

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年3月16日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成30年3月17日から平成31年3月15日まで) 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 1兆円を上限とします。 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 1兆円を上限とします。 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 1兆円を上限とします。 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型

野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型

野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型

野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型

これらを総称して「野村ターゲットデートファンド2016」または「各ファンド」という場合、あるいは個別に「ファンド」という場合があります。なお、ファンドの愛称を「未来図」とします。

ファンドの名称については、正式名称ではなく略称で記載する場合があります。

正式名称	略称
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	2026-2028年目標型 野村ターゲットデート2016 2026-2028年目標型
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2029-2031年目標型 野村ターゲットデート2016 2029-2031年目標型
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2032-2034年目標型 野村ターゲットデート2016 2032-2034年目標型
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	2035-2037年目標型 野村ターゲットデート2016 2035-2037年目標型

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

信用格付

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額をその時の受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当たりの価額で表示されます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（５）【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%（税抜2.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

（６）【申込単位】

1万口以上1口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位

（購入コースには、分配金を受取る一般コースと、分配金が再投資される自動けいぞく投資コースがあります。原則、購入後に購入コースの変更はできません。）

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

（７）【申込期間】

平成30年 3月17日から平成31年 3月15日まで

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

（８）【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（９）【払込期日】

取得申込日から起算して7営業日目までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売

会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、「委託者」(または「委託会社」といいます。)の指定する口座を経由して、「受託者」(または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座に払い込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

申込代金は申込みの販売会社にお支払いください。払込取扱場所についてご不明の場合は、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(1 1) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国（新興国を含む）の各債券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」、「新興国株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」とします。なお、別に定める親投資信託証券については後述の《マザーファンドの概要》をご覧ください。

信託金の限度額

信託金限度額は、各ファンドにつき5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

<商品分類>

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

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

- （野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型）
- （野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型）
- （野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型）
- （野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型）

《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
追加型	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産 ()	
		資産複合	

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
--------	------	--------	------	-------	----------

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)	T O P I X
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券) 資産配分 変更型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (合成指数)
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

各ファンドは、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。

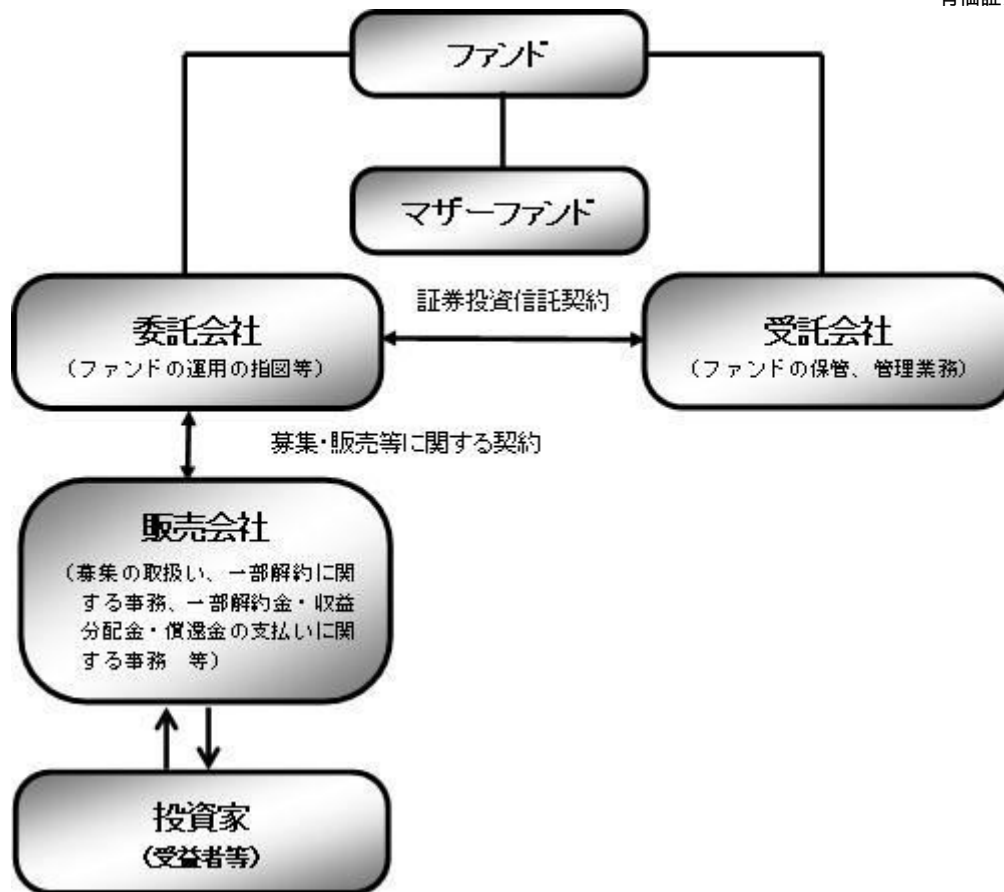
〔特殊型〕

- (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】

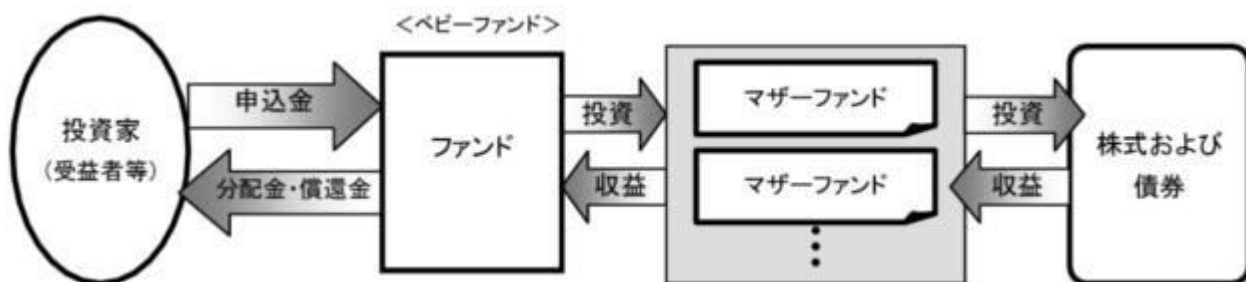
平成28年4月1日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(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、投資家の皆様が出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	野村ターゲットデ トファンド2016 2026-2028年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2029-2031年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2032-2034年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2035-2037年目標型
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			
	新興国株式マザーファンド			
	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド			
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド			
	外国債券マザーファンド			
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド			
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

委託会社の概況(平成30年1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】

「野村ターゲットデートファンド2016」は、ターゲット時期の異なる4本のファンド(「2026-2028年目標型」、「2029-2031年目標型」、「2032-2034年目標型」、「2035-2037年目標型」)で構成されています。

「2026-2028年目標型」は2026年から2028年、「2029-2031年目標型」は2029年から2031年、「2032-2034年目標型」は2032年から2034年、「2035-2037年目標型」は2035年から2037年をターゲット時期とします。

各ファンドは、「投資基礎期」、「資産形成期」、ターゲット時期を含む「目標前準備期」を定め、各期間毎に株式および債券の配分比率(「株式・債券配分」といいます。)を変化させます。また、各期間において、株式・債券配分を変化させることに合わせて、各マザーファンドへの基本投資割合を定期的に変更します。

株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合の変更は、当面、原則毎月行なうことを基本とします。

当面の株式・債券配分は「株式・債券配分のイメージ図」をご覧ください。

各期間における株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上で行ないます。

各ファンドの「投資基礎期」、「資産形成期」、「目標前準備期」の期間はそれぞれ以下のとおりとします。

ファンド名	投資基礎期	資産形成期	目標前準備期
2026-2028年目標型	当初設定日から 2017年12月	2018年1月から 2022年12月	2023年1月以降
2029-2031年目標型	当初設定日から 2018年12月	2019年1月から 2025年12月	2026年1月以降
2032-2034年目標型	当初設定日から 2019年12月	2020年1月から 2028年12月	2029年1月以降
2035-2037年目標型	当初設定日から 2020年12月	2021年1月から 2031年12月	2032年1月以降

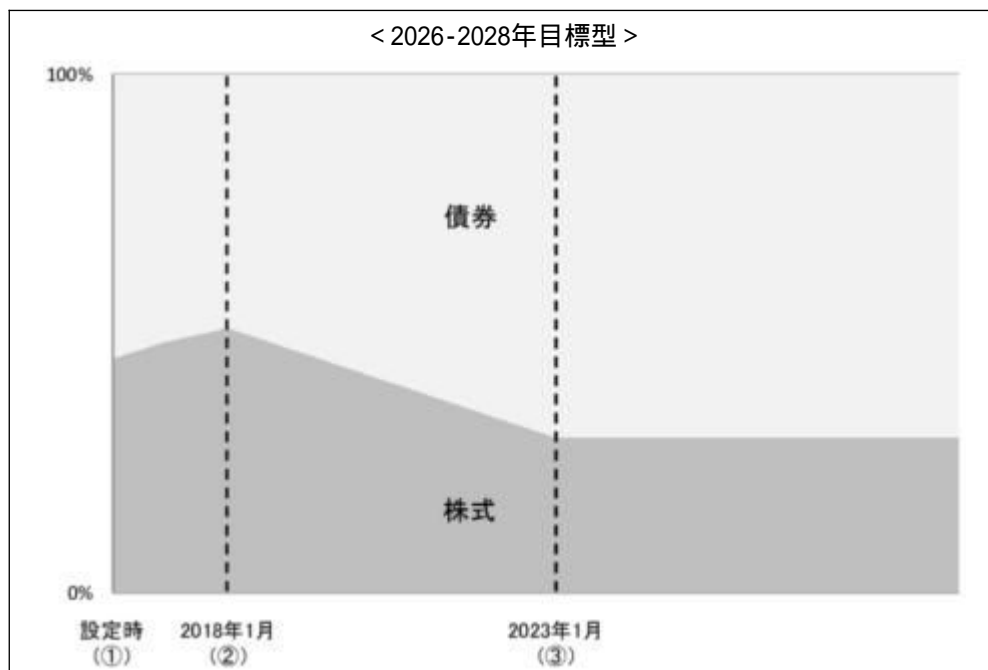
「投資基礎期」は、株式への実質投資割合を徐々に増やし、債券への実質投資割合を徐々に減らすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

「資産形成期」は、株式への実質投資割合を徐々に減らし、債券への実質投資割合を徐々に増やすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

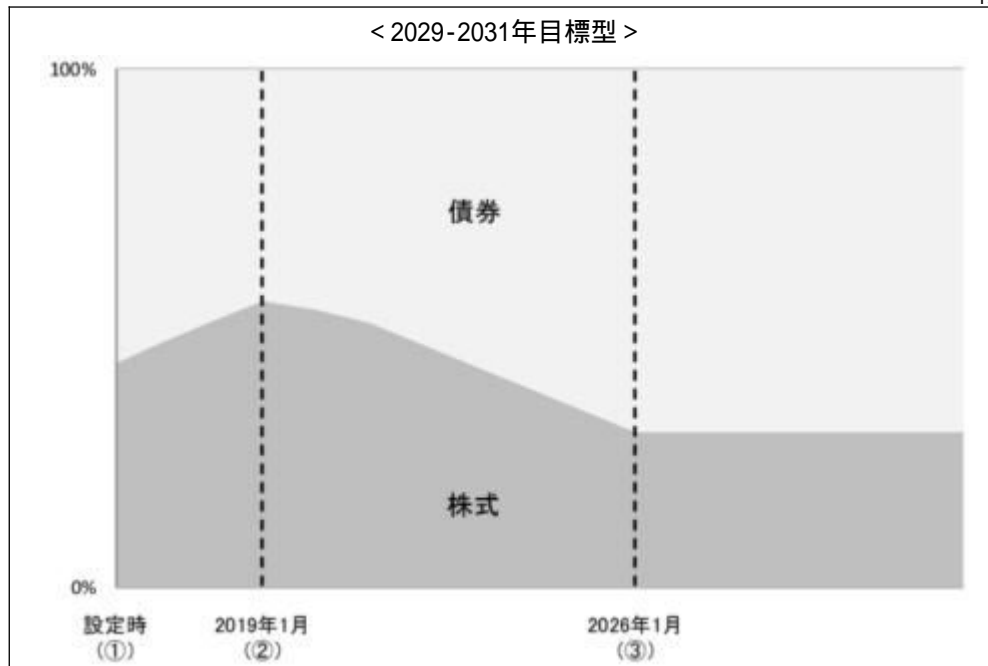
「目標前準備期」は、株式・債券配分を一定とすることを基本とします。

・期間中は、安定運用を行なう場合があります。

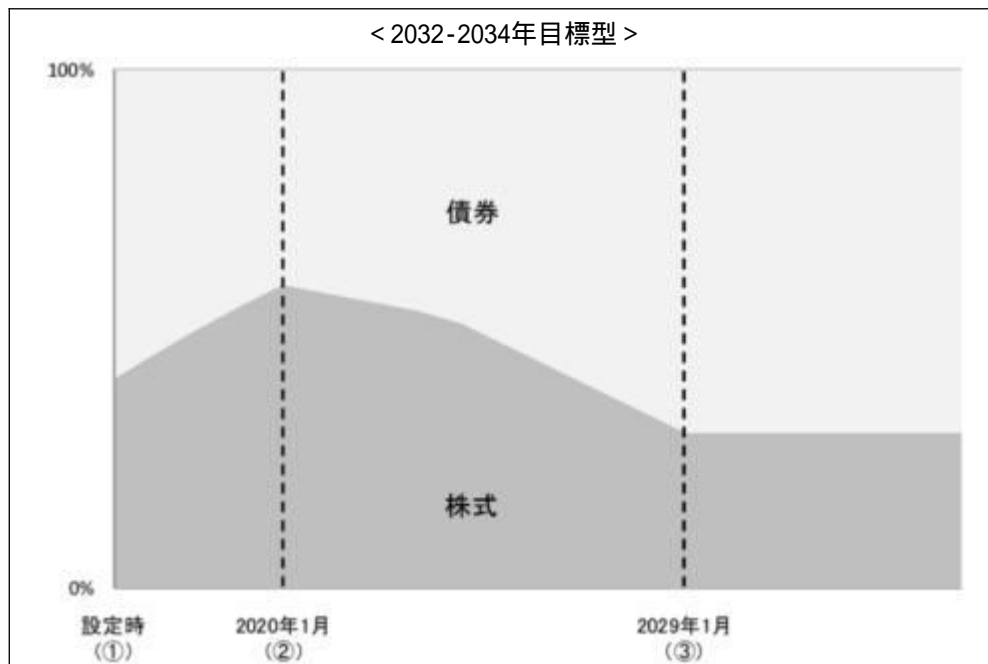
株式・債券配分のイメージ図



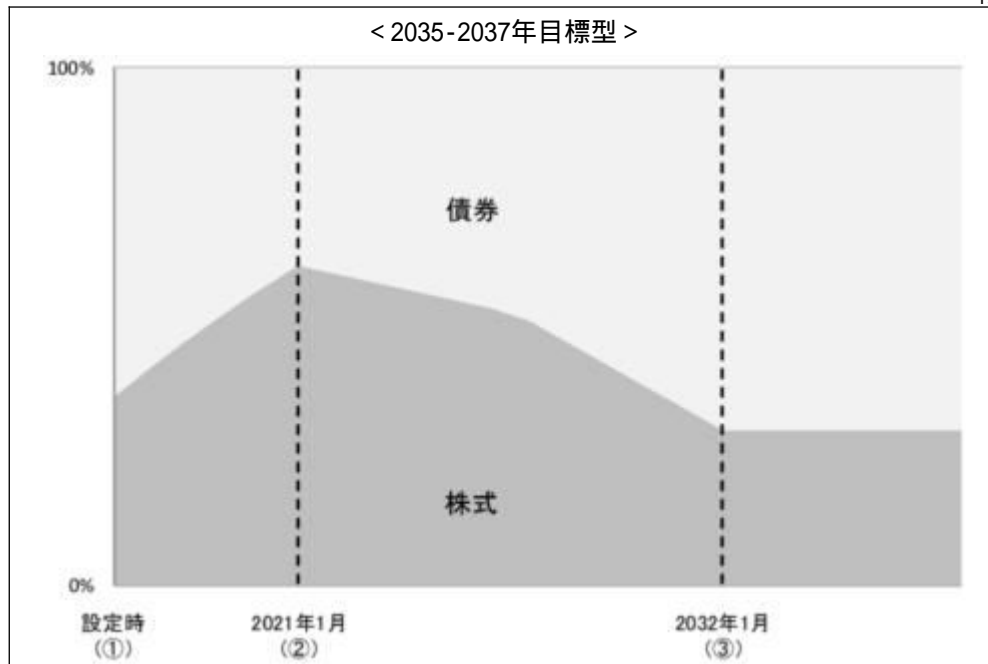
投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式45.2%	株式51.1%	株式30.0%
債券54.8%	債券48.9%	債券70.0%



投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式43.2%	株式55.2%	株式30.0%
債券56.8%	債券44.8%	債券70.0%



投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式40.5%	株式58.5%	株式30.0%
債券59.5%	債券41.5%	債券70.0%



投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式36.5%	株式61.8%	株式30.0%
債券63.5%	債券38.2%	債券70.0%

各マザーファンドへの基本投資割合

		2026-2028年 目標型		2029-2031年 目標型		2032-2034年 目標型		2035-2037年 目標型		各ファンド 共通 目標前 準備期 開始日
		2018年 3月	資産 形成期 開始日	2018年 3月	資産 形成期 開始日	2018年 3月	資産 形成期 開始日	2018年 3月	資産 形成期 開始日	
株式	国内株式マザーファンド	25.2%	25.5%	25.9%	27.6%	25.1%	29.2%	23.8%	30.9%	15.0%
	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	15.1%	15.4%	15.6%	16.6%	15.1%	17.6%	14.3%	18.6%	9.0%
	新興国株式マザーファンド	10.1%	10.2%	10.3%	11.0%	10.0%	11.7%	9.5%	12.3%	6.0%
債券	国内債券NOMURA-BPI 総合 マザーファンド	17.3%	17.0%	15.7%	14.9%	15.2%	13.2%	14.5%	11.6%	30.0%
	外国債券為替ヘッジ型 マザーファンド	17.3%	17.0%	15.7%	14.9%	15.2%	13.2%	14.5%	11.6%	30.0%
	外国債券マザーファンド	12.3%	12.2%	13.7%	12.3%	15.9%	12.3%	19.2%	12.3%	8.2%
	新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド	2.7%	2.7%	3.1%	2.7%	3.5%	2.8%	4.2%	2.7%	1.8%

上記の株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合は、2018年3月現在のものであり、家計や市場の構造変化等により変更する場合があります。

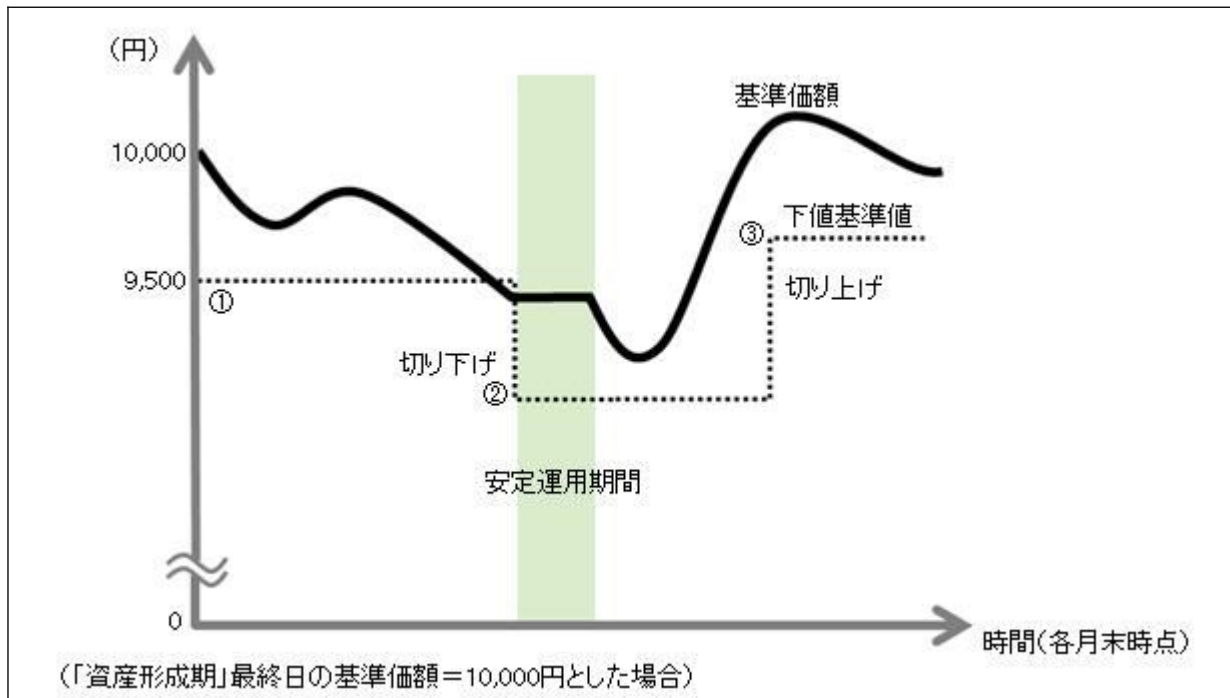
「目標前準備期」の各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する株式および債券の実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する安定運用を行ないます。なお、安定運用を行なうにあたっては、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の売建てを行なう場合があります。

株式および債券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。

* 各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、各ファンドの「資産形成期」最終日の基準価額の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各ファンドの「資産形成期」最終日）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、「目標前準備期」における株式・債券配分となるよう、株式および債券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）



<ご参考例>

「資産形成期」最終日の基準価額が10,000円の場合、当初の下値基準値は当該基準価額の95%程度の9,500円程度となります。

「目標前準備期」の月末における基準価額が でめた下値基準値（9,500円程度）を下回った場合、安定運用を行ない、下値基準値（9,500円程度）を見直します。

例えば、月末の基準価額が9,400円の場合、当該基準価額の95%程度の8,930円程度が新たな下値基準値となります。

安定運用期間終了後の月末における基準価額が で下値基準値の見直しを行なった時点の基準価額（9,400円）を一定水準上回った場合、下値基準値（8,930円程度）を見直します。

例えば、月末の基準価額が10,200円の場合、当該基準価額の95%程度の9,690円程度が新たな下値基準値となります。

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、各期間の株式・債券配分の範囲内で各マザーファンドへの投資比率を決定します。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。

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。

《マザーファンドの概要》

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) ^{*2}
新興国株式マザーファンド	新興国の株式(DR(預託証券) ^{*1} を含みます)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース) ^{*3}
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-債券・パフォーマンス・インデックス総合)
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース) ^{*4}

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

*2 MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

*3 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・ドルベース)をもとに、委託会社が円換算したものです。

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

各ファンドは、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、各マザーファンド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。

実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行なうマザーファンドを通じて投資する部分を除き、原則として為替ヘッジを行ないません。

ただし、「目標前準備期」で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。

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。

[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ないません。

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。

[新興国株式マザーファンド]

- ・新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ない

ます。

- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[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、野村証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。

[外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。
- ・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。

「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率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す。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

[外国債券マザーファンド]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE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。

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率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す。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

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

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets(GBI-EM)Global

Diversified（USドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets(GBI-EM)Global Diversified）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数です（ただし、国別の組入比率には上限が設定されています）。

各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

東証株価指数（TOPIX）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

「MSCI-KOKUSAI指数」、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」

MSCI-KOKUSAI指数、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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、参加もしておりません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

ていたとしても、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

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

NOMURA-BPI総合

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

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)」、

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率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す。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income 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

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

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

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド(英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員)及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

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

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

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（新興国を含む）の各株式、国内および外国（新興国を含む）の各債券を投資対象とします。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。

別に定め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
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証書）を含みます）
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債
外国債券マザーファンド	外国の公社債
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債

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

有価証券の指図範囲等（信託約款）

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された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。）
 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. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
 13. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第11号の証券または証書の性質を有するもの
 14. 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。）
 15. 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。）
 16. 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。）
 17. 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。）
 18. 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。）
 19. 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。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 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18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
 22. 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13号、第18号および第19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13号、第18号および第19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14号および第15号の証券ならびに第18号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）
8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第12号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第12号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）
9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの
10. 流動性のある外国の者に対する貸付債権

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引
3. 金利先渡取引

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

4. 為替先渡取引

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

5. 直物為替先渡取引

「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で

反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

(参考)各マザーファンドの概要

「国内株式マザーファンド」

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

「新興国株式マザーファンド」

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2)投資態度

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

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。

「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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す。

効率的な運用を行なうため、債券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

「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、FTSE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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

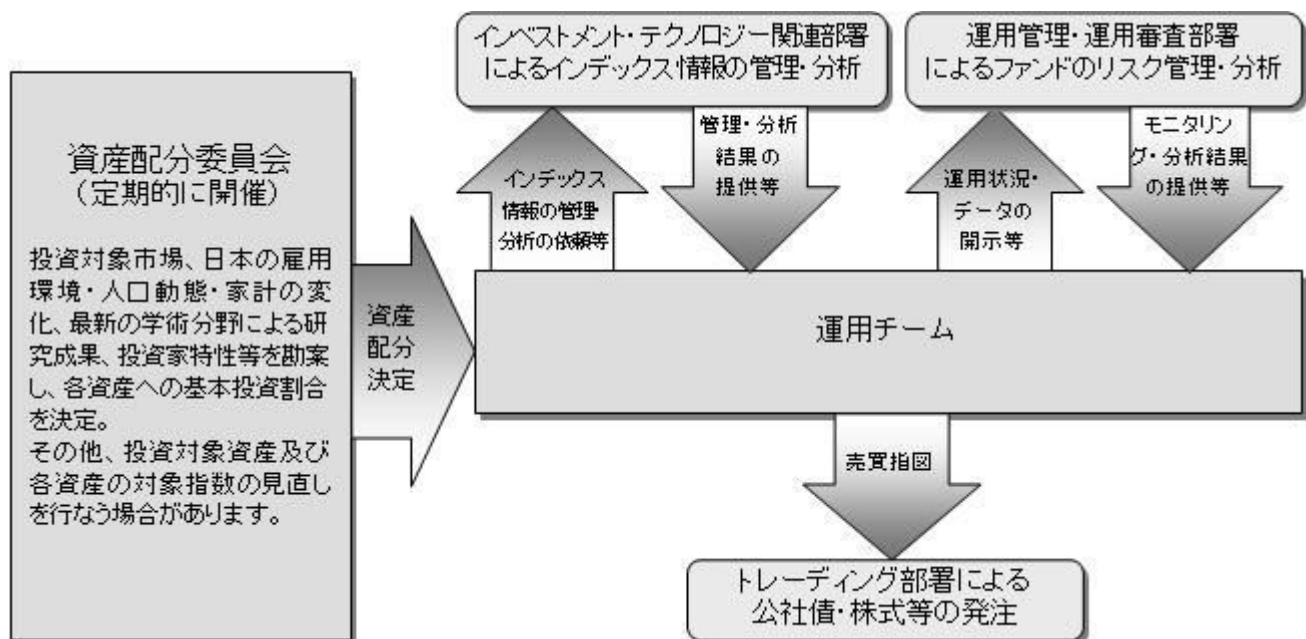
一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をい

ます。)の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(3) 【運用体制】

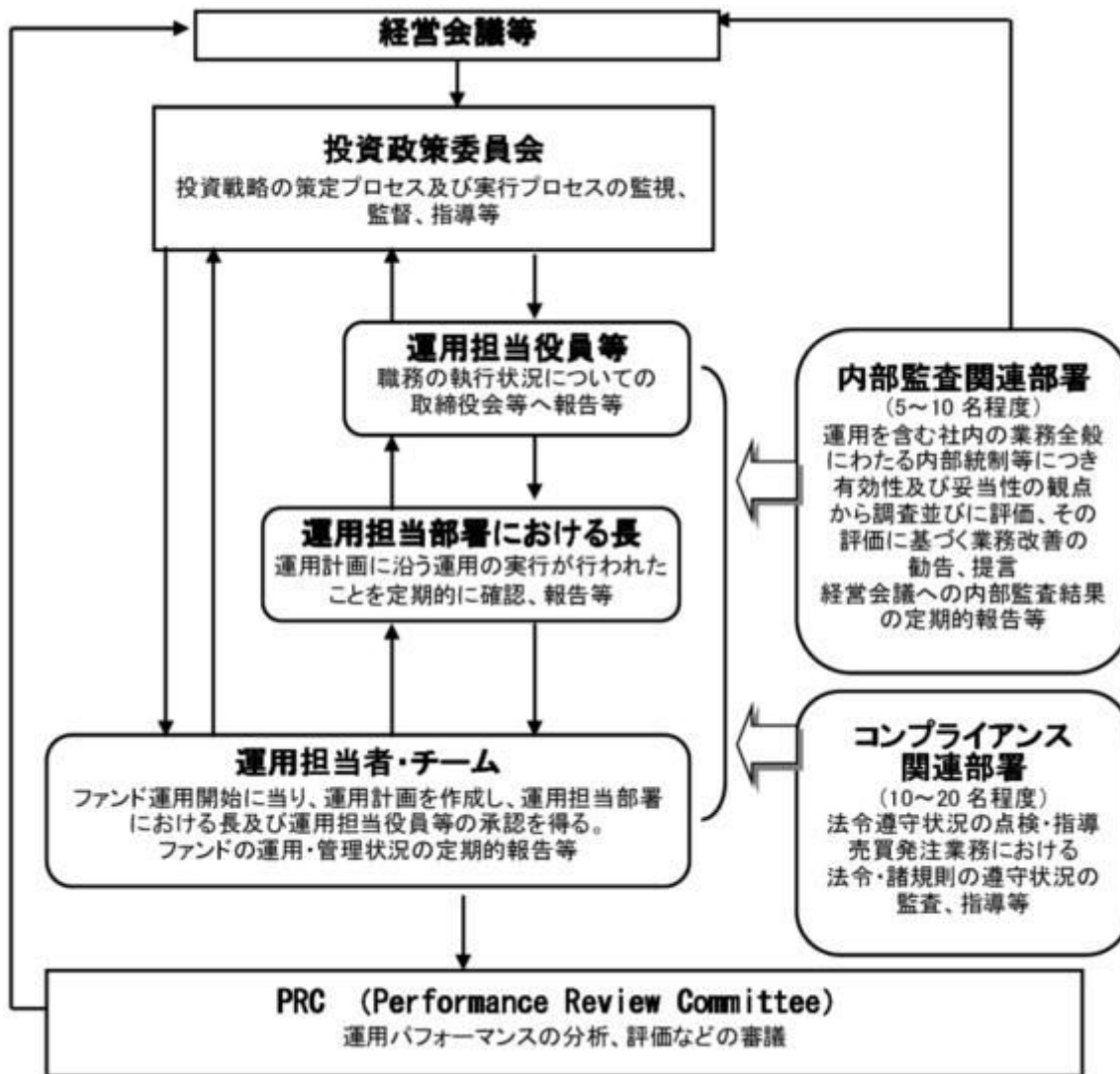
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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12月26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書の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券

5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

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および株式にかかる有価証券店頭オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ハおよびニに掲げるものをいいます。以下同じ。)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。
- ()上記()の店頭オプション取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ()委託者は、上記()の店頭オプション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。

スワップ取引の運用指図(信託約款)

- ()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引および有価証券店頭指数等スワップ取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ホに掲げるものをいいます。以下同じ。)(これらを総称して以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ()スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ()スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ()委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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たときは、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たときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

()上記()の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

()信託財産の一部解約等の事由により、上記()の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

()上記()の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

()金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

()金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

()委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券（外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。）への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

()直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

()直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

()委託者は、直物為替先渡取引を行なうにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたとき

は、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

資金の借入れ(信託約款)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ()一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ()収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ()借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

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

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、為替ヘッジを行なうマザーファンドを通じて投資する部分を除き、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。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる

可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されま
す。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

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。

目標前準備期開始日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

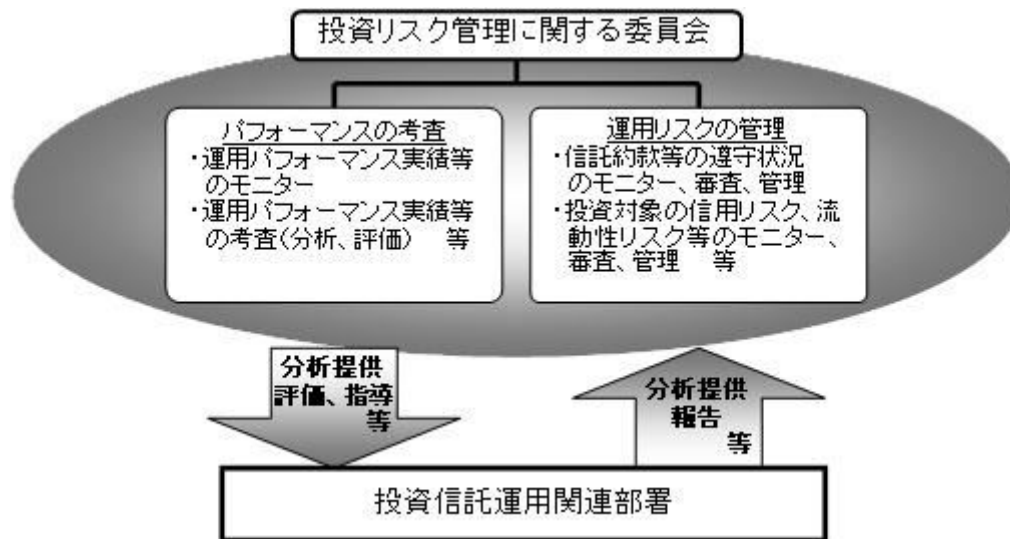
パフォーマンスの考査

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。

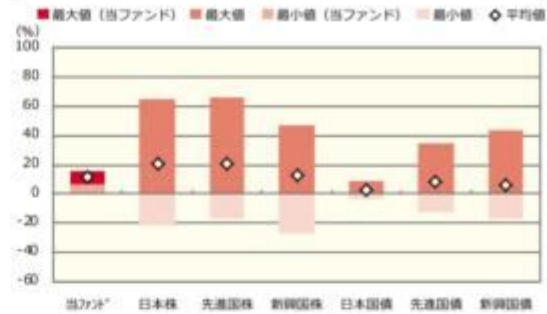
■ リスクの定量的比較 (2013年2月末～2018年1月末：月次)

2026-2028年目標型

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



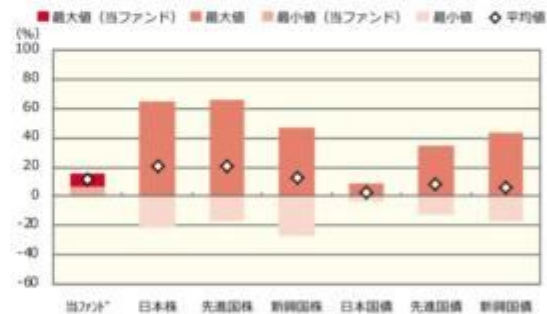
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	15.0	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値 (%)	6.8	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	11.5	20.2	20.9	12.6	2.3	8.7	6.2

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年4月から2018年1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おりません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2013年2月から2018年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2018年1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おりません。

2029-2031年目標型

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



	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 (%)	15.0	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値 (%)	6.5	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	11.4	20.2	20.9	12.6	2.3	8.7	6.2

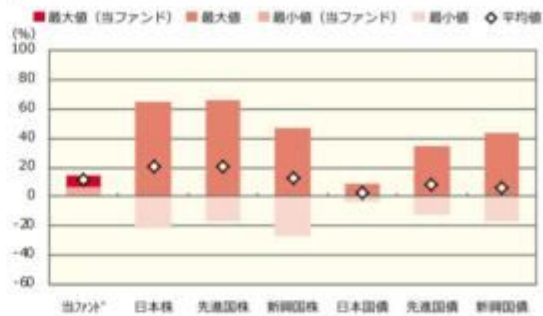
- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年4月から2018年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2013年2月から2018年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2018年1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おりません。

2032-2034年目標型**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**

2013年2月 2014年1月 2015年1月 2016年1月 2017年1月 2018年1月

- * 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、2017年4月から2018年1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おりません。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

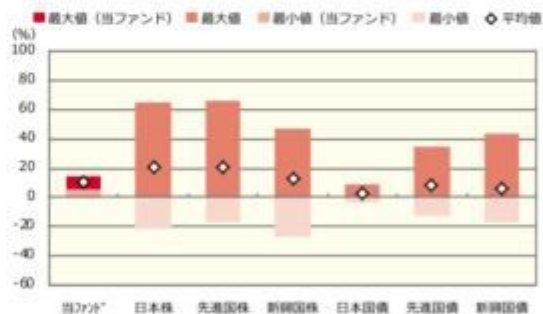
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	14.8	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値 (%)	6.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	11.1	20.2	20.9	12.6	2.3	8.7	6.2

- * 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。
- * 2013年2月から2018年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2018年1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おりません。

2035-2037年目標型**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**

2013年2月 2014年1月 2015年1月 2016年1月 2017年1月 2018年1月

- * 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、2017年4月から2018年1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おりません。

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 (%)	14.4	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値 (%)	5.5	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	10.7	20.2	20.9	12.6	2.3	8.7	6.2

- * 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。
- * 2013年2月から2018年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2018年1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おりません。

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

<p><代表的な資産クラスの指数></p> <ul style="list-style-type: none"> ○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：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース） ○新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）
<p style="text-align: center;">■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■</p> <p>○東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、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。</p> <p>○MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> <p>○NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。</p> <p>○FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率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す。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。</p> <p>○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価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を法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、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、または競主になっている可能性もあります。</p> <p>米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に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、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。</p> <p>JPMSLLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JP SI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。</p>

（出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他）

4 【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜2.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせ下さい。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

購入時手数料は、商品及び関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務コストの対価として、購入時に頂戴するものです。

（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 >
	年1.026% (税抜年0.95%)	年0.45%	年0.45%	年0.05%
	年0.9612% (税抜年0.89%)	年0.42%	年0.42%	年0.05%

ファンド名		
2026-2028年目標型	(1~7期) 設定日~2022年決算日	(8期以降) 2022年決算日翌日以降
2029-2031年目標型	(1~10期) 設定日~2025年決算日	(11期以降) 2025年決算日翌日以降
2032-2034年目標型	(1~13期) 設定日~2028年決算日	(14期以降) 2028年決算日翌日以降
2035-2037年目標型	(1~16期) 設定日~2031年決算日	(17期以降) 2031年決算日翌日以降

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	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等	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。

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口当たりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資家との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、クローズド期間の有無に関係なく、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

* 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。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%(国税(所得税及び復興特別所得税)15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除は適用されません。

< 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 >

換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)については、申告分離課税により20.315%(国税15.315%および地方税5%)の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 特定公社債^(注1)の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金 	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

(注1) 「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、平成27年12月31日以前に発行された公社債(同族会社が発行した社債を除きます。)などの一定の公社債をいいます。

(注2) 株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

上場株式、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

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。

換金（解約）時および償還時の課税について

〔個人の投資家の場合〕

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

〔法人の投資家の場合〕

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

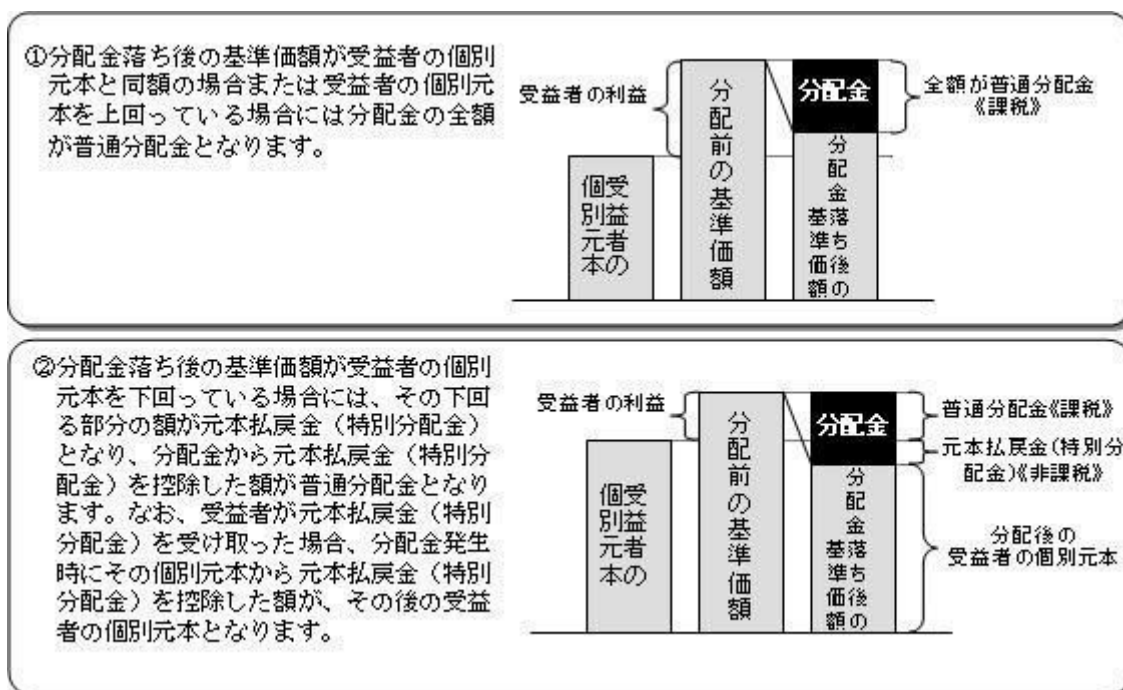
個別元本について

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。

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30年1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30年 1月31日現在の運用状況であります。

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

（１）【投資状況】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

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	90,155,281	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）		93,958	0.10
合計（純資産総額）		90,249,239	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

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	21,829,963	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）		22,352	0.10
合計（純資産総額）		21,852,315	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	16,206,426	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）		16,327	0.10
合計（純資産総額）		16,222,753	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

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	10,911,891	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）		10,992	0.10
合計（純資産総額）		10,922,883	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	359,085,510,670	97.85
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,879,137,642	2.14
合計（純資産総額）		366,964,648,312	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	7,854,665,000	2.14

(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	305,266,266,332	63.25
	カナダ	17,723,297,455	3.67
	ドイツ	19,308,347,763	4.00
	イタリア	4,820,558,018	0.99
	フランス	20,083,055,741	4.16
	オランダ	6,618,736,342	1.37
	スペイン	6,452,185,057	1.33
	ベルギー	2,161,739,812	0.44
	オーストリア	531,050,136	0.11
	ルクセンブルグ	123,719,772	0.02
	フィンランド	1,850,929,782	0.38
	アイルランド	926,628,133	0.19
	ポルトガル	283,460,787	0.05
	イギリス	33,760,657,361	6.99
	スイス	15,617,395,893	3.23
	スウェーデン	5,303,216,490	1.09
	ノルウェー	1,293,578,908	0.26
	デンマーク	3,525,122,766	0.73
	オーストラリア	12,128,585,345	2.51
	ニュージーランド	316,243,204	0.06
香港	6,167,502,294	1.27	
シンガポール	2,312,728,491	0.47	
イスラエル	493,890,426	0.10	
小計		467,068,896,308	96.78
投資信託受益証券	アメリカ	22,703,385	0.00
投資証券	アメリカ	8,328,623,704	1.72
	カナダ	79,123,161	0.01
	フランス	645,154,642	0.13
	イギリス	413,072,101	0.08
	オーストラリア	1,063,084,226	0.22
	香港	268,891,428	0.05
	シンガポール	217,875,070	0.04

	小計	11,015,824,332	2.28
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,493,592,765	0.93
合計（純資産総額）		482,601,016,790	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	2,888,407,133	0.59
	買建	カナダ	166,380,480	0.03
	買建	ドイツ	588,898,816	0.12
	買建	イギリス	313,556,052	0.06
	買建	スイス	141,478,236	0.02
	買建	オーストラリア	117,726,390	0.02

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	4,223,254,337	12.41
	メキシコ	941,006,278	2.76
	ブラジル	2,434,501,018	7.15
	チリ	205,221,794	0.60
	コロンビア	83,694,481	0.24
	ギリシャ	112,903,331	0.33
	トルコ	337,171,657	0.99
	チェコ	58,284,738	0.17
	ハンガリー	109,688,816	0.32
	ポーランド	449,916,171	1.32
	香港	7,651,750,171	22.50
	マレーシア	786,605,331	2.31
	タイ	763,092,175	2.24
	フィリピン	351,185,320	1.03
	インドネシア	709,906,870	2.08
	韓国	4,913,388,146	14.44
	台湾	3,725,602,479	10.95
	インド	2,783,637,188	8.18
	パキスタン	23,774,366	0.06
	カタール	186,128,462	0.54
エジプト	32,837,533	0.09	
南アフリカ	2,146,987,831	6.31	
アラブ首長国連邦	182,285,945	0.53	

	小計	33,212,824,438	97.66
投資証券	メキシコ	26,913,131	0.07
	トルコ	8,056,363	0.02
	南アフリカ	101,942,831	0.29
	小計	136,912,325	0.40
現金・預金・その他資産（負債控除後）		655,907,437	1.92
合計（純資産総額）		34,005,644,200	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	637,760,698	1.87

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	554,229,900,590	80.05
地方債証券	日本	45,489,812,355	6.57
特殊債券	日本	56,816,089,386	8.20
社債券	日本	29,476,812,810	4.25
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,292,524,387	0.90
合計（純資産総額）		692,305,139,528	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

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	9,277,911,617	40.46
	カナダ	486,505,202	2.12
	メキシコ	162,490,162	0.70
	ドイツ	1,542,543,796	6.72
	イタリア	2,284,370,233	9.96
	フランス	2,271,753,758	9.90
	オランダ	485,164,858	2.11
	スペイン	1,336,392,184	5.82
	ベルギー	566,533,762	2.47
	オーストリア	334,952,518	1.46
	フィンランド	156,552,598	0.68
	アイルランド	261,296,278	1.13
	イギリス	1,557,787,902	6.79

	スイス	23,119,149	0.10
	スウェーデン	89,119,558	0.38
	ノルウェー	47,979,374	0.20
	デンマーク	153,322,146	0.66
	ポーランド	143,379,574	0.62
	オーストラリア	483,218,594	2.10
	シンガポール	204,928,737	0.89
	南アフリカ	141,226,858	0.61
	小計	22,010,548,858	96.00
現金・預金・その他資産（負債控除後）		915,098,342	3.99
合計（純資産総額）		22,925,647,200	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	259,797,340,636	41.41
	カナダ	13,541,535,030	2.15
	メキシコ	4,788,400,806	0.76
	ドイツ	39,864,160,809	6.35
	イタリア	67,800,029,526	10.80
	フランス	62,731,083,016	10.00
	オランダ	12,912,762,813	2.05
	スペイン	40,672,180,313	6.48
	ベルギー	16,576,137,312	2.64
	オーストリア	8,545,872,840	1.36
	フィンランド	3,429,049,932	0.54
	アイルランド	7,060,731,155	1.12
	イギリス	45,495,696,900	7.25
	スイス	1,119,140,803	0.17
	スウェーデン	3,007,444,747	0.47
	ノルウェー	1,898,606,101	0.30
	デンマーク	3,686,091,177	0.58
	ポーランド	4,181,256,917	0.66
	オーストラリア	13,876,086,346	2.21
	シンガポール	2,407,943,969	0.38
マレーシア	2,954,844,927	0.47	
南アフリカ	3,807,201,942	0.60	
	小計	620,153,598,017	98.86
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,134,361,471	1.13
合計（純資産総額）		627,287,959,488	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アルゼンチン	60,154,012	0.89
	メキシコ	638,216,177	9.46
	ブラジル	672,056,327	9.96
	チリ	159,903,793	2.37
	コロンビア	440,318,290	6.52
	ペルー	181,496,452	2.69
	ウルグアイ	14,810,610	0.21
	トルコ	455,941,126	6.76
	チェコ	261,129,973	3.87
	ハンガリー	304,140,891	4.51
	ポーランド	593,673,983	8.80
	ロシア	507,905,439	7.53
	ルーマニア	189,719,089	2.81
	マレーシア	364,822,373	5.40
	タイ	528,501,409	7.83
	フィリピン	21,950,904	0.32
インドネシア	615,554,171	9.12	
南アフリカ	535,346,632	7.93	
	小計	6,545,641,651	97.06
現金・預金・その他資産（負債控除後）		197,980,576	2.93
合計（純資産総額）		6,743,622,227	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

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	13,079,652	1.7588	23,005,444	1.7697	23,147,060	25.64
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	11,687,888	1.3062	15,267,668	1.3042	15,243,343	16.89
3	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	13,525,287	1.1294	15,276,070	1.1182	15,123,975	16.75
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	5,175,041	2.6733	13,834,646	2.7036	13,991,240	15.50
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	4,719,222	2.3181	10,939,709	2.2643	10,685,734	11.84
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	6,694,890	1.3583	9,094,258	1.4242	9,534,862	10.56

7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	1,739,023	1.3898	2,417,048	1.3968	2,429,067	2.69
---	----	---------------	--------------------------	-----------	--------	-----------	--------	-----------	------

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	99.89
合計	99.89

野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型

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	3,181,547	1.7588	5,595,705	1.7697	5,630,383	25.76
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	2,648,504	1.3064	3,460,006	1.3042	3,454,178	15.80
3	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	3,058,405	1.1295	3,454,469	1.1182	3,419,908	15.65
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A Iマザーファンド	1,253,688	2.6731	3,351,234	2.7036	3,389,470	15.51
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,302,984	2.3184	3,020,839	2.2643	2,950,346	13.50
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,622,149	1.3580	2,202,879	1.4242	2,310,264	10.57
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	483,544	1.3898	672,030	1.3968	675,414	3.09

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	99.89
合計	99.89

野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型

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	2,271,072	1.7591	3,995,043	1.7697	4,019,116	24.77
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,127,970	2.3183	2,614,973	2.2643	2,554,062	15.74
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	1,905,648	1.3062	2,489,158	1.3042	2,485,346	15.32
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	2,202,845	1.1295	2,488,114	1.1182	2,463,221	15.18
5	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A Iマザーファンド	901,104	2.6735	2,409,102	2.7036	2,436,224	15.01
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,169,623	1.3583	1,588,699	1.4242	1,665,777	10.26

7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	417,154	1.3900	579,845	1.3968	582,680	3.59
---	----	---------------	--------------------------	---------	--------	---------	--------	---------	------

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	99.89
合 計	99.89

野村ターゲットデットファンド2016 2035 - 2037年目標型

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	1,456,276	1.7591	2,561,736	1.7697	2,577,171	23.59
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	924,655	2.3183	2,143,628	2.2643	2,093,696	19.16
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA - B P I 総 合 マザーファンド	1,217,889	1.3063	1,590,929	1.3042	1,588,370	14.54
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	1,407,783	1.1295	1,590,091	1.1182	1,574,182	14.41
5	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A Iマザーファンド	570,755	2.6732	1,525,743	2.7036	1,543,093	14.12
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	748,633	1.3585	1,017,018	1.4242	1,066,203	9.76
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	335,894	1.3900	466,893	1.3968	469,176	4.29

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	99.89
合 計	99.89

(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	1,661,700	6,111.85	10,156,061,145	7,480.00	12,429,516,000	3.38
2	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	9,525,000	728.43	6,938,295,750	820.80	7,818,120,000	2.13
3	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通 信業	607,200	8,735.95	5,304,468,840	8,980.00	5,452,656,000	1.48
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	962,600	5,055.46	4,866,385,796	5,191.00	4,996,856,600	1.36
5	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	1,020,500	4,212.30	4,298,652,150	4,878.00	4,977,999,000	1.35
6	日本	株式	ソニー	電気機器	913,100	4,097.75	3,741,655,525	5,209.00	4,756,337,900	1.29
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	1,230,000	3,239.82	3,984,978,600	3,826.00	4,705,980,000	1.28

8	日本	株式	キーエンス	電気機器	67,100	49,895.79	3,348,007,509	66,430.00	4,457,453,000	1.21
9	日本	株式	任天堂	その他製品	84,200	29,967.50	2,523,263,500	47,970.00	4,039,074,000	1.10
10	日本	株式	ファナック	電気機器	129,900	22,953.84	2,981,703,816	29,475.00	3,828,802,500	1.04
11	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,317,500	208.67	3,822,312,725	205.30	3,760,582,750	1.02
12	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,207,800	3,032.41	3,662,544,798	2,753.00	3,325,073,400	0.90
13	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	503,500	5,503.33	2,770,926,655	6,415.00	3,229,952,500	0.88
14	日本	株式	キヤノン	電気機器	735,800	3,856.17	2,837,369,886	4,349.00	3,199,994,200	0.87
15	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	848,800	3,789.36	3,216,408,768	3,612.00	3,065,865,600	0.83
16	日本	株式	信越化学工業	化学	238,400	9,891.47	2,358,126,448	12,410.00	2,958,544,000	0.80
17	日本	株式	三菱商事	卸売業	944,700	2,372.69	2,241,480,243	3,050.00	2,881,335,000	0.78
18	日本	株式	日本電産	電気機器	164,500	10,751.96	1,768,697,420	17,450.00	2,870,525,000	0.78
19	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,282,000	643.09	2,110,621,380	866.40	2,843,524,800	0.77
20	日本	株式	小松製作所	機械	660,000	2,916.05	1,924,593,000	4,235.00	2,795,100,000	0.76
21	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,366,900	1,651.75	2,257,777,075	1,992.50	2,723,548,250	0.74
22	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	993,000	2,728.09	2,708,993,370	2,704.50	2,685,568,500	0.73
23	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,007,600	2,073.46	2,089,218,296	2,659.00	2,679,208,400	0.73
24	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	245,500	10,264.13	2,519,843,915	10,845.00	2,662,447,500	0.72
25	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	507,900	4,940.11	2,509,081,869	5,140.00	2,610,606,000	0.71
26	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	483,100	4,788.99	2,313,561,069	5,306.00	2,563,328,600	0.69
27	日本	株式	花王	化学	336,100	6,616.55	2,223,822,455	7,563.00	2,541,924,300	0.69
28	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	564,300	4,832.29	2,726,861,247	4,486.00	2,531,449,800	0.68
29	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,561,600	1,380.72	2,156,132,352	1,619.00	2,528,230,400	0.68
30	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	122,400	18,777.70	2,298,390,480	20,650.00	2,527,560,000	0.68

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	0.09
		鉱業	0.33
		建設業	3.09
		食料品	4.24
		繊維製品	0.67
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.99
		医薬品	4.31
		石油・石炭製品	0.68
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	1.01
		鉄鋼	1.12
		非鉄金属	0.97
		金属製品	0.68
機械	5.69		

電気機器	13.79
輸送用機器	8.72
精密機器	1.53
その他製品	2.11
電気・ガス業	1.45
陸運業	3.91
海運業	0.23
空運業	0.57
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	7.00
卸売業	4.57
小売業	4.48
銀行業	7.22
証券、商品先物取引業	1.01
保険業	2.18
その他金融業	1.20
不動産業	2.37
サービス業	4.09
合 計	97.85

(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	586,500	15,915.19	9,334,261,442	18,164.66	10,653,576,785	2.20
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	831,000	7,329.32	6,090,669,200	10,089.18	8,384,112,403	1.73
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	46,380	98,447.24	4,565,983,244	156,420.43	7,254,779,905	1.50
4	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	269,300	15,989.80	4,306,054,187	20,356.78	5,482,082,147	1.13
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	399,800	9,784.83	3,911,975,426	12,522.81	5,006,622,197	1.03
6	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	304,900	13,727.79	4,185,605,660	15,494.95	4,724,413,213	0.97
7	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	481,400	9,049.35	4,356,360,932	9,440.79	4,544,799,291	0.94
8	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	35,560	92,993.46	3,306,847,474	126,597.83	4,501,819,016	0.93
9	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	33,870	94,896.05	3,214,129,321	128,086.08	4,338,275,608	0.89

10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,139,000	2,628.62	2,994,003,261	3,468.22	3,950,308,503	0.81
11	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	535,900	6,096.51	3,267,120,695	7,101.81	3,805,860,622	0.78
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	144,000	18,490.81	2,662,677,891	23,325.66	3,358,895,602	0.69
13	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	353,700	9,098.23	3,218,047,081	9,367.15	3,313,162,087	0.68
14	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	134,000	16,170.93	2,166,905,545	21,954.90	2,941,957,927	0.60
15	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	215,400	11,807.68	2,543,376,345	13,623.77	2,934,560,424	0.60
16	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	698,100	4,463.57	3,116,019,745	4,073.09	2,843,429,435	0.58
17	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	534,300	3,951.83	2,111,463,619	5,307.86	2,835,991,789	0.58
18	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	109,930	18,580.69	2,042,575,376	25,745.15	2,830,164,724	0.58
19	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	208,000	9,928.34	2,065,095,967	13,441.00	2,795,728,936	0.57
20	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	676,200	3,735.03	2,525,629,911	4,112.26	2,780,711,564	0.57
21	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	289,900	9,801.22	2,841,374,872	9,459.29	2,742,248,316	0.56
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	463,900	5,320.24	2,468,061,019	5,863.78	2,720,208,006	0.56
23	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	2,285,000	1,031.73	2,357,521,291	1,171.09	2,675,953,949	0.55
24	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	309,800	6,726.38	2,083,833,185	8,553.06	2,649,741,024	0.54
25	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	568,600	3,668.03	2,085,643,766	4,596.37	2,613,500,246	0.54
26	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	253,000	8,860.21	2,241,635,418	10,016.77	2,534,244,530	0.52
27	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	534,900	4,108.68	2,197,738,277	4,606.16	2,463,839,584	0.51
28	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	460,900	4,682.58	2,158,203,783	5,157.73	2,377,199,555	0.49
29	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	63,860	20,371.26	1,300,908,788	36,739.47	2,346,182,612	0.48
30	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	181,400	7,378.26	1,338,417,134	12,606.58	2,286,834,555	0.47

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	不動産管理・開発	0.54
		エネルギー設備・サービス	0.55
		石油・ガス・消耗燃料	6.08
		化学	2.69
		建設資材	0.34
		容器・包装	0.29
		金属・鉱業	1.64
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	2.23
		建設関連製品	0.42
		建設・土木	0.35

電気設備	0.78
コングロマリット	1.63
機械	1.73
商社・流通業	0.33
商業サービス・用品	0.36
航空貨物・物流サービス	0.60
旅客航空輸送業	0.13
海運業	0.07
陸運・鉄道	0.93
運送インフラ	0.26
自動車部品	0.52
自動車	1.07
家庭用耐久財	0.45
レジャー用品	0.05
繊維・アパレル・贅沢品	1.23
ホテル・レストラン・レジャー	1.82
メディア	2.29
販売	0.07
インターネット販売・通信販売	2.15
複合小売り	0.41
専門小売り	1.61
食品・生活必需品小売り	1.72
飲料	1.99
食品	1.84
タバコ	1.29
家庭用品	1.23
パーソナル用品	0.70
ヘルスケア機器・用品	2.13
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.98
バイオテクノロジー	2.24
医薬品	5.27
銀行	9.86
各種金融サービス	1.03
保険	4.04
インターネットソフトウェア・サービス	3.34
情報技術サービス	3.07
ソフトウェア	4.03
通信機器	0.89
コンピュータ・周辺機器	2.55
電子装置・機器・部品	0.48
半導体・半導体製造装置	2.90
各種電気通信サービス	2.07

	無線通信サービス	0.35
	電力	1.65
	ガス	0.12
	総合公益事業	0.94
	水道	0.07
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.01
	消費者金融	0.51
	資本市場	3.11
	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	0.05
	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	0.58
	専門サービス	0.61
投資信託受益証券		0.00
投資証券		2.28
合 計		99.06

(参考) 新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	298,800	3,814.49	1,139,771,257	6,423.63	1,919,383,034	5.64
2	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	60,500	14,280.53	863,972,141	21,721.01	1,314,121,190	3.86
3	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コン ピュ タ・周辺 機器	5,100	241,925.30	1,233,819,040	252,984.00	1,290,218,400	3.79
4	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・ 半導体製 造装置	1,293,000	777.22	1,004,951,058	941.16	1,216,919,880	3.57
5	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	23,040	25,320.81	583,391,625	31,192.07	718,665,293	2.11
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	4,430,000	89.73	397,512,930	123.24	545,964,718	1.60
7	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,892,000	73.46	285,930,892	101.12	393,581,224	1.15
8	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	14,500	21,046.71	305,177,380	26,552.37	385,009,442	1.13
9	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信 サービス	324,500	1,170.85	379,942,700	1,142.70	370,808,259	1.09
10	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	275,500	685.07	188,738,088	1,254.68	345,664,891	1.01
11	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	170,794	1,353.96	231,248,380	1,760.95	300,761,061	0.88

12	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	824,812	389.01	320,865,226	348.19	287,192,940	0.84
13	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	565,100	321.44	181,647,332	497.82	281,321,029	0.82
14	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,205,000	53.04	223,061,386	64.40	270,815,876	0.79
15	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	80,170	2,711.76	217,402,091	3,332.50	267,166,525	0.78
16	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	164,521	976.45	160,647,815	1,418.27	233,335,857	0.68
17	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	30,890	6,202.13	191,584,049	7,426.95	229,418,794	0.67
18	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	162,085	1,077.60	174,663,037	1,381.68	223,949,603	0.65
19	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	135,210	1,211.61	163,822,869	1,634.68	221,026,164	0.64
20	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	910	187,503.17	170,627,885	208,280.00	189,534,800	0.55
21	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	92,370	1,636.00	151,117,900	2,013.51	185,988,658	0.54
22	ブラジル	株式	AMBEV SA	飲料	245,656	658.06	161,657,181	747.95	183,739,388	0.54
23	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	34,200	4,284.26	146,522,000	5,358.99	183,277,643	0.53
24	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	1,791,100	87.45	156,645,293	101.32	181,484,998	0.53
25	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガス・消耗燃料	952,000	128.31	122,158,117	171.37	163,145,382	0.47
26	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	22,680	5,484.14	124,380,361	7,182.31	162,894,922	0.47
27	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	278,200	488.95	136,027,978	550.47	153,142,813	0.45
28	韓国	株式	POSCO	金属・鉱業	3,870	28,554.99	110,507,838	38,557.20	149,216,364	0.43
29	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	インターネットソフトウェア・サービス	4,200	30,601.52	128,526,416	35,117.41	147,493,130	0.43
30	韓国	株式	CELLTRION INC	バイオテクノロジー	4,360	11,247.83	49,040,560	33,182.56	144,675,962	0.42

