

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年3月17日提出
【計算期間】	第1期(自 平成28年4月1日至 平成28年12月26日)
【ファンド名】	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
【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】	CEO兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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。

## &lt;商品分類&gt;

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

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

- （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	<b>インデックス型</b>
<b>追加型</b>	海外	債券	
	<b>内外</b>	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		<b>資産複合</b>	

## 《属性区分表》

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	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)	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券) 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。

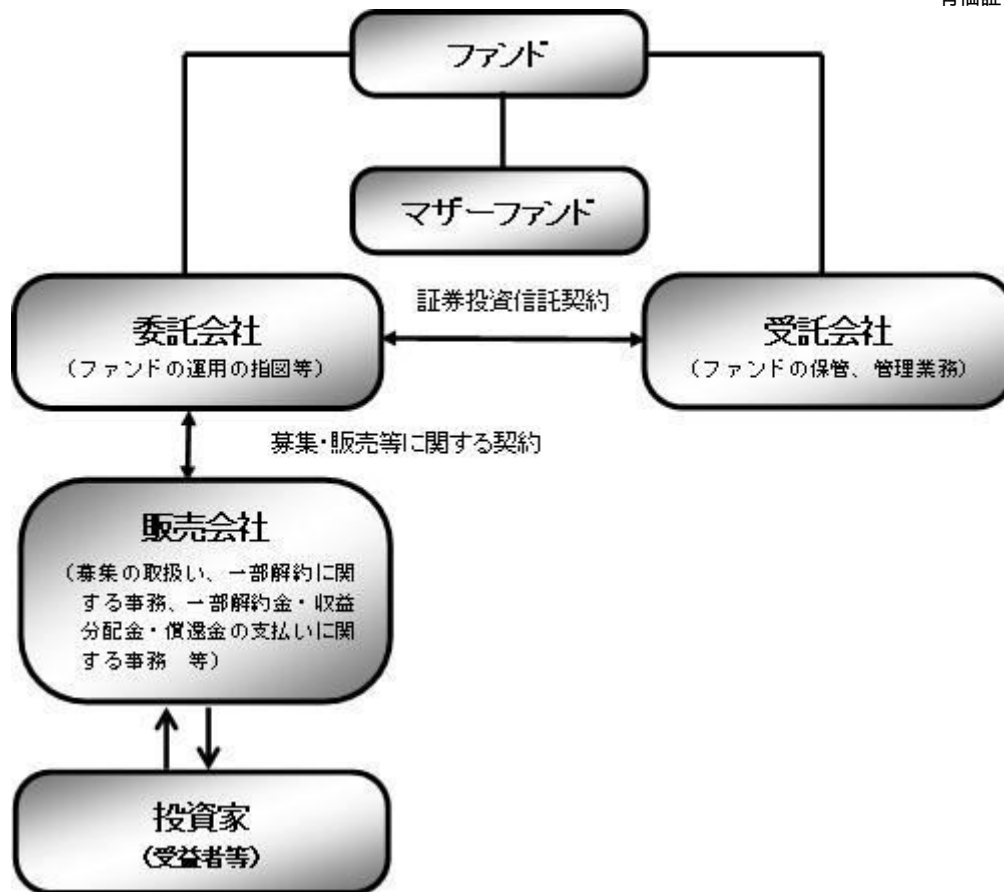
## 〔特殊型〕

- (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】

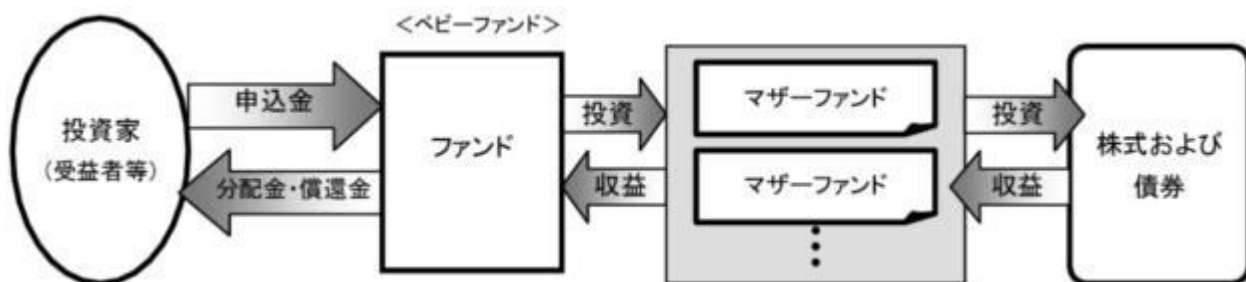
平成28年4月1日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (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、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



ファンド	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29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

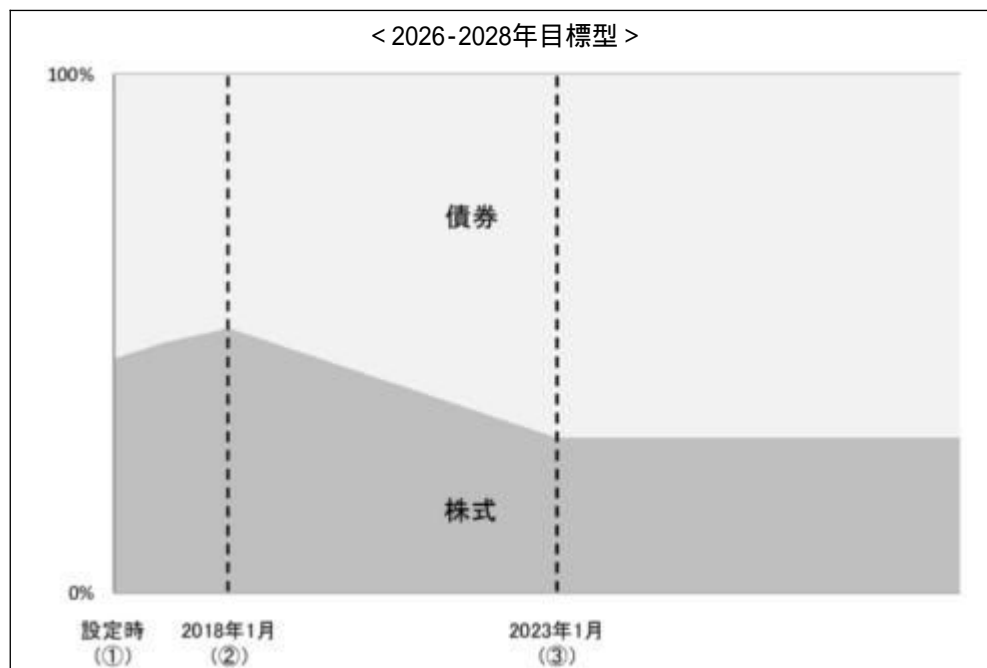
「投資基礎期」は、株式への実質投資割合を徐々に増やし、債券への実質投資割合を徐々に減らすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

「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。

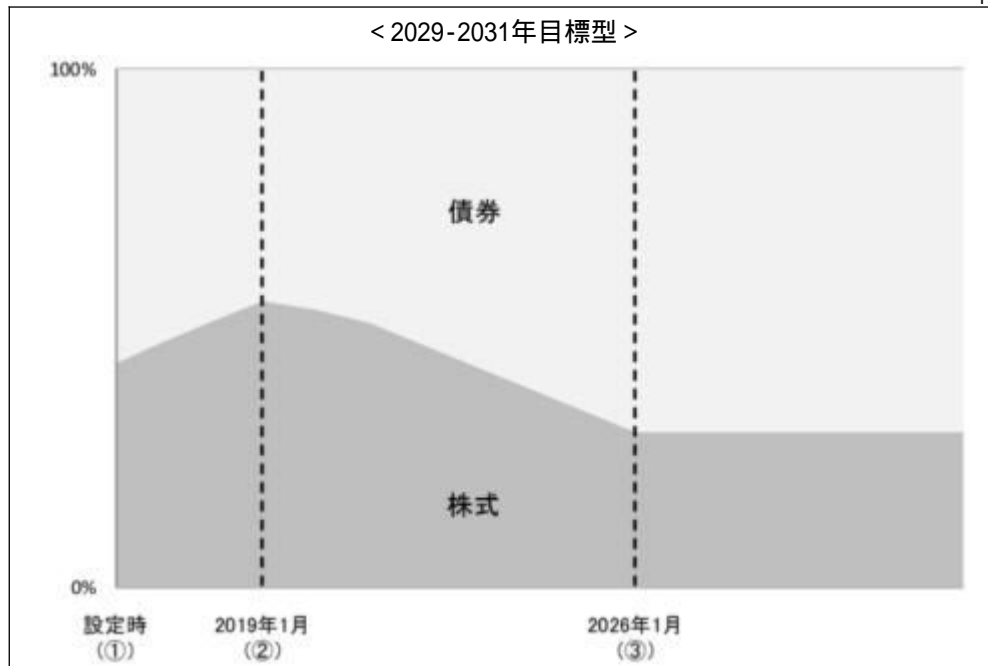
・期間中は、安定運用を行なう場合があります。

#### 株式・債券配分のイメージ図

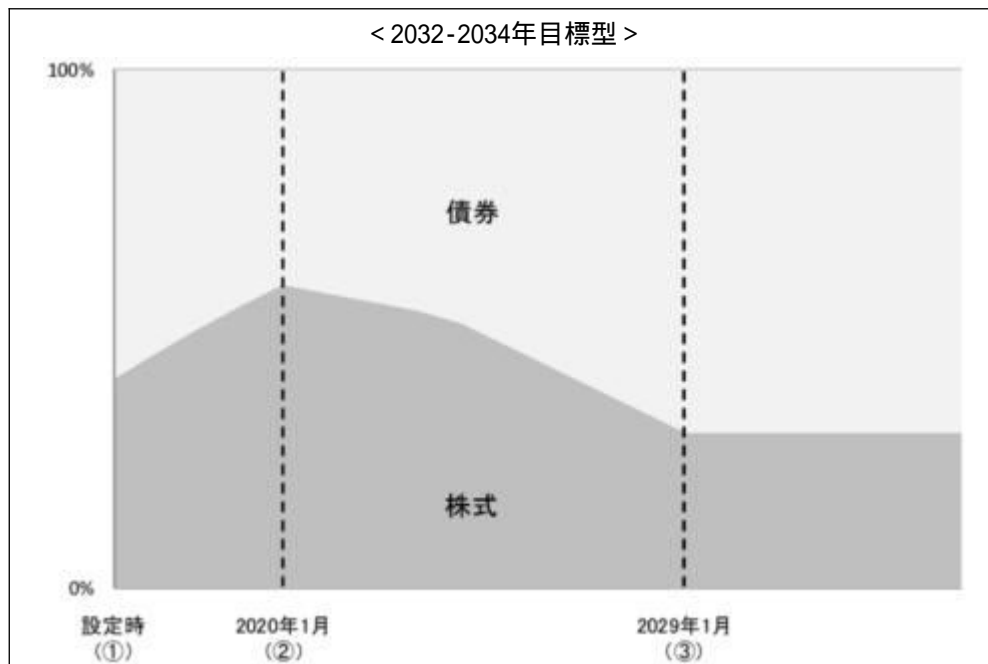


投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式45.2%	株式51.1%	株式30.0%
債券54.8%	債券48.9%	債券70.0%

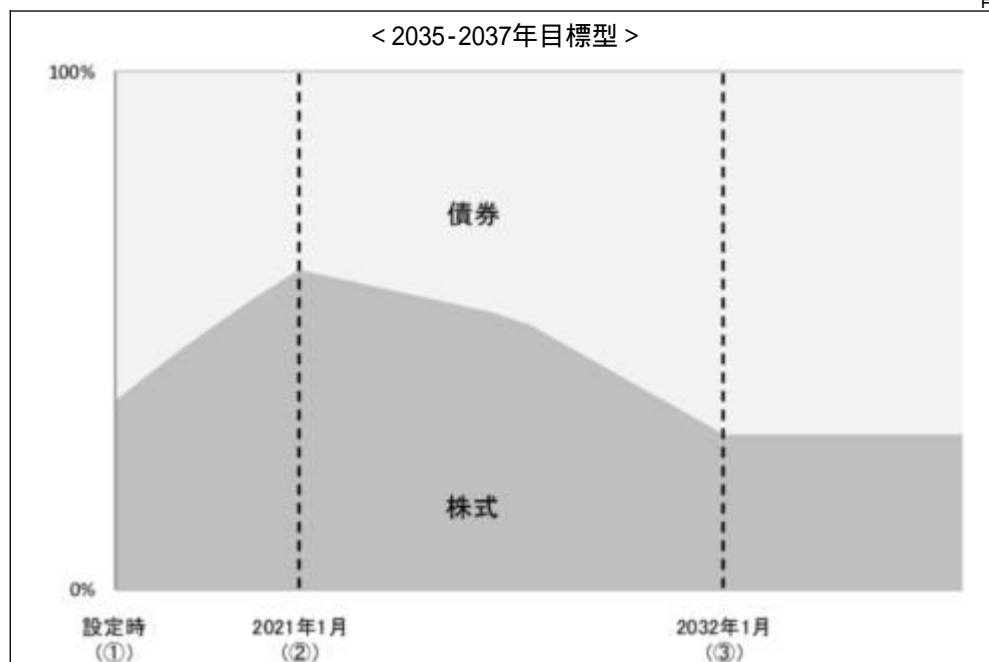




投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式43.2%	株式55.2%	株式30.0%
債券56.8%	債券44.8%	債券70.0%



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
		2017年 3月	資産 形成期 開始日	2017年 3月	資産 形成期 開始日	2017年 3月	資産 形成期 開始日	2017年 3月	資産 形成期 開始日	
株式	国内株式マザーファンド	24.4%	25.5%	23.8%	27.5%	22.6%	29.3%	21.0%	30.9%	15.0%
	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	14.7%	15.4%	14.3%	16.7%	13.6%	17.6%	12.7%	18.6%	9.0%
	新興国株式マザーファンド	9.7%	10.2%	9.5%	11.0%	9.1%	11.6%	8.3%	12.3%	6.0%
債券	国内債券NOMURA-BPI 総合 マザーファンド	17.4%	17.0%	16.8%	14.9%	16.2%	13.2%	15.4%	11.6%	30.0%
	外国債券為替ヘッジ型 マザーファンド	17.4%	17.0%	16.8%	14.9%	16.2%	13.2%	15.4%	11.6%	30.0%
	外国債券マザーファンド	13.7%	12.4%	15.7%	12.5%	18.6%	12.5%	22.7%	12.5%	8.3%
	新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド	2.7%	2.5%	3.1%	2.5%	3.7%	2.6%	4.5%	2.5%	1.7%

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、2017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。

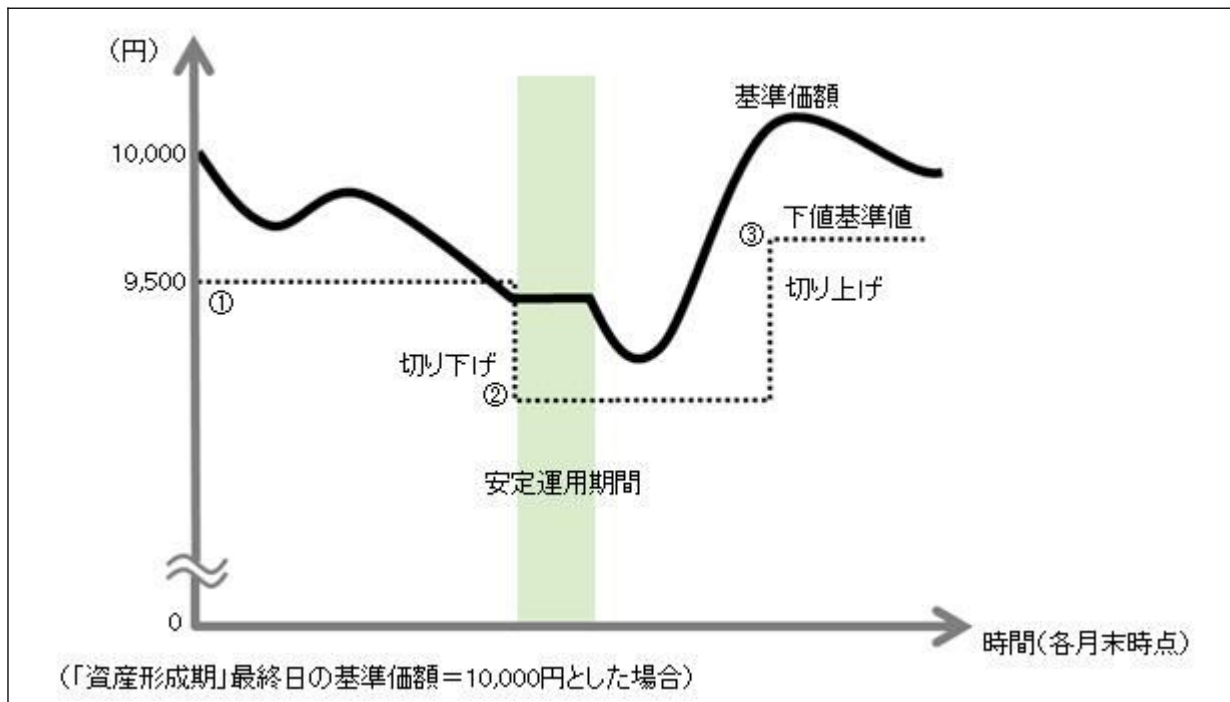
\* 各ファンドにおいては、上記のような運用を「下値保全に配慮した運用」という場合があります。

・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 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 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) <sup>*2</sup>
新興国株式マザーファンド	新興国の株式(DR(預託証券) <sup>*1</sup> 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) <sup>*3</sup>
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	シティ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	シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債券(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) <sup>*4</sup>

\*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、シティ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。

「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）」は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行なう円ベースの指数）です。

#### [ 外国債券マザーファンド ]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行わない円ベースの指数）です。

#### [ 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド ]

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

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets(GBI-EM)Global Diversified（USドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシ

ファイド (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。

#### 「シティ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)」

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行なう円ベースの指数)です。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

#### 「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」

「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行わない円ベースの指数)です。

「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

#### 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、）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たす資産
  - ・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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。)
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. 預託証券(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券
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」

といたします。

#### 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ないます。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

行なうこととします。

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1.基本方針

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

### 2.運用方法

#### (1)投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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。

## 「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」

### 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1.基本方針

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

#### 2.運用方法

##### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### (3)投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

## 「新興国債券（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。

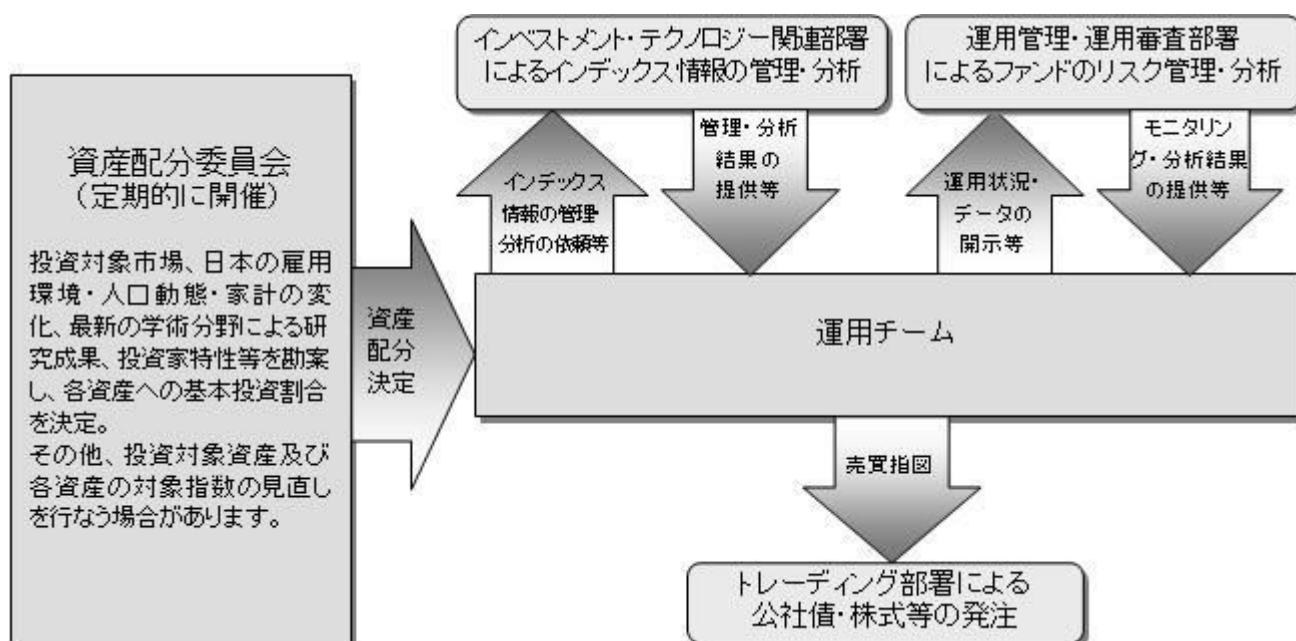
外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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います。）の利用は行ないません。

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

### （３）【運用体制】

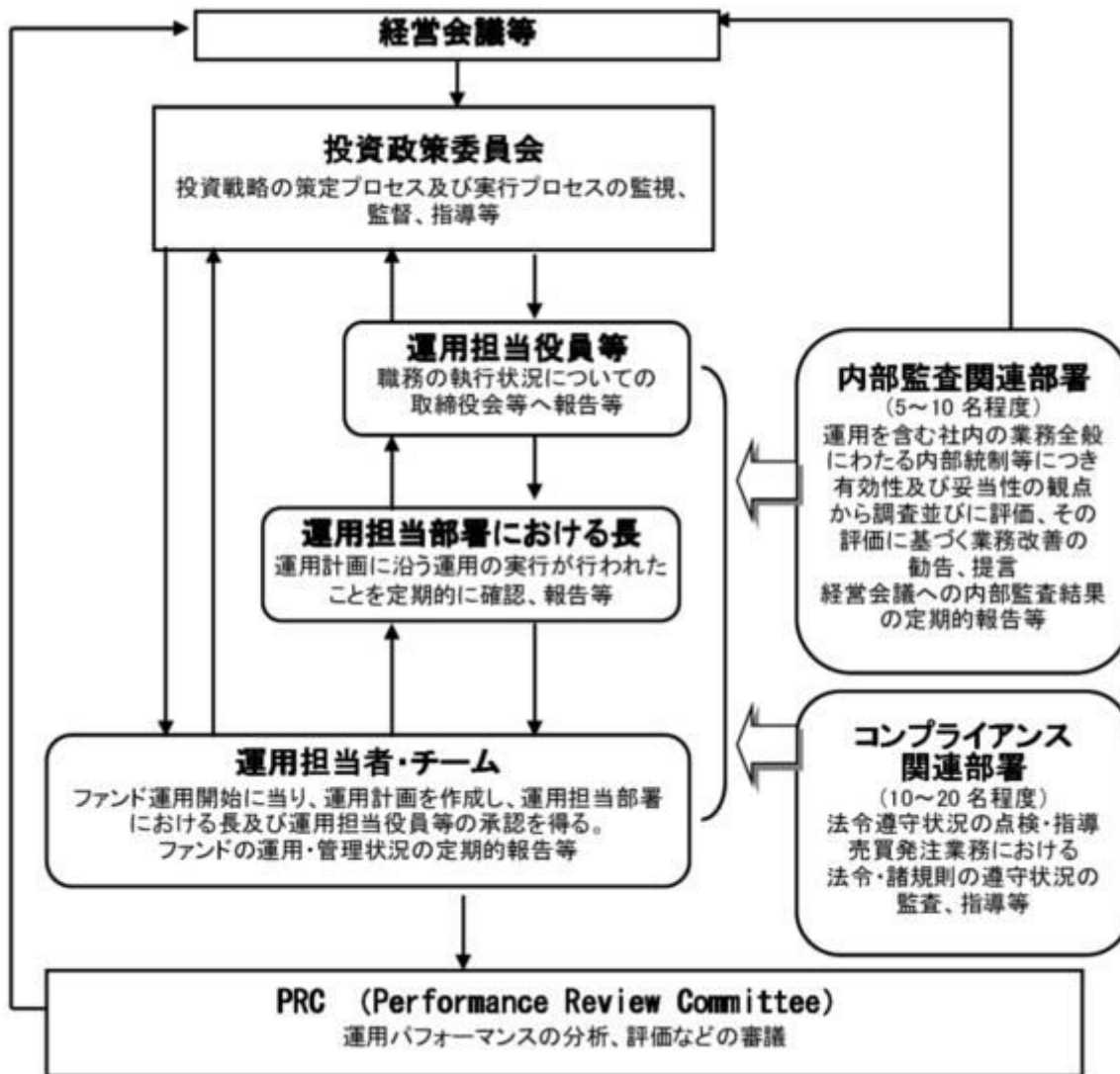
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

