,325.00
PROCTER & GAMBLE CO	261,600	81.23	21,249,768.00
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,800	78.32	454,256.00

ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,600	87.24	1,884,384.00
ABBOTT LABORATORIES	142,600	36.95	5,269,070.00
BARD (C R)	7,030	225.03	1,581,960.90
BAXTER INTERNATIONAL INC.	47,800	42.35	2,024,330.00
BECTON,DICKINSON	20,410	163.01	3,327,034.10
BOSTON SCIENTIFIC CORP	130,600	21.98	2,870,588.00
DENTSPLY SIRONA INC	22,900	59.36	1,359,344.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,800	94.53	1,966,224.00
HOLOGIC INC	24,700	32.93	813,371.00
IDEXX LABORATORIES INC	8,600	86.62	744,932.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,560	629.90	2,242,444.00
MEDTRONIC PLC	136,200	82.38	11,220,156.00
RESMED INC	13,200	59.22	781,704.00
ST JUDE MEDICAL INC	27,000	76.12	2,055,240.00
STRYKER CORP	32,500	114.78	3,730,350.00
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,700	162.99	766,053.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,500	78.04	741,380.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,400	115.34	2,122,256.00
AETNA INC	33,700	115.56	3,894,372.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,800	73.85	1,388,380.00
ANTHEM INC	25,250	124.85	3,152,462.50
CARDINAL HEALTH INC	31,700	73.69	2,335,973.00
CENTENE CORP	16,100	67.73	1,090,453.00
CIGNA CORP	24,920	122.09	3,042,482.80
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	16,000	73.78	1,180,480.00
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	18,800	25.12	472,256.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	64,700	73.21	4,736,687.00
HCA HOLDINGS INC	30,800	74.43	2,292,444.00
HENRY SCHEIN INC	8,060	167.75	1,352,065.00
HUMANA INC	14,370	176.94	2,542,627.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,900	125.53	1,242,747.00
MCKESSON CORP	22,140	172.63	3,822,028.20
MEDNAX INC	9,100	68.02	618,982.00
PATTERSON COS INC	8,700	45.67	397,329.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	14,100	77.58	1,093,878.00

UNITEDHEALTH GROUP INC	91,800	137.11	12,586,698.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,700	129.36	1,125,432.00
ABBVIE INC	155,900	58.68	9,148,212.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,820	111.89	2,441,439.80
ALKERMES PLC	13,800	40.01	552,138.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,200	52.50	378,000.00
AMGEN INC	72,690	144.58	10,509,520.20
BIOGEN INC	21,170	224.60	4,754,782.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,300	74.61	1,141,533.00
CELGENE CORP	75,600	94.85	7,170,660.00
GILEAD SCIENCES INC	132,200	78.25	10,344,650.00
INCYTE CORP	16,000	72.44	1,159,040.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12,100	20.62	249,502.00
MEDIVATION INC	15,400	56.61	871,794.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,450	331.05	2,466,322.50
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,340	98.33	426,752.20
VERTEX PHARMACEUTICALS	24,000	79.84	1,916,160.00
ALLERGAN PLC	38,170	217.48	8,301,211.60
BRISTOL MYERS SQUIBB	161,400	70.32	11,349,648.00
ELI LILLY & CO.	96,500	74.89	7,226,885.00
ENDO INTERNATIONAL PLC	20,500	13.69	280,645.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,800	132.61	769,138.00
JOHNSON & JOHNSON	266,900	116.55	31,107,195.00
MALLINCKRODT PLC	11,100	54.05	599,955.00
MERCK & CO INC	268,500	55.31	14,850,735.00
MYLAN NV	40,400	41.81	1,689,124.00
PERRIGO CO PLC	13,950	87.75	1,224,112.50
PFIZER INC	596,500	33.80	20,161,700.00
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	1,500	137.76	206,640.00
ZOETIS INC	46,000	45.42	2,089,320.00
BANK OF AMERICA CORP	998,900	12.18	12,166,602.00
BB&T CORPORATION	78,600	33.05	2,597,730.00
CIT GROUP INC	19,400	28.45	551,930.00
CITIGROUP	285,200	38.48	10,974,496.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,100	18.44	923,844.00

COMERICA INC	17,300	36.96	639,408.00
FIFTH THIRD BANCORP	76,700	16.26	1,247,142.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,700	64.25	880,225.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,000	8.09	606,750.00
JPMORGAN CHASE & CO	355,000	57.61	20,451,550.00
KEYCORP	81,000	10.29	833,490.00
M & T BANK CORP	13,900	108.78	1,512,042.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	30,500	13.84	422,120.00
PNC FINANCIAL	48,700	77.88	3,792,756.00
REGIONS FINANCIAL CORP	126,000	7.91	996,660.00
SIGNATURE BANK	4,890	114.99	562,301.10
SUNTRUST BKS INC.	49,000	37.84	1,854,160.00
US BANCORP	168,100	38.69	6,503,789.00
WELLS FARGO CO	466,500	45.01	20,997,165.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	115,200	138.50	15,955,200.00
CME GROUP INC	32,700	92.97	3,040,119.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	11,450	242.21	2,773,304.50
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,200	15.65	503,930.00
MOODYS CORP	16,900	87.88	1,485,172.00
MSCI INC	9,300	71.86	668,298.00
NASDAQ INC	11,100	61.43	681,873.00
S&P GLOBAL INC	25,800	99.38	2,564,004.00
VOYA FINANCIAL INC	20,300	23.64	479,892.00
AFLAC INC	40,800	67.33	2,747,064.00
ALLEGHANY CORP	1,510	513.45	775,309.50
ALLSTATE CORP	36,700	66.06	2,424,402.00
AMERICAN INTL GROUP	111,300	48.79	5,430,327.00
AON PLC	26,300	100.80	2,651,040.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,100	67.54	817,234.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,800	44.06	740,208.00
ASSURANT INC	6,200	81.01	502,262.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,500	51.53	489,535.00
CHUBB LTD	44,600	121.83	5,433,618.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,700	69.46	1,021,062.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,020	169.21	680,224.20

FNF GROUP	24,400	34.26	835,944.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	38,500	40.98	1,577,730.00
LINCOLN NATIONAL CORP	23,400	35.50	830,700.00
LOEWS CORP	27,900	38.34	1,069,686.00
MARKEL CORP	1,360	910.65	1,238,484.00
MARSH & MCLENNAN COS	50,100	63.73	3,192,873.00
METLIFE INC	90,300	36.53	3,298,659.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	28,000	38.14	1,067,920.00
PROGRESSIVE CO	56,900	31.36	1,784,384.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	43,200	66.93	2,891,376.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,200	111.69	469,098.00
TORCHMARK CORP	11,200	57.68	646,016.00
TRAVELERS COS INC/THE	28,600	110.35	3,156,010.00
UNUM GROUP	22,700	29.99	680,773.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,700	113.40	1,440,180.00
WR BERKLEY CORP	9,900	55.06	545,094.00
XL GROUP PLC	28,800	30.67	883,296.00
CBRE GROUP INC	29,600	24.88	736,448.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,000	5.95	678,300.00
JONES LANG LASALLE INC	4,210	99.15	417,421.50
REALOGY HOLDINGS CORP	14,000	27.73	388,220.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	16,700	51.16	854,372.00
ALPHABET INC-CL A	28,290	681.14	19,269,450.60
ALPHABET INC-CL C	30,040	668.26	20,074,530.40
EBAY INC	108,300	22.72	2,460,576.00
FACEBOOK INC-A	221,900	108.97	24,180,443.00
LINKEDIN CORP - A	11,300	189.44	2,140,672.00
TWITTER INC	54,000	15.84	855,360.00
VERISIGN INC	9,600	80.84	776,064.00
YAHOO! INC	86,900	35.22	3,060,618.00
ZILLOW GROUP INC - C	10,900	32.81	357,629.00
ACCENTURE PLC-CL A	60,700	109.29	6,633,903.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,760	186.40	1,073,664.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	44,400	85.66	3,803,304.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	11,400	61.60	702,240.00

INC				
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	58,800	55.48	3,262,224.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	29,800	68.36	2,037,128.00	
FISERV INC	21,600	102.45	2,212,920.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,960	134.67	1,206,643.20	
GARTNER INC	8,100	92.37	748,197.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	14,900	67.48	1,005,452.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	88,310	143.50	12,672,485.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	94,900	89.07	8,452,743.00	
PAYCHEX INC	31,700	54.27	1,720,359.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	105,700	34.20	3,614,940.00	
SABRE CORP	20,000	25.30	506,000.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,300	49.25	802,775.00	
VANTIV INC - CL A	15,100	52.35	790,485.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	185,700	73.34	13,619,238.00	
WESTERN UNION CO	49,100	18.11	889,201.00	
XEROX CORP	84,000	8.96	752,640.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	56,600	36.15	2,046,090.00	
ADOBE SYSTEMS INC.	47,900	90.85	4,351,715.00	
ANSYS INC	8,400	85.09	714,756.00	
AUTODESK INC.	19,900	50.54	1,005,746.00	
CA INC	30,900	31.26	965,934.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	29,100	23.07	671,337.00	
CDK GLOBAL INC	12,800	53.04	678,912.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	12,700	77.07	978,789.00	
CITRIX SYSTEMS INC	14,900	77.02	1,147,598.00	
ELECTRONIC ARTS	29,600	71.50	2,116,400.00	
FORTINET INC	13,900	29.97	416,583.00	
INTUIT INC	23,600	104.18	2,458,648.00	
MICROSOFT CORP	726,700	48.43	35,194,081.00	
MOBILEYE NV	17,000	39.79	676,430.00	
NETSUITE INC	3,900	67.36	262,704.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	25,000	14.72	368,000.00	
ORACLE CORPORATION	304,900	38.48	11,732,552.00	
RED HAT INC	17,800	70.14	1,248,492.00	

SALESFORCE.COM INC	61,000	76.07	4,640,270.00
SERVICENOW INC	15,500	63.67	986,885.00
SPLUNK INC	12,800	50.97	652,416.00
SYMANTEC CORP	63,400	19.95	1,264,830.00
SYNOPSYS INC	14,900	51.33	764,817.00
VMWARE INC - CLASS A	7,400	55.34	409,516.00
WORKDAY INC-CLASS A	10,700	69.46	743,222.00
CISCO SYSTEMS	486,800	27.31	13,294,508.00
F5 NETWORKS INC	6,700	108.64	727,888.00
HARRIS CORP	11,900	78.49	934,031.00
JUNIPER NETWORKS INC	33,500	21.24	711,540.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,100	63.08	952,508.00
PALO ALTO NETWORKS INC	8,550	116.76	998,298.00
APPLE INC	536,200	92.04	49,351,848.00
EMC CORP	187,300	27.04	5,064,592.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	168,600	17.20	2,899,920.00
HP INC	167,000	11.55	1,928,850.00
NETAPP INC	27,900	22.96	640,584.00
SEAGATE TECHNOLOGY	29,000	20.87	605,230.00
WESTERN DIGITAL CORP	26,630	42.18	1,123,253.40
AMPHENOL CORP-CL A	29,600	55.52	1,643,392.00
ARROW ELECTRS INC	8,900	60.01	534,089.00
AVNET	12,200	38.92	474,824.00
CDW CORPORATION	14,100	39.29	553,989.00
CORNING INC	107,900	19.06	2,056,574.00
FLEXTRONICS INTL LTD	55,000	11.69	642,950.00
FLIR SYSTEMS INC	12,600	29.08	366,408.00
TE CONNECTIVITY LTD	35,800	54.83	1,962,914.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,200	24.07	558,424.00
ANALOG DEVICES INC	30,400	52.55	1,597,520.00
APPLIED MATERIALS	109,600	22.29	2,442,984.00
BROADCOM LTD	37,750	143.63	5,422,032.50
INTEL CORP	456,100	30.72	14,011,392.00
KLA TENCOR CORP	15,000	71.27	1,069,050.00
LAM RESEARCH	15,400	79.96	1,231,384.00

LINEAR TECHNOLOGY CORP	22,500	44.09	992,025.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	41,000	9.12	373,920.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,100	33.84	917,064.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	20,700	48.13	996,291.00	
MICRON TECHNOLOGY	101,000	12.23	1,235,230.00	
NVIDIA CORP	52,200	45.24	2,361,528.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,474	75.04	2,136,688.96	
QORVO INC	13,400	50.69	679,246.00	
QUALCOMM INC	145,000	51.14	7,415,300.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,200	58.01	1,055,782.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	97,300	59.07	5,747,511.00	
XILINX INC	25,000	43.84	1,096,000.00	
AT & T INC	594,300	42.03	24,978,429.00	
CENTURYLINK INC	53,000	26.82	1,421,460.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	114,000	4.60	524,400.00	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	29,000	47.43	1,375,470.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	12,100	100.98	1,221,858.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	394,000	54.74	21,567,560.00	
SPRINT CORP	71,000	4.19	297,490.00	
T-MOBILE US INC	27,100	41.20	1,116,520.00	
ALLIANT ENERGY CORP	21,600	39.85	860,760.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,500	68.35	3,246,625.00	
DUKE ENERGY CORP	66,600	83.99	5,593,734.00	
EDISON INTERNATIONAL	31,800	76.45	2,431,110.00	
ENTERGY CORP	17,400	78.91	1,373,034.00	
EVERSOURCE ENERGY	30,900	58.59	1,810,431.00	
EXELON CORPORATION	89,400	34.59	3,092,346.00	
FIRSTENERGY CORP	40,300	33.11	1,334,333.00	
NEXTERA ENERGY INC	44,500	127.88	5,690,660.00	
OGE ENERGY CORP	19,600	31.07	608,972.00	
PG&E CORP	47,300	63.17	2,987,941.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	10,500	79.13	830,865.00	
PPL CORPORATION	65,400	36.57	2,391,678.00	
SOUTHERN CO.	88,300	52.20	4,609,260.00	
WESTAR ENERGY INC	13,600	55.79	758,744.00	

XCEL ENERGY INC	48,300	43.72	2,111,676.00
AGL RESOURCES INC	11,500	66.01	759,115.00
ATMOS ENERGY CORP	9,700	77.87	755,339.00
UGI CORP	16,500	44.06	726,990.00
AMEREN CORPORATION	23,100	52.31	1,208,361.00
CENTERPOINT ENERGY INC	38,900	23.17	901,313.00
CMS ENERGY CORP	27,300	44.94	1,226,862.00
CONSOLIDATED EDISON INC	28,600	79.73	2,280,278.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	57,200	74.95	4,287,140.00
DTE ENERGY COMPANY	17,000	96.49	1,640,330.00
NISOURCE INC	30,800	25.40	782,320.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	49,300	44.42	2,189,906.00
SCANA CORP	13,100	73.39	961,409.00
SEMPRA ENERGY	23,000	111.39	2,561,970.00
TECO ENERGY INC	22,400	27.65	619,360.00
WEC ENERGY GROUP INC	30,200	64.48	1,947,296.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,100	81.71	1,397,241.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	47,100	14.40	678,240.00
ALLY FINANCIAL INC	42,100	14.90	627,290.00
AMERICAN EXPRESS CO	79,300	57.67	4,573,231.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51,100	58.15	2,971,465.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	40,200	50.71	2,038,542.00
NAVIENT CORP	33,900	11.01	373,239.00
SYNCHRONY FINANCIAL	80,500	23.36	1,880,480.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,200	132.73	690,196.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,400	85.52	1,402,528.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	104,200	35.88	3,738,696.00
BLACKROCK INC	11,900	319.54	3,802,526.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	27,500	21.83	600,325.00
EATON VANCE CORP	11,700	33.11	387,387.00
FRANKLIN RESOURCES INC	37,800	30.67	1,159,326.00
GOLDMAN SACHS GROUP	36,790	139.51	5,132,572.90
INVESCO LTD	40,500	23.16	937,980.00
MORGAN STANLEY	142,100	23.61	3,354,981.00
NORTHERN TRUST CORP	21,400	61.67	1,319,738.00