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	不動産管理・開発	2.38
		エネルギー設備・サービス	0.08
		石油・ガス・消耗燃料	6.89
		化学	2.33
		建設資材	1.08
		容器・包装	0.05
		金属・鉱業	3.35

紙製品・林産品	0.39
航空宇宙・防衛	0.18
建設関連製品	0.03
建設・土木	0.67
電気設備	0.15
コングロマリット	1.68
機械	0.61
商社・流通業	0.03
商業サービス・用品	0.09
航空貨物・物流サービス	0.03
旅客航空輸送業	0.30
海運業	0.07
陸運・鉄道	0.19
運送インフラ	0.90
自動車部品	0.62
自動車	2.31
家庭用耐久財	0.41
レジャー用品	0.02
繊維・アパレル・贅沢品	0.53
ホテル・レストラン・レジャー	0.68
メディア	2.49
販売	0.05
インターネット販売・通信販売	0.97
複合小売り	0.59
専門小売り	0.39
食品・生活必需品小売り	1.60
飲料	1.24
食品	1.53
タバコ	0.58
家庭用品	0.38
パーソナル用品	0.72
ヘルスケア機器・用品	0.05
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.44
バイオテクノロジー	0.61
医薬品	1.35
銀行	16.75
各種金融サービス	1.25
保険	3.56
インターネットソフトウェア・サービス	12.12
情報技術サービス	1.66
ソフトウェア	0.23
通信機器	0.06

	コンピュータ・周辺機器	5.25
	電子装置・機器・部品	2.39
	半導体・半導体製造装置	5.35
	各種電気通信サービス	1.38
	無線通信サービス	3.18
	電力	0.99
	ガス	0.44
	総合公益事業	0.05
	水道	0.22
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.93
	消費者金融	0.18
	資本市場	1.26
	各種消費者サービス	0.48
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.47
	ヘルスケア・テクノロジー	0.02
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.11
投資証券		0.40
合計		98.07

(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 2回	9,800,000,000	100.72	9,871,168,000	100.40	9,839,592,000	0.1	2019/12/20	1.42
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	8,200,000,000	100.90	8,274,210,000	100.51	8,242,148,000	0.1	2020/9/20	1.19
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	7,200,000,000	102.43	7,375,320,000	102.28	7,364,376,000	0.3	2025/12/20	1.06
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	100.83	7,360,736,000	100.44	7,332,631,000	0.1	2020/3/20	1.05
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 2回	7,000,000,000	100.95	7,067,060,000	100.81	7,056,840,000	0.1	2022/6/20	1.01
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	6,900,000,000	100.59	6,941,124,000	100.58	6,940,296,000	0.1	2026/6/20	1.00
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	6,800,000,000	100.43	6,829,512,000	100.44	6,830,056,000	0.1	2026/12/20	0.98
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	6,800,000,000	100.69	6,847,160,000	100.32	6,822,168,000	0.1	2027/6/20	0.98
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	6,200,000,000	101.03	6,264,356,000	100.64	6,239,866,000	0.1	2021/6/20	0.90
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	6,000,000,000	101.07	6,064,620,000	100.67	6,040,380,000	0.1	2021/9/20	0.87

11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	6,000,000,000	100.67	6,040,200,000	100.64	6,038,940,000	0.1	2026/3/20	0.87
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	100.99	6,059,700,000	100.61	6,036,660,000	0.1	2021/3/20	0.87
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	5,900,000,000	100.81	5,948,144,000	100.37	5,921,948,000	0.2	2019/3/20	0.85
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,800,000,000	100.51	5,830,044,000	100.51	5,829,928,000	0.1	2026/9/20	0.84
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	5,800,000,000	100.63	5,836,748,000	100.40	5,823,664,000	0.1	2027/3/20	0.84
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,500,000,000	104.16	5,729,075,000	103.47	5,691,015,000	0.6	2023/3/20	0.82
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	104.42	5,639,032,000	103.83	5,606,928,000	0.6	2023/12/20	0.80
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	105.52	5,592,825,000	104.66	5,547,404,000	0.8	2023/6/20	0.80
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	5,500,000,000	100.95	5,552,360,000	100.56	5,530,965,000	0.1	2020/12/20	0.79
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	100.96	5,553,075,000	100.53	5,529,150,000	0.2	2019/9/20	0.79
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	5,500,000,000	100.54	5,530,235,000	100.33	5,518,370,000	0.1	2027/9/20	0.79
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	105.02	5,198,490,000	103.75	5,135,823,000	1.2	2020/12/20	0.74
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	5,100,000,000	100.87	5,144,370,000	100.47	5,124,276,000	0.1	2020/6/20	0.74
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	5,000,000,000	101.05	5,052,630,000	100.88	5,044,150,000	0.1	2022/9/20	0.72
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	5,000,000,000	101.09	5,054,720,000	100.76	5,038,300,000	0.1	2022/3/20	0.72
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	5,000,000,000	101.13	5,056,900,000	100.72	5,036,000,000	0.1	2021/12/20	0.72
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 8回	5,000,000,000	100.88	5,044,400,000	100.44	5,022,400,000	0.2	2019/6/20	0.72
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第38 0回	5,000,000,000	100.43	5,021,650,000	100.38	5,019,400,000	0.1	2019/9/15	0.72
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 9回	4,700,000,000	100.66	4,731,302,000	100.31	4,714,570,000	0.1	2019/6/20	0.68
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	4,500,000,000	103.29	4,648,050,000	102.97	4,633,785,000	0.4	2025/9/20	0.66

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.05
地方債証券	6.57
特殊債券	8.20

社債券	4.25
合計	99.09

(参考) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	10,769.52	473,859,305	10,741.73	472,636,449	1.25	2019/8/31	2.06
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,660,000	10,859.18	397,446,020	10,819.50	395,993,880	1.625	2019/6/30	1.72
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,700,000	10,636.82	393,562,656	10,558.57	390,667,409	1.375	2021/4/30	1.70
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,300,000	10,588.59	349,423,512	10,489.30	346,147,225	1.625	2022/8/15	1.50
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	10,229.14	347,790,878	10,035.87	341,219,836	1.625	2026/2/15	1.48
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,280,000	10,600.32	347,690,719	10,375.84	340,327,757	2	2025/8/15	1.48
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	10,703.16	342,501,212	10,586.62	338,772,060	1.875	2022/9/30	1.47
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,150,000	10,784.05	339,697,624	10,709.86	337,360,755	1.5	2020/5/31	1.47
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	10,752.04	333,313,304	10,596.82	328,501,604	1.875	2022/8/31	1.43
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	11,010.20	330,306,137	10,911.29	327,338,895	2.375	2020/12/31	1.42
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	10,684.77	320,543,206	10,666.94	320,008,331	0.75	2019/8/15	1.39
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,640,000	10,775.81	284,481,389	10,542.43	278,320,176	2.25	2025/11/15	1.21
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,740,000	14,758.83	256,803,775	14,356.02	249,794,912	5	2037/5/15	1.08
14	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,850,000	13,257.07	245,255,977	12,946.01	239,501,244	0.25	2026/11/25	1.04
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	10,910.05	240,021,201	10,727.71	236,009,694	2.125	2022/6/30	1.02
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000	13,909.94	208,649,160	13,862.44	207,936,749	1.5	2019/8/1	0.90
17	イギリス	国債証券	UK TREASURY	880,000	23,813.45	209,558,374	23,331.07	205,313,452	4.25	2046/12/7	0.89
18	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	990,000	21,354.47	211,409,317	20,660.35	204,537,474	4.75	2035/4/25	0.89
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	10,682.61	202,969,639	10,627.42	201,921,040	1.375	2020/10/31	0.88
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000	13,602.76	204,041,447	13,302.67	199,540,177	1.6	2026/6/1	0.87
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,900,000	10,466.98	198,872,794	10,384.34	197,302,553	1.625	2023/5/31	0.86
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000	14,111.92	197,566,926	13,921.06	194,894,855	1.45	2022/9/15	0.85
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	1,810,000	11,046.02	199,933,127	10,716.66	193,971,630	2.875	2043/5/15	0.84
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,176.67	190,003,434	10,965.69	186,416,754	2.75	2024/2/15	0.81
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,330,000	13,976.05	185,881,562	13,897.03	184,830,504	1.35	2022/4/15	0.80
26	イギリス	国債証券	UK TREASURY	860,000	21,453.28	184,498,251	21,130.84	181,725,250	4.25	2036/3/7	0.79
27	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,220,000	14,371.68	175,334,515	14,350.96	175,081,794	1.95	2026/4/30	0.76
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	10,519.65	173,574,377	10,458.28	172,561,758	1.625	2022/11/15	0.75
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,120,000	15,494.01	173,532,953	15,224.51	170,514,574	3	2022/4/25	0.74
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,580,000	10,835.36	171,198,742	10,784.65	170,397,602	2	2021/2/28	0.74

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.00
合 計	96.00

(参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,800,000	11,497.31	5,955,610,598	11,202.81	5,803,060,741	3.625	2020/2/15	0.92
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	11,224.49	5,904,083,374	10,986.08	5,778,683,136	2.625	2020/11/15	0.92
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,800,000	11,391.78	5,787,028,604	11,123.35	5,650,662,883	3.375	2019/11/15	0.90
4	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	16,848.52	5,576,862,901	16,663.46	5,515,608,173	3.5	2026/4/25	0.87
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,300,000	10,788.05	5,426,393,218	10,542.43	5,302,842,762	2.25	2025/11/15	0.84
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	39,200,000	14,039.00	5,503,291,523	13,501.85	5,292,728,478	6	2026/2/15	0.84
7	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000	17,034.93	5,331,935,845	16,590.52	5,192,834,513	4.25	2023/10/25	0.82
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,600,000	10,670.95	5,292,794,272	10,455.73	5,186,046,228	1.75	2023/5/15	0.82
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	11,632.87	5,327,858,988	11,304.81	5,177,603,249	3.625	2021/2/15	0.82
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,200,000	11,496.92	5,311,580,367	11,199.84	5,174,328,185	3.5	2020/5/15	0.82
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	47,100,000	10,970.38	5,167,050,676	10,706.46	5,042,745,292	2.375	2024/8/15	0.80
12	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000	20,392.41	4,996,142,836	20,020.27	4,904,967,213	5.5	2029/4/25	0.78
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,700,000	10,646.97	4,759,195,819	10,414.94	4,655,479,124	2	2025/2/15	0.74
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	15,003.33	4,380,973,995	14,722.36	4,298,931,806	4.25	2020/3/1	0.68
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,400,000	11,438.24	4,392,287,251	11,154.37	4,283,279,880	3.125	2021/5/15	0.68
16	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,100,000	20,748.22	4,170,392,465	20,456.45	4,111,747,294	3.5	2045/1/22	0.65
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	10,799.10	3,984,870,409	10,948.69	4,040,067,735	3	2044/11/15	0.64
18	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000	21,662.37	4,202,500,626	20,814.07	4,037,929,960	6.5	2027/7/4	0.64
19	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	20,300,000	19,755.89	4,010,445,812	19,524.93	3,963,561,947	3.25	2044/1/22	0.63
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,200,000	11,045.44	3,998,452,429	10,852.65	3,928,660,078	2.125	2020/8/31	0.62
21	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,700,000	14,853.39	3,965,856,946	14,545.41	3,883,625,645	2.5	2020/10/25	0.61
22	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000	19,616.31	3,884,030,885	19,131.92	3,788,120,303	6	2025/10/25	0.60
23	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	25,250,000	15,162.73	3,828,589,325	14,768.01	3,728,923,215	4	2020/4/30	0.59
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	10,782.53	3,773,887,023	10,579.82	3,702,939,625	1.75	2022/4/30	0.59
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	11,009.03	3,743,072,844	10,801.65	3,672,563,325	2.125	2021/6/30	0.58
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	20,700,000	17,468.54	3,615,988,939	17,650.90	3,653,737,045	5.25	2029/11/1	0.58
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,200,000	10,907.03	3,730,206,750	10,607.87	3,627,893,130	2.25	2024/11/15	0.57

28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	10,932.11	3,684,124,433	10,708.59	3,608,794,916	2	2022/2/15	0.57
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,400,000	11,412.28	3,697,581,683	11,137.80	3,608,647,372	3.625	2019/8/15	0.57
30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,900,000	20,995.61	3,548,258,477	21,265.64	3,593,893,904	4.5	2041/4/25	0.57

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.86
合計	98.86

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	5,460,000,000	4.77	260,486,049	4.80	262,170,832	9.85	2027/6/28	3.88
2	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,370,000,000	4.07	178,258,279	4.07	178,147,458	7.75	2021/4/14	2.64
3	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	381,000	3,462.40	131,927,859	3,525.04	134,304,226	10	2025/1/1	1.99
4	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,310,000	2,785.84	120,069,985	2,835.00	122,188,536		2019/7/1	1.81
5	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,400,000	2,698.68	118,742,166	2,721.54	119,748,111		2020/7/1	1.77
6	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000	193.05	113,899,606	201.45	118,857,506	7.75	2026/9/16	1.76
7	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	330,000	3,442.91	113,619,409	3,548.74	117,108,615	10	2023/1/1	1.73
8	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,600,000	556.44	114,627,959	543.39	111,940,070	1.5	2019/10/29	1.65
9	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,700,000	2,944.48	108,945,905	2,940.59	108,801,848		2020/1/1	1.61
10	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	19,900,000	544.21	108,298,618	508.93	101,277,768	1	2026/6/26	1.50
11	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,000,000	561.60	95,472,358	557.61	94,794,040	6.5	2022/6/9	1.40
12	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	11,050,000,000	0.80	88,609,818	0.83	92,682,427	7	2027/5/15	1.37
13	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	42,000,000	193.48	81,263,692	198.77	83,483,694	7.6	2022/7/20	1.23
14	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,900,000	528.32	84,003,554	515.56	81,974,358	5.75	2026/3/5	1.21
15	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,380,000,000	0.82	77,043,969	0.84	79,510,977	7	2022/5/15	1.17
16	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,700,000	1,011.82	77,910,222	1,017.69	78,362,391	10.5	2026/12/21	1.16
17	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	40,500,000	185.98	75,323,770	191.57	77,586,579	6.4	2020/5/27	1.15
18	チリ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	420,000,000	19.05	80,044,795	18.20	76,459,402	5	2035/3/1	1.13
19	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,830.90	73,603,575	2,835.17	73,714,635	4.181	2024/7/15	1.09
20	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	196,000	3,473.01	68,070,995	3,566.58	69,904,991	10	2021/1/1	1.03
21	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,500,000	555.11	69,389,109	554.85	69,356,400	5	2019/12/11	1.02

22	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	19,500,000	354.96	69,217,238	354.90	69,206,138	2.55	2020/6/26	1.02
23	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	19,000,000	343.89	65,339,988	348.04	66,127,800	1.875	2022/6/17	0.98
24	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,150,000	2,972.93	63,918,190	3,050.12	65,577,688	2.5	2026/7/25	0.97
25	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,100,000	373.17	63,812,079	376.94	64,456,979	3.625	2023/6/16	0.95
26	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,950,000	597.03	65,375,606	586.03	64,170,504	8	2020/6/11	0.95
27	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,260,000	746.73	61,679,987	760.35	62,805,670	7	2031/2/28	0.93
28	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	6,900,000,000	0.85	59,075,195	0.90	62,233,515	8.25	2036/5/15	0.92
29	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	6,830,000,000	0.86	59,113,419	0.90	62,109,583	8.375	2024/3/15	0.92
30	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	16,000,000	384.00	61,441,335	387.00	61,920,825	3.85	2025/12/12	0.91

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.06
合計	97.06

【投資不動産物件】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

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) 新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

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(2018年03月限)	買建	427	日本円	7,995,847,783	7,854,665,000	2.14

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2018 年03月限)	買建	188	米ドル	26,311,625	2,862,441,682	26,550,300	2,888,407,133	0.59
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2018年03 月限)	買建	10	カナダド ル	1,928,540	170,097,228	1,886,400	166,380,480	0.03
	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(2018年03月 限)	買建	121	ユーロ	4,376,560	591,185,725	4,359,630	588,898,816	0.12
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200株価指数先 物(2018年03月限)	買建	9	豪ドル	1,348,825	118,413,349	1,341,000	117,726,390	0.02
	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(2018年03月限)	買建	27	英ポンド	2,070,800	318,841,078	2,036,475	313,556,052	0.06
	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 (2018年03月限)	買建	13	スイスフ ラン	1,222,390	142,310,643	1,215,240	141,478,236	0.02

(参考)新興国株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	インターコ ンチネン タル取 引所	E-mini MSCIエ マーキングマ ケット株価指数先 物(2018年03月限)	買建	94	米ドル	5,895,230	641,342,072	5,862,310	637,760,698	1.87

(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)外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

平成30年1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	(2016年12月26日)	55	55	1.0544	1.0544
第2計算期間	(2017年12月26日)	87	87	1.1699	1.1699
	2017年 1月末日	56		1.0493	
	2月末日	57		1.0582	
	3月末日	58		1.0598	
	4月末日	61		1.0670	
	5月末日	63		1.0813	
	6月末日	65		1.0943	
	7月末日	67		1.0999	
	8月末日	69		1.1063	
	9月末日	73		1.1258	
	10月末日	75		1.1491	
	11月末日	82		1.1561	
	12月末日	87		1.1701	
	2018年 1月末日	90		1.1732	

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

平成30年1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	(2016年12月26日)	10	10	1.0514	1.0514
第2計算期間	(2017年12月26日)	21	21	1.1664	1.1664
	2017年 1月末日	11		1.0459	
	2月末日	11		1.0544	
	3月末日	11		1.0560	
	4月末日	15		1.0631	
	5月末日	15		1.0775	
	6月末日	16		1.0909	
	7月末日	16		1.0962	
	8月末日	18		1.1028	
	9月末日	19		1.1224	

10月末日	20	1.1454
11月末日	20	1.1523
12月末日	21	1.1666
2018年 1月末日	21	1.1694

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

平成30年1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 (2016年12月26日)	7	7	1.0472	1.0472
第2計算期間 (2017年12月26日)	15	15	1.1589	1.1589
2017年 1月末日	7		1.0409	
2月末日	8		1.0489	
3月末日	8		1.0505	
4月末日	10		1.0575	
5月末日	10		1.0718	
6月末日	11		1.0852	
7月末日	11		1.0903	
8月末日	12		1.0972	
9月末日	13		1.1164	
10月末日	13		1.1383	
11月末日	14		1.1450	
12月末日	15		1.1592	
2018年 1月末日	16		1.1611	

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

平成30年1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 (2016年12月26日)	6	6	1.0409	1.0409
第2計算期間 (2017年12月26日)	10	10	1.1478	1.1478
2017年 1月末日	7		1.0338	
2月末日	7		1.0410	
3月末日	7		1.0426	
4月末日	7		1.0493	
5月末日	7		1.0634	
6月末日	8		1.0771	
7月末日	8		1.0818	
8月末日	8		1.0891	

9月末日	8	1.1076
10月末日	9	1.1277
11月末日	10	1.1340
12月末日	10	1.1481
2018年 1月末日	10	1.1486

【分配の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日 ~ 2017年12月26日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日 ~ 2017年12月26日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日 ~ 2017年12月26日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日 ~ 2017年12月26日	0.0000円

【収益率の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	5.4%

第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	11.0%
--------	-------------------------	-------

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。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.9%

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

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.7%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.7%

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。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.3%

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

(4)【設定及び解約の実績】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	55,225,894	2,600,834	52,625,060
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	24,780,288	2,633,235	74,772,113

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	9,846,136	172	9,845,964
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	8,525,619	19,110	18,352,473

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,747,567	22	6,747,545
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	6,892,208	7,296	13,632,457

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,671,960	59,305	6,612,655
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	2,418,017	29,744	9,000,928

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

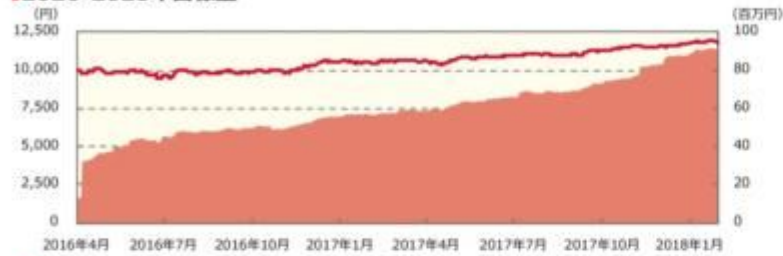


運用実績（2018年1月31日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） ■ 純資産総額（右軸）

■ 2026-2028年目標型



■ 2029-2031年目標型



■ 2032-2034年目標型



■ 2035-2037年目標型



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

■ 2026-2028年目標型

2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
--	--
--	--
--	--
設定来累計	0 円

■ 2029-2031年目標型

2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
--	--
--	--
--	--
設定来累計	0 円

■ 2032-2034年目標型

2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
--	--
--	--
--	--
設定来累計	0 円

■ 2035-2037年目標型

2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
--	--
--	--
--	--
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率 (%)			
	野村ターゲットデートファンド2016			
	2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
国内株式マザーファンド	25.6	25.8	24.8	23.6
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	15.5	15.5	15.0	14.1
新興国株式マザーファンド	10.6	10.6	10.3	9.8
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	16.9	15.8	15.3	14.5
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	16.8	15.7	15.2	14.4
外国債券マザーファンド	11.8	13.5	15.7	19.2
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2.7	3.1	3.6	4.3

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.9	0.9	0.8	0.8
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.5	0.5	0.5	0.5
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.4	0.4	0.4	0.3
4	日本電信電話	情報・通信業	0.3	0.4	0.3	0.3
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.3	0.3	0.3	0.3

・「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 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.3	0.3	0.3	0.3
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3	0.3	0.3	0.2
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.2	0.2	0.2
4	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	0.2	0.2	0.2	0.2
5	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.2	0.2	0.2	0.1

・「新興国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 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	TENCENT HOLDINGS LTD	インターネットソフトウェア・サービス	0.6	0.6	0.6	0.6
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネットソフトウェア・サービス	0.4	0.4	0.4	0.4
3	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.4	0.4	0.4	0.4
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.4	0.4	0.4	0.3
5	NASPERS LTD-N SHS	メディア	0.2	0.2	0.2	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 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	国庫債券 利付（5年）第122回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
2	国庫債券 利付（5年）第125回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
3	国庫債券 利付（10年）第341回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
4	国庫債券 利付（5年）第123回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
5	国庫債券 利付（5年）第132回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.1

・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.3	0.3	0.3	0.3
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.3	0.3	0.3	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.3	0.3	0.3	0.2
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.3	0.2	0.2	0.2
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.2	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 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2
4	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じての投資銘柄

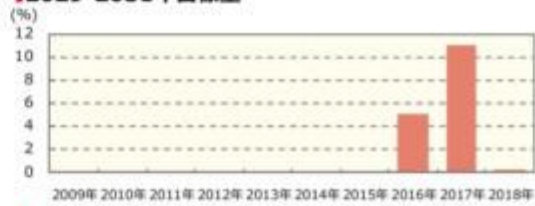
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2
2	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
3	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
4	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0	0.1	0.1	0.1
5	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0	0.1	0.1	0.1

■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)

■ 2026-2028年目標型



■ 2029-2031年目標型



■ 2032-2034年目標型



■ 2035-2037年目標型



- ・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、毎月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おりません。
- ・2016年は設定日（2016年4月1日）から年末までの収益率。
- ・2018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。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

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。
- ・ 販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得の申込みができません。

申込日当日またはその翌営業日が以下のいずれかの休業日と同日の場合

- ・ ニューヨーク証券取引所
- ・ ニューヨークの銀行

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 購入コースには、分配金を受取る「一般コース」と、分配金が再投資される「自動けいぞく投資コース」があります。販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。また、原則として、お買付け後のコース変更はできません。
- ・ 販売の単位は、1万口以上1口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。
- ・ スイッチングのお取扱いはありません。

積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。

当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

- ・ 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7営業日目までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。
- ・ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、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口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。
 - ・受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
 - ・一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。
- ただし、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求ができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）
- ・換金価額は、換金申込日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

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7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したが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】

2026-2028年目標型：平成41年3月16日までとします(平成28年4月1日設定)。

2029-2031年目標型：平成44年3月16日までとします(平成28年4月1日設定)。

2032-2034年目標型：平成47年3月16日までとします(平成28年4月1日設定)。

2035-2037年目標型：平成50年3月16日までとします(平成28年4月1日設定)。

なお、委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

原則として、毎年12月27日から翌年12月26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、信託終了前に、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が、各ファンドにつき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れ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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

()上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。

()上記()から()までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記()から()までに規定するこの信託契約の解約の手続を行なうことが困難な場合には適用しません。

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

()委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更等」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(c) 運用報告書

各ファンドにつき、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、知れ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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

(e) 公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nomura-am.co.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- ()受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d)信託約款の変更等」にしたがい、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、決算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（当該収益分配金にかかる決算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、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

累積投資契約を結んでいる場合には、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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】

野村ターゲットデートファンド2016	2026 - 2028年目標型
野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型

(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28年12月27日から平成29年12月26日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (平成28年12月26日現在)	第2期 (平成29年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	396,435	1,062,975
親投資信託受益証券	55,433,184	87,398,414
未収入金	6,907	-
流動資産合計	55,836,526	88,461,389
資産合計	55,836,526	88,461,389
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,382	599,999
未払受託者報酬	18,167	20,119
未払委託者報酬	327,073	361,991
未払利息	-	1
その他未払費用	998	1,156
流動負債合計	347,620	983,266
負債合計	347,620	983,266
純資産の部		
元本等		
元本	52,625,060	74,772,113
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,863,846	12,706,010
(分配準備積立金)	3,403,281	10,449,985
元本等合計	55,488,906	87,478,123
純資産合計	55,488,906	87,478,123
負債純資産合計	55,836,526	88,461,389

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	自	平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,742,443		7,968,306
営業収益合計		3,742,443		7,968,306
営業費用				
支払利息		9		19
受託者報酬		18,167		36,229
委託者報酬		327,073		651,996
その他費用		998		2,074
営業費用合計		346,247		690,318
営業利益又は営業損失 ()		3,396,196		7,277,988
経常利益又は経常損失 ()		3,396,196		7,277,988
当期純利益又は当期純損失 ()		3,396,196		7,277,988
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 ()		7,085		91,874
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		2,863,846
剰余金増加額又は欠損金減少額		29,937		2,807,599
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		29,937		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,807,599
剰余金減少額又は欠損金増加額		569,372		151,549
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		151,549
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		569,372		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		2,863,846		12,706,010

(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28年12月27日から平成29年12月26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28年12月26日現在	第2期 平成29年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 52,625,060口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 74,772,113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 1.0544円 (10,000口当たり純資産額) (10,544円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1699円 (10,000口当たり純資産額) (11,699円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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>608,370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>2,794,911円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>58,252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>3,461,533円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>52,625,060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>657円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	608,370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	2,794,911円	収益調整金額	C	58,252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	3,461,533円	当ファンドの期末残存口数	F	52,625,060口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	657円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0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>1,286,459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>5,899,655円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,256,025円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,263,871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>12,706,010円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>74,772,113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>1,699円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,286,459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	5,899,655円	収益調整金額	C	2,256,025円	分配準備積立金額	D	3,263,871円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,706,010円	当ファンドの期末残存口数	F	74,772,113口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,699円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	608,370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	2,794,911円																																																											
収益調整金額	C	58,252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	3,461,533円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	52,625,060口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	657円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,286,459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	5,899,655円																																																											
収益調整金額	C	2,256,025円																																																											
分配準備積立金額	D	3,263,871円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,706,010円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	74,772,113口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,699円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	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28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 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 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成28年12月26日現在	第2期 平成29年12月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
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。	2. 時価の算定方法 同左
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。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
期首元本額 - 円	期首元本額 52,625,060円
期中追加設定元本額 55,225,894円	期中追加設定元本額 24,780,288円
期中一部解約元本額 2,600,834円	期中一部解約元本額 2,633,235円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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	3,632,302	7,612,992
合計	3,632,302	7,612,992

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29年12月26日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26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	12,711,306	22,346,475	
		外国債券マザーファンド	4,666,735	10,819,358	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	5,092,395	13,608,407	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	11,237,986	14,682,428	
		新興国株式マザーファンド	6,512,564	8,837,549	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,779,699	2,472,713	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	12,951,655	14,631,484	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	54,952,340	87,398,414 100.0%	
合計			87,398,414		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (平成28年12月26日現在)	第2期 (平成29年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,078	115,127
親投資信託受益証券	10,342,079	21,389,230
未収入金	1,412	-
流動資産合計	10,406,569	21,504,357
資産合計	10,406,569	21,504,357
負債の部		
流動負債		
未払解約金	96	-
未払受託者報酬	2,847	5,153
未払委託者報酬	50,950	92,677
その他未払費用	201	229
流動負債合計	54,094	98,059
負債合計	54,094	98,059
純資産の部		
元本等		
元本	9,845,964	18,352,473
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	506,511	3,053,825
(分配準備積立金)	608,073	2,502,431
元本等合計	10,352,475	21,406,298
純資産合計	10,352,475	21,406,298
負債純資産合計	10,406,569	21,504,357

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	自	平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		662,077		2,061,487
営業収益合計		662,077		2,061,487
営業費用				
受託者報酬		2,847		8,699
委託者報酬		50,950		156,492
その他費用		201		416
営業費用合計		53,998		165,607
営業利益又は営業損失 ()		608,079		1,895,880
経常利益又は経常損失 ()		608,079		1,895,880
当期純利益又は当期純損失 ()		608,079		1,895,880
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 ()		6		848
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		506,511
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		653,283
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		653,283
剰余金減少額又は欠損金増加額		101,562		1,001
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,001
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		101,562		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		506,511		3,053,825

(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28年12月27日から平成29年12月26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28年12月26日現在	第2期 平成29年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 9,845,964口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 18,352,473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 1.0514円 (10,000口当たり純資産額) (10,514円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1664円 (10,000口当たり純資産額) (11,664円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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>97,440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>510,633円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,960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>618,033円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>9,845,964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>627円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	97,440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	510,633円	収益調整金額	C	9,960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	618,033円	当ファンドの期末残存口数	F	9,845,964口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	627円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0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>314,081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>1,580,951円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>558,146円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>607,399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>3,060,577円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>18,352,473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>1,667円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	314,081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	1,580,951円	収益調整金額	C	558,146円	分配準備積立金額	D	607,399円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,060,577円	当ファンドの期末残存口数	F	18,352,473口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,667円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	97,440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	510,633円																																																											
収益調整金額	C	9,960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	618,033円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	9,845,964口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	627円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	314,081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	1,580,951円																																																											
収益調整金額	C	558,146円																																																											
分配準備積立金額	D	607,399円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,060,577円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	18,352,473口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,667円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	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

<p>第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日</p>	<p>第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 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 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。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期 平成28年12月26日現在</p>	<p>第2期 平成29年12月26日現在</p>
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</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。	同左
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。	2. 時価の算定方法 同左
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。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
期首元本額 - 円	期首元本額 9,845,964円
期中追加設定元本額 9,846,136円	期中追加設定元本額 8,525,619円
期中一部解約元本額 172円	期中一部解約元本額 19,110円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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	645,358	2,016,119
合計	645,358	2,016,119

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29年12月26日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26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	3,110,360	5,468,012	
		外国債券マザーファンド	1,298,475	3,010,384	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,245,960	3,329,578	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	2,587,797	3,380,956	
		新興国株式マザーファンド	1,593,781	2,162,760	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	481,638	669,187	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	2,981,635	3,368,353	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	13,299,646	21,389,230 100.0%	
合計			21,389,230		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (平成28年12月26日現在)	第2期 (平成29年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	40,116	80,403
親投資信託受益証券	7,059,472	15,787,287
流動資産合計	7,099,588	15,867,690
資産合計	7,099,588	15,867,690
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23	-
未払受託者報酬	1,767	3,598
未払委託者報酬	31,912	64,614
その他未払費用	180	186
流動負債合計	33,882	68,398
負債合計	33,882	68,398
純資産の部		
元本等		
元本	6,747,545	13,632,457
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	318,161	2,166,835
(分配準備積立金)	398,774	1,671,673
元本等合計	7,065,706	15,799,292
純資産合計	7,065,706	15,799,292
負債純資産合計	7,099,588	15,867,690

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	自	平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		432,634		1,388,545
営業収益合計		432,634		1,388,545
営業費用				
受託者報酬		1,767		6,042
委託者報酬		31,912		108,685
その他費用		180		340
営業費用合計		33,859		115,067
営業利益又は営業損失 ()		398,775		1,273,478
経常利益又は経常損失 ()		398,775		1,273,478
当期純利益又は当期純損失 ()		398,775		1,273,478
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 ()		1		380
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		318,161
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		575,974
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		575,974
剰余金減少額又は欠損金増加額		80,613		398
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		398
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		80,613		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		318,161		2,166,835

(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28年12月27日から平成29年12月26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28年12月26日現在	第2期 平成29年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,747,545口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 13,632,457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 1.0472円 (10,000口当たり純資産額) (10,472円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1589円 (10,000口当たり純資産額) (11,589円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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>64,348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>334,426円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>7,057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>405,831円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>6,747,545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>601円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	64,348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	334,426円	収益調整金額	C	7,057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	405,831円	当ファンドの期末残存口数	F	6,747,545口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	601円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0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>222,097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>1,051,001円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>495,162円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>398,575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>2,166,835円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>13,632,457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>1,589円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	222,097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	1,051,001円	収益調整金額	C	495,162円	分配準備積立金額	D	398,575円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,166,835円	当ファンドの期末残存口数	F	13,632,457口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,589円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	64,348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	334,426円																																																											
収益調整金額	C	7,057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	405,831円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	6,747,545口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	601円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	222,097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	1,051,001円																																																											
収益調整金額	C	495,162円																																																											
分配準備積立金額	D	398,575円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,166,835円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	13,632,457口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,589円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	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28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 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 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。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成28年12月26日現在	第2期 平成29年12月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
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。 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。	2. 時価の算定方法 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
期首元本額 - 円	期首元本額 6,747,545円
期中追加設定元本額 6,747,567円	期中追加設定元本額 6,892,208円
期中一部解約元本額 22円	期中一部解約元本額 7,296円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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	423,665	1,355,216
合計	423,665	1,355,216

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29年12月26日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26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	2,214,385	3,892,888	
		外国債券マザーファンド	1,121,526	2,600,145	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	883,568	2,361,158	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,838,402	2,401,872	
		新興国株式マザーファンド	1,153,061	1,564,703	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	412,837	573,595	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	2,118,196	2,392,926	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	9,741,975	15,787,287 100.0%	
合計			15,787,287		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (平成28年12月26日現在)	第2期 (平成29年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	43,781	54,802
親投資信託受益証券	6,876,309	10,323,061
未収入金	1,312	-
流動資産合計	6,921,402	10,377,863
資産合計	6,921,402	10,377,863
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,278	-
未払受託者報酬	1,934	2,464
未払委託者報酬	34,783	44,180
その他未払費用	181	156
流動負債合計	38,176	46,800
負債合計	38,176	46,800
純資産の部		
元本等		
元本	6,612,655	9,000,928
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	270,571	1,330,135
(分配準備積立金)	355,371	1,205,009
元本等合計	6,883,226	10,331,063
純資産合計	6,883,226	10,331,063
負債純資産合計	6,921,402	10,377,863

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	自	平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		392,344		936,840
営業収益合計		392,344		936,840
営業費用				
受託者報酬		1,934		4,486
委託者報酬		34,783		80,392
その他費用		181		294
営業費用合計		36,898		85,172
営業利益又は営業損失（ ）		355,446		851,668
経常利益又は経常損失（ ）		355,446		851,668
当期純利益又は当期純損失（ ）		355,446		851,668
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（ ）		75		695
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		270,571
剰余金増加額又は欠損金減少額		366		209,711
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		366		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		209,711
剰余金減少額又は欠損金増加額		85,166		1,120
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,120
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		85,166		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		270,571		1,330,135

(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28年12月27日から平成29年12月26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28年12月26日現在	第2期 平成29年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 6,612,655口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 9,000,928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 1.0409円 (10,000口当たり純資産額) (10,409円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1478円 (10,000口当たり純資産額) (11,478円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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>73,975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>281,396円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,325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>364,696円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>6,612,655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>551円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	73,975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	281,396円	収益調整金額	C	9,325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	364,696円	当ファンドの期末残存口数	F	6,612,655口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	551円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0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>171,681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>679,292円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>146,904円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>354,036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>1,351,913円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>9,000,928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>1,501円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	171,681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	679,292円	収益調整金額	C	146,904円	分配準備積立金額	D	354,036円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,351,913円	当ファンドの期末残存口数	F	9,000,928口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,501円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	73,975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	281,396円																																																											
収益調整金額	C	9,325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	364,696円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	6,612,655口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	551円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	171,681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	679,292円																																																											
収益調整金額	C	146,904円																																																											
分配準備積立金額	D	354,036円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,351,913円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	9,000,928口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,501円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	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28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 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 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。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 平成28年12月26日現在	第2期 平成29年12月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
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。	2. 時価の算定方法 同左
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。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
期首元本額 - 円	期首元本額 6,612,655円
期中追加設定元本額 6,671,960円	期中追加設定元本額 2,418,017円
期中一部解約元本額 59,305円	期中一部解約元本額 29,744円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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	386,603	917,928
合計	386,603	917,928

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29年12月26日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	1,365,258	2,400,123	
		外国債券マザーファンド	888,936	2,060,909	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	546,327	1,459,949	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,147,499	1,499,207	
		新興国株式マザーファンド	700,682	950,825	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	329,945	458,425	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,322,142	1,493,623	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	6,300,789	10,323,061 100.0%	
合計			10,323,061		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「野村ターゲットデートファンド2016」の各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」および「新興国債券(現地通貨建て)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29年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,684,238,766
株式	354,732,313,120
派生商品評価勘定	100,865,282
未収配当金	17,927,950
未収利息	1,149,286
その他未収収益	10,301,876
差入委託証拠金	19,828,152
流動資産合計	373,566,624,432
資産合計	373,566,624,432
負債の部	
流動負債	
未払解約金	282,193,481
未払利息	21,499
有価証券貸借取引受入金	13,397,271,719
流動負債合計	13,679,486,699
負債合計	13,679,486,699
純資産の部	
元本等	
元本	204,709,754,583
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	155,177,383,150
元本等合計	359,887,137,733
純資産合計	359,887,137,733
負債純資産合計	373,566,624,432

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29年12月26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	1.7580円
(10,000口当たり純資産額)	(17,580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	12,722,754,850円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年12月26日現在	
期首	平成28年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	223,425,016,244円
同期中における追加設定元本額	26,204,845,405円
同期中における一部解約元本額	44,920,107,066円
期末元本額	204,709,754,583円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	157,714,290円
バランスセレクト50	365,926,884円
バランスセレクト70	463,453,332円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,295,711,495円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,497,773,423円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	6,823,772,596円
野村資産設計ファンド2015	55,191,970円
野村資産設計ファンド2020	63,555,607円
野村資産設計ファンド2025	91,315,995円
野村資産設計ファンド2030	96,268,271円
野村資産設計ファンド2035	71,709,770円
野村資産設計ファンド2040	189,180,379円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	69,460,354,752円
のむらップ・ファンド（保守型）	2,221,483,420円
のむらップ・ファンド（普通型）	5,162,880,226円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,526,190,746円
野村資産設計ファンド2045	21,544,275円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,166,096,053円
マイ・ロード	3,258,000,636円
ネクストコア	138,378,056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	566,592,873円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,316,828,742円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,315,565,815円
野村資産設計ファンド2050	30,327,871円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	12,711,306円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	3,110,360円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,214,385円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,365,258円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	193,037,111円

のむラップ・ファンド(やや積極型)	125,999,681円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,530,594円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,755,444円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,401,061円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,852,693円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,939,134円
野村6資産均等バランス	231,886円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	134,599,960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)	532,413,659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)	484,163,425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)	1,383,928,793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)	846,287,994円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	3,505,795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)	16,115,048円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	2,822,383円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,766,825,546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)	192,571,942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)	1,361,641,993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)	946,905,536円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,535,703,616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)	326,990,006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)	116,386,747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)	316,001,133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)	4,967,801,255円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	678,332,127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)	706,517,142円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	1,319,745,249円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	1,176,321,638円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	651,204円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	6,887,318円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	28,998,728円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	35,071,422円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	96,757,134円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	3,905,017,523円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,269,869,098円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,711,864,289円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	30,834,895,204円
マイバランスDC30	2,567,649,519円
マイバランスDC50	3,426,169,964円
マイバランスDC70	3,309,804,309円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,829,779,676円
野村DC運用戦略ファンド	797,984,005円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	23,884,358円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	275,088,401円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	16,800,904円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	36,327,483円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	124,142円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	101,856円

野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	768,249円
野村資産設計ファンド（DC）2030	169,863円
野村資産設計ファンド（DC）2040	242,191円
野村資産設計ファンド（DC）2050	300,366円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	6,000	4,345.00	26,070,000	貸付有価証券 2,900株
		日本水産	171,500	611.00	104,786,500	貸付有価証券 2,000株
		マルハニチロ	28,900	3,410.00	98,549,000	
		カネコ種苗	5,200	1,710.00	8,892,000	
		サカタのタネ	22,500	3,950.00	88,875,000	
		ホクト	15,500	2,021.00	31,325,500	
		ホクリヨウ	2,100	1,232.00	2,587,200	
		住石ホールディングス	39,800	153.00	6,089,400	貸付有価証券 19,300株
		日鉄鉱業	4,200	8,130.00	34,146,000	
		三井松島産業	7,700	1,523.00	11,727,100	貸付有価証券 500株
		国際石油開発帝石	741,000	1,385.00	1,026,285,000	
		日本海洋掘削	5,300	2,216.00	11,744,800	貸付有価証券 2,400株(300株)
		石油資源開発	24,100	2,903.00	69,962,300	貸付有価証券 5,600株(5,600株)
		K&Oエナジーグループ	9,000	1,925.00	17,325,000	貸付有価証券 500株
		ショーボンドホールディングス	14,400	7,810.00	112,464,000	
ミライト・ホールディングス	46,900	1,666.00	78,135,400	貸付有価証券 5,000株(1,900株)		

タマホーム	11,400	797.00	9,085,800	貸付有価証券 5,400株(1,300株)
サンヨーホームズ	2,700	1,003.00	2,708,100	貸付有価証券 1,300株
ファーストコーポレーション	3,400	1,497.00	5,089,800	貸付有価証券 1,200株
ベステラ	2,100	2,130.00	4,473,000	貸付有価証券 900株
インベスターズクラウド	2,700	8,480.00	22,896,000	貸付有価証券 1,200株(700株)
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,408.00	5,068,800	貸付有価証券 1,700株
安藤・間	117,300	886.00	103,927,800	貸付有価証券 42,100株(17,400株)
東急建設	58,600	1,082.00	63,405,200	貸付有価証券 23,700株
コムシスホールディングス	53,600	3,315.00	177,684,000	
ミサワホーム	12,700	987.00	12,534,900	貸付有価証券 100株
ピーアールホールディングス	15,100	443.00	6,689,300	
高松コンストラクショングループ	9,900	3,145.00	31,135,500	
東建コーポレーション	5,700	13,320.00	75,924,000	
ソネック	1,900	822.00	1,561,800	
ヤマウラ	7,100	918.00	6,517,800	貸付有価証券 400株
大成建設	155,000	5,610.00	869,550,000	
大林組	457,000	1,363.00	622,891,000	
清水建設	466,200	1,167.00	544,055,400	
飛島建設	138,600	186.00	25,779,600	
長谷工コーポレーション	177,800	1,770.00	314,706,000	
松井建設	16,800	963.00	16,178,400	
銭高組	2,200	6,210.00	13,662,000	
鹿島建設	670,000	1,077.00	721,590,000	
不動テトラ	115,300	179.00	20,638,700	貸付有価証券 100株(100株)
大未建設	4,900	1,157.00	5,669,300	
鉄建建設	9,300	3,295.00	30,643,500	貸付有価証券

				500株
西松建設	35,200	3,150.00	110,880,000	
三井住友建設	109,900	618.00	67,918,200	
大豊建設	55,000	552.00	30,360,000	
前田建設工業	108,700	1,544.00	167,832,800	
佐田建設	9,800	448.00	4,390,400	
ナカノフード建設	11,700	627.00	7,335,900	
奥村組	25,100	4,620.00	115,962,000	
東鉄工業	18,300	3,720.00	68,076,000	
イチケン	2,800	2,332.00	6,529,600	
浅沼組	54,000	403.00	21,762,000	
戸田建設	177,000	897.00	158,769,000	
熊谷組	23,900	3,080.00	73,612,000	貸付有価証券 2,800株
青木あすなろ建設	10,000	1,017.00	10,170,000	
北野建設	32,000	395.00	12,640,000	
植木組	1,900	2,736.00	5,198,400	
三井ホーム	20,000	777.00	15,540,000	
矢作建設工業	20,700	983.00	20,348,100	
ピーエス三菱	18,000	905.00	16,290,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
日本ハウスホールディングス	29,100	742.00	21,592,200	貸付有価証券 1,800株(1,200株)
大東建託	55,200	23,295.00	1,285,884,000	貸付有価証券 1,000株
新日本建設	18,100	949.00	17,176,900	
N I P P O	35,000	2,616.00	91,560,000	
東亜道路工業	3,100	4,315.00	13,376,500	
前田道路	48,000	2,583.00	123,984,000	
日本道路	4,100	6,650.00	27,265,000	
東亜建設工業	12,300	3,000.00	36,900,000	
若築建設	8,200	1,725.00	14,145,000	
東洋建設	47,800	646.00	30,878,800	貸付有価証券 100株(100株)
五洋建設	181,200	830.00	150,396,000	
世紀東急工業	20,500	630.00	12,915,000	
福田組	4,900	6,590.00	32,291,000	
住友林業	97,400	2,003.00	195,092,200	貸付有価証券

				500株(500株)
日本基礎技術	16,900	411.00	6,945,900	
日成ビルド工業	22,500	1,484.00	33,390,000	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
ヤマダ・エスバイエル ホーム	69,000	77.00	5,313,000	
バコーポレーション	18,900	653.00	12,341,700	
大和ハウス工業	450,100	4,403.00	1,981,790,300	
ライト工業	29,300	1,267.00	37,123,100	
積水ハウス	495,800	2,044.00	1,013,415,200	
日特建設	13,000	703.00	9,139,000	
北陸電気工事	8,400	1,159.00	9,735,600	
ユアテック	24,000	955.00	22,920,000	
西部電気工業	2,500	2,983.00	7,457,500	
四電工	2,300	2,952.00	6,789,600	
中電工	19,600	3,240.00	63,504,000	
関電工	60,700	1,178.00	71,504,600	
きんでん	101,300	1,849.00	187,303,700	
東京エネシス	17,300	1,271.00	21,988,300	
トーエネック	4,300	3,310.00	14,233,000	
住友電設	12,000	2,387.00	28,644,000	貸付有価証券 200株
日本電設工業	23,400	2,397.00	56,089,800	
協和エクシオ	54,700	2,987.00	163,388,900	
新日本空調	11,700	1,473.00	17,234,100	
N D S	2,400	4,295.00	10,308,000	
九電工	30,000	5,460.00	163,800,000	貸付有価証券 13,600株
三機工業	32,300	1,365.00	44,089,500	
日揮	131,300	2,125.00	279,012,500	貸付有価証券 23,800株(800株)
中外炉工業	4,600	2,363.00	10,869,800	
ヤマト	12,500	837.00	10,462,500	
太平電業	10,300	2,857.00	29,427,100	
高砂熱学工業	41,900	2,050.00	85,895,000	
三晃金属工業	1,700	4,065.00	6,910,500	
朝日工業社	3,200	3,505.00	11,216,000	
明星工業	27,600	827.00	22,825,200	

大気社	20,200	3,825.00	77,265,000	
ダイダシ	10,200	2,923.00	29,814,600	
日比谷総合設備	17,000	2,396.00	40,732,000	貸付有価証券 300株
東芝プラントシステム	33,000	2,117.00	69,861,000	貸付有価証券 3,700株
OSJBホールディングス	67,300	328.00	22,074,400	貸付有価証券 9,100株
東洋エンジニアリング	17,900	1,231.00	22,034,900	貸付有価証券 8,500株（8,500株）
千代田化工建設	98,900	816.00	80,702,400	貸付有価証券 45,700株
新興プランテック	29,300	1,197.00	35,072,100	貸付有価証券 400株
日本製粉	45,300	1,733.00	78,504,900	
日清製粉グループ本社	167,100	2,327.00	388,841,700	
日東富士製粉	1,000	4,900.00	4,900,000	
昭和産業	12,500	2,900.00	36,250,000	貸付有価証券 5,900株（5,900株）
鳥越製粉	12,100	999.00	12,087,900	貸付有価証券 5,600株
中部飼料	16,700	2,470.00	41,249,000	
フィード・ワン	91,700	265.00	24,300,500	貸付有価証券 9,400株（3,800株）
東洋精糖	2,300	1,202.00	2,764,600	
日本甜菜製糖	7,800	2,695.00	21,021,000	
三井製糖	10,800	4,855.00	52,434,000	
塩水港精糖	16,300	262.00	4,270,600	
日新製糖	6,500	2,298.00	14,937,000	
森永製菓	32,000	5,730.00	183,360,000	
中村屋	3,500	5,060.00	17,710,000	
江崎グリコ	38,100	5,660.00	215,646,000	
名糖産業	6,600	1,587.00	10,474,200	
不二家	8,700	2,682.00	23,333,400	貸付有価証券 4,000株
山崎製パン	111,600	2,263.00	252,550,800	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
第一屋製パン	2,300	1,239.00	2,849,700	貸付有価証券 1,000株
モロゾフ	2,300	7,780.00	17,894,000	

亀田製菓	8,500	5,100.00	43,350,000	貸付有価証券 700株
寿スピリッツ	13,100	6,270.00	82,137,000	貸付有価証券 2,200株
カルビー	62,200	3,695.00	229,829,000	貸付有価証券 29,200株（800株）
森永乳業	27,300	4,825.00	131,722,500	
六甲バター	6,800	2,812.00	19,121,600	貸付有価証券 3,100株（100株）
ヤクルト本社	81,700	8,650.00	706,705,000	貸付有価証券 38,400株
明治ホールディングス	90,300	9,800.00	884,940,000	
雪印メグミルク	32,900	3,325.00	109,392,500	
プリマハム	96,000	825.00	79,200,000	
日本ハム	117,000	2,764.00	323,388,000	
林兼産業	4,900	876.00	4,292,400	
丸大食品	73,000	501.00	36,573,000	
S Foods	9,500	5,170.00	49,115,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	87,900	1,037.00	91,152,300	
サッポロホールディングス	49,900	3,535.00	176,396,500	貸付有価証券 14,900株
アサヒグループホールディングス	285,900	5,721.00	1,635,633,900	
キリンホールディングス	656,100	2,928.50	1,921,388,850	
宝ホールディングス	110,300	1,316.00	145,154,800	
オエノンホールディングス	38,800	367.00	14,239,600	貸付有価証券 100株（100株）
養命酒製造	4,200	2,531.00	10,630,200	
コカ・コーラボトラーズ ジャパン	95,800	4,175.00	399,965,000	
サントリー食品インター ナショナル	104,400	5,140.00	536,616,000	
ダイトーグループホール ディングス	7,000	5,910.00	41,370,000	
伊藤園	45,200	4,510.00	203,852,000	貸付有価証券 4,300株（300株）
キーコーヒー	13,400	2,164.00	28,997,600	
ユニカフェ	4,100	1,358.00	5,567,800	貸付有価証券 1,900株

ジャパンフーズ	1,900	1,493.00	2,836,700	
日清オイリオグループ	16,100	3,440.00	55,384,000	
不二製油グループ本社	37,000	3,370.00	124,690,000	
かどや製油	1,500	6,520.00	9,780,000	
J - オイルミルズ	7,100	4,015.00	28,506,500	
キッコーマン	106,600	4,635.00	494,091,000	貸付有価証券 3,000株
味の素	313,900	2,136.00	670,490,400	
キュービー	76,000	3,035.00	230,660,000	
ハウス食品グループ本社	52,100	3,810.00	198,501,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
カゴメ	54,700	4,270.00	233,569,000	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
焼津水産化学工業	6,600	1,216.00	8,025,600	
アリアケジャパン	12,500	9,680.00	121,000,000	貸付有価証券 2,000株
ピエトロ	1,800	1,680.00	3,024,000	貸付有価証券 700株
エバラ食品工業	3,000	2,138.00	6,414,000	
ニチレイ	65,000	3,190.00	207,350,000	
東洋水産	74,900	4,890.00	366,261,000	
イートアンド	1,900	4,670.00	8,873,000	貸付有価証券 900株（600株）
大冷	1,500	2,059.00	3,088,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	7,700.00	3,080,000	貸付有価証券 100株
日清食品ホールディングス	59,500	8,330.00	495,635,000	
永谷園ホールディングス	15,000	1,407.00	21,105,000	
一正蒲鉾	5,300	1,306.00	6,921,800	貸付有価証券 800株
フジッコ	14,800	2,511.00	37,162,800	
ロック・フィールド	14,700	2,064.00	30,340,800	
日本たばこ産業	844,600	3,720.00	3,141,912,000	
ケンコーマヨネーズ	9,000	4,220.00	37,980,000	貸付有価証券 1,800株
わらべや日洋ホールディングス	8,900	3,240.00	28,836,000	
なとり	7,600	2,059.00	15,648,400	

イフジ産業	2,400	803.00	1,927,200	
北の達人コーポレーション	13,100	1,416.00	18,549,600	貸付有価証券 1,600株
ユーグレナ	52,700	1,022.00	53,859,400	貸付有価証券 25,800株（4,200株）
ミヨシ油脂	5,200	1,518.00	7,893,600	
理研ビタミン	5,200	4,520.00	23,504,000	
片倉工業	16,400	1,449.00	23,763,600	貸付有価証券 7,700株
グンゼ	10,600	6,460.00	68,476,000	貸付有価証券 100株
東洋紡	52,600	2,038.00	107,198,800	
ユニチカ	41,500	819.00	33,988,500	
富士紡ホールディングス	7,900	3,725.00	29,427,500	
倉敷紡績	144,000	363.00	52,272,000	
シキボウ	7,200	1,378.00	9,921,600	
日本毛織	40,200	1,087.00	43,697,400	
ダイトウボウ	21,500	106.00	2,279,000	貸付有価証券 7,100株（300株）
トーア紡コーポレーション	6,000	632.00	3,792,000	貸付有価証券 600株
ダイドーリミテッド	15,900	440.00	6,996,000	
帝国繊維	14,900	2,397.00	35,715,300	貸付有価証券 2,000株
帝人	116,400	2,517.00	292,978,800	貸付有価証券 3,200株（2,700株）
東レ	1,033,400	1,063.50	1,099,020,900	貸付有価証券 11,700株（900株）
サカイオーボックス	3,600	2,637.00	9,493,200	
住江織物	3,900	3,095.00	12,070,500	貸付有価証券 700株
日本フェルト	7,500	509.00	3,817,500	
イチカワ	9,000	369.00	3,321,000	
日東製網	1,500	1,793.00	2,689,500	貸付有価証券 400株
アツギ	9,500	1,290.00	12,255,000	
ダイニック	5,400	1,120.00	6,048,000	
セーレン	32,800	2,172.00	71,241,600	
ソトー	5,300	1,121.00	5,941,300	

東海染工	2,000	1,435.00	2,870,000	
小松精練	21,900	934.00	20,454,600	
ワコールホールディングス	39,400	3,615.00	142,431,000	
ホギメディカル	9,000	8,650.00	77,850,000	貸付有価証券 1,400株
レナウン	38,500	180.00	6,930,000	貸付有価証券 18,900株（6,900株）
クラウドシアホールディングス	3,300	577.00	1,904,100	
T S Iホールディングス	53,800	823.00	44,277,400	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
三陽商会	7,500	2,274.00	17,055,000	貸付有価証券 3,500株
ナイガイ	5,200	549.00	2,854,800	貸付有価証券 300株（300株）
オンワードホールディングス	85,100	986.00	83,908,600	
ルック	24,000	383.00	9,192,000	貸付有価証券 11,000株
キムラタン	62,500	47.00	2,937,500	貸付有価証券 29,600株
ゴールドウイン	4,000	8,840.00	35,360,000	貸付有価証券 600株
デサント	32,500	1,901.00	61,782,500	
キング	7,100	656.00	4,657,600	
ヤマトインターナショナル	9,400	442.00	4,154,800	
特種東海製紙	8,300	4,190.00	34,777,000	
王子ホールディングス	600,000	746.00	447,600,000	
日本製紙	63,800	2,118.00	135,128,400	貸付有価証券 2,200株（600株）
三菱製紙	20,300	711.00	14,433,300	貸付有価証券 100株（100株）
北越紀州製紙	79,500	669.00	53,185,500	貸付有価証券 30,300株（7,000株）
中越パルプ工業	5,600	2,022.00	11,323,200	
巴川製紙所	22,000	311.00	6,842,000	
大王製紙	56,800	1,479.00	84,007,200	貸付有価証券 26,600株（9,700株）
阿波製紙	3,400	713.00	2,424,200	貸付有価証券

				1,600株(1,600株)
レンゴー	137,400	806.00	110,744,400	
トーモク	8,200	2,189.00	17,949,800	貸付有価証券 100株(100株)
ザ・パック	10,100	3,660.00	36,966,000	貸付有価証券 4,700株
クラレ	239,800	2,170.00	520,366,000	
旭化成	888,400	1,465.50	1,301,950,200	
共和レザー	8,300	1,010.00	8,383,000	
昭和電工	94,800	4,870.00	461,676,000	
住友化学	1,049,000	819.00	859,131,000	
住友精化	5,900	6,270.00	36,993,000	
日産化学工業	82,900	4,520.00	374,708,000	
ラサ工業	5,000	2,213.00	11,065,000	貸付有価証券 200株(200株)
クレハ	11,900	7,770.00	92,463,000	
多木化学	1,900	5,640.00	10,716,000	貸付有価証券 900株
テイカ	10,900	3,245.00	35,370,500	
石原産業	25,600	2,086.00	53,401,600	
片倉コープアグリ	3,400	1,415.00	4,811,000	
日東エフシー	8,300	808.00	6,706,400	貸付有価証券 800株
日本曹達	99,000	745.00	73,755,000	
東ソー	205,900	2,557.00	526,486,300	
トクヤマ	41,300	3,555.00	146,821,500	貸付有価証券 800株
セントラル硝子	29,000	2,390.00	69,310,000	
東亜合成	83,600	1,459.00	121,972,400	
大阪ソーダ	12,700	2,902.00	36,855,400	貸付有価証券 5,900株(5,700株)
関東電化工業	34,000	1,347.00	45,798,000	貸付有価証券 16,000株(3,100株)
デンカ	52,400	4,580.00	239,992,000	
信越化学工業	237,200	11,510.00	2,730,172,000	
日本カーバイド工業	4,500	2,078.00	9,351,000	
堺化学工業	9,700	3,015.00	29,245,500	
エア・ウォーター	117,500	2,394.00	281,295,000	
大陽日酸	109,700	1,586.00	173,984,200	

日本化学工業	5,300	2,494.00	13,218,200	
東邦アセチレン	2,000	1,633.00	3,266,000	
日本パーカライジング	72,800	1,906.00	138,756,800	
高圧ガス工業	21,100	950.00	20,045,000	
チタン工業	1,500	3,010.00	4,515,000	貸付有価証券 700株
四国化成工業	20,500	1,787.00	36,633,500	
戸田工業	2,800	4,390.00	12,292,000	貸付有価証券 1,300株
ステラ ケミファ	7,300	3,490.00	25,477,000	貸付有価証券 3,400株
保土谷化学工業	4,600	5,870.00	27,002,000	貸付有価証券 2,200株
日本触媒	22,400	7,650.00	171,360,000	
大日精化工業	11,000	5,530.00	60,830,000	
カネカ	192,000	1,018.00	195,456,000	
三菱瓦斯化学	122,500	3,225.00	395,062,500	
三井化学	129,500	3,655.00	473,322,500	
J S R	143,200	2,238.00	320,481,600	
東京応化工業	24,800	4,930.00	122,264,000	貸付有価証券 200株（200株）
大阪有機化学工業	9,200	1,292.00	11,886,400	貸付有価証券 2,400株
三菱ケミカルホールディングス	954,100	1,248.50	1,191,193,850	貸付有価証券 2,500株
K H ネオケム	21,800	2,901.00	63,241,800	貸付有価証券 1,700株
ダイセル	192,100	1,293.00	248,385,300	
住友ベークライト	115,000	949.00	109,135,000	
積水化学工業	295,900	2,303.00	681,457,700	
日本ゼオン	120,100	1,638.00	196,723,800	
アイカ工業	40,000	4,225.00	169,000,000	
宇部興産	71,800	3,325.00	238,735,000	
積水樹脂	22,000	2,292.00	50,424,000	
タキロンシーアイ	29,000	793.00	22,997,000	
旭有機材	8,400	2,044.00	17,169,600	
日立化成	70,400	2,880.00	202,752,000	
ニチバン	7,000	3,155.00	22,085,000	