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

#### ファンドの決算日

原則として**毎年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。

スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有

する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

- ( )上記( )に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ( )委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

#### 公社債の借入れ(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。
- ( )上記( )の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ( )信託財産の一部解約等の事由により、上記( )の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ( )上記( )の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

#### 直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

#### 資金の借入れ(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ

(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### 基準価額の変動要因

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

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

#### [株価変動リスク]

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

#### [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

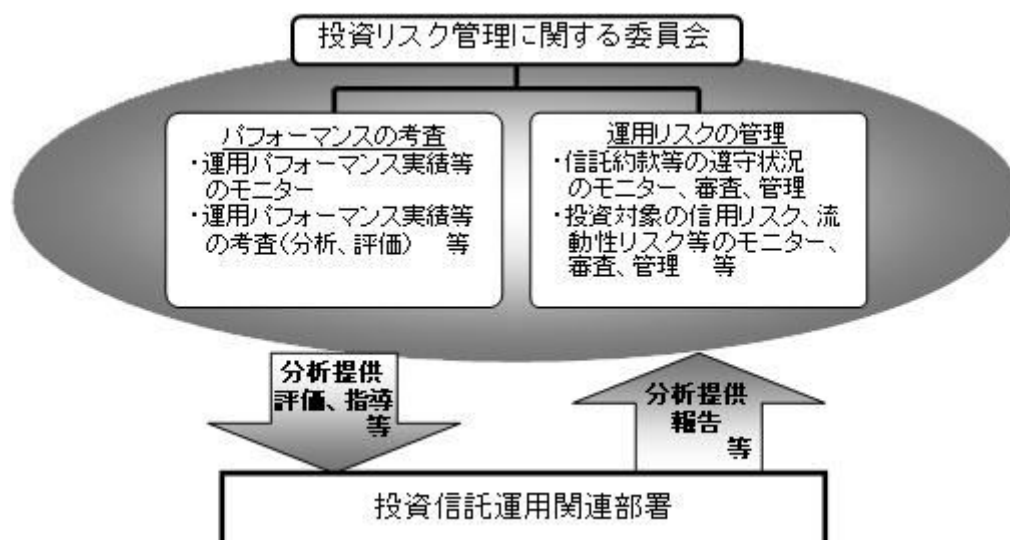
#### パフォーマンスの考査

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。

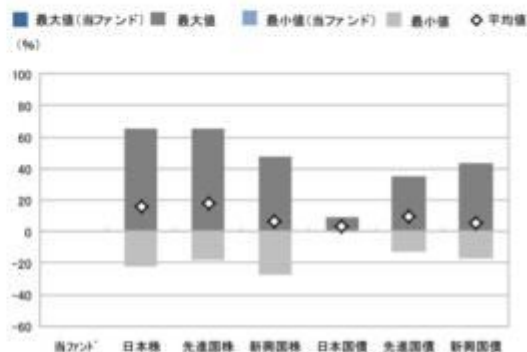
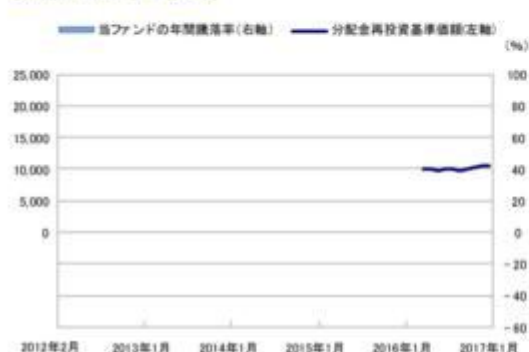
## リスクの定量的比較

(2012年2月末～2017年1月末:月次)

〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉

〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉

## ●2026-2028年目標型



当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債	
最大値(%)	—	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	—	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	0.5	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	—	15.8	18.2	6.7	3.1	9.2	5.3

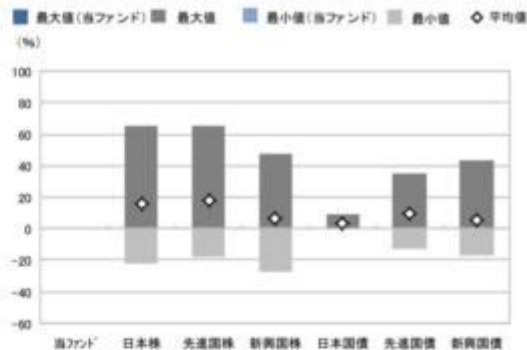
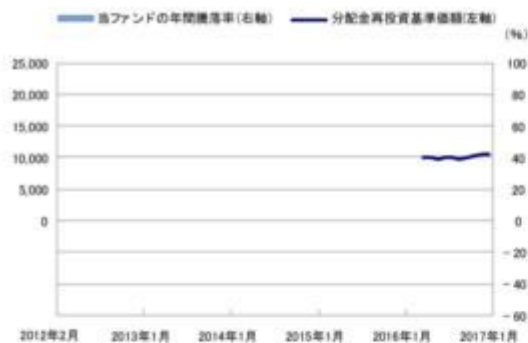
＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。  
 ＊年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。また、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク(合成指数)の騰落率は掲載しておりません。

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。  
 ＊2012年2月から2017年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。  
 ＊決算日に対応した数値とは異なります。  
 ＊当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク(合成指数)の騰落率は掲載しておりません。

## 〈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〉

## ●2029-2031年目標型

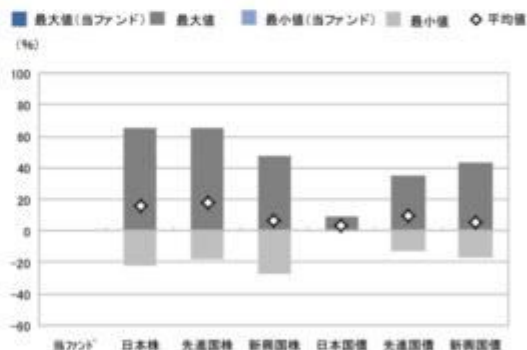
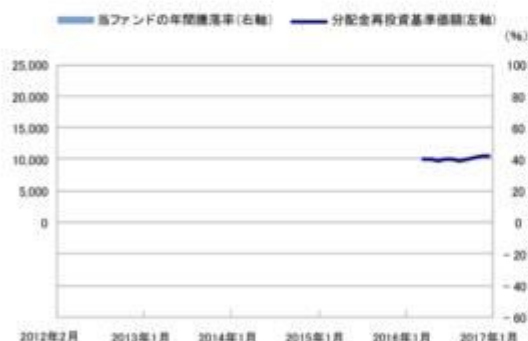


	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	—	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	—	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	0.5	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	—	15.8	18.2	6.7	3.1	9.2	5.3

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

- ＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ＊2012年2月から2017年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- ＊決算日に対応した数値とは異なります。
- ＊当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

## ●2032-2034年目標型



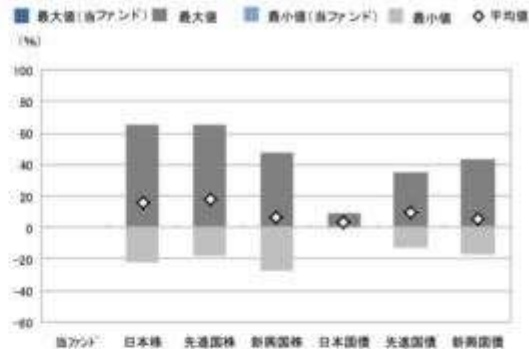
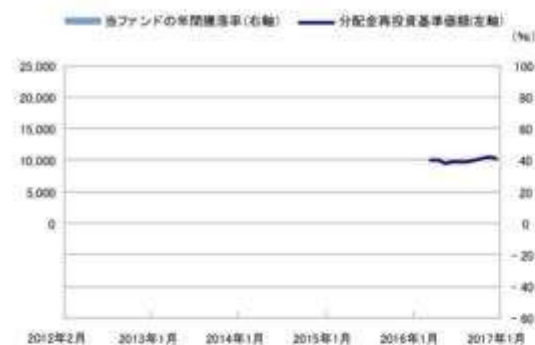
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	—	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	—	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	0.5	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	—	15.8	18.2	6.7	3.1	9.2	5.3

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

- ＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ＊2012年2月から2017年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- ＊決算日に対応した数値とは異なります。
- ＊当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

## 〈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〉

### ●2035-2037年目標型



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	—	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	—	△22.0	△17.5	△27.4	0.5	△12.3	△17.4
平均値(%)	—	15.8	18.2	6.7	3.1	9.2	5.3

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

- ・全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ・2012年2月から2017年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- ・決算日に対応した数値とは異なります。
- ・当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

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

#### ＜代表的な資産クラスの指数＞

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

#### ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・「シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、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は法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価値、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPM)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを予測するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)(「指数スポンサー」)は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、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関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSC, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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口あたりに換算して、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》 <sup>(注2)</sup>	《配当所得》
・ 特定公社債 <sup>(注1)</sup> 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 ・ 譲渡益 ・ 譲渡損	・ 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。

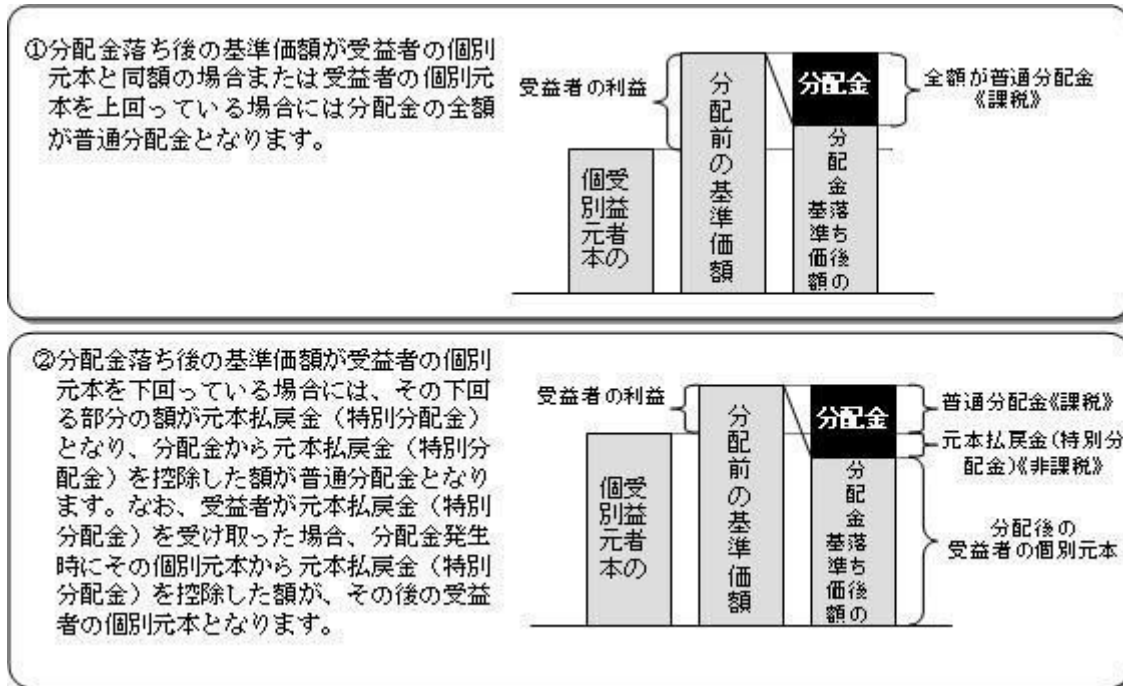
#### 個別元本について

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29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29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	56,726,995	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		57,246	0.10
合計(純資産総額)		56,784,241	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	11,131,601	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		11,236	0.10
合計(純資産総額)		11,142,837	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	7,766,349	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		7,838	0.10
合計(純資産総額)		7,774,187	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	7,130,240	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		7,200	0.10
合計(純資産総額)		7,137,440	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	314,786,076,620	98.72
現金・預金・その他資産(負債控除後)		4,054,712,804	1.27
合計(純資産総額)		318,840,789,424	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,291,890,000	1.03

## (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	220,202,435,009	62.92
	カナダ	13,750,157,984	3.92
	ドイツ	12,794,803,069	3.65
	イタリア	2,691,806,007	0.76
	フランス	12,996,177,599	3.71
	オランダ	4,172,027,483	1.19
	スペイン	4,264,192,840	1.21
	ベルギー	1,579,085,325	0.45

	オーストリア	279,917,312	0.07
	ルクセンブルグ	86,483,712	0.02
	フィンランド	1,292,747,710	0.36
	アイルランド	640,132,037	0.18
	ポルトガル	199,025,334	0.05
	イギリス	85,002,441	0.02
	イギリス	24,369,597,312	6.96
	スイス	11,959,034,030	3.41
	スウェーデン	3,956,898,082	1.13
	ノルウェー	938,947,405	0.26
	デンマーク	2,271,829,025	0.64
	オーストラリア	9,482,733,893	2.70
	ニュージーランド	258,799,065	0.07
	香港	4,183,026,484	1.19
	シンガポール	1,627,132,523	0.46
	イスラエル	344,451,388	0.09
	小計	334,426,443,069	95.57
投資信託受益証券	アメリカ	24,909,594	0.00
投資証券	アメリカ	6,875,836,772	1.96
	カナダ	82,996,235	0.02
	フランス	449,007,242	0.12
	イギリス	332,292,893	0.09
	オーストラリア	871,181,366	0.24
	香港	192,353,773	0.05
	シンガポール	142,490,976	0.04
	小計	8,946,159,257	2.55
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,523,467,148	1.86
合計（純資産総額）		349,920,979,068	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,351,730,208	1.24
	買建	カナダ	268,439,733	0.07
	買建	ドイツ	791,862,000	0.22
	買建	イギリス	471,607,093	0.13
	買建	スイス	226,342,803	0.06
	買建	オーストラリア	192,967,319	0.05

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	2,090,014,407	11.32
	メキシコ	595,851,906	3.22
	ブラジル	1,435,944,236	7.77
	チリ	108,508,970	0.58
	コロンビア	53,026,190	0.28
	ギリシャ	57,883,321	0.31
	トルコ	176,699,345	0.95
	チェコ	30,804,682	0.16
	ハンガリー	54,459,003	0.29
	ポーランド	209,840,605	1.13
	香港	3,689,423,952	19.98
	マレーシア	441,913,820	2.39
	タイ	410,643,606	2.22
	フィリピン	221,109,763	1.19
	インドネシア	444,783,165	2.40
	韓国	2,632,614,691	14.26
	台湾	2,145,967,152	11.62
	インド	1,460,753,397	7.91
	カタール	155,145,004	0.84
	エジプト	23,668,263	0.12
南アフリカ	1,161,929,055	6.29	
アラブ首長国連邦	133,596,846	0.72	
	小計	17,734,581,379	96.06
投資証券	メキシコ	15,496,203	0.08
	トルコ	5,935,567	0.03
	南アフリカ	63,886,562	0.34
	小計	85,318,332	0.46
現金・預金・その他資産（負債控除後）		641,030,947	3.47
合計（純資産総額）		18,460,930,658	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	623,929,170	3.37

（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	538,480,877,840	79.05

地方債証券	日本	53,138,512,217	7.80
特殊債券	日本	56,096,545,207	8.23
社債券	日本	27,750,785,450	4.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,696,258,136	0.83
合計（純資産総額）		681,162,978,850	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	5,056,912,198	42.46
	カナダ	270,528,075	2.27
	メキシコ	106,318,732	0.89
	ドイツ	776,824,708	6.52
	イタリア	1,115,488,710	9.36
	フランス	1,127,214,498	9.46
	オランダ	244,493,133	2.05
	スペイン	667,219,013	5.60
	ベルギー	285,874,456	2.40
	オーストリア	159,872,268	1.34
	フィンランド	80,600,879	0.67
	アイルランド	94,224,640	0.79
	イギリス	819,450,352	6.88
	スイス	29,432,776	0.24
	スウェーデン	55,369,883	0.46
	ノルウェー	20,215,612	0.16
	デンマーク	74,862,293	0.62
	ポーランド	54,210,292	0.45
	オーストラリア	239,107,362	2.00
	シンガポール	102,060,937	0.85
南アフリカ	63,007,017	0.52	
	小計	11,443,287,834	96.09
現金・預金・その他資産（負債控除後）		465,212,232	3.90
合計（純資産総額）		11,908,500,066	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	285,764,243,695	43.84
	カナダ	14,104,224,847	2.16
	メキシコ	5,025,661,927	0.77

	ドイツ	39,631,052,589	6.07
	イタリア	64,323,920,499	9.86
	フランス	62,625,524,812	9.60
	オランダ	13,813,653,936	2.11
	スペイン	40,903,744,499	6.27
	ベルギー	16,304,029,219	2.50
	オーストリア	8,901,525,660	1.36
	フィンランド	3,609,419,625	0.55
	アイルランド	5,516,520,503	0.84
	イギリス	46,650,770,027	7.15
	スイス	1,506,700,086	0.23
	スウェーデン	3,032,670,399	0.46
	ノルウェー	1,796,635,351	0.27
	デンマーク	4,192,133,326	0.64
	ポーランド	3,957,988,933	0.60
	オーストラリア	13,891,629,523	2.13
	シンガポール	2,499,248,227	0.38
	マレーシア	2,869,633,090	0.44
	南アフリカ	3,458,574,166	0.53
	小計	644,379,504,939	98.85
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,452,700,633	1.14
合計（純資産総額）		651,832,205,572	100.00

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	389,376,258	9.57
	ブラジル	417,671,537	10.27
	コロンビア	307,622,117	7.56
	ペルー	86,126,610	2.11
	トルコ	327,382,406	8.05
	ハンガリー	202,496,247	4.98
	ポーランド	397,452,965	9.77
	ロシア	246,288,770	6.05
	ルーマニア	114,759,121	2.82
	マレーシア	353,542,749	8.69
	タイ	298,199,031	7.33
	フィリピン	11,724,800	0.28
	インドネシア	396,752,863	9.76
	南アフリカ	382,133,193	9.40
	小計	3,931,528,667	96.72

現金・預金・その他資産(負債控除後)		133,054,455	3.27
合計(純資産総額)		4,064,583,122	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	9,572,421	1.4491	13,871,396	1.4355	13,741,210	24.19
2	日本	親投資信託受益証券	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	7,637,026	1.3027	9,948,754	1.2968	9,903,695	17.44
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	8,846,248	1.1214	9,920,183	1.1124	9,840,566	17.32
4	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,668,526	2.2628	8,301,141	2.2423	8,225,935	14.48
5	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	3,602,480	2.2037	7,938,786	2.1576	7,772,710	13.68
6	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	5,309,521	1.0129	5,378,014	1.0658	5,658,887	9.96
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	1,267,904	1.2534	1,589,191	1.2493	1,583,992	2.78

## 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	1,824,822	1.4499	2,645,810	1.4355	2,619,531	23.50
2	日本	親投資信託受益証券	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,456,583	1.3025	1,897,200	1.2968	1,888,896	16.95
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	1,687,219	1.1214	1,892,048	1.1124	1,876,862	16.84
4	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	808,341	2.2036	1,781,261	2.1576	1,744,076	15.65
5	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	700,394	2.2634	1,585,272	2.2423	1,570,493	14.09
6	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	1,009,872	1.0144	1,024,415	1.0658	1,076,321	9.65
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	284,497	1.2536	356,646	1.2493	355,422	3.18

## 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	1,208,796	1.4504	1,753,238	1.4355	1,735,226	22.32
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	670,332	2.2036	1,477,144	2.1576	1,446,308	18.60
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	981,155	1.3026	1,278,053	1.2968	1,272,361	16.36
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	1,136,658	1.1214	1,274,649	1.1124	1,264,418	16.26
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	464,770	2.2637	1,052,100	2.2423	1,042,153	13.40
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	667,135	1.0151	677,209	1.0658	711,032	9.14
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	236,013	1.2536	295,866	1.2493	294,851	3.79

## 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 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	外国債券マザーファンド	755,556	2.2031	1,664,566	2.1576	1,630,187	22.83
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	1,026,051	1.4489	1,486,646	1.4355	1,472,896	20.63
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	852,393	1.3026	1,110,328	1.2968	1,105,383	15.48
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	987,386	1.1214	1,107,255	1.1124	1,098,368	15.38
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	395,330	2.2622	894,316	2.2423	886,448	12.41
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	571,447	1.0136	579,219	1.0658	609,048	8.53
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	262,475	1.2531	328,908	1.2493	327,910	4.59

## 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

## (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	1,725,000	5,656.69	9,757,790,250	6,584.00	11,357,400,000	3.56
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,611,100	506.79	5,377,599,369	730.90	7,755,652,990	2.43
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,124,100	5,001.37	5,622,040,017	4,979.00	5,596,893,900	1.75
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	630,300	5,981.81	3,770,334,843	8,701.00	5,484,240,300	1.72
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,121,300	3,346.06	3,751,937,078	4,451.00	4,990,906,300	1.56
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,276,800	3,027.14	3,865,052,352	3,387.00	4,324,521,600	1.35
7	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,385,300	3,264.35	4,522,104,055	3,030.00	4,197,459,000	1.31
8	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,012,000	165.23	3,141,352,760	210.30	3,998,223,600	1.25
9	日本	株式	ソニー	電気機器	1,001,800	2,704.96	2,709,828,928	3,423.00	3,429,161,400	1.07
10	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	881,100	4,564.12	4,021,446,132	3,640.00	3,207,204,000	1.00
11	日本	株式	ファナック	電気機器	143,800	16,256.63	2,337,703,394	22,165.00	3,187,327,000	0.99
12	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,046,300	2,794.79	2,924,188,777	2,706.50	2,831,810,950	0.88
13	日本	株式	キーエンス	電気機器	64,300	33,255.14	2,138,305,502	43,870.00	2,820,841,000	0.88
14	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	274,500	9,787.95	2,686,792,275	10,230.00	2,808,135,000	0.88
15	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	567,300	3,705.41	2,102,079,093	4,731.00	2,683,896,300	0.84
16	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,050,700	1,807.94	1,899,602,558	2,549.50	2,678,759,650	0.84
17	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	586,100	4,739.26	2,777,680,286	4,509.00	2,642,724,900	0.82
18	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	557,100	5,247.97	2,923,644,087	4,724.00	2,631,740,400	0.82
19	日本	株式	三菱電機	電気機器	1,513,500	1,240.50	1,877,496,750	1,721.50	2,605,490,250	0.81
20	日本	株式	信越化学工業	化学	266,500	6,240.34	1,663,050,610	9,747.00	2,597,575,500	0.81
21	日本	株式	キヤノン	電気機器	763,800	3,065.80	2,341,658,040	3,345.00	2,554,911,000	0.80
22	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,518,100	1,483.09	2,251,478,929	1,513.50	2,297,644,350	0.72
23	日本	株式	村田製作所	電気機器	148,900	12,829.30	1,910,282,770	15,255.00	2,271,469,500	0.71
24	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,041,000	2,136.74	2,224,346,340	2,162.50	2,251,162,500	0.70
25	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,407,000	478.46	1,630,113,220	647.60	2,206,373,200	0.69
26	日本	株式	ダイキン工業	機械	193,700	8,813.97	1,707,265,989	11,225.00	2,174,282,500	0.68
27	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	118,000	19,386.97	2,287,662,460	18,270.00	2,155,860,000	0.67
28	日本	株式	花王	化学	377,400	6,079.62	2,294,448,588	5,583.00	2,107,024,200	0.66
29	日本	株式	三井物産	卸売業	1,266,300	1,284.82	1,626,967,566	1,656.50	2,097,625,950	0.65
30	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	501,500	4,100.51	2,056,405,765	4,143.00	2,077,714,500	0.65