	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,000	47.01	564,120.00	
	SCHWAB(CHARLES)CORP	114,800	24.05	2,760,940.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	12,900	44.43	573,147.00	
	STATE STREET CORP	38,800	50.79	1,970,652.00	
	T ROWE PRICE GROUP INC	24,000	67.62	1,622,880.00	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,400	26.68	677,672.00	
	H & R BLOCK INC	22,400	21.73	486,752.00	
	AES CORP	65,000	11.41	741,650.00	
	CALPINE CORP	31,000	13.41	415,710.00	
	NRG ENERGY INC	29,400	13.32	391,608.00	
	CERNER CORP	29,300	53.71	1,573,703.00	
	IMS HEALTH HOLDINGS INC	16,300	23.72	386,636.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	31,800	42.26	1,343,868.00	
	ILLUMINA INC	14,270	135.48	1,933,299.60	
	METTLER-TOLEDO INTL	2,620	348.52	913,122.40	
	QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	8,800	61.32	539,616.00	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,360	140.93	5,406,074.80	
	WATERS CORP	8,000	132.50	1,060,000.00	
	DUN & BRADSTREET CORP	3,600	116.68	420,048.00	
	EQUIFAX INC	11,300	118.63	1,340,519.00	
	IHS INC-CLASS A	6,600	107.85	711,810.00	
	MANPOWERGROUP INC	7,000	60.34	422,380.00	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	35,000	50.17	1,755,950.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	13,300	34.57	459,781.00	
	VERISK ANALYTICS INC	15,200	76.00	1,155,200.00	
小計	銘柄数：595			1,709,828,028.14	
				(173,769,822,499)	
	組入時価比率：62.3%			65.8%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	14,100	30.33	427,653.00	
	ARC RESOURCES LTD	33,500	20.24	678,040.00	
	CAMECO CORP	38,600	13.99	540,014.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	106,300	37.66	4,003,258.00	
	CENOVUS ENERGY INC	79,000	17.04	1,346,160.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	48,800	19.12	933,056.00	
	ENBRIDGE INC	88,300	53.67	4,739,061.00	

ENCANA CORP	79,000	9.57	756,030.00
HUSKY ENERGY INC	35,745	14.55	520,089.75
IMPERIAL OIL	28,300	38.86	1,099,738.00
INTER PIPELINE LTD	33,100	26.08	863,248.00
KEYERA CORP	17,800	36.58	651,124.00
PEMBINA PIPELINE CORP	36,200	37.59	1,360,758.00
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	15,100	33.32	503,132.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	20,726	23.66	490,377.16
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	18,800	24.13	453,644.00
SUNCOR ENERGY INC	160,960	34.33	5,525,756.80
TOURMALINE OIL CORP	19,400	30.97	600,818.00
TRANSCANADA CORP	68,800	57.28	3,940,864.00
VERESEN INC	29,000	10.23	296,670.00
VERMILION ENERGY INC	10,500	39.59	415,695.00
AGRIUM INC	12,600	115.89	1,460,214.00
METHANEX CORP	8,200	36.55	299,710.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	81,800	20.66	1,689,988.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,660	226.86	603,447.60
AGNICO EAGLE MINES LTD	20,600	68.81	1,417,486.00
BARRICK GOLD	113,000	27.60	3,118,800.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	70,800	5.84	413,472.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,400	8.24	580,096.00
FRANCO-NEVADA CORP	17,300	94.83	1,640,559.00
GOLDCORP INC	80,000	24.05	1,924,000.00
KINROSS GOLD CORP	118,600	6.74	799,364.00
SILVER WHEATON CORP	42,000	28.75	1,207,500.00
TECK RESOURCES LTD	58,200	14.91	867,762.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	98,000	4.09	400,820.00
YAMANA GOLD INC	97,000	6.64	644,080.00
WEST FRASER TIMBER	6,800	36.22	246,296.00
BOMBARDIER B SHEARS	189,000	1.81	342,090.00
CAE INC	26,000	15.73	408,980.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,500	51.73	750,085.00
FINNING INTERNATIONAL INC	14,900	20.97	312,453.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	76,900	73.73	5,669,837.00

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	14,000	158.18	2,214,520.00
LINAMAR CORP	4,800	44.43	213,264.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	38,800	44.00	1,707,200.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	23,100	35.42	818,202.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,400	52.15	1,116,010.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	40,400	24.78	1,001,112.00
THOMSON REUTERS CORP	33,000	50.36	1,661,880.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,000	136.98	958,860.00
DOLLARAMA INC	11,500	88.02	1,012,230.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	40,100	52.51	2,105,651.00
EMPIRE CO LTD A	16,200	21.40	346,680.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	19.45	182,830.00
LOBLAW COMPANIES	21,400	68.23	1,460,122.00
METRO INC	23,200	44.68	1,036,576.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,800	110.43	530,064.00
SAPUTO INC	23,900	37.66	900,074.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	31,300	24.50	766,850.00
BANK OF MONTREAL	61,800	80.26	4,960,068.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	116,200	62.80	7,297,360.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	38,300	98.96	3,790,168.00
NATIONAL BANK OF CANADA	33,400	43.35	1,447,890.00
ROYAL BANK OF CANADA	143,900	75.20	10,821,280.00
TORONTO DOMINION BANK	178,900	54.51	9,751,839.00
ELEMENT FINANCIAL CORP	36,000	13.30	478,800.00
ONEX CORP	8,000	79.17	633,360.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,170	677.80	1,470,826.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	28,000	32.71	915,880.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,900	39.00	386,100.00
INTACT FINANCIAL CORP	12,700	88.78	1,127,506.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	191,800	16.47	3,158,946.00
POWER CORPORATION OF CANADA	35,000	26.77	936,950.00
POWER FINANCIAL CORP	24,300	29.23	710,289.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	58,800	40.28	2,368,464.00
	86,100	41.98	3,614,478.00

	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A				
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,300	21.81	246,453.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	21,400	53.85	1,152,390.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,790	498.31	891,974.90	
	OPEN TEXT CORP	12,100	75.00	907,500.00	
	BLACKBERRY LTD	50,900	8.24	419,416.00	
	BCE INC	14,100	60.17	848,397.00	
	TELUS CORP	19,300	41.05	792,265.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	34,800	50.85	1,769,580.00	
	FORTIS INC	27,300	42.86	1,170,078.00	
	HYDRO ONE LTD	17,300	25.32	438,036.00	
	ATCO LTD CL1	6,800	44.35	301,580.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	12,400	36.65	454,460.00	
	CI FINANCIAL CORP	24,200	26.36	637,912.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	34.87	359,161.00	
	小計銘柄数：90			137,233,758.21	
				(10,672,669,375)	
	組入時価比率：3.8%			4.0%	
ユ-口	SAIPEM SPA	549,700	0.34	187,502.67	
	TECHNIP SA	10,500	45.85	481,425.00	
	TENARIS SA	46,000	12.09	556,140.00	
	ENI SPA	244,800	13.23	3,238,704.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	44,500	11.52	512,640.00	
	NESTE OYJ	12,500	29.45	368,125.00	
	OMV AG	14,000	23.91	334,740.00	
	REPSOL SA	104,318	10.20	1,064,565.19	
	REPSOL SA-RTS	104,318	0.25	27,018.36	
	TOTAL SA	213,700	40.32	8,617,452.50	
	VOPAK	7,100	42.00	298,200.00	
	AIR LIQUIDE	33,400	88.71	2,962,914.00	
	AKZO NOBEL	24,000	52.72	1,265,280.00	
	ARKEMA	6,700	63.88	427,996.00	
	BASF SE	88,700	65.19	5,782,353.00	
	COVESTRO AG	6,800	37.26	253,402.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,800	25.18	347,484.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	33.28	213,024.00	

K+S AG	18,800	18.52	348,270.00	
KONINKLIJKE DSM NV	17,500	49.20	861,000.00	
LANXESS	8,300	37.90	314,611.50	
LINDE AG	17,910	121.30	2,172,483.00	
OCI	8,000	11.21	89,680.00	
SOLVAY SA	7,300	80.18	585,314.00	
SYMRISE AG	12,100	55.87	676,027.00	
UMICORE	8,800	44.58	392,348.00	
CRH PLC	82,200	23.31	1,916,493.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,700	65.97	903,789.00	
IMERYS	3,800	54.95	208,810.00	
ARCELORMITTAL	179,200	4.00	717,875.20	
THYSSENKRUPP AG	36,300	17.00	617,100.00	
VOESTALPINE AG	11,000	28.71	315,865.00	
STORA ENSO OYJ-R	54,000	6.86	370,440.00	
UPM-KYMMENE OYJ	50,500	15.68	791,840.00	
AIRBUS GROUP SE	57,400	49.92	2,865,408.00	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	41,000	8.38	343,580.00	
SAFRAN SA	30,100	56.02	1,686,202.00	
THALES SA	9,900	70.33	696,267.00	
ZODIAC AEROSPACE	19,500	19.53	380,835.00	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	45,500	32.51	1,479,205.00	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y S-RTS	18,525	0.60	11,207.62	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,525	23.63	437,745.75	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,100	29.28	237,208.50	
BOUYGUES	20,100	25.56	513,856.50	
EIFFAGE SA	5,500	58.80	323,400.00	
FERROVIAL SA	47,191	15.95	752,932.40	
HOCHTIEF AG	2,000	107.15	214,300.00	
VINCI	48,500	58.57	2,840,645.00	
LEGRAND SA	25,300	43.29	1,095,363.50	
OSRAM LICHT AG	8,850	42.73	378,204.75	
PRYSMIAN SPA	19,400	17.94	348,036.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,800	49.72	2,675,205.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	90,300	21.01	1,897,203.00	

SIEMENS AG	74,200	87.39	6,484,338.00
ALSTOM	15,500	19.16	296,980.00
ANDRITZ AG	7,200	40.19	289,368.00
CNH INDUSTRIAL NV	99,000	6.18	612,315.00
GEA GROUP AG	17,500	39.46	690,637.50
KONE OYJ	32,600	38.69	1,261,294.00
MAN SE	3,200	90.52	289,664.00
METSO OYJ	10,400	19.80	205,920.00
WARTSILA OYJ	14,700	34.23	503,181.00
ZARDOYA OTIS S.A	16,872	7.96	134,301.12
BRENNTAG AG	15,190	41.19	625,752.05
REXEL SA	28,600	10.12	289,432.00
EDENRED	18,700	16.00	299,200.00
SOCIETE BIC SA	2,810	123.00	345,630.00
BOLLORE	87,000	2.88	251,082.00
DEUTSCHE POST AG-REG	94,000	23.67	2,224,980.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,600	10.05	227,130.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	80,000	4.11	329,440.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	52,710	12.46	656,766.60
ADP	2,800	94.14	263,592.00
AENA SA	6,500	107.50	698,750.00
ATLANTIA SPA	39,300	20.94	822,942.00
FRAPORT AG	3,800	45.25	171,950.00
GRUPE EUROTUNNEL SE - REGR	45,000	8.30	373,500.00
CONTINENTAL AG	10,630	166.60	1,770,958.00
MICHELIN (CGDE)	17,800	82.40	1,466,720.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	11,300	31.00	350,300.00
SCHAEFFLER AG	16,000	11.64	186,320.00
VALEO SA	22,890	39.44	902,896.05
BAYER MOTOREN WERK	31,800	65.67	2,088,306.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	5,300	56.53	299,609.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	92,900	53.37	4,958,073.00
FERRARI NV	12,740	35.72	455,072.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,000	5.35	476,595.00
PEUGEOT CITROEN	47,300	10.65	503,981.50

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	15,200	41.35	628,596.00
RENAULT SA	18,800	66.23	1,245,124.00
VOLKSWAGEN AG	3,250	120.10	390,325.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	17,830	106.10	1,891,763.00
ADIDAS AG	18,400	119.75	2,203,400.00
CHRISTIAN DIOR SE	5,380	137.55	740,019.00
HERMES INTERNATIONAL	2,470	321.15	793,240.50
HUGO BOSS AG	6,300	46.72	294,367.50
KERING SA	7,230	138.60	1,002,078.00
LUXOTTICA GROUP SPA	16,500	44.23	729,795.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	26,860	131.40	3,529,404.00
ACCOR SA	17,300	32.88	568,910.50
PADDY POWER PLC	8,100	96.02	777,762.00
SODEXO	9,000	91.94	827,460.00
ALTICE NV - A	36,830	13.14	484,130.35
ALTICE NV - B	10,010	13.16	131,781.65
AXEL SPRINGER SE	4,400	46.68	205,392.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,300	15.82	257,866.00
JC DECAUX SA	6,800	28.89	196,486.00
LAGARDERE S.C.A	11,600	18.48	214,368.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	20,900	37.99	794,095.50
PUBLICIS GROUPE	18,400	58.17	1,070,328.00
RELX NV	97,000	14.65	1,421,050.00
RTL GROUP	3,900	74.08	288,912.00
SES FDR	35,200	18.27	643,104.00
TELENET GROUP HOLDING NV	5,200	38.45	199,940.00
VIVENDI SA	113,200	15.28	1,729,696.00
WOLTERS KLUWER	28,900	34.47	996,327.50
ZALANDO SE	8,100	23.03	186,583.50
INDITEX SA	105,600	28.41	3,000,624.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	54,100	21.44	1,160,174.50
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	45.85	270,515.00
COLRUYT SA	7,000	49.46	346,220.00
DELHAIZE GROUP	9,800	89.12	873,376.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	57,000	4.76	271,719.00

JERONIMO MARTINS	25,200	13.34	336,294.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	81,200	18.94	1,537,928.00
METRO AG	16,600	26.28	436,248.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	77,700	109.50	8,508,150.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,700	31.26	647,082.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,700	68.51	664,547.00
HEINEKEN NV	22,000	78.86	1,734,920.00
PERNOD RICARD SA	20,500	94.42	1,935,610.00
REMY COINTREAU	2,300	71.92	165,416.00
DANONE	56,700	60.46	3,428,082.00
KERRY GROUP PLC-A	16,100	76.40	1,230,040.00
HENKEL AG & CO KGAA	10,000	95.26	952,600.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,400	105.85	1,841,790.00
BEIERSDORF AG	10,000	79.10	791,000.00
LOREAL-ORD	24,530	162.80	3,993,484.00
UNILEVER NV-CVA	157,100	39.15	6,150,465.00
ESSILOR INTERNATIONAL	19,900	113.10	2,250,690.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	20,900	73.43	1,534,687.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	39,800	61.94	2,465,212.00
GRIFOLS SA	28,800	18.62	536,400.00
BAYER AG-REG	80,100	86.98	6,967,098.00
MERCK KGAA	12,600	85.84	1,081,584.00
ORION OYJ	9,600	33.45	321,120.00
SANOFI	113,700	70.42	8,006,754.00
UCB SA	12,300	62.26	765,798.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	22,700	14.52	329,717.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	630,660	4.76	3,003,833.58
BANCO DE SABADELL SA	504,574	1.16	587,324.13
BANCO SANTANDER SA	1,397,815	3.30	4,612,789.50
BANK OF IRELAND	2,850,000	0.17	484,500.00
BANKIA SA	430,000	0.60	261,010.00
BANKINTER S.A.	65,000	5.67	368,810.00
BCO POPULAR ESPANOL	313,260	1.17	369,020.28
BNP PARIBAS	102,300	36.91	3,775,893.00
CAIXABANK	248,288	1.89	470,257.47

COMMERZBANK AG	102,000	5.87	599,352.00
CREDIT AGRICOLE SA	103,000	7.19	740,982.00
ERSTE GROUP BANK AG	26,800	18.87	505,716.00
ING GROEP NV	375,000	8.60	3,227,625.00
INTESA SANPAOLO	1,216,000	1.55	1,884,800.00
INTESA SANPAOLO-RSP	92,000	1.49	137,816.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	24,000	40.24	965,760.00
NATIXIS	87,000	3.27	284,490.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	10.67	117,425.00
SOCIETE GENERALE	74,200	26.38	1,957,767.00
UNICREDIT SPA	484,173	1.90	923,802.08
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	90,000	2.42	217,800.00
DEUTSCHE BOERSE AG	18,900	70.63	1,334,907.00
EURAZEO	4,069	50.61	205,932.09
EXOR SPA	11,200	30.65	343,280.00
GROUPE BRUXELLES LAM	7,800	69.77	544,206.00
WENDEL	2,900	86.81	251,749.00
AEGON NV	180,000	3.60	648,900.00
AGEAS	20,000	30.34	606,900.00
ALLIANZ SE-REG	44,090	120.15	5,297,413.50
ASSICURAZIONI GENERALI	113,700	9.99	1,136,431.50
AXA	188,100	16.40	3,085,780.50
CNP ASSURANCES	16,500	12.55	207,157.50
HANNOVER RUECK SE	5,700	89.36	509,352.00
MAPFRE SA	111,000	1.85	205,461.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	16,060	143.75	2,308,625.00
NN GROUP NV	30,600	23.40	716,040.00
POSTE ITALIANE SPA	50,000	5.80	290,250.00
SAMPO OYJ-A SHS	43,200	34.42	1,486,944.00
SCOR SE	15,400	25.32	390,005.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	1.38	148,088.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	32,900	29.47	969,563.00
IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00
VONOVIA SE	45,200	32.24	1,457,474.00

UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,600	35.79	415,222.00	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	43,000	37.32	1,604,760.00	
ATOS SE	8,600	71.08	611,288.00	
CAP GEMINI SA	16,000	74.40	1,190,400.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,100	64.78	783,838.00	
GEMALTO	7,600	49.78	378,328.00	
SAP SE	94,800	65.20	6,180,960.00	
NOKIA OYJ	560,000	4.56	2,553,600.00	
INGENICO GROUP	5,500	95.34	524,370.00	
ASML HOLDING NV	35,600	83.49	2,972,244.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	109,000	12.35	1,346,695.00	
STMICROELECTRONICS NV	57,700	4.98	287,807.60	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	311,400	13.97	4,351,815.00	
ELISA OYJ	13,700	32.11	439,907.00	
ILIAD SA	2,440	170.15	415,166.00	
KONINKLIJKE KPN NV	330,000	2.96	977,130.00	
NUMERICABLE-SFR	11,000	21.92	241,175.00	
ORANGE SA	192,500	13.58	2,615,112.50	
PROXIMUS	15,100	26.78	404,378.00	
TELECOM ITALIA SPA	990,000	0.66	660,825.00	
TELECOM ITALIA-RNC	570,000	0.53	303,525.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	74,600	3.60	268,858.40	
TELEFONICA SA	435,617	7.66	3,337,261.83	
ELECTRICITE DE FRANCE	22,800	9.69	221,046.00	
ENDESA S.A.	31,700	16.98	538,266.00	
ENEL SPA	738,760	3.58	2,649,193.36	
ENERGIAS DE PORTUGAL	220,000	2.56	564,960.00	
FORTUM OYJ	44,000	13.33	586,520.00	
IBERDROLA SA	528,709	5.54	2,929,047.86	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	10,200	75.38	768,876.00	
TERNA SPA	142,000	4.52	642,976.00	
ENAGAS	21,300	25.85	550,605.00	
GAS NATURAL SDG	32,800	15.76	516,928.00	
SNAM SPA	237,000	4.78	1,134,756.00	
E.ON SE	194,000	8.23	1,597,008.00	

	ENGIE	141,100	13.18	1,859,698.00	
	RWE AG	46,200	12.13	560,406.00	
	SUEZ	29,900	12.90	385,859.50	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,700	18.06	789,222.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	133,100	12.54	1,669,074.00	
	MEDIOBANCA S.P.A.	53,000	4.63	245,496.00	
	QIAGEN NV	22,300	18.19	405,748.50	
	BUREAU VERITAS SA	25,500	18.09	461,422.50	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,600	35.38	410,408.00	
小計	銘柄数：237			278,175,758.24	
				(31,147,339,650)	
	組入時価比率：11.2%			11.8%	
英ポンド	PETROFAC LTD	26,000	6.85	178,230.00	
	BP PLC	1,789,000	3.94	7,065,655.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	407,100	19.07	7,763,397.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	362,500	19.22	6,969,062.50	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	12,262	28.19	345,665.78	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,150	27.79	532,178.50	
	REXAM PLC	65,555	6.40	419,552.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	137,000	6.29	862,963.00	
	ANTOFAGASTA PLC	41,000	4.23	173,471.00	
	BHP BILLITON PLC	204,300	8.41	1,720,001.70	
	FRESNILLO PLC	20,900	14.83	309,947.00	
	GLENCORE PLC	1,188,000	1.35	1,610,334.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	9,000	80.35	723,150.00	
	RIO TINTO PLC-REG	120,100	20.85	2,504,685.50	
	MONDI PLC	34,200	12.59	430,578.00	
	BAE SYSTEMS PLC	306,000	4.68	1,434,834.00	
	COBHAM PLC	169,500	1.42	241,368.00	
	MEGGITT PLC	78,000	3.64	283,920.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT	12,567,000	0.00	12,567.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	177,000	6.52	1,154,040.00	
	DCC PLC	8,600	60.25	518,150.00	
	SMITHS GROUP PLC	37,500	10.60	397,500.00	
	IMI PLC	25,900	9.13	236,596.50	

WEIR GROUP PLC	22,000	12.49	274,780.00
ASHTREAD GROUP PLC	46,800	9.75	456,300.00
BUNZLE	33,100	20.40	675,240.00
TRAVIS PERKINS PLC	24,700	13.48	332,956.00
WOLSELEY PLC	24,200	35.54	860,068.00
AGGREKO PLC	26,233	10.92	286,464.36
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	8.69	225,200.50
G4S PLC	152,000	1.64	249,280.00
ROYAL MAIL PLC	88,000	4.69	413,512.00
EASYJET PLC	16,300	10.20	166,260.00
GKN PLC	169,000	2.53	428,246.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	98,000	3.54	347,312.00
PERSIMMON PLC	29,500	13.10	386,450.00
TAYLOR WIMPEY PLC	319,000	1.15	369,402.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	12,400	23.41	290,284.00
BURBERRY GROUP PLC	42,300	10.61	448,803.00
CARNIVAL PLC	18,700	32.64	610,368.00
COMPASS GROUP PLC	158,500	13.45	2,131,825.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	18,183	25.99	472,576.17
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	69,000	4.09	282,831.00
TUI AG-DI	46,652	8.55	399,107.86
WHITBREAD PLC	17,500	34.14	597,450.00
WILLIAM HILL PLC	85,000	2.53	215,050.00
ITV PLC	353,000	1.54	543,620.00
PEARSON	79,000	8.97	709,025.00
RELX PLC	106,600	12.90	1,375,140.00
SKY PLC	99,800	7.97	795,406.00
WPP PLC	124,300	14.76	1,834,668.00
MARKS & SPENCER PLC	155,000	2.85	442,060.00
NEXT PLC	14,000	43.84	613,760.00
DIXONS CARPHONE PLC	92,000	3.30	303,600.00
KINGFISHER PLC	217,000	3.14	682,899.00
MORRISON SUPERMARKETS	213,000	1.74	371,898.00
SAINSBURY	133,800	2.17	291,416.40
TESCO PLC	787,000	1.53	1,209,225.50

COCA-COLA HBC AG-CDI	19,800	13.70	271,260.00
DIAGEO PLC	242,700	19.14	4,645,278.00
SABMILLER PLC	93,800	42.78	4,012,764.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,400	23.50	808,400.00
TATE & LYLE ORD.	42,500	6.26	266,262.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	180,400	44.55	8,036,820.00
IMPERIAL BRANDS PLC	92,600	37.22	3,446,572.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	61,700	69.91	4,313,447.00
UNILEVER PLC	124,400	33.10	4,118,262.00
SMITH & NEPHEW PLC	85,800	11.71	1,004,718.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	9.82	368,437.50
ASTRAZENECA PLC	121,900	41.26	5,029,594.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	471,200	14.88	7,011,456.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,900	22.43	311,777.00
SHIRE PLC	86,610	41.50	3,594,315.00
BARCLAYS PLC	1,630,000	1.27	2,073,360.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,905,000	4.38	8,343,900.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,210,000	0.51	3,176,415.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	341,000	1.74	594,363.00
STANDARD CHARTERED PLC	316,428	5.28	1,670,739.84
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	30,200	22.89	691,278.00
ADMIRAL GROUP PLC	19,800	18.27	361,746.00
AVIVA PLC	389,000	3.46	1,346,718.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	136,083	3.33	453,564.63
LEGAL & GENERAL	576,000	1.65	950,400.00
OLD MUTUAL PLC	468,000	1.78	833,508.00
PRUDENTIAL PLC	249,300	11.05	2,754,765.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	98,750	4.46	440,425.00
ST JAMES S PLACE PLC	49,900	7.16	357,284.00
STANDARD LIFE PLC	186,000	2.65	494,388.00
AUTO TRADER GROUP PLC	95,000	3.28	311,600.00
WORLDPAY GROUP PLC	135,000	2.57	347,625.00
SAGE GROUP PLC (THE)	105,000	5.73	601,650.00
ARM HOLDINGS PLC	136,500	10.28	1,403,220.00
BT GROUP PLC	817,000	3.75	3,070,694.50

	INMARSAT PLC	42,500	7.03	298,775.00	
	VODAFONE GROUP PLC	2,561,000	2.09	5,360,173.00	
	SSE PLC	96,900	13.69	1,326,561.00	
	CENTRICA PLC	524,000	1.99	1,042,760.00	
	NATIONAL GRID PLC	362,600	9.96	3,614,759.40	
	SEVERN TRENT PLC	22,100	22.29	492,609.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,000	9.38	628,795.00	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	14,300	21.64	309,452.00	
	3I GROUP PLC	97,000	4.69	455,512.00	
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	94,000	2.45	231,052.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,000	10.56	264,000.00	
	ICAP PLC	54,000	3.92	211,842.00	
	INVESTEC PLC	61,000	4.19	255,834.00	
	SCHRODERS PLC	13,300	20.49	272,517.00	
	CAPITA PLC	64,000	8.48	543,040.00	
	EXPERIAN PLC	94,600	13.03	1,232,638.00	
	INTERTEK GROUP PLC	15,100	31.05	468,855.00	
小計	銘柄数：110			150,506,512.14	
				(20,226,570,166)	
	組入時価比率：7.3%			7.6%	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	830	465.75	386,572.50	
	GIVAUDAN-REG	894	1,816.00	1,623,504.00	
	SIKA AG-BR	209	3,772.00	788,348.00	
	SYNGENTA AG-REG	9,000	367.50	3,307,500.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	44,300	36.86	1,632,898.00	
	GEBERIT AG-REG	3,670	351.20	1,288,904.00	
	ABB LTD	191,400	18.83	3,604,062.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	167.20	322,696.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,310	167.60	722,356.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,250	129.10	677,775.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	50,600	53.50	2,707,100.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,950	269.70	795,615.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	52.45	241,270.00	
	DUFREY AG-REG	4,500	110.40	496,800.00	
	ARYZTA AG	8,500	34.35	291,975.00	

	BARRY CALLEBAUT AG	190	1,110.00	210,900.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	95	5,565.00	528,675.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	10	66,560.00	665,600.00	
	NESTLE SA-REG	308,000	71.10	21,898,800.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,030	121.10	609,133.00	
	ACTELION LTD	9,770	149.30	1,458,661.00	
	GALENICA AG-REG	368	1,244.00	457,792.00	
	NOVARTIS-REG	219,900	75.35	16,569,465.00	
	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	67,880	240.90	16,352,292.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	3,200	59.85	191,520.00	
	BALOISE HOLDING AG	5,000	104.30	521,500.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,180	216.10	687,198.00	
	SWISS RE LTD	32,500	79.10	2,570,750.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,570	220.10	3,206,857.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,800	85.35	580,380.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,460	447.80	1,101,588.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	180,200	10.21	1,839,842.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,000	36.61	805,420.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,690	397.75	672,197.50	
	UBS GROUP AG	354,000	12.50	4,425,000.00	
	LONZA AG-REG	5,020	153.20	769,064.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	16,300	47.45	773,435.00	
	SGS SA-REG	523	2,085.00	1,090,455.00	
	小計 銘柄数：38			96,873,900.00	
				(10,057,448,298)	
	組入時価比率：3.6%			3.8%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	20,100	140.50	2,824,050.00	
	BOLIDEN AB	26,000	147.60	3,837,600.00	
	ASSA ABLOY AB-B	97,000	161.90	15,704,300.00	
	SKANSKA AB-B SHS	34,200	163.00	5,574,600.00	
	ALFA LAVAL AB	27,700	122.80	3,401,560.00	
	ATLAS COPCO AB-A	64,800	202.00	13,089,600.00	
	ATLAS COPCO AB-B	38,200	184.80	7,059,360.00	
	SANDVIK AB	103,000	78.45	8,080,350.00	
	SKF AB-B SHARES	38,800	131.40	5,098,320.00	

	VOLVO AB-B SHS	150,000	79.40	11,910,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	29,400	121.20	3,563,280.00	
	ELECTROLUX AB-B	23,300	210.30	4,899,990.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	60.45	2,297,100.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	92,300	236.60	21,838,180.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,800	262.00	2,043,600.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,900	271.10	5,123,790.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	58,400	250.90	14,652,560.00	
	GETINGE AB-B SHS	19,100	159.60	3,048,360.00	
	NORDEA BANK AB	293,000	67.75	19,850,750.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	146,000	70.15	10,241,900.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	145,000	96.90	14,050,500.00	
	SWEDBANK AB	86,500	165.00	14,272,500.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,800	128.40	2,157,120.00	
	INVESTOR AB-B SHS	44,400	261.80	11,623,920.00	
	KINNEVIK AB - B	23,600	184.70	4,358,920.00	
	ERICSSON LM-B	292,000	60.60	17,695,200.00	
	HEXAGON AB-B SHS	24,400	290.40	7,085,760.00	
	TELIA CO AB	251,000	35.69	8,958,190.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6,100	454.90	2,774,890.00	
	TELE 2 AB-B SHS	28,400	67.05	1,904,220.00	
	小計銘柄数：30			249,020,470.00	
				(2,955,872,978)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	107,900	135.40	14,609,660.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,800	257.10	4,319,280.00	
	NORSK HYDRO	130,000	29.20	3,796,000.00	
	SCHIBSTED ASA	7,800	238.30	1,858,740.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,100	229.10	2,084,810.00	
	MARINE HARVEST ASA	36,500	138.40	5,051,600.00	
	ORKLA ASA	80,000	70.25	5,620,000.00	
	DNB ASA	95,600	96.65	9,239,740.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,700	132.80	2,616,160.00	
	TELENOR ASA	71,900	124.00	8,915,600.00	

小計	銘柄数：10			58,111,590.00	
				(688,622,341)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,300	406.00	3,775,800.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,500	293.50	6,603,750.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	21,600	418.00	9,028,800.00	
	ISS A/S	16,100	237.20	3,818,920.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	375	7,770.00	2,913,750.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	620	8,100.00	5,022,000.00	
	DSV A/S	18,200	263.10	4,788,420.00	
	PANDORA A/S	11,230	856.00	9,612,880.00	
	CARLSBERG B	10,500	593.00	6,226,500.00	
	COLOPLAST-B	11,700	465.40	5,445,180.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	121.70	1,582,100.00	
	GENMAB A/S	5,470	1,078.00	5,896,660.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	179,500	341.90	61,371,050.00	
	DANSKE BANK AS	68,600	165.40	11,346,440.00	
	TRYG A/S	11,800	112.00	1,321,600.00	
TDC A/S	76,800	30.05	2,307,840.00		
小計	銘柄数：16			141,061,690.00	
				(2,124,389,051)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	25,500	31.60	805,800.00	
	OIL SEARCH LTD	130,000	6.46	839,800.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	175,000	5.59	978,250.00	
	SANTOS LTD.	167,000	4.66	778,220.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	71,100	25.85	1,837,935.00	
	INCITEC PIVOT LTD	161,000	3.03	487,830.00	
	ORICA LTD	36,600	12.43	454,938.00	
	BORAL LTD	67,000	5.97	399,990.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	44,000	19.60	862,400.00	
	AMCOR	113,000	14.42	1,629,460.00	
	ALUMINA LTD	233,000	1.28	299,405.00	
	BHP BILLITON LIMITED	308,400	18.08	5,575,872.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,000	3.53	501,260.00	

NEWCREST MINING	75,000	24.19	1,814,250.00
RIO TINTO LTD	41,000	44.07	1,806,870.00
SOUTH32 LTD	500,000	1.61	805,000.00
CIMIC GROUP LTD	8,938	35.00	312,830.00
BRAMBLES LTD	155,000	11.97	1,855,350.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	44,133	2.73	120,483.09
ASCIANO LTD	61,000	8.86	540,460.00
AURIZON HOLDINGS LTD	209,000	4.73	988,570.00
SYDNEY AIRPORT	107,900	7.28	785,512.00
TRANSURBAN GROUP	195,004	11.91	2,322,497.64
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,000	13.14	683,280.00
CROWN RESORTS LTD	36,000	12.09	435,240.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	5,900	67.22	396,598.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	30.70	159,640.00
TABCORP HOLDINGS	78,000	4.37	340,860.00
TATTS GROUP LTD	147,000	3.86	567,420.00
REA GROUP LTD	5,400	58.37	315,198.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	4.49	237,970.00
WESFARMERS LIMITED	107,900	39.21	4,230,759.00
WOOLWORTHS LIMITED	122,900	20.68	2,541,572.00
COCA-COLA AMATIL LTD	52,000	8.32	432,640.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	9.36	673,920.00
COCHLEAR LTD	5,200	120.25	625,300.00
HEALTHSCOPE LTD	176,000	2.74	482,240.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,100	68.92	971,772.00
SONIC HEALTHCARE LTD	37,300	20.91	779,943.00
CSL LIMITED	45,100	108.82	4,907,782.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	281,700	23.27	6,555,159.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,115	10.36	363,791.40
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	44,300	9.21	408,003.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	164,600	72.80	11,982,880.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	255,400	24.51	6,259,854.00
WESTPAC BANKING CORP	322,800	28.38	9,161,064.00
ASX LTD	18,200	44.25	805,350.00
CHALLENGER LIMITED	56,000	8.46	473,760.00