リケンテクノス	30,700	619.00	19,003,300	貸付有価証券 9,900株(1,300株)
大倉工業	34,000	696.00	23,664,000	
積水化成成品工業	17,900	1,451.00	25,972,900	貸付有価証券 100株
群栄化学工業	3,400	3,770.00	12,818,000	
タイガースポリマー	7,000	824.00	5,768,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
ミライアル	4,700	1,805.00	8,483,500	
ダイキアクシス	4,700	1,667.00	7,834,900	貸付有価証券 2,200株
ダイキョーニシカワ	28,100	1,829.00	51,394,900	
竹本容器	1,600	2,238.00	3,580,800	貸付有価証券 700株
日本化薬	92,500	1,684.00	155,770,000	
カーリットホールディングス	13,200	1,124.00	14,836,800	貸付有価証券 6,200株(300株)
日本精化	11,800	1,133.00	13,369,400	貸付有価証券 100株(100株)
扶桑化学工業	10,100	3,015.00	30,451,500	貸付有価証券 1,200株(800株)
A D E K A	61,300	1,961.00	120,209,300	
日油	55,000	3,070.00	168,850,000	
新日本理化	22,500	278.00	6,255,000	貸付有価証券 200株
ハリマ化成グループ	11,000	904.00	9,944,000	
花王	334,400	7,778.00	2,600,963,200	
第一工業製薬	27,000	884.00	23,868,000	
日華化学	4,500	1,288.00	5,796,000	貸付有価証券 2,100株
ニイタカ	2,100	1,853.00	3,891,300	
三洋化成工業	8,900	5,920.00	52,688,000	
有機合成薬品工業	9,300	297.00	2,762,100	
大日本塗料	16,300	1,808.00	29,470,400	
日本ペイントホールディングス	109,900	3,620.00	397,838,000	貸付有価証券 48,600株(8,200株)
関西ペイント	149,700	2,986.00	447,004,200	貸付有価証券 38,600株(5,300株)
神東塗料	10,500	260.00	2,730,000	
中国塗料	40,800	942.00	38,433,600	

日本特殊塗料	9,000	2,285.00	20,565,000	
藤倉化成	18,000	741.00	13,338,000	
太陽ホールディングス	10,900	5,040.00	54,936,000	
D I C	56,300	4,275.00	240,682,500	
サカティンクス	29,100	1,807.00	52,583,700	貸付有価証券 4,400株
東洋インキ S C ホール ディングス	141,000	675.00	95,175,000	
T & K T O K A	9,500	1,483.00	14,088,500	
富士フイルムホールディ ングス	282,500	4,661.00	1,316,732,500	
資生堂	253,400	5,571.00	1,411,691,400	
ライオン	189,500	2,155.00	408,372,500	
高砂香料工業	8,500	3,490.00	29,665,000	
マンダム	26,500	3,715.00	98,447,500	
ミルボン	9,100	7,890.00	71,799,000	
ファンケル	33,000	3,285.00	108,405,000	
コーセー	23,000	18,110.00	416,530,000	貸付有価証券 300株
コタ	5,900	1,612.00	9,510,800	
シーズ・ホールディング ス	18,500	5,740.00	106,190,000	貸付有価証券 8,600株
シーボン	1,600	3,425.00	5,480,000	
ポーラ・オルビスホール ディングス	58,100	4,090.00	237,629,000	貸付有価証券 22,100株
ノエビアホールディング ス	9,000	8,460.00	76,140,000	
アジュバンコスメジャパ ン	3,000	1,070.00	3,210,000	
エステー	9,700	2,852.00	27,664,400	
アグロ カネショウ	5,500	2,173.00	11,951,500	貸付有価証券 900株
コニシ	22,300	2,082.00	46,428,600	
長谷川香料	18,000	2,357.00	42,426,000	貸付有価証券 1,000株
星光 P M C	7,800	1,120.00	8,736,000	貸付有価証券 3,600株（800株）
小林製薬	38,100	7,580.00	288,798,000	
荒川化学工業	12,200	2,280.00	27,816,000	

メック	9,300	2,329.00	21,659,700	貸付有価証券 4,300株
日本高純度化学	3,700	2,610.00	9,657,000	
タカラバイオ	35,600	1,554.00	55,322,400	貸付有価証券 1,500株
J C U	8,300	5,530.00	45,899,000	
新田ゼラチン	9,300	836.00	7,774,800	
O A T アグリオ	2,100	2,685.00	5,638,500	貸付有価証券 900株
デクセリアルズ	34,800	1,445.00	50,286,000	
アース製薬	10,200	5,780.00	58,956,000	貸付有価証券 4,700株
北興化学工業	13,900	733.00	10,188,700	貸付有価証券 500株
大成ラミック	4,200	3,195.00	13,419,000	貸付有価証券 100株
クミアイ化学工業	61,900	762.00	47,167,800	貸付有価証券 29,000株
日本農薬	35,500	657.00	23,323,500	貸付有価証券 7,900株（500株）
アキレス	10,300	2,356.00	24,266,800	
有沢製作所	22,700	1,257.00	28,533,900	
日東電工	102,700	10,245.00	1,052,161,500	
レック	8,100	2,959.00	23,967,900	貸付有価証券 3,800株
きもと	23,100	332.00	7,669,200	
藤森工業	11,400	3,970.00	45,258,000	
前澤化成工業	9,300	1,253.00	11,652,900	
J S P	8,000	3,825.00	30,600,000	
エフピコ	11,200	6,040.00	67,648,000	貸付有価証券 5,200株（1,300株）
天馬	10,600	2,244.00	23,786,400	
信越ポリマー	27,900	1,261.00	35,181,900	貸付有価証券 100株（100株）
東リ	33,900	432.00	14,644,800	
ニフコ	25,000	7,690.00	192,250,000	貸付有価証券 400株（400株）
日本バルカー工業	11,000	3,085.00	33,935,000	
ユニ・チャーム	288,400	2,957.00	852,798,800	
協和発酵キリン	170,400	2,173.00	370,279,200	

武田薬品工業	501,000	6,440.00	3,226,440,000	
アステラス製薬	1,397,800	1,429.50	1,998,155,100	
大日本住友製薬	100,800	1,666.00	167,932,800	貸付有価証券 43,900株
塩野義製薬	194,600	6,187.00	1,203,990,200	貸付有価証券 300株(300株)
田辺三菱製薬	166,000	2,382.00	395,412,000	
わかもと製薬	16,000	271.00	4,336,000	
あすか製薬	15,500	2,010.00	31,155,000	
日本新薬	35,600	8,430.00	300,108,000	
ピオフェルミン製薬	2,300	2,979.00	6,851,700	
中外製薬	141,800	5,820.00	825,276,000	
科研製薬	24,500	5,950.00	145,775,000	
エーザイ	162,800	6,301.00	1,025,802,800	
ロート製薬	74,700	3,060.00	228,582,000	
小野薬品工業	321,200	2,637.50	847,165,000	貸付有価証券 23,400株
久光製薬	40,200	6,800.00	273,360,000	貸付有価証券 100株(100株)
持田製薬	9,500	8,770.00	83,315,000	貸付有価証券 100株(100株)
参天製薬	257,400	1,748.00	449,935,200	
扶桑薬品工業	4,800	2,875.00	13,800,000	
日本ケミファ	1,800	4,775.00	8,595,000	
ツムラ	48,600	3,780.00	183,708,000	
日医工	35,900	1,670.00	59,953,000	貸付有価証券 17,300株
キッセイ薬品工業	25,200	3,235.00	81,522,000	
生化学工業	26,400	1,684.00	44,457,600	
栄研化学	11,000	5,400.00	59,400,000	貸付有価証券 1,300株(200株)
日水製薬	5,700	1,536.00	8,755,200	
鳥居薬品	8,500	2,956.00	25,126,000	
JCRファーマ	9,600	5,300.00	50,880,000	貸付有価証券 600株
東和薬品	6,500	6,150.00	39,975,000	
富士製薬工業	4,600	4,290.00	19,734,000	
沢井製薬	27,300	5,000.00	136,500,000	貸付有価証券

				7,500株
ゼリア新薬工業	29,200	2,185.00	63,802,000	貸付有価証券 300株(300株)
第一三共	389,200	2,926.50	1,138,993,800	
キョーリン製薬ホールディングス	38,000	2,174.00	82,612,000	
大幸薬品	7,200	2,294.00	16,516,800	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ダイト	8,500	3,240.00	27,540,000	
大塚ホールディングス	282,700	5,015.00	1,417,740,500	
大正製薬ホールディングス	30,500	9,170.00	279,685,000	
ペプチドリーム	55,800	3,880.00	216,504,000	貸付有価証券 26,200株
日本コークス工業	114,900	127.00	14,592,300	
昭和シェル石油	127,300	1,555.00	197,951,500	
ニチレキ	17,400	1,474.00	25,647,600	
ユシロ化学工業	7,600	1,701.00	12,927,600	
ビーピー・カストロール	5,800	2,156.00	12,504,800	貸付有価証券 1,300株
富士石油	33,000	584.00	19,272,000	
MORESCO	4,900	2,197.00	10,765,300	貸付有価証券 200株
出光興産	114,200	4,520.00	516,184,000	
JXTGホールディングス	2,170,700	716.20	1,554,655,340	
コスモエネルギーホールディングス	39,400	3,885.00	153,069,000	
横浜ゴム	78,800	2,811.00	221,506,800	貸付有価証券 1,500株
東洋ゴム工業	80,600	2,348.00	189,248,800	
ブリヂストン	480,700	5,382.00	2,587,127,400	
住友ゴム工業	133,300	2,149.00	286,461,700	貸付有価証券 6,600株
藤倉ゴム工業	11,900	950.00	11,305,000	
オカモト	47,000	1,144.00	53,768,000	
フコク	5,900	1,130.00	6,667,000	
ニッタ	14,100	4,290.00	60,489,000	
住友理工	26,400	1,215.00	32,076,000	
三ツ星ベルト	33,000	1,521.00	50,193,000	

バンドー化学	25,900	1,324.00	34,291,600	貸付有価証券 100株
日東紡績	20,200	3,190.00	64,438,000	
旭硝子	139,000	4,785.00	665,115,000	
日本板硝子	68,700	1,019.00	70,005,300	貸付有価証券 9,700株（6,500株）
石塚硝子	1,800	2,959.00	5,326,200	
日本山村硝子	56,000	190.00	10,640,000	
日本電気硝子	58,800	4,355.00	256,074,000	
オハラ	5,400	3,535.00	19,089,000	貸付有価証券 2,600株（800株）
住友大阪セメント	264,000	536.00	141,504,000	貸付有価証券 5,000株
太平洋セメント	85,900	4,840.00	415,756,000	
日本ヒューム	13,600	813.00	11,056,800	
日本コンクリート工業	29,300	485.00	14,210,500	
三谷セキサン	7,100	2,747.00	19,503,700	
アジアパイルホールディングス	17,500	717.00	12,547,500	
東海カーボン	123,500	1,402.00	173,147,000	
日本カーボン	7,000	4,995.00	34,965,000	貸付有価証券 2,400株
東洋炭素	8,800	3,425.00	30,140,000	貸付有価証券 1,200株
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	5,710.00	45,680,000	
TOTO	104,600	6,590.00	689,314,000	
日本碍子	166,000	2,117.00	351,422,000	
日本特殊陶業	116,700	2,723.00	317,774,100	貸付有価証券 200株
ダントーホールディングス	10,000	145.00	1,450,000	貸付有価証券 4,000株
MARUWA	4,700	7,690.00	36,143,000	
品川リフラクトリーズ	3,600	3,410.00	12,276,000	
黒崎播磨	2,700	4,735.00	12,784,500	
ヨータイ	8,100	630.00	5,103,000	
イソライト工業	7,000	1,090.00	7,630,000	貸付有価証券 3,300株
東京窯業	17,300	436.00	7,542,800	貸付有価証券

				8,200株
ニッカトー	4,600	1,039.00	4,779,400	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレー テッド	12,100	2,425.00	29,342,500	貸付有価証券 700株
エーアンドエーマテリア ル	3,000	1,391.00	4,173,000	
ニチアス	74,000	1,473.00	109,002,000	
ニチハ	20,500	4,660.00	95,530,000	
新日鐵住金	602,000	2,860.50	1,722,021,000	
神戸製鋼所	246,200	1,031.00	253,832,200	貸付有価証券 17,300株(17,300株)
中山製鋼所	18,600	722.00	13,429,200	
合同製鐵	7,200	2,289.00	16,480,800	貸付有価証券 1,900株
ジェイ エフ イー ホールディングス	363,300	2,711.50	985,087,950	
日新製鋼	37,100	1,801.00	66,817,100	貸付有価証券 18,000株(18,000株)
東京製鐵	72,000	997.00	71,784,000	貸付有価証券 34,100株
共英製鋼	15,200	2,121.00	32,239,200	貸付有価証券 7,300株(100株)
大和工業	28,600	3,245.00	92,807,000	
東京鐵鋼	5,500	1,989.00	10,939,500	
大阪製鐵	8,900	2,404.00	21,395,600	貸付有価証券 100株
淀川製鋼所	19,700	3,515.00	69,245,500	
東洋鋼鈹	34,100	480.00	16,368,000	
丸一鋼管	47,600	3,280.00	156,128,000	貸付有価証券 800株
モリ工業	4,400	3,515.00	15,466,000	
大同特殊鋼	23,900	6,770.00	161,803,000	
日本高周波鋼業	5,000	903.00	4,515,000	
日本冶金工業	111,300	234.00	26,044,200	貸付有価証券 52,400株
山陽特殊製鋼	15,500	2,836.00	43,958,000	
愛知製鋼	7,600	4,490.00	34,124,000	
日立金属	144,900	1,608.00	232,999,200	貸付有価証券 800株

日本金属	3,400	2,544.00	8,649,600	貸付有価証券 1,500株
大太平洋金属	8,300	3,025.00	25,107,500	貸付有価証券 3,900株
新日本電工	80,600	468.00	37,720,800	貸付有価証券 38,300株
栗本鐵工所	6,800	2,257.00	15,347,600	
虹技	2,000	2,123.00	4,246,000	
日本鑄鉄管	14,000	172.00	2,408,000	
三菱製鋼	10,000	2,782.00	27,820,000	
日亜鋼業	19,700	334.00	6,579,800	
日本精線	2,200	5,200.00	11,440,000	貸付有価証券 200株
シンニッタン	10,500	780.00	8,190,000	貸付有価証券 400株
新家工業	3,100	2,173.00	6,736,300	
大紀アルミニウム工業所	22,100	846.00	18,696,600	貸付有価証券 10,300株（1,300株）
日本軽金属ホールディング グス	392,700	317.00	124,485,900	
三井金属鉱業	36,300	6,460.00	234,498,000	
東邦亜鉛	7,500	5,960.00	44,700,000	
三菱マテリアル	88,800	3,890.00	345,432,000	
住友金属鉱山	171,900	4,895.00	841,450,500	貸付有価証券 1,300株
DOWAホールディング ス	34,000	4,530.00	154,020,000	
古河機械金属	22,200	2,310.00	51,282,000	
大阪チタニウムテクノ ロジーズ	14,000	1,995.00	27,930,000	貸付有価証券 6,800株
東邦チタニウム	24,100	1,106.00	26,654,600	貸付有価証券 10,600株
UACJ	20,400	2,950.00	60,180,000	貸付有価証券 9,600株
古河電気工業	44,800	5,550.00	248,640,000	貸付有価証券 900株
住友電気工業	502,900	1,912.00	961,544,800	
フジクラ	162,400	1,021.00	165,810,400	
昭和電線ホールディング ス	16,900	949.00	16,038,100	

東京特殊電線	1,700	2,796.00	4,753,200	
タツタ電線	26,700	913.00	24,377,100	
沖電線	1,500	3,630.00	5,445,000	貸付有価証券 200株
カナレ電気	2,200	2,569.00	5,651,800	貸付有価証券 1,000株
平河ヒューテック	6,700	1,263.00	8,462,100	
リヨービ	16,500	3,195.00	52,717,500	貸付有価証券 600株(100株)
アーレスティ	16,500	890.00	14,685,000	
アサヒホールディングス	23,000	2,120.00	48,760,000	
稲葉製作所	7,600	1,446.00	10,989,600	
宮地エンジニアリンググループ	3,800	2,575.00	9,785,000	貸付有価証券 200株(200株)
トーカコ	9,300	4,900.00	45,570,000	
アルファC o	4,700	2,327.00	10,936,900	貸付有価証券 1,400株
SUMCO	123,800	2,896.00	358,524,800	
川田テクノロジーズ	2,700	6,000.00	16,200,000	貸付有価証券 1,300株
RS Technologies	1,900	6,230.00	11,837,000	貸付有価証券 800株
東洋製罐グループホールディングス	92,000	1,818.00	167,256,000	
ホッカンホールディングス	34,000	447.00	15,198,000	
コロナ	7,400	1,454.00	10,759,600	
横河ブリッジホールディングス	25,000	2,515.00	62,875,000	
駒井ハルテック	2,900	2,578.00	7,476,200	
高田機工	1,200	3,245.00	3,894,000	
三和ホールディングス	129,000	1,545.00	199,305,000	
文化シャッター	39,600	1,082.00	42,847,200	貸付有価証券 200株
三協立山	18,700	1,640.00	30,668,000	貸付有価証券 2,800株
アルインコ	9,800	1,243.00	12,181,400	
東洋シャッター	3,500	604.00	2,114,000	
LIXILグループ	198,300	3,025.00	599,857,500	貸付有価証券 200株(200株)

日本ファイルコン	10,300	772.00	7,951,600	
ノーリツ	30,000	2,233.00	66,990,000	
長府製作所	15,200	2,622.00	39,854,400	貸付有価証券 7,100株(1,800株)
リンナイ	24,000	10,300.00	247,200,000	
ダイニチ工業	7,200	845.00	6,084,000	
日東精工	18,600	690.00	12,834,000	
三洋工業	1,600	2,146.00	3,433,600	
岡部	27,300	1,100.00	30,030,000	貸付有価証券 7,300株
ジーテクト	14,800	2,280.00	33,744,000	
中国工業	2,000	911.00	1,822,000	貸付有価証券 900株
東プレ	25,100	3,300.00	82,830,000	
高周波熱錬	25,900	1,262.00	32,685,800	
東京製綱	9,600	1,785.00	17,136,000	貸付有価証券 2,600株
サンコール	7,600	742.00	5,639,200	
モリテック スチール	7,900	750.00	5,925,000	貸付有価証券 3,700株
パイオラックス	19,900	3,400.00	67,660,000	
エイチワン	9,900	1,715.00	16,978,500	貸付有価証券 3,200株
日本発條	134,000	1,243.00	166,562,000	
中央発條	1,600	3,695.00	5,912,000	
アドバネクス	2,100	3,715.00	7,801,500	貸付有価証券 900株
立川ブラインド工業	5,900	1,483.00	8,749,700	貸付有価証券 2,700株
三益半導体工業	12,000	2,058.00	24,696,000	
日本ドライケミカル	1,800	2,501.00	4,501,800	
日本製鋼所	43,900	3,630.00	159,357,000	
三浦工業	58,200	3,075.00	178,965,000	
タクマ	45,600	1,605.00	73,188,000	
ツガミ	36,000	1,433.00	51,588,000	
オークマ	15,700	7,650.00	120,105,000	貸付有価証券 100株
東芝機械	76,000	854.00	64,904,000	
アマダホールディングス	207,600	1,552.00	322,195,200	

アイダエンジニアリング	34,200	1,378.00	47,127,600	貸付有価証券 800株
滝澤鉄工所	4,200	2,138.00	8,979,600	貸付有価証券 2,000株
富士機械製造	40,300	2,176.00	87,692,800	貸付有価証券 18,900株（18,900株）
牧野フライス製作所	66,000	1,147.00	75,702,000	貸付有価証券 1,000株
オーエスジー	60,800	2,420.00	147,136,000	貸付有価証券 25,700株（25,700株）
ダイジェット工業	1,600	1,885.00	3,016,000	
旭ダイヤモンド工業	40,000	1,283.00	51,320,000	
D M G 森精機	74,500	2,369.00	176,490,500	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
ソディック	29,300	1,475.00	43,217,500	貸付有価証券 13,700株（7,800株）
ディスコ	18,200	25,200.00	458,640,000	
日東工器	8,300	2,894.00	24,020,200	
日進工具	3,600	2,510.00	9,036,000	貸付有価証券 300株
パンチ工業	5,600	2,656.00	14,873,600	
富士ダイス	5,100	1,118.00	5,701,800	
豊和工業	7,400	1,757.00	13,001,800	貸付有価証券 3,500株（2,400株）
O K K	5,200	1,304.00	6,780,800	貸付有価証券 400株
東洋機械金属	10,500	939.00	9,859,500	
津田駒工業	32,000	191.00	6,112,000	貸付有価証券 15,000株
エンシュウ	35,000	148.00	5,180,000	貸付有価証券 16,000株（14,000株）
島精機製作所	17,000	7,200.00	122,400,000	
N C ホールディングス	4,300	792.00	3,405,600	
フリー	9,600	1,073.00	10,300,800	貸付有価証券 4,500株
ヤマシンフィルタ	18,400	1,446.00	26,606,400	貸付有価証券 8,700株（6,500株）
日阪製作所	19,400	1,180.00	22,892,000	
やまびこ	26,100	1,746.00	45,570,600	貸付有価証券 200株
平田機工	3,700	11,350.00	41,995,000	貸付有価証券

				1,800株
ペガサスマシン製造	12,600	767.00	9,664,200	貸付有価証券 1,700株(1,500株)
ナブテスコ	74,000	4,455.00	329,670,000	
三井海洋開発	14,300	2,790.00	39,897,000	
レオン自動機	12,000	1,942.00	23,304,000	
S M C	42,700	47,150.00	2,013,305,000	
新川	11,000	1,166.00	12,826,000	貸付有価証券 5,300株
ホソカワミクロン	5,100	8,040.00	41,004,000	
ユニオンツール	6,100	4,330.00	26,413,000	貸付有価証券 400株
オイレス工業	17,400	2,280.00	39,672,000	貸付有価証券 100株(100株)
日精エー・エス・ビー機 械	4,500	6,890.00	31,005,000	貸付有価証券 300株
サトーホールディングス	17,700	3,425.00	60,622,500	
技研製作所	6,800	2,928.00	19,910,400	貸付有価証券 3,100株
日本エアーテック	4,600	949.00	4,365,400	
日精樹脂工業	11,300	1,723.00	19,469,900	
オカダアイヨン	4,000	2,265.00	9,060,000	
ワイエイシイホールディ ングス	4,500	1,057.00	4,756,500	貸付有価証券 2,200株
小松製作所	656,700	4,064.00	2,668,828,800	
住友重機械工業	77,900	4,785.00	372,751,500	
日立建機	63,600	4,010.00	255,036,000	貸付有価証券 700株(200株)
日工	3,900	2,400.00	9,360,000	
巴工業	5,800	2,103.00	12,197,400	
井関農機	13,600	2,825.00	38,420,000	貸付有価証券 200株(200株)
T O W A	10,600	2,183.00	23,139,800	貸付有価証券 1,600株(1,000株)
丸山製作所	3,000	2,067.00	6,201,000	
北川鉄工所	6,500	3,065.00	19,922,500	
ローツェ	6,700	2,652.00	17,768,400	貸付有価証券 3,200株(600株)
タカキタ	4,700	1,033.00	4,855,100	

クボタ	733,800	2,216.50	1,626,467,700	貸付有価証券 85,800株
荏原実業	4,000	2,056.00	8,224,000	
三菱化工機	4,700	2,283.00	10,730,100	
月島機械	27,000	1,538.00	41,526,000	
帝国電機製作所	9,500	1,604.00	15,238,000	
東京機械製作所	5,300	572.00	3,031,600	貸付有価証券 2,500株(100株)
新東工業	32,300	1,452.00	46,899,600	
澁谷工業	11,900	4,515.00	53,728,500	
アイチ コーポレーショ ン	23,500	841.00	19,763,500	
小森コーポレーション	34,200	1,570.00	53,694,000	
鶴見製作所	11,500	2,062.00	23,713,000	
住友精密工業	22,000	367.00	8,074,000	
酒井重工業	2,500	4,395.00	10,987,500	
荏原製作所	55,900	4,285.00	239,531,500	
石井鐵工所	2,100	1,747.00	3,668,700	
西島製作所	13,900	1,175.00	16,332,500	
北越工業	15,300	1,271.00	19,446,300	
ダイキン工業	185,700	13,465.00	2,500,450,500	
オルガノ	4,900	3,300.00	16,170,000	
トーヨーカネツ	5,700	4,470.00	25,479,000	
栗田工業	73,600	3,705.00	272,688,000	
椿本チエイン	81,000	892.00	72,252,000	
大同工業	5,200	1,799.00	9,354,800	
木村化工機	11,300	628.00	7,096,400	
アネスト岩田	22,900	1,301.00	29,792,900	
ダイフク	69,200	6,320.00	437,344,000	貸付有価証券 31,900株
サムコ	3,700	1,415.00	5,235,500	貸付有価証券 500株
加藤製作所	6,400	3,305.00	21,152,000	貸付有価証券 800株
油研工業	2,700	2,723.00	7,352,100	
タダノ	65,600	1,816.00	119,129,600	貸付有価証券 6,600株
フジテック	43,600	1,622.00	70,719,200	

C K D	37,800	2,568.00	97,070,400	
キトー	10,300	1,771.00	18,241,300	貸付有価証券 400株
平和	42,100	2,095.00	88,199,500	貸付有価証券 19,800株(12,000株)
理想科学工業	13,500	2,111.00	28,498,500	
S A N K Y O	34,100	3,555.00	121,225,500	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
日本金銭機械	12,500	1,103.00	13,787,500	貸付有価証券 5,900株(1,100株)
マースエンジニアリング	8,600	2,497.00	21,474,200	
福島工業	8,400	5,070.00	42,588,000	
オーイズミ	5,700	497.00	2,832,900	貸付有価証券 2,600株
ダイコク電機	6,200	1,734.00	10,750,800	貸付有価証券 3,000株(100株)
竹内製作所	22,800	2,590.00	59,052,000	
アマノ	42,100	3,055.00	128,615,500	
J U K I	20,200	1,877.00	37,915,400	
サンデンホールディングス	16,600	2,243.00	37,233,800	
蛇の目ミシン工業	12,400	832.00	10,316,800	
マックス	20,900	1,614.00	33,732,600	
グローリー	40,600	4,235.00	171,941,000	
新晃工業	13,800	2,170.00	29,946,000	
大和冷機工業	21,800	1,325.00	28,885,000	
セガサミーホールディングス	134,900	1,386.00	186,971,400	貸付有価証券 200株
日本ピストンリング	5,000	2,262.00	11,310,000	
リケン	6,300	6,430.00	40,509,000	
T P R	15,200	3,750.00	57,000,000	
ツバキ・ナカシマ	13,600	2,619.00	35,618,400	貸付有価証券 200株
ホシザキ	42,800	10,200.00	436,560,000	
大豊工業	11,100	1,675.00	18,592,500	
日本精工	279,300	1,772.00	494,919,600	
N T N	314,800	560.00	176,288,000	
ジェイテクト	145,000	1,947.00	282,315,000	
不二越	126,000	756.00	95,256,000	

日本トムソン	43,500	861.00	37,453,500	貸付有価証券 300株
T H K	84,800	4,295.00	364,216,000	
ユーシン精機	6,000	3,080.00	18,480,000	貸付有価証券 2,900株
前澤給装工業	5,300	1,984.00	10,515,200	貸付有価証券 100株
イーグル工業	16,800	2,075.00	34,860,000	
前澤工業	9,000	423.00	3,807,000	
日本ピラー工業	13,700	1,709.00	23,413,300	
キット	60,600	859.00	52,055,400	
マキタ	177,400	4,775.00	847,085,000	
日立造船	107,800	573.00	61,769,400	
三菱重工業	227,900	4,228.00	963,561,200	貸付有価証券 900株(900株)
I H I	104,500	3,755.00	392,397,500	
スター精密	21,800	1,961.00	42,749,800	貸付有価証券 10,200株
日清紡ホールディングス	83,100	1,505.00	125,065,500	
イビデン	83,300	1,672.00	139,277,600	貸付有価証券 39,100株
コニカミノルタ	318,400	1,078.00	343,235,200	貸付有価証券 26,500株
ブラザー工業	166,100	2,840.00	471,724,000	
ミネベアミツミ	252,500	2,368.00	597,920,000	貸付有価証券 2,100株
日立製作所	3,266,000	888.20	2,900,861,200	
三菱電機	1,360,100	1,897.00	2,580,109,700	
富士電機	410,000	852.00	349,320,000	貸付有価証券 3,000株
東洋電機製造	5,800	1,912.00	11,089,600	貸付有価証券 100株
安川電機	157,700	5,010.00	790,077,000	貸付有価証券 25,300株
シンフォニアテクノロジー	88,000	432.00	38,016,000	貸付有価証券 24,000株
明電舎	115,000	463.00	53,245,000	
オリジン電気	4,000	1,718.00	6,872,000	
山洋電気	6,600	8,090.00	53,394,000	
デンヨー	12,500	1,994.00	24,925,000	

東芝テック	97,000	701.00	67,997,000	貸付有価証券 1,000株
芝浦メカトロニクス	20,000	440.00	8,800,000	貸付有価証券 1,000株
マブチモーター	37,900	6,080.00	230,432,000	
日本電産	163,700	16,020.00	2,622,474,000	貸付有価証券 300株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	4,900	2,938.00	14,396,200	貸付有価証券 2,300株
東光高岳	6,900	1,847.00	12,744,300	
ダブル・スコープ	19,700	2,280.00	44,916,000	貸付有価証券 9,600株（600株）
ダイヘン	74,000	999.00	73,926,000	
田淵電機	18,800	324.00	6,091,200	貸付有価証券 9,100株
ヤーマン	17,200	1,888.00	32,473,600	貸付有価証券 8,100株
JVCケンウッド	99,800	382.00	38,123,600	
ミマキエンジニアリング	12,200	1,029.00	12,553,800	貸付有価証券 5,800株
第一精工	6,400	2,893.00	18,515,200	
日新電機	31,900	1,325.00	42,267,500	
大崎電気工業	29,100	813.00	23,658,300	
オムロン	144,600	6,810.00	984,726,000	貸付有価証券 8,200株
日東工業	21,800	1,826.00	39,806,800	
I D E C	17,300	2,641.00	45,689,300	貸付有価証券 5,000株
不二電機工業	1,500	1,429.00	2,143,500	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	245,000	559.00	136,955,000	貸付有価証券 19,000株（3,000株）
サクサホールディングス	3,400	1,966.00	6,684,400	貸付有価証券 1,600株
メルコホールディングス	6,600	3,975.00	26,235,000	
テクノメディカ	3,300	1,965.00	6,484,500	
日本電気	176,000	3,030.00	533,280,000	
富士通	1,399,000	810.00	1,133,190,000	
沖電気工業	55,200	1,575.00	86,940,000	
岩崎通信機	6,000	785.00	4,710,000	

電気興業	7,700	3,295.00	25,371,500	
サンケン電気	79,000	786.00	62,094,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ナカヨ	2,600	2,010.00	5,226,000	
アイホン	7,700	1,957.00	15,068,900	
ルネサスエレクトロニクス	70,400	1,304.00	91,801,600	貸付有価証券 2,200株
セイコーエプソン	202,500	2,691.00	544,927,500	
ワコム	105,500	602.00	63,511,000	貸付有価証券 35,800株
アルバック	22,900	7,110.00	162,819,000	
アクセル	5,700	797.00	4,542,900	貸付有価証券 900株
E I Z O	12,500	5,400.00	67,500,000	貸付有価証券 400株（400株）
ジャパンディスプレイ	279,400	225.00	62,865,000	貸付有価証券 135,500株（19,300株）
日本信号	37,500	1,178.00	44,175,000	
京三製作所	32,000	687.00	21,984,000	
能美防災	18,000	2,031.00	36,558,000	
ホーチキ	9,900	2,447.00	24,225,300	
エレコム	11,800	2,624.00	30,963,200	
パナソニック	1,553,800	1,662.00	2,582,415,600	
アンリツ	99,200	1,267.00	125,686,400	貸付有価証券 11,900株（1,000株）
富士通ゼネラル	41,500	2,479.00	102,878,500	貸付有価証券 700株（700株）
日立国際電気	26,700	3,110.00	83,037,000	貸付有価証券 1,000株
ソニー	907,900	5,146.00	4,672,053,400	
T D K	71,100	8,920.00	634,212,000	
帝国通信工業	6,000	1,290.00	7,740,000	
タムラ製作所	52,400	846.00	44,330,400	
アルプス電気	117,200	3,245.00	380,314,000	貸付有価証券 6,400株
池上通信機	43,000	171.00	7,353,000	貸付有価証券 13,000株
パイオニア	226,600	226.00	51,211,600	貸付有価証券 89,100株

日本電波工業	12,300	753.00	9,261,900	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
鈴木	5,200	1,150.00	5,980,000	
日本トリム	2,900	5,040.00	14,616,000	貸付有価証券 1,400株(600株)
ローランド ディー . ジー .	6,900	3,305.00	22,804,500	
フォスター電機	15,900	2,789.00	44,345,100	貸付有価証券 700株(500株)
クラリオン	72,000	410.00	29,520,000	
S M K	35,000	613.00	21,455,000	
ヨコオ	8,800	1,608.00	14,150,400	貸付有価証券 4,100株(500株)
ティアック	98,000	44.00	4,312,000	貸付有価証券 48,000株(3,000株)
ホシデン	34,300	1,671.00	57,315,300	貸付有価証券 15,800株
ヒロセ電機	22,000	16,740.00	368,280,000	
日本航空電子工業	35,000	1,874.00	65,590,000	
T O A	14,600	1,431.00	20,892,600	
マクセルホールディング ス	27,000	2,445.00	66,015,000	
古野電気	16,200	829.00	13,429,800	
ユニデンホールディング ス	37,000	293.00	10,841,000	貸付有価証券 10,000株(4,000株)
アルパイン	32,400	2,338.00	75,751,200	
スミダコーポレーション	13,900	1,897.00	26,368,300	貸付有価証券 700株
アイコム	7,500	2,658.00	19,935,000	
リオン	5,700	2,248.00	12,813,600	
本多通信工業	10,600	1,153.00	12,221,800	貸付有価証券 4,400株(200株)
船井電機	13,700	866.00	11,864,200	貸付有価証券 6,600株
横河電機	136,100	2,181.00	296,834,100	貸付有価証券 800株(800株)
新電元工業	4,800	8,770.00	42,096,000	
アズビル	40,800	5,030.00	205,224,000	
東亜ディーケーケー	6,700	1,024.00	6,860,800	
日本光電工業	56,800	2,649.00	150,463,200	貸付有価証券

				500株(500株)
チノー	4,700	1,728.00	8,121,600	
共和電業	15,400	466.00	7,176,400	
日本電子材料	5,400	595.00	3,213,000	
堀場製作所	26,900	6,820.00	183,458,000	
アドバンテスト	75,800	2,079.00	157,588,200	貸付有価証券 13,200株
小野測器	5,800	742.00	4,303,600	
エスペック	12,100	2,802.00	33,904,200	
キーエンス	66,800	64,800.00	4,328,640,000	
日置電機	7,100	2,942.00	20,888,200	
シスメックス	105,800	8,910.00	942,678,000	貸付有価証券 23,800株
日本マイクロニクス	23,700	1,109.00	26,283,300	貸付有価証券 11,600株
メガチップス	10,700	3,360.00	35,952,000	貸付有価証券 5,200株
OBARA GROUP	7,900	7,760.00	61,304,000	
澤藤電機	1,500	2,417.00	3,625,500	貸付有価証券 700株(600株)
コーセル	18,900	1,897.00	35,853,300	
イリソ電子工業	11,400	6,580.00	75,012,000	貸付有価証券 600株(600株)
新日本無線	8,300	1,055.00	8,756,500	貸付有価証券 4,000株
オブテックスグループ	11,100	5,950.00	66,045,000	
千代田インテグレ	6,600	2,818.00	18,598,800	
アイ・オー・データ機器	5,600	1,064.00	5,958,400	貸付有価証券 2,300株(900株)
レーザーテック	29,900	2,855.00	85,364,500	
スタンレー電気	104,200	4,600.00	479,320,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
岩崎電気	5,300	1,639.00	8,686,700	
ウシオ電機	82,500	1,639.00	135,217,500	貸付有価証券 600株(600株)
岡谷電機産業	7,300	604.00	4,409,200	貸付有価証券 3,400株
ヘリオス テクノ ホー ルディング	11,600	1,076.00	12,481,600	貸付有価証券 5,400株(5,200株)
日本セラミック	13,800	2,956.00	40,792,800	

遠藤照明	6,900	1,234.00	8,514,600	貸付有価証券 300株
古河電池	9,700	1,130.00	10,961,000	貸付有価証券 4,700株
双信電機	5,900	768.00	4,531,200	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
山一電機	9,900	2,019.00	19,988,100	
図研	8,800	1,844.00	16,227,200	
日本電子	50,000	636.00	31,800,000	貸付有価証券 14,000株
カシオ計算機	109,400	1,619.00	177,118,600	
ファナック	129,300	27,430.00	3,546,699,000	
日本シイエムケイ	24,000	1,040.00	24,960,000	貸付有価証券 11,200株
エンプラス	6,200	4,740.00	29,388,000	
大真空	5,000	1,660.00	8,300,000	貸付有価証券 2,400株
ローム	61,000	12,420.00	757,620,000	
浜松ホトニクス	99,000	3,810.00	377,190,000	貸付有価証券 22,700株
三井ハイテック	17,900	2,066.00	36,981,400	貸付有価証券 8,400株
新光電気工業	51,400	896.00	46,054,400	
京セラ	223,200	7,522.00	1,678,910,400	
太陽誘電	61,100	1,732.00	105,825,200	貸付有価証券 22,900株（600株）
村田製作所	142,700	15,110.00	2,156,197,000	貸付有価証券 4,600株
ユーシン	20,300	767.00	15,570,100	貸付有価証券 9,600株（5,200株）
双葉電子工業	22,200	2,361.00	52,414,200	
北陸電気工業	5,500	1,684.00	9,262,000	
ニチコン	42,800	1,465.00	62,702,000	
日本ケミコン	11,000	3,550.00	39,050,000	
K O A	18,800	2,208.00	41,510,400	
市光工業	20,300	1,007.00	20,442,100	
小糸製作所	81,500	7,980.00	650,370,000	
ミツバ	25,000	1,669.00	41,725,000	貸付有価証券 400株（200株）
S C R E E Nホールディ	25,700	9,250.00	237,725,000	

ングス				
キャノン電子	12,500	2,537.00	31,712,500	
キャノン	732,200	4,398.00	3,220,215,600	
リコー	408,900	1,061.00	433,842,900	貸付有価証券 32,900株
MUTOHホールディングス	1,900	2,432.00	4,620,800	
東京エレクトロン	90,700	20,550.00	1,863,885,000	
トヨタ紡織	39,600	2,349.00	93,020,400	
芦森工業	2,800	2,878.00	8,058,400	貸付有価証券 1,100株
ユニプレス	26,300	3,020.00	79,426,000	
豊田自動織機	110,100	7,220.00	794,922,000	貸付有価証券 8,400株
モリタホールディングス	21,800	2,054.00	44,777,200	
三櫻工業	17,200	883.00	15,187,600	
デンソー	301,800	6,817.00	2,057,370,600	
東海理化電機製作所	35,800	2,377.00	85,096,600	
三井造船	49,100	1,652.00	81,113,200	貸付有価証券 19,800株（7,700株）
川崎重工業	105,800	3,650.00	386,170,000	
名村造船所	40,800	682.00	27,825,600	
サノヤスホールディングス	16,500	301.00	4,966,500	貸付有価証券 7,800株
日本車輛製造	50,000	323.00	16,150,000	貸付有価証券 15,000株（5,000株）
三菱ロジスネクスト	16,200	1,014.00	16,426,800	貸付有価証券 2,400株
近畿車輛	2,000	2,860.00	5,720,000	貸付有価証券 300株
日産自動車	1,604,100	1,127.50	1,808,622,750	貸付有価証券 128,600株
いすゞ自動車	394,100	1,873.00	738,149,300	
トヨタ自動車	1,653,500	7,253.00	11,992,835,500	
日野自動車	194,100	1,460.00	283,386,000	
三菱自動車工業	503,500	805.00	405,317,500	
エフテック	8,700	1,721.00	14,972,700	
レシップホールディングス	4,900	927.00	4,542,300	貸付有価証券 500株（500株）
GMB	2,200	2,120.00	4,664,000	

ファルテック	2,400	1,465.00	3,516,000	
武蔵精密工業	14,500	3,450.00	50,025,000	貸付有価証券 4,500株（4,400株）
日産車体	53,100	1,133.00	60,162,300	
新明和工業	59,100	1,065.00	62,941,500	
極東開発工業	25,300	1,977.00	50,018,100	貸付有価証券 900株（900株）
日信工業	27,600	2,213.00	61,078,800	貸付有価証券 600株
トピー工業	11,200	3,430.00	38,416,000	
ティラド	4,900	3,930.00	19,257,000	
曙ブレーキ工業	63,200	310.00	19,592,000	貸付有価証券 29,900株
タチエス	23,100	2,083.00	48,117,300	
N O K	73,100	2,641.00	193,057,100	
フタバ産業	41,600	1,061.00	44,137,600	貸付有価証券 20,400株（20,400株）
K Y B	14,100	6,560.00	92,496,000	
大同メタル工業	17,100	1,091.00	18,656,100	貸付有価証券 2,900株（200株）
プレス工業	72,200	677.00	48,879,400	貸付有価証券 10,100株
ミクニ	17,300	808.00	13,978,400	
太平洋工業	28,200	1,761.00	49,660,200	貸付有価証券 500株
ケーヒン	31,200	2,270.00	70,824,000	
河西工業	16,700	1,820.00	30,394,000	
アイシン精機	112,000	6,350.00	711,200,000	
富士機工	13,500	737.00	9,949,500	貸付有価証券 5,500株（5,500株）
マツダ	426,900	1,498.00	639,496,200	
今仙電機製作所	12,600	1,339.00	16,871,400	
本田技研工業	1,223,900	3,910.00	4,785,449,000	
スズキ	269,600	6,482.00	1,747,547,200	貸付有価証券 34,800株（100株）
S U B A R U	422,300	3,550.00	1,499,165,000	
安永	6,600	2,417.00	15,952,200	貸付有価証券 3,200株（1,500株）
ヤマハ発動機	192,100	3,730.00	716,533,000	

ショーワ	35,300	1,355.00	47,831,500	
T B K	16,200	544.00	8,812,800	
エクセディ	16,400	3,460.00	56,744,000	
豊田合成	49,400	2,902.00	143,358,800	貸付有価証券 300株(300株)
愛三工業	23,800	1,351.00	32,153,800	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
盟和産業	2,100	1,296.00	2,721,600	
ヨロズ	13,800	2,440.00	33,672,000	
エフ・シー・シー	22,200	2,950.00	65,490,000	
シマノ	54,800	15,860.00	869,128,000	
テイ・エス テック	31,600	4,650.00	146,940,000	貸付有価証券 900株(900株)
ジャムコ	6,800	2,681.00	18,230,800	貸付有価証券 3,300株(100株)
テルモ	208,500	5,340.00	1,113,390,000	貸付有価証券 100株(100株)
クリエートメディック	4,500	1,384.00	6,228,000	
日機装	47,100	1,190.00	56,049,000	貸付有価証券 100株
島津製作所	162,500	2,580.00	419,250,000	
J M S	12,500	629.00	7,862,500	
クボテック	2,900	558.00	1,618,200	貸付有価証券 1,400株(800株)
長野計器	10,700	1,265.00	13,535,500	貸付有価証券 500株
ブイ・テクノロジー	3,200	18,220.00	58,304,000	貸付有価証券 900株
東京計器	8,700	1,372.00	11,936,400	貸付有価証券 2,800株
愛知時計電機	1,800	4,500.00	8,100,000	
インターアクション	5,100	877.00	4,472,700	貸付有価証券 2,400株
オーバル	13,300	323.00	4,295,900	貸付有価証券 6,300株
東京精密	24,600	4,520.00	111,192,000	
マニー	16,600	3,455.00	57,353,000	
ニコン	237,000	2,300.00	545,100,000	貸付有価証券 29,000株
トプコン	73,000	2,391.00	174,543,000	

オリンパス	202,600	4,340.00	879,284,000	貸付有価証券 2,600株
理研計器	13,000	2,565.00	33,345,000	
タムロン	11,000	2,495.00	27,445,000	
H O Y A	279,800	5,682.00	1,589,823,600	
シード	1,400	5,040.00	7,056,000	貸付有価証券 600株
ノーリツ鋼機	13,800	2,335.00	32,223,000	貸付有価証券 4,500株
エー・アンド・デイ	12,400	855.00	10,602,000	
シチズン時計	162,300	837.00	135,845,100	貸付有価証券 1,000株
リズム時計工業	5,200	2,280.00	11,856,000	
大研医器	12,100	762.00	9,220,200	貸付有価証券 3,500株(400株)
メニコン	9,300	6,080.00	56,544,000	
松風	6,600	1,486.00	9,807,600	
セイコーホールディングス	21,000	3,230.00	67,830,000	
ニプロ	94,100	1,652.00	155,453,200	貸付有価証券 8,800株(6,800株)
中本パックス	1,300	4,035.00	5,245,500	
スノーピーク	4,200	1,446.00	6,073,200	貸付有価証券 2,000株(1,000株)
パラマウントベッドホールディングス	14,300	5,600.00	80,080,000	貸付有価証券 6,300株
トランザクション	6,100	1,015.00	6,191,500	貸付有価証券 2,900株
S H O - B I	4,500	432.00	1,944,000	貸付有価証券 2,100株
ニホンフラッシュ	6,300	3,240.00	20,412,000	貸付有価証券 100株(100株)
前田工織	13,600	2,053.00	27,920,800	
永大産業	18,000	573.00	10,314,000	
アートネイチャー	14,500	779.00	11,295,500	
ダンロップスポーツ	8,600	1,683.00	14,473,800	
バンダイナムコホールディングス	140,600	3,740.00	525,844,000	
アイフィスジャパン	3,000	612.00	1,836,000	
共立印刷	22,600	382.00	8,633,200	

SHOEI	6,100	5,200.00	31,720,000	
フランスベッドホールディングス	16,100	1,031.00	16,599,100	
パイロットコーポレーション	23,700	5,530.00	131,061,000	
萩原工業	7,500	2,018.00	15,135,000	
トッパン・フォームズ	29,100	1,269.00	36,927,900	貸付有価証券 800株（200株）
フジシールインターナショナル	30,500	3,825.00	116,662,500	
タカラトミー	56,900	1,514.00	86,146,600	
廣済堂	12,600	418.00	5,266,800	貸付有価証券 200株
As-meエステール	4,000	1,025.00	4,100,000	貸付有価証券 700株
アーク	57,200	113.00	6,463,600	貸付有価証券 26,800株
タカノ	6,000	1,153.00	6,918,000	
プロネクサス	12,700	1,515.00	19,240,500	
ホクシン	9,600	197.00	1,891,200	
ウッドワン	4,600	1,553.00	7,143,800	
大建工業	10,600	2,934.00	31,100,400	
凸版印刷	384,000	1,014.00	389,376,000	
大日本印刷	178,000	2,503.00	445,534,000	
図書印刷	9,100	1,023.00	9,309,300	貸付有価証券 3,600株
共同印刷	4,200	3,640.00	15,288,000	
NISSHA	27,100	3,345.00	90,649,500	貸付有価証券 12,700株
光村印刷	1,200	2,332.00	2,798,400	
宝印刷	7,100	1,777.00	12,616,700	貸付有価証券 200株（200株）
アシックス	135,100	1,758.00	237,505,800	貸付有価証券 12,900株（2,700株）
ツツミ	4,200	2,148.00	9,021,600	
小松ウオール工業	4,600	2,401.00	11,044,600	
ヤマハ	91,600	4,070.00	372,812,000	
河合楽器製作所	4,600	2,577.00	11,854,200	
クリナップ	12,600	871.00	10,974,600	

ビジョン	82,200	4,400.00	361,680,000	貸付有価証券 600株
兼松サステック	1,100	2,048.00	2,252,800	
キングジム	11,300	1,016.00	11,480,800	
リンテック	32,300	3,125.00	100,937,500	貸付有価証券 100株（100株）
イトーキ	28,600	832.00	23,795,200	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
任天堂	83,800	41,680.00	3,492,784,000	
三菱鉛筆	22,400	2,459.00	55,081,600	貸付有価証券 100株（100株）
タカラスタンダード	28,100	1,807.00	50,776,700	貸付有価証券 13,300株
コクヨ	65,200	2,143.00	139,723,600	
ナカバヤシ	13,400	722.00	9,674,800	
グローブライド	6,100	2,020.00	12,322,000	
岡村製作所	47,500	1,597.00	75,857,500	
美津濃	13,500	3,300.00	44,550,000	
東京電力ホールディングス	1,085,800	439.00	476,666,200	貸付有価証券 8,300株
中部電力	416,100	1,381.50	574,842,150	
関西電力	555,000	1,367.50	758,962,500	
中国電力	188,000	1,202.00	225,976,000	貸付有価証券 80,300株（17,900株）
北陸電力	133,200	894.00	119,080,800	貸付有価証券 63,200株
東北電力	318,500	1,434.00	456,729,000	
四国電力	122,500	1,214.00	148,715,000	貸付有価証券 25,200株（700株）
九州電力	300,400	1,164.00	349,665,600	貸付有価証券 114,600株（108,800株）
北海道電力	136,400	727.00	99,162,800	貸付有価証券 200株（200株）
沖縄電力	22,000	2,960.00	65,120,000	
電源開発	108,200	3,000.00	324,600,000	貸付有価証券 3,400株
エフオン	6,800	1,435.00	9,758,000	貸付有価証券 600株
イーレックス	21,400	1,039.00	22,234,600	貸付有価証券

				10,000株
東京瓦斯	290,200	2,599.50	754,374,900	
大阪瓦斯	263,900	2,188.00	577,413,200	
東邦瓦斯	67,400	3,085.00	207,929,000	
北海道瓦斯	37,000	296.00	10,952,000	
広島ガス	28,000	368.00	10,304,000	貸付有価証券 100株(100株)
西部瓦斯	16,500	2,721.00	44,896,500	
静岡ガス	38,600	933.00	36,013,800	
メタウォーター	7,700	2,840.00	21,868,000	
SBSホールディングス	13,400	1,139.00	15,262,600	貸付有価証券 900株
東武鉄道	145,300	3,685.00	535,430,500	
相鉄ホールディングス	43,500	2,986.00	129,891,000	貸付有価証券 6,300株
東京急行電鉄	369,400	1,803.00	666,028,200	
京浜急行電鉄	186,300	2,189.00	407,810,700	貸付有価証券 100株
小田急電鉄	202,300	2,428.00	491,184,400	貸付有価証券 400株
京王電鉄	76,000	5,060.00	384,560,000	貸付有価証券 200株
京成電鉄	94,600	3,685.00	348,601,000	
富士急行	18,500	3,385.00	62,622,500	貸付有価証券 8,500株(8,200株)
新京成電鉄	3,500	2,148.00	7,518,000	
東日本旅客鉄道	244,300	11,140.00	2,721,502,000	貸付有価証券 12,700株
西日本旅客鉄道	122,700	8,340.00	1,023,318,000	
東海旅客鉄道	121,800	20,345.00	2,478,021,000	貸付有価証券 25,800株
西武ホールディングス	173,400	2,064.00	357,897,600	
鴻池運輸	19,200	1,999.00	38,380,800	
西日本鉄道	37,700	3,070.00	115,739,000	貸付有価証券 100株
ハマキョウレックス	9,600	3,160.00	30,336,000	
サカイ引越センター	7,100	5,700.00	40,470,000	貸付有価証券 1,500株
近鉄グループホールディングス	128,800	4,365.00	562,212,000	貸付有価証券 16,800株

阪急阪神ホールディングス	171,800	4,605.00	791,139,000	
南海電気鉄道	61,100	2,857.00	174,562,700	貸付有価証券 200株（200株）
京阪ホールディングス	57,400	3,320.00	190,568,000	貸付有価証券 5,400株
神戸電鉄	3,100	3,980.00	12,338,000	貸付有価証券 100株
名古屋鉄道	99,000	2,863.00	283,437,000	貸付有価証券 2,800株（400株）
山陽電気鉄道	9,900	2,813.00	27,848,700	
日本通運	50,600	7,610.00	385,066,000	貸付有価証券 600株
ヤマトホールディングス	225,800	2,297.50	518,775,500	貸付有価証券 100株
山九	33,000	4,880.00	161,040,000	
丸運	7,300	324.00	2,365,200	
丸全昭和運輸	46,000	505.00	23,230,000	貸付有価証券 12,000株（12,000株）
センコーグループホールディングス	77,500	814.00	63,085,000	
トナミホールディングス	3,100	5,650.00	17,515,000	
ニッコンホールディングス	49,000	3,200.00	156,800,000	
日本石油輸送	1,500	3,915.00	5,872,500	
福山通運	18,800	4,255.00	79,994,000	貸付有価証券 100株（100株）
セイノーホールディングス	96,500	1,803.00	173,989,500	貸付有価証券 2,900株
神奈川中央交通	3,200	3,645.00	11,664,000	
日立物流	28,300	2,961.00	83,796,300	
丸和運輸機関	6,800	3,775.00	25,670,000	貸付有価証券 3,200株（3,200株）
C & F ロジホールディングス	14,100	1,646.00	23,208,600	
九州旅客鉄道	108,100	3,515.00	379,971,500	
日本郵船	107,700	2,701.00	290,897,700	
商船三井	81,500	3,735.00	304,402,500	貸付有価証券 1,500株
川崎汽船	59,500	2,845.00	169,277,500	貸付有価証券 28,300株（100株）

N S ユナイテッド海運	6,100	2,707.00	16,512,700	
明治海運	13,700	446.00	6,110,200	
飯野海運	65,700	622.00	40,865,400	
共栄タンカー	1,000	2,093.00	2,093,000	貸付有価証券 400株
乾汽船	9,900	777.00	7,692,300	貸付有価証券 1,800株
日本航空	239,000	4,441.00	1,061,399,000	
A N A ホールディングス	252,400	4,704.00	1,187,289,600	
パスコ	12,000	326.00	3,912,000	貸付有価証券 5,000株
トランコム	3,600	7,880.00	28,368,000	
日新	11,100	3,115.00	34,576,500	
三菱倉庫	44,600	2,972.00	132,551,200	貸付有価証券 1,500株
三井倉庫ホールディングス	74,000	369.00	27,306,000	
住友倉庫	89,000	829.00	73,781,000	
澁澤倉庫	7,100	2,046.00	14,526,600	
東陽倉庫	23,200	328.00	7,609,600	
日本トランスシティ	31,000	487.00	15,097,000	
ケイヒン	2,500	1,650.00	4,125,000	
中央倉庫	7,800	1,246.00	9,718,800	
川西倉庫	2,600	2,309.00	6,003,400	貸付有価証券 700株
安田倉庫	11,500	927.00	10,660,500	
東洋埠頭	3,900	1,789.00	6,977,100	
宇徳	11,000	554.00	6,094,000	
上組	81,100	2,534.00	205,507,400	
サンリツ	3,300	894.00	2,950,200	
キムラユニティー	3,400	1,178.00	4,005,200	
キューソー流通システム	3,700	3,155.00	11,673,500	貸付有価証券 200株
郵船ロジスティクス	12,500	1,506.00	18,825,000	貸付有価証券 2,400株
近鉄エクスプレス	24,300	2,354.00	57,202,200	貸付有価証券 100株（100株）
東海運	7,300	404.00	2,949,200	貸付有価証券 1,200株

エーアイテーター	9,200	1,335.00	12,282,000	
内外トランスライン	4,500	2,050.00	9,225,000	貸付有価証券 2,100株
日本コンセプト	2,500	1,388.00	3,470,000	
N E C ネットエスアイ	14,700	2,962.00	43,541,400	
システナ	10,700	3,575.00	38,252,500	
デジタルアーツ	6,600	4,550.00	30,030,000	貸付有価証券 2,800株(2,600株)
新日鉄住金ソリューションズ	21,000	3,085.00	64,785,000	
キューブシステム	7,700	860.00	6,622,000	貸付有価証券 200株(200株)
コア	5,600	1,500.00	8,400,000	貸付有価証券 1,500株
ソフトクリエイティブホールディングス	6,400	1,582.00	10,124,800	
T I S	44,500	3,930.00	174,885,000	
ネオス	3,900	409.00	1,595,100	貸付有価証券 1,800株(700株)
電算システム	4,700	2,112.00	9,926,400	貸付有価証券 2,200株
グリー	81,700	699.00	57,108,300	
コーエーテクモホールディングス	22,700	2,313.00	52,505,100	貸付有価証券 400株(400株)
三菱総合研究所	5,700	3,935.00	22,429,500	
ボルテージ	2,400	1,065.00	2,556,000	貸付有価証券 1,100株(200株)
電算	1,500	2,506.00	3,759,000	
A G S	7,500	919.00	6,892,500	貸付有価証券 1,900株
ファインデックス	11,000	747.00	8,217,000	貸付有価証券 5,100株(2,800株)
ヒト・コミュニケーションズ	3,000	2,692.00	8,076,000	貸付有価証券 1,400株(200株)
ブレインパッド	2,900	1,330.00	3,857,000	貸付有価証券 1,300株
K L a b	25,800	1,784.00	46,027,200	貸付有価証券 12,500株(500株)
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	9,700	2,133.00	20,690,100	貸付有価証券 3,200株
イーブックイニシアティブ	2,100	1,047.00	2,198,700	貸付有価証券

ブジャパン				1,000株(1,000株)
ネクソン	149,100	3,265.00	486,811,500	
アイスタイル	30,600	900.00	27,540,000	貸付有価証券 14,700株(100株)
エムアップ	4,400	1,256.00	5,526,400	貸付有価証券 2,000株(1,800株)
エイチーム	9,200	2,682.00	24,674,400	貸付有価証券 3,900株(3,400株)
テクノスジャパン	12,100	914.00	11,059,400	貸付有価証券 5,600株(1,100株)
e n i s h	4,000	1,355.00	5,420,000	貸付有価証券 1,900株
コロプラ	43,100	1,199.00	51,676,900	貸付有価証券 20,300株
モバイルクリエイト	10,800	369.00	3,985,200	貸付有価証券 5,000株(3,500株)
オルトプラス	6,400	1,022.00	6,540,800	貸付有価証券 3,000株(100株)
ブロードリーフ	33,100	1,107.00	36,641,700	貸付有価証券 15,500株
ハーツユナイテッドグループ	7,100	1,710.00	12,141,000	貸付有価証券 3,400株(1,900株)
メディアドゥホールディングス	4,300	2,347.00	10,092,100	貸付有価証券 2,000株
ブイキューブ	8,200	541.00	4,436,200	貸付有価証券 3,800株(1,000株)
サイバーリンクス	2,000	1,389.00	2,778,000	貸付有価証券 900株
ディー・エル・イー	6,000	481.00	2,886,000	貸付有価証券 2,800株(800株)
フィックスターズ	2,300	5,710.00	13,133,000	貸付有価証券 1,100株
VOYAGE GROUP	6,800	1,407.00	9,567,600	貸付有価証券 3,100株
オブティム	2,300	2,719.00	6,253,700	貸付有価証券 1,000株
セレス	4,100	2,070.00	8,487,000	貸付有価証券 1,500株
ベリサーブ	1,800	3,665.00	6,597,000	貸付有価証券 800株
ティーガイア	13,400	2,605.00	34,907,000	
セック	1,300	2,612.00	3,395,600	

日本アジアグループ	14,000	524.00	7,336,000	
豆蔵ホールディングス	9,900	1,283.00	12,701,700	貸付有価証券 300株(200株)
テクマトリックス	7,300	1,951.00	14,242,300	貸付有価証券 3,500株
プロシップ	1,900	2,414.00	4,586,600	貸付有価証券 800株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	361,900	314.00	113,636,600	貸付有価証券 174,000株
GMOペイメントゲート ウェイ	9,400	9,480.00	89,112,000	貸付有価証券 4,500株
ザッパラス	6,900	397.00	2,739,300	
システムリサーチ	1,300	2,200.00	2,860,000	貸付有価証券 600株(600株)
インターネットイニシア ティブ	21,700	2,090.00	45,353,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
さくらインターネット	15,900	814.00	12,942,600	貸付有価証券 7,400株
ヴィンクス	1,400	1,238.00	1,733,200	貸付有価証券 600株
GMOクラウド	3,000	2,382.00	7,146,000	貸付有価証券 1,400株(500株)
SRAホールディングス	7,100	4,120.00	29,252,000	
Minorityソリューションズ	2,600	1,485.00	3,861,000	
システムインテグレータ	1,900	901.00	1,711,900	貸付有価証券 300株(100株)
朝日ネット	12,200	532.00	6,490,400	
アドソル日進	5,100	1,203.00	6,135,300	
フリービット	9,900	1,164.00	11,523,600	貸付有価証券 4,800株(4,800株)
コムチュア	6,800	2,884.00	19,611,200	
サイバーコム	2,400	1,143.00	2,743,200	貸付有価証券 800株
メディカル・データ・ビ ジョン	5,100	2,236.00	11,403,600	貸付有価証券 2,400株(1,500株)
gumi	15,300	1,012.00	15,483,600	貸付有価証券 7,300株(1,100株)
ショーケース・ティー ビー	2,600	1,546.00	4,019,600	貸付有価証券 1,200株
モバイルファクトリー	2,500	1,308.00	3,270,000	貸付有価証券

				1,100株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2,000	2,215.00	4,430,000	貸付有価証券 900株(300株)
P C Iホールディングス	2,200	3,065.00	6,743,000	
パイプドHD	2,100	1,169.00	2,454,900	貸付有価証券 400株
アイビーシー	1,400	1,039.00	1,454,600	貸付有価証券 600株(500株)
オープンドア	1,800	7,620.00	13,716,000	貸付有価証券 800株
アカツキ	2,600	6,560.00	17,056,000	貸付有価証券 1,200株
L I N E	37,600	4,635.00	174,276,000	貸付有価証券 100株(100株)
シンクロ・フード	1,100	2,742.00	3,016,200	貸付有価証券 500株
オークネット	4,200	1,479.00	6,211,800	貸付有価証券 1,300株
A O I T Y O H o l d i n g s	10,900	1,341.00	14,616,900	
マクロミル	17,300	2,597.00	44,928,100	貸付有価証券 8,300株(1,200株)
ソルクシーズ	5,100	1,286.00	6,558,600	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
フェイス	4,700	1,299.00	6,105,300	
ハイマックス	1,800	1,782.00	3,207,600	
野村総合研究所	89,200	5,340.00	476,328,000	貸付有価証券 100株(100株)
サイバネットシステム	10,900	709.00	7,728,100	
C Eホールディングス	3,800	834.00	3,169,200	貸付有価証券 1,600株
日本システム技術	1,600	1,346.00	2,153,600	
インテージホールディングス	15,300	1,430.00	21,879,000	貸付有価証券 800株(500株)
東邦システムサイエンス	4,400	833.00	3,665,200	
ソースネクスト	9,400	1,289.00	12,116,600	貸付有価証券 4,400株(3,900株)
フォーカスシステムズ	7,600	902.00	6,855,200	貸付有価証券 3,500株(400株)
クレスコ	3,000	4,770.00	14,310,000	
フジ・メディア・ホール	139,800	1,756.00	245,488,800	貸付有価証券