## 種類別及び業種別投資比率



種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.33
		建設業	2.90
		食料品	4.30
		繊維製品	0.70
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.60
		医薬品	4.57
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.88
		ガラス・土石製品	0.96
		鉄鋼	1.32
		非鉄金属	0.93
		金属製品	0.70
		機械	5.04
		電気機器	12.46
		輸送用機器	9.32
		精密機器	1.52
		その他製品	1.72
		電気・ガス業	1.75
		陸運業	4.18
		海運業	0.24
		空運業	0.56
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	7.92
		卸売業	4.42
		小売業	4.59
		銀行業	8.41
		証券、商品先物取引業	1.21
		保険業	2.66
その他金融業	1.25		
不動産業	2.49		
サービス業	3.58		
合 計		98.72	

(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	517,800	12,441.70	6,442,317,023	13,842.71	7,167,755,393	2.04
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア	711,300	6,258.41	4,451,608,385	7,412.44	5,272,472,342	1.50
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗燃 料	398,400	9,638.56	3,840,005,849	9,657.91	3,847,713,973	1.09
4	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信販 売	38,710	68,857.32	2,665,467,097	94,505.54	3,658,309,755	1.04
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	347,000	6,808.11	2,362,415,627	9,791.07	3,397,502,782	0.97
6	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	262,800	12,439.43	3,269,082,993	12,875.32	3,383,635,489	0.96
7	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インター ネットソフ トウェア・ サービス	223,100	13,090.42	2,920,474,085	14,906.83	3,325,714,621	0.95
8	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	460,400	5,530.02	2,546,024,845	6,382.46	2,938,486,794	0.83
9	アメリカ	株式	GENERAL ELEC CO	コングロマ リット	860,800	3,618.01	3,114,391,530	3,409.74	2,935,110,734	0.83
10	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通 信サービス	590,900	4,488.66	2,652,352,976	4,759.53	2,812,408,759	0.80
11	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インター ネットソフ トウェア・ サービス	29,700	85,310.83	2,533,731,885	91,312.03	2,711,967,564	0.77
12	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インター ネットソフ トウェア・ サービス	28,320	87,343.48	2,473,567,481	93,760.09	2,655,285,814	0.75
13	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	980,000	1,536.43	1,505,706,300	2,611.93	2,559,700,710	0.73
14	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	298,900	8,276.95	2,473,982,417	8,280.38	2,475,007,973	0.70
15	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	245,500	9,432.57	2,315,696,622	9,873.01	2,423,825,796	0.69
16	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗燃 料	181,200	10,868.85	1,969,436,526	12,726.23	2,305,993,637	0.65
17	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通 信サービス	391,500	6,146.87	2,406,502,777	5,618.79	2,199,760,083	0.62
18	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	116,990	16,228.16	1,898,533,363	18,755.88	2,194,251,337	0.62

19	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	582,400	3,435.92	2,001,082,080	3,563.39	2,075,318,977	0.59
20	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	230,600	6,932.16	1,598,557,733	8,574.44	1,977,267,109	0.56
21	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	453,300	3,727.27	1,689,574,891	4,258.77	1,930,500,532	0.55
22	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	118,600	15,166.32	1,798,725,623	15,759.27	1,869,049,505	0.53
23	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	265,500	6,078.59	1,613,866,203	6,991.34	1,856,202,974	0.53
24	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	393,600	5,289.88	2,082,100,232	4,709.45	1,853,642,590	0.52
25	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	メディア	146,600	11,245.56	1,648,599,990	12,626.08	1,850,983,533	0.52
26	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,909,000	626.69	1,196,355,028	968.52	1,848,912,316	0.52
27	スイス	株式	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	医薬品	67,440	27,134.28	1,829,936,012	26,762.57	1,804,868,395	0.51
28	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	278,900	4,773.19	1,331,243,081	6,442.78	1,796,892,485	0.51
29	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	214,400	8,037.92	1,723,330,820	8,234.64	1,765,506,816	0.50
30	アメリカ	株式	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	情報技術 サービス	87,160	16,907.61	1,473,667,602	20,007.79	1,743,879,674	0.49

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	不動産管理・開発	0.52
		エネルギー設備・サービス	0.78
		石油・ガス・消耗燃料	6.57
		化学	2.67
		建設資材	0.38
		容器・包装	0.30
		金属・鉱業	1.58
		紙製品・林産品	0.09
		航空宇宙・防衛	1.87
		建設関連製品	0.39
		建設・土木	0.31
		電気設備	0.76
		コングロマリット	2.11
		機械	1.50
		商社・流通業	0.32
商業サービス・用品	0.35		
航空貨物・物流サービス	0.59		

旅客航空輸送業	0.14
海運業	0.07
陸運・鉄道	0.91
運送インフラ	0.22
自動車部品	0.45
自動車	1.04
家庭用耐久財	0.43
レジャー用品	0.07
繊維・アパレル・贅沢品	1.16
ホテル・レストラン・レジャー	1.73
メディア	2.71
販売	0.08
インターネット販売・通信販売	1.58
複合小売り	0.39
専門小売り	1.77
食品・生活必需品小売り	1.89
飲料	1.99
食品	2.16
タバコ	1.57
家庭用品	1.41
パーソナル用品	0.63
ヘルスケア機器・用品	1.84
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.87
バイオテクノロジー	2.24
医薬品	5.58
銀行	9.55
各種金融サービス	0.91
保険	4.15
インターネットソフトウェア・サービス	2.89
情報技術サービス	2.68
ソフトウェア	3.47
通信機器	0.79
コンピュータ・周辺機器	2.40
電子装置・機器・部品	0.40
半導体・半導体製造装置	2.45
各種電気通信サービス	2.55

		無線通信サービス	0.35
		電力	1.80
		ガス	0.15
		総合公益事業	1.06
		水道	0.08
		貯蓄・抵当・不動産金融	0.02
		消費者金融	0.56
		資本市場	2.79
		各種消費者サービス	0.01
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.04
		ヘルスケア・テクノロジー	0.04
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.46
		専門サービス	0.59
	投資信託受益証券		0.00
	投資証券		2.55
	合計		98.13

## (参考) 新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	3,740	129,246.25	483,381,004	194,313.00	726,730,620	3.93
2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インター ネットソフ トウェア・ サービス	214,000	2,350.03	502,908,143	2,998.54	641,689,272	3.47
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	928,000	544.50	505,302,479	669.65	621,439,840	3.36
4	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネットソフ トウェア・ サービス	42,340	9,517.57	402,974,307	11,497.08	486,786,630	2.63
5	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	16,560	16,713.20	276,770,593	18,181.23	301,081,233	1.63
6	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信 サービス	232,000	1,265.73	293,649,618	1,288.75	298,992,204	1.61
7	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,180,000	70.85	225,313,777	85.08	270,573,480	1.46
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	10,240	19,777.23	202,518,922	19,884.88	203,621,204	1.10
9	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,761,000	59.10	163,196,268	70.12	193,608,499	1.04
10	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	579,812	243.82	141,374,149	302.15	175,194,254	0.94

11	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	122,694	1,030.89	126,484,902	1,355.53	166,316,134	0.90
12	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,979,000	44.73	133,275,575	51.93	154,704,832	0.83
13	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	405,000	213.99	86,667,114	331.95	134,443,747	0.72
14	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	57,230	2,045.45	117,061,446	2,304.79	131,903,246	0.71
15	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	222,800	533.58	118,882,595	566.48	126,213,810	0.68
16	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	105,841	940.43	99,536,955	1,177.90	124,670,537	0.67
17	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	198,500	511.78	101,588,644	588.26	116,771,000	0.63
18	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	21,970	2,632.34	57,832,710	5,191.41	114,055,497	0.61
19	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	69,980	1,988.49	139,154,546	1,594.90	111,611,662	0.60
20	ブラジル	株式	AMBEV SA	飲料	177,256	690.78	122,446,505	617.70	109,492,449	0.59
21	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	16,070	4,582.54	73,641,570	6,471.23	103,992,772	0.56
22	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	660	106,568.82	70,335,427	157,301.00	103,818,660	0.56
23	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガス・消耗燃料	673,000	132.58	89,232,384	144.35	97,149,434	0.52
24	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	1,241,200	63.47	78,781,072	72.42	89,891,179	0.48
25	香港	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	石油・ガス・消耗燃料	964,900	76.72	74,034,799	91.10	87,903,065	0.47
26	香港	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	276,000	250.90	69,250,681	316.13	87,254,226	0.47
27	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	49,630	1,667.20	82,743,148	1,755.26	87,113,752	0.47
28	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	インターネットソフトウェア・サービス	3,000	18,368.54	55,105,643	28,508.26	85,524,801	0.46
29	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	25,500	2,693.54	68,685,485	3,250.41	82,885,547	0.44
30	ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	金属・鉱業	73,300	457.47	33,533,006	1,108.01	81,217,573	0.43

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	不動産管理・開発	1.92
		エネルギー設備・サービス	0.08
		石油・ガス・消耗燃料	7.42
		化学	2.45
		建設資材	1.14
		容器・包装	0.06
		金属・鉱業	3.45
		紙製品・林産品	0.37

航空宇宙・防衛	0.25
建設関連製品	0.04
建設・土木	0.83
電気設備	0.23
コングロマリット	1.91
機械	0.63
商社・流通業	0.05
商業サービス・用品	0.12
航空貨物・物流サービス	0.07
旅客航空輸送業	0.18
海運業	0.05
陸運・鉄道	0.15
運送インフラ	0.91
自動車部品	0.75
自動車	2.47
家庭用耐久財	0.69
レジャー用品	0.06
繊維・アパレル・贅沢品	0.55
ホテル・レストラン・レジャー	0.68
メディア	2.17
販売	0.04
インターネット販売・通信販売	0.95
複合小売り	0.65
専門小売り	0.39
食品・生活必需品小売り	1.73
飲料	1.32
食品	1.81
タバコ	0.68
家庭用品	0.35
パーソナル用品	0.81
ヘルスケア機器・用品	0.04
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.56
バイオテクノロジー	0.22
医薬品	1.39
銀行	16.33
各種金融サービス	1.32
保険	3.32
インターネットソフトウェア・サービス	8.34
情報技術サービス	1.61
ソフトウェア	0.14
通信機器	0.02
コンピュータ・周辺機器	5.60

	電子装置・機器・部品	2.45
	半導体・半導体製造装置	4.91
	各種電気通信サービス	1.78
	無線通信サービス	3.80
	電力	1.21
	ガス	0.48
	総合公益事業	0.09
	水道	0.25
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.85
	消費者金融	0.19
	資本市場	1.30
	各種消費者サービス	0.36
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.68
	ヘルスケア・テクノロジー	0.03
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.07
投資証券		0.46
合計		96.52

## (参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	8,200,000,000	101.32	8,308,896,000	100.83	8,268,716,000	0.1	2020/9/20	1.21
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	8,100,000,000	101.27	8,203,194,000	100.81	8,165,934,000	0.1	2020/6/20	1.19
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 6回	8,100,000,000	101.17	8,195,013,000	100.79	8,164,152,000	0.2	2018/12/20	1.19
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	7,800,000,000	101.15	7,890,402,000	100.73	7,857,486,000	0.1	2019/12/20	1.15
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	7,500,000,000	102.03	7,652,257,000	100.36	7,527,225,000	0.1	2026/3/20	1.10
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	101.21	7,388,841,000	100.78	7,357,305,000	0.1	2020/3/20	1.08
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	7,200,000,000	103.67	7,464,702,000	102.16	7,355,808,000	0.3	2025/12/20	1.07
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 5回	7,300,000,000	101.05	7,376,796,000	100.69	7,350,735,000	0.2	2018/9/20	1.07
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 3回	7,000,000,000	101.16	7,081,620,000	100.76	7,053,690,000	0.3	2018/6/20	1.03
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	6,900,000,000	102.31	7,060,028,000	100.32	6,922,494,000	0.1	2026/6/20	1.01
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	6,800,000,000	101.15	6,878,240,000	100.28	6,819,448,000	0.1	2026/9/20	1.00



12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	6,200,000,000	101.99	6,323,778,000	100.92	6,257,226,000	0.1	2021/6/20	0.91
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	6,000,000,000	104.57	6,274,560,000	103.00	6,180,420,000	0.4	2025/9/20	0.90
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	5,900,000,000	104.55	6,168,509,000	103.00	6,077,354,000	0.4	2025/6/20	0.89
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	6,000,000,000	100.91	6,055,165,000	100.95	6,057,180,000	0.1	2021/9/20	0.88
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	101.58	6,095,240,000	100.89	6,053,460,000	0.1	2021/3/20	0.88
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 7回	5,900,000,000	101.28	5,975,579,000	100.83	5,949,088,000	0.2	2019/3/20	0.87
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,500,000,000	105.49	5,802,280,000	104.02	5,721,430,000	0.6	2023/3/20	0.83
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	107.08	5,675,293,000	105.40	5,586,412,000	0.8	2023/6/20	0.82
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	101.44	5,579,585,000	100.96	5,553,020,000	0.2	2019/9/20	0.81
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	5,500,000,000	101.38	5,575,960,000	100.85	5,547,135,000	0.1	2020/12/20	0.81
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	106.60	5,277,145,500	105.12	5,203,638,000	1.2	2020/12/20	0.76
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,900,000,000	106.47	5,217,373,000	104.88	5,139,463,000	0.8	2022/9/20	0.75
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	4,900,000,000	104.56	5,123,783,000	102.95	5,044,893,000	0.4	2025/3/20	0.74
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 8回	5,000,000,000	101.37	5,068,700,000	100.89	5,044,750,000	0.2	2019/6/20	0.74
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第37 2回	5,000,000,000	100.62	5,031,300,000	100.62	5,031,300,000	0.1	2019/1/15	0.73
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	4,700,000,000	105.34	4,951,215,000	103.65	4,871,832,000	0.5	2024/9/20	0.71
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第11 9回	4,700,000,000	101.06	4,750,146,000	100.65	4,730,832,000	0.1	2019/6/20	0.69
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 46回	3,700,000,000	123.67	4,576,098,000	119.80	4,432,711,000	1.7	2033/9/20	0.65
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	4,100,000,000	106.10	4,350,182,000	104.34	4,278,309,000	0.6	2024/6/20	0.62

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.05
地方債証券	7.80
特殊債券	8.23
社債券	4.07

合 計	99.16
-----	-------

## (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	1,300,000	11,890.92	154,581,988	11,561.49	150,299,431	2.25	2021/7/31	1.26
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,150,000	12,316.51	141,639,959	11,982.94	137,803,901	3.125	2021/5/15	1.15
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	11,328.54	124,613,948	11,302.31	124,325,417	0.75	2018/10/31	1.04
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	11,291.64	124,208,054	11,262.29	123,885,295	0.875	2019/6/15	1.04
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,849.13	118,491,325	11,576.61	115,766,109	2.25	2021/4/30	0.97
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,789.56	117,895,602	11,486.80	114,868,069	2.125	2021/9/30	0.96
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,020,000	11,374.63	116,021,291	11,240.96	114,657,793	1	2019/11/30	0.96
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,573.49	115,734,989	11,449.46	114,494,635	1.625	2019/8/31	0.96
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,536.15	115,361,550	11,416.56	114,165,656	2	2021/10/31	0.95
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,381.00	113,810,000	11,338.76	113,387,651	0.875	2018/10/15	0.95
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,383.22	113,832,228	11,262.29	112,622,996	1	2019/9/30	0.94
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,268.07	112,680,792	11,230.29	112,302,905	0.875	2019/9/15	0.94
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,020,000	10,745.54	109,604,529	10,604.77	108,168,749	1.625	2026/2/15	0.90
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	11,833.21	99,398,986	11,196.94	94,054,360	2.25	2025/11/15	0.78
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	12,422.36	104,347,837	11,196.05	94,046,894	3	2045/5/15	0.78
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	820,000	11,368.48	93,221,543	11,356.54	93,123,693	0.75	2018/4/15	0.78
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	11,655.29	93,242,399	11,482.36	91,858,892	1.75	2019/9/30	0.77
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	11,425.01	91,400,099	11,363.66	90,909,288	1	2018/9/15	0.76
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	820,000	11,395.60	93,443,967	10,929.31	89,620,396	1.5	2023/3/31	0.75
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000	17,532.14	92,920,367	15,648.52	82,937,195	5	2034/8/1	0.69
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	720,000	11,371.04	81,871,534	11,356.99	81,770,348	0.75	2018/3/31	0.68
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	12,146.51	85,025,627	11,527.70	80,693,955	2.5	2024/5/15	0.67
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000	13,368.63	80,211,822	13,178.65	79,071,950	4.25	2018/10/25	0.66
24	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	600,000	13,171.52	79,029,143	13,038.81	78,232,898	4.25	2018/7/4	0.65
25	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	600,000	12,514.56	75,087,365	11,927.73	71,566,428	0.5	2025/5/25	0.60
26	イギリス	国債証券	UK TREASURY	460,000	15,650.02	71,990,104	15,539.11	71,479,920	3.75	2019/9/7	0.60
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	600,000	12,280.21	73,681,305	11,732.20	70,393,258	2.75	2023/11/15	0.59
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	600,000	11,796.22	70,777,372	11,430.34	68,582,081	2	2021/8/31	0.57
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	580,000	11,577.89	67,151,770	11,482.36	66,597,696	2	2021/2/28	0.55
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	570,000	12,755.82	72,708,201	11,491.25	65,500,144	3.125	2043/2/15	0.55

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.09
合 計	96.09

## (参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	43,200,000	15,767.31	6,811,480,248	14,666.37	6,335,873,463	6	2026/2/15	0.97
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,800,000	12,481.75	6,465,549,362	12,100.31	6,267,962,901	3.625	2020/2/15	0.96
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	12,111.87	6,370,844,480	11,765.10	6,188,447,203	2.625	2020/11/15	0.94
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	12,323.48	6,075,480,108	11,987.83	5,910,004,299	3.375	2019/11/15	0.90
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	51,200,000	11,992.46	6,140,140,548	11,409.45	5,841,639,680	2.375	2024/8/15	0.89
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,700,000	12,459.79	5,943,323,182	12,079.41	5,761,882,846	3.5	2020/5/15	0.88
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	12,658.82	5,797,739,763	12,209.67	5,592,033,011	3.625	2021/2/15	0.85
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,500,000	12,094.09	5,139,988,340	11,764.21	4,999,792,971	2.625	2020/8/15	0.76
9	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	15,877.08	5,255,314,399	14,918.02	4,937,867,102	3.5	2026/4/25	0.75
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	32,000,000	15,978.49	5,113,117,218	15,312.49	4,899,999,200	4.25	2023/10/25	0.75
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,200,000	11,557.63	4,877,320,437	11,080.46	4,675,958,298	1.75	2023/5/15	0.71
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,400,000	12,432.20	4,773,964,953	11,982.94	4,601,452,001	3.125	2021/5/15	0.70
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000	19,348.42	4,740,363,035	18,082.37	4,430,180,864	5.5	2029/4/25	0.67
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,600,000	11,820.53	4,444,520,331	11,565.05	4,348,459,272	2.125	2020/8/31	0.66
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,700,000	12,218.33	4,361,943,995	11,906.03	4,250,455,350	3.75	2018/11/15	0.65
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	12,334.10	4,551,285,717	11,206.72	4,135,282,793	3	2044/11/15	0.63
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	14,048.82	4,102,257,284	13,597.04	3,970,335,680	4.25	2020/3/1	0.60
18	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,700,000	13,133.12	4,031,870,223	12,756.59	3,916,276,123	4.5	2018/1/31	0.60
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	11,915.68	4,051,333,266	11,507.25	3,912,467,516	2.125	2021/6/30	0.60
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	33,600,000	11,847.65	3,980,812,973	11,635.73	3,909,608,185	2.875	2018/3/31	0.59
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	11,388.55	3,872,109,374	11,356.54	3,861,226,293	0.75	2018/4/15	0.59
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,600,000	13,370.69	3,957,727,006	12,994.98	3,846,515,930	4.5	2018/8/1	0.59
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	11,798.89	3,976,227,792	11,396.11	3,840,490,791	2	2022/2/15	0.58
24	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000	20,735.24	4,022,637,045	19,751.62	3,831,815,105	6.5	2027/7/4	0.58
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000	21,170.66	4,149,450,627	19,472.98	3,816,705,491	5.75	2032/10/25	0.58
26	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	27,500,000	13,968.36	3,841,299,186	13,712.36	3,770,899,441	4	2020/4/30	0.57
27	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	21,050,000	17,068.81	3,592,984,758	17,688.38	3,723,404,348	3.25	2044/1/22	0.57
28	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,000,000	18,000.35	3,600,070,793	18,528.71	3,705,743,740	3.5	2045/1/22	0.56
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,300,000	13,646.61	3,725,526,259	13,409.54	3,660,805,785	2.5	2020/10/25	0.56
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,200,000	11,777.02	3,674,430,288	11,598.39	3,618,698,982	2.375	2018/6/30	0.55

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.85
合計	98.85

(参考) 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	ロシア	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND	130,000,000	186.06	241,887,175	189.45	246,288,770	7.85	2018/3/10	6.05
2	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,820,000,000	3.89	148,783,082	4.10	156,685,061	7.75	2021/4/14	3.85
3	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,150,000,000	4.47	140,988,721	4.79	150,937,056	9.85	2027/6/28	3.71
4	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	256,000	3,334.24	85,365,374	3,613.65	92,509,534	10	2021/1/1	2.27
5	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	251,000	3,089.26	77,549,076	3,519.37	88,336,380	10	2025/1/1	2.17
6	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	6,880,000,000	1.02	70,358,367	1.02	70,376,352	11	2025/9/15	1.73
7	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,430,000	2,685.23	65,251,167	2,808.25	68,240,643		2019/1/1	1.67
8	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000	925.91	65,739,966	929.13	65,968,839	10.5	2026/12/21	1.62
9	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,140,000	2,812.22	60,181,665	2,889.98	61,845,740		2018/7/1	1.52
10	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,950,000	586.16	64,185,234	563.98	61,756,466	8	2020/6/11	1.51
11	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	2,310,000	2,387.83	55,158,897	2,554.11	58,999,973		2019/7/1	1.45
12	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,100,000	2,892.22	60,736,768	2,716.20	57,040,368	3.25	2025/7/25	1.40
13	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000	357.87	53,680,892	345.01	51,752,497	3.65	2021/12/17	1.27
14	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,960,000	2,603.35	51,025,693	2,584.90	50,664,158	3.58	2018/9/28	1.24
15	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	5,330,000,000	0.88	47,298,182	0.88	47,139,853	8.375	2024/3/15	1.15
16	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,730,000	2,747.34	47,528,996	2,720.41	47,063,214	1.5	2020/4/25	1.15
17	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,760,000	2,655.25	46,732,520	2,639.49	46,455,118	4.378	2019/11/29	1.14
18	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,700,000	2,761.58	46,946,905	2,712.84	46,118,293	2	2021/4/25	1.13
19	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000	747.41	44,844,961	760.15	45,609,083	8	2030/1/31	1.12
20	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000	746.78	44,060,481	768.73	45,355,394	8.75	2048/2/28	1.11
21	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,200,000	570.35	46,769,343	529.61	43,428,136	6.5	2022/6/9	1.06
22	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,160,000	674.62	41,557,169	690.50	42,534,880	7	2031/2/28	1.04
23	ハンガリー	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND	92,000,000	47.22	43,447,189	45.96	42,284,138	5.5	2025/6/24	1.04
24	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,410,000	3,070.72	43,297,274	2,989.41	42,150,681	10.5	2020/1/15	1.03