	AMP LIMITED	285,000	5.15	1,467,750.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	232,000	5.47	1,269,040.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	261,000	2.94	767,340.00	
	QBE INSURANCE	133,000	10.23	1,360,590.00	
	SUNCORP GROUP LTD	126,000	11.82	1,489,320.00	
	COMPUTERSHARE LTD	47,000	9.24	434,280.00	
	TELSTRA CORP LTD	417,000	5.47	2,280,990.00	
	TPG TELECOM LTD	33,000	11.75	387,750.00	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	43,000	8.71	374,530.00	
	AUSNET SERVICES	163,400	1.59	259,806.00	
	APA GROUP	107,000	8.93	955,510.00	
	AGL ENERGY LTD	64,500	18.89	1,218,405.00	
	DUET GROUP	229,000	2.53	579,370.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,600	67.00	1,983,200.00	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	25,000	5.81	145,250.00	
	SEEK LTD	32,800	14.97	491,016.00	
小計	銘柄数：64			97,059,125.13	
				(7,255,169,603)	
	組入時価比率：2.6%			2.7%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	69,000	8.19	565,110.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,110	6.26	607,908.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,000	8.81	308,350.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	170,000	3.41	580,550.00	
	CONTACT ENERGY LTD	76,000	5.13	389,880.00	
	MIGHTY RIVER POWER	60,000	2.85	171,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	120,000	2.52	302,400.00	
小計	銘柄数：7			2,925,198.60	
				(208,625,164)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	262,540	83.50	21,922,090.00	
	NWS HOLDINGS LTD	135,500	11.54	1,563,670.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	11.10	1,187,700.00	
	MTR CORP	139,500	38.05	5,307,975.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	128,000	31.05	3,974,400.00	
	LI & FUNG LTD	563,600	3.36	1,893,696.00	

YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	75,000	30.40	2,280,000.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	223,000	22.75	5,073,250.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	78,000	10.24	798,720.00	
SANDS CHINA LTD	234,800	25.65	6,022,620.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	108,333	7.80	844,997.40	
SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	4.50	747,000.00	
WYNN MACAU LTD	168,400	11.22	1,889,448.00	
WH GROUP LIMITED	590,000	5.92	3,492,800.00	
BANK OF EAST ASIA	120,860	28.40	3,432,424.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	363,500	22.60	8,215,100.00	
HANG SENG BANK	73,000	130.70	9,541,100.00	
FIRST PACIFIC CO	226,000	5.32	1,202,320.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	110,200	184.40	20,320,880.00	
AIA GROUP LTD	1,162,400	44.50	51,726,800.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	263,540	46.00	12,122,840.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	14.96	3,186,480.00	
HENDERSON LAND	107,818	41.20	4,442,101.60	
HYSAN DEVELOPMENT	65,000	33.95	2,206,750.00	
KERRY PROPERTIES	57,000	18.50	1,054,500.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	516,666	7.50	3,874,995.00	
SINO LAND CO.LTD	286,000	12.10	3,460,600.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	141,000	88.75	12,513,750.00	
SWIRE PACIFIC-A	53,500	85.55	4,576,925.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	20.30	2,371,040.00	
WHARF(HOLDING)	133,000	45.85	6,098,050.00	
WHEELOK & COMPANY LTD	87,000	34.90	3,036,300.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	56.45	1,236,255.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	259,600	11.28	2,928,288.00	
PCCW LTD	386,000	5.07	1,957,020.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	65,000	66.50	4,322,500.00	
CLP HLDGS	160,500	75.85	12,173,925.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	135,000	68.15	9,200,250.00	
HONG KONG & CHINA GAS	728,809	13.74	10,013,835.66	
小計銘柄数：39			252,213,395.66	
			(3,303,995,483)	

	組入時価比率：1.2%			1.2%
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	141,000	3.03	427,230.00
	KEPPEL CORP.	142,700	5.28	753,456.00
	SEMBCORP INDUSTRIES	99,040	2.76	273,350.40
	SEMBCORP MARINE	72,600	1.52	110,715.00
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	0.86	140,995.00
	NOBLE GROUP LTD	412,481	0.21	88,683.41
	SINGAPORE AIRLINES LTD	55,040	10.40	572,416.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	207,000	2.68	554,760.00
	GENTING SINGAPORE PLC	614,600	0.70	430,220.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	151,000	3.70	558,700.00
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	32.60	326,000.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	615,320	0.33	206,132.20
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	184,000	3.21	590,640.00
	DBS GROUP HLDGS	171,000	15.26	2,609,460.00
	OCBC-ORD	297,500	8.34	2,481,150.00
	UNITED OVERSEAS BANK	125,500	17.61	2,210,055.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	7.35	565,950.00
	CAPITALAND LIMITED	246,000	2.88	708,480.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	8.00	296,000.00
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	266,000	1.75	465,500.00
UOL GROUP LIMITED	48,700	5.26	256,162.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	770,000	3.89	2,995,300.00	
STARHUB LTD	53,000	3.58	189,740.00	
小計	銘柄数：23			17,811,095.01 (1,330,845,019)
	組入時価比率：0.5%			0.5%
新シケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	44,000	14.95	657,800.00
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	88,900	190.70	16,953,230.00
	BANK HAPOALIM BM	102,000	19.11	1,949,220.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	138,000	13.63	1,880,940.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,000	44.85	583,050.00
	AZRIELI GROUP	4,100	156.50	641,650.00
	NICE LTD	5,900	234.60	1,384,140.00

		BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	201,000	7.17	1,442,577.00	
	小計	銘柄数：8			25,492,607.00	
					(666,121,820)	
		組入時価比率：0.2%			0.3%	
	合計				264,407,491,447	
					(264,407,491,447)	

(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。

(2)株式以外の有価証券(平成28年 6月28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		213,780.00	
	小計	銘柄数：1		213,780.00	
		組入時価比率：0.0%		(21,726,461)	0.3%
	合計			21,726,461	(21,726,461)
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,000	693,910.00	
		AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	32,900	635,957.00	
		AMERICAN TOWER CORP	41,000	4,464,490.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	91,000	996,450.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,330	2,332,483.40	
		BOSTON PROPERTIES	14,700	1,859,550.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	20,300	533,687.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,300	708,156.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,300	3,138,914.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,400	1,499,328.00	
		DUKE REALTY CORP	34,000	866,320.00	
		EQUINIX INC	6,680	2,479,348.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	35,100	2,315,547.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,300	1,376,865.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,000	1,083,720.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,520	1,037,397.20	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	54,400	1,557,472.00			

	HCP INC	45,600	1,558,608.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	73,900	1,092,981.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,400	926,712.00	
	KIMCO REALTY CORP	40,500	1,214,595.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	540,397.00	
	MACERICH CO /THE	12,300	996,792.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,200	740,952.00	
	PROLOGIS INC	50,700	2,378,844.00	
	PUBLIC STORAGE	14,240	3,562,990.40	
	REALTY INCOME CORP	23,800	1,593,886.00	
	REGENCY CENTERS CORP	9,400	742,600.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	29,970	6,232,261.50	
	SL GREEN REALTY CORP	9,800	959,518.00	
	UDR INC	25,700	895,645.00	
	VENTAS INC	32,500	2,307,825.00	
	VEREIT INC	84,000	821,520.00	
	VORNADO REALTY TRUST	16,600	1,587,790.00	
	WELLTOWER INC	34,500	2,530,920.00	
	WEYERHAEUSER CO	76,000	2,034,520.00	
小計	銘柄数：36	1,055,640	60,298,952.30	
			(6,128,182,522)	
	組入時価比率：2.2%		76.0%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	293,760.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,400	412,272.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	252,678.00	
小計	銘柄数：3	34,900	958,710.00	
			(74,558,876)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	3,100	234,019.00	
	GECINA SA	4,000	463,800.00	
	ICADE	3,700	225,737.00	
	KLEPIERRE	21,200	802,102.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	9,600	2,166,720.00	
小計	銘柄数：5	41,600	3,892,378.00	
			(435,829,564)	

		組入時価比率：0.2%		5.4%
英ポンド	BRITISH LAND		94,000	518,410.00
	HAMMERSON PLC		73,000	342,078.00
	INTU PROPERTIES PLC		88,000	225,016.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC		77,500	705,250.00
	SEGRO PLC		70,000	259,350.00
	小計	銘柄数：5		402,500
		組入時価比率：0.1%		3.4%
豪ドル	DEXUS PROPERTY GROUP		92,000	851,000.00
	GOODMAN GROUP		174,000	1,249,320.00
	GPT GROUP		179,000	997,030.00
	LENDLEASE GROUP		53,000	677,340.00
	MIRVAC GROUP		350,000	717,500.00
	SCENTRE GROUP		513,000	2,462,400.00
	STOCKLAND TRUST GROUP		230,000	1,117,800.00
	VICINITY CENTRES		328,704	1,084,723.20
	WESTFIELD CORP		193,000	1,978,250.00
	小計	銘柄数：9		2,112,704
		組入時価比率：0.3%		10.3%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	1,853,800.00
	LINK REIT		219,000	11,311,350.00
小計	銘柄数：2		479,000	13,165,150.00 (172,463,465)
		組入時価比率：0.1%		2.1%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		213,000	504,810.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		192,000	274,560.00
	CAPITALAND MALL TRUST		249,900	514,794.00
	SUNTEC REIT		243,000	405,810.00
	小計	銘柄数：4		897,900
		組入時価比率：0.0%		1.6%
合計				8,045,938,359 (8,045,938,359)
合計				8,067,664,820

(8,067,664,820)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年 6月28日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	6,379,819,845	-	6,141,400,769	238,419,076
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	57,407,524	-	57,030,800	376,724
米ドル	51,114,750	-	50,810,000	304,750
カナダドル	6,292,774	-	6,220,800	71,974
売建	62,142,530	-	61,988,200	154,330
米ドル	62,142,530	-	61,988,200	154,330
合計	-	-	-	238,641,470

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 6月28日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,715,705,910
国債証券	537,552,551,900
地方債証券	52,056,918,551
特殊債券	58,495,045,964
社債券	29,934,540,350
未収利息	1,134,455,638
前払費用	17,506,225
流動資産合計	683,906,724,538
資産合計	683,906,724,538
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,884,874,045
未払利息	7,422
流動負債合計	1,884,881,467
負債合計	1,884,881,467
純資産の部	
元本等	
元本	505,018,668,249
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	177,003,174,822
元本等合計	682,021,843,071
純資産合計	682,021,843,071
負債純資産合計	683,906,724,538

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 6月28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	1.3505円

(10,000口当たり純資産額)

(13,505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 6月30日 至 平成28年 6月28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 style="padding-left: 2em;">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 style="padding-left: 2em;">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 style="padding-left: 2em;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6月28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>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。</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>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 6月28日現在	平成27年 6月30日
期首	455,050,709,296円
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	119,919,536,746円
同期中における追加設定元本額	69,951,577,793円
同期中における一部解約元本額	505,018,668,249円
期末元本額	

期末元本額の内訳 *		
野村国内債券インデックスファンド		384,379,216円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		17,382,098,153円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		19,868,273,154円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		2,512,273,717円
野村資産設計ファンド2015		560,920,763円
野村資産設計ファンド2020		305,532,969円
野村資産設計ファンド2025		228,781,861円
野村資産設計ファンド2030		133,867,841円
野村資産設計ファンド2035		70,800,894円
野村資産設計ファンド2040		147,524,783円
野村日本債券インデックスファンド		1,496,683,028円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）		263,392,687,277円
のむらップ・ファンド（保守型）		8,642,094,419円
のむらップ・ファンド（普通型）		3,644,093,893円
のむらップ・ファンド（積極型）		625,224,182円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）		17,876,257,730円
野村資産設計ファンド2045		11,063,337円
野村円債投資インデックスファンド		1,890,819,357円
野村インデックスファンド・国内債券		1,221,340,581円
マイ・ロード		31,512,759,160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		215,274,859円
野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）		65,199,378円
野村時間分散投資「日経225・国内債券」（限定追加型）		48,911,618円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）		5,741,612,854円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		1,280,313,599円
野村資産設計ファンド2050		5,175,803円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		6,127,785円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		827,550円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		546,066円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		567,417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）		1,027,037,097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）		264,694,397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）		10,674,825,964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）		1,752,303,664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）		46,330,070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）		34,661,145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）		6,132,923円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）		7,156,316,767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）		382,109,068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）		2,089,934,151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）		918,690,722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）		198,660,891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）		400,814,999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）		875,697,850円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）		1,836,165,953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）		692,529,127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）		726,195,968円

マイバランス30(確定拠出年金向け)	11,312,939,922円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	16,357,381,253円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	7,217,695,440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)	41,948,185,378円
マイバランスDC30	6,226,104,911円
マイバランスDC50	3,960,409,837円
マイバランスDC70	1,166,734,138円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	8,427,284,353円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	44,180,460円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,411,358円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,207,199円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 6月28日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 6月28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359回	300,000,000	301,782,000	
		国庫債券 利付(2年)第360回	4,200,000,000	4,226,040,000	
		国庫債券 利付(2年)第362回	1,400,000,000	1,409,604,000	
		国庫債券 利付(5年)第106回	3,100,000,000	3,119,220,000	
		国庫債券 利付(5年)第107回	3,800,000,000	3,828,120,000	
		国庫債券 利付(5年)第108回	1,800,000,000	1,810,656,000	
		国庫債券 利付(5年)第109回	2,800,000,000	2,819,124,000	
		国庫債券 利付(5年)第110回	1,000,000,000	1,010,280,000	
		国庫債券 利付(5年)第111回	1,400,000,000	1,416,814,000	
		国庫債券 利付(5年)第112回	2,200,000,000	2,230,316,000	
		国庫債券 利付(5年)第113回	7,000,000,000	7,081,900,000	
		国庫債券 利付(5年)第114回	1,500,000,000	1,519,980,000	
		国庫債券 利付(5年)第115回	7,300,000,000	7,380,884,000	
		国庫債券 利付(5年)第116回	8,100,000,000	8,200,926,000	

国庫債券 利付(5年)第117回	5,900,000,000	5,980,889,000	
国庫債券 利付(5年)第118回	5,000,000,000	5,075,700,000	
国庫債券 利付(5年)第119回	4,700,000,000	4,757,058,000	
国庫債券 利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,589,540,000	
国庫債券 利付(5年)第121回	3,500,000,000	3,545,570,000	
国庫債券 利付(5年)第122回	7,800,000,000	7,909,512,000	
国庫債券 利付(5年)第123回	7,300,000,000	7,409,865,000	
国庫債券 利付(5年)第124回	8,100,000,000	8,231,868,000	
国庫債券 利付(5年)第125回	8,200,000,000	8,342,106,000	
国庫債券 利付(5年)第126回	5,500,000,000	5,601,035,000	
国庫債券 利付(5年)第127回	6,000,000,000	6,116,340,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	2,660,000,000	4,626,325,200	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,527,867,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,549,377,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,300,000,000	2,265,471,000	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,300,000,000	2,197,338,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	2,175,043,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	2,259,390,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	2,269,185,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	300,000,000	338,913,000	
国庫債券 利付(10年)第288回	1,850,000,000	1,895,695,000	
国庫債券 利付(10年)第289回	2,000,000,000	2,053,280,000	
国庫債券 利付(10年)第290回	1,250,000,000	1,286,525,000	
国庫債券 利付(10年)第291回	1,400,000,000	1,438,486,000	
国庫債券 利付(10年)第292回	1,600,000,000	1,655,056,000	
国庫債券 利付(10年)第293回	750,000,000	781,095,000	
国庫債券 利付(10年)第294回	500,000,000	519,740,000	
国庫債券 利付(10年)第295回	1,600,000,000	1,656,816,000	
国庫債券 利付(10年)第297回	1,100,000,000	1,146,178,000	
国庫債券 利付(10年)第298回	1,500,000,000	1,559,235,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第299回	1,400,000,000	1,461,040,000	
国庫債券 利付(10年)第300回	1,000,000,000	1,049,080,000	
国庫債券 利付(10年)第301回	1,500,000,000	1,580,970,000	
国庫債券 利付(10年)第302回	700,000,000	735,686,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	3,300,000,000	3,482,094,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,051,920,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,330,256,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,192,480,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,802,680,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,808,987,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,168,840,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,905,794,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,884,708,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,286,699,000	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,443,488,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,346,344,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	2,600,000,000	2,796,144,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,498,560,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,933,740,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,420,800,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,995,243,500	