ディングス				68,200株
オービック	42,100	8,460.00	356,166,000	
ジャストシステム	21,700	2,178.00	47,262,600	
TDCソフト	5,800	1,164.00	6,751,200	
ヤフー	962,200	512.00	492,646,400	貸付有価証券 452,700株
トレンドマイクロ	65,200	6,530.00	425,756,000	
インフォメーション・ ディベロプメント	4,200	1,369.00	5,749,800	貸付有価証券 1,800株
日本オラクル	21,600	9,460.00	204,336,000	
アルファシステムズ	4,400	2,489.00	10,951,600	
フューチャー	18,100	1,213.00	21,955,300	
CAC Holdings	10,000	1,109.00	11,090,000	
ソフトバンク・テクノ ロジー	5,500	1,961.00	10,785,500	貸付有価証券 2,600株
トーセ	3,600	2,031.00	7,311,600	貸付有価証券 1,700株（1,600株）
オービックビジネスコン サルタント	6,800	6,370.00	43,316,000	貸付有価証券 3,000株
伊藤忠テクノソリュー ションズ	30,400	4,985.00	151,544,000	
アイティフォー	16,200	826.00	13,381,200	
東計電算	2,400	3,415.00	8,196,000	貸付有価証券 1,100株
エクスネット	2,100	907.00	1,904,700	
大塚商会	40,100	8,910.00	357,291,000	
サイボウズ	17,800	508.00	9,042,400	
ソフトブレイン	10,500	409.00	4,294,500	貸付有価証券 5,100株（100株）
電通国際情報サービス	8,300	2,610.00	21,663,000	
デジタルガレージ	24,000	3,040.00	72,960,000	貸付有価証券 10,900株（3,300株）
EMシステムズ	4,600	2,522.00	11,601,200	貸付有価証券 800株
ウェザーニューズ	4,500	3,370.00	15,165,000	貸付有価証券 2,100株（200株）
C I J	11,300	722.00	8,158,600	貸付有価証券 5,300株
東洋ビジネスエンジニア	1,300	1,850.00	2,405,000	貸付有価証券

リング				600株
日本エンタープライズ	13,700	229.00	3,137,300	貸付有価証券 3,000株
WOWOW	6,400	3,310.00	21,184,000	貸付有価証券 3,100株
スカラ	9,300	711.00	6,612,300	貸付有価証券 3,200株
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,300	1,185.00	13,390,500	貸付有価証券 1,200株
ネットワンシステムズ	54,500	1,727.00	94,121,500	
システムソフト	31,600	140.00	4,424,000	貸付有価証券 15,400株
アルゴグラフィックス	6,100	3,375.00	20,587,500	
マーベラス	22,600	1,021.00	23,074,600	貸付有価証券 10,600株（5,200株）
エイベックス	24,700	1,590.00	39,273,000	貸付有価証券 300株
日本ユニシス	37,000	2,310.00	85,470,000	
兼松エレクトロニクス	8,500	3,390.00	28,815,000	
東京放送ホールディングス	80,400	2,828.00	227,371,200	貸付有価証券 7,600株
日本テレビホールディングス	122,500	1,936.00	237,160,000	
朝日放送	13,200	906.00	11,959,200	
テレビ朝日ホールディングス	36,700	2,297.00	84,299,900	貸付有価証券 17,600株
スカパーJ S A Tホールディングス	101,900	515.00	52,478,500	貸付有価証券 10,600株（9,900株）
テレビ東京ホールディングス	10,900	2,388.00	26,029,200	
日本BS放送	4,500	1,284.00	5,778,000	貸付有価証券 1,500株（100株）
ビジョン	3,400	2,719.00	9,244,600	貸付有価証券 1,600株
USEN-NEXT HOLDINGS	3,500	1,006.00	3,521,000	貸付有価証券 1,600株
ワイヤレスゲート	6,200	1,321.00	8,190,200	貸付有価証券 2,900株
コネクシオ	9,400	2,364.00	22,221,600	
日本通信	119,600	101.00	12,079,600	貸付有価証券 56,900株（2,600株）

クロップス	2,800	1,116.00	3,124,800	貸付有価証券 1,300株(200株)
日本電信電話	957,800	5,355.00	5,129,019,000	
K D D I	1,201,800	2,834.00	3,405,901,200	
光通信	16,100	16,320.00	262,752,000	
N T T ドコモ	988,000	2,683.00	2,650,804,000	
エムティーアイ	18,000	635.00	11,430,000	貸付有価証券 8,400株(3,600株)
G M O インターネット	48,600	1,908.00	92,728,800	貸付有価証券 22,800株(1,400株)
アイドママーケティング コミュニケーション	2,100	709.00	1,488,900	
カドカワ	38,900	1,357.00	52,787,300	貸付有価証券 8,700株(7,900株)
学研ホールディングス	4,500	4,840.00	21,780,000	
ゼンリン	16,100	3,660.00	58,926,000	
昭文社	6,100	737.00	4,495,700	
インプレスホールディン グス	11,000	159.00	1,749,000	貸付有価証券 100株(100株)
アイネット	7,500	1,700.00	12,750,000	
松竹	8,800	19,370.00	170,456,000	
東宝	87,800	3,920.00	344,176,000	
東映	5,000	11,530.00	57,650,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	414,600	1,354.00	561,368,400	
ピー・シー・エー	2,000	1,781.00	3,562,000	
ビジネスブレイン太田昭 和	2,300	1,765.00	4,059,500	
D T S	13,800	3,720.00	51,336,000	
スクウェア・エニック ス・ホールディングス	62,000	5,520.00	342,240,000	貸付有価証券 2,000株
シーイーシー	7,900	3,330.00	26,307,000	
カプコン	28,600	3,570.00	102,102,000	
アイ・エス・ビー	2,600	1,309.00	3,403,400	貸付有価証券 1,200株
ジャステック	7,700	1,272.00	9,794,400	
S C S K	31,900	5,240.00	167,156,000	
日本システムウエア	4,400	2,662.00	11,712,800	
アイネス	16,900	1,158.00	19,570,200	貸付有価証券

				100株(100株)
T K C	12,400	4,095.00	50,778,000	
富士ソフト	18,500	3,585.00	66,322,500	貸付有価証券 700株
N S D	21,900	2,369.00	51,881,100	
コナミホールディングス	54,500	6,310.00	343,895,000	
福井コンピュータホールディングス	3,900	3,180.00	12,402,000	貸付有価証券 1,000株
J B C Cホールディングス	10,500	1,123.00	11,791,500	
ミロク情報サービス	11,800	3,015.00	35,577,000	
ソフトバンクグループ	604,200	8,933.00	5,397,318,600	
ハウスイ	1,100	1,173.00	1,290,300	
高千穂交易	5,200	1,154.00	6,000,800	
伊藤忠食品	3,300	6,230.00	20,559,000	
エレマテック	6,300	2,599.00	16,373,700	
J A L U X	3,800	2,877.00	10,932,600	
あらた	6,600	6,030.00	39,798,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
トーメンデバイス	2,000	3,385.00	6,770,000	
東京エレクトロン デバイス	4,900	2,024.00	9,917,600	貸付有価証券 700株
フィールズ	10,300	1,211.00	12,473,300	貸付有価証券 4,400株
双日	792,700	338.00	267,932,600	
アルフレッサ ホールディングス	148,900	2,652.00	394,882,800	
横浜冷凍	31,600	1,158.00	36,592,800	貸付有価証券 15,500株(12,100株)
神栄	1,800	1,519.00	2,734,200	貸付有価証券 800株
ラサ商事	5,900	1,004.00	5,923,600	貸付有価証券 200株
ラクーン	8,600	819.00	7,043,400	貸付有価証券 2,600株
アルコニックス	14,200	2,324.00	33,000,800	貸付有価証券 3,400株(1,000株)
神戸物産	8,700	4,270.00	37,149,000	貸付有価証券 4,000株
ペッパーフードサービス	7,100	4,965.00	35,251,500	貸付有価証券

				3,400株(2,700株)
あい ホールディングス	19,100	2,677.00	51,130,700	
ディービーエックス	4,800	1,325.00	6,360,000	
ダイワボウホールディングス	11,400	4,600.00	52,440,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	24,800	2,515.00	62,372,000	
ラクト・ジャパン	1,900	4,560.00	8,664,000	貸付有価証券 800株
パイタルケーエスケー・ホールディングス	25,200	1,023.00	25,779,600	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
八洲電機	10,300	1,049.00	10,804,700	
メディアスホールディングス	2,100	2,447.00	5,138,700	
U K C ホールディングス	8,600	2,326.00	20,003,600	
ジューテックホールディングス	3,100	1,343.00	4,163,300	
大光	3,100	938.00	2,907,800	貸付有価証券 1,400株
O C H I ホールディングス	3,900	1,499.00	5,846,100	
T O K A I ホールディングス	70,800	942.00	66,693,600	貸付有価証券 18,700株
大阪工機	2,000	1,125.00	2,250,000	
三洋貿易	7,300	2,746.00	20,045,800	
ビューティガレージ	1,800	1,985.00	3,573,000	
ウイン・パートナーズ	9,700	1,398.00	13,560,600	
ミタチ産業	3,100	1,634.00	5,065,400	貸付有価証券 1,400株
シップヘルスケアホールディングス	27,900	3,715.00	103,648,500	
明治電機工業	4,600	1,821.00	8,376,600	
デリカフーズホールディングス	2,600	1,490.00	3,874,000	
スターティア	3,000	973.00	2,919,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
コメダホールディングス	24,700	2,064.00	50,980,800	
富士興産	5,200	582.00	3,026,400	
協栄産業	1,600	2,113.00	3,380,800	貸付有価証券 700株
小野建	11,700	2,034.00	23,797,800	貸付有価証券

				5,600株
佐島電機	9,900	1,225.00	12,127,500	
エコトレーディング	3,100	703.00	2,179,300	
伯東	8,200	1,930.00	15,826,000	貸付有価証券 200株
コンドーテック	10,600	1,096.00	11,617,600	
中山福	7,700	789.00	6,075,300	
ナガイレーベン	17,800	2,692.00	47,917,600	
三菱食品	14,700	3,315.00	48,730,500	
松田産業	9,800	1,825.00	17,885,000	
第一興商	19,900	5,580.00	111,042,000	
メディバルホールディング グス	134,200	2,242.00	300,876,400	
S P K	2,900	3,230.00	9,367,000	
萩原電気	4,600	3,635.00	16,721,000	
アズワン	10,500	7,000.00	73,500,000	
スズデン	4,600	1,625.00	7,475,000	
尾家産業	3,900	1,347.00	5,253,300	
シモジマ	8,200	1,241.00	10,176,200	
ドウシシャ	14,200	2,384.00	33,852,800	
小津産業	2,900	2,138.00	6,200,200	
高速	8,000	1,332.00	10,656,000	
たけびし	4,700	1,851.00	8,699,700	
黒田電気	16,700	2,706.00	45,190,200	貸付有価証券 700株
リックス	3,000	1,928.00	5,784,000	
丸文	11,800	1,112.00	13,121,600	
ハビネット	9,100	2,144.00	19,510,400	
橋本総業ホールディング ス	2,800	1,867.00	5,227,600	
日本ライフライン	19,100	4,865.00	92,921,500	貸付有価証券 2,100株
エクセル	5,400	2,656.00	14,342,400	貸付有価証券 200株
マルカキカイ	4,300	2,114.00	9,090,200	
I D O M	40,600	804.00	32,642,400	貸付有価証券 17,000株(14,000株)
日本エム・ディ・エム	8,900	914.00	8,134,600	貸付有価証券

				4,100株
進和	7,900	2,711.00	21,416,900	貸付有価証券 2,900株
エスケイジャパン	3,200	441.00	1,411,200	貸付有価証券 1,500株
ダイترون	6,100	2,383.00	14,536,300	
シークス	8,500	4,755.00	40,417,500	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
田中商事	4,100	828.00	3,394,800	
オーハシテクニカ	7,500	1,770.00	13,275,000	
白銅	4,800	2,356.00	11,308,800	
伊藤忠商事	983,100	2,087.50	2,052,221,250	
丸紅	1,100,900	802.50	883,472,250	
高島	2,300	2,213.00	5,089,900	
長瀬産業	80,700	2,046.00	165,112,200	
蝶理	8,500	2,088.00	17,748,000	
豊田通商	149,500	4,520.00	675,740,000	
三共生興	22,800	486.00	11,080,800	
兼松	57,100	1,565.00	89,361,500	
ツカモトコーポレーショ ン	2,400	1,291.00	3,098,400	
三井物産	1,138,000	1,798.00	2,046,124,000	
日本紙パルプ商事	7,000	4,200.00	29,400,000	
日立ハイテクノロジーズ	46,500	4,745.00	220,642,500	
カメイ	17,500	1,910.00	33,425,000	
東都水産	2,000	2,005.00	4,010,000	
OUGホールディングス	2,100	2,694.00	5,657,400	
スターゼン	5,200	5,480.00	28,496,000	貸付有価証券 2,500株(2,500株)
山善	52,300	1,324.00	69,245,200	
椿本興業	3,000	2,879.00	8,637,000	
住友商事	845,000	1,909.50	1,613,527,500	
内田洋行	6,200	3,175.00	19,685,000	
三菱商事	940,000	3,051.00	2,867,940,000	
第一実業	6,100	3,340.00	20,374,000	
キャノンマーケティング ジャパン	38,300	3,100.00	118,730,000	
西華産業	8,300	3,025.00	25,107,500	

佐藤商事	12,000	1,369.00	16,428,000	
菱洋エレクトロ	12,400	2,040.00	25,296,000	
東京産業	13,300	533.00	7,088,900	
ユアサ商事	12,700	4,050.00	51,435,000	
神鋼商事	3,000	3,260.00	9,780,000	
小林産業	8,900	355.00	3,159,500	貸付有価証券 100株
阪和興業	25,000	5,020.00	125,500,000	
正栄食品工業	7,400	4,855.00	35,927,000	貸付有価証券 3,400株
カナデン	12,800	1,389.00	17,779,200	
菱電商事	9,600	1,804.00	17,318,400	
フルサト工業	7,400	1,879.00	13,904,600	
岩谷産業	29,700	3,610.00	107,217,000	貸付有価証券 100株（100株）
すてきナイスグループ	5,700	1,527.00	8,703,900	
昭光通商	48,000	140.00	6,720,000	貸付有価証券 2,000株
ニチモウ	2,100	1,945.00	4,084,500	
極東貿易	19,000	511.00	9,709,000	
イワキ	19,000	506.00	9,614,000	貸付有価証券 1,000株
三愛石油	36,000	1,624.00	58,464,000	
稲畑産業	32,200	1,686.00	54,289,200	
G S Iクレオス	3,500	1,566.00	5,481,000	貸付有価証券 500株
明和産業	12,400	474.00	5,877,600	
ワキタ	28,600	1,375.00	39,325,000	
東邦ホールディングス	39,700	2,548.00	101,155,600	貸付有価証券 17,400株（17,400株）
サンゲツ	45,300	2,108.00	95,492,400	
ミツウロコグループホールディングス	19,400	869.00	16,858,600	貸付有価証券 200株
シナネンホールディングス	6,400	2,671.00	17,094,400	
伊藤忠エネクス	29,600	1,088.00	32,204,800	
サンリオ	37,600	1,851.00	69,597,600	貸付有価証券 18,300株（7,500株）
サンワテクノス	7,900	2,278.00	17,996,200	貸付有価証券

				500株
リョーサン	16,800	4,340.00	72,912,000	
新光商事	14,700	2,102.00	30,899,400	
トーホー	6,000	2,831.00	16,986,000	
三信電気	12,400	1,876.00	23,262,400	貸付有価証券 600株
東陽テクニカ	15,400	977.00	15,045,800	貸付有価証券 2,500株
モスフードサービス	17,600	3,420.00	60,192,000	
加賀電子	12,100	3,095.00	37,449,500	
ソーダニッカ	13,800	618.00	8,528,400	
立花エレテック	9,100	1,937.00	17,626,700	
フォーバル	5,900	875.00	5,162,500	
PALTA C	18,800	5,170.00	97,196,000	貸付有価証券 100株(100株)
三谷産業	14,500	441.00	6,394,500	貸付有価証券 3,400株
太平洋興発	5,600	1,037.00	5,807,200	
西本Wismettac ホールディングス	2,700	4,595.00	12,406,500	貸付有価証券 100株
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,100	1,562.00	1,718,200	貸付有価証券 100株
ヤマタネ	6,700	2,185.00	14,639,500	
丸紅建材リース	13,000	241.00	3,133,000	
日鉄住金物産	10,500	6,690.00	70,245,000	
トラスコ中山	27,900	3,345.00	93,325,500	貸付有価証券 13,100株
オートバックスセブン	53,200	2,154.00	114,592,800	貸付有価証券 100株(100株)
モリト	10,700	1,004.00	10,742,800	貸付有価証券 100株(100株)
加藤産業	20,900	4,175.00	87,257,500	
イノテック	11,500	1,092.00	12,558,000	
イエローハット	12,600	3,395.00	42,777,000	
J Kホールディングス	13,400	1,009.00	13,520,600	
日伝	11,100	2,292.00	25,441,200	
北沢産業	11,100	290.00	3,219,000	貸付有価証券 5,200株
杉本商事	7,200	1,785.00	12,852,000	

因幡電機産業	17,700	5,170.00	91,509,000	
バイテックホールディングス	6,100	1,767.00	10,778,700	貸付有価証券 1,500株
ミスミグループ本社	155,500	3,265.00	507,707,500	
アルテック	11,400	371.00	4,229,400	貸付有価証券 5,400株(1,900株)
タキヒヨー	4,500	2,306.00	10,377,000	
蔵王産業	2,200	1,947.00	4,283,400	
スズケン	61,100	4,655.00	284,420,500	
ジェコス	9,200	1,394.00	12,824,800	
ルネサスイーストン	12,300	749.00	9,212,700	貸付有価証券 200株(200株)
ローソン	33,900	7,740.00	262,386,000	貸付有価証券 9,700株
サンエー	10,100	5,410.00	54,641,000	
カワチ薬品	10,400	2,763.00	28,735,200	
エービーシー・マート	24,400	6,480.00	158,112,000	貸付有価証券 700株
ハードオフコーポレーション	5,900	1,255.00	7,404,500	
アスクル	14,000	3,210.00	44,940,000	貸付有価証券 6,800株(500株)
ゲオホールディングス	24,500	2,180.00	53,410,000	
アダストリア	20,600	2,493.00	51,355,800	
ジーフット	8,100	774.00	6,269,400	貸付有価証券 1,200株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	1,700	700.00	1,190,000	
くらコーポレーション	7,900	6,490.00	51,271,000	
キャンドゥ	6,400	1,782.00	11,404,800	貸付有価証券 2,000株(1,600株)
パルグループホールディングス	6,800	3,545.00	24,106,000	
エディオン	52,000	1,310.00	68,120,000	貸付有価証券 24,400株(10,700株)
サーラコーポレーション	23,000	692.00	15,916,000	貸付有価証券 7,300株(7,000株)
ワッツ	5,300	1,242.00	6,582,600	
ハローズ	5,000	2,597.00	12,985,000	貸付有価証券 2,100株

あみやき亭	2,900	5,230.00	15,167,000	
ひらまつ	18,500	556.00	10,286,000	貸付有価証券 5,800株
大黒天物産	3,200	5,040.00	16,128,000	貸付有価証券 100株
ハニーズホールディングス	13,000	1,152.00	14,976,000	貸付有価証券 2,200株
ファーマライズホールディングス	3,100	605.00	1,875,500	
アルペン	10,300	2,379.00	24,503,700	貸付有価証券 4,800株
クオール	13,900	2,052.00	28,522,800	
ジンズ	9,100	5,950.00	54,145,000	貸付有価証券 4,400株
ビックカメラ	77,100	1,628.00	125,518,800	
D C Mホールディングス	72,200	1,095.00	79,059,000	貸付有価証券 33,900株(1,800株)
Monotaro	47,600	3,615.00	172,074,000	貸付有価証券 23,000株(5,900株)
東京一番フーズ	3,300	613.00	2,022,900	貸付有価証券 1,600株(800株)
DDホールディングス	3,000	4,755.00	14,265,000	
きちり	3,600	833.00	2,998,800	貸付有価証券 1,700株(1,200株)
アークランドサービスホールディングス	11,200	2,726.00	30,531,200	貸付有価証券 5,200株
J.フロント リテイリング	160,000	2,018.00	322,880,000	
ドトール・日レスホールディングス	23,500	2,789.00	65,541,500	
マツモトキヨシホールディングス	27,700	9,310.00	257,887,000	
ブロンコビリー	7,000	3,465.00	24,255,000	貸付有価証券 3,400株(300株)
スタートトゥデイ	131,600	3,555.00	467,838,000	
トレジャー・ファクトリー	3,900	989.00	3,857,100	
物語コーポレーション	3,800	10,770.00	40,926,000	貸付有価証券 1,700株
ココカラファイン	14,000	7,320.00	102,480,000	
三越伊勢丹ホールディング	250,400	1,348.00	337,539,200	貸付有価証券

グス				21,100株
H a m e e	4,000	1,704.00	6,816,000	貸付有価証券 1,800株
ウエルシアホールディングス	35,400	4,920.00	174,168,000	
クリエイティブSDホールディングス	19,800	3,050.00	60,390,000	
丸善CHIホールディングス	15,600	344.00	5,366,400	
ミサワ	2,400	502.00	1,204,800	貸付有価証券 1,100株
ティーライフ	1,800	1,305.00	2,349,000	
エー・ピーカンパニー	2,500	860.00	2,150,000	貸付有価証券 1,000株(100株)
チムニー	4,100	2,855.00	11,705,500	
シュッピン	4,000	3,085.00	12,340,000	貸付有価証券 1,800株(200株)
ネクステージ	14,100	929.00	13,098,900	貸付有価証券 6,600株(600株)
ジョイフル本田	21,800	3,485.00	75,973,000	貸付有価証券 200株(100株)
鳥貴族	4,900	3,875.00	18,987,500	貸付有価証券 2,300株(700株)
キリン堂ホールディングス	4,800	2,061.00	9,892,800	
ホットランド	7,800	1,470.00	11,466,000	貸付有価証券 3,600株
すかいらーく	83,100	1,628.00	135,286,800	貸付有価証券 39,100株
綿半ホールディングス	5,000	3,325.00	16,625,000	
ヨシックス	2,200	4,160.00	9,152,000	貸付有価証券 1,000株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	44,500	1,168.00	51,976,000	貸付有価証券 100株(100株)
ブックオフコーポレーション	7,600	817.00	6,209,200	貸付有価証券 3,700株(700株)
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,400	1,036.00	5,594,400	貸付有価証券 2,500株
B E E N O S	2,100	1,954.00	4,103,400	貸付有価証券 200株(200株)
あさひ	10,000	1,311.00	13,110,000	貸付有価証券 400株

日本調剤	4,700	3,410.00	16,027,000	貸付有価証券 1,500株
コスモス薬品	6,800	23,630.00	160,684,000	
トーエル	6,500	1,040.00	6,760,000	
一六堂	2,900	507.00	1,470,300	
オンリー	2,000	980.00	1,960,000	
セブン & アイ・ホールディングス	561,500	4,719.00	2,649,718,500	
薬王堂	5,800	3,195.00	18,531,000	貸付有価証券 1,700株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	36,000	1,337.00	48,132,000	
ツルハホールディングス	26,900	15,250.00	410,225,000	
サンマルクホールディングス	9,600	3,075.00	29,520,000	
フェリシモ	3,400	1,367.00	4,647,800	
トリドールホールディングス	16,500	4,225.00	69,712,500	
T O K Y O B A S E	2,600	4,760.00	12,376,000	貸付有価証券 1,200株
サツドラホールディングス	1,800	1,999.00	3,598,200	
ダイユー・リックホールディングス	6,200	1,181.00	7,322,200	
バロックジャパンリミテッド	10,700	962.00	10,293,400	貸付有価証券 5,200株（700株）
クスリのアオキホールディングス	10,600	5,860.00	62,116,000	貸付有価証券 2,100株
スシローグローバルホールディングス	12,200	4,390.00	53,558,000	貸付有価証券 2,600株
L I X I L ビバ	12,700	1,910.00	24,257,000	貸付有価証券 800株（800株）
メディカルシステムネットワーク	15,100	595.00	8,984,500	貸付有価証券 7,300株
総合メディカル	5,800	5,970.00	34,626,000	
はるやまホールディングス	6,300	1,042.00	6,564,600	
ノジマ	23,400	2,687.00	62,875,800	
カップ・クリエイト	16,700	1,266.00	21,142,200	貸付有価証券 1,500株
ライトオン	11,300	908.00	10,260,400	貸付有価証券

				5,400株
ジーンズメイト	4,100	1,125.00	4,612,500	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
良品計画	17,800	34,700.00	617,660,000	貸付有価証券 8,500株
三城ホールディングス	16,600	473.00	7,851,800	
アドヴァン	13,600	1,082.00	14,715,200	貸付有価証券 200株
アルビス	3,000	4,035.00	12,105,000	貸付有価証券 200株(100株)
コナカ	17,100	622.00	10,636,200	
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,837.00	2,939,200	
G-7ホールディングス	3,900	2,534.00	9,882,600	
イオン北海道	13,500	761.00	10,273,500	貸付有価証券 6,300株
コジマ	23,000	369.00	8,487,000	貸付有価証券 900株
ヒマラヤ	3,600	1,219.00	4,388,400	
コーナン商事	19,000	2,410.00	45,790,000	
エコス	5,400	1,255.00	6,777,000	貸付有価証券 2,500株(100株)
ワタミ	15,800	1,640.00	25,912,000	
マルシェ	3,500	807.00	2,824,500	貸付有価証券 1,100株
ドンキホーテホールディングス	86,800	5,920.00	513,856,000	
西松屋チェーン	29,400	1,250.00	36,750,000	貸付有価証券 11,400株
ゼンショーホールディングス	69,500	1,948.00	135,386,000	貸付有価証券 17,900株(17,600株)
幸楽苑ホールディングス	8,500	1,808.00	15,368,000	貸付有価証券 3,900株
ハークスレイ	3,300	1,184.00	3,907,200	
サイゼリヤ	19,900	3,725.00	74,127,500	
V Tホールディングス	45,400	573.00	26,014,200	貸付有価証券 200株
魚力	3,700	1,167.00	4,317,900	
ポブラ	3,500	709.00	2,481,500	
フジ・コーポレーション	2,300	2,279.00	5,241,700	貸付有価証券 1,100株

ユナイテッドアローズ	16,600	4,585.00	76,111,000	
ハイデイ日高	14,600	3,750.00	54,750,000	貸付有価証券 300株(300株)
京都きもの友禅	8,500	756.00	6,426,000	貸付有価証券 4,100株
コロワイド	44,500	2,249.00	100,080,500	貸付有価証券 15,500株
ピーシーデポコーポレーション	20,000	847.00	16,940,000	貸付有価証券 9,400株(800株)
壱番屋	9,400	4,560.00	42,864,000	
トップカルチャー	4,800	499.00	2,395,200	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
P L A N T	3,100	1,355.00	4,200,500	貸付有価証券 600株
スギホールディングス	29,400	5,730.00	168,462,000	貸付有価証券 100株(100株)
ヴィア・ホールディングス	11,500	717.00	8,245,500	貸付有価証券 5,100株
スクロール	20,600	524.00	10,794,400	
ヨンドシーホールディングス	13,600	2,968.00	40,364,800	貸付有価証券 5,200株(5,100株)
ユニー・ファミリーマートホールディングス	42,800	7,860.00	336,408,000	貸付有価証券 5,200株(300株)
木曽路	16,400	2,766.00	45,362,400	
S R S ホールディングス	15,800	943.00	14,899,400	貸付有価証券 7,100株
千趣会	24,300	623.00	15,138,900	貸付有価証券 11,400株
タカキュー	10,300	223.00	2,296,900	貸付有価証券 4,900株
ケーヨー	24,800	713.00	17,682,400	貸付有価証券 10,500株
上新電機	15,800	4,000.00	63,200,000	
日本瓦斯	24,600	3,950.00	97,170,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
ロイヤルホールディングス	23,800	3,145.00	74,851,000	貸付有価証券 11,300株
東天紅	1,000	2,168.00	2,168,000	貸付有価証券 400株(400株)
いなげや	14,900	1,877.00	27,967,300	
島忠	32,400	3,315.00	107,406,000	貸付有価証券

				10,100株(10,100株)
チヨダ	15,800	3,025.00	47,795,000	
ライフコーポレーション	10,200	2,999.00	30,589,800	
リンガーハット	16,500	2,556.00	42,174,000	貸付有価証券 500株(100株)
さが美グループホールディングス	12,000	132.00	1,584,000	貸付有価証券 1,000株
MrMaxHD	16,700	900.00	15,030,000	
テナアライド	12,300	487.00	5,990,100	貸付有価証券 5,700株
AOKIホールディングス	26,800	1,678.00	44,970,400	
オークワ	19,000	1,158.00	22,002,000	
コメリ	20,700	3,275.00	67,792,500	貸付有価証券 100株(100株)
青山商事	25,700	4,225.00	108,582,500	
しまむら	15,600	12,420.00	193,752,000	貸付有価証券 1,600株(500株)
はせがわ	7,100	504.00	3,578,400	貸付有価証券 400株(400株)
高島屋	210,000	1,188.00	249,480,000	
松屋	27,000	1,501.00	40,527,000	貸付有価証券 11,100株(600株)
エイチ・ツー・オー リテイリング	63,400	2,304.00	146,073,600	
近鉄百貨店	5,100	4,195.00	21,394,500	
パルコ	12,900	1,599.00	20,627,100	
丸井グループ	128,300	2,055.00	263,656,500	貸付有価証券 10,600株
アクシアル リテイリング	11,100	4,240.00	47,064,000	
井筒屋	7,300	454.00	3,314,200	
イオン	515,500	1,913.00	986,151,500	貸付有価証券 157,000株(20,800 株)
イズミ	24,200	7,140.00	172,788,000	
東武ストア	1,600	2,976.00	4,761,600	
平和堂	27,200	2,490.00	67,728,000	
フジ	16,000	2,415.00	38,640,000	
ヤオコー	15,200	5,540.00	84,208,000	

ゼビオホールディングス	18,200	2,180.00	39,676,000	
ケーズホールディングス	56,800	2,899.00	164,663,200	貸付有価証券 11,900株（3,000株）
Olympicグループ	7,900	600.00	4,740,000	
日産東京販売ホールディングス	19,700	404.00	7,958,800	
Genky Drug Stores	5,800	3,970.00	23,026,000	貸付有価証券 2,700株
アインホールディングス	19,100	6,680.00	127,588,000	貸付有価証券 200株（100株）
元気寿司	3,400	3,845.00	13,073,000	貸付有価証券 1,500株
ヤマダ電機	448,900	616.00	276,522,400	貸付有価証券 210,900株（48,300株）
アークランドサカモト	22,700	1,827.00	41,472,900	
ニトリホールディングス	53,200	15,865.00	844,018,000	貸付有価証券 18,100株
グルメ杵屋	10,000	1,144.00	11,440,000	
愛眼	10,700	622.00	6,655,400	貸付有価証券 5,000株（3,500株）
ケーユーホールディングス	7,000	1,234.00	8,638,000	貸付有価証券 100株
吉野家ホールディングス	44,000	1,934.00	85,096,000	貸付有価証券 17,100株（200株）
松屋フーズ	6,400	4,185.00	26,784,000	貸付有価証券 200株（200株）
サガミチェーン	17,900	1,402.00	25,095,800	
関西スーパーマーケット	10,100	1,223.00	12,352,300	貸付有価証券 4,900株（4,700株）
王将フードサービス	9,800	5,450.00	53,410,000	貸付有価証券 500株
プレナス	15,000	2,448.00	36,720,000	貸付有価証券 5,400株（3,900株）
ミニストップ	9,900	2,417.00	23,928,300	
アークス	25,100	2,640.00	66,264,000	
パローホールディングス	31,100	2,646.00	82,290,600	貸付有価証券 200株（200株）
藤久	1,100	1,730.00	1,903,000	貸付有価証券 500株
ベルク	5,900	6,810.00	40,179,000	

大庄	7,200	1,722.00	12,398,400	貸付有価証券 100株
ファーストリテイリング	22,400	44,600.00	999,040,000	貸付有価証券 6,300株
サンドラッグ	56,700	5,280.00	299,376,000	
サックスパーホールディングス	12,600	1,365.00	17,199,000	貸付有価証券 3,000株（800株）
ヤマザワ	2,800	1,738.00	4,866,400	
やまや	2,700	3,365.00	9,085,500	貸付有価証券 1,300株
ペルーナ	32,800	1,381.00	45,296,800	
島根銀行	2,800	1,357.00	3,799,600	
じもとホールディングス	90,600	191.00	17,304,600	
めぶきフィナンシャルグループ	697,100	476.00	331,819,600	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
東京ＴＹフィナンシャルグループ	18,100	3,215.00	58,191,500	
九州フィナンシャルグループ	220,100	688.00	151,428,800	
ゆうちょ銀行	380,100	1,477.00	561,407,700	貸付有価証券 3,400株
富山第一銀行	34,100	525.00	17,902,500	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	815,600	680.00	554,608,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	91,000	1,356.00	123,396,000	
新生銀行	116,100	1,954.00	226,859,400	貸付有価証券 8,000株（1,700株）
あおぞら銀行	79,900	4,460.00	356,354,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,477,800	836.00	7,923,440,800	
りそなホールディングス	1,472,200	683.20	1,005,807,040	
三井住友トラスト・ホールディングス	263,700	4,499.00	1,186,386,300	
三井住友フィナンシャルグループ	1,015,400	4,884.00	4,959,213,600	
第四銀行	16,400	5,080.00	83,312,000	
北越銀行	13,500	2,584.00	34,884,000	
千葉銀行	481,000	937.00	450,697,000	貸付有価証券 1,000株

群馬銀行	272,500	690.00	188,025,000	
武蔵野銀行	21,400	3,745.00	80,143,000	
千葉興業銀行	36,800	560.00	20,608,000	
筑波銀行	55,800	375.00	20,925,000	
七十七銀行	42,100	2,812.00	118,385,200	
青森銀行	10,400	3,590.00	37,336,000	貸付有価証券 4,700株（1,900株）
秋田銀行	8,600	3,045.00	26,187,000	
山形銀行	15,100	2,455.00	37,070,500	貸付有価証券 7,300株（1,600株）
岩手銀行	9,400	4,455.00	41,877,000	
東邦銀行	120,000	395.00	47,400,000	貸付有価証券 3,100株（1,100株）
東北銀行	6,800	1,503.00	10,220,400	
みちのく銀行	8,600	1,765.00	15,179,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
ふくおかフィナンシャル グループ	545,000	638.00	347,710,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
静岡銀行	354,000	1,166.00	412,764,000	貸付有価証券 19,000株（1,000株）
十六銀行	18,000	3,300.00	59,400,000	貸付有価証券 200株（200株）
スルガ銀行	137,200	2,401.00	329,417,200	貸付有価証券 15,700株
八十二銀行	242,800	648.00	157,334,400	
山梨中央銀行	83,000	484.00	40,172,000	
大垣共立銀行	21,200	2,804.00	59,444,800	
福井銀行	11,500	2,645.00	30,417,500	貸付有価証券 300株
北國銀行	15,200	4,490.00	68,248,000	
清水銀行	4,600	3,240.00	14,904,000	
富山銀行	2,600	4,255.00	11,063,000	
滋賀銀行	126,000	578.00	72,828,000	貸付有価証券 46,000株（46,000株）
南都銀行	15,700	3,015.00	47,335,500	
百五銀行	128,800	539.00	69,423,200	
京都銀行	51,200	5,930.00	303,616,000	
紀陽銀行	50,500	1,860.00	93,930,000	
三重銀行	6,000	2,511.00	15,066,000	

ほくほくフィナンシャルグループ	89,300	1,761.00	157,257,300	
広島銀行	198,000	965.00	191,070,000	貸付有価証券 4,600株（3,100株）
山陰合同銀行	79,500	1,085.00	86,257,500	
中国銀行	92,800	1,505.00	139,664,000	貸付有価証券 5,900株（5,900株）
鳥取銀行	4,300	1,790.00	7,697,000	
伊予銀行	191,400	906.00	173,408,400	貸付有価証券 4,700株
百十四銀行	143,000	369.00	52,767,000	
四国銀行	20,600	1,554.00	32,012,400	
阿波銀行	107,000	708.00	75,756,000	
大分銀行	7,700	4,365.00	33,610,500	貸付有価証券 3,700株
宮崎銀行	8,900	3,865.00	34,398,500	
佐賀銀行	8,100	2,562.00	20,752,200	
十八銀行	83,000	292.00	24,236,000	
沖縄銀行	13,100	4,580.00	59,998,000	貸付有価証券 300株
琉球銀行	26,000	1,715.00	44,590,000	
セブン銀行	503,200	390.00	196,248,000	貸付有価証券 233,100株
みずほフィナンシャルグループ	18,226,700	205.30	3,741,941,510	
高知銀行	4,900	1,298.00	6,360,200	
山口フィナンシャルグループ	126,000	1,358.00	171,108,000	貸付有価証券 25,000株（24,000株）
長野銀行	4,400	1,955.00	8,602,000	貸付有価証券 2,100株（300株）
名古屋銀行	10,800	4,385.00	47,358,000	貸付有価証券 5,200株（1,100株）
北洋銀行	202,200	378.00	76,431,600	
愛知銀行	4,500	5,350.00	24,075,000	
第三銀行	7,600	1,789.00	13,596,400	貸付有価証券 1,200株
中京銀行	5,500	2,318.00	12,749,000	
大光銀行	4,600	2,481.00	11,412,600	
愛媛銀行	18,500	1,348.00	24,938,000	貸付有価証券 2,700株（2,700株）

トマト銀行	5,200	1,530.00	7,956,000	
みなと銀行	12,100	2,066.00	24,998,600	貸付有価証券 5,600株
京葉銀行	119,000	515.00	61,285,000	貸付有価証券 1,000株
関西アーバン銀行	18,700	1,418.00	26,516,600	貸付有価証券 9,000株
栃木銀行	69,400	452.00	31,368,800	貸付有価証券 900株(100株)
北日本銀行	4,200	3,100.00	13,020,000	
東和銀行	23,600	1,480.00	34,928,000	
福島銀行	12,600	905.00	11,403,000	貸付有価証券 4,400株
大東銀行	6,400	1,619.00	10,361,600	
トモニホールディングス	110,600	583.00	64,479,800	貸付有価証券 5,600株(1,900株)
フィデアホールディングス	130,200	201.00	26,170,200	
池田泉州ホールディングス	142,400	411.00	58,526,400	貸付有価証券 400株(400株)
F P G	47,900	1,361.00	65,191,900	
S B Iホールディングス	151,700	2,351.00	356,646,700	貸付有価証券 50,600株(11,400株)
日本アジア投資	12,100	393.00	4,755,300	貸付有価証券 5,800株(300株)
ジャフコ	19,200	6,550.00	125,760,000	
大和証券グループ本社	1,148,000	700.50	804,174,000	
野村ホールディングス	2,421,300	660.10	1,598,300,130	
岡三証券グループ	114,000	690.00	78,660,000	
丸三証券	42,700	1,005.00	42,913,500	
東洋証券	48,000	316.00	15,168,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	154,000	725.00	111,650,000	
光世証券	3,200	1,503.00	4,809,600	貸付有価証券 1,500株
水戸証券	41,600	412.00	17,139,200	
いちよし証券	28,100	1,289.00	36,220,900	
松井証券	65,700	951.00	62,480,700	貸付有価証券 1,100株(1,000株)

だいこう証券ビジネス	6,500	738.00	4,797,000	
マネックスグループ	142,200	317.00	45,077,400	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
カブドットコム証券	85,800	355.00	30,459,000	貸付有価証券 6,800株
極東証券	18,000	1,632.00	29,376,000	
岩井コスモホールディングス	13,700	1,435.00	19,659,500	
藍澤証券	25,100	758.00	19,025,800	
マネーパートナーズグループ	17,100	406.00	6,942,600	貸付有価証券 8,400株
小林洋行	3,800	285.00	1,083,000	貸付有価証券 300株
かんぼ生命保険	50,700	2,645.00	134,101,500	貸付有価証券 500株（500株）
SOMPOホールディングス	263,100	4,428.00	1,165,006,800	
アニコムホールディングス	9,100	3,635.00	33,078,500	貸付有価証券 2,400株
MS&ADインシュアランスグループホール	350,800	3,825.00	1,341,810,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	110,200	2,010.00	221,502,000	
第一生命ホールディングス	758,900	2,355.50	1,787,588,950	
東京海上ホールディングス	505,400	5,164.00	2,609,885,600	
T&Dホールディングス	414,900	1,957.00	811,959,300	
アドバンスクリエイト	3,100	1,945.00	6,029,500	
全国保証	37,800	4,940.00	186,732,000	貸付有価証券 17,400株
クレディセゾン	101,800	2,033.00	206,959,400	
アクリーティブ	7,300	368.00	2,686,400	貸付有価証券 3,500株（100株）
芙蓉総合リース	15,300	7,520.00	115,056,000	
興銀リース	25,200	2,856.00	71,971,200	
東京センチュリー	27,000	5,480.00	147,960,000	
日本証券金融	54,900	624.00	34,257,600	貸付有価証券 7,200株
アイフル	225,100	383.00	86,213,300	貸付有価証券 105,700株

ポケットカード	3,300	1,067.00	3,521,100	貸付有価証券 1,200株（900株）
リコーリース	10,600	3,900.00	41,340,000	貸付有価証券 2,100株
イオンフィナンシャル サービス	95,200	2,653.00	252,565,600	貸付有価証券 19,000株（800株）
アコム	269,600	467.00	125,903,200	貸付有価証券 130,800株
ジャックス	16,300	2,578.00	42,021,400	貸付有価証券 600株
オリエントコーポレー ション	290,300	178.00	51,673,400	貸付有価証券 140,800株
日立キャピタル	36,900	2,841.00	104,832,900	
アプラスフィナンシャル	64,400	111.00	7,148,400	貸付有価証券 31,400株
オリックス	894,700	1,913.50	1,712,008,450	
三菱UFJリース	340,500	677.00	230,518,500	
日本取引所グループ	394,200	2,007.00	791,159,400	貸付有価証券 200株（200株）
イー・ギャランティ	3,600	3,510.00	12,636,000	貸付有価証券 1,400株
アサックス	1,900	1,900.00	3,610,000	
NECキャピタルソ リューション	5,500	2,247.00	12,358,500	
いちご	191,600	414.00	79,322,400	貸付有価証券 84,800株
日本駐車場開発	161,800	193.00	31,227,400	
ヒューリック	280,000	1,290.00	361,200,000	貸付有価証券 36,900株
三栄建築設計	5,400	2,532.00	13,672,800	貸付有価証券 500株
スター・マイカ	4,900	1,725.00	8,452,500	貸付有価証券 200株（100株）
野村不動産ホールディン グス	89,200	2,547.00	227,192,400	
三重交通グループホール ディングス	27,200	486.00	13,219,200	貸付有価証券 2,400株（1,200株）
サムティ	11,400	1,679.00	19,140,600	貸付有価証券 5,400株（3,000株）
ディア・ライフ	13,400	672.00	9,004,800	貸付有価証券 800株（400株）

コーセーアールイー	2,200	1,339.00	2,945,800	貸付有価証券 1,000株
エー・ディー・ワークス	177,800	42.00	7,467,600	貸付有価証券 83,900株
日本商業開発	7,500	1,680.00	12,600,000	貸付有価証券 2,200株
プレサンスコーポレーション	18,400	1,506.00	27,710,400	
ユニゾホールディングス	15,700	3,110.00	48,827,000	
THEグローバル社	6,300	856.00	5,392,800	貸付有価証券 3,000株
日本管理センター	8,800	1,653.00	14,546,400	貸付有価証券 1,400株（100株）
サンセイランディック	3,900	1,098.00	4,282,200	貸付有価証券 100株
エストラスト	1,800	1,148.00	2,066,400	貸付有価証券 300株
フージャースホールディングス	17,300	1,270.00	21,971,000	貸付有価証券 3,000株（300株）
オープンハウス	21,800	6,090.00	132,762,000	
東急不動産ホールディングス	324,700	818.00	265,604,600	
飯田グループホールディングス	111,900	2,130.00	238,347,000	貸付有価証券 5,100株（1,100株）
ムゲンエステート	8,200	1,143.00	9,372,600	貸付有価証券 400株（400株）
ファーストブラザーズ	3,700	1,175.00	4,347,500	貸付有価証券 1,700株
ハウズドゥ	2,200	2,496.00	5,491,200	貸付有価証券 1,000株
シーアールイー	2,100	1,506.00	3,162,600	
ケイアイスター不動産	4,800	2,992.00	14,361,600	
パーク24	74,400	2,768.00	205,939,200	貸付有価証券 9,600株（7,600株）
パラカ	4,300	2,546.00	10,947,800	
三井不動産	669,900	2,538.50	1,700,541,150	
三菱地所	998,500	1,967.00	1,964,049,500	
平和不動産	23,700	2,029.00	48,087,300	
東京建物	146,600	1,538.00	225,470,800	
ダイビル	34,500	1,395.00	48,127,500	
京阪神ビルディング	22,200	896.00	19,891,200	

住友不動産	322,000	3,777.00	1,216,194,000	
大京	21,400	2,166.00	46,352,400	
テーオーシー	46,200	965.00	44,583,000	貸付有価証券 1,700株
東京楽天地	2,200	6,010.00	13,222,000	
レオパレス21	160,100	911.00	145,851,100	
スターツコーポレーション	18,200	2,937.00	53,453,400	
フジ住宅	17,100	856.00	14,637,600	
空港施設	13,900	664.00	9,229,600	
明和地所	7,400	845.00	6,253,000	
ゴールドクレスト	10,600	2,274.00	24,104,400	
日本エスリード	5,200	2,435.00	12,662,000	
日神不動産	17,800	931.00	16,571,800	
日本エスコン	23,600	669.00	15,788,400	貸付有価証券 11,000株（4,700株）
タカラレーベン	62,800	486.00	30,520,800	貸付有価証券 28,000株（8,600株）
サンヨーハウジング名古屋	6,900	1,191.00	8,217,900	
イオンモール	86,400	2,209.00	190,857,600	
ファースト住建	5,000	1,751.00	8,755,000	
トーセイ	16,300	1,090.00	17,767,000	
穴吹興産	1,500	3,140.00	4,710,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	83,400	1,304.00	108,753,600	
サンフロンティア不動産	15,400	1,286.00	19,804,400	貸付有価証券 5,300株
エフ・ジェー・ネクスト	10,200	996.00	10,159,200	
インテリックス	4,100	1,055.00	4,325,500	
ランドビジネス	7,900	318.00	2,512,200	
グランディハウス	11,700	570.00	6,669,000	
日本空港ビルデング	39,200	4,215.00	165,228,000	貸付有価証券 16,400株
日本工営	8,700	3,480.00	30,276,000	
LIFULL	45,100	1,027.00	46,317,700	貸付有価証券 16,900株
ジェイエイシーリクルートメント	10,500	2,244.00	23,562,000	貸付有価証券 4,700株（500株）

日本M & A センター	45,000	5,490.00	247,050,000	
メンバーズ	3,200	747.00	2,390,400	
中広	1,300	750.00	975,000	貸付有価証券 200株（200株）
タケエイ	13,500	1,345.00	18,157,500	貸付有価証券 200株
トラスト・テック	5,700	3,370.00	19,209,000	貸付有価証券 200株（200株）
コシダカホールディングス	6,800	5,360.00	36,448,000	貸付有価証券 1,300株（1,000株）
パソナグループ	10,600	2,391.00	25,344,600	貸付有価証券 5,100株（1,600株）
C D S	3,500	1,389.00	4,861,500	貸付有価証券 200株
リンクアンドモチベーション	23,900	908.00	21,701,200	貸付有価証券 11,200株
G C A	14,700	1,169.00	17,184,300	貸付有価証券 1,700株（1,300株）
エス・エム・エス	25,700	3,595.00	92,391,500	貸付有価証券 12,100株
パーソルホールディングス	119,900	2,906.00	348,429,400	貸付有価証券 56,400株（9,700株）
リニカル	8,400	1,599.00	13,431,600	貸付有価証券 3,900株（1,000株）
クックパッド	40,700	610.00	24,827,000	貸付有価証券 19,100株（1,000株）
エスクリ	4,500	994.00	4,473,000	
アイ・ケイ・ケイ	7,600	790.00	6,004,000	
学情	5,900	1,905.00	11,239,500	貸付有価証券 2,700株（500株）
スタジオアリス	6,500	2,792.00	18,148,000	
シミックホールディングス	7,200	2,036.00	14,659,200	貸付有価証券 100株
N J S	3,200	1,555.00	4,976,000	
総合警備保障	51,700	6,260.00	323,642,000	
カカコム	99,900	1,907.00	190,509,300	貸付有価証券 48,400株
セントケア・ホールディング	5,500	828.00	4,554,000	
サイネックス	1,900	953.00	1,810,700	
ルネサンス	6,300	1,919.00	12,089,700	

ディップ	18,300	2,851.00	52,173,300	
オプトホールディング	9,100	1,235.00	11,238,500	貸付有価証券 4,300株
新日本科学	15,800	562.00	8,879,600	貸付有価証券 7,600株
ツクイ	30,600	1,016.00	31,089,600	貸付有価証券 3,700株
キャリアデザインセン ター	3,000	2,401.00	7,203,000	
エムスリー	136,700	3,970.00	542,699,000	貸付有価証券 8,300株
ツカダ・グローバルホー ルディング	10,300	627.00	6,458,100	
プラス	700	1,066.00	746,200	貸付有価証券 300株
アウトソーシング	38,700	2,019.00	78,135,300	貸付有価証券 18,500株
ウェルネット	10,600	1,173.00	12,433,800	貸付有価証券 4,900株（100株）
ワールドホールディング ス	4,300	3,655.00	15,716,500	貸付有価証券 2,000株（500株）
ディー・エヌ・エー	70,100	2,294.00	160,809,400	貸付有価証券 13,900株
博報堂DYホールディン グス	180,600	1,485.00	268,191,000	
ぐるなび	20,600	1,299.00	26,759,400	貸付有価証券 9,600株（100株）
エスアールジータカミヤ	15,400	668.00	10,287,200	貸付有価証券 900株
ジャパンベストレス キューシステム	16,100	724.00	11,656,400	貸付有価証券 100株
ファンコミュニケーション ズ	36,100	925.00	33,392,500	貸付有価証券 300株
ライク	5,100	2,600.00	13,260,000	貸付有価証券 2,400株
ビジネス・ブレイクス ルー	6,000	481.00	2,886,000	
WDBホールディングス	5,900	3,790.00	22,361,000	
ティア	6,800	1,088.00	7,398,400	貸付有価証券 500株（500株）
CDG	1,200	1,927.00	2,312,400	貸付有価証券 400株

バリューコマース	11,600	733.00	8,502,800	貸付有価証券 600株(300株)
インフォマート	65,700	662.00	43,493,400	貸付有価証券 26,000株(20,200株)
J Pホールディングス	40,800	314.00	12,811,200	貸付有価証券 19,100株
E P Sホールディングス	19,600	2,480.00	48,608,000	
レグス	3,200	918.00	2,937,600	貸付有価証券 1,500株
プレステージ・インター ナショナル	26,900	1,415.00	38,063,500	貸付有価証券 1,900株
アミューズ	8,700	3,140.00	27,318,000	
ドリームインキュベータ	4,300	2,255.00	9,696,500	貸付有価証券 400株
クイック	8,100	1,795.00	14,539,500	
T A C	7,800	346.00	2,698,800	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
ケネディクス	180,200	704.00	126,860,800	貸付有価証券 1,100株
電通	158,300	4,825.00	763,797,500	
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	6,100	1,149.00	7,008,900	貸付有価証券 1,000株
ぴあ	4,300	7,650.00	32,895,000	貸付有価証券 2,000株(300株)
イオンファンタジー	4,200	4,940.00	20,748,000	
シーティーエス	13,200	892.00	11,774,400	貸付有価証券 3,800株
ネクシィーズグループ	5,100	1,888.00	9,628,800	貸付有価証券 2,300株(1,900株)
みらかホールディングス	38,700	4,835.00	187,114,500	
アルプス技研	5,700	4,675.00	26,647,500	貸付有価証券 400株
ダイオーズ	2,600	1,437.00	3,736,200	
日本空調サービス	13,600	786.00	10,689,600	
オリエンタルランド	153,600	10,330.00	1,586,688,000	貸付有価証券 2,000株(900株)
ダスキン	35,000	3,015.00	105,525,000	
明光ネットワークジャ パン	16,400	1,354.00	22,205,600	
ファルコホールディング ス	6,700	1,793.00	12,013,100	

秀英予備校	2,800	478.00	1,338,400	
田谷	2,400	664.00	1,593,600	
ラウンドワン	40,300	1,909.00	76,932,700	
リゾートトラスト	55,000	2,593.00	142,615,000	
ビー・エム・エル	16,700	2,821.00	47,110,700	
ワタベウェディング	2,100	644.00	1,352,400	
りらいあコミュニケー ションズ	20,500	1,305.00	26,752,500	貸付有価証券 600株(600株)
リソー教育	22,000	935.00	20,570,000	貸付有価証券 7,800株
早稲田アカデミー	1,800	1,691.00	3,043,800	貸付有価証券 700株
ユー・エス・エス	158,700	2,467.00	391,512,900	
東京個別指導学院	4,600	986.00	4,535,600	貸付有価証券 2,200株(100株)
サイバーエージェント	85,400	4,385.00	374,479,000	貸付有価証券 41,100株
楽天	666,300	1,031.00	686,955,300	
クリーク・アンド・リ バー社	6,700	1,123.00	7,524,100	貸付有価証券 3,200株
テー・オー・ダブリュー	11,400	947.00	10,795,800	貸付有価証券 3,600株
セントラルスポーツ	4,800	4,300.00	20,640,000	
フルキャストホールディ ングス	11,400	2,217.00	25,273,800	貸付有価証券 3,500株
リソルホールディングス	1,400	4,600.00	6,440,000	
テクノプロ・ホールディ ングス	23,100	6,230.00	143,913,000	
アトラ	2,200	683.00	1,502,600	貸付有価証券 300株
インターワークス	2,900	1,170.00	3,393,000	
K e e P e r 技研	4,200	1,356.00	5,695,200	
ファーストロジック	1,000	1,949.00	1,949,000	貸付有価証券 400株(300株)
三機サービス	1,400	1,323.00	1,852,200	
デザインワン・ジャパン	2,500	1,378.00	3,445,000	貸付有価証券 1,200株(700株)
イー・ガーディアン	6,600	2,611.00	17,232,600	貸付有価証券 2,100株(400株)
リブセンス	8,300	480.00	3,984,000	貸付有価証券

				3,900株(2,900株)
ジャパンマテリアル	11,800	3,915.00	46,197,000	貸付有価証券 4,700株
ベクトル	15,600	1,658.00	25,864,800	貸付有価証券 3,200株
ウチヤマホールディングス	6,400	579.00	3,705,600	
ライクキッズネクスト	1,300	2,353.00	3,058,900	貸付有価証券 600株(300株)
キャリアリンク	4,200	545.00	2,289,000	貸付有価証券 1,500株
I B J	9,600	1,100.00	10,560,000	貸付有価証券 4,500株
アサンテ	4,700	1,904.00	8,948,800	
N・フィールド	7,300	1,535.00	11,205,500	貸付有価証券 3,400株
バリューHR	1,500	5,240.00	7,860,000	貸付有価証券 700株
M&Aキャピタルパートナーズ	2,500	7,640.00	19,100,000	貸付有価証券 1,200株(100株)
ライドオンエクスプレス ホールディングス	5,300	1,084.00	5,745,200	貸付有価証券 2,400株
E R Iホールディングス	3,600	910.00	3,276,000	貸付有価証券 900株
アビスト	1,800	5,570.00	10,026,000	貸付有価証券 600株(600株)
ウィルグループ	5,600	1,754.00	9,822,400	貸付有価証券 200株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	17,700	545.00	9,646,500	貸付有価証券 1,900株
日本ビューホテル	2,900	1,380.00	4,002,000	貸付有価証券 500株
リクルートホールディン グス	1,002,600	2,866.50	2,873,952,900	貸付有価証券 107,800株
エラン	3,100	1,356.00	4,203,600	貸付有価証券 1,300株(1,200株)
土木管理総合試験所	3,800	752.00	2,857,600	貸付有価証券 1,800株(1,600株)
日本郵政	737,500	1,283.00	946,212,500	
ベルシステム24ホール ディングス	21,700	1,378.00	29,902,600	貸付有価証券 6,300株
鎌倉新書	1,700	1,864.00	3,168,800	貸付有価証券

				800株
一蔵	1,600	1,111.00	1,777,600	
LITALICO	2,200	2,036.00	4,479,200	貸付有価証券 700株(400株)
グローバルグループ	1,400	1,716.00	2,402,400	貸付有価証券 600株
エポラブルアジア	2,700	2,232.00	6,026,400	貸付有価証券 1,300株(600株)
ストライク	1,200	5,050.00	6,060,000	貸付有価証券 500株(400株)
ソラスト	7,800	2,580.00	20,124,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
インソース	1,600	3,455.00	5,528,000	貸付有価証券 700株
リログループ	71,000	3,135.00	222,585,000	
東祥	8,100	3,620.00	29,322,000	貸付有価証券 2,600株(1,300株)
エイチ・アイ・エス	20,300	4,170.00	84,651,000	貸付有価証券 8,300株(2,000株)
ラックランド	2,500	2,218.00	5,545,000	貸付有価証券 1,100株
共立メンテナンス	23,100	4,510.00	104,181,000	貸付有価証券 11,000株
イチネンホールディングス	14,600	1,606.00	23,447,600	
建設技術研究所	9,000	1,175.00	10,575,000	
スペース	7,700	1,797.00	13,836,900	
燦ホールディングス	3,100	3,300.00	10,230,000	
スバル興業	900	7,510.00	6,759,000	
東京テアトル	5,400	1,470.00	7,938,000	
タナベ経営	2,500	1,700.00	4,250,000	
ナガワ	2,600	4,885.00	12,701,000	
よみうりランド	2,800	4,875.00	13,650,000	
東京都競馬	9,700	4,205.00	40,788,500	貸付有価証券 4,500株
常磐興産	5,200	1,863.00	9,687,600	貸付有価証券 2,000株
カナモト	19,800	3,560.00	70,488,000	
東京ドーム	52,600	1,120.00	58,912,000	貸付有価証券 1,100株

西尾レントオール	11,400	3,690.00	42,066,000	
トランス・コスモス	14,400	2,846.00	40,982,400	
乃村工藝社	30,400	2,602.00	79,100,800	
藤田観光	5,200	3,570.00	18,564,000	貸付有価証券 2,400株
KNT-CTホールディングス	8,100	1,749.00	14,166,900	
日本管財	13,900	2,094.00	29,106,600	
トーカイ	6,300	5,100.00	32,130,000	
白洋舎	1,500	4,670.00	7,005,000	貸付有価証券 700株
セコム	137,900	8,578.00	1,182,906,200	
セントラル警備保障	6,300	2,521.00	15,882,300	貸付有価証券 2,900株
丹青社	26,600	1,323.00	35,191,800	貸付有価証券 3,100株（500株）
メイテック	15,200	5,970.00	90,744,000	
アサツー ディ・ケイ	24,700	3,650.00	90,155,000	貸付有価証券 400株
応用地質	14,600	1,480.00	21,608,000	貸付有価証券 200株
船井総研ホールディングス	18,000	3,935.00	70,830,000	貸付有価証券 200株
進学会ホールディングス	5,900	683.00	4,029,700	
オオバ	11,000	515.00	5,665,000	
いであ	2,600	1,162.00	3,021,200	
学究社	3,500	1,636.00	5,726,000	
ベネッセホールディングス	47,600	4,050.00	192,780,000	
イオンディライト	16,000	4,255.00	68,080,000	
ナック	8,700	973.00	8,465,100	
ニチイ学館	24,700	1,425.00	35,197,500	貸付有価証券 5,400株（5,400株）
ダイセキ	21,800	3,110.00	67,798,000	
ステップ	4,800	1,784.00	8,563,200	
小計	銘柄数：2,023		354,732,313,120	
	組入時価比率：98.6%		100.0%	
合計			354,732,313,120	

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成29年12月26日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年12月26日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	5,032,868,152	-	5,133,870,000	100,865,282
合計	5,032,868,152	-	5,133,870,000	100,865,282

(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29年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	3,118,535,167
コール・ローン	359,239,352
株式	457,698,952,510
投資信託受益証券	23,661,272
投資証券	11,693,634,764
派生商品評価勘定	31,921,296
未収入金	769,059
未収配当金	396,302,876
差入委託証拠金	1,480,798,288
流動資産合計	474,803,814,584
資産合計	474,803,814,584
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,430,620
未払解約金	134,998,421

(平成29年12月26日現在)

未払利息	413
その他未払費用	4,348,000
流動負債合計	146,777,454
負債合計	146,777,454
純資産の部	
元本等	
元本	177,618,827,888
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	297,038,209,242
元本等合計	474,657,037,130
純資産合計	474,657,037,130
負債純資産合計	474,803,814,584