25	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,650,000	2,713.42	44,771,527	2,528.90	41,726,974	2.5	2026/7/25	1.02
26	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,620,000	2,700.38	43,746,243	2,566.22	41,572,829	8	2025/3/12	1.02
27	ハンガリー	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND	81,000,000	48.33	39,150,017	47.80	38,723,152	7.5	2020/11/12	0.95
28	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,450,000	586.79	37,848,372	599.68	38,679,427	6.5	2041/2/28	0.95
29	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,000,000	418.56	41,856,212	382.64	38,264,486	4.875	2029/6/22	0.94
30	トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,390,000	2,767.50	38,468,360	2,713.84	37,722,405	8.5	2022/9/14	0.92

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.72
合計	96.72

## 【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(2017年03月限)	買建	217	日本円	3,279,406,461	3,291,890,000	1.03

（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(2017 年03月限)	買建	336	米ドル	38,149,162.5	4,341,756,185	38,236,800	4,351,730,208	1.24
	カナダ	モン トル オー ル取 引所	S&P TSX60株指 数先物(2017年03 月限)	買建	17	カナダ ドル	3,087,680	267,979,747	3,092,980	268,439,733	0.07

ドイツ	ユーロレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2017年03月限)	買建	200	ユーロ	6,556,710	798,279,444	6,504,000	791,862,000	0.22
オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2017年03月限)	買建	16	豪ドル	2,254,950	194,151,194	2,241,200	192,967,319	0.05
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2017年03月限)	買建	47	英ポンド	3,311,255	471,622,051	3,311,150	471,607,093	0.13
スイス	ユーロレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2017年03月限)	買建	24	スイスフラン	1,969,760	225,281,451	1,979,040	226,342,803	0.06

### (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エマージングマーケット株価指数先物(2017年03月限)	買建	120	米ドル	5,299,235	603,105,931	5,482,200	623,929,170	3.37

### (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29年1月末日及び同日前1年以内における各月末（設定来）並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	55	55	1.0544	1.0544
2016年 4月末日	36		0.9989	
5月末日	43		1.0055	
6月末日	44		0.9626	
7月末日	47		0.9932	
8月末日	48		0.9922	
9月末日	49		0.9851	
10月末日	49		0.9989	
11月末日	52		1.0276	
12月末日	55		1.0533	
2017年 1月末日	56		1.0493	

#### 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

平成29年1月末日及び同日前1年以内における各月末（設定来）並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	10	10	1.0514	1.0514
2016年 4月末日	4		0.9979	
5月末日	4		1.0042	
6月末日	5		0.9612	
7月末日	7		0.9911	
8月末日	8		0.9899	
9月末日	8		0.9825	
10月末日	9		0.9958	
11月末日	9		1.0245	
12月末日	10		1.0504	
2017年 1月末日	11		1.0459	



## 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

平成29年1月末日及び同日前1年以内における各月末（設定来）並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	7	7	1.0472	1.0472
2016年 4月末日	2		0.9964	
5月末日	2		1.0023	
6月末日	4		0.9597	
7月末日	4		0.9885	
8月末日	5		0.9870	
9月末日	5		0.9791	
10月末日	6		0.9918	
11月末日	6		1.0203	
12月末日	7		1.0463	
2017年 1月末日	7		1.0409	

## 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

平成29年1月末日及び同日前1年以内における各月末（設定来）並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	6	6	1.0409	1.0409
2016年 4月末日	2		0.9944	
5月末日	4		0.9998	
6月末日	4		0.9572	
7月末日	5		0.9844	
8月末日	5		0.9825	
9月末日	5		0.9740	
10月末日	6		0.9858	
11月末日	6		1.0141	
12月末日	6		1.0404	
2017年 1月末日	7		1.0338	

## 【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

## 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

## 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

## 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

## 【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%

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%

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%

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%

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

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

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

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

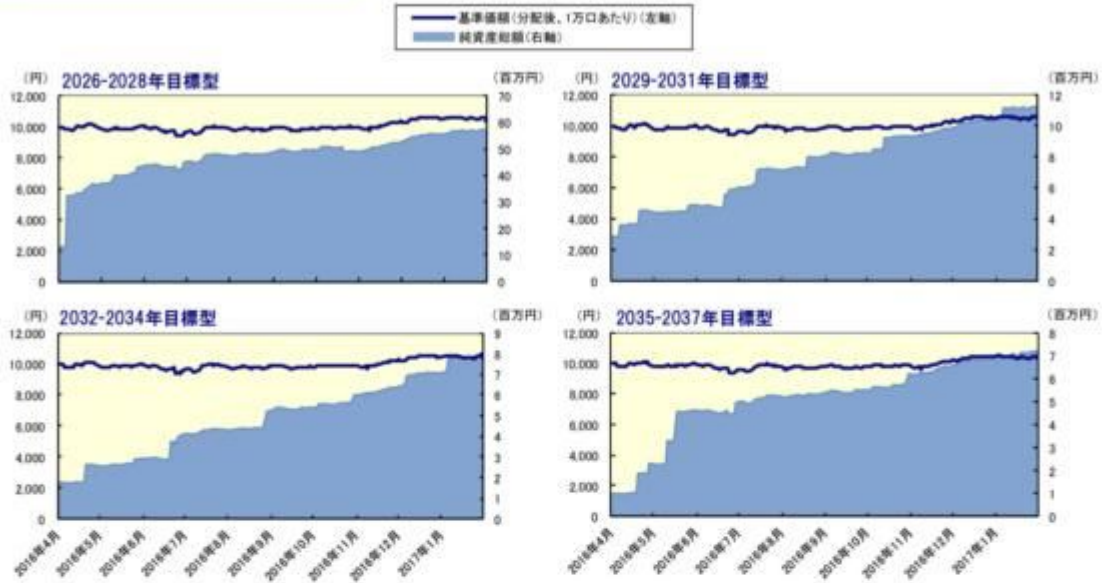
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報

## 運用実績 (2017年1月31日現在)

## 基準価額・純資産の推移

(日次・設定来)



## 分配の推移

(1万円あたり、課税前)

	野村ターゲットデットファンド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
2016年12月	0円	0円	0円	0円
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
---	---	---	---	---
設定来累計	0円	0円	0円	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	24.2	23.5	22.3	20.8
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	14.5	14.1	13.4	12.4
新興国株式マザーファンド	10.0	9.7	9.1	8.5
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	17.4	17.0	16.4	15.5
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	17.3	16.8	16.3	15.4
外国債券マザーファンド	13.7	15.7	16.6	22.8
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2.8	3.2	3.8	4.6

### 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	0.8	0.8	0.7
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.6	0.6	0.5	0.5
3	日本電信電話	情報・通信業	0.4	0.4	0.4	0.4
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.4	0.4	0.4	0.4
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.4	0.4	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	0.2	0.2	0.2	0.2
3	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.2	0.2	0.1	0.1
4	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.1	0.1	0.1
5	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.1	0.1	0.1	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	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.4	0.4	0.4	0.3
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インターネットソフトウェア・サービス	0.3	0.3	0.3	0.3
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.3	0.3	0.3	0.3
4	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネットソフトウェア・サービス	0.3	0.3	0.2	0.2
5	NASPERS LTD-N SHS	メディア	0.2	0.2	0.1	0.1

#### ・「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125回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
2	国庫債券 利付(5年)第124回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
3	国庫債券 利付(5年)第116回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
4	国庫債券 利付(5年)第122回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
5	国庫債券 利付(10年)第342回	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2

#### ・「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	0.2	0.2	0.2	0.2
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.1

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

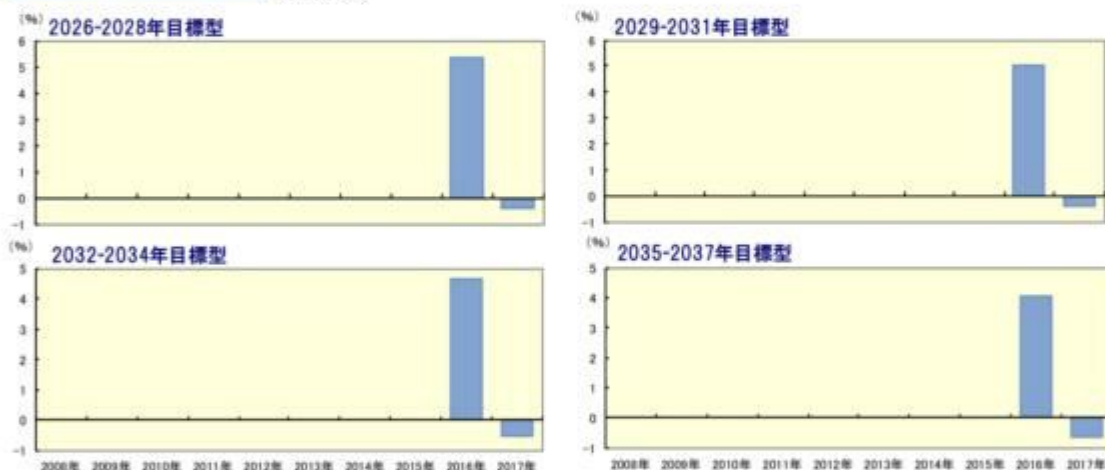
順位	銘柄	種類	投資比率(%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.2	0.2	0.2
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.2	0.2	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.2	0.2
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.2	0.2
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.2	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	RUSSIA FOREIGN BOND	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.3
2	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2
3	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2
4	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1

## 年間収益率の推移

(暦年ベース)



・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。

・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、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。

・2017年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●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」  
という場合があります、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項  
第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）  
等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受  
益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

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



## 2【換金（解約）手続等】

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

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

## (2) 【保管】

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

## (3) 【信託期間】

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たときは、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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

( )上記( )の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

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

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

## (c) 運用報告書

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、知っている受益者に対して交付します。

## (d) 信託約款の変更等

( )委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、

( )委託者は、上記( )の事項（上記( )の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当す

る場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知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1期計算期間(平成28年4月1日から平成28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)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		396,435
親投資信託受益証券		55,433,184
未収入金		6,907
流動資産合計		55,836,526
資産合計		55,836,526
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,382
未払受託者報酬		18,167
未払委託者報酬		327,073
その他未払費用		998
流動負債合計		347,620
負債合計		347,620
純資産の部		
元本等		
元本		52,625,060
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,863,846
（分配準備積立金）		3,403,281
元本等合計		55,488,906
純資産合計		55,488,906
負債純資産合計		55,836,526

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	3,742,443
<b>営業収益合計</b>	<b>3,742,443</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	9
受託者報酬	18,167
委託者報酬	327,073
その他費用	998
<b>営業費用合計</b>	<b>346,247</b>
営業利益又は営業損失（ ）	3,396,196
経常利益又は経常損失（ ）	3,396,196
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,396,196
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
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,937
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
剰余金減少額又は欠損金増加額	569,372
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（ ）	<b>2,863,846</b>



## ( 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 4月 1日から平成28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	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	52,625,060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)

## ( 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		
1. 分配金の計算過程		
項目	項目	
費用控除後の配当等収益額	A	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
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
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</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

第1期 平成28年12月26日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28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。

(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	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	55,225,894円
期中一部解約元本額	2,600,834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
	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,632,302
合計	3,632,302

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成28年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28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	9,317,922	13,501,668	
		外国債券マザーファンド	3,550,987	7,826,375	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,672,742	8,310,680	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	7,244,431	9,438,044	
		新興国株式マザーファンド	5,228,199	5,290,937	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,272,510	1,595,345	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	8,444,169	9,470,135	
	小計	銘柄数: 7 組入時価比率: 99.9%	38,730,960	55,433,184 100.0%	
合計			55,433,184		

(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)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	63,078
親投資信託受益証券	10,342,079
未収入金	1,412
流動資産合計	10,406,569
資産合計	10,406,569
負債の部	
流動負債	
未払解約金	96
未払受託者報酬	2,847
未払委託者報酬	50,950
その他未払費用	201
流動負債合計	54,094
負債合計	54,094
純資産の部	
元本等	
元本	9,845,964
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	506,511
(分配準備積立金)	608,073
元本等合計	10,352,475
純資産合計	10,352,475
負債純資産合計	10,406,569

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日
営業収益	
有価証券売買等損益	662,077
営業収益合計	662,077
営業費用	
受託者報酬	2,847
委託者報酬	50,950
その他費用	201
営業費用合計	53,998
営業利益又は営業損失（ ）	608,079
経常利益又は経常損失（ ）	608,079
当期純利益又は当期純損失（ ）	608,079
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
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	101,562
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 ) 【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 4月 1日から平成28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	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,845,964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)

( 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		
1. 分配金の計算過程		
項目	項目	
費用控除後の配当等収益額	A	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
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
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</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

第1期 平成28年12月26日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（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
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。

(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	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	9,846,136円
期中一部解約元本額	172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
	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	645,358
合計	645,358

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成28年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28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	1,687,221	2,444,783	
		外国債券マザーファンド	761,040	1,677,332	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	666,068	1,507,178	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,312,957	1,710,520	
		新興国株式マザーファンド	934,613	945,828	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	271,279	340,102	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,530,394	1,716,336	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	7,163,572	10,342,079 100.0%	
合計			10,342,079		

(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)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		40,116
親投資信託受益証券		7,059,472
流動資産合計		7,099,588
資産合計		7,099,588
負債の部		
流動負債		
未払解約金		23
未払受託者報酬		1,767
未払委託者報酬		31,912
その他未払費用		180
流動負債合計		33,882
負債合計		33,882
純資産の部		
元本等		
元本		6,747,545
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		318,161
(分配準備積立金)		398,774
元本等合計		7,065,706
純資産合計		7,065,706
負債純資産合計		7,099,588

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日
営業収益	
有価証券売買等損益	432,634
営業収益合計	432,634
営業費用	
受託者報酬	1,767
委託者報酬	31,912
その他費用	180
営業費用合計	33,859
営業利益又は営業損失（ ）	398,775
経常利益又は経常損失（ ）	398,775
当期純利益又は当期純損失（ ）	398,775
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
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	80,613
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

## (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 4月 1日から平成28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	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,747,545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)

## (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		
1.分配金の計算過程		
項目	項目	
費用控除後の配当等収益額	A	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
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
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</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

第1期 平成28年12月26日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(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
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。

(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	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	6,747,567円
期中一部解約元本額	22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
	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	423,665
合計	423,665

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成28年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28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	1,092,111	1,582,468	
		外国債券マザーファンド	615,596	1,356,773	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	431,940	977,393	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	864,633	1,126,443	
		新興国株式マザーファンド	603,182	610,420	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	219,882	275,666	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,007,855	1,130,309	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	4,835,199	7,059,472 100.0%	
合計			7,059,472		

(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)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		43,781
親投資信託受益証券		6,876,309
未収入金		1,312
流動資産合計		6,921,402
資産合計		6,921,402
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,278
未払受託者報酬		1,934
未払委託者報酬		34,783
その他未払費用		181
流動負債合計		38,176
負債合計		38,176
純資産の部		
元本等		
元本		6,612,655
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		270,571
(分配準備積立金)		355,371
元本等合計		6,883,226
純資産合計		6,883,226
負債純資産合計		6,921,402

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28年12月26日
営業収益	
有価証券売買等損益	392,344
営業収益合計	392,344
営業費用	
受託者報酬	1,934
委託者報酬	34,783
その他費用	181
営業費用合計	36,898
営業利益又は営業損失（ ）	355,446
経常利益又は経常損失（ ）	355,446
当期純利益又は当期純損失（ ）	355,446
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
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	366
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	366
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,166
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

## (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 4月 1日から平成28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	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,612,655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)

## (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		
1.分配金の計算過程		
項目	項目	
費用控除後の配当等収益額	A	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
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
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</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

第1期 平成28年12月26日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成28年 4月 1日 至 平成28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。

(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	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	6,671,960円
期中一部解約元本額	59,305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
	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	386,603
合計	386,603

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成28年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28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	981,369	1,422,003	
		外国債券マザーファンド	736,983	1,624,310	
		外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	385,836	873,069	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	796,217	1,037,311	
		新興国株式マザーファンド	540,239	546,721	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	264,861	332,056	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	928,078	1,040,839	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：99.9%	4,633,583	6,876,309 100.0%	
合計			6,876,309		

(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-KOKUSA I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28年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	30,183,316,821
株式	320,540,324,720
派生商品評価勘定	144,265,912
未収入金	3,595,140
未収配当金	15,527,650
未収利息	1,842,090
その他未収収益	12,806,403

(平成28年12月26日現在)

流動資産合計	350,901,678,736
資産合計	350,901,678,736
負債の部	
流動負債	
前受金	18,702,000
未払解約金	688,136,581
未払利息	33,871
有価証券貸借取引受入金	26,458,611,427
流動負債合計	27,165,483,879
負債合計	27,165,483,879
純資産の部	
元本等	
元本	223,425,016,244
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	100,311,178,613
元本等合計	323,736,194,857
純資産合計	323,736,194,857
負債純資産合計	350,901,678,736

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28年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	1.4490円
(10,000口当たり純資産額)	(14,490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

25,088,247,150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 4月 1日 至 平成28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、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年12月26日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成28年12月26日現在	
期首	平成28年 4月 1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	226,101,018,220円
同期中における追加設定元本額	24,655,873,817円
同期中における一部解約元本額	27,331,875,793円
期末元本額	223,425,016,244円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	196,054,677円
バランスセレクト50	440,386,897円
バランスセレクト70	499,893,339円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,416,920,531円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	4,478,002,600円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	8,248,189,574円
野村資産設計ファンド2015	79,326,920円
野村資産設計ファンド2020	89,062,159円
野村資産設計ファンド2025	117,147,646円
野村資産設計ファンド2030	112,554,506円
野村資産設計ファンド2035	84,463,955円
野村資産設計ファンド2040	264,880,987円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	78,384,079,713円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	2,129,293,769円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	4,808,448,698円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	1,533,313,280円
野村資産設計ファンド2045	27,083,833円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,209,981,452円
マイ・ロード	3,304,683,818円
ネクストコア	165,031,641円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	377,259,723円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,462,427,980円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,499,609,827円
野村資産設計ファンド2050	21,006,020円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	9,317,922円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,687,221円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,092,111円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	981,369円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	123,570,755円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	17,627,391円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	1,860,321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）	749,346,976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）	634,944,767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）	3,219,518,895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）	1,071,426,866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）	5,226,833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）	30,921,206円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	10,686,148円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	6,803,378,080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）	443,427,222円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	2,934,012,784円
野村日本株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,126,418,383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）	1,933,304,740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)	416,547,044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)	70,650,079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)	366,700,378円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	5,911,890,016円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	846,346,212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)	561,766,123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)	960,217,691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)	1,226,549,362円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	9,510,733円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	36,278,597円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	39,108,115円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	100,595,040円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,157,904,901円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,635,207,021円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	16,905,807,297円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	31,614,460,102円
マイバランスDC30	2,356,054,923円
マイバランスDC50	3,212,510,332円
マイバランスDC70	2,852,732,845円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,683,964,078円
野村DC運用戦略ファンド	248,839,951円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	889,044円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	135,980,269円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	2,519,172円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	4,133,384円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年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	6,300	2,734.00	17,224,200	
		日本水産	207,700	555.00	115,273,500	
		マルハニチロ	30,300	3,115.00	94,384,500	貸付有価証券 1,100株
		カネコ種苗	5,500	1,584.00	8,712,000	
		サカタのタネ	23,600	3,330.00	78,588,000	貸付有価証券 8,200株
		ホクト	16,300	2,154.00	35,110,200	

ホクリヨウ	1,700	749.00	1,273,300	貸付有価証券 700株(500株)
住石ホールディングス	44,400	96.00	4,262,400	貸付有価証券 14,200株(12,600株)
日鉄鉱業	4,400	5,600.00	24,640,000	
三井松島産業	9,800	1,325.00	12,985,000	貸付有価証券 900株
国際石油開発帝石	842,700	1,200.50	1,011,661,350	貸付有価証券 1,300株
日本海洋掘削	5,600	2,444.00	13,686,400	貸付有価証券 2,200株(300株)
石油資源開発	25,300	2,636.00	66,690,800	貸付有価証券 8,600株
K&Oエナジーグループ	10,800	1,882.00	20,325,600	貸付有価証券 100株
ショーボンドホールディングス	16,800	4,995.00	83,916,000	貸付有価証券 7,800株
ミライト・ホールディングス	49,200	1,033.00	50,823,600	貸付有価証券 23,200株(4,400株)
タマホーム	12,000	528.00	6,336,000	貸付有価証券 5,500株(1,300株)
サンヨーホームズ	3,400	651.00	2,213,400	
ダイセキ環境ソリューション	3,700	1,355.00	5,013,500	貸付有価証券 1,700株
安藤・間	114,900	778.00	89,392,200	
東急建設	56,800	938.00	53,278,400	貸付有価証券 25,000株
コムシスホールディングス	62,500	2,126.00	132,875,000	
ミサワホーム	18,900	989.00	18,692,100	貸付有価証券 9,100株(4,700株)
ビーアールホールディングス	15,800	241.00	3,807,800	貸付有価証券 7,400株
高松コンストラクショングループ	12,100	2,490.00	30,129,000	
東建コーポレーション	6,600	8,540.00	56,364,000	
ソネック	2,000	627.00	1,254,000	
ヤマウラ	7,500	556.00	4,170,000	
大成建設	813,000	828.00	673,164,000	
大林組	479,800	1,131.00	542,653,800	
清水建設	489,000	1,089.00	532,521,000	貸付有価証券

				33,000株
飛島建設	154,100	187.00	28,816,700	貸付有価証券 33,700株
長谷工コーポレーション	186,700	1,202.00	224,413,400	
松井建設	17,600	1,077.00	18,955,200	
銭高組	23,000	495.00	11,385,000	貸付有価証券 10,000株
鹿島建設	703,000	807.00	567,321,000	
不動テトラ	129,100	210.00	27,111,000	
大末建設	5,600	922.00	5,163,200	
鉄建建設	97,000	343.00	33,271,000	貸付有価証券 45,000株(1,000株)
西松建設	185,000	574.00	106,190,000	
三井住友建設	613,000	125.00	76,625,000	
大豊建設	58,000	565.00	32,770,000	
前田建設工業	99,000	1,028.00	101,772,000	貸付有価証券 22,000株(6,000株)
佐田建設	11,000	440.00	4,840,000	
ナカノフドー建設	12,200	619.00	7,551,800	
奥村組	132,000	663.00	87,516,000	
東鉄工業	19,200	3,050.00	58,560,000	貸付有価証券 3,000株
イチケン	14,000	413.00	5,782,000	貸付有価証券 3,000株
浅沼組	51,000	392.00	19,992,000	
戸田建設	186,000	627.00	116,622,000	貸付有価証券 16,000株
熊谷組	251,000	302.00	75,802,000	貸付有価証券 18,000株(7,000株)
青木あすなろ建設	10,500	773.00	8,116,500	
北野建設	33,000	325.00	10,725,000	
植木組	20,000	260.00	5,200,000	
三井ホーム	21,000	508.00	10,668,000	
矢作建設工業	21,800	1,062.00	23,151,600	貸付有価証券 2,300株
ピーエス三菱	16,800	393.00	6,602,400	貸付有価証券 4,200株(1,100株)
日本ハウスホールディングス	32,600	501.00	16,332,600	貸付有価証券 600株
大東建託	58,900	17,440.00	1,027,216,000	