国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,755,290,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,445,120,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,569,872,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,899,665,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,417,184,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,900,000,000	5,246,871,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,240,847,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,328,408,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,500,000,000	5,845,510,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,721,297,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	4,113,234,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	2,028,516,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,775,948,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	5,000,000,000	5,355,650,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,399,587,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	4,700,000,000	5,012,832,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,700,000,000	2,884,032,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,887,923,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	4,900,000,000	5,197,822,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,900,000,000	6,263,440,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	6,000,000,000	6,374,220,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	7,200,000,000	7,584,264,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第342回	7,500,000,000	7,753,725,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	139,613,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	270,472,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	214,987,200	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,297,089,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	201,985,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	971,285,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	829,794,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	130,910,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	80,856,750	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	298,980,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	207,929,600	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	301,917,000	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	393,756,200	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,146,328,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,310,265,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,335,534,000	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,733,640,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	2,145,855,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,296,000,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,900,000,000	2,807,763,000	
国庫債券 利付(30年)第21回	1,400,000,000	2,019,192,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	892,284,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	840,000,000	1,251,919,200	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	1,047,571,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	730,960,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,264,834,000	
国庫債券 利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,357,441,500	
国庫債券 利付(30年)第28回	700,000,000	1,071,959,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	800,000,000	1,217,240,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	900,000,000	1,357,965,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,000,000,000	1,495,310,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,908,976,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	2,000,000,000	2,940,480,000	

国庫債券 利付（30年）第34回	2,300,000,000	3,516,079,000	
国庫債券 利付（30年）第35回	2,300,000,000	3,425,758,000	
国庫債券 利付（30年）第36回	1,800,000,000	2,698,164,000	
国庫債券 利付（30年）第37回	2,100,000,000	3,113,691,000	
国庫債券 利付（30年）第38回	1,400,000,000	2,051,420,000	
国庫債券 利付（30年）第39回	1,600,000,000	2,394,128,000	
国庫債券 利付（30年）第40回	1,100,000,000	1,621,389,000	
国庫債券 利付（30年）第41回	1,000,000,000	1,451,110,000	
国庫債券 利付（30年）第42回	1,200,000,000	1,746,132,000	
国庫債券 利付（30年）第43回	1,300,000,000	1,896,960,000	
国庫債券 利付（30年）第44回	1,400,000,000	2,048,606,000	
国庫債券 利付（30年）第45回	1,900,000,000	2,680,957,000	
国庫債券 利付（30年）第46回	1,300,000,000	1,836,315,000	
国庫債券 利付（30年）第47回	1,900,000,000	2,744,968,000	
国庫債券 利付（30年）第48回	1,400,000,000	1,947,190,000	
国庫債券 利付（30年）第49回	1,400,000,000	1,951,796,000	
国庫債券 利付（30年）第50回	1,900,000,000	2,320,698,000	
国庫債券 利付（20年）第36回	380,000,000	395,435,600	
国庫債券 利付（20年）第37回	320,000,000	333,392,000	
国庫債券 利付（20年）第38回	170,000,000	178,804,300	
国庫債券 利付（20年）第39回	511,000,000	536,580,660	
国庫債券 利付（20年）第40回	525,000,000	555,381,750	
国庫債券 利付（20年）第41回	255,000,000	267,625,050	
国庫債券 利付（20年）第42回	683,000,000	737,325,820	
国庫債券 利付（20年）第43回	400,000,000	441,604,000	
国庫債券 利付（20年）第44回	150,000,000	165,739,500	
国庫債券 利付（20年）第45回	242,000,000	266,483,140	
国庫債券 利付（20年）第46回	90,000,000	99,038,700	
国庫債券 利付（20年）第47回	1,230,000,000	1,361,364,000	
国庫債券 利付（20年）第48回	200,000,000	225,358,000	
国庫債券 利付（20年）第49回	200,000,000	222,904,000	
国庫債券 利付（20年）第50回	183,000,000	202,202,190	
国庫債券 利付（20年）第51回	310,000,000	345,836,000	
国庫債券 利付（20年）第52回	100,000,000	112,745,000	
国庫債券 利付（20年）第53回	250,000,000	283,550,000	
国庫債券 利付（20年）第54回	250,000,000	284,940,000	

国庫債券	利付(20年)第55回	231,000,000	262,090,290
国庫債券	利付(20年)第56回	120,000,000	136,909,200
国庫債券	利付(20年)第57回	210,000,000	238,312,200
国庫債券	利付(20年)第58回	180,000,000	205,378,200
国庫債券	利付(20年)第59回	230,000,000	260,541,700
国庫債券	利付(20年)第60回	780,000,000	868,397,400
国庫債券	利付(20年)第61回	300,000,000	327,084,000
国庫債券	利付(20年)第62回	440,000,000	474,975,600
国庫債券	利付(20年)第63回	300,000,000	345,111,000
国庫債券	利付(20年)第64回	400,000,000	465,328,000
国庫債券	利付(20年)第65回	455,000,000	531,326,250
国庫債券	利付(20年)第66回	300,000,000	348,030,000
国庫債券	利付(20年)第67回	310,000,000	363,614,500
国庫債券	利付(20年)第68回	290,000,000	347,025,600
国庫債券	利付(20年)第69回	560,000,000	665,694,400
国庫債券	利付(20年)第70回	540,000,000	658,281,600
国庫債券	利付(20年)第71回	200,000,000	240,544,000
国庫債券	利付(20年)第72回	670,000,000	804,241,200
国庫債券	利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,914,976,000
国庫債券	利付(20年)第74回	1,300,000,000	1,567,189,000
国庫債券	利付(20年)第75回	600,000,000	726,666,000
国庫債券	利付(20年)第76回	910,000,000	1,085,866,600
国庫債券	利付(20年)第77回	700,000,000	841,533,000
国庫債券	利付(20年)第78回	800,000,000	958,744,000
国庫債券	利付(20年)第79回	860,000,000	1,038,553,200
国庫債券	利付(20年)第80回	900,000,000	1,095,129,000
国庫債券	利付(20年)第81回	360,000,000	436,276,800
国庫債券	利付(20年)第82回	820,000,000	1,001,482,400
国庫債券	利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,679,962,500
国庫債券	利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,459,872,000
国庫債券	利付(20年)第85回	400,000,000	492,420,000
国庫債券	利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,751,302,000
国庫債券	利付(20年)第87回	500,000,000	620,495,000
国庫債券	利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,381,930,000
国庫債券	利付(20年)第89回	470,000,000	585,671,700
国庫債券	利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,877,730,000

国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	315,567,500	
国庫債券 利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,931,377,500	
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	372,102,000	
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	250,256,000	
国庫債券 利付(20年)第95回	700,000,000	895,321,000	
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	502,648,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	1,300,000,000	1,655,394,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	378,576,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,660,952,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,951,968,800	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	327,030,000	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	656,640,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	780,642,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	510,656,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,435,382,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	517,700,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	386,049,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	2,018,224,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,139,256,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,420,947,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	1,048,024,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,334,258,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	1,800,000,000	2,343,276,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	2,500,000,000	3,266,800,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	660,220,000	

国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,458,039,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,900,000,000	2,491,888,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	651,095,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	1,019,000,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	996,248,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	2,000,000,000	2,584,640,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,405,635,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	2,000,000,000	2,652,040,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,311,300,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,210,167,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,314,730,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	800,000,000	1,039,824,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,500,000,000	1,954,515,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	500,000,000	643,910,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,600,000,000	2,066,784,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	1,021,040,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,663,857,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,813,798,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	900,000,000	1,169,379,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	400,000,000	513,352,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	887,222,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,286,950,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	1,003,688,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	889,546,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,400,000,000	3,097,128,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	2,199,647,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	1,250,000,000	1,638,200,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	2,500,000,000	3,200,925,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,895,220,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,600,000,000	3,381,742,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	3,126,984,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,700,000,000	3,476,115,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,500,000,000	3,181,425,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,600,000,000	3,315,806,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	2,930,000,000	3,687,639,400	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,304,638,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	3,400,000,000	4,163,776,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	3,450,000,000	4,296,837,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	3,500,000,000	4,299,155,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	3,100,000,000	3,689,310,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,800,000,000	3,003,084,000	
ポーランド共和国 第12回円貨債券(2012)	100,000,000	100,961,000	
ポーランド共和国 第15回円貨債券(2013)	100,000,000	101,644,000	

小計	銘柄数：261	463,515,000,000	537,552,551,900	
	組入時価比率：78.8%		79.3%	
合計			537,552,551,900	
地方債証券	日本円	東京都 公募第655回	100,000,000	102,601,000
		東京都 公募第659回	300,000,000	310,044,000
		東京都 公募第660回	100,000,000	103,300,000
		東京都 公募第664回	100,000,000	103,625,000
		東京都 公募第668回	200,000,000	208,766,000
		東京都 公募第671回	100,000,000	104,445,000
		東京都 公募第685回	100,000,000	104,677,000
		東京都 公募第690回	200,000,000	211,830,000
		東京都 公募第703回	100,000,000	105,542,000
		東京都 公募第707回	100,000,000	105,100,000
		東京都 公募第708回	100,000,000	105,481,000
		東京都 公募第710回	100,000,000	105,002,000
		東京都 公募第712回	100,000,000	104,957,000
		東京都 公募第715回	100,000,000	105,030,000
		東京都 公募第716回	200,000,000	210,188,000
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	148,686,000
		東京都 公募第10回	200,000,000	292,810,000
		東京都 公募(7年)第3回	100,000,000	101,451,000
		東京都 公募第1回	300,000,000	332,349,000
		東京都 公募第7回	100,000,000	119,967,000
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	249,726,000
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	251,716,000
		東京都 公募第23回	100,000,000	130,512,000
		東京都 公募(20年)第26回	300,000,000	381,567,000
		北海道 公募平成20年度第7回	300,000,000	311,511,000
		北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	104,984,000
		北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	105,029,000
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	104,894,000
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	104,678,000
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	310,926,000
		北海道 公募(5年)平成25年度第8回	100,000,000	100,661,000
		北海道 公募(5年)平成26年度第8回	200,000,000	200,962,000

北海道 公募(5年)平成26年度 第10回	100,000,000	100,395,000	
宮城県 公募(5年)第9回1号	500,000,000	504,075,000	
神奈川県 公募第155回	100,000,000	103,257,000	
神奈川県 公募第156回	101,000,000	104,830,930	
神奈川県 公募第184回	100,000,000	105,126,000	
神奈川県 公募第188回	200,000,000	212,138,000	
神奈川県 公募第196回	100,000,000	104,662,000	
神奈川県 公募第200回	100,000,000	106,043,000	
神奈川県 公募第205回	100,000,000	105,172,000	
神奈川県 公募第206回	100,000,000	105,262,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	207,618,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	147,894,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	370,230,000	
神奈川県 公募(5年)第56回	100,000,000	100,553,000	
大阪府 公募第304回	150,000,000	153,187,500	
大阪府 公募第320回	400,000,000	417,636,000	
大阪府 公募第337回	200,000,000	210,838,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	105,445,000	
大阪府 公募第356回	100,000,000	105,570,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	109,283,200	
大阪府 公募第384回	100,000,000	105,183,000	
大阪府 公募第387回	300,000,000	312,489,000	
大阪府 公募第5回	100,000,000	128,899,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	126,685,000	
大阪府 公募第98回	200,000,000	201,258,000	
大阪府 公募(5年)第99回	240,000,000	241,262,400	
大阪府 公募(5年)第101回	148,000,000	148,757,760	
大阪府 公募第102回	100,000,000	100,514,000	
大阪府 公募(5年)第130回	600,000,000	601,092,000	
京都府 公募平成19年度第1回	100,000,000	102,312,000	
京都府 公募平成20年度第3回	140,000,000	145,552,400	
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	105,505,000	
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	105,083,000	
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	124,218,000	
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	209,456,000	

兵庫県	公募平成20年度第3回	100,000,000	103,320,000	
兵庫県	公募平成20年度第12回	100,000,000	104,286,000	
兵庫県	公募平成20年度第16回	100,000,000	104,104,000	
兵庫県	公募平成21年度第13回	100,000,000	104,502,000	
兵庫県	公募平成21年度第25回	100,000,000	105,190,000	
兵庫県	公募平成22年度第1回	100,000,000	105,510,000	
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	146,629,000	
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	347,778,000	
兵庫県	公募(15年)第3回	100,000,000	113,995,000	
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	314,103,000	
兵庫県	公募第2回	100,000,000	125,830,000	
兵庫県	公募第9回	100,000,000	127,838,000	
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	125,866,000	
静岡県	公募平成19年度第4回	200,000,000	204,656,000	
静岡県	公募平成19年度第7回	100,000,000	102,623,000	
静岡県	公募平成21年度第2回	100,000,000	105,013,000	
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	105,354,000	
静岡県	公募(5年)平成24年度 第8回	100,000,000	100,381,000	
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	104,666,000	
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	107,630,650	
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	173,936,400	
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	104,693,000	
静岡県	公募平成26年度第9回	100,000,000	104,693,000	
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	125,902,000	
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	127,126,000	
愛知県	公募平成19年度第3回	111,000,000	113,454,210	
愛知県	公募平成19年度第4回	100,000,000	102,517,000	
愛知県	公募平成20年度第7回	210,000,000	217,734,300	
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	124,771,000	
愛知県	公募平成20年度第10回	100,000,000	104,163,000	
愛知県	公募平成21年度第3回	114,000,000	119,754,720	
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	105,285,000	
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	105,442,000	
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	104,998,000	
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	105,767,000	

愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	105,789,000	
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	126,118,000	
愛知県	公募(5年)平成24年度第6回	1,100,000,000	1,102,849,000	
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	458,764,000	
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	129,172,000	
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	141,881,000	
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	122,563,000	
広島県	公募平成20年度第3回	300,000,000	311,082,000	
広島県	公募平成22年度第6回	200,000,000	211,636,000	
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	105,234,000	
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	211,668,000	
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	300,000,000	301,962,000	
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	112,750,902	
埼玉県	公募平成19年度第7回	200,000,000	205,608,000	
埼玉県	公募平成20年度第1回	100,000,000	102,880,000	
埼玉県	公募平成21年度第5回	100,000,000	104,677,000	
埼玉県	公募平成22年度第2回	200,000,000	210,916,000	
埼玉県	公募平成24年度第4回	100,000,000	105,166,000	
埼玉県	公募(5年)平成24年度第8回	200,000,000	200,718,000	
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	106,527,000	
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	156,764,560	
埼玉県	公募(5年)平成25年度第7回	100,000,000	100,677,000	
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	105,259,000	
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	105,115,000	
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	209,226,000	
福岡県	公募平成19年度第6回	100,000,000	102,157,000	
福岡県	公募平成19年度第8回	100,000,000	102,455,000	
福岡県	公募平成20年度第3回	100,000,000	103,237,000	
福岡県	公募平成22年度第5回	100,000,000	104,211,000	
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	105,491,000	
福岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	100,357,000	
福岡県	公募平成26年度第4回	100,000,000	100,587,000	

福岡県 公募平成23年度第1回	100,000,000	115,007,000	
福岡県 公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	148,976,000	
福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	142,222,000	
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	124,895,000	
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	125,283,000	
千葉県 公募平成20年度第1回	100,000,000	102,884,000	
千葉県 公募平成20年度第6回	200,000,000	207,772,000	
千葉県 公募平成21年度第1回	100,000,000	104,395,000	
千葉県 公募平成21年度第11回	180,000,000	189,340,200	
千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	106,179,000	
千葉県 公募平成24年度第2回	100,000,000	105,408,000	
千葉県 公募平成24年度第4回	100,000,000	100,317,000	
千葉県 公募平成24年度第8回	100,000,000	105,630,000	
千葉県 公募平成25年度第2回	900,000,000	904,986,000	
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	106,258,000	
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	106,523,000	
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	129,839,000	
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	123,400,000	
新潟県 公募平成20年度第2回	200,000,000	208,390,000	
新潟県 公募平成21年度第2回	150,000,000	158,122,500	
長野県 公募平成25年度第1回	1,100,000,000	1,107,557,000	
群馬県 公募第8回	100,000,000	105,661,000	
群馬県 公募(5年)第4回	600,000,000	603,894,000	
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	125,782,000	
岐阜県 公募平成19年度第1回	190,000,000	194,812,700	
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	195,051,483	
共同発行市場地方債 公募第56回	400,000,000	409,844,000	
共同発行市場地方債 公募第58回	270,500,000	277,435,620	
共同発行市場地方債 公募第62回	100,000,000	103,387,000	
共同発行市場地方債 公募第63回	200,000,000	207,656,000	
共同発行市場地方債 公募第64回	262,000,000	271,906,220	
共同発行市場地方債 公募第65回	700,000,000	725,046,000	
共同発行市場地方債 公募第66回	181,000,000	187,439,980	