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>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>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>(株式、投資証券)</p> <p>受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(投資信託受益証券)</p> <p>受取配当金は、投資信託受益証券の収益分配金を、原則として収益分配金落の売買が行なわれる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>配当株式</p> <p>配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月26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	2.6723円
(10,000口当たり純資産額)	(26,723円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月26日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年12月26日現在	
期首	平成28年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	157,289,751,923円
同期中における追加設定元本額	45,305,432,363円
同期中における一部解約元本額	24,976,356,398円
期末元本額	177,618,827,888円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	52,293,469円
バランスセレクト50	160,987,657円
バランスセレクト70	169,949,409円
野村外国株式インデックスファンド	546,058,869円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,585,191,053円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	6,978,723,808円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	4,538,241,756円
野村資産設計ファンド2015	22,023,697円
野村資産設計ファンド2020	25,361,107円
野村資産設計ファンド2025	36,438,588円
野村資産設計ファンド2030	38,414,706円
野村資産設計ファンド2035	28,614,933円
野村資産設計ファンド2040	75,490,173円
野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	33,746,395,809円
のむラップ・ファンド（保守型）	945,798,748円
のむラップ・ファンド（普通型）	5,545,300,885円
のむラップ・ファンド（積極型）	4,121,461,290円
野村資産設計ファンド2045	8,596,988円
野村インデックスファンド・外国株式	2,863,668,166円
マイ・ロード	1,428,033,270円
ネクストコア	111,196,223円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	88,309,838円

野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	864,271,605円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,081,307,472円
野村資産設計ファンド2050	12,101,974円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,092,395円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,245,960円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	883,568円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	546,327円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	143,236,485円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	179,599,068円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,997,001円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,143,838円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,291,354円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,752,522円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,512,744円
野村6資産均等バランス	154,219円
野村つみたて外国株投信	145,568,318円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	333,556円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	61,273,986円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	269,943,701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)	354,088,868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)	321,999,402円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	2,746,957,093円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,799,658,480円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,331,482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)	13,098,744円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	4,129,402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)	51,230,357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)	603,734,433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)	412,331,813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)	163,084,328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)	51,603,009円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	210,099,410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)	3,775,889,291円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	448,408,262円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,355,759,482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)	394,234,628円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	5,121,182,486円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,263,497円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	12,756,004円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	12,865,539円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	58,975,420,715円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,293,301,788円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,406,817,899円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,128,766,225円
マイバランスDC30	850,845,530円

マイバランスDC50	1,505,006,789円
マイバランスDC70	1,211,575,627円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	15,697,594,839円
野村DC運用戦略ファンド	642,652,274円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	19,107,349円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	102,988,568円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	7,194,028円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	14,797,607円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	247,687円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	203,209円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	510,935円
野村資産設計ファンド（DC）2030	67,778円
野村資産設計ファンド（DC）2040	96,638円
野村資産設計ファンド（DC）2050	119,858円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年12月26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, A GE CO, LLC	43,800	32.23	1,411,674.00	
		HALLIBURTON CO	97,700	48.01	4,690,577.00	
		HELMERICH & PAYNE	12,800	64.32	823,296.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	41,200	35.44	1,460,128.00	
		SCHLUMBERGER LTD	155,400	67.44	10,480,176.00	
		TECHNIPFMC PLC	48,300	31.15	1,504,545.00	
		ANADARKO PETE	63,300	52.93	3,350,469.00	
		ANDEAVOR	16,400	112.18	1,839,752.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	21,800	18.59	405,262.00	
		APACHE CORPORATION	43,900	42.91	1,883,749.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	53,300	27.59	1,470,547.00	
		CHENIERE ENERGY INC	22,200	53.00	1,176,600.00	
		CHEVRON CORP	213,700	124.98	26,708,226.00	
		CIMAREX ENERGY CO	10,600	119.95	1,271,470.00	
		CONCHO RESOURCES INC	16,300	151.77	2,473,851.00	
CONOCOPHILLIPS	136,000	55.50	7,548,000.00			

CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	9,400	51.90	487,860.00	
DEVON ENERGY CORP	57,300	41.57	2,381,961.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	9,400	124.37	1,169,078.00	
EOG RESOURCES INC	64,700	107.11	6,930,017.00	
EQT CORP	28,200	54.77	1,544,514.00	
EXXON MOBIL CORP	477,500	83.97	40,095,675.00	
HESS CORP	31,900	47.01	1,499,619.00	
HOLLYFRONTIER CORP	19,700	50.62	997,214.00	
KINDER MORGAN INC	226,000	18.05	4,079,300.00	
MARATHON OIL CORP	93,000	16.90	1,571,700.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	56,600	66.36	3,755,976.00	
NEWFIELD EXPLORATION CO	22,900	31.46	720,434.00	
NOBLE ENERGY INC	51,800	28.79	1,491,322.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	85,800	72.99	6,262,542.00	
ONEOK INC	43,600	53.21	2,319,956.00	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	26,100	29.54	770,994.00	
PHILLIPS 66	49,300	100.89	4,973,877.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,200	171.12	3,285,504.00	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	14,000	21.97	307,580.00	
RANGE RESOURCES CORP	24,500	16.46	403,270.00	
TARGA RESOURCES CORP	24,900	47.19	1,175,031.00	
VALERO ENERGY CORP	50,400	91.13	4,592,952.00	
WILLIAMS COS	93,500	30.31	2,833,985.00	
AIR PRODUCTS	24,500	163.42	4,003,790.00	
ALBEMARLE CORP	12,200	129.29	1,577,338.00	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	24,900	31.99	796,551.00	
CELANESE CORP-SERIES A	15,500	106.54	1,651,370.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	26,400	41.71	1,101,144.00	
CHEMOURS CO/THE	20,600	49.02	1,009,812.00	
DOWDUPONT INC	263,300	72.11	18,986,563.00	
EASTMAN CHEMICAL CO.	16,000	92.65	1,482,400.00	
ECOLAB INC	29,400	133.97	3,938,718.00	
FMC CORP	14,800	95.46	1,412,808.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	8,700	152.51	1,326,837.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	38,600	109.98	4,245,228.00	

MONSANTO CO	49,300	116.28	5,732,604.00
MOSAIC CO/THE	34,800	25.52	888,096.00
PPG INDUSTRIES	28,900	116.19	3,357,891.00
PRAXAIR INC	32,100	153.84	4,938,264.00
SHERWIN-WILLIAMS	9,450	413.09	3,903,700.50
WR GRACE & CO	6,700	70.26	470,742.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,980	211.10	1,473,478.00
VULCAN MATERIALS CO	14,500	124.23	1,801,335.00
AVERY DENNISON CORP	9,900	114.17	1,130,283.00
BALL CORP	36,800	37.97	1,397,296.00
CROWN HOLDINGS INC	14,500	56.15	814,175.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	44,500	57.98	2,580,110.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	10,900	120.09	1,308,981.00
SEALED AIR CORP	21,900	49.09	1,075,071.00
WESTROCK CO	29,200	63.73	1,860,916.00
FREEMONT-MCMORAN INC	157,000	18.10	2,841,700.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	61,200	36.92	2,259,504.00
NUCOR CORP	36,600	64.56	2,362,896.00
STEEL DYNAMICS	27,100	43.26	1,172,346.00
ARCONIC INC	44,100	26.83	1,183,203.00
BOEING CO	63,360	295.10	18,697,536.00
GENERAL DYNAMICS	28,790	202.64	5,834,005.60
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,120	237.44	1,215,692.80
L3 TECHNOLOGIES INC	9,000	197.70	1,779,300.00
LOCKHEED MARTIN	29,310	318.03	9,321,459.30
NORTHROP GRUMMAN CORP	18,630	303.78	5,659,421.40
RAYTHEON COMPANY	32,900	187.31	6,162,499.00
ROCKWELL COLLINS INC	18,400	135.09	2,485,656.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	13,200	86.72	1,144,704.00
TEXTRON INC	29,400	56.76	1,668,744.00
TRANSDIGM GROUP INC	5,730	270.65	1,550,824.50
UNITED TECHNOLOGIES	85,800	127.23	10,916,334.00
ALLEGION PLC	10,800	80.34	867,672.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	17,100	68.53	1,171,863.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	105,600	38.11	4,024,416.00

PLC				
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,500	205.65	925,425.00	
MASCO CORP	35,700	43.83	1,564,731.00	
OWENS CORNING INC	12,400	91.20	1,130,880.00	
SMITH (A.O.) CORP	16,500	61.26	1,010,790.00	
FLUOR CORP	16,400	51.07	837,548.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,100	66.28	934,548.00	
ACUITY BRANDS INC	5,000	172.18	860,900.00	
AMETEK INC	25,300	72.60	1,836,780.00	
EATON CORP PLC	50,400	77.51	3,906,504.00	
EMERSON ELEC	72,500	69.66	5,050,350.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,600	194.57	2,840,722.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	19,400	51.28	994,832.00	
3M CORP	67,360	234.73	15,811,412.80	
GENERAL ELEC CO	977,000	17.50	17,097,500.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	81,600	153.49	12,524,784.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	23,900	61.19	1,462,441.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	24,300	39.37	956,691.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,530	259.53	2,992,380.90	
AGCO CORP	6,300	72.94	459,522.00	
CATERPILLAR INC DEL	66,100	155.75	10,295,075.00	
CUMMINS INC	18,000	175.76	3,163,680.00	
DEERE & COMPANY	30,500	157.53	4,804,665.00	
DOVER CORP	16,900	100.46	1,697,774.00	
FLOWSERVE CORP	15,000	41.39	620,850.00	
FORTIVE CORP	35,300	72.47	2,558,191.00	
IDEX CORP	8,500	132.07	1,122,595.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	35,100	167.13	5,866,263.00	
INGERSOLL-RAND PLC	27,900	89.77	2,504,583.00	
MIDDLEBY CORP	6,500	132.04	858,260.00	
PACCAR	39,700	71.00	2,818,700.00	
PARKER HANNIFIN CORP	15,100	199.25	3,008,675.00	
PENTAIR PLC	18,900	69.73	1,317,897.00	
SNAP-ON INC	6,700	174.70	1,170,490.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,300	167.46	2,897,058.00	
WABCO HOLDINGS INC	6,000	143.81	862,860.00	

WABTEC CORP	9,000	79.63	716,670.00
XYLEM INC	20,600	67.58	1,392,148.00
AERCAP HOLDINGS NV	16,900	53.06	896,714.00
FASTENAL CO	32,000	54.05	1,729,600.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,200	234.84	1,456,008.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	39.37	901,573.00
UNITED RENTALS INC	9,400	169.49	1,593,206.00
CINTAS CORP	10,000	156.85	1,568,500.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	26,000	66.93	1,740,180.00
ROLLINS INC	9,700	46.45	450,565.00
STERICYCLE INC	8,900	68.31	607,959.00
WASTE CONNECTIONS INC	30,300	71.34	2,161,602.00
WASTE MANAGEMENT INC	50,000	85.91	4,295,500.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	15,500	88.70	1,374,850.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	19,700	64.77	1,275,969.00
FEDEX CORPORATION	28,570	250.02	7,143,071.40
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	77,100	118.64	9,147,144.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,500	52.59	657,375.00
DELTA AIR LINES INC	20,100	56.03	1,126,203.00
SOUTHWEST AIRLINES	17,600	65.97	1,161,072.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,600	67.25	511,100.00
AMERCO	680	379.27	257,903.60
CSX CORP	103,500	55.00	5,692,500.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	9,800	114.53	1,122,394.00
KANSAS CITY SOUTHERN	11,800	108.19	1,276,642.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	14,300	44.35	634,205.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	32,600	144.52	4,711,352.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,900	132.68	915,492.00
UNION PAC CORP	90,400	134.47	12,156,088.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	9,500	63.85	606,575.00
APTIV PLC	30,300	84.79	2,569,137.00
AUTOLIV INC	9,700	127.72	1,238,884.00
BORGWARNER INC	23,600	51.71	1,220,356.00

GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	28,300	32.85	929,655.00	
LEAR CORP	7,700	177.69	1,368,213.00	
FORD MOTOR COMPANY	420,000	12.58	5,283,600.00	
GENERAL MOTORS CO	147,000	42.02	6,176,940.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	19,400	51.84	1,005,696.00	
TESLA INC	15,150	325.20	4,926,780.00	
DR HORTON INC	39,400	50.83	2,002,702.00	
GARMIN LTD	13,300	59.18	787,094.00	
LEGGETT & PLATT INC	13,400	47.06	630,604.00	
LENNAR CORP-A	22,600	64.00	1,446,400.00	
MOHAWK INDUSTRIES	7,260	276.46	2,007,099.60	
NEWELL BRANDS INC	56,500	30.67	1,732,855.00	
NVR INC	396	3,480.00	1,378,080.00	
PULTEGROUP INC	33,000	33.37	1,101,210.00	
TOLL BROTHERS INC	16,300	47.29	770,827.00	
WHIRLPOOL CORP	8,200	171.68	1,407,776.00	
HASBRO INC	12,600	93.54	1,178,667.00	
MATTEL INC	40,000	15.84	633,600.00	
POLARIS INDUSTRIES INC	6,200	125.22	776,364.00	
HANESBRANDS INC	37,700	20.41	769,457.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,600	78.48	831,888.00	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,100	63.40	1,020,740.00	
NIKE INC-B	148,400	63.29	9,392,236.00	
PVH CORP	9,000	135.60	1,220,400.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	5,800	101.80	590,440.00	
TAPESTRY INC	30,500	44.38	1,353,590.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	18,400	15.50	285,200.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	18,700	13.80	258,060.00	
V F CORP	37,800	73.87	2,792,286.00	
ARAMARK	28,600	42.80	1,224,080.00	
CARNIVAL CORP	39,400	66.35	2,614,190.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,890	295.23	853,214.70	
DARDEN RESTAURANTS INC	14,300	96.40	1,378,520.00	
DOMINOS PIZZA INC	5,270	192.87	1,016,424.90	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	22,000	79.35	1,745,700.00	

LAS VEGAS SANDS CORP	44,800	69.74	3,124,352.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	36,200	133.97	4,849,714.00
MCDONALD'S CORP	91,400	171.42	15,667,788.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	28,300	28.46	805,418.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	49,800	33.34	1,660,332.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	20,000	54.03	1,080,600.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,500	121.06	2,360,670.00
STARBUCKS CORP	163,300	57.30	9,357,090.00
VAIL RESORTS INC	4,470	215.17	961,809.90
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,900	113.58	1,351,602.00
WYNN RESORTS LTD	9,100	167.75	1,526,525.00
YUM BRANDS INC	36,100	82.40	2,974,640.00
CBS CORP-CL B	40,000	60.17	2,406,800.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	21,670	338.20	7,328,794.00
COMCAST CORP-CL A	530,600	40.78	21,637,868.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	14,300	23.73	339,339.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,200	22.47	476,364.00
DISH NETWORK CORP-A	25,100	48.53	1,218,103.00
DISNEY (WALT) CO	174,200	108.67	18,930,314.00
INTERPUBRIC GROUP	44,300	20.39	903,277.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	12,400	85.19	1,056,356.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,600	33.88	2,188,648.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	35.52	852,480.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,400	34.37	769,888.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	19,700	39.60	780,120.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	9,870	39.77	392,529.90
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	16,100	42.07	677,327.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	46,000	16.42	755,320.00
OMNICOM GROUP	25,300	73.61	1,862,333.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	9,100	85.35	776,685.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	182,000	5.37	977,340.00
TIME WARNER INC	87,100	92.38	8,046,298.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	118,800	35.24	4,186,512.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	47,800	34.72	1,659,616.00
VIACOM INC-CLASS B	37,800	32.23	1,218,294.00

GENUINE PARTS CO	16,100	95.11	1,531,271.00
LKQ CORP	33,700	40.82	1,375,634.00
AMAZON.COM INC	46,010	1,168.36	53,756,243.60
EXPEDIA INC	14,400	120.18	1,730,592.00
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	47,900	26.18	1,254,022.00
NETFLIX INC	48,300	189.94	9,174,102.00
PRICELINE GROUP INC/THE	5,550	1,775.26	9,852,693.00
TRIPADVISOR INC	12,300	34.57	425,211.00
DOLLAR GENERAL CORP	31,200	92.91	2,898,792.00
DOLLAR TREE INC	26,800	109.46	2,933,528.00
KOHL'S CORP	19,600	53.66	1,051,736.00
MACYS INC	35,900	25.67	921,553.00
NORDSTROM INC	12,700	47.54	603,758.00
TARGET CORP	59,100	65.39	3,864,549.00
ADVANCE AUTO PARTS	8,300	100.55	834,565.00
AUTONATION INC	7,100	51.54	365,934.00
AUTOZONE	3,100	710.09	2,201,279.00
BEST BUY COMPANY INC	30,500	67.11	2,046,855.00
CARMAX INC	20,400	65.23	1,330,692.00
GAP INC	27,100	34.44	933,324.00
HOME DEPOT	132,900	188.13	25,002,477.00
L BRANDS, INC	27,000	61.36	1,656,720.00
LOWES COS INC	94,300	91.19	8,599,217.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,880	242.50	2,395,900.00
ROSS STORES INC	44,300	80.44	3,563,492.00
TIFFANY & CO	13,900	102.84	1,429,476.00
TJX COS INC	72,300	76.25	5,512,875.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	14,900	74.48	1,109,752.00
ULTA BEAUTY INC	6,510	226.27	1,473,017.70
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	49,100	186.63	9,163,533.00
CVS HEALTH CORP	115,000	73.41	8,442,150.00
KROGER CO	100,900	28.25	2,850,425.00
SYSCO CORP	57,400	60.72	3,485,328.00
WAL-MART STORES INC	168,600	98.21	16,558,206.00
	103,000	72.71	7,489,130.00

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC				
BROWN-FORMAN CORP-CL B	22,800	67.79	1,545,612.00	
COCA COLA CO	457,100	45.59	20,839,189.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	24,300	39.40	957,420.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	19,300	223.81	4,319,533.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	20,200	96.12	1,941,624.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	20,400	81.10	1,654,440.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	45,400	63.77	2,895,158.00	
PEPSICO INC	160,800	118.60	19,070,880.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	64,400	40.19	2,588,236.00	
BUNGE LIMITED	15,600	66.74	1,041,144.00	
CAMPBELL SOUP CO	19,100	48.77	931,507.00	
CONAGRA BRANDS INC	47,200	38.08	1,797,376.00	
GENERAL MILLS	65,000	60.13	3,908,450.00	
HERSHEY CO/THE	16,600	114.95	1,908,170.00	
HORMEL FOODS CORP	32,800	36.73	1,204,744.00	
INGREDION INC	8,400	140.57	1,180,788.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,600	125.22	1,577,772.00	
KELLOGG CO	28,400	68.10	1,934,040.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	68,400	78.24	5,351,616.00	
MCCORMICK & CO INC.	13,900	101.92	1,416,688.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	170,700	43.36	7,401,552.00	
TYSON FOODS INC-CL A	32,700	80.62	2,636,274.00	
ALTRIA GROUP INC	216,600	72.14	15,625,524.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	175,200	104.65	18,334,680.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	28,700	50.05	1,436,435.00	
CLOROX CO	14,100	149.52	2,108,232.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	94,800	75.15	7,124,220.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	39,900	120.66	4,814,334.00	
PROCTER & GAMBLE CO	287,500	92.13	26,487,375.00	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,600	114.11	296,686.00	
COTY INC-CL A	55,000	19.93	1,096,150.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	25,300	127.75	3,232,075.00	
ABBOTT LABORATORIES	196,300	56.93	11,175,359.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,400	223.12	1,874,208.00	

BARD (C R)	8,190	332.28	2,721,373.20
BAXTER INTERNATIONAL INC.	55,200	64.72	3,572,544.00
BECTON,DICKINSON	25,530	217.23	5,545,881.90
BOSTON SCIENTIFIC CORP	156,100	25.10	3,918,110.00
DANAHER CORP	70,100	93.46	6,551,546.00
DENTSPLY SIRONA INC	25,300	65.82	1,665,246.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,100	112.49	2,711,009.00
HOLOGIC INC	31,100	43.37	1,348,807.00
IDEXX LABORATORIES INC	9,600	157.65	1,513,440.00
INTUITIVE SURGICAL INC	12,430	363.16	4,514,078.80
MEDTRONIC PLC	153,500	81.54	12,516,390.00
RESMED INC	15,700	85.11	1,336,227.00
STRYKER CORP	37,800	154.14	5,826,492.00
TELEFLEX INC	4,920	249.44	1,227,244.80
THE COOPER COMPANIES, INC.	5,630	219.80	1,237,474.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,700	110.91	1,186,737.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,900	120.12	2,750,748.00
AETNA INC	37,200	179.96	6,694,512.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,100	92.46	1,673,526.00
ANTHEM INC	29,730	225.60	6,707,088.00
CARDINAL HEALTH INC	36,300	62.49	2,268,387.00
CENTENE CORP	19,800	102.16	2,022,768.00
CIGNA CORP	28,090	203.39	5,713,225.10
DAVITA INC	17,500	71.98	1,259,650.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	11,600	34.38	398,808.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	64,300	74.53	4,792,279.00
HCA HEALTHCARE INC	31,800	89.09	2,833,062.00
HENRY SCHEIN INC	17,400	71.01	1,235,574.00
HUMANA INC	16,250	245.00	3,981,250.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,100	160.72	1,783,992.00
MCKESSON CORP	23,800	158.44	3,770,872.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	15,300	99.24	1,518,372.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	109,040	220.00	23,988,800.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9,800	115.06	1,127,588.00
ABBVIE INC	179,900	98.21	17,667,979.00

ALEXION PHARMACEUTICALS INC	25,400	118.78	3,017,012.00	
ALKERMES PLC	17,400	53.04	922,896.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,900	123.96	1,227,204.00	
AMGEN INC	82,400	176.42	14,537,008.00	
BIOGEN INC	23,930	319.50	7,645,635.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,200	90.46	1,827,292.00	
CELGENE CORP	87,500	106.33	9,303,875.00	
GILEAD SCIENCES INC	147,600	72.71	10,731,996.00	
INCYTE CORP	19,800	95.81	1,897,038.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,830	381.00	3,364,230.00	
SEATTLE GENETICS INC	11,500	53.43	614,445.00	
TESARO INC	3,700	80.68	298,516.00	
UNITED THERAPEUTICS CORP	5,200	137.25	713,700.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	28,000	149.97	4,199,160.00	
ALLERGAN PLC	37,900	164.90	6,249,710.00	
BRISTOL MYERS SQUIBB	185,300	60.96	11,295,888.00	
ELI LILLY & CO.	110,800	85.07	9,425,756.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,000	132.78	929,460.00	
JOHNSON & JOHNSON	302,500	140.12	42,386,300.00	
MERCK & CO INC	307,800	56.36	17,347,608.00	
MYLAN NV	52,400	42.05	2,203,420.00	
PERRIGO CO PLC	14,200	87.01	1,235,542.00	
PFIZER INC	670,700	36.14	24,239,098.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	105,000	18.75	1,968,750.00	
ZOETIS INC	55,300	71.99	3,981,047.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,129,800	29.88	33,758,424.00	
BB&T CORPORATION	91,300	50.45	4,606,085.00	
CIT GROUP INC	16,400	50.35	825,740.00	
CITIGROUP	307,300	75.49	23,198,077.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55,000	42.63	2,344,650.00	
COMERICA INC	19,100	87.74	1,675,834.00	
EAST WEST BANCORP INC	16,200	61.81	1,001,322.00	
FIFTH THIRD BANCORP	85,000	30.84	2,621,400.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	17,300	87.20	1,508,560.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	118,000	14.78	1,744,040.00	

JPMORGAN CHASE & CO	396,600	107.45	42,614,670.00
KEYCORP	124,000	20.44	2,534,560.00
M & T BANK CORP	15,700	173.07	2,717,199.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	35,400	18.91	669,591.00
PNC FINANCIAL	54,200	146.12	7,919,704.00
REGIONS FINANCIAL CORP	137,000	17.47	2,393,390.00
SIGNATURE BANK	5,700	139.11	792,927.00
SUNTRUST BKS INC.	54,700	65.76	3,597,072.00
SVB FINANCIAL GROUP	5,900	241.70	1,426,030.00
US BANCORP	189,100	54.46	10,298,386.00
WELLS FARGO CO	531,600	61.55	32,719,980.00
ZIONS BANCORPORATION	22,600	51.33	1,160,058.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	142,900	197.92	28,282,768.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,600	26.21	959,286.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	51.14	1,109,738.00
AFLAC INC	44,700	87.21	3,898,287.00
ALLEGHANY CORP	1,720	589.86	1,014,559.20
ALLSTATE CORP	41,100	104.11	4,278,921.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,400	108.36	910,224.00
AMERICAN INTL GROUP	101,300	59.31	6,008,103.00
AON PLC	29,500	133.35	3,933,825.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,500	89.71	1,300,795.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	19,900	62.60	1,245,740.00
ASSURANT INC	6,300	101.03	636,489.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	11,400	51.82	590,748.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,500	50.06	425,510.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	8,463	59.54	503,887.02
CHUBB LTD	52,700	145.20	7,652,040.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,000	73.99	1,257,830.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,560	218.95	998,412.00
FNF GROUP	29,900	39.07	1,168,193.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	40,200	55.55	2,233,110.00
LINCOLN NATIONAL CORP	24,400	77.75	1,897,100.00
LOEWS CORP	31,100	49.66	1,544,426.00
MARKEL CORP	1,530	1,126.69	1,723,835.70

MARSH & MCLENNAN COS	57,900	80.69	4,671,951.00
METLIFE INC	102,500	50.76	5,202,900.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31,600	71.26	2,251,816.00
PROGRESSIVE CO	65,600	56.09	3,679,504.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	48,400	116.16	5,622,144.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	7,200	155.07	1,116,504.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,200	125.83	528,486.00
TORCHMARK CORP	12,500	90.69	1,133,625.00
TRAVELERS COS INC/THE	30,600	134.39	4,112,334.00
UNUM GROUP	25,000	54.79	1,369,750.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,000	151.74	2,124,360.00
WR BERKLEY CORP	11,500	70.90	815,350.00
XL GROUP LTD	29,000	35.17	1,019,930.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	19,100	65.45	1,250,095.00
ALPHABET INC-CL A	33,590	1,068.86	35,903,007.40
ALPHABET INC-CL C	35,270	1,060.12	37,390,432.40
COSTAR GROUP INC	4,110	299.79	1,232,136.90
EBAY INC	115,700	37.76	4,368,832.00
FACEBOOK INC-A	267,100	177.20	47,330,120.00
IAC/INTERACTIVE CORP	8,200	126.97	1,041,154.00
MERCADOLIBRE INC	4,700	314.83	1,479,701.00
TWITTER INC	70,000	24.46	1,712,200.00
VERISIGN INC	10,100	113.99	1,151,299.00
ZILLOW GROUP INC - C	10,900	42.34	461,506.00
ACCENTURE PLC-CL A	69,800	153.89	10,741,522.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,480	251.99	1,380,905.20
AUTOMATIC DATA PROCESS	50,400	116.88	5,890,752.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	13,000	90.95	1,182,350.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	66,200	71.70	4,746,540.00
DXC TECHNOLOGY CO	32,000	95.89	3,068,480.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	37,300	94.32	3,518,136.00
FIRST DATA CORP- CLASS A	49,000	16.62	814,380.00
FISERV INC	24,000	130.32	3,127,680.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,200	190.46	1,942,692.00
GARTNER INC	10,000	123.59	1,235,900.00

GLOBAL PAYMENTS INC	16,800	100.36	1,686,048.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	99,900	152.50	15,234,750.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,800	116.84	1,028,192.00
LEIDOS HOLDINGS INC	16,100	65.22	1,050,042.00
MASTERCARD INC	106,600	150.85	16,080,610.00
PAYCHEX INC	35,400	68.27	2,416,758.00
PAYPAL HOLDINGS INC	127,700	73.89	9,435,753.00
SABRE CORP	26,000	20.76	539,760.00
SQUARE INC - A	28,100	35.14	987,434.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	18,300	78.80	1,442,040.00
VANTIV INC - CL A	17,900	74.36	1,331,044.00
VISA INC-CLASS A SHARES	206,300	112.69	23,247,947.00
WESTERN UNION CO	52,800	19.08	1,007,424.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	80,500	64.51	5,193,055.00
ADOBE SYSTEMS INC.	55,800	175.00	9,765,000.00
ANSYS INC	9,300	146.66	1,363,938.00
AUTODESK INC.	22,700	103.89	2,358,303.00
CA INC	34,800	33.52	1,166,496.00
CADENCE DESIGN SYS INC	32,100	42.26	1,356,546.00
CDK GLOBAL INC	14,600	71.34	1,041,564.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	14,200	101.92	1,447,264.00
CITRIX SYSTEMS INC	17,300	87.88	1,520,324.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	23,300	82.08	1,912,464.00
ELECTRONIC ARTS	35,100	106.02	3,721,302.00
FORTINET INC	17,000	43.92	746,640.00
INTUIT INC	27,400	158.50	4,342,900.00
MICROSOFT CORP	824,300	85.51	70,485,893.00
ORACLE CORPORATION	350,100	47.36	16,580,736.00
RED HAT INC	20,300	122.92	2,495,276.00
SALESFORCE.COM INC	76,400	102.63	7,840,932.00
SERVICENOW INC	19,300	129.19	2,493,367.00
SPLUNK INC	15,000	82.75	1,241,250.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,800	40.44	800,712.00
SYMANTEC CORP	66,800	28.32	1,891,776.00

SYNOPSYS INC	16,600	85.82	1,424,612.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	11,800	109.14	1,287,852.00
VMWARE INC - CLASS A	8,400	127.69	1,072,596.00
WORKDAY INC-CLASS A	15,500	102.32	1,585,960.00
ARISTA NETWORKS INC	5,200	236.55	1,230,060.00
CISCO SYSTEMS	564,000	38.55	21,742,200.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	38.31	873,468.00
F5 NETWORKS INC	7,300	132.37	966,301.00
HARRIS CORP	13,500	142.78	1,927,530.00
JUNIPER NETWORKS INC	42,400	28.86	1,223,664.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17,900	90.76	1,624,604.00
PALO ALTO NETWORKS INC	10,000	146.15	1,461,500.00
APPLE INC	581,800	175.01	101,820,818.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	186,000	14.71	2,736,060.00
HP INC	189,600	21.26	4,030,896.00
NETAPP INC	30,000	56.30	1,689,000.00
SEAGATE TECHNOLOGY	32,400	42.17	1,366,308.00
WESTERN DIGITAL CORP	32,900	80.68	2,654,372.00
XEROX CORP	24,400	29.58	721,752.00
AMPHENOL CORP-CL A	34,500	88.14	3,040,830.00
ARROW ELECTRS INC	10,500	80.40	844,200.00
AVNET	12,200	39.60	483,120.00
CDW CORPORATION	16,500	69.20	1,141,800.00
COGNEX CORP	19,200	61.89	1,188,288.00
CORNING INC	103,900	32.38	3,364,282.00
FLEX LTD	62,000	17.97	1,114,140.00
FLIR SYSTEMS INC	15,600	47.36	738,816.00
IPG PHOTONICS CORP	4,200	213.12	895,104.00
TE CONNECTIVITY LTD	40,000	94.95	3,798,000.00
TRIMBLE INC	28,400	40.51	1,150,484.00
ADVANCED MICRO DEVICES	90,000	10.54	948,600.00
ANALOG DEVICES INC	41,900	88.85	3,722,815.00
APPLIED MATERIALS	120,900	52.06	6,294,054.00
BROADCOM LTD	45,930	262.35	12,049,735.50
INTEL CORP	530,000	46.70	24,751,000.00

KLA TENCOR CORP	17,300	109.32	1,891,236.00	
LAM RESEARCH	18,180	186.69	3,394,024.20	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	46,500	22.01	1,023,465.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	31,200	53.15	1,658,280.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	26,700	88.92	2,374,164.00	
MICRON TECHNOLOGY	118,700	44.12	5,237,044.00	
NVIDIA CORP	67,800	195.27	13,239,306.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	38,600	116.70	4,504,620.00	
QORVO INC	14,200	67.69	961,198.00	
QUALCOMM INC	166,800	64.73	10,796,964.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	21,100	97.07	2,048,177.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	111,900	104.13	11,652,147.00	
XILINX INC	28,600	67.92	1,942,512.00	
AT & T INC	692,300	38.94	26,958,162.00	
CENTURYLINK INC	108,086	17.24	1,863,402.64	
VERIZON COMMUNICATIONS	460,000	53.19	24,467,400.00	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	19,200	36.00	691,200.00	
SPRINT CORP	90,000	5.64	507,600.00	
T-MOBILE US INC	33,400	63.62	2,124,908.00	
ALLIANT ENERGY CORP	25,300	42.50	1,075,250.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	55,400	73.65	4,080,210.00	
DUKE ENERGY CORP	78,400	84.17	6,598,928.00	
EDISON INTERNATIONAL	36,800	65.23	2,400,464.00	
ENTERGY CORP	19,700	80.31	1,582,107.00	
EVERSOURCE ENERGY	36,300	62.37	2,264,031.00	
EXELON CORPORATION	107,900	39.01	4,209,179.00	
FIRSTENERGY CORP	48,800	30.48	1,487,424.00	
NEXTERA ENERGY INC	52,500	154.54	8,113,350.00	
OGE ENERGY CORP	22,500	33.01	742,725.00	
PG&E CORP	58,500	44.57	2,607,345.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	12,400	85.14	1,055,736.00	
PPL CORPORATION	77,300	31.13	2,406,349.00	
SOUTHERN CO.	112,100	48.50	5,436,850.00	
WESTAR ENERGY INC	15,800	52.78	833,924.00	
XCEL ENERGY INC	57,400	48.25	2,769,550.00	

ATMOS ENERGY CORP	11,700	85.09	995,553.00	
UGI CORP	20,400	47.02	959,208.00	
AMEREN CORPORATION	26,700	58.69	1,567,023.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	45,200	28.07	1,268,764.00	
CMS ENERGY CORP	30,400	47.35	1,439,440.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	34,500	84.75	2,923,875.00	
DOMINION ENERGY INC	72,800	80.44	5,856,032.00	
DTE ENERGY COMPANY	20,600	108.72	2,239,632.00	
NISOURCE INC	38,200	25.28	965,696.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	57,200	51.07	2,921,204.00	
SCANA CORP	14,100	39.01	550,041.00	
SEMPRA ENERGY	26,900	108.31	2,913,539.00	
WEC ENERGY GROUP INC	35,800	65.72	2,352,776.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,300	90.51	1,746,843.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	56,000	13.28	743,680.00	
ALLY FINANCIAL INC	52,700	29.25	1,541,475.00	
AMERICAN EXPRESS CO	85,000	98.74	8,392,900.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54,300	100.50	5,457,150.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	41,400	77.13	3,193,182.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	91,700	38.77	3,555,209.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	6,500	204.20	1,327,300.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16,600	171.51	2,847,066.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	117,100	54.00	6,323,400.00	
BLACKROCK INC	13,600	512.12	6,964,832.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,200	124.47	1,394,064.00	
CME GROUP INC	38,200	148.98	5,691,036.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	30,700	49.71	1,526,097.00	
EATON VANCE CORP	13,800	56.43	778,734.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	36,800	43.91	1,615,888.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	41,540	258.97	10,757,613.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	66,600	70.25	4,678,650.00	
INVESCO LTD	46,900	36.64	1,718,416.00	
MOODYS CORP	19,500	146.99	2,866,305.00	
MORGAN STANLEY	155,800	52.72	8,213,776.00	
MSCI INC	10,400	128.33	1,334,632.00	

	NASDAQ INC	12,700	76.09	966,343.00	
	NORTHERN TRUST CORP	24,700	98.98	2,444,806.00	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,900	90.64	1,350,536.00	
	S&P GLOBAL INC	29,000	167.83	4,867,070.00	
	SCHWAB(CHARLES)CORP	136,500	52.08	7,108,920.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	15,000	72.01	1,080,150.00	
	STATE STREET CORP	42,400	97.93	4,152,232.00	
	T ROWE PRICE GROUP INC	27,500	105.24	2,894,100.00	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	29,400	51.95	1,527,330.00	
	H & R BLOCK INC	23,500	26.23	616,405.00	
	AES CORP	74,000	10.71	792,540.00	
	VISTRA ENERGY CORP	29,000	17.98	521,420.00	
	CERNER CORP	34,200	67.38	2,304,396.00	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,600	56.07	706,482.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	36,500	67.35	2,458,275.00	
	ILLUMINA INC	16,470	215.72	3,552,908.40	
	IQVIA HOLDINGS INC	15,500	99.38	1,540,390.00	
	METTLER-TOLEDO INTL	2,840	614.77	1,745,946.80	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	44,800	190.42	8,530,816.00	
	WATERS CORP	8,700	193.79	1,685,973.00	
	EQUIFAX INC	13,900	119.73	1,664,247.00	
	IHS MARKIT LTD	44,500	45.05	2,004,725.00	
	MANPOWERGROUP INC	7,100	127.04	901,984.00	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	39,300	36.54	1,436,022.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	13,300	55.68	740,544.00	
	TRUNION	17,200	55.16	948,752.00	
	VERISK ANALYTICS INC	17,300	95.33	1,649,209.00	
	CBRE GROUP INC	33,100	43.37	1,435,547.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	129,000	7.02	905,580.00	
	JONES LANG LASALLE INC	4,700	149.57	702,979.00	
小計	銘柄数：602			2,640,925,037.06	
				(299,428,080,701)	
	組入時価比率：63.1%			65.4%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	20,800	28.41	590,928.00	
	ARC RESOURCES LTD	40,000	14.55	582,000.00	
		48,000	11.97	574,560.00	

CAMECO CORP			
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	122,400	44.22	5,412,528.00
CENOVUS ENERGY INC	117,000	11.17	1,306,890.00
CRESCENT POINT ENERGY CORP	65,000	9.16	595,400.00
ENBRIDGE INC	184,400	49.14	9,061,416.00
ENCANA CORP	107,000	16.04	1,716,280.00
HUSKY ENERGY INC	35,745	17.53	626,609.85
IMPERIAL OIL	34,400	38.44	1,322,336.00
INTER PIPELINE LTD	40,900	25.51	1,043,359.00
KEYERA CORP	20,900	35.05	732,545.00
PEMBINA PIPELINE CORP	57,100	45.13	2,576,923.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24,600	31.71	780,066.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	29,000	17.95	520,550.00
SUNCOR ENERGY INC	188,000	44.70	8,403,600.00
TOURMALINE OIL CORP	26,500	22.42	594,130.00
TRANSCANADA CORP	97,900	61.68	6,038,472.00
VERMILION ENERGY INC	12,000	45.11	541,320.00
AGRIUM INC	15,200	143.68	2,183,936.00
METHANEX CORP	10,300	75.59	778,577.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	92,000	25.64	2,358,880.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15,500	58.57	907,835.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	25,600	57.62	1,475,072.00
BARRICK GOLD	134,000	18.40	2,465,600.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	80,000	17.12	1,369,600.00
FRANCO-NEVADA CORP	20,600	99.86	2,057,116.00
GOLDCORP INC	93,000	16.00	1,488,000.00
KINROSS GOLD CORP	140,000	5.40	756,000.00
LUNDIN MINING CORP	73,000	8.20	598,600.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	62,700	32.33	2,027,091.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	98,000	4.23	414,540.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	51,200	28.03	1,435,136.00
WEST FRASER TIMBER	6,800	77.49	526,932.00
BOMBARDIER B SHEARS	232,000	3.02	700,640.00
CAE INC	31,000	23.49	728,190.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	19,700	57.47	1,132,159.00

FINNING INTERNATIONAL INC	19,600	31.42	615,832.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	85,100	103.97	8,847,847.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16,600	231.75	3,847,050.00
LINAMAR CORP	4,800	74.45	357,360.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	39,300	73.00	2,868,900.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	24,100	41.13	991,233.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,900	77.98	2,019,682.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	46,000	28.99	1,333,540.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,000	163.56	1,144,920.00
DOLLARAMA INC	12,000	155.51	1,866,120.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	47,700	65.40	3,119,580.00
EMPIRE CO LTD A	21,000	24.25	509,250.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	24.40	229,360.00
LOBLAW COMPANIES	24,000	68.16	1,635,840.00
METRO INC	26,700	40.35	1,077,345.00
WESTON(GEORGE)LTD	5,900	109.01	643,159.00
SAPUTO INC	23,900	44.64	1,066,896.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	38,000	27.44	1,042,720.00
BANK OF MONTREAL	73,600	100.78	7,417,408.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	135,500	82.29	11,150,295.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	49,500	123.11	6,093,945.00
NATIONAL BANK OF CANADA	39,200	62.35	2,444,120.00
ROYAL BANK OF CANADA	164,700	102.45	16,873,515.00
TORONTO DOMINION BANK	208,300	72.99	15,203,817.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	49,000	9.60	470,400.00
ONEX CORPORATION	9,200	93.08	856,336.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,240	666.00	2,157,840.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	33,200	35.03	1,162,996.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	12,100	59.56	720,676.00
INTACT FINANCIAL CORP	15,100	104.07	1,571,457.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	222,200	26.71	5,934,962.00
POWER CORPORATION OF CANADA	40,900	32.40	1,325,160.00
POWER FINANCIAL CORP	27,800	34.91	970,498.00
	69,400	51.82	3,596,308.00

	SUN LIFE FINANCIAL INC			
	SHOIFY INC - CLASS A	9,000	131.99	1,187,910.00
	CGI GROUP INC - CLASS A	23,300	68.92	1,605,836.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,230	767.34	1,711,168.20
	OPEN TEXT CORP	29,500	41.69	1,229,855.00
	BLACKBERRY LTD	60,000	14.74	884,400.00
	BCE INC	17,400	60.39	1,050,786.00
	TELUS CORP	19,300	47.73	921,189.00
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	41,200	64.15	2,642,980.00
	EMERA INC	4,900	46.82	229,418.00
	FORTIS INC	45,700	45.82	2,093,974.00
	HYDRO ONE LTD	35,000	22.39	783,650.00
	ATCO LTD CL1	9,600	44.40	426,240.00
	CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	36.97	580,429.00
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	94,500	54.59	5,158,755.00
	CI FINANCIAL CORP	28,200	29.53	832,746.00
	IGM FINANCIAL INC	10,300	44.27	455,981.00
	THOMSON REUTERS CORP	31,600	55.23	1,745,268.00
	FIRST CAPITAL REALTY INC	18,000	20.62	371,160.00
小計	銘柄数：89			201,501,929.05 (17,959,866,936)
	組入時価比率：3.8%			3.9%
ユーロ	TENARIS SA	53,000	13.35	707,550.00
	ENAGAS	26,700	24.13	644,271.00
	ENI SPA	289,000	14.02	4,051,780.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	57,000	15.66	892,620.00
	NESTE OYJ	14,600	53.55	781,830.00
	OMV AG	17,100	54.14	925,794.00
	REPSOL SA	140,000	15.04	2,105,600.00
	REPSOL SA-RTS	140,000	0.38	54,040.00
	SNAM SPA	252,000	4.09	1,032,192.00
	TOTAL SA	268,200	46.47	12,463,254.00
	VOPAK	7,100	36.72	260,747.50
	AIR LIQUIDE	47,900	106.55	5,103,745.00
	AKZO NOBEL	28,600	73.29	2,096,094.00
	ARKEMA	7,700	101.75	783,475.00

BASF SE	103,800	93.51	9,706,338.00
COVESTRO AG	14,100	86.25	1,216,125.00
EVONIK INDUSTRIES AG	19,500	31.58	615,907.50
FUCHS PETROLUB SE -PFD	8,200	44.57	365,515.00
K+S AG	23,300	20.26	472,058.00
KONINKLIJKE DSM NV	20,900	80.26	1,677,434.00
LANXESS	10,300	64.93	668,779.00
LINDE AG - TENDER	20,910	196.50	4,108,815.00
SOLVAY SA	8,100	115.90	938,790.00
SYMRISE AG	13,600	70.64	960,704.00
UMICORE	21,400	38.72	828,715.00
CRH PLC	97,100	29.96	2,909,116.00
HEIDELBERGCEMENT AG	16,400	90.12	1,477,968.00
IMERYS	3,800	79.02	300,276.00
ARCELORMITTAL	76,100	27.47	2,090,467.00
THYSSENKRUPP AG	48,100	23.93	1,151,033.00
VOESTALPINE AG	12,800	50.82	650,496.00
STORA ENSO OYJ-R	62,000	13.42	832,040.00
UPM-KYMMENE OYJ	61,500	26.39	1,622,985.00
AIRBUS SE	65,100	84.55	5,504,205.00
DASSAULT AVIATION SA	270	1,296.25	349,987.50
LEONARDO SPA	47,000	9.91	466,005.00
MTU AERO ENGINES AG	5,800	152.30	883,340.00
SAFRAN SA	37,500	88.05	3,301,875.00
THALES SA	11,500	89.69	1,031,435.00
ZODIAC AEROSPACE	23,200	24.98	579,652.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	56,400	46.45	2,619,780.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	27,900	32.52	907,308.00
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	9,602	31.36	301,166.73
BOUYGUES	23,400	43.82	1,025,388.00
EIFFAGE SA	8,700	90.77	789,699.00
FERROVIAL SA	54,075	19.16	1,036,347.37
HOCHTIEF AG	2,000	144.10	288,200.00
VINCI	56,600	85.93	4,863,638.00
LEGRAND SA	30,200	64.35	1,943,370.00

OSRAM LICHT AG	11,600	75.12	871,392.00
PRYSMIAN SPA	23,000	27.54	633,420.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	63,200	72.32	4,570,624.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	23,600	11.61	274,114.00
SIEMENS AG	86,400	117.45	10,147,680.00
ALSTOM	18,100	34.90	631,780.50
ANDRITZ AG	8,900	46.82	416,742.50
CNH INDUSTRIAL NV	113,000	11.34	1,281,420.00
GEA GROUP AG	20,700	39.50	817,650.00
KION GROUP AG	8,000	73.64	589,120.00
KONE OYJ	38,400	44.69	1,716,096.00
MAN SE	3,700	95.14	352,018.00
METSO OYJ	12,400	28.43	352,532.00
WARTSILA OYJ	16,200	53.00	858,600.00
BRENNTAG AG	17,000	53.09	902,530.00
REXEL SA	35,000	15.03	526,225.00
EDENRED	25,300	24.10	609,730.00
SOCIETE BIC SA	2,810	92.24	259,194.40
BOLLORE	106,000	4.51	478,696.00
DEUTSCHE POST AG-REG	109,000	40.49	4,413,955.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	26,700	31.05	829,168.50
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	75,000	7.31	548,550.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	76,300	18.45	1,408,116.50
ADP	3,400	158.30	538,220.00
AENA SME SA	7,450	169.45	1,262,402.50
ATLANTIA SPA	50,000	26.53	1,326,500.00
FRAPORT AG	4,900	91.41	447,909.00
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	53,000	10.72	568,160.00
CONTINENTAL AG	12,420	226.30	2,810,646.00
FAURECIA	8,500	66.36	564,060.00
MICHELIN (CGDE)	19,300	121.85	2,351,705.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,400	37.67	504,778.00
SCHAEFFLER AG	16,000	14.74	235,840.00
VALEO SA	27,600	62.32	1,720,032.00

BAYER MOTOREN WERK	37,300	87.52	3,264,496.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	6,400	74.03	473,792.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	108,900	71.31	7,765,659.00
FERRARI NV	13,500	89.55	1,208,925.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	123,000	15.45	1,900,350.00
PEUGEOT CITROEN	67,400	17.09	1,152,203.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	17,100	70.12	1,199,052.00
RENAULT SA	21,800	84.18	1,835,124.00
VOLKSWAGEN AG	3,810	170.00	647,700.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	20,900	169.00	3,532,100.00
SEB SA	2,450	154.35	378,157.50
ADIDAS AG	21,180	169.40	3,587,892.00
HERMES INTERNATIONAL	3,640	448.40	1,632,176.00
HUGO BOSS AG	7,600	71.62	544,312.00
KERING SA	8,530	391.30	3,337,789.00
LUXOTTICA GROUP SPA	18,600	51.70	961,620.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	31,190	249.50	7,781,905.00
ACCOR SA	21,400	41.89	896,553.00
PADDY POWER PLC	9,400	97.98	921,012.00
SODEXO	10,100	112.10	1,132,210.00
ALTICE NV - A	64,000	8.56	548,160.00
AXEL SPRINGER SE	5,900	66.22	390,698.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	20,000	19.91	398,200.00
JC DECAUX SA	9,300	33.75	313,875.00
LAGARDERE S.C.A	11,600	27.07	314,012.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	25,600	28.98	741,888.00
PUBLICIS GROUPE	23,900	56.79	1,357,281.00
RTL GROUP	3,900	67.43	262,977.00
SES FDR	43,000	13.65	586,950.00
TELENET GROUP HOLDING NV	5,200	57.96	301,392.00
VIVENDI SA	116,400	22.76	2,649,846.00
ZALANDO SE	11,700	43.90	513,630.00
INDITEX SA	122,800	29.61	3,636,722.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	67,400	17.54	1,182,196.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	49.94	294,646.00

COLRUYT SA	7,300	43.02	314,046.00
JERONIMO MARTINS	26,700	16.04	428,268.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	145,000	18.20	2,639,000.00
METRO AG	18,200	16.60	302,211.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	86,200	93.99	8,101,938.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	65,000	6.41	416,650.00
HEINEKEN HOLDING NV	12,400	83.10	1,030,440.00
HEINEKEN NV	29,300	87.70	2,569,610.00
PERNOD RICARD SA	23,900	130.80	3,126,120.00
REMY COINTREAU	2,300	115.75	266,225.00
DANONE	67,700	70.60	4,779,620.00
KERRY GROUP PLC-A	18,300	93.00	1,701,900.00
HENKEL AG & CO KGAA	11,500	99.79	1,147,585.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	20,100	110.50	2,221,050.00
BEIERSDORF AG	11,000	98.41	1,082,510.00
LOREAL-ORD	28,240	186.80	5,275,232.00
UNILEVER NV-CVA	184,100	47.48	8,741,068.00
BIOMERIEUX	4,600	74.12	340,952.00
ESSILOR INTERNATIONAL	23,500	115.25	2,708,375.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	105,800	31.95	3,380,310.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	24,400	88.23	2,152,812.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	46,800	65.36	3,058,848.00
GRIFOLS SA	32,900	24.79	815,591.00
BAYER AG-REG	93,400	105.45	9,849,030.00
IPSEN	4,000	100.90	403,600.00
MERCK KGAA	14,200	90.28	1,281,976.00
ORION OYJ	10,800	30.37	327,996.00
RECORDATI SPA	11,200	37.00	414,400.00
SANOFI	128,400	72.55	9,315,420.00
UCB SA	13,900	65.98	917,122.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	48,900	26.89	1,314,921.00
AIB GROUP PLC	105,000	5.56	583,800.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	747,000	7.26	5,426,208.00
BANCO DE SABADELL SA	581,000	1.68	981,309.00
BANCO SANTANDER SA	1,825,000	5.59	10,209,050.00

BANK OF IRELAND GROUP PLC	109,000	7.19	783,710.00
BANKIA SA	107,500	4.01	431,182.50
BANKINTER S.A.	75,000	8.02	601,500.00
BNP PARIBAS	127,000	62.95	7,994,650.00
CAIXABANK	413,000	3.94	1,627,220.00
COMMERZBANK AG	117,000	12.63	1,477,710.00
CREDIT AGRICOLE SA	129,000	14.00	1,806,000.00
ERSTE GROUP BANK AG	33,200	36.54	1,213,128.00
ING GROEP NV	435,000	15.54	6,762,075.00
INTESA SANPAOLO	1,513,000	2.84	4,296,920.00
INTESA SANPAOLO-RSP	118,000	2.73	322,140.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	28,500	71.21	2,029,485.00
MEDIOBANCA S.P.A.	68,000	9.54	648,720.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	16,900	30.35	512,915.00
SOCIETE GENERALE	86,300	43.45	3,750,166.50
UNICREDIT SPA	225,000	15.92	3,582,000.00
EURAZEO SE	4,272	76.78	328,004.16
EXOR NV	12,100	51.40	621,940.00
GROUPE BRUXELLES LAM	8,900	89.99	800,911.00
WENDEL	2,900	143.70	416,730.00
AEGON NV	193,000	5.29	1,021,742.00
AGEAS	21,300	41.11	875,643.00
ALLIANZ SE-REG	50,790	195.25	9,916,747.50
ASSICURAZIONI GENERALI	142,000	15.28	2,169,760.00
AXA	219,700	25.17	5,530,947.50
CNP ASSURANCES	21,200	19.22	407,464.00
HANNOVER RUECK SE	7,100	105.95	752,245.00
MAPFRE SA	126,000	2.68	338,814.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17,460	183.50	3,203,910.00
NN GROUP NV	34,600	36.46	1,261,516.00
POSTE ITALIANE SPA	64,000	6.33	405,120.00
SAMPO OYJ-A SHS	50,600	45.74	2,314,444.00
SCOR SE	18,000	34.00	612,000.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	1.96	210,576.00

UNITED INTERNET AG-REG SHARE	14,400	58.17	837,648.00
AMADEUS IT GROUP SA	49,500	60.73	3,006,135.00
ATOS SE	10,400	122.25	1,271,400.00
CAPGEMINI SA	18,200	99.52	1,811,264.00
WIRECARD AG	13,100	94.11	1,232,841.00
DASSAULT SYSTEMES SA	15,000	89.14	1,337,100.00
SAP SE	111,000	94.58	10,498,380.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,000	65.37	457,590.00
NOKIA OYJ	658,000	4.03	2,654,372.00
INGENICO GROUP	6,700	88.29	591,543.00
ASML HOLDING NV	44,000	147.00	6,468,000.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	128,000	23.21	2,971,520.00
STMICROELECTRONICS NV	71,000	18.59	1,319,890.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	373,000	15.00	5,596,865.00
ELISA OYJ	14,500	32.77	475,165.00
ILIAD SA	3,150	200.35	631,102.50
KONINKLIJKE KPN NV	372,000	2.90	1,082,148.00
ORANGE SA	227,000	14.64	3,323,280.00
PROXIMUS	18,400	27.74	510,416.00
TELECOM ITALIA SPA	1,240,000	0.73	915,120.00
TELECOM ITALIA-RNC	680,000	0.60	410,040.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	74,600	4.24	316,826.20
TELEFONICA SA	509,000	8.25	4,201,795.00
DRILLISCH AG	5,900	68.16	402,144.00
ELECTRICITE DE FRANCE	67,000	10.55	707,185.00
ENDESA S.A.	35,600	18.96	674,976.00
ENEL SPA	912,000	5.28	4,819,920.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	262,000	2.86	751,678.00
FORTUM OYJ	50,000	16.53	826,500.00
IBERDROLA SA	645,000	6.51	4,204,110.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	48,200	18.58	895,556.00
TERNA SPA	163,000	4.93	804,242.00
GAS NATURAL SDG	41,200	19.24	792,688.00
E.ON SE	249,000	9.21	2,294,037.00
ENGIE	206,000	14.56	3,000,390.00

	INNOGY SE	14,600	32.55	475,230.00	
	RWE AG	57,900	17.04	986,905.50	
	SUEZ	38,500	14.61	562,677.50	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,300	21.48	1,123,665.50	
	AMUNDI SA	6,700	70.84	474,628.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	233,000	16.31	3,801,395.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	22,100	96.63	2,135,523.00	
	NATIXIS	111,000	6.68	741,591.00	
	UNIPER SE	22,400	25.02	560,448.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,240	503.50	624,340.00	
	QIAGEN NV	24,500	27.00	661,500.00	
	BUREAU VERITAS SA	30,100	22.73	684,323.50	
	RANDSTAD HOLDING NV	13,500	51.46	694,710.00	
	RELX NV	109,500	19.27	2,110,065.00	
	TELEPERFORMANCE	6,400	118.75	760,000.00	
	WOLTERS KLUWER	32,800	44.22	1,450,416.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	39,000	36.34	1,417,260.00	
	VONOVIA SE	55,500	40.97	2,274,112.50	
小計	銘柄数：241			454,138,944.36	
				(61,127,101,910)	
	組入時価比率：12.9%			13.4%	
英ボンド	WOOD GROUP (JOHN) PLC	73,000	6.48	473,040.00	
	BP PLC	2,230,000	5.17	11,533,560.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	509,100	24.52	12,485,677.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	422,900	24.71	10,451,973.50	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	15,500	43.63	676,265.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	21,800	30.71	669,478.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	151,000	15.01	2,266,510.00	
	ANTOFAGASTA PLC	41,000	9.64	395,240.00	
	BHP BILLITON PLC	238,000	14.63	3,483,130.00	
	FRESNILLO PLC	26,000	13.50	351,000.00	
	GLENCORE PLC	1,386,000	3.75	5,203,044.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	10,900	71.35	777,715.00	
	RIO TINTO PLC-REG	138,300	37.46	5,181,409.50	
	MONDI PLC	40,800	18.74	764,592.00	

BAE SYSTEMS PLC	360,000	5.68	2,044,800.00
COBHAM PLC	254,000	1.25	318,770.00
MEGGITT PLC	78,000	4.90	382,200.00
ROLLS-ROYCE HLDGS-C SHS ENTITL	8,188,000	0.00	8,188.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	188,000	8.59	1,615,860.00
DCC PLC	9,800	74.40	729,120.00
SMITHS GROUP PLC	47,000	14.85	697,950.00
IMI PLC	32,000	13.26	424,320.00
WEIR GROUP PLC	26,600	21.10	561,260.00
ASHTED GROUP PLC	55,700	19.44	1,082,808.00
BUNZLE	36,800	20.65	759,920.00
FERGUSON PLC	29,100	54.25	1,578,675.00
TRAVIS PERKINS PLC	30,200	15.43	465,986.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	7.02	181,818.00
G4S PLC	179,000	2.60	465,579.00
ROYAL MAIL PLC	108,000	4.53	489,348.00
EASYJET PLC	16,300	14.45	235,535.00
GKN PLC	193,000	3.14	606,599.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	113,000	6.44	727,720.00
PERSIMMON PLC	35,500	27.19	965,245.00
TAYLOR WIMPEY PLC	366,000	2.05	752,130.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	14,800	42.04	622,192.00
BURBERRY GROUP PLC	50,400	17.59	886,536.00
CARNIVAL PLC	20,500	49.03	1,005,115.00
COMPASS GROUP PLC	178,200	15.69	2,795,958.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	19,700	47.18	929,446.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	69,000	3.60	248,952.00
TUI AG-DI	49,000	15.32	750,680.00
WHITBREAD PLC	20,600	39.48	813,288.00
ITV PLC	400,000	1.65	660,400.00
PEARSON	91,000	7.35	668,850.00
SKY PLC	114,000	10.15	1,157,100.00
WPP PLC	144,000	13.45	1,936,800.00
MARKS & SPENCER PLC	181,000	3.13	567,435.00
NEXT PLC	16,200	45.79	741,798.00

KINGFISHER PLC	246,000	3.41	840,582.00
MORRISON SUPERMARKETS	246,000	2.13	525,702.00
SAINSBURY	170,000	2.38	404,600.00
TESCO PLC	930,000	2.06	1,922,775.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	19,300	23.79	459,147.00
DIAGEO PLC	284,800	26.89	7,659,696.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	39,200	28.19	1,105,048.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	258,800	49.70	12,862,360.00
IMPERIAL BRANDS PLC	107,900	31.29	3,376,191.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	74,900	68.33	5,117,917.00
UNILEVER PLC	142,900	41.28	5,898,912.00
CONVATEC GROUP PLC-WI	157,000	2.05	322,478.00
SMITH & NEPHEW PLC	96,000	12.93	1,241,280.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	6.22	233,437.50
SHIRE PLC	102,000	38.80	3,958,110.00
ASTRAZENECA PLC	141,600	49.42	6,997,872.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	556,000	13.02	7,239,120.00
BARCLAYS PLC	1,916,000	2.02	3,873,194.00
HSBC HOLDINGS PLC	2,267,000	7.61	17,265,472.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,150,000	0.67	5,477,615.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,000	2.75	1,094,926.00
STANDARD CHARTERED PLC	375,000	7.68	2,881,500.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	295,000	4.28	1,263,780.00
ADMIRAL GROUP PLC	22,900	19.22	440,138.00
AVIVA PLC	459,000	5.00	2,295,000.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	157,000	3.73	586,552.00
LEGAL & GENERAL	675,000	2.70	1,827,225.00
OLD MUTUAL PLC	536,000	2.22	1,191,528.00
PRUDENTIAL PLC	292,800	18.87	5,525,136.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	112,000	6.17	691,600.00
AUTO TRADER GROUP PLC	95,000	3.52	334,495.00
WORLDPAY GROUP PLC	230,000	4.28	985,780.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	48,000	24.99	1,199,520.00
SAGE GROUP PLC (THE)	119,000	7.95	946,645.00
BT GROUP PLC	956,000	2.74	2,620,396.00

	VODAFONE GROUP PLC	2,984,000	2.35	7,039,256.00	
	SSE PLC	109,100	13.04	1,422,664.00	
	CENTRICA PLC	650,000	1.38	902,200.00	
	NATIONAL GRID PLC	387,000	8.66	3,353,742.00	
	SEVERN TRENT PLC	27,700	21.42	593,334.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	76,000	8.18	621,680.00	
	3I GROUP PLC	106,000	9.01	955,590.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	30,300	17.56	532,068.00	
	INVESTEC PLC	75,000	5.27	395,625.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	34,100	37.38	1,274,658.00	
	SCHRODERS PLC	13,300	34.89	464,037.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	62,000	12.02	745,240.00	
	CAPITA PLC	76,000	4.00	304,000.00	
	EXPERIAN PLC	106,700	15.97	1,703,999.00	
	INTERTEK GROUP PLC	17,900	51.65	924,535.00	
	RELX PLC	121,200	17.32	2,099,184.00	
小計	銘柄数：100			217,588,557.00	
				(32,988,601,126)	
	組入時価比率：6.9%			7.2%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	27.51	712,509.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	980	658.00	644,840.00	
	GIVAUDAN-REG	1,047	2,242.00	2,347,374.00	
	SIKA AG-BR	236	7,815.00	1,844,340.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	51,500	54.40	2,801,600.00	
	GEBERIT AG-REG	4,060	430.50	1,747,830.00	
	ABB LTD	206,800	26.27	5,432,636.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,450	219.60	538,020.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,480	225.40	1,009,792.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,900	171.30	1,010,670.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	58,600	89.00	5,215,400.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,540	395.80	1,401,132.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,000	74.35	446,100.00	
	DUFREY AG-REG	3,660	144.00	527,040.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	230	1,987.00	457,010.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	125	5,910.00	738,750.00	