新日本建設	19,000	943.00	17,917,000	
N I P P O	37,000	2,197.00	81,289,000	
東亜道路工業	30,000	347.00	10,410,000	
前田道路	50,000	1,945.00	97,250,000	
日本道路	48,000	464.00	22,272,000	
東亜建設工業	13,000	2,018.00	26,234,000	貸付有価証券 2,000株
若築建設	92,000	156.00	14,352,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
東洋建設	46,000	413.00	18,998,000	貸付有価証券 5,800株（100株）
五洋建設	177,500	561.00	99,577,500	
大林道路	16,600	721.00	11,968,600	貸付有価証券 1,400株
世紀東急工業	23,300	497.00	11,580,100	
福田組	26,000	1,249.00	32,474,000	貸付有価証券 12,000株
住友林業	110,100	1,573.00	173,187,300	貸付有価証券 1,100株
日本基礎技術	17,800	360.00	6,408,000	
日成ビルド工業	47,000	536.00	25,192,000	
ヤマダ・エスバイエル ホーム	81,000	79.00	6,399,000	
巴コーポレーション	19,900	357.00	7,104,300	
パナホーム	60,000	974.00	58,440,000	
大和ハウス工業	472,500	3,263.00	1,541,767,500	
ライト工業	30,700	1,219.00	37,423,300	
積水ハウス	503,400	1,956.00	984,650,400	
日特建設	13,600	471.00	6,405,600	貸付有価証券 5,900株
北陸電気工事	7,700	852.00	6,560,400	
ユアテック	25,000	795.00	19,875,000	
西部電気工業	2,700	2,204.00	5,950,800	貸付有価証券 300株（300株）
四電工	12,000	443.00	5,316,000	
中電工	20,200	2,570.00	51,914,000	貸付有価証券 100株
関電工	64,000	1,048.00	67,072,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）

きんでん	106,400	1,465.00	155,876,000	
東京エネシス	17,000	1,028.00	17,476,000	
トーエネック	22,000	578.00	12,716,000	貸付有価証券 1,000株
住友電設	11,100	1,283.00	14,241,300	
日本電設工業	26,100	1,907.00	49,772,700	貸付有価証券 6,400株
協和エクシオ	62,700	1,686.00	105,712,200	貸付有価証券 1,000株
新日本空調	12,300	1,277.00	15,707,100	貸付有価証券 800株
N D S	2,500	2,891.00	7,227,500	
九電工	31,100	3,080.00	95,788,000	貸付有価証券 6,500株(4,000株)
三機工業	35,500	987.00	35,038,500	貸付有価証券 400株
日揮	149,300	2,127.00	317,561,100	貸付有価証券 10,700株
中外炉工業	48,000	225.00	10,800,000	貸付有価証券 6,000株
ヤマト	14,300	568.00	8,122,400	
太平電業	22,000	1,144.00	25,168,000	
高砂熱学工業	44,000	1,508.00	66,352,000	貸付有価証券 4,900株
三晃金属工業	1,400	3,160.00	4,424,000	
朝日工業社	3,600	2,962.00	10,663,200	
明星工業	29,000	578.00	16,762,000	
大気社	21,200	2,826.00	59,911,200	貸付有価証券 1,700株
ダイダン	21,000	972.00	20,412,000	
日比谷総合設備	17,900	1,677.00	30,018,300	
東芝プラントシステム	26,000	1,682.00	43,732,000	貸付有価証券 4,400株(4,400株)
OSJBホールディングス	48,900	242.00	11,833,800	貸付有価証券 22,900株
東洋エンジニアリング	94,000	310.00	29,140,000	貸付有価証券 38,000株
千代田化工建設	115,000	830.00	95,450,000	
新興プランテック	32,800	848.00	27,814,400	
日本製粉	47,600	1,606.00	76,445,600	

日清製粉グループ本社	175,400	1,763.00	309,230,200	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
日東富士製粉	1,000	3,815.00	3,815,000	
昭和産業	66,000	610.00	40,260,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
鳥越製粉	12,700	826.00	10,490,200	貸付有価証券 6,000株
中部飼料	17,500	1,014.00	17,745,000	貸付有価証券 400株
フィード・ワン	96,300	154.00	14,830,200	
東洋精糖	24,000	115.00	2,760,000	
日本甜菜製糖	8,200	2,299.00	18,851,800	
三井製糖	11,300	2,508.00	28,340,400	
塩水港精糖	17,100	242.00	4,138,200	
日新製糖	6,800	1,653.00	11,240,400	
森永製菓	31,200	4,835.00	150,852,000	貸付有価証券 2,300株
中村屋	3,700	4,900.00	18,130,000	
江崎グリコ	40,000	5,370.00	214,800,000	
名糖産業	6,900	1,383.00	9,542,700	
不二家	91,000	227.00	20,657,000	貸付有価証券 30,000株
山崎製パン	117,200	2,299.00	269,442,800	貸付有価証券 54,700株
第一屋製パン	25,000	139.00	3,475,000	
モロゾフ	24,000	489.00	11,736,000	
亀田製菓	8,900	5,360.00	47,704,000	貸付有価証券 1,100株
寿スピリッツ	11,400	2,795.00	31,863,000	貸付有価証券 5,300株
カルビー	65,200	3,685.00	240,262,000	貸付有価証券 23,300株(3,000株)
森永乳業	143,000	824.00	117,832,000	貸付有価証券 37,000株
六甲バター	7,100	2,583.00	18,339,300	貸付有価証券 3,300株
ヤクルト本社	85,800	5,370.00	460,746,000	貸付有価証券 38,100株(30,200株)
明治ホールディングス	94,800	9,170.00	869,316,000	貸付有価証券 11,000株

雪印メグミルク	34,500	3,225.00	111,262,500	
プリマハム	101,000	408.00	41,208,000	
日本ハム	109,000	3,135.00	341,715,000	貸付有価証券 5,000株
林兼産業	5,100	860.00	4,386,000	
丸大食品	76,000	491.00	37,316,000	
S Foods	8,600	2,953.00	25,395,800	貸付有価証券 4,000株（2,600株）
伊藤ハム米久ホールディングス	92,300	1,082.00	99,868,600	貸付有価証券 5,500株
サッポロホールディングス	52,400	3,050.00	159,820,000	貸付有価証券 19,900株
アサヒグループホールディングス	300,100	3,721.00	1,116,672,100	
キリンホールディングス	688,800	1,948.00	1,341,782,400	
宝ホールディングス	115,800	1,047.00	121,242,600	貸付有価証券 2,200株
オエノンホールディングス	41,000	272.00	11,152,000	
養命酒製造	4,900	1,860.00	9,114,000	
コカ・コーラウエスト	54,200	3,460.00	187,532,000	貸付有価証券 21,200株
コカ・コーライースト ジャパン	62,300	2,575.00	160,422,500	貸付有価証券 29,200株
サントリー食品インター ナショナル	109,600	4,915.00	538,684,000	
ダイドードリンコ	7,300	5,880.00	42,924,000	貸付有価証券 200株（200株）
伊藤園	47,500	3,805.00	180,737,500	貸付有価証券 18,100株（8,000株）
キーコーヒー	14,100	2,169.00	30,582,900	貸付有価証券 400株
ユニカフェ	4,300	1,034.00	4,446,200	貸付有価証券 2,000株
ジャパンフーズ	2,000	1,229.00	2,458,000	貸付有価証券 900株
日清オイリオグループ	92,000	532.00	48,944,000	
不二製油グループ本社	42,700	2,285.00	97,569,500	貸付有価証券 2,300株
かどや製油	1,600	3,635.00	5,816,000	貸付有価証券 300株



J - オイルミルズ	7,400	3,840.00	28,416,000	
キッコーマン	112,000	3,765.00	421,680,000	
味の素	329,600	2,385.50	786,260,800	
キューピー	81,400	2,802.00	228,082,800	貸付有価証券 900株
ハウス食品グループ本社	59,200	2,438.00	144,329,600	
カゴメ	57,400	2,907.00	166,861,800	貸付有価証券 26,900株
焼津水産化学工業	7,500	1,080.00	8,100,000	
アリアケジャパン	13,100	6,160.00	80,696,000	貸付有価証券 2,100株
ピエトロ	1,900	1,605.00	3,049,500	貸付有価証券 700株
エバラ食品工業	3,800	2,044.00	7,767,200	
ニチレイ	78,700	2,411.00	189,745,700	
東洋水産	78,600	4,175.00	328,155,000	
イトアンド	1,800	2,146.00	3,862,800	貸付有価証券 600株
日清食品ホールディングス	62,500	6,050.00	378,125,000	貸付有価証券 8,700株
永谷園ホールディングス	15,000	1,354.00	20,310,000	
一正蒲鉾	5,600	1,132.00	6,339,200	貸付有価証券 1,600株
フジッコ	15,500	2,413.00	37,401,500	
ロック・フィールド	16,600	1,566.00	25,995,600	
日本たばこ産業	886,600	3,935.00	3,488,771,000	
ケンコーマヨネーズ	5,700	3,300.00	18,810,000	貸付有価証券 1,100株
わらべや日洋ホールディングス	9,400	2,471.00	23,227,400	
なとり	8,000	1,842.00	14,736,000	
北の達人コーポレーション	3,400	479.00	1,628,600	
ユーグレナ	51,400	1,270.00	65,278,000	貸付有価証券 23,700株(2,700株)
ミヨシ油脂	55,000	145.00	7,975,000	
理研ビタミン	4,700	4,870.00	22,889,000	貸付有価証券 1,900株(100株)
片倉工業	18,700	1,435.00	26,834,500	貸付有価証券 800株

グンゼ	112,000	380.00	42,560,000	貸付有価証券 1,000株
東洋紡	592,000	172.00	101,824,000	貸付有価証券 269,000株
ユニチカ	410,000	83.00	34,030,000	
富士紡ホールディングス	7,300	3,275.00	23,907,500	
倉敷紡績	151,000	225.00	33,975,000	
シキボウ	81,000	142.00	11,502,000	
日本毛織	42,200	869.00	36,671,800	
ダイトウボウ	20,000	73.00	1,460,000	貸付有価証券 3,000株
トーア紡コーポレーション	6,300	578.00	3,641,400	貸付有価証券 100株（100株）
ダイドーリミテッド	16,700	404.00	6,746,800	貸付有価証券 100株
帝国繊維	15,600	1,630.00	25,428,000	
帝人	122,200	2,368.00	289,369,600	
東レ	1,085,000	978.40	1,061,564,000	貸付有価証券 121,000株
サカイオーベックス	3,600	1,768.00	6,364,800	
住江織物	37,000	258.00	9,546,000	貸付有価証券 9,000株（6,000株）
日本フェルト	8,600	513.00	4,411,800	
イチカワ	10,000	294.00	2,940,000	
日東製網	1,600	2,111.00	3,377,600	貸付有価証券 400株
アツギ	123,000	123.00	15,129,000	
ダイニック	28,000	175.00	4,900,000	
セーレン	37,200	1,447.00	53,828,400	
ソトー	5,600	1,131.00	6,333,600	
東海染工	21,000	142.00	2,982,000	
小松精練	21,000	752.00	15,792,000	貸付有価証券 700株
ワコールホールディングス	89,000	1,376.00	122,464,000	
ホギメディカル	9,400	7,030.00	66,082,000	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
レナウン	40,400	114.00	4,605,600	貸付有価証券 10,100株（7,000株）
クラウディア	3,400	521.00	1,771,400	貸付有価証券

				1,400株
T S Iホールディングス	61,600	709.00	43,674,400	貸付有価証券 12,800株
三陽商会	78,000	176.00	13,728,000	貸付有価証券 26,000株
ナイガイ	55,000	61.00	3,355,000	貸付有価証券 2,000株
オンワードホールディングス	97,000	815.00	79,055,000	貸付有価証券 20,000株(2,000株)
ルック	27,000	173.00	4,671,000	貸付有価証券 12,000株(7,000株)
キムラタン	631,000	7.00	4,417,000	貸付有価証券 63,000株
ゴールドウイン	6,300	5,280.00	33,264,000	貸付有価証券 200株
デサント	34,100	1,330.00	45,353,000	貸付有価証券 200株
キング	7,400	397.00	2,937,800	
ヤマトインターナショナル	9,200	402.00	3,698,400	貸付有価証券 3,300株
特種東海製紙	8,700	3,955.00	34,408,500	
王子ホールディングス	585,000	488.00	285,480,000	
日本製紙	67,000	2,010.00	134,670,000	貸付有価証券 13,700株(1,700株)
三菱製紙	21,300	755.00	16,081,500	貸付有価証券 400株
北越紀州製紙	83,500	685.00	57,197,500	貸付有価証券 6,300株
中越パルプ工業	59,000	239.00	14,101,000	貸付有価証券 21,000株(19,000株)
巴川製紙所	23,000	227.00	5,221,000	貸付有価証券 2,000株
大王製紙	59,600	1,276.00	76,049,600	貸付有価証券 28,000株(8,000株)
阿波製紙	2,700	607.00	1,638,900	
レンゴー	144,200	668.00	96,325,600	
トーモク	47,000	327.00	15,369,000	
ザ・パック	10,600	2,689.00	28,503,400	貸付有価証券 4,900株
クラレ	251,700	1,757.00	442,236,900	
旭化成	933,000	1,038.00	968,454,000	貸付有価証券

				41,000株
共和レザー	8,700	842.00	7,325,400	
昭和電工	99,500	1,739.00	173,030,500	
住友化学	1,101,000	573.00	630,873,000	
日本化成	28,000	162.00	4,536,000	
住友精化	6,200	4,615.00	28,613,000	
日産化学工業	81,900	3,930.00	321,867,000	
ラサ工業	56,000	135.00	7,560,000	
クレハ	11,300	4,405.00	49,776,500	貸付有価証券 100株(100株)
多木化学	10,000	870.00	8,700,000	貸付有価証券 4,000株
テイカ	23,000	641.00	14,743,000	
石原産業	26,900	946.00	25,447,400	貸付有価証券 1,100株
片倉コープアグリ	20,000	227.00	4,540,000	
日東エフシー	8,700	917.00	7,977,900	貸付有価証券 800株
日本曹達	90,000	552.00	49,680,000	貸付有価証券 9,000株
東ソー	432,000	836.00	361,152,000	
トクヤマ	233,000	454.00	105,782,000	
セントラル硝子	152,000	551.00	83,752,000	
東亜合成	93,600	1,175.00	109,980,000	
大阪ソーダ	64,000	476.00	30,464,000	貸付有価証券 9,000株(5,000株)
関東電化工業	31,000	1,047.00	32,457,000	貸付有価証券 14,000株
デンカ	310,000	519.00	160,890,000	貸付有価証券 21,000株
信越化学工業	268,200	9,281.00	2,489,164,200	貸付有価証券 13,500株
日本カーバイド工業	51,000	152.00	7,752,000	
堺化学工業	56,000	389.00	21,784,000	
エア・ウォーター	123,300	2,129.00	262,505,700	貸付有価証券 48,500株
大陽日酸	115,200	1,399.00	161,164,800	貸付有価証券 46,100株
日本化学工業	55,000	241.00	13,255,000	
日本パーカライジング	76,400	1,378.00	105,279,200	

高圧ガス工業	22,200	762.00	16,916,400	
チタン工業	17,000	191.00	3,247,000	
四国化成工業	22,000	1,053.00	23,166,000	
戸田工業	30,000	281.00	8,430,000	貸付有価証券 1,000株
ステラ ケミファ	7,100	3,285.00	23,323,500	貸付有価証券 2,800株
保土谷化学工業	5,200	2,716.00	14,123,200	貸付有価証券 200株
日本触媒	23,500	7,440.00	174,840,000	貸付有価証券 9,000株
大日精化工業	62,000	632.00	39,184,000	
カネカ	202,000	976.00	197,152,000	
三菱瓦斯化学	139,300	1,992.00	277,485,600	
三井化学	680,000	531.00	361,080,000	
J S R	150,300	1,859.00	279,407,700	
東京応化工業	28,000	3,955.00	110,740,000	貸付有価証券 12,900株
大阪有機化学工業	9,700	958.00	9,292,600	
三菱ケミカルホールディングス	1,001,600	774.80	776,039,680	
K Hネオケム	18,300	1,294.00	23,680,200	
ダイセル	201,700	1,314.00	265,033,800	
住友ベークライト	132,000	668.00	88,176,000	
積水化学工業	339,500	1,833.00	622,303,500	
日本ゼオン	126,000	1,148.00	144,648,000	
アイカ工業	47,900	3,095.00	148,250,500	
宇部興産	753,000	248.00	186,744,000	貸付有価証券 1,000株
積水樹脂	23,100	1,837.00	42,434,700	
タキロン	31,000	524.00	16,244,000	
旭有機材	48,000	220.00	10,560,000	
日立化成	83,100	2,905.00	241,405,500	
ニチバン	15,000	835.00	12,525,000	
リケンテクノス	32,200	533.00	17,162,600	貸付有価証券 3,500株（700株）
大倉工業	36,000	506.00	18,216,000	貸付有価証券 16,000株
積水化成成品工業	21,300	813.00	17,316,900	

群栄化学工業	3,600	3,255.00	11,718,000	
タイガースポリマー	7,400	794.00	5,875,600	
ミライアル	5,400	947.00	5,113,800	
ダイキアクシス	2,500	1,166.00	2,915,000	
ダイキョーニシカワ	26,200	1,443.00	37,806,600	貸付有価証券 9,000株
日本化薬	97,000	1,445.00	140,165,000	貸付有価証券 1,000株
カーリットホールディングス	13,900	552.00	7,672,800	
日本精化	12,400	908.00	11,259,200	貸付有価証券 100株（100株）
扶桑化学工業	10,600	2,499.00	26,489,400	
A D E K A	64,300	1,586.00	101,979,800	
日油	120,000	1,121.00	134,520,000	
新日本理化	23,600	156.00	3,681,600	貸付有価証券 6,800株（6,800株）
ハリマ化成グループ	12,700	750.00	9,525,000	
花王	379,800	5,626.00	2,136,754,800	
第一工業製薬	33,000	378.00	12,474,000	貸付有価証券 9,000株
ニイタカ	2,200	1,443.00	3,174,600	
三洋化成工業	9,400	5,040.00	47,376,000	
有機合成薬品工業	9,700	249.00	2,415,300	貸付有価証券 100株
大日本塗料	86,000	246.00	21,156,000	
日本ペイントホールディングス	115,400	3,175.00	366,395,000	貸付有価証券 2,300株
関西ペイント	157,100	2,154.00	338,393,400	貸付有価証券 65,000株（9,900株）
神東塗料	11,000	223.00	2,453,000	貸付有価証券 5,000株
中国塗料	42,900	866.00	37,151,400	
日本特殊塗料	10,500	1,730.00	18,165,000	
藤倉化成	20,300	670.00	13,601,000	
太陽ホールディングス	12,200	4,585.00	55,937,000	
D I C	59,100	3,655.00	216,010,500	
サカティンクス	30,500	1,446.00	44,103,000	貸付有価証券 12,300株

東洋インキ S C ホールディングス	148,000	537.00	79,476,000	
T & K T O K A	10,800	1,009.00	10,897,200	
富士フイルムホールディングス	296,600	4,504.00	1,335,886,400	
資生堂	283,700	2,999.00	850,816,300	貸付有価証券 44,200株
ライオン	186,000	1,902.00	353,772,000	貸付有価証券 63,000株
高砂香料工業	9,800	3,145.00	30,821,000	
マンダム	15,000	5,040.00	75,600,000	
ミルボン	8,100	4,395.00	35,599,500	貸付有価証券 3,700株
ファンケル	31,800	1,639.00	52,120,200	貸付有価証券 1,000株
コーセー	24,200	9,810.00	237,402,000	
コタ	5,600	1,286.00	7,201,600	
シーズ・ホールディングス	19,400	3,310.00	64,214,000	
シーボン	1,700	2,374.00	4,035,800	貸付有価証券 700株
ポーラ・オルビスホールディングス	15,200	9,760.00	148,352,000	貸付有価証券 7,100株
ノエビアホールディングス	9,400	3,770.00	35,438,000	貸付有価証券 100株（100株）
アジupan コスメジャパン	2,800	921.00	2,578,800	
エステー	10,200	1,481.00	15,106,200	
アグロ カネショウ	5,800	1,178.00	6,832,400	貸付有価証券 2,700株
コニシ	23,500	1,267.00	29,774,500	
長谷川香料	18,900	1,988.00	37,573,200	
星光 P M C	8,200	1,177.00	9,651,400	貸付有価証券 2,700株（100株）
小林製薬	41,500	5,120.00	212,480,000	
荒川化学工業	12,800	1,798.00	23,014,400	
メック	11,600	933.00	10,822,800	貸付有価証券 3,100株（2,500株）
日本高純度化学	4,200	2,444.00	10,264,800	貸付有価証券 1,900株
タカラバイオ	32,000	1,425.00	45,600,000	貸付有価証券

				15,000株(5,800株)
J C U	4,700	5,590.00	26,273,000	
新田ゼラチン	9,000	721.00	6,489,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
O A T アグリオ	1,700	1,375.00	2,337,500	
デクセリアルズ	39,100	1,144.00	44,730,400	貸付有価証券 100株(100株)
アース製薬	10,700	4,950.00	52,965,000	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
イハラケミカル工業	20,700	1,131.00	23,411,700	貸付有価証券 600株
北興化学工業	15,000	458.00	6,870,000	貸付有価証券 4,000株(1,000株)
大成ラミック	4,200	3,135.00	13,167,000	
クミアイ化学工業	30,800	711.00	21,898,800	貸付有価証券 14,400株(10,800株)
日本農薬	34,100	637.00	21,721,700	貸付有価証券 14,200株(500株)
アキレス	12,200	1,589.00	19,385,800	
有沢製作所	25,300	645.00	16,318,500	
日東電工	107,800	9,096.00	980,548,800	貸付有価証券 3,600株
レック	4,700	3,170.00	14,899,000	貸付有価証券 2,200株
きもと	26,700	249.00	6,648,300	貸付有価証券 3,300株
藤森工業	11,100	2,935.00	32,578,500	
前澤化成工業	9,800	1,179.00	11,554,200	
J S P	7,000	2,749.00	19,243,000	
エフピコ	13,300	5,370.00	71,421,000	貸付有価証券 6,200株(2,000株)
天馬	9,900	2,019.00	19,988,100	
信越ポリマー	29,300	905.00	26,516,500	
東リ	35,600	368.00	13,100,800	
ニフコ	26,200	6,160.00	161,392,000	貸付有価証券 4,300株
日本バルカー工業	11,600	1,549.00	17,968,400	
ユニ・チャーム	302,700	2,569.00	777,636,300	貸付有価証券 48,700株(48,700株)
協和発酵キリン	178,900	1,632.00	291,964,800	



武田薬品工業	560,600	4,855.00	2,721,713,000	貸付有価証券 22,600株
アステラス製薬	1,527,600	1,634.00	2,496,098,400	貸付有価証券 68,500株
大日本住友製薬	105,800	1,989.00	210,436,200	貸付有価証券 49,300株(200株)
塩野義製薬	202,400	5,551.00	1,123,522,400	貸付有価証券 11,000株
田辺三菱製薬	174,200	2,291.00	399,092,200	
わかもと製薬	17,000	241.00	4,097,000	
あすか製薬	16,300	1,662.00	27,090,600	貸付有価証券 400株
日本新薬	34,300	5,700.00	195,510,000	
バイオフェルミン製薬	2,400	2,918.00	7,003,200	
中外製薬	148,900	3,460.00	515,194,000	
科研製薬	27,900	6,180.00	172,422,000	
エーザイ	184,100	6,777.00	1,247,645,700	貸付有価証券 14,200株
ロート製薬	73,200	1,845.00	135,054,000	貸付有価証券 34,400株(2,700株)
小野薬品工業	339,600	2,453.00	833,038,800	
久光製薬	42,200	5,730.00	241,806,000	貸付有価証券 19,400株
持田製薬	10,200	8,070.00	82,314,000	
参天製薬	275,500	1,419.00	390,934,500	貸付有価証券 15,200株
扶桑薬品工業	5,000	2,750.00	13,750,000	
日本ケミファ	2,100	5,490.00	11,529,000	
ツムラ	50,200	3,280.00	164,656,000	貸付有価証券 13,500株
日医工	35,000	1,683.00	58,905,000	貸付有価証券 16,400株
キッセイ薬品工業	26,500	2,851.00	75,551,500	貸付有価証券 700株
生化学工業	27,700	1,689.00	46,785,300	貸付有価証券 1,300株
栄研化学	12,500	3,045.00	38,062,500	
日水製薬	6,000	1,293.00	7,758,000	
鳥居薬品	10,200	2,591.00	26,428,200	貸付有価証券 100株