共同発行市場地方債 公募第 6 8 回	900,000,000	937,332,000	
共同発行市場地方債 公募第 7 0 回	110,000,000	114,115,100	
共同発行市場地方債 公募第 7 4 回	500,000,000	523,245,000	
共同発行市場地方債 公募第 7 5 回	310,000,000	325,496,900	
共同発行市場地方債 公募第 8 2 回	300,000,000	315,510,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 4 回	500,000,000	526,300,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 5 回	100,000,000	105,644,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 8 回	100,000,000	104,890,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 9 回	100,000,000	104,455,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 2 回	110,000,000	115,100,700	
共同発行市場地方債 公募第 9 3 回	300,000,000	317,139,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 4 回	300,000,000	317,253,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 6 回	100,000,000	106,191,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 1 回	300,000,000	316,503,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 2 回	150,000,000	158,224,500	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 3 回	100,000,000	105,412,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 8 回	200,000,000	211,780,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 0 回	200,000,000	210,644,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 1 回	200,000,000	210,918,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 3 回	200,000,000	209,676,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 5 回	100,000,000	105,159,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 6 回	200,000,000	210,462,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 8 回	100,000,000	105,594,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 9 回	200,000,000	210,862,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 0 回	300,000,000	314,052,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 1 回	100,000,000	103,960,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 2 回	400,000,000	417,568,000	

回			
共同発行市場地方債 公募第124回	100,000,000	106,491,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	105,984,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	315,144,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	105,841,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	105,192,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	209,988,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	209,464,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	162,213,700	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	561,432,600	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	127,633,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	137,366,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	104,860,000	
島根県 公募平成25年度第3回	700,000,000	704,879,000	
福島県 公募平成24年度第2回	100,000,000	100,349,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	208,222,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	104,905,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	147,901,520	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	104,905,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	245,974,696	
大阪市 公募平成20年度第3回	110,000,000	114,216,300	
大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	105,420,000	
大阪市 公募平成25年度第1回	800,000,000	806,560,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	105,024,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	116,855,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	129,032,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	126,721,000	
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	126,712,000	
名古屋市 公募第460回	200,000,000	204,428,000	
名古屋市 公募第464回	300,000,000	311,010,000	

名古屋市 公募第469回	100,000,000	104,788,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	106,113,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	315,159,000	
名古屋市 公募(6年)第1回	200,000,000	201,260,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	218,640,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	111,480,000	
京都市 公募平成19年度第2回	300,000,000	307,953,000	
京都市 公募平成19年度第4回	190,000,000	195,223,100	
京都市 公募平成20年度第4回	200,000,000	208,348,000	
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	105,854,000	
京都市 公募平成25年度第3回	100,000,000	100,769,000	
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	119,655,000	
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	121,974,000	
神戸市 公募平成21年度第7回	100,000,000	105,125,000	
横浜市 公募平成20年度第3回	100,000,000	103,512,000	
横浜市 公募公債平成20年度5回	200,000,000	207,964,000	
横浜市 公募平成21年度第4回	200,000,000	208,890,000	
横浜市 公募平成22年度第5回	100,000,000	105,731,000	
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	210,324,000	
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	209,010,000	
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	209,660,000	
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	208,022,000	
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	128,134,000	
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	122,500,000	
札幌市 公募平成19年度第3回	100,000,000	102,244,000	
札幌市 公募平成22年度第4回	100,000,000	104,276,000	
札幌市 公募(5年)平成24年度第8回	200,000,000	200,676,000	
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	128,820,000	
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	104,353,000	
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	207,260,000	
川崎市 公募第81回	100,000,000	104,393,000	
川崎市 公募第82回	100,000,000	105,011,000	
川崎市 公募第85回	100,000,000	104,736,000	
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	124,505,000	
北九州市 公募(5年)平成25年	100,000,000	100,780,000	

		度第2回			
		北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	127,127,000	
		福岡市 公募平成20年度第3回	100,000,000	103,099,000	
		福岡市 公募平成24年度第5回	100,000,000	100,350,000	
		福岡市 公募(5年)平成25年度第2回	300,000,000	302,472,000	
		福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	124,324,000	
		福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	104,529,000	
		福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	166,500,800	
		広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	104,807,000	
		仙台市 公募平成25年度第1回	600,000,000	604,044,000	
		千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	106,210,000	
		鹿児島県 公募(5年)平成25年度第1回	100,000,000	100,633,000	
		福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	103,247,000	
		徳島県 公募平成22年度第1回	400,000,000	419,052,000	
		山梨県 公募平成19年度第1回	200,000,000	205,110,000	
		山梨県 公募平成21年度第1回	100,000,000	104,704,000	
		岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	105,400,000	
		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	128,330,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	389,277,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	126,791,000	
		東京都住宅供給公社債券 第5回	200,000,000	204,752,000	
	小計	銘柄数:278 組入時価比率:7.6%	48,772,020,000	52,056,918,551 7.7%	
	合計			52,056,918,551	
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	104,626,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	158,802,170	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	203,367,250	
		新関西国際空港社債 財投機関債第10回	100,000,000	100,233,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	112,515,000	

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	2,105,880,000	
原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第5回	3,590,000,000	3,593,877,200	
韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	100,000,000	100,906,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第18回	100,000,000	102,176,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	115,584,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回	100,000,000	101,796,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	112,286,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第5回	100,000,000	104,032,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	141,000,000	147,188,490	
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	107,434,560	
日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	140,000,000	146,666,800	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第344回	200,000,000	213,288,000	
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	144,602,000	
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	246,742,000	
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	251,904,000	
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	345,068,000	
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	103,729,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	100,000,000	128,125,000	
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	129,711,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第80回	100,000,000	106,152,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	424,088,000	

券 財投機関債第 8 4 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 6 回	200,000,000	211,174,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 8 9 回	100,000,000	124,754,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 2 回	100,000,000	104,793,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 3 回	350,000,000	437,993,500	
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	127,793,000	
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	301,911,000	
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	209,444,000	
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	208,948,000	
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	395,985,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 4 9 回	100,000,000	134,370,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 7 3 回	100,000,000	107,750,000	
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	109,069,000	
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	109,218,000	
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	102,445,000	
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	210,311,550	
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	140,522,000	
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	293,383,270	
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	103,623,000	
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	354,067,120	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 9 回	100,000,000	103,958,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 7 1 回	100,000,000	103,594,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	255,716,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	256,204,000	
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	314,526,000	
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	260,178,000	
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	421,256,000	
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	258,310,000	
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	253,526,000	
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	146,066,000	
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	467,372,400	
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	147,959,000	
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	105,214,000	
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	147,442,400	
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	142,149,000	
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	105,329,000	
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	125,693,000	
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	229,272,780	
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	124,545,000	
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	434,277,000	
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	210,706,000	
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	210,432,000	
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	210,094,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	423,112,000	

券 政府保証債第182回			
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	127,749,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第189回	196,000,000	203,802,760	
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	417,920,000	
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	212,966,000	
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	288,692,640	
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	316,077,000	
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	144,163,730	
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	152,489,250	
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	124,660,000	
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	124,695,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第220回	100,000,000	105,327,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第225回	190,000,000	199,026,900	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第234回	100,000,000	104,120,000	
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	147,608,000	
公営企業債券 政府保証第880回	131,000,000	134,133,520	
公営企業債券 政府保証第881回	200,000,000	204,812,000	
公営企業債券 政府保証第886回	203,000,000	210,342,510	
公営企業債券 30年第4回財投機 関債	100,000,000	148,184,000	
公営企業債券 政府保証15年第1 回	300,000,000	319,620,000	
政保 地方公営企業等金融機構債 券 第2回	400,000,000	415,616,000	
地方公営企業等金融機構債券 第1 回	200,000,000	208,040,000	
地方公営企業等金融機構債券(20 年) 第1回	100,000,000	124,680,000	

地方公共団体金融機構債券 第1回	100,000,000	105,021,000	
地方公共団体金融機構債券 第2回	100,000,000	104,405,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第5回	200,000,000	208,222,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	127,091,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	387,435,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	111,622,000	
地方公共団体金融機構債券 第13回	200,000,000	210,416,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第16回	100,000,000	104,389,000	
地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	105,083,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	316,599,000	
地方公共団体金融機構債券 第28回	100,000,000	105,701,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第1回	100,000,000	100,523,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	111,457,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第4回	500,000,000	503,750,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	110,019,000	
地方公共団体金融機構債券 第37回	300,000,000	316,101,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	204,214,100	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	105,103,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	106,338,860	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	107,323,380	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	632,238,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	108,672,000	

地方公共団体金融機構債券 F 1 4 4 回	200,000,000	205,142,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5 回	200,000,000	218,562,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	108,000,000	113,801,760	
地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	100,000,000	105,447,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 3 回	202,000,000	212,144,440	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	102,000,000	107,868,060	
地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	100,000,000	105,520,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 5 回	223,000,000	235,690,930	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	111,697,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	106,541,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6 年) 第 1 0 回	300,000,000	303,966,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	300,000,000	319,089,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (4 年) 第 6 回	400,000,000	401,048,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	317,799,000	
地方公共団体金融機構債券 (1 5 年) 第 2 回	200,000,000	226,962,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	122,238,480	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6 年) 第 1 4 回	300,000,000	302,910,000	
地方公共団体金融機構債券 (2 0 年) 第 3 8 回	100,000,000	122,999,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	104,638,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	104,909,000	
地方公共団体金融機構債券 (2 0 年) 第 3 9 回	100,000,000	122,005,000	
政保 地方公共団体金融機構債券	400,000,000	418,576,000	

第65回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	300,000,000	311,259,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	197,920,800	
公営企業債券(20年) 第2回財 投機関債	100,000,000	109,715,000	
公営企業債券(20年) 第5回財 投機関債	200,000,000	231,250,000	
公営企業債券(20年) 第25回 財投機関債	100,000,000	129,025,000	
公営企業債券 第29回財投機関債	500,000,000	513,310,000	
首都高速道路社債 第12回	100,000,000	100,690,000	
首都高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	104,801,000	
阪神高速道路 第13回	100,000,000	100,580,000	
阪神高速道路債券 政府保証第5回	100,000,000	104,994,000	
日本政策金融公庫債券 政府保証第 22回	2,000,000,000	2,012,960,000	
中小企業債券 第6回財投機関債	100,000,000	101,372,000	
都市再生債券 財投機関債第21回	300,000,000	311,616,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	105,804,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	112,375,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7回	100,000,000	120,223,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 16回	120,000,000	126,321,600	
東京交通債券 第342回	200,000,000	228,908,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	182,030,510	
関西国際空港社債 財投機関債第2 6回	300,000,000	315,048,000	
関西国際空港社債 財投機関債第3 2回	100,000,000	106,274,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機 関債	100,000,000	105,815,000	
中部国際空港債券 政府保証第18 回	368,000,000	385,704,480	
預金保険機構債券 政府保証第19 4回	300,000,000	300,543,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第3回	200,000,000	247,014,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債	200,000,000	206,432,000	

第14回			
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	115,915,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第25回	300,000,000	312,456,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第41回	100,000,000	105,308,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	116,959,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	125,775,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第73回	100,000,000	106,379,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	128,892,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	350,787,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	128,795,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	105,777,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	211,314,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	232,098,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	148,728,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	208,632,000	
私学振興債券 財投機関債第7回	300,000,000	306,453,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	106,140,000	
商工債券 利付第753回い号	100,000,000	100,459,000	
農林債券 利付第751回い号	200,000,000	201,016,000	
農林債券 利付第752回い号	100,000,000	100,521,000	
農林債券 利付第756回い号	100,000,000	100,582,000	
農林債券 利付第759回い号	100,000,000	100,906,000	
農林債券 利付第760回い号	100,000,000	100,922,000	
農林債券 利付第761回い号	100,000,000	100,745,000	
農林債券 利付第764回い号	100,000,000	100,968,000	
農林債券 利付第765回い号	300,000,000	302,604,000	
農林債券 利付第767回い号	300,000,000	302,715,000	

農林債券 利付第773回い号	300,000,000	302,616,000	
農林債券 利付第777回い号	300,000,000	303,090,000	
しんきん中金債券 利付第277回	100,000,000	100,433,000	
しんきん中金債券 利付第284回	100,000,000	100,867,000	
しんきん中金債券 利付第286回	100,000,000	100,809,000	
しんきん中金債券 利付第287回	100,000,000	100,745,000	
しんきん中金債券 利付第290回	100,000,000	100,839,000	
しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	100,826,000	
商工債券 利付(3年)第174回	200,000,000	200,418,000	
商工債券 利付(3年)第178回	1,000,000,000	1,002,650,000	
商工債券 利付(3年)第181回	500,000,000	501,455,000	
商工債券 利付(3年)第182回	100,000,000	100,279,000	
商工債券 利付(10年)第5回	600,000,000	616,236,000	
あおぞら債券 利付(3年)第71回	400,000,000	401,012,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	100,000,000	128,491,000	
東日本高速道路 第21回	100,000,000	101,118,000	
東日本高速道路 第26回	100,000,000	100,922,000	
東日本高速道路 第27回	100,000,000	100,753,000	
中日本高速道路債券 財投機関債第3回	100,000,000	102,372,000	
中日本高速道路社債 第32回	200,000,000	202,764,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	101,731,000	
中日本高速道路社債 第46回	1,500,000,000	1,506,630,000	
中日本高速道路社債 第47回	100,000,000	100,452,000	
中日本高速道路 第62回	100,000,000	100,973,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	211,286,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	104,848,000	
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	210,064,000	
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	122,005,000	
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	14,873,000	15,471,935	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	51,894,000	53,930,320	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫	94,085,000	98,493,823	

債券			
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	93,822,000	96,625,401	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	59,112,000	62,510,348	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	75,726,000	81,909,027	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	20,642,000	22,245,883	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	50,830,000	53,910,298	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	55,202,000	59,157,775	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	56,658,000	59,289,197	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	112,748,000	118,923,207	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	99,670,000	105,591,394	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	97,576,000	105,826,050	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	55,480,000	59,454,587	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	27,731,000	29,789,472	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	38,499,000	42,212,228	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	131,574,000	142,795,946	
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	33,253,000	34,834,512	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	139,900,000	148,919,353	
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	68,026,000	71,457,911	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	194,076,000	209,270,210	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	140,682,000	150,459,399	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	74,482,000	81,735,057	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	187,041,000	202,623,385	

貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	193,014,000	203,984,915	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	232,869,000	246,857,440	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	228,780,000	243,531,734	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	151,224,000	160,633,157	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	67,238,000	72,204,198	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	140,832,000	151,085,977	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	82,232,000	86,700,486	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	168,658,000	178,165,251	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	79,826,000	84,123,033	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	41,032,000	43,190,693	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	238,992,000	253,940,949	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	48,717,000	52,571,489	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	50,399,000	54,340,705	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	53,302,000	57,351,352	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	65,231,000	70,522,538	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	152,572,000	162,948,421	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	224,412,000	239,689,968	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	75,190,000	80,358,560	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	156,518,000	165,981,078	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	19,233,000	20,363,900	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	153,685,000	160,582,382	
貸付債権担保S種第15回住宅金融	62,002,000	64,694,746	

	支援機構債券			
	貸付債権担保第 1 回住宅金融公庫債券	25,810,000	26,482,866	
	貸付債権担保第 7 回住宅金融公庫債券	53,784,000	55,345,887	
	貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援機構債券	303,020,000	321,928,448	
	貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援機構債券	152,238,000	162,562,781	
	貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援機構債券	240,567,000	254,611,301	
	貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援機構債券	166,174,000	177,595,139	
	貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援機構債券	155,340,000	165,183,895	
	貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援機構債券	89,709,000	94,189,964	
	貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援機構債券	90,853,000	95,551,008	
	貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援機構債券	91,197,000	95,453,163	
	貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援機構債券	186,096,000	193,329,551	
	貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援機構債券	187,494,000	193,075,696	
	貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援機構債券	94,407,000	98,542,026	
	貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援機構債券	95,059,000	98,897,482	
	貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援機構債券	285,513,000	298,846,457	
	貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援機構債券	288,801,000	303,908,180	
	貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券	192,974,000	202,863,917	
	貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	96,537,000	101,207,460	
	貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	96,904,000	101,947,853	
小計	銘柄数：281	54,776,017,000	58,495,045,964	
	組入時価比率：8.6%		8.6%	
合計			58,495,045,964	

社債券	日本円	新韓銀行 第5回円貨社債(2014)	200,000,000	199,490,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	103,785,000	
		ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング 第2回円貨社債	200,000,000	199,168,000	
		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	194,736,000	
		スタンダード・チャータード 第2回円貨社債(2015)	100,000,000	98,563,000	
		スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015)	100,000,000	96,473,000	
		成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	211,240,000	
		エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第12回	100,000,000	107,195,000	
		パークレイズ・バンク・ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	99,376,000	
		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	201,696,000	
		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	100,924,000	
		ラボバンク・ネーデルランド 第23回円貨社債(2013)(コー	100,000,000	101,057,000	
		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	100,881,000	
		ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債(2014)	200,000,000	202,328,000	
		清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,493,000	
		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	102,150,000	
		森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,994,000	
		アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,862,000	
		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	102,078,000	
		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	209,286,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,943,000			
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	104,438,000			