	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	12	69,660.00	835,920.00	
	NESTLE SA-REG	350,900	83.60	29,335,240.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,800	153.60	890,880.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,120	691.00	773,920.00	
	NOVARTIS-REG	250,900	82.20	20,623,980.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	79,270	246.30	19,524,201.00	
	VIFOR PHARMA AG	5,700	122.40	697,680.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	4,300	84.00	361,200.00	
	BALOISE HOLDING AG	5,800	151.70	879,860.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,590	344.30	1,236,037.00	
	SWISS RE LTD	35,000	91.80	3,213,000.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,990	298.00	5,063,020.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,990	519.50	1,553,305.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	273,000	17.82	4,864,860.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,900	59.30	1,535,870.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,890	666.50	1,259,685.00	
	UBS GROUP AG	410,000	18.11	7,425,100.00	
	LONZA AG-REG	8,540	261.70	2,234,918.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,000	74.60	1,342,800.00	
	SGS SA-REG	605	2,530.00	1,530,650.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	8,100	88.15	714,015.00	
小計	銘柄数 : 37			132,771,184.00	
				(15,220,888,533)	
	組入時価比率 : 3.2%			3.3%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	21,700	193.20	4,192,440.00	
	BOLIDEN AB	30,100	277.80	8,361,780.00	
	ASSA ABLOY AB-B	113,700	173.10	19,681,470.00	
	SKANSKA AB-B SHS	38,200	171.00	6,532,200.00	
	ALFA LAVAL AB	31,000	197.30	6,116,300.00	
	ATLAS COPCO AB-A	75,700	361.90	27,395,830.00	
	ATLAS COPCO AB-B	45,000	322.10	14,494,500.00	
	SANDVIK AB	124,000	145.50	18,042,000.00	
	SKF AB-B SHARES	42,700	185.20	7,908,040.00	
	VOLVO AB-B SHS	176,000	160.00	28,160,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	33,300	145.40	4,841,820.00	

	ELECTROLUX AB-B	26,500	269.80	7,149,700.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	45,000	80.60	3,627,000.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	107,500	170.70	18,350,250.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,800	296.40	2,311,920.00	
	SWEDISH MATCH AB	21,500	324.00	6,966,000.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	69,600	237.00	16,495,200.00	
	GETINGE AB-B SHS	26,800	119.30	3,197,240.00	
	NORDEA BANK AB	342,000	101.60	34,747,200.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	175,000	98.10	17,167,500.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	173,000	115.10	19,912,300.00	
	SWEDBANK AB	102,600	202.10	20,735,460.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,800	203.90	3,425,520.00	
	INVESTOR AB-B SHS	51,600	379.20	19,566,720.00	
	KINNEVIK AB - B	26,600	277.90	7,392,140.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,600	615.50	2,831,300.00	
	ERICSSON LM-B	349,000	55.40	19,334,600.00	
	HEXAGON AB-B SHS	28,100	415.40	11,672,740.00	
	TELIA CO AB	287,000	37.10	10,647,700.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6,800	556.50	3,784,200.00	
	TELE 2 AB-B SHS	42,000	103.80	4,359,600.00	
小計	銘柄数：31			379,400,670.00	
				(5,159,849,112)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	131,500	175.00	23,012,500.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	20,600	377.90	7,784,740.00	
	NORSK HYDRO	148,000	61.20	9,057,600.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,100	213.50	1,942,850.00	
	MARINE HARVEST ASA	46,700	135.40	6,323,180.00	
	ORKLA ASA	91,000	86.35	7,857,850.00	
	DNB ASA	112,000	151.30	16,945,600.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,700	153.20	3,018,040.00	
	TELENOR ASA	85,600	178.50	15,279,600.00	
小計	銘柄数：9			91,221,960.00	
				(1,243,355,314)	

	組入時価比率：0.3%			0.3%
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	11,400	582.50	6,640,500.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	25,200	352.80	8,890,560.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	23,900	432.90	10,346,310.00
	ISS A/S	18,600	240.50	4,473,300.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	440	10,050.00	4,422,000.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S	730	10,530.00	7,686,900.00
	DSV A/S	20,700	485.80	10,056,060.00
	PANDORA A/S	12,400	664.00	8,233,600.00
	CARLSBERG B	11,700	746.50	8,734,050.00
	COLOPLAST-B	13,000	502.50	6,532,500.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	173.70	2,258,100.00
	GENMAB A/S	6,380	1,046.00	6,673,480.00
	H LUNDBECK A/S	8,200	299.60	2,456,720.00
	NOVO NORDISK A/S-B	210,700	335.80	70,753,060.00
	DANSKE BANK AS	85,400	245.00	20,923,000.00
	TRYG A/S	11,800	154.40	1,821,920.00
	TDC A/S	97,000	38.35	3,719,950.00
ORSTED A/S	21,800	339.80	7,407,640.00	
小計	銘柄数：18			192,029,650.00 (3,471,896,072)
	組入時価比率：0.7%			0.8%
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	29,100	33.95	987,945.00
	OIL SEARCH LTD	162,000	7.66	1,240,920.00
	ORIGIN ENERGY LTD	192,000	9.41	1,806,720.00
	SANTOS LTD.	212,000	5.31	1,125,720.00
	WOODSIDE PETROLEUM	95,500	32.73	3,125,715.00
	INCITEC PIVOT LTD	196,000	3.92	768,320.00
	ORICA LTD	42,000	18.24	766,080.00
	BORAL LTD	133,000	7.91	1,052,030.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	52,000	22.40	1,164,800.00
	AMCOR	134,000	15.48	2,074,320.00
	ALUMINA LTD	290,000	2.41	698,900.00
	BHP BILLITON LIMITED	359,600	29.10	10,464,360.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	60,000	15.09	905,400.00

FORTESCUE METALS GROUP LTD	164,000	4.90	803,600.00
NEWCREST MINING	89,000	22.41	1,994,490.00
RIO TINTO LTD	48,000	74.28	3,565,440.00
SOUTH32 LTD	580,000	3.36	1,948,800.00
CIMIC GROUP LTD	11,700	52.12	609,804.00
BRAMBLES LTD	176,000	10.18	1,791,680.00
AURIZON HOLDINGS LTD	239,000	4.95	1,183,050.00
SYDNEY AIRPORT	125,000	7.28	910,000.00
TRANSURBAN GROUP	233,000	12.57	2,928,810.00
TRANSURBAN GROUP-RIGHTS	18,891	0.88	16,718.53
ARISTOCRAT LEISURE LTD	63,000	23.83	1,501,290.00
CROWN RESORTS LTD	43,000	12.93	555,990.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	5,900	46.60	274,940.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	44.65	232,180.00
TABCORP HOLDINGS	218,400	5.59	1,220,856.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	4.18	221,540.00
WESFARMERS LIMITED	127,500	44.22	5,638,050.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	146,300	27.35	4,001,305.00
COCA-COLA AMATIL LTD	60,000	8.52	511,200.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	82,000	16.14	1,323,480.00
COCHLEAR LTD	6,700	174.14	1,166,738.00
HEALTHSCOPE LTD	176,000	2.07	364,320.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,800	69.59	1,099,522.00
SONIC HEALTHCARE LTD	44,000	23.01	1,012,440.00
CSL LIMITED	51,300	141.20	7,243,560.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	329,000	28.87	9,498,230.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	42,000	12.67	532,140.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	54,000	11.51	621,540.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	195,700	80.39	15,732,323.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	300,900	29.57	8,897,613.00
WESTPAC BANKING CORP	383,900	31.28	12,008,392.00
AMP LIMITED	322,000	5.25	1,690,500.00
CHALLENGER LIMITED	66,000	14.17	935,220.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	262,000	7.25	1,899,500.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	308,000	3.30	1,016,400.00

	QBE INSURANCE	152,000	10.74	1,632,480.00	
	SUNCORP GROUP LTD	149,000	13.95	2,078,550.00	
	REA GROUP LTD	5,400	77.23	417,042.00	
	COMPUTERSHARE LTD	56,000	16.80	940,800.00	
	TELSTRA CORP LTD	452,000	3.66	1,654,320.00	
	TPG TELECOM LTD	35,964	6.45	231,967.80	
	AUSNET SERVICES	230,000	1.80	414,000.00	
	APA GROUP	125,000	8.63	1,078,750.00	
	AGL ENERGY LTD	73,000	24.39	1,780,470.00	
	ASX LTD	21,900	55.04	1,205,376.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	36,600	99.93	3,657,438.00	
	SEEK LTD	40,000	18.98	759,200.00	
小計	銘柄数：60			136,983,285.33	
				(11,991,516,797)	
	組入時価比率：2.5%			2.6%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	69,000	7.68	529,920.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	108,000	6.57	710,100.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	64,000	14.14	904,960.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	45,000	10.52	473,400.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	189,000	3.62	684,180.00	
	MERCURY NZ LTD	88,000	3.43	301,840.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	2.93	465,870.00	
小計	銘柄数：7			4,070,270.00	
				(324,237,708)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	304,040	96.60	29,370,264.00	
	NWS HOLDINGS LTD	159,500	14.02	2,236,190.00	
	MTR CORP	163,000	45.60	7,432,800.00	
	MINTH GROUP LTD	82,000	45.90	3,763,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	156,000	49.35	7,698,600.00	
	LI & FUNG LTD	749,600	4.28	3,208,288.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	75,000	30.45	2,283,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	271,000	61.95	16,788,450.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	94,000	23.05	2,166,700.00	

SANDS CHINA LTD	268,000	39.70	10,639,600.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	16.30	2,613,427.90	
SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	6.99	1,160,340.00	
WYNN MACAU LTD	184,000	24.20	4,452,800.00	
WH GROUP LIMITED	1,020,000	8.88	9,057,600.00	
BANK OF EAST ASIA	140,060	33.45	4,685,007.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	421,000	39.00	16,419,000.00	
HANG SENG BANK	87,000	191.80	16,686,600.00	
FIRST PACIFIC CO	226,000	5.35	1,209,100.00	
AIA GROUP LTD	1,364,000	63.95	87,227,800.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	29,000	109.20	3,166,800.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	449,600	9.88	4,442,048.00	
PCCW LTD	550,000	4.56	2,508,000.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	75,000	66.35	4,976,250.00	
CLP HLDGS	187,000	79.90	14,941,300.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,000	65.65	9,913,150.00	
HONG KONG & CHINA GAS	960,289	15.22	14,615,598.58	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	131,600	236.00	31,057,600.00	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	450,000	7.69	3,460,500.00	
CK ASSET HOLDINGS LTD	286,040	68.65	19,636,646.00	
HANG LUNG GROUP LTD	103,000	28.70	2,956,100.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	18.70	3,983,100.00	
HENDERSON LAND	132,599	50.75	6,729,399.25	
HYSAN DEVELOPMENT	65,000	41.00	2,665,000.00	
KERRY PROPERTIES	79,000	34.50	2,725,500.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	679,666	11.30	7,680,225.80	
SINO LAND CO.LTD	360,000	13.54	4,874,400.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	166,000	127.00	21,082,000.00	
SWIRE PACIFIC-A	53,500	72.30	3,868,050.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	25.40	2,966,720.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	134,000	51.80	6,941,200.00	
WHARF(HOLDING)	134,000	26.70	3,577,800.00	
WHEELOCK & COMPANY LTD	98,000	53.70	5,262,600.00	
小計銘柄数：42			413,130,104.53	
			(5,998,649,117)	

	組入時価比率：1.3%			1.3%
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	161,000	3.21	516,810.00
	KEPPEL CORP.	162,000	7.47	1,210,140.00
	SEMBCORP INDUSTRIES	99,040	3.04	301,081.60
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	270,000	1.50	405,000.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	63,040	10.65	671,376.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	250,000	1.93	482,500.00
	SATS LTD	77,000	5.22	401,940.00
	GENTING SINGAPORE PLC	720,000	1.31	943,200.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	187,000	2.66	497,420.00
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	40.43	404,300.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.37	352,507.50
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	175,000	3.09	540,750.00
	DBS GROUP HLDGS	202,000	24.72	4,993,440.00
	OCBC-ORD	355,000	12.29	4,362,950.00
	UNITED OVERSEAS BANK	149,000	25.73	3,833,770.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	925,000	3.59	3,320,750.00
	STARHUB LTD	69,000	2.88	198,720.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	93,000	7.43	690,990.00
	CAPITALAND LIMITED	285,000	3.51	1,000,350.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	51,000	12.23	623,730.00
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	302,000	3.36	1,014,720.00	
UOL GROUP LIMITED	48,700	8.63	420,281.00	
小計	銘柄数：22			27,186,726.10 (2,293,200,346)
	組入時価比率：0.5%			0.5%
新シケル	FRUTAROM	4,800	318.00	1,526,400.00
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	50,000	14.03	701,500.00
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,800	471.00	1,318,800.00
	BANK HAPOALIM BM	125,000	25.11	3,138,750.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	161,000	20.65	3,324,650.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	63.50	1,079,500.00
	NICE LTD	6,800	313.70	2,133,160.00
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	204,000	5.37	1,095,888.00

	AZRIELI GROUP	4,100	195.50	801,550.00	
小計	銘柄数：9			15,120,198.00	
				(491,708,838)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				457,698,952,510	
				(457,698,952,510)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(平成29年12月26日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	208,690.00	
	小計	銘柄数：1	509,000	208,690.00	
				(23,661,272)	
		組入時価比率：0.0%		0.2%	
	合計			23,661,272	
				(23,661,272)	
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	42,800	865,416.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,100	1,307,546.00	
		AMERICAN TOWER CORP	48,100	6,765,746.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	132,000	1,590,600.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,600	2,778,672.00	
		BOSTON PROPERTIES	17,700	2,253,918.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	37,000	671,920.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,500	954,555.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	59,000	693,250.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	45,600	4,949,880.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,200	2,574,736.00	
		DUKE REALTY CORP	38,900	1,044,854.00	
		EQUINIX INC	8,770	3,916,682.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	41,500	2,647,700.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,590	1,816,970.10	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	14,100	1,214,292.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,900	1,030,081.00	

	GGP INC	68,200	1,595,880.00	
	HCP INC	51,600	1,324,572.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	82,000	1,651,480.00	
	INVITATION HOMES INC	34,000	792,200.00	
	IRON MOUNTAIN INC	27,900	1,050,714.00	
	KIMCO REALTY CORP	44,400	800,088.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,900	725,517.00	
	MACERICH CO /THE	14,200	925,840.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,400	1,236,900.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	17,100	724,014.00	
	PROLOGIS INC	59,700	3,810,651.00	
	PUBLIC STORAGE	17,640	3,633,310.80	
	REALTY INCOME CORP	30,000	1,675,500.00	
	REGENCY CENTERS CORP	17,000	1,157,530.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	13,800	2,211,036.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	35,200	5,880,864.00	
	SL GREEN REALTY CORP	11,000	1,100,440.00	
	UDR INC	30,800	1,175,328.00	
	VENTAS INC	40,200	2,417,628.00	
	VEREIT INC	109,000	852,380.00	
	VORNADO REALTY TRUST	18,800	1,451,360.00	
	WELLTOWER INC	41,400	2,624,760.00	
	WEYERHAEUSER CO	85,000	2,969,900.00	
小計	銘柄数：40	1,438,600	78,864,710.90	
			(8,941,680,921)	
	組入時価比率：1.9%		76.3%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	286,552.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	422,331.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6,900	211,623.00	
小計	銘柄数：3	37,400	920,506.00	
			(82,044,699)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	4,000	375,360.00	
	GECINA SA	5,000	758,000.00	
	ICADE	3,700	299,552.00	
	KLEPIERRE	24,900	900,384.00	

小計	UNIBAIL RODAMCO-NA	11,280	2,376,132.00	
	銘柄数：5	48,880	4,709,428.00	(633,889,008)
	組入時価比率：0.1%			5.4%
英ポンド	BRITISH LAND	114,000	768,360.00	
	HAMMERSON PLC	89,000	475,260.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	80,625	795,768.75	
	SEGRO PLC	118,000	680,860.00	
小計	銘柄数：4	401,625	2,720,248.75	(412,416,912)
	組入時価比率：0.1%			3.5%
豪ドル	DEXUS	113,000	1,123,220.00	
	GOODMAN GROUP	200,000	1,720,000.00	
	GPT GROUP	203,000	1,063,720.00	
	LENDLEASE GROUP	61,000	998,570.00	
	MIRVAC GROUP	430,000	1,032,000.00	
	SCENTRE GROUP	612,000	2,558,160.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	274,000	1,252,180.00	
	VICINITY CENTRES	373,000	1,036,940.00	
	WESTFIELD CORP	220,000	2,068,000.00	
小計	銘柄数：9	2,486,000	12,852,790.00	(1,125,133,236)
	組入時価比率：0.2%			9.6%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,846,000.00	
	LINK REIT	252,000	17,992,800.00	
小計	銘柄数：2	512,000	19,838,800.00	(288,059,376)
	組入時価比率：0.1%			2.5%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	282,000	755,760.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	299,972	572,946.52	
	CAPITALAND MALL TRUST	249,900	529,788.00	
	SUNTEC REIT	300,000	636,000.00	
小計	銘柄数：4	1,131,872	2,494,494.52	(210,410,612)
	組入時価比率：0.0%			1.8%
合計			11,693,634,764	

		(11,693,634,764)	
合計		11,717,296,036	(11,717,296,036)

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年12月26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	4,898,144,373	-	4,922,576,145	24,431,772
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	181,701,296	-	181,760,200	58,904
米ドル	130,328,603	-	130,357,500	28,897
カナダドル	15,124,900	-	15,150,400	25,500
英ポンド	15,168,394	-	15,160,000	8,394
スイスフラン	11,459,330	-	11,464,000	4,670
豪ドル	9,620,069	-	9,628,300	8,231
合計	-	-	-	24,490,676

(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。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成29年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	480,982,746
コール・ローン	23,756,943
株式	29,892,031,382
投資証券	135,211,656
派生商品評価勘定	13,501,752
未収入金	4,483,347
未収配当金	20,716,904
差入委託証拠金	174,454,465
流動資産合計	30,745,139,195
資産合計	30,745,139,195
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,558,628
未払利息	27
その他未払費用	1,768,800
流動負債合計	3,327,455
負債合計	3,327,455
純資産の部	
元本等	
元本	22,653,411,356
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	8,088,400,384
元本等合計	30,741,811,740
純資産合計	30,741,811,740
負債純資産合計	30,745,139,195

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>
-------------------	---

	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。
	為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 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	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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29年12月26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	1.3570円
(10,000口当たり純資産額)	(13,570円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</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>

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月26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。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年12月26日現在

平成29年12月26日現在	
期首	平成28年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	17,122,250,107円
同期中における追加設定元本額	6,941,743,788円
同期中における一部解約元本額	1,410,582,539円
期末元本額	22,653,411,356円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	28,443,554円
野村資産設計ファンド2020	32,753,811円
野村資産設計ファンド2025	47,060,398円
野村資産設計ファンド2030	49,612,505円
野村資産設計ファンド2035	36,955,853円
野村資産設計ファンド2040	97,495,385円
野村資産設計ファンド2045	11,102,844円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,290,275,813円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	171,039,645円

野村資産設計ファンド2050		15,629,676円
野村ターゲットデートファンド2016	2026 - 2028年目標型	6,512,564円
野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	1,593,781円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	1,153,061円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	700,682円
インデックス・ブレンド(タイプ)		884,047円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,108,723円
インデックス・ブレンド(タイプ)		4,844,205円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,062,733円
インデックス・ブレンド(タイプ)		4,072,216円
野村つみたて外国株投信		41,742,855円
野村外国株(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)		927,958円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)		95,651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)		105,294,366円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)		474,019,295円
野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)		18,228,662,633円
野村資産設計ファンド(DC)2030		87,520円
野村資産設計ファンド(DC)2040		124,786円
野村資産設計ファンド(DC)2050		154,796円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年12月26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	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	12,600	13.83	174,258.00	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	21,230	56.92	1,208,411.60	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	4,450	119.90	533,555.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	265,700	4.46	1,185,287.70	
		ROSNEFT OJSC - GDR	55,870	4.97	277,953.25	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	67,300	4.79	322,636.20	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	12,310	48.98	602,943.80	
		TRANSNEFT PJSC	21	3,122.57	65,574.05	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	5,010	15.30	76,653.00	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	5,000	59.64	298,200.00	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	8,600	13.70	117,820.00	
		MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	8,400	9.63	80,892.00	

NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	6,020	24.95	150,199.00
PJSC ALROSA	140,000	1.29	181,554.80
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	31,879	18.48	589,123.92
POLYUS PJSC-REG S-GDR	2,700	37.95	102,465.00
SEVERSTAL-GDR REG S	11,380	14.98	170,472.40
SOUTHERN COPPER CORP	4,242	46.21	196,022.82
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	15,800	13.72	216,776.00
DP WORLD LTD	8,460	23.55	199,233.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	18,800	40.87	768,356.00
CTIP.COM INTERNATIONAL -ADR	19,700	45.15	889,455.00
JD.COM INC-ADR	33,000	42.19	1,392,270.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	21,800	12.21	266,178.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	18,420	26.55	489,051.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	29.15	116,600.00
BANCO DE CHILE-ADR	1,951	93.64	182,691.64
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	8,196	31.08	254,731.68
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	5,500	39.63	217,965.00
CREDICORP LTD	3,400	206.84	703,256.00
ITAU CORPBANCA-ADR	5,466	13.13	71,768.58
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	533,000	3.85	2,053,286.56
STATE BANK OF INDIA-GDR	8,700	49.40	429,780.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	124,140	1.77	219,976.08
58.COM INC-ADR	4,400	70.38	309,672.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	57,100	176.29	10,066,159.00
AUTOHOME INC-ADR	2,600	64.97	168,922.00
BAIDU INC - SPON ADR	13,500	239.05	3,227,175.00
MOMO INC-SPON ADR	5,500	25.42	139,810.00
NETEASE INC-ADR	3,900	365.63	1,425,957.00
SINA CORP	2,900	104.26	302,354.00
WEIBO CORP-SPON ADR	2,500	106.82	267,050.00
YY INC-ADR	2,000	114.60	229,200.00
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	23,950	10.42	249,559.00
ENEL AMERICAS S.A-ADR	28,141	10.67	300,264.47
ENEL CHILE SA-ADR	20,925	5.56	116,343.00
INTER RAO UES PJSC	1,669,000	0.05	98,170.58

	PJSC RUSHYDRO	4,691,000	0.01	58,872.05	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	67,570	1.89	128,227.58	
	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	6,600	91.75	605,550.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	13,700	29.40	402,780.00	
	ENEL GENERACION CHILE-SP ADR	5,500	26.30	144,650.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	40,840	1.40	57,461.88	
小計	銘柄数：53			33,103,574.64	
				(3,753,283,292)	
	組入時価比率：12.2%			12.6%	
メキシコペソ	MEXICHEM SAB DE CV-*	48,658	48.11	2,340,936.38	
	CEMEX SAB - CPO	733,185	14.71	10,785,151.35	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	196,083	62.27	12,210,088.41	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,610	389.06	2,571,686.60	
	ALFA S.A.B.-A	140,100	21.23	2,974,323.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	20,700	62.14	1,286,298.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	11,200	353.69	3,961,328.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	17,400	199.94	3,478,956.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	10,000	194.36	1,943,600.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	124,300	74.56	9,267,808.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	7,600	122.18	928,568.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	253,000	46.01	11,640,530.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	20,900	132.00	2,758,800.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	25,995	133.87	3,479,950.65	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	95,600	179.48	17,158,288.00	
	GRUMA S.A.B.-B	10,500	245.12	2,573,760.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	74,500	42.28	3,149,860.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	32,300	27.62	892,126.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	79,500	33.29	2,646,555.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	93,100	28.07	2,613,317.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	124,600	104.56	13,028,176.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	114,700	31.37	3,598,139.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,676,900	16.78	28,138,382.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	26,100	97.03	2,532,483.00	
	GENTERA SAB DE CV	51,300	16.14	827,982.00	
小計	銘柄数：25			146,787,092.39	

				(842,557,910)	
	組入時価比率：2.7%			2.8%	
リアル	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	6,700	41.00	274,700.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	151,700	16.59	2,516,703.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	199,100	15.75	3,135,825.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	17,700	73.88	1,307,676.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,400	43.21	362,964.00	
	KLABIN SA-UNIT	30,200	17.70	534,540.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	30,300	8.05	243,915.00	
	GERDAU SA PFD NPV	56,100	12.44	697,884.00	
	VALE SA	155,521	39.79	6,188,180.59	
	FIBRIA CELULOSE SA	12,473	48.40	603,693.20	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	20,700	18.64	385,848.00	
	EMBRAER SA	33,500	19.91	666,985.00	
	WEG SA	25,980	24.27	630,534.60	
	LOCALIZA RENT A CAR	24,834	21.40	531,447.60	
	RUMO SA	58,100	12.32	715,792.00	
	CCR SA	59,100	15.90	939,690.00	
	LOJAS AMERICANAS S.A.(PREF)	38,792	15.84	614,465.28	
	LOJAS RENNER S.A.	35,650	33.70	1,201,405.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,000	14.74	280,060.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	8,403	73.91	621,065.73	
	RAIA DROGASIL SA	11,600	89.98	1,043,768.00	
	AMBEV SA	236,956	21.03	4,983,184.68	
	BRF SA	22,700	36.36	825,372.00	
	JBS SA	37,300	9.18	342,414.00	
	M DIAS BRANCO SA	5,500	48.64	267,520.00	
	NATURA COSMETICOS SA	8,700	31.92	277,704.00	
	ODONTOPREV S.A.	10,600	15.30	162,180.00	
	QUALICORP SA	10,300	28.86	297,258.00	
	HYPERMARCAS S.A	17,500	36.00	630,000.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	45,960	31.60	1,452,336.00	
	BANCO BRADESCO SA - PREF	151,385	34.07	5,157,686.95	
	BANCO DO BRASIL SA	43,100	31.30	1,349,030.00	
	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	20,200	31.80	642,360.00	

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	159,594	42.53	6,787,532.82	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	193,507	10.96	2,120,836.72	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	36,800	28.21	1,038,128.00	
	PORTO SEGURO SA	4,900	35.79	175,371.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	9,149	18.65	170,628.85	
	CIELO SA	58,563	23.12	1,353,976.56	
	TELEFONICA BRASIL-PREF	22,105	49.36	1,091,102.80	
	TIM PARTICIPACOES SA	37,552	12.70	476,910.40	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	11,800	22.29	263,022.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	11,100	18.78	208,458.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	40,229	6.59	265,109.11	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	15,600	13.50	210,600.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	9,800	63.96	626,808.00	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500	20.79	155,925.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	15,300	33.84	517,752.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	101,633	22.29	2,265,399.57	
	KROTON EDUCACIONAL SA	71,556	17.81	1,274,412.36	
	ENGIE BRASIL SA	7,100	35.31	250,701.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	37,800	12.32	465,696.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,800	70.40	267,520.00	
小計	銘柄数：53			59,870,077.82	
				(2,033,187,842)	
	組入時価比率：6.6%			6.8%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	22,700	9,777.80	221,956,060.00	
	EMPRESAS CMPC SA	60,751	2,094.10	127,218,669.10	
	S.A.C.I. FALABELLA	38,600	6,137.00	236,888,200.00	
	CENCOSUD SA	66,638	1,806.00	120,348,228.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	10,300	3,014.40	31,048,320.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,223	41,817.00	92,959,191.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,972	6,900.00	48,106,800.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	125,600	402.51	50,555,256.00	
	AES GENER SA	121,560	201.57	24,502,849.20	
	COLBUN SA	374,000	140.00	52,360,000.00	
小計	銘柄数：10			1,005,943,573.30	
				(183,182,324)	

	組入時価比率：0.6%			0.6%	
コロンビアペソ	CEMENTOS ARGOS SA	21,600	11,400.00	246,240,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	15,600	20,780.00	324,168,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	12,000	29,600.00	355,200,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	163,400	1,295.00	211,603,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	10,600	40,680.00	431,208,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF	5,200	38,780.00	201,656,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	18,600	14,280.00	265,608,000.00	
	小計	銘柄数：7			2,035,683,000.00
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ユーロ	TITAN CEMENT CO	2,000	22.50	45,000.00	
	OPAP SA	11,030	10.55	116,366.50	
	FF GROUP	1,300	19.40	25,220.00	
	JUMBO SA	5,202	15.00	78,030.00	
	ALPHA BANK A.E.	66,409	1.84	122,790.24	
	EUROBANK ERGASIAS SA	85,678	0.82	70,684.35	
	NATIONAL BANK OF GREECE	297,986	0.31	94,163.57	
	PIRAEUS BANK S.A.	13,081	3.22	42,120.82	
	HELLENIC TELECOM	12,860	11.58	148,918.80	
	小計	銘柄数：9			743,294.28
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	6,730	120.40	810,292.00	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	28,600	7.50	214,500.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	67,250	9.77	657,032.50	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	10,040	32.42	325,496.80	
	KOC HLDGS	40,504	17.58	712,060.32	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	42,345	4.58	193,940.10	
	TURK HAVA YOLLARI AO	26,146	15.00	392,190.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	6,760	21.40	144,664.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	59.35	197,042.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	5,920	31.62	187,190.40	
	ARCELIK A.S	10,793	20.54	221,688.22	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	10,860	77.30	839,478.00	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT	10,220	24.60	251,412.00	

	SANAYI I				
	COCA-COLA ICECEK AS	2,880	33.74	97,171.20	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	6,040	19.65	118,686.00	
	AKBANK T.A.S	109,590	9.39	1,029,050.10	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	122,710	10.17	1,247,960.70	
	TURKIYE HALK BANKASI	32,890	10.24	336,793.60	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	76,510	6.72	514,147.20	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	31,720	6.46	204,911.20	
	YAPI VE KREDI BANKASI A.S.	43,660	4.23	184,681.80	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	47,880	10.75	514,710.00	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	22,200	6.33	140,526.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	59,780	14.82	885,939.60	
小計	銘柄数：24			10,421,563.74	
				(310,458,383)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,010	906.10	3,633,461.00	
	MONETA MONEY BANK AS	20,500	82.10	1,683,050.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	2,750	271.50	746,625.00	
	CEZ AS	7,970	500.00	3,985,000.00	
小計	銘柄数：4			10,048,136.00	
				(52,451,269)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	16,720	2,975.00	49,742,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	6,910	6,806.00	47,029,460.00	
	OTP BANK NYRT	11,860	10,550.00	125,123,000.00	
小計	銘柄数：3			221,894,460.00	
				(95,902,785)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	4,709	58.33	274,675.97	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	15,590	111.15	1,732,828.50	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	80,090	6.11	489,349.90	
	GRUPA AZOTY SA	2,330	67.76	157,880.80	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,570	95.00	244,150.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	6,630	109.25	724,327.50	
	CCC SA	1,520	278.10	422,712.00	
	LPP SA	60	8,949.45	536,967.00	

	CYFROWY POLSAT SA	11,670	24.35	284,164.50	
	DINO POLSKA SA	2,410	74.57	179,713.70	
	ALIOR BANK SA	4,843	78.70	381,144.10	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1,250	77.92	97,400.00	
	BANK MILLENNIUM SA	26,300	8.65	227,495.00	
	BANK PEKAO SA	7,640	126.85	969,134.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	1,670	394.00	657,980.00	
	MBANK	710	477.00	338,670.00	
	PKO BANK POLSKI SA	47,630	43.25	2,059,997.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	29,550	41.25	1,218,937.50	
	CD PROJEKT RED SA	3,300	100.15	330,495.00	
	ORANGE POLSKA SA	28,450	5.95	169,277.50	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	5,600	33.50	187,600.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	43,880	11.90	522,172.00	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	55,440	3.01	166,874.40	
小計	銘柄数：23			12,373,946.87	
				(397,079,955)	
	組入時価比率：1.3%			1.3%	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	72,000	7.40	532,800.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,278,900	5.76	7,366,464.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	163,500	19.90	3,253,650.00	
	CNOOC LTD	873,000	11.08	9,672,840.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	144,000	8.18	1,177,920.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,068,000	5.49	5,863,320.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	8.61	826,560.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	148,000	4.49	664,520.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	63,000	35.85	2,258,550.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	147,000	6.63	974,610.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	5.49	1,152,900.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	4.75	855,000.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	60,000	11.76	705,600.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	271,000	2.77	750,670.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	9.65	752,700.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	77,000	12.70	977,900.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	112,000	3.97	444,640.00	

CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	208,000	8.75	1,820,000.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	179,000	5.74	1,027,460.00
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	96,000	8.98	862,080.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	101,250	10.76	1,089,450.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	3.24	408,240.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	28,500	50.65	1,443,525.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	27,000	45.95	1,240,650.00
CITIC LTD	291,000	11.08	3,224,280.00
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	133,940	17.34	2,322,519.60
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	19,000	21.80	414,200.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	83,000	18.14	1,505,620.00
CRRC CORP LTD-H	223,350	7.90	1,764,465.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	24.00	768,000.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	89,800	8.28	743,544.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	122,000	11.02	1,344,440.00
AIR CHINA LIMITED-H	76,000	9.32	708,320.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	76,000	8.18	621,680.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	66,000	11.64	768,240.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	70,000	19.84	1,388,800.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	68,000	7.97	541,960.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	48,000	11.66	559,680.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	64,000	8.25	528,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	24,800	32.10	796,080.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	43,000	18.26	785,180.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	160,000	19.70	3,152,000.00
BYD CO LTD-H	30,000	64.55	1,936,500.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	136,000	9.31	1,266,160.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	240,000	25.65	6,156,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	166,500	8.73	1,453,545.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	109,922	18.00	1,978,596.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	66,000	21.60	1,425,600.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	51,000	33.35	1,700,850.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	40,000	72.55	2,902,000.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	580,000	0.99	574,200.00

GOME RETAIL HODINGS LTD	523,360	0.94	491,958.40
SUN ART RETAIL GROUP LTD	127,000	8.28	1,051,560.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	75,333	28.65	2,158,290.45
TSING TAO BREWERY CO-H	14,000	39.65	555,100.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.42	60,480.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	137,000	23.50	3,219,500.00
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	96,000	15.52	1,489,920.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	236,000	6.55	1,545,800.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	35,500	85.10	3,021,050.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	72,000	5.50	396,000.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	32,700	21.05	688,335.00
SINOPHARM GROUP CO-H	57,200	33.25	1,901,900.00
3SBIO, INC	51,000	15.10	770,100.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	62,000	17.98	1,114,760.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	10.28	956,040.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	244,000	15.96	3,894,240.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	24,500	47.85	1,172,325.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	155,000	2.84	440,200.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	226,000	13.00	2,938,000.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,314,000	3.64	4,782,960.00
BANK OF CHINA LTD-H	3,892,000	3.80	14,789,600.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	448,790	5.78	2,594,006.20
CHINA CITIC BANK-H	420,000	4.88	2,049,600.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,189,000	7.05	29,532,450.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	134,000	3.64	487,760.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	199,192	30.90	6,155,032.80
CHINA MINSHENG BANKING-H	289,000	7.81	2,257,090.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	5.48	750,760.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,679,000	6.28	23,104,120.00
FAR EAST HORIZON LTD	106,000	6.72	712,320.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	367,000	24.65	9,046,550.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	132,400	37.95	5,024,580.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	78,072	29.65	2,314,834.80

NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	37,400	52.35	1,957,890.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	339,000	3.89	1,318,710.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	232,280	15.22	3,535,301.60	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	257,500	82.90	21,346,750.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	282,400	405.80	114,597,920.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	48,000	23.45	1,125,600.00	
KINGSOFT CORP LTD	35,000	23.85	834,750.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	15.08	497,640.00	
ZTE CORP-H	33,852	29.00	981,708.00	
LENOVO GROUP LTD	340,000	4.58	1,557,200.00	
MEITU INC	63,000	10.38	653,940.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	35,500	142.50	5,058,750.00	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	32,000	40.90	1,308,800.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	36,000	99.55	3,583,800.00	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	538,200	1.38	742,716.00	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD	367,000	0.10	39,269.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	143,000	12.02	1,718,860.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	126,400	5.22	659,808.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	666,000	3.75	2,497,500.00	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	302,000	10.50	3,171,000.00	
CHINA MOBILE LTD	306,000	78.00	23,868,000.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	82,000	22.10	1,812,200.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	40,000	28.10	1,124,000.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	38,000	57.15	2,171,700.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	227,000	6.11	1,386,970.00	
GUANGDONG INVESTMENT	154,000	10.46	1,610,840.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	443,000	2.83	1,253,690.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	17.26	828,480.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	151,500	5.60	848,400.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	490,000	3.59	1,759,100.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	123,000	16.08	1,977,840.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	63,400	15.60	989,040.00	

	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	172,400	11.34	1,955,016.00	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	74,600	15.50	1,156,300.00	
	CGN POWER CO LTD-H	480,000	2.14	1,027,200.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	159,000	5.48	871,320.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDING	86,000	14.36	1,234,960.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	184,000	4.95	910,800.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	226,000	2.61	589,860.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	156,000	3.91	609,960.00	
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	76,000	10.90	828,400.00	
	CHINA EVERGRANDE GROUP	161,000	24.85	4,000,850.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	182,000	3.22	586,040.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	196,000	24.40	4,782,400.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	140,444	22.15	3,110,834.60	
	CHINA VANKE CO LTD-H	53,700	29.95	1,608,315.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	274,380	13.40	3,676,692.00	
	FULLSHARE HOLDINGS LIMITED	307,500	3.24	996,300.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	50,400	16.94	853,776.00	
	LONGFOR PROPERTIES	80,000	19.04	1,523,200.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	56,000	16.58	928,480.00	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	5.25	766,500.00	
	SOHO CHINA LTD	106,000	4.48	474,880.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	103,000	30.25	3,115,750.00	
小計	銘柄数：138			461,345,737.45	
				(6,698,740,107)	
	組入時価比率：21.8%			22.5%	
リング	DIALOG GROUP BHD	162,144	2.47	400,495.68	
	SAPURA ENERGY BHD	207,500	0.71	147,325.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	11,300	24.24	273,912.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	118,400	7.60	899,840.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	64,300	5.02	322,786.00	
	GAMUDA BERHAD	81,600	4.99	407,184.00	
	IJM CORP	152,600	2.93	447,118.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	9.60	324,480.00	
	SIME DARBY BERHAD	122,800	2.10	257,880.00	
	AIRASIA BHD	66,700	3.31	220,777.00	

MISC BHD	67,260	7.13	479,563.80
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	41,660	8.55	356,193.00
WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.74	192,236.00
UMW HOLDINGS BHD	21,300	5.08	108,204.00
GENTING BHD	124,000	9.10	1,128,400.00
GENTING MALAYSIA BHD	140,600	5.59	785,954.00
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	69,300	2.61	180,873.00
FELDA GLOBAL VENTURES	73,300	1.70	124,610.00
GENTING PLANTATIONS BHD	8,500	10.74	91,290.00
IOI CORP	111,800	4.55	508,690.00
KUALA LUMPUR KEPONG	23,700	24.68	584,916.00
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,900	102.00	295,800.00
PPB GROUP BERHAD	23,800	16.90	402,220.00
SIME DARBY PLANTATION BHD	122,800	5.43	666,804.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	6,000	36.44	218,640.00
HARTALEGA HOLDINGS BHD	29,700	10.74	318,978.00
IHH HEALTHCARE BHD	105,600	5.81	613,536.00
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	54,800	4.07	223,036.00
AMMB HOLDING	80,800	4.33	349,864.00
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	228,800	6.49	1,484,912.00
HONG LEONG BANK	30,760	16.64	511,846.40
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	9,722	17.60	171,107.20
MALAYAN BANKING	207,500	9.48	1,967,100.00
PUBLIC BANK BHD	147,060	20.70	3,044,142.00
RHB BANK BHD	33,823	4.93	166,747.39
TELEKOM MALAYSIA	50,000	6.50	325,000.00
AXIATA GROUP BERHAD	144,800	5.39	780,472.00
DIGI.COM BERHAD	149,400	4.80	717,120.00
MAXIS BHD	96,300	6.00	577,800.00
TENAGA NASIONAL	167,200	14.98	2,504,656.00
PETRONAS GAS BERHAD	36,500	17.10	624,150.00
YTL CORPORATION	210,847	1.31	276,209.57
YTL POWER INTL	73,514	1.25	91,892.50
IOI PROPERTIES GROUP BHD	70,540	1.82	128,382.80
SIME DARBY PROPERTY BHD	122,800	1.41	173,148.00

	SP SETIA BHD	51,300	3.34	171,342.00	
小計	銘柄数：46			25,047,633.34	
				(696,324,206)	
	組入時価比率：2.3%			2.3%	
パーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	88,100	18.80	1,656,280.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	50,600	51.00	2,580,600.00	
	IRPC PCL - NVDR	527,900	6.95	3,668,905.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	75,500	100.50	7,587,750.00	
	PTT PCL-NVDR	51,800	448.00	23,206,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	60,300	103.50	6,241,050.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	68,367	54.50	3,726,001.50	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	112,694	85.25	9,607,163.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	5,200	490.00	2,548,000.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC (F)	15,300	490.00	7,497,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	57,500	61.75	3,550,625.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	311,600	8.40	2,617,440.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	208,600	66.50	13,871,900.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	341,700	7.80	2,665,260.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	116,200	43.50	5,054,700.00	
	ROBINSON PCL -NVDR	26,100	72.50	1,892,250.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	189,497	13.00	2,463,461.00	
	CP ALL PCL-NVDR	250,100	76.50	19,132,650.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	151,400	24.70	3,739,580.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	80,400	19.30	1,551,720.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	208,300	21.20	4,415,960.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	16,200	193.50	3,134,700.00	
	BANGKOK BANK(F)	13,500	215.00	2,902,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	36,500	234.00	8,541,000.00	
	KASIKORNBANK PCL(F)	53,600	237.00	12,703,200.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	184,250	19.40	3,574,450.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,300	152.00	13,421,600.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	649,400	3.00	1,948,200.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	21,000	74.50	1,564,500.00	
	KCE ELECTRONICS-NVDR	10,700	84.75	906,825.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	474,200	6.20	2,940,040.00	

	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	51,200	187.00	9,574,400.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	6,700	225.00	1,507,500.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	26,100	81.75	2,133,675.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	62,700	82.75	5,188,425.00	
小計	銘柄数：35			199,315,711.00	
				(689,632,360)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	100,500	72.70	7,306,350.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	218,900	15.94	3,489,266.00	
	DMCI HOLDINGS INC	178,000	14.28	2,541,840.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	146,000	73.80	10,774,800.00	
	SM INVESTMENTS CORP	11,415	984.50	11,238,067.50	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	26,960	105.00	2,830,800.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	19,500	247.00	4,816,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	41,800	151.00	6,311,800.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	35,849	106.00	3,799,994.00	
	BDO UNIBANK INC	93,298	153.60	14,330,572.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	31,445	98.00	3,081,610.00	
	SECURITY BANK CORP	12,000	252.00	3,024,000.00	
	AYALA CORPORATION	12,472	1,010.00	12,596,720.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	3,950	1,268.00	5,008,600.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	6.73	5,032,694.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,470	1,854.00	2,725,380.00	
	PLDT INC	3,970	1,470.00	5,835,900.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	11,000	320.80	3,528,800.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	40.90	3,137,030.00	
	AYALA LAND LTD	373,600	43.25	16,158,200.00	
	MEGAWORLD CORP	558,000	5.11	2,851,380.00	
	ROBINSONS LAND CO	73,200	21.20	1,551,840.00	
	SM PRIME HLDGS	460,575	37.00	17,041,275.00	
小計	銘柄数：23			149,013,419.30	
				(338,260,461)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	691,400	1,890.00	1,306,746,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	85,050	34,250.00	2,912,962,500.00	

	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	83,700	20,200.00	1,690,740,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	148,900	9,825.00	1,462,942,500.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	258,500	2,160.00	558,360,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	75,300	6,350.00	478,155,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	113,559	6,300.00	715,421,700.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,018,000	8,200.00	8,347,600,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	253,500	2,480.00	628,680,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	112,200	10,875.00	1,220,175,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	119,600	9,000.00	1,076,400,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	216,900	7,625.00	1,653,862,500.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	319,900	3,180.00	1,017,282,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	23,800	80,950.00	1,926,610,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	485,300	4,650.00	2,256,645,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	78,100	54,125.00	4,227,162,500.00	
	KALBE FARMA PT	1,100,000	1,650.00	1,815,000,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	483,700	21,500.00	10,399,550,000.00	
	BANK DANAMON PT	165,196	6,000.00	991,176,000.00	
	BANK MANDIRI	939,600	7,675.00	7,211,430,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	358,300	9,850.00	3,529,255,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	2,785,500	3,460.00	9,637,830,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	208,000	3,500.00	728,000,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	2,537,800	4,300.00	10,912,540,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	88,700	6,350.00	563,245,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	138,200	2,880.00	398,016,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	593,500	1,740.00	1,032,690,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	293,700	1,690.00	496,353,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	920,000	675.00	621,000,000.00	
小計	銘柄数：29			79,815,829,700.00	
				(670,452,969)	
	組入時価比率：2.2%			2.2%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,530	62,100.00	157,113,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,280	124,500.00	283,860,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,190	204,000.00	650,760,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	5,150	29,950.00	154,242,500.00	
	HYOSUNG CORPORATION	960	136,500.00	131,040,000.00	

KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	96,800.00	96,606,400.00
LG CHEM LTD - PREFERRED	384	244,500.00	93,888,000.00
LG CHEMICALS LTD	2,286	393,500.00	899,541,000.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	730	360,500.00	263,165,000.00
OCI COMPANY LTD	860	127,500.00	109,650,000.00
HYUNDAI STEEL CO	3,949	57,400.00	226,672,600.00
KOREA ZINC CO LTD	460	483,000.00	222,180,000.00
POSCO	3,740	337,000.00	1,260,380,000.00
HANWHA TECHWIN CO LTD	1,430	34,200.00	48,906,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,370	46,200.00	155,694,000.00
KCC CORP	309	379,000.00	117,111,000.00
DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	1,210	81,100.00	98,131,000.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	4,990	5,740.00	28,642,600.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,988	26,900.00	53,477,200.00
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	2,860	38,750.00	110,825,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	3,740	34,900.00	130,526,000.00
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1,770	15,650.00	27,700,500.00
CJ CORP	687	181,500.00	124,690,500.00
HANWHA CORPORATION	1,860	40,700.00	75,702,000.00
LG CORP	4,690	88,000.00	412,720,000.00
LOTTE CORP	1,194	61,900.00	73,908,600.00
SAMSUNG C&T CORP	3,778	123,000.00	464,694,000.00
SK HOLDINGS CO LTD	1,532	278,500.00	426,662,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	1,430	35,100.00	50,193,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,630	134,000.00	218,420,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,007	7,200.00	86,450,400.00
POSCO DAEWOO CORP	1,809	17,850.00	32,290,650.00
SK NETWORKS CO LTD	4,820	6,590.00	31,763,800.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	790	40,000.00	31,600,000.00
S-1 CORPORATION	820	103,000.00	84,460,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	900	136,000.00	122,400,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,576	33,150.00	85,394,400.00
PAN OCEAN CO LTD	8,710	4,955.00	43,158,050.00
CJ LOGISTICS	390	139,500.00	54,405,000.00
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	3,923	54,100.00	212,234,300.00

HANON SYSTEMS	8,590	13,300.00	114,247,000.00
HYUNDAI MOBIS	3,340	260,000.00	868,400,000.00
HYUNDAI WIA CORP	802	63,600.00	51,007,200.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD	7,560	153,000.00	1,156,680,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,920	104,500.00	200,640,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,090	93,200.00	101,588,000.00
KIA MOTORS CORP	12,670	33,100.00	419,377,000.00
COWAY CO LTD	2,690	99,300.00	267,117,000.00
HANSSEM CO LTD	560	181,000.00	101,360,000.00
LG ELECTRONICS INC	5,115	100,000.00	511,500,000.00
KANGWON LAND INC	6,200	34,650.00	214,830,000.00
CHEIL WORLDWIDE INC	3,320	21,350.00	70,882,000.00
CJ E&M CORP	800	95,400.00	76,320,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	600	101,000.00	60,600,000.00
LOTTE SHOPPING CO	544	191,500.00	104,176,000.00
SHINSEGAE CO LTD	327	282,000.00	92,214,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	1,672	82,800.00	138,441,600.00
BGF RETAIL CO LTD /NEW	355	219,500.00	77,922,500.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,650	29,400.00	48,510,000.00
E-MART CO	1,001	270,000.00	270,270,000.00
GS RETAIL CO LTD	1,140	39,850.00	45,429,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	400	367,000.00	146,800,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,131	113,500.00	128,368,500.00
OTTOGI CORPORATION	40	798,000.00	31,920,000.00
KT & G CORP	5,760	120,000.00	691,200,000.00
AMOREPACIFIC CORP	1,650	299,000.00	493,350,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	161,000.00	66,010,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	138,500.00	210,520,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	479	1,178,000.00	564,262,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	683,000.00	71,032,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,680	95,900.00	161,112,000.00
CELLTRION INC	4,040	201,900.00	815,676,000.00
MEDY-TOX INC	220	469,000.00	103,180,000.00
SILLAJEN INC	2,610	81,000.00	211,410,000.00
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	324	573,000.00	185,652,000.00

HANMI SCIENCE CO LTD	487	109,000.00	53,083,000.00	
YUHAN CORPORATION	400	221,000.00	88,400,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	12,887	9,690.00	124,875,030.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	8,359	11,050.00	92,366,950.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	14,545	50,300.00	731,613,500.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	12,450	17,200.00	214,140,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	19,850	62,300.00	1,236,655,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	21,180	50,700.00	1,073,826,000.00	
WOORI BANK	19,010	16,200.00	307,962,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,310	71,500.00	165,165,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,280	6,980.00	92,694,400.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	47,300.00	160,820,000.00	
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	1,610	53,500.00	86,135,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,490	267,500.00	398,575,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	3,600	122,000.00	439,200,000.00	
KAKAO CORP	1,840	129,500.00	238,280,000.00	
NAVER CORP	1,380	862,000.00	1,189,560,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,830	197,500.00	361,425,000.00	
NCSOFT CORPORATION	880	436,500.00	384,120,000.00	
NETMARBLE GAMES CORP	870	183,000.00	159,210,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	4,820	2,485,000.00	11,977,700,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	880	2,002,000.00	1,761,760,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	620	144,000.00	89,280,000.00	
LG.DISPLAY CO LTD	11,540	30,000.00	346,200,000.00	
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	2,920	99,800.00	291,416,000.00	
SAMSUNG SDI CO,LTD	2,685	202,500.00	543,712,500.00	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	487	369,000.00	179,703,000.00	
SK HYNIX INC	29,140	76,700.00	2,235,038,000.00	
KT CORP	880	31,050.00	27,324,000.00	
SK TELECOM CO LTD	1,080	274,000.00	295,920,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER	12,430	38,750.00	481,662,500.00	
KOREA GAS CORPORATION	1,099	42,350.00	46,542,650.00	
SAMSUNG CARD CO	1,360	41,200.00	56,032,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,820	67,400.00	122,668,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	18,677	8,960.00	167,345,920.00	

	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	5,930	14,000.00	83,020,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	35,950.00	128,161,750.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	780	347,000.00	270,660,000.00	
小計	銘柄数：113			43,525,514,500.00	
				(4,583,236,676)	
	組入時価比率：14.9%			15.3%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	72,360	113.00	8,176,680.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	142,998	97.90	13,999,504.20	
	FORMOSA PLASTIC	211,424	96.00	20,296,704.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	241,726	76.50	18,492,039.00	
	ASIA CEMENT	126,980	27.25	3,460,205.00	
	TAIWAN CEMENT	196,323	36.15	7,097,076.45	
	CHINA STEEL	637,544	24.35	15,524,196.40	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	91,000	28.30	2,575,300.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	142,454	26.00	3,703,804.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	6,000	516.00	3,096,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10,082	319.00	3,216,158.00	
	CHINA AIRLINES	133,561	11.80	1,576,019.80	
	EVA AIRWAYS CORP	88,197	15.80	1,393,512.60	
	EVERGREEN MARINE	82,138	16.45	1,351,170.10	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	69,000	23.35	1,611,150.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	88,036	50.70	4,463,425.20	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	315.00	2,205,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	13,752	158.50	2,179,692.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	8,443	284.50	2,402,033.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	14,315	133.00	1,903,895.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	32,000	30.95	990,400.00	
	POU CHEN CORP	109,468	38.00	4,159,784.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,785	50.00	1,039,250.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	13,000	345.00	4,485,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	27,816	274.00	7,621,584.00	
	STANDARD FOODS CORP	27,079	72.20	1,955,103.80	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	238,836	65.00	15,524,340.00	
	TAI MED BIOLOGICS INC	8,000	183.50	1,468,000.00	

CHANG HWA COMMERCIAL BANK	223,948	16.45	3,683,944.60
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	710,789	10.15	7,214,508.35
CTBC FINANCIAL HOLDING	845,212	20.10	16,988,761.20
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	475,565	18.80	8,940,622.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	473,308	19.35	9,158,509.80
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	368,036	16.70	6,146,201.20
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	542,380	23.80	12,908,644.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	488,715	9.66	4,720,986.90
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	434,128	13.75	5,969,260.00
TAIWAN BUSINESS BANK	172,451	8.37	1,443,414.87
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	385,789	16.45	6,346,229.05
CHAILEASE HOLDING CO LTD	64,632	85.00	5,493,720.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	333,541	50.80	16,943,882.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	413,510	53.50	22,122,785.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	120,949	29.85	3,610,327.65
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	440,547	10.45	4,603,716.15
ACER INC	123,767	24.50	3,032,291.50
ADVANTECH CO.,LTD.	18,594	209.50	3,895,443.00
ASUSTEK COMPUTER INC	33,805	274.00	9,262,570.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	33,840	329.50	11,150,280.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	20,498	74.90	1,535,300.20
COMPAL ELECTRONICS	195,590	21.15	4,136,728.50
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	43,834	83.70	3,668,905.80
HTC CORPORATION	32,792	74.00	2,426,608.00
INVENTEC CO.,LTD	136,911	23.70	3,244,790.70
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	108,897	39.90	4,344,990.30
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	33,000	75.00	2,475,000.00
PEGATRON CORP	100,692	71.80	7,229,685.60
QUANTA COMPUTER INC	127,684	61.40	7,839,797.60
WISTRON CORP	114,993	23.75	2,731,083.75
AU OPTRONICS CORP	398,008	12.45	4,955,199.60
DELTA ELECTRONICS INC	96,681	140.50	13,583,680.50
GENERAL INTERFACE SOLUTION H	8,000	213.50	1,708,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	778,812	92.10	71,728,585.20
INNOLUX CORP	420,322	12.50	5,254,025.00

	LARGAN PRECISION CO LTD	5,040	4,000.00	20,160,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	59,566	40.00	2,382,640.00	
	WPG HOLDINGS CO LTD	83,030	39.50	3,279,685.00	
	YAGEO CORPORATION	10,000	345.00	3,450,000.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	20,410	65.90	1,345,019.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	338,317	37.90	12,822,214.30	
	GLOBALWAFERS CO LTD	11,000	396.00	4,356,000.00	
	MACRONIX INTERNATIONAL	89,000	40.50	3,604,500.00	
	MEDIATEK INC	73,538	287.00	21,105,406.00	
	NANYA TECHNOLOGY CO	33,000	76.20	2,514,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	26,058	114.00	2,970,612.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	6,306	302.50	1,907,565.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	34,147	87.30	2,981,033.10	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	21,417	108.50	2,323,744.50	
	SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES	104,220	49.95	5,205,789.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,222,000	228.50	279,227,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	598,500	14.45	8,648,325.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	46,000	66.00	3,036,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	17,000	293.50	4,989,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	144,000	23.75	3,420,000.00	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	108,000	9.69	1,046,520.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	194,065	106.00	20,570,890.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	85,000	72.50	6,162,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	76,200	106.50	8,115,300.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	487,377	13.70	6,677,064.90	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	42.00	1,642,620.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	32,678	31.60	1,032,624.80	
小計	銘柄数：90			891,442,658.47	
				(3,369,653,249)	
	組入時価比率：11.0%			11.3%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	37,795	535.15	20,225,994.25	
	COAL INDIA LTD	33,740	265.90	8,971,466.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	28,020	429.30	12,028,986.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	28,790	410.25	11,811,097.50	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	61,640	193.40	11,921,176.00	

PETRONET LNG LTD	22,080	252.85	5,582,928.00	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	130,310	920.40	119,937,324.00	
ASIAN PAINTS LTD	14,250	1,138.00	16,216,500.00	
UPL LTD	16,290	731.60	11,917,764.00	
ACC LIMITED	1,840	1,721.65	3,167,836.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	267.60	8,006,592.00	
GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,490	1,134.15	19,836,283.50	
SHREE CEMENT LIMITED	360	17,847.10	6,424,956.00	
ULTRATECH CEMENT LTD	4,400	4,288.90	18,871,160.00	
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	59,450	267.85	15,923,682.50	
JSW STEEL LTD	37,810	264.50	10,000,745.00	
TATA STEEL LIMITED	16,040	711.20	11,407,648.00	
VEDANTA LTD	73,574	316.55	23,289,849.70	
LARSEN&TOUBRO LIMITED	22,835	1,266.15	28,912,535.25	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	35,970	92.20	3,316,434.00	
HAVELLS INDIA LTD	12,350	550.05	6,793,117.50	
SIEMENS INDIA LIMITED	3,220	1,230.60	3,962,532.00	
ASHOK LEYLAND LIMITED	60,650	117.60	7,132,440.00	
EICHER MOTORS LTD	700	30,250.75	21,175,525.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,212	1,362.90	3,014,734.80	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	39,379	402.15	15,836,264.85	
BHARAT FORGE LIMITED	9,640	728.90	7,026,596.00	
BOSCH LTD	390	19,926.50	7,771,335.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	30,332	376.85	11,430,614.20	
BAJAJ AUTO LIMITED	4,300	3,328.95	14,314,485.00	
HERO MOTOCORP LTD	2,430	3,792.80	9,216,504.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	35,920	746.20	26,803,504.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,190	9,700.00	50,343,000.00	
TATA MOTORS LTD	78,659	422.00	33,194,098.00	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	14,960	240.35	3,595,636.00	
TITAN CO LTD	14,720	856.85	12,612,832.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	27,550	574.55	15,828,852.50	
UNITED SPIRITS LIMITED	3,123	3,554.40	11,100,391.20	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,410	4,746.65	6,692,776.50	
	1,220	7,883.30	9,617,626.00	

NESTLE INDIA LIMITED			
ITC LTD	171,745	263.10	45,186,109.50
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	31,640	1,356.50	42,919,660.00
DABUR INDIA LTD	28,756	353.55	10,166,683.80
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,780	987.60	10,646,328.00
MARICO LIMITED	20,020	316.95	6,345,339.00
AUROBINDO PHARMA LTD	14,046	681.30	9,569,539.80
CADILA HEALTHCARE LTD	8,880	423.30	3,758,904.00
CIPLA LIMITED	16,810	601.20	10,106,172.00
DR.REDDYS LABORATORIES	5,420	2,332.70	12,643,234.00
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	6,830	567.60	3,876,708.00
LUPIN LTD	10,930	871.65	9,527,134.50
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,680	2,901.10	10,676,048.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	45,402	530.95	24,106,191.90
AXIS BANK LIMITED	82,250	553.60	45,533,600.00
ICICI BANK LTD	120,850	316.60	38,261,110.00
IDFC BANK LTD	50,500	55.00	2,777,500.00
YES BANK LTD	87,080	310.15	27,007,862.00
POWER FINANCE CORPORATION	24,180	120.95	2,924,571.00
RURAL ELECTRIFICATION CORP	28,170	156.65	4,412,830.50
BAJAJ FINSERV LTD	1,830	5,428.15	9,933,514.50
HCL TECHNOLOGIES LTD	27,980	886.90	24,815,462.00
INFOSYS LTD	92,370	1,039.35	96,004,759.50
TATA CONSULTANCY SVS LTD	22,600	2,646.75	59,816,550.00
TECH MAHINDRA LTD	22,440	493.45	11,073,018.00
VAKRANGEE LIMITED	20,780	399.55	8,302,649.00
WIPRO LTD	62,456	301.60	18,836,729.60
BHARTI INFRATEL LTD	29,560	363.95	10,758,362.00
BHARTI AIRTEL LIMITED	61,020	528.55	32,252,121.00
IDEA CELLULAR LIMITED	65,790	100.65	6,621,763.50
TATA POWER COMPANY LIMITED	45,274	92.75	4,199,163.50
GAIL INDIA LTD	25,483	503.10	12,820,497.30
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	74,690	1,709.35	127,671,351.50
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	16,200	1,193.40	19,333,080.00
LIC HOUSING FINANCE	13,840	567.75	7,857,660.00

	BAJAJ FINANCE LTD	8,570	1,782.45	15,275,596.50
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	15,160	474.45	7,192,662.00
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,080	1,465.00	10,372,200.00
	NTPC LIMITED	86,000	179.75	15,458,500.00
小計	銘柄数：78			1,464,274,988.15 (2,606,409,478)
	組入時価比率：8.5%			8.7%
パキスタン ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	31,900	162.14	5,172,266.00
	LUCKY CEMENT	5,300	475.18	2,518,454.00
	HABIB BANK LTD	27,300	170.07	4,642,911.00
	MCB BANK LIMITED	21,900	202.45	4,433,655.00
	UNITED BANK LTD	24,200	182.80	4,423,760.00
小計	銘柄数：5			21,191,046.00 (21,826,777)
	組入時価比率：0.1%			0.1%
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	13,040	15.77	205,640.80
	INDUSTRIES QATAR	7,930	98.31	779,598.30
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	8,990	28.56	256,754.40
	DOHA BANK LTD	6,730	28.30	190,459.00
	MASRAF AL RAYAN	18,160	37.45	680,092.00
	QATAR ISLAMIC BANK	2,720	98.85	268,872.00
	QATAR NATIONAL BANK	11,356	128.05	1,454,135.80
	QATAR INSURANCE CO	6,523	54.90	358,112.70
	OOREDOO QSC	4,310	94.59	407,682.90
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,500	178.50	267,750.00
	BARWA REAL ESTATE CO	4,990	32.60	162,674.00
	EZDAN HOLDING GROUP	35,190	12.16	427,910.40
	小計	銘柄数：12		
	組入時価比率：0.6%			0.6%
エジプトポンド	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	51,781	75.01	3,884,092.81
	GLOBAL TELECOM HOLDING	95,560	7.50	716,700.00
	EGYPTIAN FINANCIAL GROUP-HERMES HOLDING	25,000	23.25	581,250.00
小計	銘柄数：3			5,182,042.81