J C R ファーマ	11,500	2,629.00	30,233,500	貸付有価証券 900株
東和薬品	6,900	4,630.00	31,947,000	貸付有価証券 100株
富士製薬工業	4,800	2,658.00	12,758,400	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	25,400	6,280.00	159,512,000	貸付有価証券 6,500株
ゼリア新薬工業	30,600	1,780.00	54,468,000	
第一三共	440,000	2,390.00	1,051,600,000	
キョーリン製薬ホールディングス	36,500	2,463.00	89,899,500	
大幸薬品	7,400	1,799.00	13,312,600	貸付有価証券 3,300株
ダイト	8,300	2,259.00	18,749,700	
大塚ホールディングス	321,500	5,080.00	1,633,220,000	
大正製薬ホールディングス	32,000	9,720.00	311,040,000	
ペプチドリーム	25,400	5,580.00	141,732,000	貸付有価証券 12,000株(100株)
日本コークス工業	120,600	112.00	13,507,200	
昭和シェル石油	133,600	1,127.00	150,567,200	
ニチレキ	18,300	914.00	16,726,200	
東燃ゼネラル石油	243,000	1,256.00	305,208,000	
ユシロ化学工業	8,000	1,443.00	11,544,000	
ビーピー・カストロール	6,100	1,531.00	9,339,100	貸付有価証券 200株
富士石油	34,700	395.00	13,706,500	
MORESCO	5,100	1,535.00	7,828,500	貸付有価証券 200株
出光興産	70,900	3,085.00	218,726,500	貸付有価証券 31,500株
J Xホールディングス	1,659,400	496.30	823,560,220	
コスモエネルギーホールディングス	45,100	1,665.00	75,091,500	貸付有価証券 3,000株
横浜ゴム	90,200	2,140.00	193,028,000	貸付有価証券 5,100株
東洋ゴム工業	78,900	1,496.00	118,034,400	貸付有価証券 2,400株
ブリヂストン	504,600	4,368.00	2,204,092,800	貸付有価証券

				35,100株
住友ゴム工業	139,900	1,894.00	264,970,600	貸付有価証券 2,000株
藤倉ゴム工業	12,500	676.00	8,450,000	貸付有価証券 5,800株(5,800株)
オカモト	45,000	1,063.00	47,835,000	貸付有価証券 12,000株
フコク	6,200	920.00	5,704,000	
ニッタ	13,400	3,150.00	42,210,000	
住友理工	27,700	1,123.00	31,107,100	貸付有価証券 200株
三ツ星ベルト	36,000	980.00	35,280,000	
バンドー化学	27,200	1,026.00	27,907,200	
日東紡績	121,000	450.00	54,450,000	
旭硝子	736,000	814.00	599,104,000	
日本板硝子	68,100	867.00	59,042,700	貸付有価証券 5,200株(2,000株)
石塚硝子	21,000	197.00	4,137,000	
日本山村硝子	59,000	205.00	12,095,000	
日本電気硝子	309,000	641.00	198,069,000	
オハラ	5,600	813.00	4,552,800	貸付有価証券 2,600株(800株)
住友大阪セメント	278,000	446.00	123,988,000	貸付有価証券 5,000株
太平洋セメント	902,000	375.00	338,250,000	
日本ヒューム	14,300	714.00	10,210,200	
日本コンクリート工業	33,300	349.00	11,621,700	貸付有価証券 6,900株
三谷セキサン	7,500	3,005.00	22,537,500	
アジアパイルホールディ ングス	18,400	529.00	9,733,600	貸付有価証券 1,300株
東海カーボン	140,000	384.00	53,760,000	
日本カーボン	73,000	236.00	17,228,000	貸付有価証券 34,000株(7,000株)
東洋炭素	8,300	1,856.00	15,404,800	貸付有価証券 1,300株
ノリタケカンパニーリミ テド	8,400	2,759.00	23,175,600	
TOTO	109,800	4,615.00	506,727,000	貸付有価証券 6,400株

日本碍子	188,800	2,312.00	436,505,600	貸付有価証券 300株
日本特殊陶業	128,800	2,631.00	338,872,800	貸付有価証券 31,500株
ダントーホールディングス	12,000	190.00	2,280,000	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
MARUWA	5,500	3,870.00	21,285,000	
品川リフラクトリーズ	38,000	239.00	9,082,000	
黒崎播磨	32,000	307.00	9,824,000	
ヨータイ	9,000	341.00	3,069,000	貸付有価証券 1,000株
イソライト工業	7,300	276.00	2,014,800	
東京窯業	18,100	188.00	3,402,800	
ニッカトー	4,800	411.00	1,972,800	
フジインコーポレーテッド	12,700	2,186.00	27,762,200	貸付有価証券 5,100株
エーアンドエーマテリアル	31,000	127.00	3,937,000	
ニチアス	78,000	1,104.00	86,112,000	
ニチハ	19,900	2,800.00	55,720,000	貸付有価証券 1,600株
新日鐵住金	674,000	2,665.50	1,796,547,000	貸付有価証券 19,000株
神戸製鋼所	258,400	1,155.00	298,452,000	貸付有価証券 117,400株（7,700株）
中山製鋼所	16,800	721.00	12,112,800	貸付有価証券 1,000株
合同製鐵	8,400	2,125.00	17,850,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	408,600	1,822.50	744,673,500	貸付有価証券 88,900株
日新製鋼	68,200	1,424.00	97,116,800	貸付有価証券 32,200株（32,200株）
東京製鐵	75,600	898.00	67,888,800	貸付有価証券 1,100株
共英製鋼	15,900	2,182.00	34,693,800	貸付有価証券 1,600株
大和工業	30,000	3,270.00	98,100,000	
東京鐵鋼	31,000	475.00	14,725,000	
大阪製鐵	9,400	2,118.00	19,909,200	
淀川製鋼所	20,700	3,045.00	63,031,500	貸付有価証券

				100株
東洋鋼鈹	35,700	362.00	12,923,400	
丸一鋼管	50,000	3,785.00	189,250,000	貸付有価証券 3,000株
モリ工業	4,800	1,967.00	9,441,600	
大同特殊鋼	250,000	487.00	121,750,000	貸付有価証券 9,000株
日本高周波鋼業	52,000	87.00	4,524,000	
日本冶金工業	123,700	192.00	23,750,400	貸付有価証券 200株(200株)
山陽特殊製鋼	89,000	556.00	49,484,000	
愛知製鋼	8,800	4,945.00	43,516,000	貸付有価証券 200株
日立金属	152,100	1,551.00	235,907,100	貸付有価証券 60,900株
日本金属	3,600	1,276.00	4,593,600	貸付有価証券 1,600株
大平洋金属	95,000	378.00	35,910,000	貸付有価証券 43,000株(10,000株)
新日本電工	84,600	247.00	20,896,200	
栗本鐵工所	7,100	2,289.00	16,251,900	
虹技	21,000	262.00	5,502,000	
日本鑄鉄管	15,000	193.00	2,895,000	
三菱製鋼	104,000	230.00	23,920,000	
日亜鋼業	20,600	279.00	5,747,400	
日本精線	10,000	559.00	5,590,000	貸付有価証券 1,000株
シンニッタン	12,200	668.00	8,149,600	貸付有価証券 500株(100株)
新家工業	32,000	159.00	5,088,000	
大紀アルミニウム工業所	25,000	515.00	12,875,000	
日本軽金属ホールディング グス	338,300	248.00	83,898,400	貸付有価証券 159,700株(1,200株)
三井金属鉱業	406,000	295.00	119,770,000	
東邦亜鉛	84,000	458.00	38,472,000	貸付有価証券 1,000株
三菱マテリアル	93,300	3,630.00	338,679,000	
住友金属鉱山	387,000	1,512.50	585,337,500	
DOWAホールディング グス	165,000	901.00	148,665,000	貸付有価証券 5,000株

古河機械金属	233,000	215.00	50,095,000	貸付有価証券 1,000株
大阪チタニウムテクノロ ジーズ	16,300	1,623.00	26,454,900	貸付有価証券 7,700株
東邦チタニウム	25,300	783.00	19,809,900	貸付有価証券 11,800株
U A C J	190,000	320.00	60,800,000	貸付有価証券 40,000株(1,000株)
古河電気工業	50,100	3,355.00	168,085,500	
住友電気工業	563,100	1,693.00	953,328,300	
フジクラ	196,700	637.00	125,297,900	
昭和電線ホールディング ス	178,000	88.00	15,664,000	貸付有価証券 23,000株(1,000株)
東京特殊電線	2,100	1,285.00	2,698,500	
タツタ電線	28,000	457.00	12,796,000	
沖電線	16,000	234.00	3,744,000	貸付有価証券 5,000株(1,000株)
カナレ電気	2,100	2,116.00	4,443,600	貸付有価証券 900株
平河ヒューテック	7,000	1,200.00	8,400,000	
リョービ	91,000	466.00	42,406,000	
アーレスティ	17,300	1,302.00	22,524,600	貸付有価証券 3,100株
アサヒホールディングス	22,500	2,029.00	45,652,500	
稲葉製作所	7,900	1,336.00	10,554,400	貸付有価証券 3,600株
宮地エンジニアリンググ ループ	43,000	193.00	8,299,000	貸付有価証券 4,000株
トーカロ	9,800	2,598.00	25,460,400	貸付有価証券 300株
アルファC o	5,000	1,110.00	5,550,000	
S U M C O	156,000	1,557.00	242,892,000	貸付有価証券 68,000株(15,500株)
川田テクノロジーズ	2,800	6,880.00	19,264,000	貸付有価証券 900株
R S T e c h n o l o g i e s	500	4,265.00	2,132,500	貸付有価証券 200株
東洋製罐グループホール ディングス	106,200	2,200.00	233,640,000	
ホッカンホールディング ス	39,000	458.00	17,862,000	

コロナ	7,800	1,165.00	9,087,000	
横河ブリッジホールディングス	26,300	1,362.00	35,820,600	貸付有価証券 3,600株
駒井ハルテック	2,900	2,123.00	6,156,700	
高田機工	13,000	229.00	2,977,000	
三和ホールディングス	148,300	1,114.00	165,206,200	
文化シャッター	41,600	915.00	38,064,000	貸付有価証券 4,900株
三協立山	19,600	1,626.00	31,869,600	貸付有価証券 9,200株
アルインコ	10,300	1,045.00	10,763,500	
東洋シャッター	3,700	612.00	2,264,400	
L I X I Lグループ	208,200	2,700.00	562,140,000	貸付有価証券 9,800株
日本ファイルコン	10,800	576.00	6,220,800	貸付有価証券 300株（300株）
ノーリツ	29,300	2,039.00	59,742,700	貸付有価証券 600株
長府製作所	15,900	2,719.00	43,232,100	貸付有価証券 900株
リンナイ	25,500	9,480.00	241,740,000	貸付有価証券 2,600株（1,500株）
ダイニチ工業	7,600	716.00	5,441,600	貸付有価証券 100株
日東精工	21,000	422.00	8,862,000	
三洋工業	19,000	198.00	3,762,000	
岡部	31,000	988.00	30,628,000	貸付有価証券 14,500株
ジーテクト	15,600	2,339.00	36,488,400	貸付有価証券 100株（100株）
中国工業	2,100	703.00	1,476,300	貸付有価証券 900株
東プレ	28,700	2,940.00	84,378,000	貸付有価証券 11,900株（8,400株）
高周波熱錬	27,800	898.00	24,964,400	
東京製網	10,100	1,952.00	19,715,200	貸付有価証券 400株
サンコール	7,900	542.00	4,281,800	
モリテック スチール	7,500	282.00	2,115,000	
パイオラックス	7,500	7,370.00	55,275,000	

日本発條	140,700	1,120.00	157,584,000	
中央発條	17,000	320.00	5,440,000	
アドバネクス	2,600	1,705.00	4,433,000	
立川ブラインド工業	6,200	880.00	5,456,000	貸付有価証券 2,900株
三益半導体工業	11,000	1,661.00	18,271,000	
日本ドライケミカル	1,900	2,351.00	4,466,900	
日本製鋼所	49,400	2,068.00	102,159,200	貸付有価証券 200株
三浦工業	61,100	1,801.00	110,041,100	
タクマ	48,000	966.00	46,368,000	
ツガミ	40,000	681.00	27,240,000	
オークマ	97,000	1,133.00	109,901,000	貸付有価証券 9,000株（4,000株）
東芝機械	89,000	472.00	42,008,000	
アマダホールディングス	201,100	1,299.00	261,228,900	貸付有価証券 100株
アイダエンジニアリング	42,400	1,117.00	47,360,800	貸付有価証券 9,300株
滝澤鉄工所	44,000	159.00	6,996,000	
富士機械製造	45,500	1,343.00	61,106,500	貸付有価証券 12,400株（6,200株）
牧野フライス製作所	74,000	917.00	67,858,000	貸付有価証券 28,000株（28,000株）
オーエスジー	68,100	2,296.00	156,357,600	貸付有価証券 30,900株（28,300株）
ダイジェット工業	17,000	167.00	2,839,000	
旭ダイヤモンド工業	42,700	844.00	36,038,800	貸付有価証券 7,500株
D M G 森精機	88,400	1,476.00	130,478,400	貸付有価証券 9,800株（9,800株）
ソディック	37,900	978.00	37,066,200	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
ディスコ	17,500	13,970.00	244,475,000	
日東工器	8,700	2,546.00	22,150,200	
パンチ工業	5,400	914.00	4,935,600	
豊和工業	8,300	603.00	5,004,900	貸付有価証券 3,900株
O K K	54,000	117.00	6,318,000	貸付有価証券 3,000株



東洋機械金属	10,100	450.00	4,545,000	
津田駒工業	33,000	167.00	5,511,000	貸付有価証券 6,000株
エンシュウ	37,000	99.00	3,663,000	貸付有価証券 17,000株(14,000株)
島精機製作所	19,500	3,880.00	75,660,000	貸付有価証券 5,400株(200株)
N C ホールディングス	4,800	902.00	4,329,600	貸付有価証券 800株(800株)
フリー	2,900	3,175.00	9,207,500	
ヤマシンフィルタ	2,900	1,093.00	3,169,700	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
日阪製作所	20,300	880.00	17,864,000	
やまびこ	27,400	1,548.00	42,415,200	
ペガサスマシン製造	14,300	694.00	9,924,200	貸付有価証券 400株(400株)
ナプテスコ	77,700	2,741.00	212,975,700	
三井海洋開発	15,000	1,900.00	28,500,000	貸付有価証券 5,000株
レオン自動機	12,600	880.00	11,088,000	貸付有価証券 1,100株
S M C	44,800	28,145.00	1,260,896,000	貸付有価証券 21,000株(12,100株)
新川	12,400	754.00	9,349,600	貸付有価証券 200株(200株)
ホソカワミクロン	25,000	765.00	19,125,000	
ユニオンツール	6,500	3,090.00	20,085,000	貸付有価証券 200株(100株)
オイレス工業	19,300	2,112.00	40,761,600	貸付有価証券 700株
日精エー・エス・ビー機 械	4,800	2,429.00	11,659,200	貸付有価証券 1,100株
サトーホールディングス	18,600	2,440.00	45,384,000	貸付有価証券 400株
日本エアーテック	4,800	654.00	3,139,200	
日精樹脂工業	11,800	999.00	11,788,200	貸付有価証券 400株
オカダアイヨン	3,100	1,030.00	3,193,000	
ワイエイシイ	5,600	1,204.00	6,742,400	貸付有価証券 2,500株
小松製作所	689,400	2,707.50	1,866,550,500	貸付有価証券

				86,100株
住友重機械工業	436,000	757.00	330,052,000	
日立建機	66,800	2,604.00	173,947,200	貸付有価証券 8,000株(2,600株)
日工	4,500	2,098.00	9,441,000	
巴工業	6,100	1,591.00	9,705,100	
井関農機	153,000	227.00	34,731,000	貸付有価証券 12,000株(2,000株)
TOWA	12,200	1,560.00	19,032,000	貸付有価証券 5,300株
丸山製作所	31,000	189.00	5,859,000	
北川鉄工所	6,800	2,309.00	15,701,200	
ローツェ	5,300	1,664.00	8,819,200	貸付有価証券 2,400株(600株)
タカキタ	5,000	552.00	2,760,000	
クボタ	717,400	1,680.50	1,205,590,700	貸付有価証券 30,500株
荏原実業	4,200	1,366.00	5,737,200	
三菱化工機	49,000	212.00	10,388,000	貸付有価証券 12,000株
月島機械	28,300	1,257.00	35,573,100	貸付有価証券 1,200株(1,100株)
帝国電機製作所	10,900	959.00	10,453,100	貸付有価証券 600株
東京機械製作所	56,000	74.00	4,144,000	貸付有価証券 4,000株
新東工業	33,900	1,017.00	34,476,300	
澁谷工業	12,500	2,570.00	32,125,000	貸付有価証券 800株(500株)
アイチ コーポレーシ ョン	21,100	826.00	17,428,600	
小森コーポレーション	35,900	1,510.00	54,209,000	貸付有価証券 2,900株
鶴見製作所	11,100	1,687.00	18,725,700	
住友精密工業	24,000	361.00	8,664,000	
酒井重工業	28,000	319.00	8,932,000	貸付有価証券 3,000株
荏原製作所	62,000	3,300.00	204,600,000	
石井鐵工所	2,200	1,749.00	3,847,800	
西島製作所	14,600	1,132.00	16,527,200	

北越工業	16,000	806.00	12,896,000	
ダイキン工業	194,900	10,745.00	2,094,200,500	貸付有価証券 12,600株
オルガノ	28,000	454.00	12,712,000	
トーヨーカネツ	69,000	315.00	21,735,000	
栗田工業	84,500	2,507.00	211,841,500	
椿本チエイン	85,000	952.00	80,920,000	
大同工業	29,000	246.00	7,134,000	
木村化工機	12,800	338.00	4,326,400	貸付有価証券 500株(100株)
アネスト岩田	25,900	1,127.00	29,189,300	貸付有価証券 2,700株
ダイフク	71,200	2,327.00	165,682,400	貸付有価証券 12,800株
サムコ	3,600	1,005.00	3,618,000	貸付有価証券 500株
加藤製作所	7,800	3,050.00	23,790,000	貸付有価証券 3,700株
油研工業	28,000	216.00	6,048,000	
タダノ	74,600	1,497.00	111,676,200	貸付有価証券 3,900株
フジテック	41,600	1,349.00	56,118,400	貸付有価証券 8,000株(2,600株)
C K D	42,800	1,355.00	57,994,000	
キトー	18,000	1,263.00	22,734,000	
平和	44,200	2,667.00	117,881,400	
理想科学工業	14,200	1,972.00	28,002,400	貸付有価証券 100株
S A N K Y O	39,700	3,820.00	151,654,000	
日本金銭機械	13,100	1,457.00	19,086,700	貸付有価証券 6,300株(2,700株)
マースエンジニアリング	8,100	2,230.00	18,063,000	
福島工業	8,800	3,365.00	29,612,000	
オーイズミ	6,000	710.00	4,260,000	貸付有価証券 2,900株(200株)
ダイコク電機	5,900	1,792.00	10,572,800	貸付有価証券 900株(100株)
竹内製作所	26,100	2,589.00	67,572,900	
アマノ	44,200	2,057.00	90,919,400	
J U K I	22,500	1,094.00	24,615,000	貸付有価証券

				100株
サンデンホールディングス	87,000	365.00	31,755,000	
蛇の目ミシン工業	13,800	815.00	11,247,000	貸付有価証券 1,400株
マックス	22,000	1,407.00	30,954,000	
グローリー	45,600	3,675.00	167,580,000	
新晃工業	10,000	1,353.00	13,530,000	
大和冷機工業	22,900	902.00	20,655,800	
セガサミーホールディングス	141,600	1,728.00	244,684,800	
日本ピストンリング	5,600	2,071.00	11,597,600	
リケン	6,600	4,390.00	28,974,000	
T P R	16,000	3,375.00	54,000,000	貸付有価証券 300株
ツバキ・ナカシマ	15,900	1,791.00	28,476,900	貸付有価証券 100株
ホシザキ	31,300	9,060.00	283,578,000	貸付有価証券 3,700株
大豊工業	11,500	1,625.00	18,687,500	
日本精工	293,200	1,353.00	396,699,600	
N T N	330,000	487.00	160,710,000	
ジェイテクト	152,200	1,916.00	291,615,200	
不二越	144,000	510.00	73,440,000	貸付有価証券 68,000株
日本トムソン	45,600	500.00	22,800,000	
T H K	100,900	2,610.00	263,349,000	貸付有価証券 1,400株
ユースン精機	6,300	2,648.00	16,682,400	貸付有価証券 2,900株
前澤給装工業	5,400	1,513.00	8,170,200	
イーグル工業	15,400	1,535.00	23,639,000	
前澤工業	10,400	366.00	3,806,400	
日本ピラー工業	14,400	1,228.00	17,683,200	
キッツ	68,500	659.00	45,141,500	
日立工機	38,200	1,253.00	47,864,600	貸付有価証券 6,300株
マキタ	93,100	7,900.00	735,490,000	
日立造船	113,200	610.00	69,052,000	貸付有価証券

				300株
三菱重工業	2,393,000	541.20	1,295,091,600	貸付有価証券 63,000株
I H I	1,097,000	312.00	342,264,000	貸付有価証券 476,000株
スター精密	25,000	1,612.00	40,300,000	貸付有価証券 11,200株(3,400株)
日清紡ホールディングス	79,300	1,149.00	91,115,700	
イビデン	99,900	1,607.00	160,539,300	貸付有価証券 30,700株(30,700株)
コニカミノルタ	334,200	1,159.00	387,337,800	
ブラザー工業	184,500	2,088.00	385,236,000	
ミネベア	230,000	1,159.00	266,570,000	貸付有価証券 3,100株
日立製作所	3,428,000	639.00	2,190,492,000	
東芝	3,193,000	443.10	1,414,818,300	貸付有価証券 107,000株
三菱電機	1,522,900	1,632.00	2,485,372,800	
富士電機	430,000	599.00	257,570,000	
東洋電機製造	5,600	1,586.00	8,881,600	貸付有価証券 1,700株
安川電機	165,500	1,836.00	303,858,000	貸付有価証券 11,500株(2,600株)
シンフォニアテクノロジー	92,000	270.00	24,840,000	貸付有価証券 42,000株(42,000株)
明電舎	131,000	397.00	52,007,000	
オリジン電気	21,000	312.00	6,552,000	
山洋電気	37,000	810.00	29,970,000	
デンヨー	13,200	1,607.00	21,212,400	
東芝テック	89,000	552.00	49,128,000	貸付有価証券 8,000株(8,000株)
芝浦メカトロニクス	23,000	256.00	5,888,000	貸付有価証券 4,000株
マブチモーター	40,300	6,190.00	249,457,000	
日本電産	185,000	10,140.00	1,875,900,000	貸付有価証券 11,800株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,700	2,981.00	5,067,700	
東光高岳	7,200	2,030.00	14,616,000	
ダブル・スコープ	13,700	1,709.00	23,413,300	貸付有価証券

				6,400株(100株)
ダイヘン	78,000	721.00	56,238,000	貸付有価証券 2,000株
田淵電機	21,500	404.00	8,686,000	貸付有価証券 3,100株
ヤーマン	1,800	5,550.00	9,990,000	
JVCケンウッド	104,800	314.00	32,907,200	貸付有価証券 49,200株(200株)
ミマキエンジニアリング	12,800	667.00	8,537,600	貸付有価証券 3,000株
第一精工	6,700	1,352.00	9,058,400	貸付有価証券 900株
日新電機	28,700	1,223.00	35,100,100	
大崎電気工業	28,000	1,214.00	33,992,000	貸付有価証券 1,000株
オムロン	151,800	4,525.00	686,895,000	貸付有価証券 39,900株
日東工業	21,000	1,619.00	33,999,000	
I D E C	18,600	1,098.00	20,422,800	
不二電機工業	1,600	1,399.00	2,238,400	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	275,000	487.00	133,925,000	貸付有価証券 52,000株
サクサホールディングス	36,000	219.00	7,884,000	貸付有価証券 12,000株(12,000株)
メルコホールディングス	7,900	3,210.00	25,359,000	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
テクノメディカ	3,200	1,976.00	6,323,200	
日本電気	1,963,000	309.00	606,567,000	
富士通	1,376,000	662.60	911,737,600	
沖電気工業	61,900	1,658.00	102,630,200	貸付有価証券 16,100株
岩崎通信機	63,000	82.00	5,166,000	
電気興業	41,000	584.00	23,944,000	
サンケン電気	83,000	534.00	44,322,000	
ナカヨ	15,000	391.00	5,865,000	
アイホン	8,100	1,954.00	15,827,400	
ルネサスエレクトロニクス	73,900	959.00	70,870,100	貸付有価証券 35,000株
セイコーエプソン	212,600	2,436.00	517,893,600	