森ビル 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,333,000	
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	104,298,000	
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	103,831,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,657,000	
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,722,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,009,000	
エア・ウォーター 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,049,000	
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	203,976,000	
宇部興産 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,721,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,455,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,745,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,579,000	
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	104,059,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,336,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,448,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,513,000	
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	101,154,000	
新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,857,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,548,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,882,000	
神戸製鋼所 第63回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,347,000	
ジェイ エフ イー ホールディン	100,000,000	103,067,000	

グス 第22回(J F E ス保証			
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,755,000	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,683,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	225,936,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,958,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,471,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,353,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,376,000	
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,370,000	
ソニー 第26回	100,000,000	105,529,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,203,000	
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	303,375,000	
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,348,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	106,402,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,466,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,655,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,035,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,280,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,110,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,267,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	213,040,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,868,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,051,000	

位特約付			
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,597,000	
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	102,294,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	105,092,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,436,000	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,662,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,022,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,771,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,690,000	
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,115,000	
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	105,190,000	
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	209,640,000	
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	125,290,000	
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	2,009,140,000	
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	301,269,000	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	106,788,000	
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	109,988,000	
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	113,979,000	
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	102,642,000	
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	104,584,000	
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	502,155,000	
三菱東京UFJ銀行 第12回(劣後特約付)	300,000,000	306,810,000	

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	312,306,000	
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	104,542,000	
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	110,789,000	
りそな銀行 第4回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	107,668,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	320,622,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特 約付	100,000,000	107,205,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約 付	300,000,000	322,170,000	
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	100,723,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	105,110,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	103,840,000	
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	209,540,000	
三井住友銀行 第57回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,413,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	107,059,000	
みずほ銀行 第35回特定社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,709,000	
興銀リース 第4回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,875,000	
NTTファイナンス 第46回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,812,000	
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	100,676,000	
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	100,677,000	
ジャックス 第12回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,323,000	
オリエントコーポレーション 第2 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,960,000	
日立キャピタル 第52回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	102,017,000	
日立キャピタル 第56回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,548,000	

日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,076,000	
オリックス 第144回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,129,000	
オリックス 第164回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,238,000	
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	100,873,000	
三井住友ファイナンス&リース 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,822,000	
三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,783,000	
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	100,921,000	
大和証券グループ本社 第22回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,052,000	
大和証券グループ本社 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,962,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	106,605,000	
野村ホールディングス 第41回	200,000,000	202,802,000	
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	102,732,000	
三井不動産 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,500,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	113,916,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	104,355,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,749,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	105,224,000	
東京建物 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,089,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,917,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,812,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,779,000	
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	104,132,000	

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	106,423,000	
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	101,253,000	
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	104,176,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	220,056,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,676,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	116,286,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	223,780,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	111,038,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	226,918,000	
東日本旅客鉄道 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,612,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	124,938,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	127,284,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	124,952,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,565,000	
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,926,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	257,072,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	117,870,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	134,704,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,981,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,225,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	101,854,000	
住友倉庫 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,354,000	

日本電信電話 第60回	100,000,000	105,885,000	
KDDI 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,585,000	
NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,900,000	
東京電力 第455回	200,000,000	208,372,000	
東京電力 第459回	100,000,000	106,152,000	
東京電力 第542回	100,000,000	102,437,000	
東京電力 第544回	100,000,000	103,401,000	
東京電力 第547回	100,000,000	106,243,000	
東京電力 第548回	100,000,000	116,200,000	
東京電力 第559回	100,000,000	103,225,000	
東京電力 第560回	100,000,000	114,412,000	
東京電力 第565回	300,000,000	310,812,000	
中部電力 第482回	200,000,000	212,696,000	
中部電力 第500回	200,000,000	211,830,000	
関西電力 第448回	200,000,000	208,094,000	
関西電力 第469回	100,000,000	103,676,000	
関西電力 第482回	100,000,000	104,224,000	
関西電力 第484回	100,000,000	103,569,000	
関西電力 第496回	100,000,000	105,534,000	
関西電力 第497回	200,000,000	212,840,000	
関西電力 第498回	200,000,000	202,278,000	
中国電力 第314回	100,000,000	105,217,000	
中国電力 第330回	100,000,000	109,384,000	
中国電力 第377回	200,000,000	214,270,000	
中国電力 第378回	100,000,000	106,461,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	106,969,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	106,352,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	108,062,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	105,257,000	
東北電力 第431回	400,000,000	413,720,000	
東北電力 第473回	100,000,000	102,289,000	
東北電力 第475回	100,000,000	105,070,000	
東北電力 第481回	200,000,000	210,476,000	
四国電力 第281回	200,000,000	214,314,000	
九州電力 第400回	100,000,000	106,304,000	

	九州電力 第409回	100,000,000	104,364,000	
	九州電力 第420回	300,000,000	304,074,000	
	九州電力 第424回	200,000,000	214,696,000	
	北海道電力 第296回	100,000,000	103,832,000	
	北海道電力 第316回	207,000,000	215,497,350	
	北海道電力 第323回	100,000,000	111,453,000	
	電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,658,000	
	電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,892,000	
	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,870,000	
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,729,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,950,000	
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,098,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	141,172,000	
	大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,609,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,784,000	
	東京都競馬 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,234,000	
	ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,696,000	
小計	銘柄数：205 組入時価比率：4.4%	28,607,000,000	29,934,540,350	4.4%
合計			29,934,540,350	
合計			678,039,056,765	

(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28年 6月28日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	184,967,156
コール・ローン	1,813,897,787
国債証券	604,660,716,799
未収利息	5,713,614,964
前払費用	475,865,963
流動資産合計	612,849,062,669
資産合計	
612,849,062,669	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,523,668
未払金	1,707,662,399
未払解約金	156,163,203
未払利息	2,855
その他未払費用	5,164,400
流動負債合計	1,880,516,525
負債合計	
1,880,516,525	
純資産の部	
元本等	
元本	300,224,930,331
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	310,743,615,813
元本等合計	610,968,546,144
純資産合計	
610,968,546,144	
負債純資産合計	
612,849,062,669	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

平成28年 6月28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	2.0350円
(10,000口当たり純資産額)	(20,350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 6月30日 至 平成28年 6月28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なっております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6月28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> 国債証券</p> <p> （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p> 派生商品評価勘定</p> <p> デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p> コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p> これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年 6月28日現在	
期首	平成27年 6月30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	241,741,257,937円
同期中における追加設定元本額	86,491,346,328円
同期中における一部解約元本額	28,007,673,934円
期末元本額	300,224,930,331円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	87,919,117円
バランスセレクト50	90,042,226円
バランスセレクト70	68,571,208円
野村外国債券インデックスファンド	282,668,659円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,749,948,214円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	30,000,117,058円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,517,406,085円
野村資産設計ファンド2015	45,735,896円
野村資産設計ファンド2020	49,619,615円
野村資産設計ファンド2025	47,770,662円
野村資産設計ファンド2030	39,133,898円
野村資産設計ファンド2035	25,875,870円
野村資産設計ファンド2040	71,874,968円
野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け）	184,701,702,438円
のむらップ・ファンド（保守型）	4,588,865,292円
のむらップ・ファンド（普通型）	6,261,300,375円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,484,708,114円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	1,642,819,908円
野村資産設計ファンド2045	5,399,437円
野村インデックスファンド・外国債券	586,806,802円
マイ・ロード	8,755,858,248円
ネクストコア	510,326,186円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	84,565,930円
野村外国債券インデックス（野村SMA・EW向け）	2,145,902,828円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,518,667,621円
野村資産設計ファンド2050	2,532,202円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	2,945,091円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	474,360円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	388,015円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	532,536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）	38,877,066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）	2,481,738,882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）	639,556,812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）	9,026,338,811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）	1,763,930,046円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	7,632,194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)	31,408,268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)	3,705,916円
野村インデックス・バランス60V A(適格機関投資家専用)	7,205,235,982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)	519,326,348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)	1,893,708,453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)	208,079,545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)	104,986,392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)	242,124,518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)	2,116,381,681円
野村世界バランス25V A(適格機関投資家専用)	1,107,724,898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)	1,492,671,158円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	140,631,023円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	4,258,887円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,347,734円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	4,849,136円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	520,761,232円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,875,286,148円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	2,484,327,990円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,228,650,558円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	12,267,185,963円
マイバランスDC30	1,033,891,746円
マイバランスDC50	601,803,154円
マイバランスDC70	361,757,282円
野村DC外国債券インデックスファンド	2,662,808,089円
野村DC運用戦略ファンド	755,491,318円
野村DC運用戦略ファンドM	5,454,044円
野村DC運用戦略ファンドA	2,720,320円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	13,342,742円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	213,143円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	243,993円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年 6月28日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成28年 6月28日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	10,500,000.00	12,766,933.20	

US TREASURY BOND	19,300,000.00	23,726,937.50	
US TREASURY BOND	12,700,000.00	16,761,023.12	
US TREASURY BOND	23,500,000.00	32,070,156.25	
US TREASURY BOND	19,400,000.00	26,077,842.78	
US TREASURY BOND	31,200,000.00	33,664,310.16	
US TREASURY BOND	43,200,000.00	60,999,747.84	
US TREASURY BOND	13,800,000.00	20,489,765.28	
US TREASURY BOND	23,700,000.00	35,055,632.22	
US TREASURY BOND	12,000,000.00	17,199,374.40	
US TREASURY BOND	5,000,000.00	7,056,250.00	
US TREASURY BOND	2,800,000.00	3,971,625.00	
US TREASURY BOND	2,200,000.00	3,151,500.00	
US TREASURY BOND	22,300,000.00	25,183,318.64	
US TREASURY BOND	16,000,000.00	21,207,499.20	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,103,996.08	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,178,945.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,019,062.40	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	16,964,694.89	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	28,762,897.38	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,399,601.52	
US TREASURY N/B	29,800,000.00	31,230,632.44	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,034,101.00	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	22,243,041.60	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,011,328.00	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	35,067,362.85	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,006,562.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,004,101.50	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,822,303.30	
US TREASURY N/B	49,600,000.00	52,140,060.64	
US TREASURY N/B	18,600,000.00	19,043,928.06	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,550,507.60	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,016,171.80	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	17,439,346.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,018,437.20	
US TREASURY N/B	41,000,000.00	42,942,694.80	

US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,079,218.00	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,351,550.16	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,027,031.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,005,234.20	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,088,981.40	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,297,812.00	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,200,750.00	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	16,158,905.68	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,170,312.50	
US TREASURY N/B	15,500,000.00	15,618,671.10	
US TREASURY N/B	31,200,000.00	32,300,530.08	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,629,823.90	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,100,437.28	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,453,656.08	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	5,155,312.32	
US TREASURY N/B	20,600,000.00	20,989,467.72	
US TREASURY N/B	27,400,000.00	27,851,669.82	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,179,375.00	
US TREASURY N/B	35,400,000.00	38,021,812.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,071,093.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,615,527.10	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,614,726.15	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,176,101.18	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,042,343.60	
US TREASURY N/B	27,500,000.00	28,999,608.00	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,583,320.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,086,562.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,091,093.60	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	26,145,468.75	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,743,500.00	
US TREASURY N/B	29,500,000.00	31,546,562.50	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,840,570.18	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,017,265.60	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	8,112,929.49	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,896,483.65	

US TREASURY N/B	37,000,000.00	40,324,216.90	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,024,843.60	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,042,687.28	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,023,437.50	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,258,656.25	
US TREASURY N/B	49,300,000.00	53,609,894.74	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,863,937.28	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,842,890.58	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,142,500.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,907,765.34	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,040,625.00	
US TREASURY N/B	51,800,000.00	57,048,795.58	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,740,921.74	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,044,374.80	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	21,717,678.09	
US TREASURY N/B	47,700,000.00	52,499,812.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,655,390.30	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	15,070,937.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,287,500.00	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,489,843.20	
US TREASURY N/B	42,500,000.00	45,488,281.25	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	7,348,359.20	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,270,937.20	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,655,124.96	
US TREASURY N/B	50,100,000.00	53,730,291.09	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	7,225,531.08	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,577,835.54	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	51,310,312.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,235,546.50	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,906,453.08	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,072,640.48	
US TREASURY N/B	36,400,000.00	40,094,028.52	
US TREASURY N/B	12,500,000.00	13,101,562.50	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,663,819.87	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	10,288,062.50	

US TREASURY N/B	26,800,000.00	28,265,625.00	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,652,167.33	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,878,748.80	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,540,546.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,340,000.00	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	13,090,718.44	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,108,203.00	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	35,363,937.50	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,557,210.39	
US TREASURY N/B	5,900,000.00	6,105,117.04	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,173,046.50	
US TREASURY N/B	11,900,000.00	12,312,781.25	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	10,103,156.25	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	28,510,312.50	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	19,001,522.05	
US TREASURY N/B	12,800,000.00	13,128,000.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,728,202.80	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	22,718,436.40	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,843,358.10	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,181,327.30	
US TREASURY N/B	42,200,000.00	43,637,437.50	
US TREASURY N/B	14,400,000.00	15,638,624.64	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	18,562,686.24	
US TREASURY N/B	27,300,000.00	30,202,757.13	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	33,088,500.00	
US TREASURY N/B	25,100,000.00	26,843,272.81	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,291,093.60	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	4,098,960.84	
US TREASURY N/B	300,000.00	446,296.86	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,893,906.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,544,062.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	728,125.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,902,538.95	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	7,026,171.50	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	7,993,046.60	

	US TREASURY N/B	7,700,000.00	10,994,757.62	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	11,815,312.00	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	11,436,249.60	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,666,874.40	
	US TREASURY N/B	7,800,000.00	10,974,843.36	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	10,552,226.30	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	10,038,163.80	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	7,713,417.40	
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,799,249.92	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,222,109.15	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	10,293,937.50	
	US TREASURY N/B	9,600,000.00	10,610,249.28	
	US TREASURY N/B	18,200,000.00	21,549,937.50	
	US TREASURY N/B	15,700,000.00	20,351,125.00	
	US TREASURY N/B	23,200,000.00	30,049,435.76	
	US TREASURY N/B	15,900,000.00	19,687,429.29	
	US TREASURY N/B	30,100,000.00	35,590,896.18	
	US TREASURY N/B	36,400,000.00	42,047,685.68	
	US TREASURY N/B	13,200,000.00	13,807,405.92	
	US TREASURY N/B	14,700,000.00	16,971,608.64	
	US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,773,828.00	
	US TREASURY NOTE	33,600,000.00	34,961,062.08	
小計	銘柄数：163	2,343,100,000.00	2,583,658,596.14	
			(262,577,223,125)	
	組入時価比率：43.0%		43.3%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	4,600,000.00	5,150,988.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,428,220.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	13,800,000.00	13,963,530.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	10,119,700.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,241,056.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,966,252.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	9,658,460.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,928,250.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	7,766,761.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,154,560.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,727,440.00
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,695,596.00
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,823,940.00
	CANADIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	11,295,700.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,090,242.00
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,413,697.00
	CANADIAN GOVERNMENT	6,900,000.00	7,651,341.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	6,281,379.00
	CANADIAN GOVERNMENT	5,180,000.00	7,839,153.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	4,836,930.00
	CANADIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	11,035,640.00
	CANADIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	9,317,952.00
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	11,563,066.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,257,020.00
小計	銘柄数：24	139,080,000.00	163,206,873.00 (12,692,598,513)
	組入時価比率：2.1%		2.1%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	1,005,415.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	60,800,000.00	63,786,313.60
	MEX BONOS DESARR FIX RT	148,100,000.00	147,833,271.90
	MEX BONOS DESARR FIX RT	104,500,000.00	113,027,513.50
	MEX BONOS DESARR FIX RT	29,000,000.00	28,792,679.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	60,700,000.00	66,446,590.40
	MEX BONOS DESARR FIX RT	85,600,000.00	89,424,180.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	38,400,000.00	39,963,724.80
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,700,000.00	39,004,043.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	71,600,000.00	78,873,700.80
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,100,000.00	55,810,815.30
	MEX BONOS DESARR FIX RT	41,000,000.00	46,055,300.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,228,890.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	63,281,234.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	37,031,758.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	54,200,000.00	61,603,936.80
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	93,892,173.00
小計	銘柄数：17	942,200,000.00	1,037,061,539.10