				(32,905,971)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	10,470	157.38	1,647,768.60	
	SASOL LTD	27,010	418.87	11,313,678.70	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,100	346.99	728,679.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	21,570	121.50	2,620,755.00	
	GOLD FIELDS LTD	44,630	52.24	2,331,471.20	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,100	371.36	1,151,216.00	
	SIBANYE GOLD LTD	77,500	14.79	1,146,225.00	
	MONDI LTD	5,750	321.49	1,848,567.50	
	SAPPI LIMITED	26,350	91.47	2,410,234.50	
	BIDVEST GROUP LTD	18,030	213.00	3,840,390.00	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	147,310	4.68	689,410.80	
	NASPERS LTD-N SHS	21,770	3,451.42	75,137,413.40	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	7,120	251.50	1,790,680.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	50,960	62.93	3,206,912.80	
	MR PRICE GROUP LTD	11,980	241.77	2,896,404.60	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	11,300	180.00	2,034,000.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	22,670	91.01	2,063,196.70	
	BID CORP LTD	17,070	297.63	5,080,544.10	
	PICKN PAY STORES LTD	17,600	66.60	1,172,160.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	22,720	204.50	4,646,240.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	8,610	190.93	1,643,907.30	
	PIONEER FOODS LTD	5,010	133.86	670,638.60	
	TIGER BRANDS LTD	8,700	443.77	3,860,799.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	69,273	26.89	1,862,750.97	
	NETCARE LTD	50,580	23.94	1,210,885.20	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	19,330	278.00	5,373,740.00	
	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	32,750	172.00	5,633,000.00	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,030	1,050.52	2,132,555.60		
NEDBANK GROUP LTD	10,180	247.58	2,520,364.40		
STANDARD BANK GROUP LTD	65,270	187.23	12,220,502.10		
FIRSTRAND LTD	167,060	63.65	10,633,369.00		
PSG GROUP LTD	3,910	259.00	1,012,690.00		
REMGRO LTD	27,050	228.03	6,168,211.50		

	RMB HOLDINGS LTD	36,200	74.64	2,701,968.00	
	DISCOVERY LTD	16,580	181.48	3,008,938.40	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,360	122.64	779,990.40	
	MMI HOLDINGS LTD	40,092	20.45	819,881.40	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	30,740	44.92	1,380,840.80	
	SANLAM LIMITED	74,140	85.33	6,326,366.20	
	TELKOM SA SOC LTD	9,950	46.08	458,496.00	
	MTN GROUP LTD	85,490	130.65	11,169,268.50	
	VODACOM GROUP	30,370	140.80	4,276,096.00	
	BRAIT SE	15,140	40.26	609,536.40	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,450	72.00	752,400.00	
	INVESTEC LTD	11,470	90.23	1,034,938.10	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	19,770	216.80	4,286,136.00	
	小計 銘柄数：46			220,304,217.77	
				(1,995,956,212)	
	組入時価比率：6.5%			6.7%	
U A E ディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	118,900	0.63	74,907.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	99,870	6.72	671,126.40	
	DUBAI ISLAMIC BANK	57,522	6.19	356,061.18	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	74,683	10.20	761,766.60	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	90,980	17.00	1,546,660.00	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	80,000	2.41	192,800.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	136,340	2.19	298,584.60	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	73,980	3.28	242,654.40	
	EMAAR MALLS PJSC	89,700	2.05	183,885.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	177,630	6.98	1,239,857.40	
	小計 銘柄数：10			5,568,302.58	
				(172,227,598)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
合計				29,892,031,382	
				(29,892,031,382)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	163,100	4,632,040.00		
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.1%	163,100	4,632,040.00 (26,587,909) 19.7%	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	80,400	221,100.00		
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	80,400	221,100.00 (6,586,569) 4.9%	
	ランド	FORTRESS REIT LTD-A	41,690	763,343.90		
		FORTRESS REIT LTD-B	37,910	1,571,369.50		
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	106,600	2,906,982.00		
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	10,470	1,184,157.00		
		REDEFINE PROPERTIES LTD	251,860	2,634,455.60		
		RESILIENT REIT LTD	15,092	2,202,073.72		
		小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.3%	463,622	11,262,381.72 (102,037,178) 75.4%	
	合計				135,211,656 (135,211,656)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年12月26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	676,952,864	-	690,450,186	13,497,322
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
買建	16,999,570	-	17,004,000	4,430
米ドル	16,999,570	-	17,004,000	4,430
合計	-	-	-	13,501,752

(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29年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,591,210,646
国債証券	563,214,876,450
地方債証券	47,442,615,337
特殊債券	56,801,087,540
社債券	29,435,242,700
未収入金	755,908,000
未収利息	1,059,164,196
前払費用	19,697,220
流動資産合計	702,319,802,089
資産合計	702,319,802,089
負債の部	
流動負債	
未払金	1,877,659,000
未払解約金	337,621,254
未払利息	4,132
流動負債合計	2,215,284,386

負債合計	2,215,284,386
純資産の部	
元本等	
元本	535,877,736,100
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	164,226,781,603
元本等合計	700,104,517,703
純資産合計	700,104,517,703
負債純資産合計	702,319,802,089

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29年12月26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	1.3065円
(10,000口当たり純資産額)	(13,065円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月26日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年12月26日現在	
期首	平成28年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	519,403,348,938円
同期中における追加設定元本額	77,862,544,736円
同期中における一部解約元本額	61,388,157,574円
期末元本額	535,877,736,100円
期末元本額の内訳*	
野村国内債券インデックスファンド	441,411,453円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	20,539,300,470円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	18,481,946,452円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,575,446,596円
野村資産設計ファンド2015	437,444,702円
野村資産設計ファンド2020	329,364,444円
野村資産設計ファンド2025	261,357,174円
野村資産設計ファンド2030	171,529,485円
野村資産設計ファンド2035	86,832,728円
野村資産設計ファンド2040	151,727,045円
野村日本債券インデックスファンド	1,106,980,608円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	270,167,772,371円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	11,249,122,589円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	6,009,376,472円

のむらっぴ・ファンド(積極型)	808,396,023円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	13,025,573,233円
野村資産設計ファンド2045	12,196,826円
野村円債投資インデックスファンド	1,579,081,229円
野村インデックスファンド・国内債券	4,056,582,398円
マイ・ロード	37,654,242,174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	498,971,689円
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	39,921,974円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	4,869,921,180円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,061,835,817円
野村資産設計ファンド2050	12,961,407円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	11,237,986円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,587,797円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,838,402円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,147,499円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	544,567,728円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	87,504,665円
インデックス・ブレンド(タイプ)	19,723,711円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,708,202円
インデックス・ブレンド(タイプ)	24,880,224円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,892,005円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,744,299円
野村6資産均等バランス	306,316円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	99,076,666円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	1,746,078,825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)	843,968,926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)	255,827,933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)	4,570,353,246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)	1,676,893,529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)	16,978,800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)	18,919,177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)	1,491,047円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	6,296,875,833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)	203,501,591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)	1,199,099,111円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	863,787,336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)	409,988,553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)	417,471,454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)	937,480,210円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,782,145,645円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,393,007,869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)	409,116,697円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	14,316,650,719円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	21,635,863,386円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	9,884,444,595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)	43,017,026,709円
マイバランスDC30	9,373,173,892円

マイバランスDC50	6,070,963,620円
マイバランスDC70	1,966,133,376円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	9,873,768,944円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	181,277,341円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	31,460,945円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	40,053,525円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,967,869円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	538,162円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	289,956円
野村資産設計ファンド(DC)2030	302,639円
野村資産設計ファンド(DC)2040	194,231円
野村資産設計ファンド(DC)2050	128,370円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年12月26日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26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372回	5,000,000,000	5,013,400,000	
		国庫債券 利付(2年)第378回	2,000,000,000	2,007,880,000	
		国庫債券 利付(2年)第379回	2,000,000,000	2,008,320,000	
		国庫債券 利付(2年)第380回	5,000,000,000	5,021,900,000	
		国庫債券 利付(5年)第117回	5,900,000,000	5,924,603,000	
		国庫債券 利付(5年)第118回	5,000,000,000	5,025,150,000	
		国庫債券 利付(5年)第119回	4,700,000,000	4,716,685,000	
		国庫債券 利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,532,395,000	
		国庫債券 利付(5年)第121回	3,500,000,000	3,514,525,000	
		国庫債券 利付(5年)第122回	9,800,000,000	9,845,668,000	
		国庫債券 利付(5年)第123回	7,300,000,000	7,338,252,000	
		国庫債券 利付(5年)第124回	5,100,000,000	5,129,121,000	
		国庫債券 利付(5年)第125回	8,200,000,000	8,250,512,000	
		国庫債券 利付(5年)第126回	5,500,000,000	5,536,960,000	

国庫債券 利付(5年)第127回	6,000,000,000	6,042,720,000	
国庫債券 利付(5年)第128回	6,200,000,000	6,246,500,000	
国庫債券 利付(5年)第129回	6,000,000,000	6,047,160,000	
国庫債券 利付(5年)第130回	5,000,000,000	5,040,900,000	
国庫債券 利付(5年)第131回	5,000,000,000	5,043,450,000	
国庫債券 利付(5年)第132回	7,000,000,000	7,066,080,000	
国庫債券 利付(5年)第133回	5,000,000,000	5,049,900,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	1,960,000,000	2,787,727,600	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,236,411,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,240,281,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,300,000,000	1,798,953,000	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,300,000,000	1,728,428,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,500,000,000	1,953,420,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,739,220,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,700,000,000	1,950,597,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,200,000,000	1,814,890,000	
国庫債券 利付(40年)第10回	1,500,000,000	1,468,065,000	
国庫債券 利付(10年)第299回	1,400,000,000	1,424,808,000	
国庫債券 利付(10年)第300回	1,000,000,000	1,020,180,000	
国庫債券 利付(10年)第301回	1,500,000,000	1,536,390,000	
国庫債券 利付(10年)第302回	700,000,000	715,946,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	3,300,000,000	3,388,044,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,024,950,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,216,686,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,102,390,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,754,230,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,760,180,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,091,290,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,813,442,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,845,324,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,145,277,500	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,346,528,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,286,504,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	3,600,000,000	3,765,240,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,459,374,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,881,882,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,333,600,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,939,040,500	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,654,490,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,350,048,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,502,336,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,822,040,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,330,240,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,900,000,000	5,109,524,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,184,042,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,239,562,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,500,000,000	5,702,180,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,561,131,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,994,750,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,975,487,000	

国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,622,210,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	3,200,000,000	3,336,096,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,280,113,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	3,700,000,000	3,842,561,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	1,700,000,000	1,767,320,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	1,700,000,000	1,743,486,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	4,900,000,000	5,061,700,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	4,400,000,000	4,546,872,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	4,500,000,000	4,651,695,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	7,200,000,000	7,390,008,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	6,000,000,000	6,059,280,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	6,900,000,000	6,964,377,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,850,576,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	6,800,000,000	6,857,936,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	5,800,000,000	5,845,414,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	6,800,000,000	6,848,212,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	5,500,000,000	5,537,345,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	131,072,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	254,294,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	202,094,400	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,211,580,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	189,498,000	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	906,367,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	773,016,000	

国庫債券 利付（30年）第8回	100,000,000	122,004,000	
国庫債券 利付（30年）第9回	65,000,000	75,573,550	
国庫債券 利付（30年）第10回	250,000,000	279,525,000	
国庫債券 利付（30年）第11回	160,000,000	193,414,400	
国庫債券 利付（30年）第12回	220,000,000	279,479,200	
国庫債券 利付（30年）第13回	290,000,000	364,332,800	
国庫債券 利付（30年）第14回	800,000,000	1,056,648,000	
国庫債券 利付（30年）第15回	900,000,000	1,205,190,000	
国庫債券 利付（30年）第16回	915,000,000	1,227,829,350	
国庫債券 利付（30年）第17回	1,200,000,000	1,594,224,000	
国庫債券 利付（30年）第18回	1,500,000,000	1,968,765,000	
国庫債券 利付（30年）第19回	1,600,000,000	2,103,440,000	
国庫債券 利付（30年）第20回	1,900,000,000	2,566,900,000	
国庫債券 利付（30年）第21回	1,400,000,000	1,844,584,000	
国庫債券 利付（30年）第22回	600,000,000	811,956,000	
国庫債券 利付（30年）第23回	840,000,000	1,137,620,400	
国庫債券 利付（30年）第24回	700,000,000	950,327,000	
国庫債券 利付（30年）第25回	500,000,000	661,155,000	
国庫債券 利付（30年）第26回	850,000,000	1,140,249,500	
国庫債券 利付（30年）第27回	1,550,000,000	2,112,355,500	
国庫債券 利付（30年）第28回	1,200,000,000	1,639,308,000	
国庫債券 利付（30年）第29回	1,500,000,000	2,027,670,000	
国庫債券 利付（30年）第30回	1,700,000,000	2,271,897,000	
国庫債券 利付（30年）第31回	1,600,000,000	2,112,400,000	
国庫債券 利付（30年）第32回	1,900,000,000	2,553,410,000	
国庫債券 利付（30年）第33回	2,500,000,000	3,212,875,000	
国庫債券 利付（30年）第34回	2,300,000,000	3,059,483,000	
国庫債券 利付（30年）第35回	2,300,000,000	2,965,758,000	
国庫債券 利付（30年）第36回	2,300,000,000	2,971,600,000	
国庫債券 利付（30年）第37回	2,300,000,000	2,924,956,000	
国庫債券 利付（30年）第38回	1,900,000,000	2,376,083,000	
国庫債券 利付（30年）第39回	1,600,000,000	2,039,360,000	
国庫債券 利付（30年）第40回	1,100,000,000	1,377,310,000	
国庫債券 利付（30年）第41回	1,500,000,000	1,843,890,000	
国庫債券 利付（30年）第42回	1,200,000,000	1,475,688,000	
国庫債券 利付（30年）第43回	1,300,000,000	1,599,299,000	

国庫債券 利付（30年）第44回	1,400,000,000	1,722,980,000	
国庫債券 利付（30年）第45回	1,900,000,000	2,247,472,000	
国庫債券 利付（30年）第46回	1,800,000,000	2,129,274,000	
国庫債券 利付（30年）第47回	1,900,000,000	2,294,041,000	
国庫債券 利付（30年）第48回	1,900,000,000	2,201,169,000	
国庫債券 利付（30年）第49回	1,800,000,000	2,085,030,000	
国庫債券 利付（30年）第50回	1,900,000,000	1,910,982,000	
国庫債券 利付（30年）第51回	1,800,000,000	1,578,438,000	
国庫債券 利付（30年）第52回	2,000,000,000	1,851,180,000	
国庫債券 利付（30年）第53回	1,900,000,000	1,804,240,000	
国庫債券 利付（30年）第54回	1,700,000,000	1,700,000,000	
国庫債券 利付（30年）第55回	1,900,000,000	1,897,720,000	
国庫債券 利付（30年）第56回	1,500,000,000	1,496,400,000	
国庫債券 利付（20年）第41回	255,000,000	260,161,200	
国庫債券 利付（20年）第42回	683,000,000	705,996,610	
国庫債券 利付（20年）第43回	400,000,000	421,072,000	
国庫債券 利付（20年）第44回	150,000,000	158,800,500	
国庫債券 利付（20年）第45回	242,000,000	255,658,480	
国庫債券 利付（20年）第46回	90,000,000	95,210,100	
国庫債券 利付（20年）第47回	1,230,000,000	1,308,375,600	
国庫債券 利付（20年）第48回	200,000,000	215,740,000	
国庫債券 利付（20年）第49回	200,000,000	214,396,000	
国庫債券 利付（20年）第50回	183,000,000	194,986,500	
国庫債券 利付（20年）第51回	310,000,000	332,902,800	
国庫債券 利付（20年）第52回	100,000,000	108,280,000	
国庫債券 利付（20年）第53回	250,000,000	272,075,000	
国庫債券 利付（20年）第54回	250,000,000	273,072,500	
国庫債券 利付（20年）第55回	231,000,000	251,699,910	
国庫債券 利付（20年）第56回	120,000,000	131,360,400	
国庫債券 利付（20年）第57回	210,000,000	228,937,800	
国庫債券 利付（20年）第58回	180,000,000	197,150,400	
国庫債券 利付（20年）第59回	230,000,000	250,773,600	
国庫債券 利付（20年）第60回	780,000,000	838,741,800	
国庫債券 利付（20年）第61回	300,000,000	317,331,000	
国庫債券 利付（20年）第62回	440,000,000	461,678,800	
国庫債券 利付（20年）第63回	300,000,000	331,296,000	

国庫債券	利付(20年)第64回	400,000,000	445,708,000	
国庫債券	利付(20年)第65回	455,000,000	509,113,150	
国庫債券	利付(20年)第66回	300,000,000	333,876,000	
国庫債券	利付(20年)第67回	310,000,000	348,396,600	
国庫債券	利付(20年)第68回	290,000,000	331,362,700	
国庫債券	利付(20年)第69回	560,000,000	636,367,200	
国庫債券	利付(20年)第70回	540,000,000	626,778,000	
国庫債券	利付(20年)第71回	200,000,000	229,538,000	
国庫債券	利付(20年)第72回	670,000,000	768,289,000	
国庫債券	利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,830,960,000	
国庫債券	利付(20年)第74回	1,300,000,000	1,496,768,000	
国庫債券	利付(20年)第75回	600,000,000	693,534,000	
国庫債券	利付(20年)第76回	910,000,000	1,038,664,900	
国庫債券	利付(20年)第77回	700,000,000	804,048,000	
国庫債券	利付(20年)第78回	800,000,000	916,728,000	
国庫債券	利付(20年)第79回	860,000,000	991,932,600	
国庫債券	利付(20年)第80回	900,000,000	1,044,819,000	
国庫債券	利付(20年)第81回	360,000,000	416,772,000	
国庫債券	利付(20年)第82回	820,000,000	955,669,000	
国庫債券	利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,602,721,900	
国庫債券	利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,394,244,000	
国庫債券	利付(20年)第85回	400,000,000	469,860,000	
国庫債券	利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,667,568,000	
国庫債券	利付(20年)第87回	500,000,000	591,440,000	
国庫債券	利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,315,567,000	
国庫債券	利付(20年)第89回	470,000,000	558,120,300	
国庫債券	利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,788,045,000	
国庫債券	利付(20年)第91回	250,000,000	300,190,000	
国庫債券	利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,841,400,000	
国庫債券	利付(20年)第93回	300,000,000	355,182,000	
国庫債券	利付(20年)第94回	200,000,000	238,632,000	
国庫債券	利付(20年)第95回	700,000,000	851,361,000	
国庫債券	利付(20年)第96回	400,000,000	478,920,000	
国庫債券	利付(20年)第97回	1,300,000,000	1,574,404,000	
国庫債券	利付(20年)第98回	300,000,000	360,414,000	
国庫債券	利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,531,193,000	

国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,852,439,200	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	309,762,500	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	621,810,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	739,926,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	484,952,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,310,723,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	490,724,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	365,946,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,916,896,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,081,017,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,345,685,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	990,616,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,208,456,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,459,420,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	2,500,000,000	3,082,675,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	1,500,000,000	1,867,305,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,373,174,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,900,000,000	2,348,989,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	613,665,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	962,256,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	942,648,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	2,000,000,000	2,434,100,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,325,038,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	2,000,000,000	2,490,140,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,232,370,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,134,828,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,235,090,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	800,000,000	977,736,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,800,000,000	2,203,002,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	800,000,000	968,608,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,600,000,000	1,939,472,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	959,056,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,560,910,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,699,964,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,702,750,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	841,155,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	831,516,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,204,260,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	940,360,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	832,608,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,800,000,000	3,374,336,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	2,049,962,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	1,250,000,000	1,526,412,500	

国庫債券 利付(20年)第143回	2,000,000,000	2,385,480,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,765,920,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,600,000,000	3,142,984,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,900,000,000	3,507,173,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,500,000,000	2,986,425,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	3,000,000,000	3,537,810,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,400,000,000	2,832,168,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	2,930,000,000	3,410,783,700	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,053,106,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	2,900,000,000	3,276,478,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	2,950,000,000	3,380,906,500	
国庫債券 利付(20年)第154回	3,000,000,000	3,386,100,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,800,000,000	3,061,212,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,900,000,000	2,863,518,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	3,700,000,000	3,512,225,000	
国庫債券 利付(20年)第158回	2,800,000,000	2,800,000,000	
国庫債券 利付(20年)第159回	3,000,000,000	3,046,710,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	2,600,000,000	2,681,770,000	
国庫債券 利付(20年)第161回	3,100,000,000	3,132,767,000	
国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,715,113,000	
メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	302,571,000	
ポーランド共和国 第15回円貨債	100,000,000	100,797,000	

		券（2013）		
	小計	銘柄数：261	516,259,000,000	563,214,876,450
		組入時価比率：80.4%		80.8%
	合計			563,214,876,450
地方債証券	日本円	東京都 公募第668回	200,000,000	203,712,000
		東京都 公募第671回	100,000,000	102,059,000
		東京都 公募第685回	100,000,000	102,725,000
		東京都 公募第690回	200,000,000	207,498,000
		東京都 公募第703回	100,000,000	103,817,000
		東京都 公募第707回	100,000,000	103,523,000
		東京都 公募第708回	100,000,000	103,847,000
		東京都 公募第710回	100,000,000	103,489,000
		東京都 公募第712回	100,000,000	103,498,000
		東京都 公募第715回	100,000,000	103,632,000
		東京都 公募第716回	200,000,000	207,364,000
		東京都 公募第731回	100,000,000	103,664,000
		東京都 公募第745回	300,000,000	309,993,000
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,231,000
		東京都 公募第761回	100,000,000	99,490,000
		東京都 公募第769回	500,000,000	502,565,000
		東京都 公募（30年）第7回	100,000,000	133,002,000
		東京都 公募第10回	200,000,000	259,762,000
		東京都 公募第1回	300,000,000	324,708,000
		東京都 公募（20年）第3回	200,000,000	227,514,000
		東京都 公募第7回	100,000,000	115,896,000
		東京都 公募（20年）第16回	200,000,000	237,890,000
		東京都 公募（20年）第17回	200,000,000	239,604,000
		東京都 公募第23回	100,000,000	122,291,000
		東京都 公募（20年）第26回	100,000,000	118,250,000
		北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	102,622,000
		北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	102,821,000
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	103,736,000
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	103,628,000
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	308,454,000
北海道 公募（5年）平成26年度第8回	200,000,000	200,514,000		

北海道 公募(5年)平成26年度 第10回	100,000,000	100,224,000	
北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	103,070,000	
北海道 公募平成28年度第13回	200,000,000	199,814,000	
北海道 公募平成29年度第5回	200,000,000	199,812,000	
北海道 公募平成29年度第6回	700,000,000	699,027,000	
宮城県 公募第32回2号	100,000,000	99,575,000	
神奈川県 公募第184回	100,000,000	103,440,000	
神奈川県 公募第188回	200,000,000	208,564,000	
神奈川県 公募第196回	100,000,000	103,330,000	
神奈川県 公募第200回	100,000,000	104,461,000	
神奈川県 公募第205回	100,000,000	103,780,000	
神奈川県 公募第206回	100,000,000	103,835,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	205,296,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	133,907,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	356,367,000	
大阪府 公募第337回	200,000,000	206,586,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	103,766,000	
大阪府 公募第356回	100,000,000	104,093,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	107,929,120	
大阪府 公募第381回	100,000,000	103,799,000	
大阪府 公募第382回	100,000,000	103,792,000	
大阪府 公募第383回	100,000,000	103,972,000	
大阪府 公募第384回	100,000,000	103,836,000	
大阪府 公募第387回	300,000,000	308,880,000	
大阪府 公募第389回	100,000,000	103,098,000	
大阪府 公募第417回	102,000,000	102,763,980	
大阪府 公募第5回	100,000,000	121,683,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	118,626,000	
大阪府 公募第102回	100,000,000	100,211,000	
大阪府 公募(5年)第130回	600,000,000	599,412,000	
大阪府 公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,022,126,080	
大阪府 公募(5年)第141回	230,000,000	229,579,100	
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	103,936,000	
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	103,705,000	
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	114,210,000	

京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	206,688,000	
兵庫県	公募平成20年度第16回	100,000,000	101,690,000	
兵庫県	公募平成21年度第13回	100,000,000	102,255,000	
兵庫県	公募平成21年度第25回	100,000,000	102,869,000	
兵庫県	公募平成22年度第1回	100,000,000	103,292,000	
兵庫県	公募平成26年度第17回	100,000,000	102,636,000	
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	130,555,000	
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	338,430,000	
兵庫県	公募(15年)第3回	100,000,000	110,471,000	
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	310,119,000	
兵庫県	公募第2回	100,000,000	120,419,000	
兵庫県	公募第9回	100,000,000	122,188,000	
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,339,000	
静岡県	公募平成21年度第2回	100,000,000	102,422,000	
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	102,890,000	
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	103,793,238	
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	103,333,000	
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	105,980,310	
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	171,529,050	
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	103,353,000	
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	206,648,000	
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,210,744	
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	298,776,000	
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	118,498,000	
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	118,034,000	
愛知県	公募平成20年度第7回	210,000,000	213,129,000	
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	119,139,000	
愛知県	公募平成20年度第10回	100,000,000	101,810,000	
愛知県	公募平成21年度第3回	114,000,000	116,782,740	
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	102,992,000	
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	103,225,000	
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	103,097,000	
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	104,053,000	
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	104,106,000	
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	117,343,000	

愛知県 公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	444,192,000	
愛知県 公募平成24年度第17回	100,000,000	119,600,000	
愛知県 公募平成26年度第8回	100,000,000	120,577,000	
愛知県 公募平成26年度第13回	100,000,000	112,642,000	
愛知県 公募平成27年度第15回	100,000,000	102,754,000	
広島県 公募平成22年度第6回	300,000,000	311,361,000	
広島県 公募平成24年度第4回	100,000,000	103,834,000	
広島県 公募平成25年度第3回	200,000,000	208,658,000	
広島県 公募(5年)平成25年度第6回	300,000,000	300,627,000	
広島県 公募平成26年度第5回	109,650,000	111,620,410	
埼玉県 公募平成21年度第5回	100,000,000	102,410,000	
埼玉県 公募平成22年度第2回	200,000,000	206,464,000	
埼玉県 公募平成24年度第4回	300,000,000	311,103,000	
埼玉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	104,901,000	
埼玉県 公募平成25年度第6回	148,000,000	154,463,160	
埼玉県 公募平成25年度第10回	100,000,000	103,782,000	
埼玉県 公募平成25年度第11回	100,000,000	103,735,000	
埼玉県 公募平成26年度第3回	100,000,000	103,887,000	
埼玉県 公募平成26年度第6回	200,000,000	206,574,000	
埼玉県 公募平成26年度第7回	400,000,000	411,308,000	
埼玉県 公募平成26年度第9回	100,000,000	102,487,000	
福岡県 公募平成22年度第5回	100,000,000	102,580,000	
福岡県 公募平成23年度第5回	100,000,000	103,785,000	
福岡県 公募平成26年度第1回	100,000,000	103,845,000	
福岡県 公募平成26年度第4回	100,000,000	100,182,000	
福岡県 公募平成27年度第1回	300,000,000	310,788,000	
福岡県 公募平成23年度第1回	100,000,000	111,809,000	
福岡県 公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	134,328,000	
福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	120,988,000	
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	119,246,000	
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,674,000	
千葉県 公募平成21年度第1回	100,000,000	101,992,000	

千葉県	公募平成21年度第11回	180,000,000	185,198,400
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	104,395,000
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	103,868,000
千葉県	公募平成24年度第7回	100,000,000	103,536,000
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	104,100,000
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	104,657,000
千葉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	104,898,000
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	207,220,000
千葉県	公募(20年)第8回	100,000,000	122,247,000
千葉県	公募(20年)第17回	100,000,000	113,366,000
新潟県	公募平成20年度第2回	200,000,000	203,492,000
新潟県	公募平成21年度第2回	150,000,000	154,375,500
群馬県	公募第8回	100,000,000	103,908,000
群馬県	公募第12回	100,000,000	103,097,000
群馬県	公募(20年)第3回	100,000,000	117,386,000
岐阜県	公募平成26年度第1回	186,670,000	192,815,176
大分県	公募平成23年度第1回	902,000,000	935,545,380
共同発行市場地方債	公募第70回	110,000,000	111,654,400
共同発行市場地方債	公募第74回	500,000,000	510,840,000
共同発行市場地方債	公募第75回	310,000,000	317,461,700
共同発行市場地方債	公募第82回	300,000,000	308,664,000
共同発行市場地方債	公募第84回	500,000,000	515,135,000
共同発行市場地方債	公募第85回	100,000,000	103,277,000
共同発行市場地方債	公募第88回	100,000,000	102,933,000
共同発行市場地方債	公募第89回	100,000,000	102,686,000
共同発行市場地方債	公募第92回	110,000,000	113,203,200
共同発行市場地方債	公募第93回	300,000,000	310,959,000
共同発行市場地方債	公募第94回	300,000,000	311,178,000
共同発行市場地方債	公募第96回	100,000,000	104,083,000
共同発行市場地方債	公募第101回	300,000,000	311,193,000
共同発行市場地方債	公募第102回	150,000,000	155,608,500
共同発行市場地方債	公募第103回	100,000,000	103,709,000
共同発行市場地方債	公募第104回	200,000,000	207,816,000

共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	208,266,000	
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	207,560,000	
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	207,712,000	
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	103,701,000	
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	827,560,000	
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	252,811,943	
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	103,714,000	
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	207,558,000	
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	104,073,000	
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	207,848,000	
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	310,041,000	
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	102,818,000	
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	412,524,000	
共同発行市場地方債 公募第124回	100,000,000	104,842,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	104,386,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	310,788,000	
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	103,946,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	104,305,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	103,765,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	207,220,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	206,642,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	160,048,350	

回			
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	554,158,800	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,023,380,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	100,000,000	99,714,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	100,000,000	99,546,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	120,218,000	
堺市 公募平成22年度第2回	100,000,000	103,670,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	116,715,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	103,060,000	
島根県 公募平成25年度第3回	700,000,000	701,554,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,884,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	205,856,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,545,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	146,157,760	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	103,740,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,545,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	242,546,656	
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,884,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,830,000	
大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	102,947,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	103,793,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,550,000	
大阪市 公募(5年)平成28年度第5回	100,000,000	99,884,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	113,690,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	123,411,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	120,957,000	
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	117,998,000	
名古屋市 公募第469回	100,000,000	102,597,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	104,337,000	
名古屋市 公募第481回	100,000,000	103,553,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	310,722,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	213,938,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	106,877,000	

京都市	公募平成20年度第4回	200,000,000	203,532,000	
京都市	公募平成23年度第4回	100,000,000	104,129,000	
京都市	公募(20年)第2回	100,000,000	115,411,000	
京都市	公募(20年)第13回	100,000,000	112,601,000	
神戸市	公募平成21年度第7回	100,000,000	102,459,000	
神戸市	公募平成26年度第17回	300,000,000	304,335,000	
神戸市	公募平成28年度第1回	200,000,000	199,094,000	
横浜市	公募平成21年度第4回	200,000,000	204,574,000	
横浜市	公募平成22年度第5回	100,000,000	103,651,000	
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	207,538,000	
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	206,718,000	
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	207,110,000	
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	205,558,000	
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	301,755,000	
横浜市	公募(20年)第26回	100,000,000	118,813,000	
横浜市	公募(20年)第30回	100,000,000	112,878,000	
札幌市	公募平成22年度第4回	100,000,000	102,527,000	
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	119,086,000	
札幌市	公募平成26年度第4回	100,000,000	103,099,000	
札幌市	公募平成26年度第9回	200,000,000	205,004,000	
川崎市	公募第81回	100,000,000	101,893,000	
川崎市	公募第82回	100,000,000	102,582,000	
川崎市	公募第85回	100,000,000	103,433,000	
川崎市	公募(20年)第17回	100,000,000	115,304,000	
北九州市	公募(20年)第14回	100,000,000	118,120,000	
福岡市	公募平成26年度第2回	100,000,000	114,815,000	
福岡市	公募平成26年度第5回	100,000,000	103,227,000	
福岡市	公募平成26年度第8回	160,000,000	164,436,800	
広島市	公募平成21年度第3回	100,000,000	102,615,000	
広島市	公募平成26年度第2回	100,000,000	102,688,000	
広島市	公募平成27年度第2回	500,000,000	513,625,000	
仙台市	公募平成25年度第1回	600,000,000	601,374,000	
千葉市	公募平成24年度第1回	100,000,000	104,395,000	
三重県	公募平成24年度第1回	140,660,000	145,889,738	
鹿児島県	公募(5年)平成28年度第1回	100,000,000	99,886,000	

		福井県 公募平成22年度第2回	100,000,000	104,549,000	
		福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	102,234,000	
		福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	199,174,000	
		徳島県 公募平成22年度第1回	400,000,000	411,936,000	
		山梨県 公募平成21年度第1回	100,000,000	102,468,000	
		山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	207,440,000	
		岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	103,071,000	
		岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	169,437,102	
		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	120,733,000	
		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	364,482,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	119,447,000	
	小計	銘柄数：266 組入時価比率：6.8%	45,205,240,000	47,442,615,337	6.8%
	合計			47,442,615,337	
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	102,064,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	156,834,640	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	200,433,490	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,253,000	
		韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	100,000,000	100,501,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	112,148,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回	100,000,000	100,842,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	310,209,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	108,046,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	300,285,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第5回	100,000,000	101,868,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	141,000,000	144,967,740	

日本政策投資銀行社債 政府保証第 16回	102,000,000	106,080,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 19回	159,000,000	164,671,530	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 42回	300,000,000	300,144,000	
道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	322,059,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承 継 政府保証第344回	200,000,000	208,346,000	
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	133,175,000	
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	237,584,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第17回	100,000,000	118,865,000	
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	241,454,000	
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	294,136,000	
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	122,102,000	
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	123,431,000	
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	104,175,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第84回	400,000,000	416,104,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第86回	200,000,000	207,410,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第89回	100,000,000	117,692,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第102回	100,000,000	103,106,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第103回	350,000,000	411,526,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第105回	100,000,000	119,986,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第127回	300,000,000	300,795,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第130回	200,000,000	206,058,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第134回	200,000,000	205,658,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	206,530,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	300,000,000	340,578,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	100,000,000	115,393,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	81,885,000	
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	106,140,000	
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	106,289,000	
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	242,840,000	
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	243,122,000	
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	308,409,000	
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	245,508,000	
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	412,492,000	
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	243,710,000	
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	239,264,000	
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	127,236,000	
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	459,096,000	
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	145,668,600	
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	103,783,000	
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	145,387,200	
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	121,778,000	
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	103,968,000	
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	117,253,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	218,000,000	226,434,420	

券 政府保証債第 1 7 0 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 1 回	100,000,000	116,246,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 2 回	300,000,000	371,472,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 3 回	200,000,000	208,046,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 5 回	200,000,000	207,918,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 0 回	200,000,000	207,602,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 2 回	900,000,000	939,114,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 3 回	100,000,000	118,703,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 9 回	196,000,000	201,819,240	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 9 0 回	400,000,000	413,468,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 9 3 回	1,000,000,000	1,049,460,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 9 7 回	272,000,000	285,058,720	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 0 7 回	300,000,000	312,576,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 1 回	137,000,000	142,567,680	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 3 回	145,000,000	150,849,300	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 6 回	100,000,000	115,197,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 7 回	100,000,000	119,678,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 9 回	100,000,000	116,530,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 2 0 回	100,000,000	104,122,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 2 4 回	100,000,000	119,701,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 2 5 回	190,000,000	196,857,100	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 3 4 回	100,000,000	103,119,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	555,650,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	150,317,480	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	500,000,000	501,670,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回	100,000,000	99,286,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	300,000,000	405,531,000	
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	136,917,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	137,328,000	
公営企業債券 政府保証15年第1回	300,000,000	312,210,000	
地方公営企業等金融機構債券(20年) 第1回	100,000,000	119,205,000	
地方公共団体金融機構債券 第1回	100,000,000	102,470,000	
地方公共団体金融機構債券 第2回	100,000,000	102,216,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第5回	200,000,000	204,474,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	120,878,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	116,708,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	367,974,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	108,383,000	
地方公共団体金融機構債券 第13回	200,000,000	206,336,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第16回	100,000,000	102,814,000	
地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	103,179,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	311,034,000	
地方公共団体金融機構債券 第28回	500,000,000	519,085,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	108,634,000	

地方公共団体金融機構債券 F 1 0 6 回	100,000,000	107,273,000	
地方公共団体金融機構債券 第 3 7 回	400,000,000	414,220,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 8 回	194,000,000	201,631,960	
地方公共団体金融機構債券 F 1 3 2 回	500,000,000	536,090,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 9 回	100,000,000	103,832,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 0 回	101,000,000	105,029,900	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 1 回	102,000,000	106,008,600	
地方公共団体金融機構債券 第 4 1 回	600,000,000	621,444,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 2 回	100,000,000	106,335,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 4 回	200,000,000	203,130,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5 回	200,000,000	213,610,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7 回	100,000,000	110,086,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	108,000,000	112,383,720	
地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	100,000,000	103,637,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 3 回	202,000,000	209,631,560	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	145,000,000	151,307,500	
地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	100,000,000	103,696,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 5 回	223,000,000	232,551,090	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	108,082,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,638,560	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	105,141,000	
政保 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,983,000	

(6年) 第10回			
地方公共団体金融機構債券 第51回	600,000,000	625,956,000	
地方公共団体金融機構債券 第52回	300,000,000	313,926,000	
地方公共団体金融機構債券(15年) 第2回	200,000,000	218,814,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	120,883,600	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年) 第14回	300,000,000	301,737,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第38回	100,000,000	114,585,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	103,549,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	103,214,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第39回	100,000,000	113,585,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	414,252,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	320,000,000	328,761,600	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	195,545,070	
地方公共団体金融機構債券 第74回	300,000,000	308,766,000	
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,761,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	521,836,980	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	410,884,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	115,472,200	
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債	100,000,000	106,906,000	
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債	200,000,000	223,304,000	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	100,000,000	123,046,000	
首都高速道路社債 第13回	100,000,000	100,359,000	

首都高速道路 第17回	200,000,000	199,864,000	
首都高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	102,763,000	
阪神高速道路 第13回	100,000,000	100,285,000	
阪神高速道路 第15回	200,000,000	199,980,000	
阪神高速道路債券 政府保証第5回	100,000,000	102,972,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	103,884,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	206,744,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,933,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	106,785,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	115,872,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	374,742,000	
東京交通債券 第342回	200,000,000	220,582,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	175,533,850	
関西国際空港社債 財投機関債第26回	300,000,000	309,288,000	
関西国際空港社債 財投機関債第32回	100,000,000	104,141,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	103,886,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	368,000,000	381,170,720	
預金保険機構債券 政府保証第209回	2,000,000,000	2,007,980,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	237,766,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	111,817,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回	100,000,000	102,966,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	113,083,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	119,634,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	100,000,000	104,259,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	121,598,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債	300,000,000	339,795,000	

第77回			
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	121,505,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	103,865,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	207,558,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	225,008,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	130,149,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	256,585,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	207,018,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,726,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	104,093,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	298,902,000	
農林債券 利付第764回い号	100,000,000	100,329,000	
農林債券 利付第765回い号	300,000,000	300,894,000	
農林債券 利付第767回い号	300,000,000	301,017,000	
農林債券 利付第773回い号	300,000,000	300,957,000	
農林債券 利付第777回い号	300,000,000	301,203,000	
農林債券 利付第781回い号	100,000,000	100,536,000	
しんきん中金債券 利付第290回	100,000,000	100,275,000	
しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	100,281,000	
しんきん中金債券 利付第308回	100,000,000	100,476,000	
しんきん中金債券 利付第316回	100,000,000	99,919,000	
しんきん中金債券 利付第317回	800,000,000	799,072,000	
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	199,902,000	
商工債券 利付(3年)第202回	1,100,000,000	1,097,668,000	
商工債券 利付(3年)第203回	1,100,000,000	1,097,800,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	100,000,000	121,607,000	
東日本高速道路 第26回	100,000,000	100,429,000	
東日本高速道路 第27回	100,000,000	100,345,000	
東日本高速道路 第34回	100,000,000	100,563,000	
東日本高速道路 第36回	200,000,000	200,072,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	100,902,000	

中日本高速道路社債 第6 1回	100,000,000	100,588,000	
中日本高速道路 第6 2回	200,000,000	201,114,000	
中日本高速道路 第6 3回	100,000,000	102,997,000	
中日本高速道路 第6 6回	1,200,000,000	1,199,076,000	
西日本高速道路 第2 0回	200,000,000	207,218,000	
西日本高速道路 第2 3回	100,000,000	102,968,000	
西日本高速道路 第3 0回	300,000,000	299,007,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第3 5回	200,000,000	206,300,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第6 2回	100,000,000	103,775,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第6 8回	200,000,000	206,516,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第6 9回	100,000,000	113,810,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第9 7回	100,000,000	99,995,000	
貸付債権担保第6 回住宅金融公庫債 券	12,260,000	12,571,894	
貸付債権担保第1 2 回住宅金融公庫 債券	41,472,000	42,735,651	
貸付債権担保第1 9 回住宅金融公庫 債券	74,850,000	77,683,072	
貸付債権担保第1 0 回住宅金融公庫 債券	76,344,000	77,969,363	
貸付債権担保第5 回S種住宅金融公 庫債券	47,220,000	49,164,047	
貸付債権担保第4 2 回住宅金融公庫 債券	53,649,000	56,962,898	
貸付債権担保第7 回S種住宅金融公 庫債券	16,523,000	17,523,302	
貸付債権担保第3 9 回住宅金融公庫 債券	36,552,000	38,211,460	
貸付債権担保第4 0 回住宅金融公庫 債券	41,720,000	44,136,422	
貸付債権担保第1 5 回住宅金融公庫 債券	45,384,000	46,981,062	
貸付債権担保第3 2 回住宅金融公庫 債券	77,148,000	80,280,208	
貸付債権担保第2 0 回住宅金融公庫 債券	79,830,000	83,832,676	
貸付債権担保第4 4 回住宅金融公庫	70,388,000	74,803,439	

債券			
貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券	120,750,000	127,472,152	
貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券	19,752,000	20,890,307	
貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券	30,293,000	32,937,578	
貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援機構債券	101,214,000	108,752,418	
貸付債権担保 5 種第 1 6 回住宅金融支援機構債券	24,616,000	25,481,006	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券	106,422,000	112,015,540	
貸付債権担保 5 種第 1 7 回住宅金融支援機構債券	50,054,000	51,937,031	
貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券	132,492,000	141,176,850	
貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援機構債券	95,480,000	100,815,422	
貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券	56,176,000	60,976,239	
貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援機構債券	125,508,000	134,205,704	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融支援機構債券	135,804,000	142,084,935	
貸付債権担保第 6 2 回住宅金融支援機構債券	177,333,000	185,330,718	
貸付債権担保第 6 0 回住宅金融支援機構債券	173,751,000	182,442,025	
貸付債権担保第 6 1 回住宅金融支援機構債券	111,276,000	116,536,016	
貸付債権担保第 5 1 回住宅金融支援機構債券	45,083,000	47,800,603	
貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援機構債券	103,716,000	109,965,926	
貸付債権担保第 7 9 回住宅金融支援機構債券	57,927,000	60,286,366	
貸付債権担保第 8 1 回住宅金融支援機構債券	124,452,000	129,622,980	
貸付債権担保第 7 2 回住宅金融支援機構債券	58,768,000	61,095,800	
貸付債権担保第 2 2 回住宅金融公庫債券	32,192,000	33,555,653	

貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	172,464,000	180,712,953	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	37,374,000	39,956,917	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	38,945,000	41,629,089	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	39,690,000	42,267,468	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	44,451,000	47,480,780	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	113,144,000	119,203,992	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	162,753,000	171,478,188	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	54,018,000	56,961,440	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	110,236,000	115,420,399	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	15,317,000	15,971,801	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	110,955,000	114,389,057	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	45,040,000	46,380,390	
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券	20,290,000	20,371,768	
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	43,624,000	44,111,280	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	108,552,000	117,527,079	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	107,340,000	114,506,018	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	217,105,000	228,222,947	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	114,294,000	120,353,867	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	183,690,000	191,535,399	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	168,963,000	175,508,626	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	127,660,000	134,480,873	
貸付債権担保第75回住宅金融支援	110,020,000	115,476,992	

機構債券			
貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援 機構債券	259,000,000	269,370,360	
貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援 機構債券	457,555,000	475,248,651	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援 機構債券	67,712,000	70,054,158	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援 機構債券	70,216,000	72,740,265	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援 機構債券	71,289,000	73,516,068	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援 機構債券	146,500,000	149,960,330	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援 機構債券	153,394,000	155,671,900	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援 機構債券	80,493,000	82,692,068	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援 機構債券	84,252,000	86,254,670	
貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援 機構債券	249,960,000	257,313,823	
貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援 機構債券	253,743,000	262,352,499	
貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援 機構債券	170,186,000	175,727,256	
貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支 援機構債券	84,314,000	86,893,165	
貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支 援機構債券	85,018,000	87,898,409	
貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支 援機構債券	287,829,000	288,375,875	
貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支 援機構債券	192,770,000	194,231,196	
貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支 援機構債券	193,610,000	194,717,449	
貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支 援機構債券	97,227,000	97,939,673	
貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支 援機構債券	194,488,000	195,728,833	
貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支 援機構債券	97,688,000	97,825,740	
貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支 援機構債券	98,193,000	98,526,856	

		貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	98,819,000	99,344,717	
		貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	397,864,000	398,600,048	
		貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	299,532,000	300,238,895	
		貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,274,000	
	小計	銘柄数：291 組入時価比率：8.1%	53,889,976,000	56,801,087,540	8.2%
	合計			56,801,087,540	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFCM)第14回円貨社債	200,000,000	202,868,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第7回円貨社債	100,000,000	100,699,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第11回円貨社債	100,000,000	100,913,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債	100,000,000	100,164,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー第1回非上位円貨社債	100,000,000	101,124,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債(2014)	100,000,000	103,410,000	
		ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング第2回円貨社債	200,000,000	200,786,000	
		マラヤン・バンキング・ベルハット第2回円貨社債(2015)	200,000,000	200,218,000	
		スタンダード・チャータード第2回円貨社債(2015)	100,000,000	100,392,000	
		スタンダード・チャータード第3回円貨社債(2015)	100,000,000	99,904,000	
		エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー第2回円	100,000,000	102,470,000	
		エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー第3回円	100,000,000	105,526,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー第1回円貨社債	100,000,000	101,125,000	
		ルノー第19回円貨社債(2017)	100,000,000	100,272,000	
		パークレイズ・バンク・ピーエルシー第7回円貨社債	100,000,000	100,484,000	

ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回 円貨社債(2017)	100,000,000	103,063,000	
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	200,410,000	
オーストラリア・ニュージーランド 銀行 第10回円貨社債	200,000,000	200,110,000	
ラボバンク・ネダーランド 第25 回円貨社債(2014)	100,000,000	100,410,000	
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨 社債(2014)	200,000,000	201,108,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上 位円貨社債(2017)	100,000,000	100,384,000	
清水建設 第18回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,952,000	
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	101,017,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,935,000	
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	100,384,000	
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	100,805,000	
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	205,178,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	200,000,000	200,182,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,000,000	
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	103,583,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回 特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	197,066,000	
森ビル 第13回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,591,000	
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	103,187,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,052,000	
住友化学 第43回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,304,000	
住友化学 第56回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,701,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特	100,000,000	100,392,000	

約付			
エア・ウォーター 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,087,000	
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	202,232,000	
宇部興産 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,298,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,201,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,519,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,806,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,858,000	
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	103,247,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,729,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,636,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,289,000	
住友大阪セメント 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,303,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,708,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,890,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFEス保証)	100,000,000	102,518,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,058,000	
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,291,000	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,340,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	219,248,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,885,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,595,000	

日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,605,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,393,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,425,000	
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,220,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,252,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,154,000	
ソニー 第26回	100,000,000	102,874,000	
ソニー 第32回	200,000,000	200,622,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,937,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,809,000	
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	301,245,000	
J A三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,791,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,633,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	100,120,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	104,327,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,515,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,814,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,828,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,462,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,732,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,662,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,918,000	

豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,036,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,727,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,660,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,170,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	102,410,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,294,000	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,254,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,044,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,410,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,308,000	
あおぞら銀行 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,958,000	
あおぞら銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,928,000	
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	102,927,000	
りそなホールディングス 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,593,000	
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	205,864,000	
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	121,418,000	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	103,312,000	
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	105,695,000	
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	110,149,000	
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	102,712,000	
三菱東京UFJ銀行 第159回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,858,000	
三井住友フィナンシャルグループ	300,000,000	307,182,000	

第1回劣後特約付			
三井住友フィナンシャルグループ	100,000,000	102,703,000	
第3回劣後特約付			
三井住友フィナンシャルグループ	100,000,000	106,483,000	
第4回劣後特約付			
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,766,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	312,183,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	104,597,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	315,624,000	
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	100,296,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,335,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,167,000	
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	206,028,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	104,453,000	
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,258,000	
みずほ銀行 第38回特定社債間限定同順位特約付	1,000,000,000	1,003,550,000	
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,229,000	
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,182,000	
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	100,167,000	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,808,000	
リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,475,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,722,000	
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	200,238,000	
日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,754,000	
日立キャピタル 第56回社債間限	100,000,000	99,980,000	

定同順位特約付			
日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,015,000	
オリックス 第164回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,608,000	
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	100,142,000	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,399,000	
三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,881,000	
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	100,419,000	
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	100,519,000	
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	103,186,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	103,758,000	
野村ホールディングス 第46回	100,000,000	100,416,000	
三井不動産 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,443,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	109,865,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	102,462,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,725,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,409,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	99,430,000	
東京建物 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,294,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,116,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,576,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,344,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,665,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第10	100,000,000	102,396,000	

回社債間限定同順位特約付			
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	104,159,000	
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	101,865,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,024,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	204,086,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,563,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,960,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,372,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,333,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	106,928,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	218,858,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,018,000	
東日本旅客鉄道 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,812,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,837,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,255,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	119,757,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,297,000	
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,206,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	244,422,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,890,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	116,386,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	99,675,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	99,667,000	

東京地下鉄 第24回	100,000,000	99,662,000	
西武ホールディングス 第1回社債 間限定同順位特約付	200,000,000	203,550,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	104,618,000	
日本通運 第11回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,444,000	
日本通運 第12回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,647,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,337,000	
ANA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	101,639,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	100,919,000	
住友倉庫 第1回社債間限定同順位 特約付	200,000,000	200,320,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	103,485,000	
KDDI 第20回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,863,000	
東京電力 第459回	100,000,000	102,799,000	
東京電力 第547回	100,000,000	104,237,000	
東京電力 第548回	100,000,000	116,132,000	
東京電力 第559回	100,000,000	102,158,000	
東京電力 第560回	100,000,000	114,333,000	
東京電力 第565回	300,000,000	307,632,000	
中部電力 第482回	200,000,000	206,322,000	
中部電力 第500回	200,000,000	208,080,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,135,000	
関西電力 第482回	100,000,000	102,968,000	
関西電力 第484回	100,000,000	102,625,000	
関西電力 第496回	100,000,000	104,120,000	
関西電力 第497回	200,000,000	209,660,000	
関西電力 第498回	200,000,000	202,074,000	
中国電力 第330回	100,000,000	106,466,000	
中国電力 第377回	200,000,000	210,080,000	
中国電力 第378回	100,000,000	104,483,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	104,996,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	104,396,000	

	北陸電力 第307回	100,000,000	105,948,000	
	北陸電力 第308回	100,000,000	103,478,000	
	東北電力 第473回	100,000,000	101,680,000	
	東北電力 第475回	100,000,000	103,503,000	
	東北電力 第481回	200,000,000	207,224,000	
	四国電力 第281回	200,000,000	210,234,000	
	九州電力 第400回	100,000,000	103,976,000	
	九州電力 第409回	100,000,000	102,372,000	
	九州電力 第424回	300,000,000	316,905,000	
	九州電力 第451回	100,000,000	100,316,000	
	北海道電力 第316回	207,000,000	212,402,700	
	北海道電力 第323回	100,000,000	109,273,000	
	北海道電力 第338回	100,000,000	99,506,000	
	電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,959,000	
	電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,214,000	
	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,049,000	
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,972,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,339,000	
	東京電力パワーグリッド 第1回	100,000,000	100,279,000	
	東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,809,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	123,472,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,155,000	
	北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,149,000	
	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	101,258,000	
小計	銘柄数：222 組入時価比率：4.2%	28,607,000,000	29,435,242,700	4.2%
合計			29,435,242,700	
合計			696,893,822,027	

(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。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(平成29年12月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	194,905,179
コール・ローン	4,541,820,710
国債証券	19,667,242,664
派生商品評価勘定	21,975,015
未収利息	32,637,004
前払費用	78,126,035
差入委託証拠金	71,790,666
流動資産合計	24,608,497,273
資産合計	24,608,497,273
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	131,057,875
未払金	4,541,160,924
未払解約金	45,587
未払利息	5,226
その他未払費用	696,000
流動負債合計	4,672,965,612
負債合計	4,672,965,612
純資産の部	
元本等	
元本	17,647,153,639
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,288,378,022
元本等合計	19,935,531,661
純資産合計	19,935,531,661
負債純資産合計	24,608,497,273

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月26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	1.1297円
(10,000口当たり純資産額)	(11,297円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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29年12月26日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年12月26日現在

	平成28年12月27日
期首	
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	12,046,706,370円
同期中における追加設定元本額	45,548,385,386円
同期中における一部解約元本額	39,947,938,117円
期末元本額	17,647,153,639円
期末元本額の内訳*	
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	575,259,043円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	829,262,566円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	12,951,655円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,981,635円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,118,196円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,322,142円
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	735,973,220円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,717,606円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,296,457円
インデックス・ブレンド(タイプ)	12,333,108円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,433,153円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,351,485円
野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	878,944円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	3,666,088円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	860,144,830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)	14,591,463,511円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年12月26日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26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	70,000.00	84,650.78	
		US TREASURY BOND	210,000.00	265,387.50	
		US TREASURY BOND	80,000.00	105,837.50	
		US TREASURY BOND	280,000.00	358,246.86	
		US TREASURY BOND	20,000.00	25,217.18	
		US TREASURY BOND	80,000.00	101,281.24	
		US TREASURY BOND	1,410,000.00	1,425,091.36	
		US TREASURY BOND	850,000.00	996,492.23	
		US TREASURY N/B	100,000.00	99,484.38	
		US TREASURY N/B	300,000.00	296,367.18	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,891,761.79	
		US TREASURY N/B	700,000.00	698,058.62	
		US TREASURY N/B	300,000.00	298,453.14	
		US TREASURY N/B	3,660,000.00	3,646,989.79	
		US TREASURY N/B	200,000.00	196,906.26	
		US TREASURY N/B	970,000.00	997,129.73	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,571,000.00	
		US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,353,422.04	
		US TREASURY N/B	130,000.00	133,615.62	
		US TREASURY N/B	320,000.00	314,600.00	
		US TREASURY N/B	300,000.00	296,753.91	
		US TREASURY N/B	140,000.00	145,014.84	
		US TREASURY N/B	130,000.00	127,598.04	
		US TREASURY N/B	200,000.00	197,398.44	
		US TREASURY N/B	80,000.00	82,903.12	
		US TREASURY N/B	3,150,000.00	3,116,654.41	
		US TREASURY N/B	2,050,000.00	2,033,584.01	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,284,460.97			
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,305,078.19			

US TREASURY N/B	1,000,000.00	984,687.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	393,140.64	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,626,812.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	209,609.38	
US TREASURY N/B	180,000.00	179,683.59	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,615,160.11	
US TREASURY N/B	550,000.00	550,021.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	198,648.44	
US TREASURY N/B	500,000.00	491,328.15	
US TREASURY N/B	200,000.00	196,281.26	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,372,546.84	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,190,890.68	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,624,843.75	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,045,941.38	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,049,746.21	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,146,000.00	
US TREASURY N/B	150,000.00	145,787.11	
US TREASURY N/B	160,000.00	158,956.25	
US TREASURY N/B	210,000.00	207,292.97	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,593.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	202,156.26	
US TREASURY N/B	600,000.00	613,593.78	
US TREASURY N/B	800,000.00	778,625.04	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,406,762.62	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,605,143.81	
US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,415,062.50	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,312,062.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,015.63	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,951,987.52	
US TREASURY N/B	160,000.00	205,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	124,742.19	
US TREASURY N/B	250,000.00	327,949.22	
US TREASURY N/B	440,000.00	522,603.13	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,872,968.80	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,692,787.50	

小計	US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,269,942.15	
	US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,259,364.03	
	US TREASURY N/B	130,000.00	121,478.90	
	US TREASURY N/B	530,000.00	469,091.39	
	US TREASURY N/B	200,000.00	201,562.50	
	銘柄数：69 組入時価比率：42.3%	74,370,000.00	74,384,685.61 (8,433,735,654) 42.8%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	591,636.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	796,816.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	649,524.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	284,301.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	294,252.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	560,000.00	579,392.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	196,703.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	99,434.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	164,587.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	294,246.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	380,000.00	500,083.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	277,970.00	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：2.1%	4,410,000.00	4,728,946.60 (421,491,010) 2.1%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	900,000.00	857,214.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,000,000.00	3,025,515.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,700,000.00	4,532,210.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,404,250.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,100,000.00	1,082,169.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	3,089,398.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	2,119,500.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,300,000.00	1,308,001.50	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	2,300,000.00	2,332,752.00	
小計	銘柄数：9 組入時価比率：0.7%	23,400,000.00	22,751,009.50 (130,590,794) 0.7%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	318,730.80	

BELGIUM KINGDOM	300,000.00	335,063.40
BELGIUM KINGDOM	340,000.00	399,018.56
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	121,125.70
BELGIUM KINGDOM	400,000.00	404,040.00
BELGIUM KINGDOM	30,000.00	34,847.34
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	306,416.70
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	104,837.50
BELGIUM KINGDOM	450,000.00	458,634.60
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	201,174.60
BELGIUM KINGDOM	50,000.00	70,573.35
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	102,971.60
BELGIUM KINGDOM	120,000.00	132,537.96
BELGIUM KINGDOM	250,000.00	375,915.75
BELGIUM KINGDOM	70,000.00	75,458.18
BELGIUM KINGDOM GOVT	270,000.00	436,636.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	343,887.06
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,170,000.00	1,210,910.22
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	103,480.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,000.00	22,836.72
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	200,716.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	930,000.00	955,234.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	190,000.00	234,819.29
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	740,000.00	905,427.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	720,000.00	861,407.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,320,000.00	1,402,460.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	599,944.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,000.00	40,570.56
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	140,000.00	142,060.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	412,381.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	418,839.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	362,619.95
BUNDESobligation	600,000.00	610,167.60
BUNDESobligation	800,000.00	812,721.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	372,857.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	327,375.60

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	215,299.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	250,000.00	274,044.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,202,733.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	609,767.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	233,058.63	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	468,406.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	922,232.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	97,702.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	770,000.00	763,682.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	201,620.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	482,131.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	481,983.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	110,000.00	179,522.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	30,000.00	52,624.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	1,100,260.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	277,724.79	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	100,000.00	100,707.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	400,000.00	404,837.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	155,477.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000.00	169,118.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,543,282.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	307,266.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	186,410.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	504,951.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	60,000.00	66,454.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,119,371.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	189,575.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	100,949.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	11,643.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	451,079.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,030,000.00	1,066,685.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,453,298.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	201,595.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	178,762.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	261,797.22	

BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	562,302.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	80,000.00	82,684.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,792,893.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	673,150.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	206,263.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	491,726.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	183,403.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	467,862.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES	710,000.00	945,874.07	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	334,464.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	201,137.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	758,675.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	270,803.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	8,858.68	
FINNISH GOVERNMENT	50,000.00	54,488.25	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	92,115.72	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	302,569.50	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	162,370.35	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	223,781.00	
FINNISH GOVERNMENT	10,000.00	10,105.69	
FINNISH GOVERNMENT	40,000.00	48,708.76	
FINNISH GOVERNMENT	60,000.00	79,198.08	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,022,859.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	505,973.00	
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	404,490.80	
FRANCE (GOVT OF)	210,000.00	239,037.33	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,008,317.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,650,000.00	1,614,841.80	
FRANCE (GOVT OF)	120,000.00	142,700.16	
FRANCE (GOVT OF)	450,000.00	447,237.45	
FRANCE (GOVT OF)	250,000.00	266,754.00	
FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	729,898.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	200,000.00	233,507.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,093,540.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	500,000.00	509,619.50	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	90,000.00	102,474.54	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,120,000.00	1,276,983.68	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,310,000.00	1,461,238.19	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	443,430.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	710,000.00	894,761.88	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	200,000.00	303,446.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	340,000.00	361,996.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	990,000.00	1,551,514.14	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	120,000.00	193,752.72	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	150,000.00	247,929.60	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	170,000.00	182,504.69	
IRISH GOVERNMENT	200,000.00	223,449.60	
IRISH TSY 0.8% 2022	300,000.00	312,079.50	
IRISH TSY 1.7% 2037	50,000.00	52,168.40	
IRISH TSY 1% 2026	250,000.00	258,081.00	
IRISH TSY 2% 2045	50,000.00	53,297.75	
IRISH TSY 3.4% 2024	200,000.00	239,478.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	107,336.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	407,292.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	226,269.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	550,000.00	612,647.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	275,590.83	
NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	809,770.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	150,000.00	184,777.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	562,043.16	
NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	68,551.95	
REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	8,900.55	
REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	405,921.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	350,381.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA	520,000.00	572,699.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	409,545.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	99,404.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	30,000.00	36,151.38	
REPUBLIC OF AUSTRIA	30,000.00	45,779.22	
REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	421,683.60	