ワコム	110,700	307.00	33,984,900	貸付有価証券 41,500株
アルバック	26,300	3,455.00	90,866,500	
アクセル	6,000	992.00	5,952,000	貸付有価証券 800株
E I Z O	14,100	3,535.00	49,843,500	
ジャパンディスプレイ	266,600	321.00	85,578,600	貸付有価証券 105,300株(16,500 株)
日本信号	39,400	998.00	39,321,200	貸付有価証券 17,400株
京三製作所	33,000	391.00	12,903,000	
能美防災	16,200	1,729.00	28,009,800	
ホーチキ	10,300	1,405.00	14,471,500	
エレコム	12,400	2,009.00	24,911,600	貸付有価証券 3,800株
日本無線	8,700	1,422.00	12,371,400	貸付有価証券 800株
パナソニック	1,631,100	1,223.00	1,994,835,300	貸付有価証券 8,100株
アンリツ	104,100	632.00	65,791,200	
富士通ゼネラル	48,000	2,457.00	117,936,000	貸付有価証券 1,000株
日立国際電気	37,300	2,355.00	87,841,500	
ソニー	1,007,900	3,333.00	3,359,330,700	貸付有価証券 105,400株
T D K	80,400	8,210.00	660,084,000	貸付有価証券 4,200株
帝国通信工業	31,000	173.00	5,363,000	
ミツミ電機	50,400	681.00	34,322,400	貸付有価証券 8,400株
タムラ製作所	55,000	442.00	24,310,000	
アルプス電気	131,800	2,805.00	369,699,000	貸付有価証券 4,700株
池上通信機	45,000	152.00	6,840,000	貸付有価証券 14,000株
パイオニア	214,500	242.00	51,909,000	貸付有価証券 80,500株
日本電波工業	13,800	891.00	12,295,800	
鈴木	5,500	506.00	2,783,000	
日本トリム	3,500	4,450.00	15,575,000	貸付有価証券

				600株(600株)
ローランド ディー . ジー .	7,300	3,145.00	22,958,500	貸付有価証券 3,400株
フォスター電機	16,700	2,243.00	37,458,100	
クラリオン	75,000	405.00	30,375,000	
S M K	37,000	422.00	15,614,000	
ヨコオ	10,200	877.00	8,945,400	
ティアック	103,000	66.00	6,798,000	貸付有価証券 46,000株(1,000株)
ホシデン	43,300	932.00	40,355,600	
ヒロセ電機	23,100	14,650.00	338,415,000	
日本航空電子工業	45,000	1,662.00	74,790,000	貸付有価証券 19,000株(4,000株)
T O A	16,800	1,047.00	17,589,600	貸付有価証券 1,400株
日立マクセル	21,300	2,021.00	43,047,300	
古野電気	18,400	846.00	15,566,400	貸付有価証券 500株
ユニデンホールディング ス	42,000	165.00	6,930,000	
アルパイン	34,000	1,524.00	51,816,000	貸付有価証券 6,600株
スミダコーポレーション	11,700	1,002.00	11,723,400	貸付有価証券 900株(900株)
アイコム	7,900	2,311.00	18,256,900	
リオン	5,500	1,617.00	8,893,500	
本多通信工業	4,600	1,249.00	5,745,400	貸付有価証券 2,100株(100株)
船井電機	16,000	943.00	15,088,000	貸付有価証券 6,400株
横河電機	154,800	1,706.00	264,088,800	
新電元工業	55,000	438.00	24,090,000	
アズビル	43,300	3,290.00	142,457,000	
東亜ディーケーケー	7,100	528.00	3,748,800	貸付有価証券 100株(100株)
日本光電工業	59,700	2,589.00	154,563,300	貸付有価証券 25,600株
チノー	5,100	1,092.00	5,569,200	
共和電業	16,200	401.00	6,496,200	
日本電子材料	5,600	605.00	3,388,000	



堀場製作所	28,300	5,500.00	155,650,000	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
アドバンテスト	97,300	1,911.00	185,940,300	貸付有価証券 13,900株(5,400株)
小野測器	6,900	883.00	6,092,700	
エスペック	12,700	1,306.00	16,586,200	
パナソニック デバイス SUNX	12,500	827.00	10,337,500	
キーエンス	32,300	79,130.00	2,555,899,000	貸付有価証券 1,000株
日置電機	7,500	2,157.00	16,177,500	
シスメックス	110,900	6,630.00	735,267,000	貸付有価証券 30,100株
日本マイクロニクス	26,600	1,149.00	30,563,400	貸付有価証券 2,800株
メガチップス	13,300	2,572.00	34,207,600	貸付有価証券 6,200株
OBARA GROUP	8,300	5,280.00	43,824,000	貸付有価証券 400株(400株)
澤藤電機	9,000	216.00	1,944,000	
コーセル	19,800	1,306.00	25,858,800	貸付有価証券 900株
イリソ電子工業	4,500	6,660.00	29,970,000	
新日本無線	12,100	389.00	4,706,900	貸付有価証券 3,300株(3,000株)
オブテックス	10,500	2,594.00	27,237,000	貸付有価証券 4,000株
千代田インテグレ	7,500	2,492.00	18,690,000	
アイ・オー・データ機器	4,400	1,199.00	5,275,600	貸付有価証券 1,200株(900株)
レーザーテック	16,700	2,094.00	34,969,800	貸付有価証券 900株
スタンレー電気	102,100	3,200.00	326,720,000	貸付有価証券 12,100株
岩崎電気	52,000	183.00	9,516,000	
ウシオ電機	86,700	1,484.00	128,662,800	貸付有価証券 38,400株
岡谷電機産業	7,600	407.00	3,093,200	貸付有価証券 400株(100株)
ヘリオス テクノ ホー ルディング	13,100	499.00	6,536,900	貸付有価証券 200株

日本セラミック	11,700	2,034.00	23,797,800	貸付有価証券 2,500株（1,300株）
遠藤照明	7,200	856.00	6,163,200	貸付有価証券 500株
日本デジタル研究所	13,500	2,391.00	32,278,500	貸付有価証券 2,200株
古河電池	10,000	739.00	7,390,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
双信電機	6,900	283.00	1,952,700	
山一電機	13,400	1,151.00	15,423,400	貸付有価証券 6,100株
図研	9,300	1,175.00	10,927,500	貸付有価証券 300株（300株）
日本電子	52,000	514.00	26,728,000	貸付有価証券 6,000株
カシオ計算機	119,300	1,672.00	199,469,600	貸付有価証券 8,100株（200株）
ファナック	144,700	20,165.00	2,917,875,500	貸付有価証券 9,000株
日本シイエムケイ	30,700	707.00	21,704,900	貸付有価証券 1,800株
エンプラス	6,500	3,485.00	22,652,500	貸付有価証券 200株（200株）
大真空	5,200	1,395.00	7,254,000	貸付有価証券 1,600株
ローム	69,000	6,710.00	462,990,000	
浜松ホトニクス	111,400	3,110.00	346,454,000	貸付有価証券 48,200株
三井ハイテック	18,800	854.00	16,055,200	
新光電気工業	53,900	801.00	43,173,900	
京セラ	234,400	5,940.00	1,392,336,000	貸付有価証券 10,900株
太陽誘電	69,400	1,417.00	98,339,800	
村田製作所	149,800	15,975.00	2,393,055,000	貸付有価証券 6,200株
ユーシン	18,900	742.00	14,023,800	貸付有価証券 8,900株（5,300株）
双葉電子工業	23,300	1,967.00	45,831,100	貸付有価証券 300株
北陸電気工業	57,000	135.00	7,695,000	
ニチコン	45,000	1,017.00	45,765,000	貸付有価証券

				200株
日本ケミコン	123,000	261.00	32,103,000	貸付有価証券 19,000株
K O A	19,700	1,150.00	22,655,000	貸付有価証券 800株
市光工業	30,000	375.00	11,250,000	貸付有価証券 14,000株(3,000株)
小糸製作所	85,500	6,140.00	524,970,000	貸付有価証券 40,000株
ミツバ	26,300	1,862.00	48,970,600	
S C R E E Nホールディングス	29,300	7,200.00	210,960,000	
キャノン電子	13,100	1,820.00	23,842,000	
キャノン	768,600	3,430.00	2,636,298,000	
リコー	429,300	997.00	428,012,100	貸付有価証券 42,900株
M U T O Hホールディングス	19,000	250.00	4,750,000	
東京エレクトロン	95,200	11,060.00	1,052,912,000	貸付有価証券 16,500株
トヨタ紡織	49,900	2,740.00	136,726,000	
芦森工業	32,000	160.00	5,120,000	貸付有価証券 11,000株
ユニプレス	27,500	2,308.00	63,470,000	貸付有価証券 300株
豊田自動織機	130,000	5,700.00	741,000,000	貸付有価証券 6,500株
モリタホールディングス	25,000	1,591.00	39,775,000	
三櫻工業	18,100	889.00	16,090,900	貸付有価証券 600株
デンソー	352,000	5,197.00	1,829,344,000	貸付有価証券 31,200株
東海理化電機製作所	37,600	2,398.00	90,164,800	
三井造船	516,000	181.00	93,396,000	貸付有価証券 2,000株
川崎重工業	1,111,000	369.00	409,959,000	貸付有価証券 115,000株
名村造船所	42,800	819.00	35,053,200	貸付有価証券 200株(200株)
サノヤスホールディングス	17,300	275.00	4,757,500	貸付有価証券 8,100株

日本車輛製造	52,000	271.00	14,092,000	貸付有価証券 24,000株（5,000株）
ニチュ三菱フォークリフト	16,400	838.00	13,743,200	貸付有価証券 3,900株
近畿車輛	2,100	2,559.00	5,373,900	貸付有価証券 900株
日産自動車	1,708,700	1,194.50	2,041,042,150	
いすゞ自動車	413,700	1,494.00	618,067,800	貸付有価証券 3,100株
トヨタ自動車	1,775,700	6,991.00	12,413,918,700	貸付有価証券 288,200株
日野自動車	203,800	1,212.00	247,005,600	貸付有価証券 3,600株
三菱自動車工業	523,200	668.00	349,497,600	貸付有価証券 23,900株
エフテック	7,500	1,318.00	9,885,000	貸付有価証券 3,500株（2,100株）
レシップホールディングス	4,700	855.00	4,018,500	貸付有価証券 1,900株
G M B	2,300	1,152.00	2,649,600	
ファルテック	2,500	1,321.00	3,302,500	
武蔵精密工業	16,600	3,105.00	51,543,000	貸付有価証券 5,800株（5,000株）
日産車体	62,700	1,149.00	72,042,300	貸付有価証券 7,300株
新明和工業	58,000	1,082.00	62,756,000	
極東開発工業	28,400	1,559.00	44,275,600	
日信工業	31,900	1,831.00	58,408,900	貸付有価証券 2,700株
トピー工業	11,700	2,889.00	33,801,300	貸付有価証券 200株
ティラド	55,000	292.00	16,060,000	
曙ブレーキ工業	66,300	308.00	20,420,400	貸付有価証券 20,800株
タチエス	24,200	1,948.00	47,141,600	貸付有価証券 200株
N O K	69,100	2,404.00	166,116,400	貸付有価証券 16,100株
フタバ産業	43,500	697.00	30,319,500	
K Y B	160,000	554.00	88,640,000	
大同メタル工業	17,900	1,161.00	20,781,900	貸付有価証券

				200株
プレス工業	75,800	515.00	39,037,000	
ミクニ	18,100	397.00	7,185,700	
カルソニックカンセイ	97,000	1,779.00	172,563,000	貸付有価証券 1,000株
太平洋工業	29,300	1,508.00	44,184,400	貸付有価証券 13,800株(12,000株)
ケーヒン	32,800	2,023.00	66,354,400	
河西工業	19,300	1,388.00	26,788,400	
アイシン精機	130,600	5,190.00	677,814,000	
富士機工	14,100	463.00	6,528,300	
マツダ	452,100	1,974.50	892,671,450	
今仙電機製作所	13,100	998.00	13,073,800	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,284,800	3,495.00	4,490,376,000	貸付有価証券 55,000株
スズキ	283,000	4,122.00	1,166,526,000	
富士重工業	443,300	4,824.00	2,138,479,200	貸付有価証券 36,700株
安永	5,200	2,070.00	10,764,000	貸付有価証券 2,400株(1,000株)
ヤマハ発動機	201,600	2,657.00	535,651,200	貸付有価証券 4,700株
ショーワ	37,100	807.00	29,939,700	
T B K	18,300	490.00	8,967,000	
エクセディ	19,400	3,235.00	62,759,000	
豊田合成	46,100	2,759.00	127,189,900	
愛三工業	25,000	996.00	24,900,000	
盟和産業	2,200	1,178.00	2,591,600	
ヨロズ	13,300	1,736.00	23,088,800	
エフ・シー・シー	23,300	2,134.00	49,722,200	貸付有価証券 1,400株
シマノ	57,500	18,570.00	1,067,775,000	
タカタ	25,800	606.00	15,634,800	貸付有価証券 12,200株(3,000株)
テイ・エス テック	33,200	2,971.00	98,637,200	
ジャムコ	8,300	2,438.00	20,235,400	貸付有価証券 3,900株(100株)
テルモ	218,800	4,325.00	946,310,000	貸付有価証券

				22,700株
クリエートメディック	4,700	984.00	4,624,800	
日機装	49,400	1,066.00	52,660,400	
島津製作所	184,000	1,871.00	344,264,000	
JMS	26,000	303.00	7,878,000	
クボテック	3,100	661.00	2,049,100	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
長野計器	11,200	688.00	7,705,600	
パイ・テクノロジー	2,900	13,220.00	38,338,000	貸付有価証券 1,300株
東京計器	49,000	229.00	11,221,000	貸付有価証券 1,000株
愛知時計電機	1,900	3,685.00	7,001,500	
オーバル	13,900	266.00	3,697,400	貸付有価証券 6,200株
東京精密	27,600	3,435.00	94,806,000	
マニー	19,000	2,804.00	53,276,000	貸付有価証券 200株(200株)
ニコン	248,800	1,798.00	447,342,400	貸付有価証券 76,200株(5,600株)
トプコン	71,900	1,722.00	123,811,800	貸付有価証券 13,600株
オリンパス	227,900	4,065.00	926,413,500	貸付有価証券 44,800株
理研計器	12,600	1,654.00	20,840,400	
タムロン	12,700	1,981.00	25,158,700	貸付有価証券 6,000株(5,300株)
HOYA	293,700	4,874.00	1,431,493,800	
ノーリツ鋼機	14,400	835.00	12,024,000	
エー・アンド・デイ	13,000	470.00	6,110,000	
シチズン時計	161,100	710.00	114,381,000	貸付有価証券 7,000株
リズム時計工業	57,000	181.00	10,317,000	
大研医器	12,700	799.00	10,147,300	貸付有価証券 4,000株(400株)
メニコン	9,800	3,140.00	30,772,000	貸付有価証券 3,000株
松風	7,500	1,343.00	10,072,500	貸付有価証券 2,300株
セイコーホールディング	101,000	425.00	42,925,000	貸付有価証券

ス				47,000株(13,000株)
ニプロ	98,800	1,272.00	125,673,600	
スノーピーク	2,200	3,065.00	6,743,000	貸付有価証券 1,000株(500株)
パラマウントベッドホールディングス	13,700	4,580.00	62,746,000	貸付有価証券 5,400株(200株)
トランザクション	3,100	1,542.00	4,780,200	
S H O - B I	4,800	425.00	2,040,000	
ニホンフラッシュ	6,700	1,320.00	8,844,000	貸付有価証券 1,600株(100株)
前田工織	14,300	1,274.00	18,218,200	貸付有価証券 2,500株
永大産業	19,000	505.00	9,595,000	
アートネイチャー	15,200	710.00	10,792,000	貸付有価証券 400株
ダンロップスポーツ	9,000	1,022.00	9,198,000	貸付有価証券 100株(100株)
バンダイナムコホールディングス	157,500	3,235.00	509,512,500	
アイフィスジャパン	3,200	424.00	1,356,800	
共立印刷	23,700	315.00	7,465,500	
S H O E I	6,400	2,146.00	13,734,400	
フランスベッドホールディングス	17,900	934.00	16,718,600	貸付有価証券 300株
パイロットコーポレーション	24,900	4,870.00	121,263,000	貸付有価証券 4,700株
萩原工業	4,000	2,573.00	10,292,000	貸付有価証券 400株
トッパン・フォームズ	25,500	1,202.00	30,651,000	
フジシールインターナショナル	16,000	4,815.00	77,040,000	
タカラトミー	55,500	1,277.00	70,873,500	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
廣済堂	14,400	347.00	4,996,800	
A s - m e エステール	3,800	697.00	2,648,600	
アーク	60,100	123.00	7,392,300	貸付有価証券 28,200株(21,000株)
タカノ	6,300	829.00	5,222,700	
プロネクサス	13,300	1,074.00	14,284,200	
ホクシン	10,100	198.00	1,999,800	貸付有価証券

				4,700株(4,100株)
ウッドワン	24,000	271.00	6,504,000	
大建工業	10,000	2,054.00	20,540,000	
凸版印刷	403,000	1,138.00	458,614,000	
大日本印刷	412,000	1,157.00	476,684,000	
図書印刷	19,000	493.00	9,367,000	貸付有価証券 7,000株
共同印刷	44,000	400.00	17,600,000	
日本写真印刷	24,000	2,793.00	67,032,000	貸付有価証券 11,200株
光村印刷	13,000	213.00	2,769,000	
宝印刷	6,900	1,546.00	10,667,400	貸付有価証券 3,200株(100株)
アシックス	141,800	2,366.00	335,498,800	貸付有価証券 4,700株(3,900株)
ツツミ	5,300	1,923.00	10,191,900	
小松ウオール工業	4,800	1,916.00	9,196,800	
ヤマハ	96,200	3,570.00	343,434,000	貸付有価証券 100株
河合楽器製作所	5,600	2,299.00	12,874,400	貸付有価証券 300株(300株)
クリナップ	16,700	943.00	15,748,100	
ピジョン	86,300	2,960.00	255,448,000	貸付有価証券 4,500株
兼松サステック	15,000	184.00	2,760,000	
キングジム	11,900	850.00	10,115,000	貸付有価証券 2,600株
リンテック	33,900	2,570.00	87,123,000	貸付有価証券 4,800株
T A S A K I	3,900	1,565.00	6,103,500	貸付有価証券 1,800株(400株)
イトーキ	30,000	760.00	22,800,000	貸付有価証券 14,100株(11,100株)
任天堂	87,900	24,555.00	2,158,384,500	貸付有価証券 9,900株
三菱鉛筆	11,800	6,290.00	74,222,000	貸付有価証券 3,800株(600株)
タカラスタANDARD	29,500	1,944.00	57,348,000	貸付有価証券 500株
コクヨ	74,200	1,376.00	102,099,200	貸付有価証券



				8,900株
ナカバヤシ	26,000	267.00	6,942,000	
グローブライド	6,900	1,946.00	13,427,400	
岡村製作所	49,800	1,045.00	52,041,000	
美津濃	77,000	574.00	44,198,000	貸付有価証券 25,000株
アデランス	26,400	621.00	16,394,400	貸付有価証券 8,100株
東京電力ホールディングス	1,211,000	492.00	595,812,000	貸付有価証券 530,300株
中部電力	470,400	1,681.00	790,742,400	
関西電力	582,600	1,314.50	765,827,700	貸付有価証券 249,500株
中国電力	197,400	1,412.00	278,728,800	貸付有価証券 93,500株
北陸電力	139,900	1,350.00	188,865,000	貸付有価証券 15,700株
東北電力	356,700	1,514.00	540,043,800	貸付有価証券 13,100株
四国電力	128,600	1,214.00	156,120,400	貸付有価証券 60,400株（4,300株）
九州電力	315,300	1,302.00	410,520,600	貸付有価証券 124,000株
北海道電力	133,600	934.00	124,782,400	貸付有価証券 22,000株
沖縄電力	21,000	2,645.00	55,545,000	
電源開発	113,600	2,775.00	315,240,000	貸付有価証券 6,800株
エフオン	5,800	913.00	5,295,400	貸付有価証券 2,700株（100株）
イーレックス	5,900	2,991.00	17,646,900	貸付有価証券 2,800株（100株）
東京瓦斯	1,531,000	538.30	824,137,300	
大阪瓦斯	1,385,000	459.30	636,130,500	貸付有価証券 461,000株
東邦瓦斯	360,000	957.00	344,520,000	貸付有価証券 38,000株
北海道瓦斯	35,000	276.00	9,660,000	貸付有価証券 8,000株
広島ガス	29,400	375.00	11,025,000	貸付有価証券 2,700株（2,700株）

西部瓦斯	161,000	255.00	41,055,000	
静岡ガス	43,900	847.00	37,183,300	
メタウォーター	8,000	2,778.00	22,224,000	貸付有価証券 3,800株
SBSホールディングス	14,100	839.00	11,829,900	
東武鉄道	763,000	585.00	446,355,000	貸付有価証券 31,000株(28,000株)
相鉄ホールディングス	228,000	577.00	131,556,000	
東京急行電鉄	776,000	879.00	682,104,000	
京浜急行電鉄	391,000	1,343.00	525,113,000	貸付有価証券 157,000株
小田急電鉄	228,700	2,349.00	537,216,300	貸付有価証券 83,700株
京王電鉄	399,000	971.00	387,429,000	貸付有価証券 15,000株
京成電鉄	107,000	2,866.00	306,662,000	
富士急行	39,000	1,098.00	42,822,000	貸付有価証券 18,000株(3,000株)
新京成電鉄	18,000	415.00	7,470,000	
東日本旅客鉄道	276,200	10,260.00	2,833,812,000	貸付有価証券 17,800株(14,700株)
西日本旅客鉄道	137,400	7,288.00	1,001,371,200	貸付有価証券 4,800株
東海旅客鉄道	118,700	19,530.00	2,318,211,000	貸付有価証券 6,400株
西武ホールディングス	197,200	2,148.00	423,585,600	貸付有価証券 39,500株
鴻池運輸	20,200	1,545.00	31,209,000	
西日本鉄道	172,000	540.00	92,880,000	貸付有価証券 1,000株
ハマキョウレックス	9,300	2,107.00	19,595,100	
サカイ引越センター	4,900	2,694.00	13,200,600	貸付有価証券 2,300株
近鉄グループホールディングス	1,437,000	450.00	646,650,000	貸付有価証券 246,000株
阪急阪神ホールディングス	180,400	3,795.00	684,618,000	
南海電気鉄道	302,000	599.00	180,898,000	
京阪ホールディングス	320,000	778.00	248,960,000	貸付有価証券 84,000株
神戸電鉄	35,000	371.00	12,985,000	貸付有価証券