			(5,517,167,388)	
	組入時価比率：0.9%		0.9%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,142,828.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,449,680.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	8,257,130.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,200,000.00	8,940,960.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	6,238,250.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	8,202,880.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,837,000.00	
	BELGIUM KINGDOM	10,400,000.00	12,523,680.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	9,059,616.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,296,130.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,800,000.00	11,881,300.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	9,829,683.40	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,000,000.00	2,152,234.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,500,000.00	2,699,000.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,852,698.80	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,600,000.00	16,855,950.40	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	9,500,000.00	16,676,290.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	28,700,000.00	28,912,380.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,700,000.00	32,915,066.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,014,100.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,100,000.00	18,568,035.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,100,000.00	18,601,362.90	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,300,000.00	15,371,427.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	10,353,070.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	23,800,000.00	27,082,020.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,800,000.00	26,083,200.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,600,000.00	13,879,098.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,500,000.00	9,348,067.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	11,903,742.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,000,000.00	22,067,615.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	8,580,150.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	9,049,518.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,300,000.00	9,831,350.00		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000,000.00	17,970,904.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,952,942.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,800,000.00	6,524,640.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,900,000.00	7,260,712.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,400,000.00	6,392,698.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	11,402,045.20
BUNDES OblIGATION	1,700,000.00	1,751,000.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	4,392,180.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,700,000.00	9,910,170.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,031,800.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000.00	3,479,750.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	8,338,060.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,358,700.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	4,016,950.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,000,000.00	22,827,800.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,600,000.00	10,916,352.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,622,200.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,879,588.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,901,584.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	6,346,566.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,100,000.00	21,258,147.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,635,028.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,720,005.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,300,000.00	2,546,836.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	26,900,000.00	46,803,310.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	10,015,680.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,397,330.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	6,502,125.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	9,504,066.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,600,000.00	12,024,559.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,400,000.00	16,508,016.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,400,000.00	13,970,534.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	10,570,388.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	9,510,501.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	7,384,663.50

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	12,816,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,300,000.00	3,491,532.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	19,796,427.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	10,622,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	33,900,000.00	36,323,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	12,911,910.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	24,900,000.00	27,210,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,663,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,000,000.00	18,839,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,800,000.00	4,246,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	4,375,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	520,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	25,900,000.00	29,243,690.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,300,000.00	11,891,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	33,544,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,500,000.00	16,743,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,000,000.00	12,707,332.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	8,106,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	9,089,340.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,400,000.00	12,664,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,882,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	12,368,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,700,000.00	26,707,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	6,200,465.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	9,097,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	17,036,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,900,000.00	14,851,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,748,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	19,371,460.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	10,801,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,600,000.00	13,271,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,200,000.00	27,230,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	9,733,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	17,067,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	27,808,840.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	9,802,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	12,101,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000.00	7,412,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	11,887,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,600,000.00	21,695,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	10,287,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	4,810,530.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,109,858.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,556,077.50	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,494,538.50	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,293,800.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,375,726.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,576,025.60	
FINNISH GOVERNMENT	4,200,000.00	4,682,832.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,252,480.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,053,658.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,524,961.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	730,847.60	
FINNISH GOVERNMENT	1,400,000.00	2,092,227.20	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,337,416.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,500,000.00	8,763,865.50	
FRANCE (GOVT OF)	3,500,000.00	4,446,225.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,700,000.00	10,319,830.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,496,764.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	4,629,699.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	11,996,899.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	6,836,603.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	13,038,527.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,188,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	12,310,758.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,020,784.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,300,000.00	19,451,255.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	14,128,730.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	17,945,836.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,588,024.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,600,000.00	23,755,178.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	13,065,125.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,500,000.00	38,883,950.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	9,106,440.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	30,501,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,500,000.00	34,889,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	9,094,320.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	23,100,000.00	37,879,957.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	31,863,884.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	14,584,215.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,800,000.00	16,124,430.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,400,000.00	20,590,452.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,400,000.00	16,252,849.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	8,845,118.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,800,000.00	7,342,686.80	
FRENCH TREASURY NOTE	1,000,000.00	1,016,400.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	3,600,000.00	4,094,748.00	
IRISH GOVERNMENT	7,500,000.00	8,073,750.00	
IRISH GOVERNMENT	5,600,000.00	6,213,368.00	
IRISH GOVERNMENT	3,400,000.00	4,073,336.00	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,221,140.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,256,630.00	
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	8,381,880.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	2,600,000.00	3,055,416.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,500,000.00	1,686,697.50	
IRISH TSY 3.4% 2024	1,300,000.00	1,582,152.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,212,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	4,631,193.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	7,110,350.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,617,645.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	8,091,870.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,056,208.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,752,650.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,003,300.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,736,491.50	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,471,760.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,509,770.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,593,340.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,774,750.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,000,000.00	3,101,700.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,300,000.00	10,170,090.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,700,000.00	6,355,095.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	8,604,185.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5,200,000.00	9,375,990.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	7,305,880.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,588,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,243,597.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,389,010.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,829,875.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000.00	1,823,760.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,400,000.00	2,458,320.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,600,000.00	5,411,210.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,285,720.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	4,057,185.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	6,176,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,626,280.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,416,400.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,865,100.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,600,000.00	7,627,444.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,900,000.00	9,865,183.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,800,000.00	9,191,921.20	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,400,000.00	4,202,978.00	
	SPANISH GOVERNMENT	9,800,000.00	14,579,871.60	
	SPANISH GOVERNMENT	8,300,000.00	12,776,190.00	
	SPANISH GOVERNMENT	5,600,000.00	7,487,362.40	
小計	銘柄数：203	1,688,600,000.00	2,178,123,863.50 (243,884,528,996)	
	組入時価比率：39.9%		40.3%	
英債券	UK TREASURY	2,300,000.00	2,492,280.00	
	UK TREASURY	23,550,000.00	24,082,230.00	

	UK TREASURY	3,600,000.00	4,030,920.00	
	UK TREASURY	18,100,000.00	18,948,890.00	
	UK TREASURY	3,000,000.00	3,345,300.00	
	UK TREASURY	5,800,000.00	6,763,960.00	
	UK TREASURY	15,290,000.00	16,315,959.00	
	UK TREASURY	7,200,000.00	8,241,120.00	
	UK TREASURY	9,340,000.00	12,830,358.00	
	UK TREASURY	8,900,000.00	10,423,680.00	
	UK TREASURY	4,650,000.00	5,578,140.00	
	UK TREASURY	8,300,000.00	8,892,620.00	
	UK TREASURY	7,200,000.00	7,966,800.00	
	UK TREASURY	10,100,000.00	11,609,950.00	
	UK TREASURY	13,450,000.00	18,119,840.00	
	UK TREASURY	8,630,000.00	11,515,009.00	
	UK TREASURY	3,850,000.00	6,009,080.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	9,612,490.00	
	UK TREASURY	7,250,000.00	10,040,525.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	9,715,000.00	
	UK TREASURY	6,900,000.00	9,843,540.00	
	UK TREASURY	4,900,000.00	7,614,110.00	
	UK TREASURY	4,200,000.00	6,163,920.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,475,330.00	
	UK TREASURY	6,100,000.00	9,570,900.00	
	UK TREASURY	19,100,000.00	26,214,750.00	
	UK TREASURY	5,950,000.00	9,355,185.00	
	UK TREASURY	4,250,000.00	6,960,225.00	
	UK TREASURY	7,250,000.00	11,267,950.00	
	UK TREASURY	5,500,000.00	9,074,450.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	21,700,000.00	28,368,410.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	6,400,000.00	11,255,040.00	
小計	銘柄数：32	271,860,000.00	350,697,961.00	
			(47,130,298,978)	
	組入時価比率：7.7%		7.8%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	9,100,000.00	10,486,840.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,600,000.00	5,544,000.00	

小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.3%	12,700,000.00	16,030,840.00 (1,664,321,808) 0.3%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	7,000,000.00	7,353,094.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,200,000.00	18,377,847.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	49,400,000.00	61,460,960.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	56,600,000.00	69,100,110.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	22,400,000.00	24,917,715.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	40,200,000.00	48,380,700.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,300,000.00	23,575,488.70	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.5%	208,100,000.00	253,165,915.50 (3,005,079,416) 0.5%	
ノルウェークロ ーネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	23,300,000.00	26,023,770.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	31,734,480.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	15,431,845.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	47,100,000.00	54,376,950.00	
小計	銘柄数：4 組入時価比率：0.2%	112,300,000.00	127,567,045.00 (1,511,669,483) 0.3%	
デンマーククロ ーネ	KINGDOM OF DENMARK	25,100,000.00	28,982,970.00	
	KINGDOM OF DENMARK	52,100,000.00	61,367,287.50	
	KINGDOM OF DENMARK	42,000,000.00	47,214,300.00	
	KINGDOM OF DENMARK	14,500,000.00	23,237,700.00	
	KINGDOM OF DENMARK	18,600,000.00	21,453,240.00	
	KINGDOM OF DENMARK	48,300,000.00	91,401,326.10	
小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.7%	200,600,000.00	273,656,823.60 (4,121,271,763) 0.7%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,852,545.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	8,100,000.00	8,408,610.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,900,000.00	11,090,750.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	6,037,910.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	12,367,620.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,200,000.00	5,104,886.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	34,476,100.00	

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	4,700,000.00	5,494,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	11,129,600.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,600,000.00	10,404,960.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	19,600,000.00	20,079,788.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,667,920.00	
	銘柄数：12	126,300,000.00	137,114,990.40 (3,442,957,408)	
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,113,204.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	10,389,087.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,880,010.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,600,000.00	14,932,664.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	3,011,792.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,100,000.00	14,517,826.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	905,499.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	12,145,864.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	9,683,030.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	9,239,400.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	8,353,460.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	16,000,000.00	17,589,040.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	11,414,250.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,050,000.00	7,590,287.65	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	11,191,183.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,607,517.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,835,136.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	6,336,543.60	
	小計	銘柄数：18	134,950,000.00	152,735,795.85 (11,417,000,739)
		組入時価比率：1.9%		1.9%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,703,680.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,600,000.00	4,780,780.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,000,000.00	4,322,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,580,000.00	2,681,600.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,310,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,216,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,644,000.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,806,550.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,617,944.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	582,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,900,000.00	3,175,500.00	
	銘柄数：11	27,580,000.00	29,841,154.40	(2,229,731,056)
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,057,676.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,385,910.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,715,562.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,300,000.00	4,354,459.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,009,690.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	12,261,831.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	10,027,090.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,445,141.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,183,066.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,940,154.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,523,382.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	10,227,131.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,928,388.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,130,492.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	3,798,636.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,727,746.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,959,397.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,572,900.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,420,275.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,582,335.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	377,622.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,699,910.20		
小計	銘柄数：22	112,900,000.00	114,328,799.30	(2,825,064,630)
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,300,000.00	10,352,614.46	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	28,800,000.00	28,703,672.64	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,300,000.00	24,410,449.47	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	24,266,827.35	

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,200,000.00	23,860,791.36	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	65,800,000.00	71,887,190.90	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,000,000.00	24,009,590.70	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	24,114,000.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	41,000,000.00	36,553,787.80	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	47,100,000.00	33,137,346.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	22,500,000.00	20,088,000.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,600,000.00	17,171,823.36	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	22,100,000.00	19,842,871.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,100,000.00	41,268,733.83	
	小計	銘柄数：14	441,900,000.00	399,667,699.92	
				(2,641,803,496)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	合計			604,660,716,799	
				(604,660,716,799)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年 6月28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	1,640,040,068	-	1,628,516,400	11,523,668
米ドル	724,397,700	-	721,502,000	2,895,700
カナダドル	19,558,247	-	19,440,000	118,247
メキシコペソ	27,537,450	-	27,081,000	456,450
ユーロ	693,091,410	-	688,554,000	4,537,410
英ポンド	121,106,451	-	118,254,400	2,852,051
豪ドル	15,124,000	-	14,946,000	178,000
リングギ	22,403,810	-	22,239,000	164,810
ランド	16,821,000	-	16,500,000	321,000
合計	1,640,040,068	-	1,628,516,400	11,523,668

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

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28年 7月29日現在

資産総額	314,737,532円
負債総額	98,374円
純資産総額（ - ）	314,639,158円
発行済口数	340,783,534口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9233円

（参考）国内株式マザーファンド

平成28年 7月29日現在

資産総額	354,258,451,439円
負債総額	69,928,686,283円
純資産総額（ - ）	284,329,765,156円
発行済口数	230,228,840,835口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2350円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成28年 7月29日現在

資産総額	318,300,546,226円
負債総額	1,075,970,865円
純資産総額（ - ）	317,224,575,361円
発行済口数	162,683,125,801口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9500円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

平成28年 7月29日現在

資産総額	681,956,425,423円
負債総額	3,692,897,751円
純資産総額（ - ）	678,263,527,672円
発行済口数	507,977,321,036口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3352円

（参考）外国債券マザーファンド

平成28年 7月29日現在

資産総額	636,539,713,768円
負債総額	1,151,961,295円
純資産総額（ - ）	635,387,752,473円
発行済口数	300,697,170,700口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1130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28年8月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

代表執行役・執行役

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

委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は平成28年7月29日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	909	17,507,148
単位型株式投資信託	56	206,117
追加型公社債投資信託	16	5,273,381
単位型公社債投資信託	257	1,789,716
合計	1,238	24,776,363

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27年4月1日から平成28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	当事業年度
		(平成27年3月31日)	(平成28年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		411	208
金銭の信託		56,824	55,341
有価証券		17,100	24,100
前払金		15	34
前払費用		29	2
未収入金		330	511
未収委託者報酬		12,679	14,131
未収運用受託報酬		7,436	7,309
繰延税金資産		2,594	2,028
その他		73	56
貸倒引当金		9	10
流動資産計		97,486	103,715
固定資産			
有形固定資産		1,322	1,176
建物	2	413	403
器具備品	2	909	773
無形固定資産		7,254	7,681
ソフトウェア		7,253	7,680

その他		1		0	
投資その他の資産			24,840		23,225
投資有価証券		11,593		9,216	
関係会社株式		10,149		10,958	
従業員長期貸付金		30		-	
長期差入保証金		49		45	
長期前払費用		60		49	
前払年金費用		2,776		2,777	
その他		179		176	
貸倒引当金		0		-	
固定資産計			33,417		32,083
資産合計			130,903		135,799

区分	注記 番号	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			118		118
未払金	1		11,602		11,855
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		32		31	
未払手数料		4,883		4,537	
その他未払金		6,684		7,284	
未払費用	1		10,221		8,872
未払法人税等			1,961		1,838
前受収益			-		45
賞与引当金			4,558		4,809
外国税支払損失引当金			1,721		-
流動負債計			30,182		27,538
固定負債					
退職給付引当金			2,467		2,708
時効後支払損失引当金			521		526
繰延税金負債			747		68
固定負債計			3,735		3,303
負債合計			33,918		30,842
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			11,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		-		2,000	
利益剰余金			61,182		68,696
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		60,497		68,011	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		35,890		43,405	
評価・換算差額等			6,893		5,349
その他有価証券評価差額金			6,893		5,349
純資産合計			96,985		104,956

負債・純資産合計			130,903		135,799
----------	--	--	---------	--	---------

(2)【損益計算書】

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

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249
会計方針の変更による累積的影響額						81	81	81

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	-	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092
当期変動額									

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

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

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

<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
<p>4. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 外国税支払損失引当金 将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p>								
<p>5. 消費税等の会計処理方法</p>	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p>								
<p>6. 連結納税制度の適用</p>	<p>連結納税制度を適用しております。</p>								

[注記事項]

貸借対照表関係

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

損益計算書関係

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

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 10,043百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額	1,950円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月2日

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

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項	
配当金の総額	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月26日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項	
配当金の総額	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月26日

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

平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項	
配当金の総額	34,973百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	6,790円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

金融商品関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自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

ティプ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

合計	87,015	-	-	-
----	--------	---	---	---

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	208	208	-
(2)金銭の信託	55,341	55,341	-
(3)未収委託者報酬	14,131	14,131	-
(4)未収運用受託報酬	7,309	7,309	-
(5)有価証券及び投資有価証券	32,071	32,071	-
その他有価証券	32,071	32,071	-

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,245百万円、関係会社株式7,894百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

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

4．その他有価証券(平成27年3月31日)

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

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成28年3月31日)

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

4．その他有価証券(平成28年3月31日)

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

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

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

退職給付関係

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

税効果会計関係

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

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

企業結合等関係

1. 会社分割について

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

(1) 企業結合の概要

会社分割の目的

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

会社分割日程

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

会社分割の方法

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

(2) 実施した会計処理の概要

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

2. 吸収合併について

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

(1) 企業結合の概要

吸収合併の目的

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

吸収合併日程

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

吸収合併の方法

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

(2) 実施した会計処理の概要

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

セグメント情報等

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

（２）地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（１）製品・サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

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

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

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

(株)野村総合研究所

流動資産合計 229,418

固定資産合計 273,220

流動負債合計 87,832

固定負債合計 65,965

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

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

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

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

1株当たり情報

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

4【利害関係人との取引制限】

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

止されています。

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

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

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

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

*平成28年7月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

* 平成28年7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・連絡等を行いません。

(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、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成27年 9月17日	有価証券届出書の訂正届出書
平成27年 9月17日	有価証券報告書
平成28年 3月23日	有価証券届出書
平成28年 3月23日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成28年6月6日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成28年8月19日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマイターゲット2050（確定拠出年金向け）の平成27年6月30日から平成28年6月28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28年6月28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。