小計	REPUBLIC OF AUSTRIA	30,000.00	51,095.04	
	REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	96,113.84	
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	130,034.07	
	SPANISH GOVERNMENT	310,000.00	403,622.79	
	銘柄数：145 組入時価比率：41.1%	54,760,000.00	60,871,172.01 (8,193,259,752) 41.7%	
英ポンド	UK TREASURY	300,000.00	306,125.70	
	UK TREASURY	60,000.00	63,387.00	
	UK TREASURY	980,000.00	1,017,683.94	
	UK TREASURY	300,000.00	308,628.00	
	UK TREASURY	520,000.00	592,244.64	
	UK TREASURY	200,000.00	209,258.00	
	UK TREASURY	100,000.00	99,210.50	
	UK TREASURY	250,000.00	269,306.50	
	UK TREASURY	250,000.00	279,032.00	
	UK TREASURY	820,000.00	843,925.14	
	UK TREASURY	90,000.00	133,011.00	
	UK TREASURY	300,000.00	415,900.50	
	UK TREASURY	560,000.00	781,431.84	
	UK TREASURY	450,000.00	446,633.55	
	UK TREASURY	100,000.00	153,353.00	
	UK TREASURY	1,180,000.00	1,817,270.80	
	UK TREASURY	440,000.00	703,384.00	
	UK TREASURY	500,000.00	760,225.00	
	UK TREASURY	80,000.00	131,416.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	30,000.00	51,370.11	
小計	銘柄数：20 組入時価比率：7.1%	7,510,000.00	9,382,797.22 (1,422,525,886) 7.2%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	80,000.00	87,230.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	10,000.00	14,235.50	
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.1%	90,000.00	101,465.50 (11,632,004) 0.1%	
スウェーデンク	SWEDISH GOVERNMENT	600,000.00	696,072.00	

ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,741,779.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,188,436.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	289,737.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,042,381.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	400,000.00	551,261.60	
小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.4%	4,850,000.00	5,509,667.30 (74,931,475) 0.4%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,050,000.00	1,151,049.90	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	400,000.00	417,606.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	750,000.00	827,610.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	700,000.00	702,727.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	350,000.00	356,246.10	
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.2%	3,250,000.00	3,455,240.00 (47,094,921) 0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	450,000.00	489,213.00	
	KINGDOM OF DENMARK	550,000.00	561,167.75	
	KINGDOM OF DENMARK	500,000.00	564,805.00	
	KINGDOM OF DENMARK	650,000.00	708,219.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,570,612.40	
	KINGDOM OF DENMARK	300,000.00	301,068.60	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	2,374,194.20	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.6%	5,250,000.00	6,569,280.15 (118,772,585) 0.6%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	170,819.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	99,164.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,650,000.00	1,617,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	169,080.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	158,560.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	533,075.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	700,000.00	662,445.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	233,636.00	
小計	銘柄数：8	3,670,000.00	3,643,779.20 (116,928,874)	

	組入時価比率：0.6%		0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	180,000.00	182,396.88
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	70,000.00	73,781.54
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	810,471.60
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	395,634.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	137,572.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	198,679.60
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	345,817.50
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	40,000.00	41,734.88
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,141,110.72
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	140,263.56
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	501,713.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	220,000.00	210,142.68
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	320,160.33
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	94,961.90
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	50,000.00	54,060.95
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	119,586.96
	小計	銘柄数：17	4,600,000.00
組入時価比率：2.1%			2.2%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	530,000.00	521,467.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	629,100.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	202,135.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	410,000.00	439,930.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	98,872.50
小計	銘柄数：5	1,820,000.00	1,891,505.00 (159,548,446)
	組入時価比率：0.8%		0.8%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	779,280.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	494,622.50
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,900,000.00	3,219,870.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	650,000.00	589,798.30
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	660,710.40
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,500,000.00	3,272,090.50
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,700,000.00	1,516,510.50

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,250,000.00	2,016,900.00	
	小計	銘柄数：8	13,100,000.00	12,549,782.20	
				(113,701,026)	
		組入時価比率：0.6%		0.6%	
	合計			19,667,242,664	
				(19,667,242,664)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年12月26日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	4,423,027,685	-	4,431,855,500	8,827,815
米ドル	1,857,126,130	-	1,859,021,000	1,894,870
カナダドル	99,675,190	-	100,699,300	1,024,110
メキシコペソ	35,264,700	-	34,380,000	884,700
ユーロ	1,839,581,378	-	1,843,883,000	4,301,622
英ポンド	348,245,520	-	348,669,000	423,480
ノルウェークローネ	27,050,652	-	27,240,000	189,348
デンマーククローネ	21,720,600	-	21,696,000	24,600
ズロチ	47,734,500	-	48,120,000	385,500
豪ドル	84,174,345	-	84,898,900	724,555
シンガポールドル	26,110,220	-	26,143,300	33,080
ランド	36,344,450	-	37,105,000	760,550
売建	19,879,783,296	-	19,997,693,971	117,910,675
米ドル	8,504,822,582	-	8,542,562,490	37,739,908
カナダドル	421,111,625	-	426,672,860	5,561,235
メキシコペソ	141,571,960	-	136,685,980	4,885,980
ユーロ	8,288,621,979	-	8,345,925,900	57,303,921
英ポンド	1,458,902,350	-	1,459,107,296	204,946
スイスフラン	13,972,452	-	13,989,740	17,288
スウェーデンクローナ	76,018,388	-	77,329,600	1,311,212

ノルウェークローネ	48,871,978	-	49,154,580	282,602
デンマーククローネ	119,203,071	-	119,964,416	761,345
ズロチ	118,551,315	-	119,610,600	1,059,285
豪ドル	420,416,768	-	429,920,600	9,503,832
シンガポールドル	160,485,779	-	161,746,869	1,261,090
ランド	107,233,049	-	115,023,040	7,789,991
合計	-	-	-	109,082,860

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成29年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	93,310,382
コール・ローン	205,366,738
国債証券	636,630,635,917
派生商品評価勘定	51,660
未収利息	6,081,463,254
前払費用	199,972,622
流動資産合計	643,210,800,573
資産合計	643,210,800,573
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,990
未払解約金	270,118,874
未払利息	236
その他未払費用	5,398,900
流動負債合計	275,550,000
負債合計	275,550,000
純資産の部	
元本等	

(平成29年12月26日現在)

元本	277,315,880,154
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	365,619,370,419
元本等合計	642,935,250,573
純資産合計	642,935,250,573
負債純資産合計	643,210,800,573

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成29年12月26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	2.3184円
(10,000口当たり純資産額)	(23,184円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月26日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年12月26日現在	
期首	平成28年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	301,949,646,048円
同期中における追加設定元本額	25,847,524,389円
同期中における一部解約元本額	50,481,290,283円
期末元本額	277,315,880,154円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	88,542,979円
バランスセレクト50	91,844,384円
バランスセレクト70	77,166,834円
野村外国債券インデックスファンド	290,757,142円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,949,098,134円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	26,307,964,228円

野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,466,398,648円
野村資産設計ファンド2015	34,039,676円
野村資産設計ファンド2020	39,345,037円
野村資産設計ファンド2025	46,930,968円
野村資産設計ファンド2030	41,423,357円
野村資産設計ファンド2035	27,641,716円
野村資産設計ファンド2040	62,505,585円
野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	164,720,857,830円
のむラップ・ファンド(保守型)	5,034,635,263円
のむラップ・ファンド(普通型)	7,872,836,856円
のむラップ・ファンド(積極型)	1,766,843,848円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	1,244,635,343円
野村資産設計ファンド2045	5,709,986円
野村インデックスファンド・外国債券	701,900,254円
マイ・ロード	8,336,794,159円
ネクストコア	467,573,849円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	99,852,275円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,894,297,270円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	728,441,885円
野村資産設計ファンド2050	6,038,094円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,666,735円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,298,475円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,121,526円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	888,936円
のむラップ・ファンド(やや保守型)	351,346,417円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	148,049,160円
インデックス・ブレンド(タイプ)	637,999円
インデックス・ブレンド(タイプ)	453,572円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,693,849円
インデックス・ブレンド(タイプ)	262,542円
インデックス・ブレンド(タイプ)	791,097円
野村6資産均等バランス	174,408円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	361,986円
NEXT FUNDS 外国債券・シティ世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	64,624,838円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	144,311,153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)	12,075,889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)	1,922,144,661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)	582,649,961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)	3,643,153,394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)	1,591,306,107円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,636,546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)	16,159,092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)	849,028円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	5,975,499,061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)	260,675,809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)	1,023,995,434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)	184,449,576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)	204,250,793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)	237,644,481円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	2,135,119,053円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,014,215,627円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,290,524,688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)	811,681,764円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,846,320円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,244,541円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,842,103円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	544,183,814円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,207,237,296円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	3,068,878,552円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,784,664,516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)	13,042,875,543円
マイバランスDC30	1,447,419,677円
マイバランスDC50	854,275,919円
マイバランスDC70	552,464,851円
野村DC外国債券インデックスファンド	3,813,658,296円
野村DC運用戦略ファンド	2,701,596,619円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	187,931,340円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	46,872,821円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	4,586,372円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	7,181,507円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	186,743円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	766,065円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	165,094円
野村資産設計ファンド(DC)2030	73,088円
野村資産設計ファンド(DC)2040	80,018円
野村資産設計ファンド(DC)2050	59,802円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年12月26日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26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	19,840,000.00	21,832,525.24	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	14,913,074.06	

US TREASURY BOND	22,100,000.00	26,930,058.87	
US TREASURY BOND	13,800,000.00	16,688,297.22	
US TREASURY BOND	47,100,000.00	47,070,562.50	
US TREASURY BOND	39,200,000.00	49,539,000.00	
US TREASURY BOND	18,800,000.00	24,871,813.44	
US TREASURY BOND	21,400,000.00	28,229,608.84	
US TREASURY BOND	17,000,000.00	21,750,702.70	
US TREASURY BOND	12,000,000.00	15,130,312.80	
US TREASURY BOND	800,000.00	1,012,812.48	
US TREASURY BOND	100,000.00	126,265.63	
US TREASURY BOND	25,300,000.00	25,570,788.43	
US TREASURY BOND	16,000,000.00	18,757,500.80	
US TREASURY N/B	500,000.00	498,164.05	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,971,406.40	
US TREASURY N/B	700,000.00	696,390.66	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,472,070.15	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,483,027.55	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,063,742.06	
US TREASURY N/B	8,100,000.00	8,050,007.61	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,487,831.90	
US TREASURY N/B	500,000.00	496,210.95	
US TREASURY N/B	37,500,000.00	37,886,718.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	197,578.12	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	994,531.30	
US TREASURY N/B	16,200,000.00	16,136,086.14	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,689,468.48	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,982,656.40	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	25,429,278.30	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,192,190.87	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,455,976.65	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,959,765.50	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,567,702.86	
US TREASURY N/B	27,600,000.00	28,080,844.44	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,848,050.83	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,385,726.58	

US TREASURY N/B	23,600,000.00	23,478,313.68	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,082,117.24	
US TREASURY N/B	900,000.00	887,167.98	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,382,171.84	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,871,917.87	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,882,706.96	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	10,319,531.25	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,444,492.55	
US TREASURY N/B	600,000.00	595,265.64	
US TREASURY N/B	32,400,000.00	33,306,189.12	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,818,750.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,956,523.40	
US TREASURY N/B	26,750,000.00	26,631,922.82	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,954,179.80	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,454,473.35	
US TREASURY N/B	50,800,000.00	52,212,875.00	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,651,500.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,786,148.46	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,815,780.80	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,368,992.12	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,978,046.80	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,326,382.88	
US TREASURY N/B	51,800,000.00	53,655,491.54	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,661,925.68	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,941,211.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,966,601.50	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,929,062.40	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	21,037,909.89	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,085,691.42	
US TREASURY N/B	46,200,000.00	47,876,556.42	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,144,953.32	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,570,171.46	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,300,703.28	
US TREASURY N/B	13,400,000.00	13,412,562.50	
US TREASURY N/B	32,180,000.00	32,723,037.50	

US TREASURY N/B	36,200,000.00	36,341,408.06	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,002,812.80	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,070.32	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,589,375.04	
US TREASURY N/B	52,600,000.00	53,520,500.00	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,870,125.00	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,313,250.00	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,858,632.90	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	48,000,548.02	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,991,211.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,712,891.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,809,843.84	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,959,609.92	
US TREASURY N/B	38,400,000.00	39,700,500.48	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,433,204.25	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,018,594.60	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,743,953.61	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	25,300,989.23	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,264,925.69	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,988,750.40	
US TREASURY N/B	12,900,000.00	12,829,453.77	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	25,177,454.39	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,921,562.40	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,381,593.44	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,787,500.00	
US TREASURY N/B	13,600,000.00	13,432,656.08	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	33,472,262.14	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,173,390.99	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,715,922.37	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	34,328,710.50	
US TREASURY N/B	19,500,000.00	19,222,735.35	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,828,703.32	
US TREASURY N/B	27,100,000.00	26,987,789.74	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,034,855.34	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,955,234.40	

US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,621,949.59	
US TREASURY N/B	29,800,000.00	29,605,602.68	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	21,450,860.20	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,780,859.80	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	24,057,617.50	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,575,469.30	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,834,179.50	
US TREASURY N/B	49,600,000.00	48,253,439.36	
US TREASURY N/B	34,400,000.00	33,228,250.00	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	19,744,785.94	
US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,609,157.22	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	17,206,875.84	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,152,914.22	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,407,188.84	
US TREASURY N/B	25,100,000.00	25,289,231.41	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	33,879,375.00	
US TREASURY N/B	44,700,000.00	43,505,674.11	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,372,538.90	
US TREASURY N/B	24,500,000.00	23,776,485.60	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	49,635,884.07	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,878,750.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	749,750.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,850,625.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,513,515.30	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,761,327.80	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,776,593.68	
US TREASURY N/B	11,100,000.00	14,645,062.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	128,359.38	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,843,210.83	
US TREASURY N/B	100,000.00	124,742.19	
US TREASURY N/B	100,000.00	128,929.69	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	7,998,539.22	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,179.69	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	12,080,585.70	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	8,551,687.68	

	US TREASURY N/B	12,800,000.00	16,023,000.32	
	US TREASURY N/B	12,000,000.00	16,064,062.80	
	US TREASURY N/B	6,700,000.00	8,546,687.50	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,878,828.45	
	US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,502,250.00	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,661,718.75	
	US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,110,875.00	
	US TREASURY N/B	17,600,000.00	17,417,125.44	
	US TREASURY N/B	24,200,000.00	25,574,484.98	
	US TREASURY N/B	15,400,000.00	17,684,734.76	
	US TREASURY N/B	13,200,000.00	15,177,938.16	
	US TREASURY N/B	18,900,000.00	20,857,922.82	
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,907,500.80	
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	38,110,781.25	
	US TREASURY N/B	27,600,000.00	25,846,969.44	
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	22,398,468.75	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,015,781.20	
	US TREASURY N/B	15,100,000.00	15,587,210.56	
	US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,036,296.66	
	US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,389,726.68	
	US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,451,804.59	
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,046,875.00	
小計	銘柄数：164	2,333,770,000.00	2,404,370,339.07	
			(272,607,509,043)	
	組入時価比率：42.4%		42.7%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	4,600,000.00	4,783,448.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	98,897.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	4,511,520.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	395,600.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	10,301,100.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,716,095.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,062,260.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	16,300,000.00	16,235,126.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,133,138.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,730,700.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	7,949,408.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,050,000.00	10,546,570.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	289,203.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,653,476.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,448,750.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,511,864.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	8,173,577.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,427,160.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,883,390.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	5,144,540.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,011,778.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,292,642.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,680,000.00	7,790,460.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	5,002,182.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	6,335,736.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	5,132,439.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	12,303,018.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,669,204.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	231,168.00	
小計	銘柄数：29	143,930,000.00	155,764,450.30 (13,883,285,455)	
	組入時価比率：2.2%		2.2%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,200,000.00	65,756,482.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	107,000,000.00	101,913,220.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,600,000.00	53,047,363.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	126,000,000.00	121,501,800.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	71,100,000.00	67,927,518.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	41,700,000.00	46,830,351.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,000,000.00	7,046,800.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	79,100,000.00	77,817,789.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,600,000.00	52,426,208.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	46,486,050.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,965,800.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	55,834,800.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	31,400,000.00	33,276,150.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	62,953,236.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	2,012,310.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	84,181,920.00	
	銘柄数：16	883,400,000.00	888,977,797.00	
	組入時価比率：0.8%		(5,102,732,554)	0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	7,600,000.00	8,074,513.60	
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	6,477,892.40	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,102,636.80	
	BELGIUM KINGDOM	4,800,000.00	5,681,308.80	
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	7,752,044.80	
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,636,255.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	8,131,046.00	
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,277,117.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,048,375.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,038,376.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,005,873.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,940,134.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,104,483.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,400,000.00	8,514,131.40	
	BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	8,270,146.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	993,707.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,346,740.80	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,077,974.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	3,000,000.00	3,173,484.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,900,000.00	16,288,033.50	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,000,000.00	16,171,720.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,200,000.00	6,244,559.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,600,000.00	2,709,413.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	12,000,000.00	12,950,076.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,900,000.00	12,925,113.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,800,000.00	3,932,870.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	25,250,000.00	27,748,790.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,600,000.00	12,103,461.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	401,433.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,900,000.00	11,726,500.50	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,060,090.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,350,000.00	12,791,471.85
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,300,000.00	10,421,280.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,000,000.00	9,788,400.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,900,000.00	17,417,589.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,700,000.00	8,015,873.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	947,655.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	19,863,792.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,374,820.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,479,363.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,099,711.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,576,873.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,030,953.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	7,693,844.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	11,727,492.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	11,543,282.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,200,336.00
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,016,946.00
BUNDES OblIGATION	3,600,000.00	3,651,541.20
BUNDES OblIGATION	3,000,000.00	3,069,384.00
BUNDES OblIGATION	1,600,000.00	1,625,443.20
BUNDES OblIGATION	900,000.00	909,526.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000.00	7,350,625.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,700,000.00	7,235,792.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,474,133.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,317,423.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,528,600.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	7,921,151.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	9,236,446.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,300,000.00	11,290,612.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	7,107,061.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,417,640.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,651,443.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,662,129.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,000,000.00	15,667,036.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,100,000.00	13,935,121.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,325,877.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,643,635.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,300,000.00	10,964,968.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,500,000.00	10,811,251.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,370,575.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	307,410.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,487,692.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	30,507,916.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,059,184.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	4,887,095.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	10,796,526.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,517,656.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,800,000.00	12,531,558.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000.00	7,375,180.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	11,424,168.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	12,629,980.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	5,721,354.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	8,512,419.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	10,579,992.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,036,514.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000,000.00	10,504,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,959,572.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,800,000.00	6,836,822.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	8,199,836.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,851,939.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,630,000.00	16,813,659.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	409,688.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	8,892,504.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	32,018,792.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	17,942,601.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,035,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,712,687.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000,000.00	11,191,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,004,344.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	16,766,899.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,550,000.00	4,560,910.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,974,696.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	309,021.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	9,081,716.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,100,000.00	24,743,904.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,300,000.00	3,326,317.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	5,601,239.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,300,000.00	11,273,683.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,016,819.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	19,112,547.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,127,623.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,671,082.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	8,494,231.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	18,618,444.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,012,999.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,100,677.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	12,855,192.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	10,496,649.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	23,350,602.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,300,000.00	7,943,273.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,700,000.00	27,440,127.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	26,119,590.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	458,507.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	9,049,785.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,900,000.00	11,856,731.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,000,000.00	7,167,090.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,727,344.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,300,000.00	15,074,618.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,600,000.00	15,173,519.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,100,000.00	6,353,455.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,060,412.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,328,802.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,399,626.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,307,718.00	

FINNISH GOVERNMENT	2,300,000.00	2,354,068.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,257,338.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,472,492.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,298,962.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,244,824.50	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,277,863.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,044,739.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,021,138.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,700,000.00	3,287,841.30	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	691,357.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,111,948.80	
FRANCE (GOVT OF)	11,300,000.00	11,558,306.70	
FRANCE (GOVT OF)	10,300,000.00	10,511,974.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	2,831,337.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,113,140.60	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	7,131,117.00	
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	14,270,016.00	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	596,316.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,300,000.00	1,310,039.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,500,000.00	1,598,089.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	4,670,152.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,500,000.00	5,941,545.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	16,184,392.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,700,000.00	28,939,676.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,038,478.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	13,435,550.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	17,167,250.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	16,532,378.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,631,902.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,200,000.00	9,038,397.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000.00	39,096,454.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,325,725.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	28,695,447.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,316,386.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	41,713,546.80	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,200,000.00	11,070,442.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000.00	37,172,233.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,129,390.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,100,000.00	26,634,664.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,300,000.00	11,440,457.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,300,000.00	12,371,921.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,900,000.00	27,286,841.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,700,000.00	24,230,556.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,500,000.00	8,853,718.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,700,000.00	6,115,596.80	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	100,000.00	107,355.70	
IRISH GOVERNMENT	3,400,000.00	3,798,643.20	
IRISH GOVERNMENT	8,680,000.00	9,700,985.00	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,044,995.50	
IRISH GOVERNMENT	4,930,000.00	6,685,715.97	
IRISH TSY 0.8% 2022	4,900,000.00	5,097,298.50	
IRISH TSY 1.7% 2037	800,000.00	834,694.40	
IRISH TSY 1% 2026	3,500,000.00	3,613,134.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,334,196.80	
IRISH TSY 2% 2045	2,500,000.00	2,664,887.50	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,600,000.00	7,902,800.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	3,470,771.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	6,976,846.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,036,464.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,800,000.00	5,300,889.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,350,000.00	7,184,066.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	404,746.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,670,857.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,069,503.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	5,961,889.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,541,283.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,199,339.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,048,852.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,043,334.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,879,168.10	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	5,420,140.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	6,115,512.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,200,000.00	9,679,632.20	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,100,000.00	4,250,220.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,413,373.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	106,032.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	103,778.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	507,402.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,336,678.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,035,377.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,503,817.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	5,870,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,997,886.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,550,000.00	2,808,429.75	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,200,000.00	4,626,148.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,389,843.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,408,810.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,047,728.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,100,000.00	9,416,942.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,205,046.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,700,000.00	8,698,051.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,590,304.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	255,475.20	
	REPUBLIC OF IRELAND	4,000,000.00	4,805,692.00	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,117,168.00	
	SPANISH GOVERNMENT	8,500,000.00	12,614,467.50	
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	6,770,446.80	
小計	銘柄数：232	1,576,340,000.00	1,951,453,519.02 (262,665,643,660)	
	組入時価比率：40.9%		41.3%	
英債券	UK TREASURY	6,000,000.00	6,122,514.00	
	UK TREASURY	200,000.00	211,290.00	
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,641,285.00	
	UK TREASURY	19,490,000.00	20,239,448.97	
	UK TREASURY	7,400,000.00	8,047,477.80	

	UK TREASURY	3,300,000.00	3,394,908.00
	UK TREASURY	7,540,000.00	9,443,872.62
	UK TREASURY	8,770,000.00	9,781,181.00
	UK TREASURY	4,250,000.00	4,840,461.00
	UK TREASURY	8,600,000.00	8,506,690.00
	UK TREASURY	8,700,000.00	9,102,723.00
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,289,736.50
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,493,852.60
	UK TREASURY	10,250,000.00	11,440,312.00
	UK TREASURY	11,850,000.00	15,149,395.50
	UK TREASURY	10,030,000.00	12,848,931.50
	UK TREASURY	5,350,000.00	7,906,765.00
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,902,109.50
	UK TREASURY	5,750,000.00	7,742,593.50
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,319,728.00
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,046,700.60
	UK TREASURY	300,000.00	297,755.70
	UK TREASURY	2,850,000.00	4,333,710.00
	UK TREASURY	4,200,000.00	6,045,799.20
	UK TREASURY	2,800,000.00	4,079,740.00
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,047,827.00
	UK TREASURY	20,100,000.00	27,146,457.00
	UK TREASURY	6,400,000.00	9,856,384.00
	UK TREASURY	3,000,000.00	2,783,823.00
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,552,510.00
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,303,937.50
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,121,054.00
	UK TREASURY	400,000.00	514,180.00
	UK TREASURY	5,450,000.00	8,952,715.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	20,300,000.00	26,142,177.60
	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	7,100,000.00	12,157,592.70
小計	銘柄数：36	234,580,000.00	298,807,638.79 (45,302,226,116)
	組入時価比率：7.0%		7.1%
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	4,800,000.00	5,233,800.00
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,150,000.00	4,484,182.50

小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.2%	7,950,000.00	9,717,982.50 (1,114,069,513) 0.2%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	39,700,000.00	46,056,764.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	48,850,000.00	56,723,936.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	28,300,000.00	30,575,235.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	34,350,000.00	39,809,863.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,508,572.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,100,000.00	14,129,610.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,000,000.00	23,428,618.00	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.5%	194,300,000.00	223,232,599.00 (3,035,963,346) 0.5%	
ノルウェークロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	21,200,000.00	22,414,675.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	30,256,168.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,929,443.10	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	49,546,252.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,814,680.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,718,311.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	8,900,000.00	9,058,829.40	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.3%	126,300,000.00	135,738,359.70 (1,850,113,842) 0.3%	
デンマーククロー ネ	KINGDOM OF DENMARK	21,300,000.00	23,156,082.00	
	KINGDOM OF DENMARK	5,000,000.00	5,101,525.00	
	KINGDOM OF DENMARK	37,100,000.00	41,908,531.00	
	KINGDOM OF DENMARK	31,370,000.00	34,179,748.16	
	KINGDOM OF DENMARK	31,400,000.00	35,226,592.40	
	KINGDOM OF DENMARK	7,900,000.00	7,928,139.80	
	KINGDOM OF DENMARK	42,000,000.00	71,225,826.00	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.6%	176,070,000.00	218,726,444.36 (3,954,574,114) 0.6%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	2,400,000.00	2,350,881.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,700,000.00	2,768,364.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	8,007,150.00	

	POLAND GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,247,332.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	33,447,650.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	15,217,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,433,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,326,875.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	19,700,000.00	19,866,465.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,500,000.00	8,990,325.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,055,996.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,599,174.00	
小計	銘柄数：12	120,700,000.00	128,310,413.40	
			(4,117,481,166)	
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,392,241.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,500,000.00	5,573,238.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,100,000.00	13,807,688.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,300,000.00	12,157,074.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	11,479,545.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	395,634.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	9,171,480.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	298,019.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,337,072.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,293,931.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,500,000.00	18,259,010.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	14,297,446.08	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,700,000.00	13,675,697.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,210,963.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,000,000.00	8,596,746.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,541,834.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,928,895.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,709,314.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,838,582.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,388,297.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	367,617.60	
小計	銘柄数：21	147,780,000.00	157,720,328.88	
			(13,806,837,590)	

		組入時価比率：2.1%		2.2%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT		3,750,000.00	3,796,218.75
	SINGAPORE GOVERNMENT		4,000,000.00	4,169,200.00
	SINGAPORE GOVERNMENT		2,980,000.00	3,036,024.00
	SINGAPORE GOVERNMENT		1,400,000.00	1,487,500.00
	SINGAPORE GOVERNMENT		3,000,000.00	3,145,500.00
	SINGAPORE GOVERNMENT		2,300,000.00	2,457,550.00
	SINGAPORE GOVERNMENT		3,900,000.00	4,379,602.50
	SINGAPORE GOVERNMENT		2,400,000.00	2,575,200.00
	SINGAPORE GOVERNMENT		850,000.00	967,890.75
	SINGAPORE GOVERNMENT		3,300,000.00	3,521,100.00
	小計	銘柄数：10		27,880,000.00
		組入時価比率：0.4%		0.4%
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT		400,000.00	403,372.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT		900,000.00	907,363.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT		2,400,000.00	2,422,958.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT		9,600,000.00	9,816,163.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT		6,600,000.00	6,642,847.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT		2,400,000.00	2,435,952.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT		6,000,000.00	6,150,240.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT		8,700,000.00	8,835,998.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4,600,000.00	4,531,961.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT		11,000,000.00	10,876,690.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT		5,800,000.00	5,888,223.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT		600,000.00	596,162.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT		8,800,000.00	8,968,863.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT		7,000,000.00	6,571,096.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT		1,800,000.00	1,716,667.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT		2,700,000.00	2,892,828.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT		5,700,000.00	5,711,759.10
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4,400,000.00	4,314,274.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4,700,000.00	4,523,388.10
	MALAYSIAN GOVERNMENT		400,000.00	374,343.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT		9,200,000.00	9,236,146.80
小計	銘柄数：21		103,700,000.00	103,817,300.00

			(2,886,120,940)	
		組入時価比率：0.4%		0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,200,000.00	9,264,308.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,300,000.00	25,239,786.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,000,000.00	13,637,400.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,200,000.00	24,928,974.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	71,300,000.00	79,164,390.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	28,000,000.00	25,406,696.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	24,776,640.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,400,000.00	42,060,068.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,000,000.00	4,674,415.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	47,100,000.00	33,731,559.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	28,546,080.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	8,186,332.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	21,360,330.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	39,100,000.00	34,855,421.30	
	小計	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	50,200,000.00	44,999,280.00
銘柄数：15		462,200,000.00	420,831,681.00	
			(3,812,735,029)	
		組入時価比率：0.6%		0.6%
合計			636,630,635,917	
			(636,630,635,917)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年12月26日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	75,713,820	-	75,694,150	19,670
米ドル	2,265,146	-	2,267,000	1,854
カナダドル	11,573,848	-	11,584,300	10,452

ユーロ	4,032,090	-	4,037,700	5,610
英ポンド	3,030,560	-	3,031,800	1,240
豪ドル	8,748,400	-	8,752,000	3,600
シンガポールドル	8,002,116	-	8,011,350	9,234
ランド	38,061,660	-	38,010,000	51,660
合計	75,713,820	-	75,694,150	19,670

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成29年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	71,111,398
コール・ローン	41,504,306
国債証券	6,355,936,962
派生商品評価勘定	214,933
未収利息	82,934,791
前払費用	9,079,542
流動資産合計	6,560,781,932
資産合計	6,560,781,932
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	359,994
未払金	48,293,705
未払解約金	6,714,596
未払利息	47
その他未払費用	472,800
流動負債合計	55,841,142
負債合計	55,841,142
純資産の部	
元本等	
元本	4,681,709,639

(平成29年12月26日現在)

剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,823,231,151
元本等合計	6,504,940,790
純資産合計	6,504,940,790
負債純資産合計	6,560,781,932

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29年12月26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	1.3894円
(10,000口当たり純資産額)	(13,894円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 平成28年12月27日 至 平成29年12月26日	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

平成29年12月26日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年12月26日現在	
期首	平成28年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	3,151,858,537円
同期中における追加設定元本額	2,380,960,466円
同期中における一部解約元本額	851,109,364円
期末元本額	4,681,709,639円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	12,606,205円
野村資産設計ファンド2020	14,268,361円
野村資産設計ファンド2025	17,381,523円
野村資産設計ファンド2030	15,340,681円
野村資産設計ファンド2035	10,242,892円
野村資産設計ファンド2040	23,148,220円

野村資産設計ファンド2045	2,084,483円
野村インデックスファンド・新興国債券	580,703,705円
ネクストコア	76,944,773円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	168,658,897円
野村資産設計ファンド2050	2,263,767円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	1,779,699円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	481,638円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	412,837円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	329,945円
ノムラFOfs用インデックスファンド・新興国債券(適格機関投資家専用)	2,953,292,806円
野村DC新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド	347,261,635円
野村DC運用戦略ファンド	443,027,431円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	11,400,991円
野村資産設計ファンド(DC)2030	27,081円
野村資産設計ファンド(DC)2040	29,648円
野村資産設計ファンド(DC)2050	22,421円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年12月26日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年12月26日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アルゼンチンペソ	REPUBLIC OF ARGENTINA	1,900,000.00	2,045,825.00	
		REPUBLIC OF ARGENTINA	6,800,000.00	7,109,495.20	
		小計	銘柄数: 2 組入時価比率: 0.9%	8,700,000.00	9,155,320.20 (57,403,857) 0.9%
	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,500,000.00	11,905,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,950,000.00	11,043,129.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,400,000.00	7,135,820.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	17,000,000.00	16,241,460.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,600,000.00	5,165,938.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,700,000.00	12,067,645.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,850,000.00	3,787,591.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,268,376.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	7,897,630.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	3,986,320.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,700,000.00	2,063,460.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	5,298,750.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,700,000.00	7,550,466.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	2,012,310.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	5,400,000.00	5,476,896.00	
	銘柄数：15	104,900,000.00	102,901,542.25	(590,654,852)
組入時価比率：9.1%			9.3%	
リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	2,230,000.00	2,085,843.88	
	LETRA TESOURO NACIONAL	4,310,000.00	3,870,181.74	
	LETRA TESOURO NACIONAL	4,000,000.00	3,243,340.00	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	196,000.00	2,103,470.04	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	330,000.00	3,480,704.70	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	381,000.00	3,955,054.32	
	銘柄数：6	11,447,000.00	18,738,594.68	(636,362,675)
組入時価比率：9.8%			10.1%	
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	420,000,000.00	425,145,000.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	90,000,000.00	102,195,000.00	
	REPUBLIC OF CHILE	300,000,000.00	314,823,000.00	
	銘柄数：3	810,000,000.00	842,163,000.00	(153,357,882)
組入時価比率：2.4%			2.4%	
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,370,000,000.00	4,670,267,070.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	5,310,000,000.00	6,663,359,700.00	
	銘柄数：2	9,680,000,000.00	11,333,626,770.00	(434,077,905)
組入時価比率：6.7%			6.8%	
ソル	BONOS DE TESORERIA	800,000.00	855,404.00	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	739,518.50	
	PERU BONO SOBERANO	480,000.00	534,525.12	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	789,292.00	

小計	PERU BONO SOBERANO	620,000.00	688,540.38
	REPUBLIC OF PERU	1,200,000.00	1,295,031.60
	銘柄数：6	4,500,000.00	4,902,311.60 (171,727,975)
	組入時価比率：2.6%		2.7%
ウルグアイペソ 小計	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	4,015,004.00
	銘柄数：1	4,000,000.00	4,015,004.00 (15,819,115)
	組入時価比率：0.2%		0.2%
トルコリラ 小計	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,065,800.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	710,000.00	681,600.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,050,000.00	941,062.50
	TURKEY GOVERNMENT BOND	950,000.00	877,325.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	900,000.00	849,150.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,250,000.00	1,134,375.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	300,000.00	284,262.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,390,000.00	1,207,562.50
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,770,000.00	1,420,885.20
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	1,003,411.60
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	484,640.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	310,000.00	272,955.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	829,005.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,396,875.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	800,000.00	760,800.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,304,450.00
	銘柄数：16	17,230,000.00	15,514,158.80 (462,166,790)
組入時価比率：7.1%		7.3%	
チェココルナ 小計	CZECH REPUBLIC	20,600,000.00	21,063,500.00
	CZECH REPUBLIC	5,500,000.00	5,356,037.50
	CZECH REPUBLIC	19,900,000.00	19,296,990.20
	CZECH REPUBLIC	2,100,000.00	1,912,470.00
	銘柄数：4	48,100,000.00	47,628,997.70 (248,623,367)
組入時価比率：3.8%		3.9%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	25,000,000.00	27,408,750.00

小計	HUNGARY GOVERNMENT BOND	78,000,000.00	80,832,960.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	38,000,000.00	40,936,336.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	81,000,000.00	97,095,510.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	21,233,380.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	50,000,000.00	63,223,000.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	49,000,000.00	50,581,377.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	97,605,970.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	72,000,000.00	78,889,104.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	37,000,000.00	46,777,250.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	55,000,000.00	59,989,930.00	
	銘柄数：11	582,000,000.00	664,573,567.00	(287,228,695)
組入時価比率：4.4%			4.5%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,690,000.00	1,732,790.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	380,000.00	405,695.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,230,000.00	1,219,717.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,230,000.00	1,340,085.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,700,000.00	1,688,950.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,470,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	680,000.00	766,496.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	1,585,600.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	980,000.00	1,120,434.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	496,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,140,000.00	1,215,411.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,512,675.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,850,000.00	1,750,747.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,401,816.00	
銘柄数：14	17,480,000.00	17,706,718.10	(568,208,583)	
組入時価比率：8.7%			8.9%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	30,700,000.00	30,670,221.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	40,500,000.00	40,108,365.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	36,000,000.00	36,849,600.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	24,000,000.00	24,008,208.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	52,000,000.00	53,608,360.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	25,000,000.00	24,351,250.00	

小計	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	23,000,000.00	24,893,820.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	13,000,000.00	13,056,680.00	
	銘柄数：8	244,200,000.00	247,546,504.00	(482,715,682)
	組入時価比率：7.4%			7.6%
レイ	ROMANIA	1,300,000.00	1,297,725.00	
	ROMANIA	940,000.00	925,307.80	
	ROMANIA	790,000.00	785,173.10	
	ROMANIA	300,000.00	323,037.00	
	ROMANIA	1,100,000.00	1,078,011.00	
	ROMANIA	250,000.00	272,233.75	
	ROMANIA	300,000.00	286,027.50	
	ROMANIA	920,000.00	956,924.20	
	ROMANIA	310,000.00	346,235.28	
	小計	銘柄数：9	6,210,000.00	6,270,674.63
	組入時価比率：2.8%			2.9%
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,560,000.00	1,595,126.52	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,311,352.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	320,000.00	328,012.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	700,000.00	710,942.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,304,722.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,050,000.00	1,034,469.45	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,280,000.00	1,265,651.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,639,548.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	346,524.26	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,576,806.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	200,000.00	200,412.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	374,343.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	384,249.60	
	小計	銘柄数：13	13,050,000.00	13,072,162.83
	組入時価比率：5.6%			5.7%
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,915,104.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,100,000.00	10,459,176.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	19,500,000.00	19,991,185.50	

	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,117,140.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	19,000,000.00	19,067,982.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,100,000.00	18,572,771.70	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,748,920.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	17,823,680.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	8,168,707.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	12,200,040.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,678,993.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,827,198.00	
小計	銘柄数：12	137,700,000.00	147,570,898.40	
			(510,595,308)	
	組入時価比率：7.8%		8.0%	
フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	10,310,000.00	
小計	銘柄数：1	10,000,000.00	10,310,000.00	
			(23,403,700)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ルビア	INDONESIA GOVERNMENT	3,300,000,000.00	3,407,137,800.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,900,000,000.00	3,299,999,900.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,700,000,000.00	2,069,420,200.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	9,380,000,000.00	9,783,340,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,930,000,000.00	6,607,852,370.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,580,000,000.00	7,144,074,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	11,050,000,000.00	11,580,400,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,030,000,000.00	4,759,365,520.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,436,507,610.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,905,142,400.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,767,760,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,366,400,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,500,000,000.00	3,419,311,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,280,000,000.00	4,761,500,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,600,000,000.00	6,227,200,000.00	
小計	銘柄数：15	66,460,000,000.00	73,535,410,800.00	
			(617,697,450)	
	組入時価比率：9.5%		9.7%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,340,000.00	6,175,794.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,956,980.00	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,700,000.00	8,549,310.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	5,444,292.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,260,000.00	6,821,834.88	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,200,000.00	4,713,628.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,900,000.00	2,711,160.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,700,000.00	2,649,825.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,900,000.00	4,371,118.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,050,000.00	6,317,352.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,200,000.00	2,852,617.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,900,000.00	6,185,160.00	
	銘柄数：12	68,150,000.00	60,749,073.88	
			(550,386,609)	
	組入時価比率：8.5%		8.7%	
合計			6,355,936,962	
			(6,355,936,962)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成29年12月26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	52,745,330	-	52,669,200	76,130
米ドル	32,778,280	-	32,873,600	95,320
メキシコペソ	11,751,063	-	11,460,000	291,063
トルコリラ	8,215,987	-	8,335,600	119,613
売建	19,967,050	-	20,035,981	68,931
米ドル	19,967,050	-	20,035,981	68,931
合計	-	-	-	145,061

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

平成30年 1月31日現在

資産総額	90,591,513円
負債総額	342,274円
純資産総額（ - ）	90,249,239円
発行済口数	76,926,072口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1732円

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

平成30年 1月31日現在

資産総額	21,874,473円
負債総額	22,158円
純資産総額（ - ）	21,852,315円
発行済口数	18,687,400口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1694円

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

平成30年 1月31日現在

資産総額	16,239,945円
負債総額	17,192円
純資産総額（ - ）	16,222,753円
発行済口数	13,972,377口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1611円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

平成30年 1月31日現在

資産総額	10,934,714円
負債総額	11,831円
純資産総額（ - ）	10,922,883円
発行済口数	9,509,812口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1486円

（参考）国内株式マザーファンド

平成30年 1月31日現在

資産総額	400,789,193,229円
負債総額	33,824,544,917円
純資産総額（ - ）	366,964,648,312円
発行済口数	207,362,088,725口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7697円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成30年 1月31日現在

資産総額	486,917,815,296円
負債総額	4,316,798,506円
純資産総額（ - ）	482,601,016,790円
発行済口数	178,504,434,907口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7036円

（参考）新興国株式マザーファンド

平成30年 1月31日現在

資産総額	34,208,112,461円
負債総額	202,468,261円
純資産総額（ - ）	34,005,644,200円
発行済口数	23,877,042,900口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4242円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

平成30年 1月31日現在

資産総額	694,308,133,614円
負債総額	2,002,994,086円
純資産総額（ - ）	692,305,139,528円
発行済口数	530,845,574,292口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3042円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

平成30年 1月31日現在

資産総額	50,422,049,943円
負債総額	27,496,402,743円
純資産総額（ - ）	22,925,647,200円
発行済口数	20,501,847,620口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1182円

（参考）外国債券マザーファンド

平成30年 1月31日現在

資産総額	629,694,677,958円
負債総額	2,406,718,470円
純資産総額（ - ）	627,287,959,488円
発行済口数	277,037,163,214口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2643円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

平成30年 1月31日現在

資産総額	6,865,241,135円
負債総額	121,618,908円
純資産総額（ - ）	6,743,622,227円
発行済口数	4,827,933,413口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3968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。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

平成30年1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29年12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	979	25,675,515
単位型株式投資信託	103	552,405
追加型公社債投資信託	14	6,048,289
単位型公社債投資信託	379	1,983,240
合計	1,475	34,259,449

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成28年4月1日から平成29年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(平成29年4月1日から平成29年9月30日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29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		208	127
金銭の信託		55,341	52,247
有価証券		24,100	15,700
前払金		34	33
前払費用		2	2
未収入金		511	495
未収委託者報酬		14,131	16,287
未収運用受託報酬		7,309	7,481
繰延税金資産		2,028	1,661
その他		56	42
貸倒引当金		10	11
流動資産計		103,715	94,066
固定資産			

有形固定資産			1,176		1,001
建物	2	403		377	
器具備品	2	773		624	
無形固定資産			7,681		7,185
ソフトウェア		7,680		7,184	
その他		0		0	
投資その他の資産			23,225		13,165
投資有価証券		9,216		1,233	
関係会社株式		10,958		8,124	
長期差入保証金		45		44	
長期前払費用		49		37	
前払年金費用		2,777		2,594	
繰延税金資産		-		960	
その他		176		170	
固定資産計			32,083		21,353
資産合計			135,799		115,419

区分	注記 番号	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29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		98
未払金	1		11,855		10,401
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		31		31	
未払手数料		4,537		5,242	
その他未払金		7,284		5,126	
未払費用	1		8,872		9,461
未払法人税等			1,838		714
前受収益			45		39
賞与引当金			4,809		4,339
流動負債計			27,538		25,055
固定負債					
退職給付引当金			2,708		2,947
時効後支払損引当金			526		538
繰延税金負債			68		-
固定負債計			3,303		3,485
負債合計			30,842		28,540
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			99,606		86,837
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			68,696		55,927
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		68,011		55,242	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		43,405		30,635	

評価・換算差額等		5,349	41
その他有価証券評価差額金		5,349	41
純資産合計		104,956	86,878
負債・純資産合計		135,799	115,419

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		104,445	96,594
運用受託報酬		31,351	28,466
その他営業収益		219	266
営業収益計		136,016	125,327
営業費用			
支払手数料		46,531	39,785
広告宣伝費		1,008	1,011
公告費		0	0
調査費		28,068	26,758
調査費		4,900	5,095
委託調査費		23,167	21,662
委託計算費		1,148	1,290
営業雑経費		3,905	4,408
通信費		185	162
印刷費		969	940
協会費		78	76
諸経費		2,672	3,228
営業費用計		80,662	73,254
一般管理費			
給料		11,835	11,269
役員報酬	2	367	301
給料・手当		6,928	6,923
賞与		4,539	4,044
交際費		124	126
旅費交通費		488	469
租税公課		695	898
不動産賃借料		1,230	1,222
退職給付費用		1,063	1,223
固定資産減価償却費		2,589	2,730
諸経費		7,801	8,118
一般管理費計		25,827	26,059
営業利益		29,526	26,012

区分	注記 番号	前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)		当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29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	7,323		7,397	
受取利息		4		0	
金銭の信託運用益		-		684	
為替差益		281		-	
その他		382		379	
営業外収益計			7,991		8,461
営業外費用					
支払利息		-		17	
金銭の信託運用損		1,196		-	
時効後支払損引当金繰入額		72		16	
為替差損		-		33	
その他		52		9	
営業外費用計			1,321		77
経常利益			36,196		34,397
特別利益					
投資有価証券等売却益		50		26	
関係会社清算益		-		41	
株式報酬受入益		96		59	
特別利益計			146		126
特別損失					
投資有価証券売却損		95		-	
投資有価証券等評価損		-		6	
固定資産除却損	3	60		9	
特別損失計			156		15
税引前当期純利益			36,186		34,507
法人税、住民税及び事業税			9,806		7,147
法人税等調整額			744		1,722
当期純利益			25,635		25,637

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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	その他利益剰余金		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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当期変動額									
剰余金の配当							38,407	38,407	38,407
当期純利益							25,637	25,637	25,637

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	12,769	12,769	12,769
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	5,349	5,349	104,956
当期変動額			
剰余金の配当			38,407
当期純利益			25,637
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	5,308	5,308	5,308
当期変動額合計	5,308	5,308	18,078
当期末残高	41	41	86,878

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に 取得した建物(附属設備を除く)、並びに平成28年4月1日以降に 取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用して おります。 主な耐用年数は以下の通りであります。 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> <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>
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の 債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計 上しております。</p>

<p>5．消費税等の会計処理方法</p> <p>6．連結納税制度の適用</p>	<p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、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>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	--

[会計方針の変更]

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

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (平成28年3月31日)	当事業年度末 (平成29年3月31日)												
<p>1．関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>未払金</td> <td>5,894百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td>1,151</td> </tr> </table>	未払金	5,894百万円	未払費用	1,151	<p>1．関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>未払金</td> <td>4,438百万円</td> </tr> <tr> <td>未払費用</td> <td>938</td> </tr> </table>	未払金	4,438百万円	未払費用	938				
未払金	5,894百万円												
未払費用	1,151												
未払金	4,438百万円												
未払費用	938												
<p>2．有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>641百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3,132</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>3,774</td> </tr> </table>	建物	641百万円	器具備品	3,132	合計	3,774	<p>2．有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>681百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3,331</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>4,013</td> </tr> </table>	建物	681百万円	器具備品	3,331	合計	4,013
建物	641百万円												
器具備品	3,132												
合計	3,774												
建物	681百万円												
器具備品	3,331												
合計	4,013												

損益計算書関係

前事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 7,081百万円 支払利息 -	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 5,252百万円 支払利息 17
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 建物 1百万円 器具備品 4 ソフトウェア 54 ア 合計 60	3. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 0 ソフトウェア 9 ア 合計 9

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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

配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

配当財産が金銭以外である場合における当該財産の総額

平成28年10月27日開催の臨時株主総会において、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

配当財産の種類 株式会社野村総合研究所の株式

配当財産の帳簿価額 3,064百万円

1株当たり配当額 594円87銭

効力発生日 平成28年10月27日

配当財産の種類 株式会社ジャフコの株式

配当財産の帳簿価額 282百万円

1株当たり配当額 54円93銭

効力発生日 平成28年10月27日

配当財産の種類 朝日火災海上保険株式会社の株式

配当財産の帳簿価額 87百万円

1株当たり配当額 16円89銭

効力発生日 平成28年10月27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29年5月12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 25,598百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 4,970円

基準日 平成29年3月31日

効力発生日 平成29年6月23日

金融商品関係

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物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。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信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、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

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	-	-	-

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物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。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信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、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年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	127	127	-
(2)金銭の信託	52,247	52,247	-
(3)未収委託者報酬	16,287	16,287	-
(4)未収運用受託報酬	7,481	7,481	-
(5)有価証券及び投資有価証券	15,700	15,700	-
その他有価証券	15,700	15,700	-
資産計	91,843	91,843	-
(6)未払金	10,401	10,401	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	5,242	5,242	-
その他未払金	5,126	5,126	-
(7)未払費用	9,461	9,461	-
(8)未払法人税等	714	714	-
負債計	20,578	20,578	-

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

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) 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1,233百万円、関係会社株式8,124百万円）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	127	-	-	-
金銭の信託	52,247	-	-	-
未収委託者報酬	16,287	-	-	-
未収運用受託報酬	7,481	-	-	-
有価証券	15,700	-	-	-
合計	91,843	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（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

当事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成29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29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29年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(平成29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	-	-	-
小計	-	-	-
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	15,700	15,700	-
小計	15,700	15,700	-
合計	15,700	15,700	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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	18,692 百万円
勤務費用	889
利息費用	125
数理計算上の差異の発生額	464
退職給付の支払額	634
その他	8
退職給付債務の期末残高	19,546
(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	15,764 百万円
期待運用収益	394
数理計算上の差異の発生額	468
事業主からの拠出額	507
退職給付の支払額	562
年金資産の期末残高	16,572
(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	16,578 百万円
年金資産	16,572
	5
非積立型制度の退職給付債務	2,967
未積立退職給付債務	2,973
未認識数理計算上の差異	2,992
未認識過去勤務費用	371
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
退職給付引当金	2,947
前払年金費用	2,594
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	889 百万円
利息費用	125
期待運用収益	394
数理計算上の差異の費用処理額	412
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	993
(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	49%
株式	39%
生保一般勘定	12%
その他	0%
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	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (平成28年3月31日)	当事業年度末 (平成29年3月31日)																																																																																				
<p>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</p> <table border="0"> <tr> <td>繰延税金資産</td> <td style="text-align: right;">百万円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">1,490</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">839</td> </tr> <tr> <td>投資有価証券評価減</td> <td style="text-align: right;">460</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価減</td> <td style="text-align: right;">1,676</td> </tr> <tr> <td>ゴルフ会員権評価減</td> <td style="text-align: right;">240</td> </tr> <tr> <td>減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">177</td> </tr> <tr> <td>時効後支払損引当金</td> <td style="text-align: right;">163</td> </tr> <tr> <td>子会社株式売却損</td> <td style="text-align: right;">148</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">350</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式譲渡益</td> <td style="text-align: right;">120</td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">89</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">251</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">6,678</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">1,453</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">5,224</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債</td> <td></td> </tr> <tr> <td> その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">2,403</td> </tr> <tr> <td> 前払年金費用</td> <td style="text-align: right;">861</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;">3,264</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">1,959</td> </tr> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,490	退職給付引当金	839	投資有価証券評価減	460	関係会社株式評価減	1,676	ゴルフ会員権評価減	240	減価償却超過額	177	時効後支払損引当金	163	子会社株式売却損	148	未払事業税	350	関係会社株式譲渡益	120	未払社会保険料	89	その他	251	繰延税金資産小計	6,678	評価性引当額	1,453	繰延税金資産合計	5,224	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	2,403	前払年金費用	861	繰延税金負債合計	3,264	繰延税金資産の純額	1,959	<p>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</p> <table border="0"> <tr> <td>繰延税金資産</td> <td style="text-align: right;">百万円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">1,345</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">913</td> </tr> <tr> <td>投資有価証券評価減</td> <td style="text-align: right;">417</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価減</td> <td style="text-align: right;">247</td> </tr> <tr> <td>ゴルフ会員権評価減</td> <td style="text-align: right;">212</td> </tr> <tr> <td>減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">171</td> </tr> <tr> <td>時効後支払損引当金</td> <td style="text-align: right;">166</td> </tr> <tr> <td>子会社株式売却損</td> <td style="text-align: right;">148</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">110</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式譲渡益</td> <td style="text-align: right;">88</td> </tr> <tr> <td>未払社会保険料</td> <td style="text-align: right;">85</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">274</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">4,183</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">739</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">3,444</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債</td> <td></td> </tr> <tr> <td> その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">18</td> </tr> <tr> <td> 前払年金費用</td> <td style="text-align: right;">804</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;">822</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">2,621</td> </tr> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,345	退職給付引当金	913	投資有価証券評価減	417	関係会社株式評価減	247	ゴルフ会員権評価減	212	減価償却超過額	171	時効後支払損引当金	166	子会社株式売却損	148	未払事業税	110	関係会社株式譲渡益	88	未払社会保険料	85	その他	274	繰延税金資産小計	4,183	評価性引当額	739	繰延税金資産合計	3,444	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	18	前払年金費用	804	繰延税金負債合計	822	繰延税金資産の純額	2,621
繰延税金資産	百万円																																																																																				
賞与引当金	1,490																																																																																				
退職給付引当金	839																																																																																				
投資有価証券評価減	460																																																																																				
関係会社株式評価減	1,676																																																																																				
ゴルフ会員権評価減	240																																																																																				
減価償却超過額	177																																																																																				
時効後支払損引当金	163																																																																																				
子会社株式売却損	148																																																																																				
未払事業税	350																																																																																				
関係会社株式譲渡益	120																																																																																				
未払社会保険料	89																																																																																				
その他	251																																																																																				
繰延税金資産小計	6,678																																																																																				
評価性引当額	1,453																																																																																				
繰延税金資産合計	5,224																																																																																				
繰延税金負債																																																																																					
その他有価証券評価差額金	2,403																																																																																				
前払年金費用	861																																																																																				
繰延税金負債合計	3,264																																																																																				
繰延税金資産の純額	1,959																																																																																				
繰延税金資産	百万円																																																																																				
賞与引当金	1,345																																																																																				
退職給付引当金	913																																																																																				
投資有価証券評価減	417																																																																																				
関係会社株式評価減	247																																																																																				
ゴルフ会員権評価減	212																																																																																				
減価償却超過額	171																																																																																				
時効後支払損引当金	166																																																																																				
子会社株式売却損	148																																																																																				
未払事業税	110																																																																																				
関係会社株式譲渡益	88																																																																																				
未払社会保険料	85																																																																																				
その他	274																																																																																				
繰延税金資産小計	4,183																																																																																				
評価性引当額	739																																																																																				
繰延税金資産合計	3,444																																																																																				
繰延税金負債																																																																																					
その他有価証券評価差額金	18																																																																																				
前払年金費用	804																																																																																				
繰延税金負債合計	822																																																																																				
繰延税金資産の純額	2,621																																																																																				
<p>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</p> <table border="0"> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">33.0%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">6.2%</td> </tr> <tr> <td>タックスヘイブン税制</td> <td style="text-align: right;">0.8%</td> </tr> <tr> <td>外国税額控除</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税</td> <td style="text-align: right;">0.7%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">0.4%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.4%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">29.1%</td> </tr> </table>	法定実効税率	33.0%	(調整)		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	6.2%	タックスヘイブン税制	0.8%	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	0.7%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.4%	その他	0.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%	<p>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</p> <table border="0"> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">31.0%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.1%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">6.2%</td> </tr> <tr> <td>タックスヘイブン税制</td> <td style="text-align: right;">0.7%</td> </tr> <tr> <td>外国税額控除</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税</td> <td style="text-align: right;">0.5%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">25.7%</td> </tr> </table>	法定実効税率	31.0%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%	タックスヘイブン税制	0.7%	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	0.5%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	その他	0.2%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.7%																																												
法定実効税率	33.0%																																																																																				
(調整)																																																																																					
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	6.2%																																																																																				
タックスヘイブン税制	0.8%																																																																																				
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	0.7%																																																																																				
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.4%																																																																																				
その他	0.4%																																																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%																																																																																				
法定実効税率	31.0%																																																																																				
(調整)																																																																																					
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%																																																																																				
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%																																																																																				
タックスヘイブン税制	0.7%																																																																																				
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	0.5%																																																																																				
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-																																																																																				
その他	0.2%																																																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.7%																																																																																				
<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成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。</p> <p>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。</p>																																																																																					

セグメント情報等

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任	資金の借入(*1)	24,500	短期借入金	-
							資金の返済	24,500		
							借入金利息の支払	17	未払費用	-

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	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	-	サービス・製品の購入	自社利用ソフトウェア開発の委託等(*2)	787	未払費用	-

(ウ) 兄弟会社等

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

親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*3）	33,019	未払手数料	4,486
---------	----------	--------	-----------------	-----	---	---	-----------------------	--------	-------	-------

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(*2) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。なお、株式会社野村総合研究所は、平成28年10月27日より関連当事者に該当しないこととなったため、取引金額は関連当事者であった期間について、期末残高は関連当事者でなくなった時点について記載しております。

(*3) 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。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	20,377円23銭	1株当たり純資産額	16,867円41銭
1株当たり当期純利益	4,977円07銭	1株当たり当期純利益	4,977円49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	25,635百万円	損益計算書上の当期純利益	25,637百万円
普通株式に係る当期純利益	25,635百万円	普通株式に係る当期純利益	25,637百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

中間財務諸表

中間貸借対照表

		平成29年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)

(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		1,411
金銭の信託		44,380
有価証券		8,200
未収委託者報酬		20,471
未収運用受託報酬		7,338
繰延税金資産		1,076
その他		675
貸倒引当金		13
流動資産計		83,539
固定資産		
有形固定資産	1	919
無形固定資産		6,967
ソフトウェア		6,966
その他		0
投資その他の資産		12,994
投資有価証券		1,230
関係会社株式		8,124
前払年金費用		2,474
繰延税金資産		920
その他		244
固定資産計		20,880
資産合計		104,420

		平成29年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払収益分配金		0
未払償還金		31
未払手数料		6,975
その他未払金	2	4,550
未払費用		9,702
未払法人税等		1,521
賞与引当金		2,361
その他		153
流動負債計		25,297
固定負債		
退職給付引当金		2,953
時効後支払損引当金		548
固定負債計		3,501
負債合計		28,798
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		44,663
利益準備金		685
その他利益剰余金		43,978
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		19,372
評価・換算差額等		47
その他有価証券評価差額金		47
純資産合計		75,621
負債・純資産合計		104,420

中間損益計算書

		自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		55,036
運用受託報酬		13,973
その他営業収益		159
営業収益計		69,169
営業費用		
支払手数料		21,927
調査費		14,996
その他営業費用		3,541
営業費用計		40,465
一般管理費	1	13,411
営業利益		15,292
営業外収益	2	4,435
営業外費用	3	91
経常利益		19,636
特別利益	4	32
特別損失	5	9
税引前中間純利益		19,659
法人税、住民税及び事業税		4,702
法人税等調整額		621
中間純利益		14,335

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

当中間期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
中間純利益							14,335	14,335	14,335
株主資本以外の 項目の 当中間期変動額 (純額)									
当中間期変動額合 計	-	-	-	-	-	-	11,263	11,263	11,263
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	19,372	44,663	75,573

(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	41	41	86,878
当中間期変動額			
剰余金の配当			25,598
中間純利益			14,335
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純 額)	6	6	6
当中間期変動額合計	6	6	11,257
当中間期末残高	47	47	75,621

[重要な会計方針]

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

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

中間貸借対照表関係

平成29年 9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	4,102百万円
2 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。	

中間損益計算書関係

自 平成29年 4月 1日 至 平成29年 9月30日	
1 減価償却実施額 有形固定資産 94百万円 無形固定資産 1,288百万円	

2	営業外収益のうち主要なもの		
	受取配当金	4,031百万円	
	金銭信託運用益	224百万円	
3	営業外費用のうち主要なもの		
	支払利息	2百万円	
	時効後支払損引当金繰入	10百万円	
	為替差損	49百万円	
4	特別利益の内訳		
	株式報酬受入益	32百万円	
5	特別損失の内訳		
	投資有価証券等評価損	1百万円	
	固定資産除却損	8百万円	

中間株主資本等変動計算書関係

自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日					
1	発行済株式に関する事項				
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株
2	配当に関する事項				
	配当金支払額				
	平成29年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。				
	・普通株式の配当に関する事項				
	(1) 配当金の総額		25,598百万円		
	(2) 1株当たり配当額		4,970円		
	(3) 基準日		平成29年3月31日		
	(4) 効力発生日		平成29年6月23日		

金融商品関係

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	1,411	1,411	-
(2)金銭の信託	44,380	44,380	-
(3)未収委託者報酬	20,471	20,471	-
(4)未収運用受託報酬	7,338	7,338	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	8,200	8,200	-
資産計	81,801	81,801	-
(6)未払金	11,558	11,558	-

未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	6,975	6,975	-
その他未払金	4,550	4,550	-
(7)未払費用	9,702	9,702	-
(8)未払法人税等	1,521	1,521	-
負債計	22,782	22,782	-

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) 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（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,230百万円、関係会社株式8,124百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

有価証券関係

当中間会計期間末（平成29年9月30日）

1．満期保有目的の債券(平成29年9月30日)

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式(平成29年9月30日)

該当事項はありません。

3．その他有価証券(平成29年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの			
譲渡性預金	8,200	8,200	-
小計	8,200	8,200	-
合計	8,200	8,200	-

セグメント情報等

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

1 株当たり情報

	自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日
1 株当たり純資産額	14,681円79銭
1 株当たり中間純利益	2,783円19銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。
2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。
- | | |
|--------------|-----------|
| 中間純利益 | 14,335百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式に係る中間純利益 | 14,335百万円 |
| 期中平均株式数 | 5,150千株 |

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託者

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

野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
------------	-----------	--

* 平成29年12月末現在

(2) 販売会社

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

* 平成29年12月末現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託者

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

(2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いを行ない、信託契約の一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

(2)目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。

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

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。

(6)目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含む)も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入

手できる旨を記載する場合があります。

- (7)目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8)目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

独立監査人の監査報告書

平成29年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の財務諸表、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29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30年2月16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	伊藤 志 保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重 俊 寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型の平成28年12月27日から平成29年12月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型の平成29年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月16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	伊藤志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型の平成28年12月27日から平成29年12月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型の平成29年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月16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	伊藤志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型の平成28年12月27日から平成29年12月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型の平成29年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月16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	伊藤 志 保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重 俊 寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型の平成28年12月27日から平成29年12月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型の平成29年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月20日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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 郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津 村 健 二 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29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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