				1,000株
名古屋鉄道	520,000	576.00	299,520,000	貸付有価証券 246,000株
山陽電気鉄道	52,000	599.00	31,148,000	
日本通運	552,000	626.00	345,552,000	
ヤマトホールディングス	255,300	2,417.50	617,187,750	貸付有価証券 13,200株
山九	188,000	715.00	134,420,000	
丸運	7,700	249.00	1,917,300	
丸全昭和運輸	48,000	461.00	22,128,000	貸付有価証券 10,000株(10,000株)
センコー	64,200	793.00	50,910,600	
トナミホールディングス	29,000	338.00	9,802,000	
ニッコンホールディングス	48,400	2,468.00	119,451,200	
日本石油輸送	1,600	2,435.00	3,896,000	
福山通運	87,000	679.00	59,073,000	貸付有価証券 41,000株(29,000株)
セイノーホールディングス	101,300	1,331.00	134,830,300	
神奈川中央交通	17,000	718.00	12,206,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
日立物流	29,700	2,414.00	71,695,800	
丸和運輸機関	3,600	2,897.00	10,429,200	貸付有価証券 1,600株(100株)
C & F ロジホールディングス	14,800	1,412.00	20,897,600	
九州旅客鉄道	106,400	3,050.00	324,520,000	
日本郵船	1,206,000	224.00	270,144,000	貸付有価証券 136,000株
商船三井	749,000	326.00	244,174,000	貸付有価証券 209,000株(2,000株)
川崎汽船	541,000	272.00	147,152,000	貸付有価証券 254,000株(1,000株)
N S ユナイテッド海運	64,000	209.00	13,376,000	貸付有価証券 8,000株
明治海運	12,800	437.00	5,593,600	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
飯野海運	73,900	470.00	34,733,000	
共栄タンカー	12,000	219.00	2,628,000	貸付有価証券 2,000株

乾汽船	10,400	952.00	9,900,800	貸付有価証券 3,300株
日本航空	257,300	3,509.00	902,865,700	
A N Aホールディングス	2,650,000	321.50	851,975,000	貸付有価証券 12,000株
パスコ	13,000	397.00	5,161,000	貸付有価証券 6,000株
トランコム	4,100	5,700.00	23,370,000	
日新	58,000	365.00	21,170,000	
三菱倉庫	94,000	1,669.00	156,886,000	貸付有価証券 3,000株(1,000株)
三井倉庫ホールディングス	83,000	352.00	29,216,000	貸付有価証券 9,000株(9,000株)
住友倉庫	104,000	612.00	63,648,000	貸付有価証券 7,000株
澁澤倉庫	37,000	347.00	12,839,000	
東陽倉庫	24,400	300.00	7,320,000	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	33,000	420.00	13,860,000	
ケイヒン	26,000	151.00	3,926,000	
中央倉庫	8,200	1,074.00	8,806,800	
安田倉庫	11,100	761.00	8,447,100	
東洋埠頭	41,000	185.00	7,585,000	貸付有価証券 2,000株
宇徳	11,600	410.00	4,756,000	
上組	170,000	1,120.00	190,400,000	
サンリツ	3,500	528.00	1,848,000	
キムラユニティー	3,600	1,172.00	4,219,200	
キューソー流通システム	4,500	2,428.00	10,926,000	貸付有価証券 500株
郵船ロジスティクス	13,100	1,275.00	16,702,500	
近鉄エクスプレス	25,500	1,682.00	42,891,000	貸付有価証券 5,300株
東海運	7,700	443.00	3,411,100	貸付有価証券 3,600株(2,500株)
エーアイティー	8,800	1,053.00	9,266,400	貸付有価証券 2,500株
内外トランスライン	4,300	1,176.00	5,056,800	貸付有価証券 2,000株
N E C ネットエスアイ	15,400	2,129.00	32,786,600	

システナ	11,200	1,746.00	19,555,200	
デジタルアーツ	6,300	2,601.00	16,386,300	貸付有価証券 2,800株(2,600株)
新日鉄住金ソリューションズ	23,500	2,109.00	49,561,500	
キューブシステム	6,100	686.00	4,184,600	
コア	5,900	1,153.00	6,802,700	貸付有価証券 500株
ソフトクリエイトホールディングス	6,700	1,335.00	8,944,500	貸付有価証券 2,000株(1,900株)
T I S	46,700	2,521.00	117,730,700	貸付有価証券 1,400株
ネオス	4,200	436.00	1,831,200	貸付有価証券 1,900株(800株)
電算システム	4,900	1,905.00	9,334,500	貸付有価証券 800株
グリー	85,600	618.00	52,900,800	
コーエーテックモホールディングス	33,400	2,090.00	69,806,000	貸付有価証券 1,900株(100株)
三菱総合研究所	5,500	3,245.00	17,847,500	
ボルテージ	2,800	1,080.00	3,024,000	貸付有価証券 200株
電算	1,600	2,235.00	3,576,000	
A G S	3,500	1,331.00	4,658,500	
ファインデックス	10,400	900.00	9,360,000	貸付有価証券 4,900株(2,800株)
ヒト・コミュニケーションズ	3,200	1,490.00	4,768,000	貸付有価証券 1,300株(500株)
ブレインパッド	2,100	1,057.00	2,219,700	貸付有価証券 500株(500株)
K L a b	26,900	664.00	17,861,600	貸付有価証券 9,100株
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	10,100	1,015.00	10,251,500	
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	864.00	1,900,800	
ネクソン	155,000	1,715.00	265,825,000	
アイスタイル	21,500	841.00	18,081,500	貸付有価証券 10,100株(100株)
エムアップ	4,000	592.00	2,368,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)

エイチーム	7,800	2,353.00	18,353,400	貸付有価証券 200株（200株）
テクノスジャパン	10,800	1,164.00	12,571,200	貸付有価証券 5,000株（1,000株）
e n i s h	4,100	470.00	1,927,000	貸付有価証券 1,700株
コロブラ	39,200	993.00	38,925,600	貸付有価証券 18,500株
モバイルクリエイト	9,200	379.00	3,486,800	貸付有価証券 1,200株
オルトプラス	5,800	669.00	3,880,200	貸付有価証券 2,700株（2,600株）
ブロードリーフ	34,800	659.00	22,933,200	貸付有価証券 16,300株
ハーツユナイテッドグループ	7,400	1,659.00	12,276,600	貸付有価証券 3,500株（1,900株）
メディアドゥ	3,000	1,430.00	4,290,000	貸付有価証券 800株
ブイキューブ	7,700	653.00	5,028,100	貸付有価証券 3,600株（400株）
サイバーリンクス	2,100	1,064.00	2,234,400	貸付有価証券 900株
ディー・エル・イー	4,100	611.00	2,505,100	貸付有価証券 1,900株
VOYAGE GROUP	4,800	1,011.00	4,852,800	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
オブティム	1,500	5,170.00	7,755,000	貸付有価証券 700株
ベリサーブ	1,600	2,990.00	4,784,000	貸付有価証券 700株（400株）
ティーガイア	14,000	1,904.00	26,656,000	
日本アジアグループ	15,900	435.00	6,916,500	
豆腐ホールディングス	10,300	941.00	9,692,300	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	4,400	2,065.00	9,086,000	貸付有価証券 2,000株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	295,400	248.00	73,259,200	貸付有価証券 141,200株（3,000株）
GMOペイメントゲートウェイ	11,500	5,080.00	58,420,000	貸付有価証券 5,400株
ザッパラス	7,900	419.00	3,310,100	
インターネットイニシア	20,700	1,757.00	36,369,900	貸付有価証券

タイプ				100株
さくらインターネット	10,800	925.00	9,990,000	貸付有価証券 5,000株(2,200株)
GMOクラウド	3,100	1,266.00	3,924,600	貸付有価証券 1,400株(900株)
SRAホールディングス	7,400	2,607.00	19,291,800	
Minorityソリューションズ	3,100	1,046.00	3,242,600	
システムインテグレータ	2,000	631.00	1,262,000	貸付有価証券 200株
朝日ネット	12,800	483.00	6,182,400	
アドソル日進	2,800	1,167.00	3,267,600	貸付有価証券 1,300株
フリービット	7,800	791.00	6,169,800	貸付有価証券 3,600株(3,600株)
コムチュア	2,400	3,290.00	7,896,000	貸付有価証券 1,100株
サイバーコム	1,900	844.00	1,603,600	貸付有価証券 800株
gumi	14,600	814.00	11,884,400	貸付有価証券 6,100株
PCIホールディングス	1,600	2,514.00	4,022,400	
パイプドHD	2,500	1,111.00	2,777,500	貸付有価証券 400株
LINE	23,500	4,010.00	94,235,000	貸付有価証券 11,100株(4,700株)
ソルクシーズ	4,000	568.00	2,272,000	
フェイス	3,700	1,219.00	4,510,300	貸付有価証券 100株
ハイマックス	1,900	1,349.00	2,563,100	
野村総合研究所	95,800	3,955.00	378,889,000	貸付有価証券 100株(100株)
サイバネットシステム	11,500	656.00	7,544,000	貸付有価証券 2,500株
CEホールディングス	2,100	1,089.00	2,286,900	貸付有価証券 900株
インテージホールディングス	8,000	1,984.00	15,872,000	
東邦システムサイエンス	4,600	649.00	2,985,400	
ソースネクスト	8,400	569.00	4,779,600	貸付有価証券 3,600株(2,600株)

ティー・ワイ・オー	27,700	148.00	4,099,600	
フォーカスシステムズ	5,400	472.00	2,548,800	
クレスコ	3,200	2,363.00	7,561,600	
フジ・メディア・ホールディングス	146,700	1,663.00	243,962,100	
オービック	48,600	5,100.00	247,860,000	
ジャストシステム	22,800	1,049.00	23,917,200	
TDCソフトウェアエンジニアリング	6,100	1,123.00	6,850,300	
ヤフー	1,009,900	452.00	456,474,800	貸付有価証券 267,500株
トレンドマイクロ	74,600	4,305.00	321,153,000	
インフォメーション・ディベロプメント	2,700	1,590.00	4,293,000	貸付有価証券 1,200株
日本オラクル	22,600	5,950.00	134,470,000	
アルファシステムズ	4,600	1,834.00	8,436,400	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
フューチャー	19,000	723.00	13,737,000	
CAC Holdings	10,500	937.00	9,838,500	
ソフトバンク・テクノロジー	3,300	3,130.00	10,329,000	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
トーセ	3,800	795.00	3,021,000	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルティング	7,200	5,120.00	36,864,000	貸付有価証券 3,300株
伊藤忠テクノソリューションズ	31,900	2,996.00	95,572,400	
アイティフォー	18,300	628.00	11,492,400	
東計電算	2,500	2,214.00	5,535,000	貸付有価証券 1,100株
エクスネット	1,300	1,695.00	2,203,500	
大塚商会	37,900	5,620.00	212,998,000	貸付有価証券 17,700株
サイボウズ	18,700	455.00	8,508,500	貸付有価証券 300株
ソフトブレーン	19,200	394.00	7,564,800	貸付有価証券 9,100株(7,400株)
電通国際情報サービス	8,700	1,833.00	15,947,100	
デジタルガレージ	22,000	1,982.00	43,604,000	貸付有価証券



				2,100株
E Mシステムズ	4,800	1,600.00	7,680,000	貸付有価証券 800株
ウェザーニューズ	4,700	3,625.00	17,037,500	貸付有価証券 2,200株(200株)
C I J	12,800	532.00	6,809,600	貸付有価証券 6,000株
東洋ビジネスエンジニア リング	1,400	1,537.00	2,151,800	貸付有価証券 600株
日本エンタープライズ	14,400	277.00	3,988,800	貸付有価証券 6,600株(400株)
WOWOW	6,700	3,480.00	23,316,000	貸付有価証券 1,900株
スカラ	8,800	838.00	7,374,400	
日本コロムビア	4,200	622.00	2,612,400	貸付有価証券 1,500株
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,800	651.00	7,681,800	貸付有価証券 5,500株(3,800株)
ネットワンシステムズ	61,000	746.00	45,506,000	貸付有価証券 6,900株
システムソフト	24,800	150.00	3,720,000	貸付有価証券 11,900株
アルゴグラフィックス	6,400	2,243.00	14,355,200	
マーベラス	23,800	772.00	18,373,600	貸付有価証券 11,300株(800株)
エイベックス・グルー プ・ホールディングス	25,900	1,737.00	44,988,300	
日本ユニシス	38,900	1,472.00	57,260,800	貸付有価証券 10,300株(10,300株)
兼松エレクトロニクス	8,900	2,461.00	21,902,900	
東京放送ホールディン グス	92,900	1,889.00	175,488,100	
日本テレビホールディ ングス	128,600	2,142.00	275,461,200	
朝日放送	13,900	698.00	9,702,200	
テレビ朝日ホールディ ングス	38,500	2,341.00	90,128,500	貸付有価証券 5,500株
スカパーJ S A Tホル ディングス	91,700	550.00	50,435,000	貸付有価証券 22,800株
テレビ東京ホールディ ングス	11,500	2,338.00	26,887,000	貸付有価証券 1,100株(800株)
日本B S放送	3,200	1,077.00	3,446,400	貸付有価証券

				1,500株(700株)
U - N E X T	3,600	559.00	2,012,400	貸付有価証券 1,700株(100株)
ワイヤレスゲート	4,900	1,705.00	8,354,500	貸付有価証券 2,300株
コネクシオ	12,400	1,507.00	18,686,800	貸付有価証券 3,700株(3,500株)
日本通信	117,800	167.00	19,672,600	貸付有価証券 55,300株
ク Robbins	3,000	549.00	1,647,000	
日本電信電話	1,131,100	4,946.00	5,594,420,600	貸付有価証券 105,700株
K D D I	1,394,000	2,950.50	4,112,997,000	
光通信	16,900	10,980.00	185,562,000	
N T T ドコモ	1,052,900	2,672.50	2,813,875,250	
エムティーアイ	21,500	713.00	15,329,500	貸付有価証券 400株
G M O インターネット	51,400	1,515.00	77,871,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
カドカワ	40,900	1,702.00	69,611,800	貸付有価証券 2,700株
学研ホールディングス	47,000	318.00	14,946,000	
ゼンリン	18,600	1,953.00	36,325,800	
昭文社	7,700	651.00	5,012,700	
インプレスホールディングス	11,600	142.00	1,647,200	貸付有価証券 900株(100株)
アイネット	7,900	1,080.00	8,532,000	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
松竹	93,000	1,280.00	119,040,000	
東宝	92,200	3,305.00	304,721,000	貸付有価証券 43,800株(43,800株)
東映	52,000	986.00	51,272,000	
A O I P r o .	6,500	858.00	5,577,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	87,000	5,810.00	505,470,000	
ピー・シー・エー	2,000	1,354.00	2,708,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	1,000.00	2,400,000	
D T S	14,500	2,540.00	36,830,000	
スクウェア・エニックス	54,200	3,000.00	162,600,000	

ス・ホールディングス				
シーイーシー	8,300	1,719.00	14,267,700	
カブコン	33,000	2,741.00	90,453,000	貸付有価証券 5,500株(1,300株)
アイ・エス・ビー	2,700	931.00	2,513,700	
ジャステック	8,900	1,055.00	9,389,500	貸付有価証券 4,000株
S C S K	38,300	4,160.00	159,328,000	
日本システムウエア	4,600	1,421.00	6,536,600	貸付有価証券 1,800株(500株)
アイネス	17,700	1,221.00	21,611,700	
T K C	13,000	3,105.00	40,365,000	
富士ソフト	20,900	2,809.00	58,708,100	
N S D	29,900	1,834.00	54,836,600	
コナミホールディングス	63,600	4,645.00	295,422,000	貸付有価証券 1,700株(100株)
福井コンピュータホールディングス	4,100	2,703.00	11,082,300	貸付有価証券 800株(100株)
J B C Cホールディングス	11,800	752.00	8,873,600	
ミロク情報サービス	10,400	1,764.00	18,345,600	
ソフトバンクグループ	634,300	7,847.00	4,977,352,100	貸付有価証券 17,300株
ハウスイ	11,000	129.00	1,419,000	
高千穂交易	5,400	999.00	5,394,600	
伊藤忠食品	3,500	4,335.00	15,172,500	貸付有価証券 200株
エレマテック	5,600	1,867.00	10,455,200	
J A L U X	4,500	1,943.00	8,743,500	貸付有価証券 1,600株(900株)
あらた	6,300	2,562.00	16,140,600	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
トーメンデバイス	2,100	2,025.00	4,252,500	
東京エレクトロン デバイス	5,100	1,575.00	8,032,500	
フィールズ	10,800	1,406.00	15,184,800	貸付有価証券 3,700株(600株)
双日	832,200	286.00	238,009,200	
アルフレッサ ホールディングス	166,700	1,937.00	322,897,900	

横浜冷凍	34,900	1,040.00	36,296,000	貸付有価証券 16,500株(13,000株)
神栄	19,000	182.00	3,458,000	貸付有価証券 7,000株
山下医科器械	1,100	1,738.00	1,911,800	貸付有価証券 100株(100株)
ラサ商事	6,000	612.00	3,672,000	貸付有価証券 200株
ラクーン	6,100	469.00	2,860,900	貸付有価証券 2,800株
アルコニックス	8,000	1,689.00	13,512,000	
神戸物産	7,600	3,895.00	29,602,000	貸付有価証券 3,200株
あい ホールディングス	25,100	2,322.00	58,282,200	貸付有価証券 10,000株(6,100株)
ディーブイエックス	5,000	1,385.00	6,925,000	
ダイワボウホールディングス	120,000	292.00	35,040,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	26,100	1,508.00	39,358,800	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	26,500	978.00	25,917,000	貸付有価証券 9,900株(9,300株)
八洲電機	10,900	604.00	6,583,600	
U K C ホールディングス	9,000	2,136.00	19,224,000	
O C H I ホールディングス	4,100	1,206.00	4,944,600	
T O K A I ホールディングス	61,900	803.00	49,705,700	貸付有価証券 29,300株
大阪工機	1,600	731.00	1,169,600	
三洋貿易	7,700	1,585.00	12,204,500	
ビューティガレージ	1,200	1,092.00	1,310,400	貸付有価証券 500株(500株)
ウイン・パートナーズ	5,100	2,140.00	10,914,000	貸付有価証券 300株
ミタチ産業	3,600	618.00	2,224,800	
シップヘルスケアホールディングス	27,000	3,000.00	81,000,000	
明治電機工業	4,800	1,210.00	5,808,000	貸付有価証券 1,200株
デリカフーズ	3,000	1,000.00	3,000,000	貸付有価証券 1,000株

スターティア	3,200	522.00	1,670,400	貸付有価証券 1,300株（1,100株）
コメダホールディングス	19,000	1,842.00	34,998,000	貸付有価証券 7,700株
富士興産	5,000	455.00	2,275,000	
協栄産業	17,000	153.00	2,601,000	
小野建	12,200	1,351.00	16,482,200	貸付有価証券 300株
佐鳥電機	11,100	726.00	8,058,600	貸付有価証券 1,100株
エコートレーディング	3,200	668.00	2,137,600	貸付有価証券 200株
伯東	9,600	1,041.00	9,993,600	
コンドーテック	11,200	839.00	9,396,800	
中山福	8,100	818.00	6,625,800	貸付有価証券 100株
ナガイレーベン	20,300	2,570.00	52,171,000	貸付有価証券 1,200株
三菱食品	15,500	3,485.00	54,017,500	貸付有価証券 200株
松田産業	10,300	1,522.00	15,676,600	
第一興商	22,900	4,545.00	104,080,500	
メディバルホールディングス	140,900	1,822.00	256,719,800	貸付有価証券 900株
S P K	3,000	2,357.00	7,071,000	貸付有価証券 800株
萩原電気	4,800	2,108.00	10,118,400	
アズワン	11,000	4,885.00	53,735,000	
スズデン	5,000	1,030.00	5,150,000	
尾家産業	4,500	1,136.00	5,112,000	
シモジマ	8,600	1,120.00	9,632,000	
ドウシシャ	16,600	2,055.00	34,113,000	貸付有価証券 500株（400株）
小津産業	3,100	2,139.00	6,630,900	
高速	8,400	1,083.00	9,097,200	
たけびし	4,900	1,186.00	5,811,400	貸付有価証券 1,200株
黒田電気	19,200	2,347.00	45,062,400	
リックス	3,200	1,479.00	4,732,800	
丸文	12,400	683.00	8,469,200	

ハピネット	11,700	1,278.00	14,952,600	
橋本総業ホールディングス	2,900	1,520.00	4,408,000	
日本ライフライン	12,000	2,326.00	27,912,000	貸付有価証券 5,600株
エクセル	6,000	1,482.00	8,892,000	貸付有価証券 2,200株
マルカキカイ	4,500	1,592.00	7,164,000	
I D O M	37,900	669.00	25,355,100	貸付有価証券 17,800株（14,000株）
日本エム・ディ・エム	10,600	805.00	8,533,000	貸付有価証券 600株
進和	8,300	1,720.00	14,276,000	
エスケイジャパン	2,600	305.00	793,000	
ダイトエレクトロン	6,400	965.00	6,176,000	
シークス	10,100	3,965.00	40,046,500	貸付有価証券 4,700株
田中商事	4,300	699.00	3,005,700	
オーハシテクニカ	7,900	1,396.00	11,028,400	貸付有価証券 2,300株（2,300株）
白銅	3,500	1,429.00	5,001,500	
伊藤忠商事	1,032,000	1,589.00	1,639,848,000	
丸紅	1,386,800	674.70	935,673,960	
高島	24,000	189.00	4,536,000	
長瀬産業	84,700	1,526.00	129,252,200	
蝶理	9,000	1,729.00	15,561,000	貸付有価証券 200株
豊田通商	157,000	3,070.00	481,990,000	
三共生興	21,300	393.00	8,370,900	貸付有価証券 100株
兼松	300,000	199.00	59,700,000	
ツカモトコーポレーション	25,000	128.00	3,200,000	
三井物産	1,274,200	1,624.50	2,069,937,900	貸付有価証券 3,800株（3,800株）
日本紙パルプ商事	73,000	370.00	27,010,000	
日立ハイテクノロジーズ	48,800	4,610.00	224,968,000	
カメイ	18,300	1,235.00	22,600,500	
東都水産	2,100	1,850.00	3,885,000	

OUGホールディングス	22,000	260.00	5,720,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
スターゼン	5,900	4,835.00	28,526,500	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
山善	54,100	983.00	53,180,300	
椿本興業	16,000	348.00	5,568,000	
住友商事	887,000	1,393.50	1,236,034,500	
内田洋行	35,000	484.00	16,940,000	
三菱商事	1,057,300	2,522.50	2,667,039,250	
第一実業	32,000	655.00	20,960,000	
キャノンマーケティング ジャパン	40,200	1,987.00	79,877,400	
西華産業	45,000	343.00	15,435,000	
佐藤商事	12,600	863.00	10,873,800	
菱洋エレクトロ	13,500	1,426.00	19,251,000	
東京産業	14,000	485.00	6,790,000	貸付有価証券 1,500株
ユアサ商事	13,300	2,953.00	39,274,900	
神鋼商事	3,500	2,428.00	8,498,000	
小林産業	10,200	259.00	2,641,800	貸付有価証券 300株
阪和興業	141,000	764.00	107,724,000	
カナデン	13,400	1,048.00	14,043,200	
菱電商事	22,000	742.00	16,324,000	
フルサト工業	7,800	1,666.00	12,994,800	
岩谷産業	156,000	626.00	97,656,000	貸付有価証券 73,000株(73,000株)
すてきナイスグループ	60,000	153.00	9,180,000	
昭光通商	50,000	100.00	5,000,000	貸付有価証券 1,000株
二チモウ	20,000	174.00	3,480,000	貸付有価証券 6,000株(1,000株)
極東貿易	22,000	234.00	5,148,000	
イワキ	21,000	219.00	4,599,000	
三愛石油	37,800	865.00	32,697,000	
稲畑産業	33,800	1,302.00	44,007,600	
G S Iクレオス	34,000	126.00	4,284,000	
明和産業	13,000	391.00	5,083,000	

ワキタ	30,000	979.00	29,370,000	
東邦ホールディングス	45,100	2,313.00	104,316,300	貸付有価証券 21,200株（19,800株）
サンゲツ	48,300	2,036.00	98,338,800	
ミツウロコグループホールディングス	22,700	721.00	16,366,700	貸付有価証券 2,400株
シナネンホールディングス	6,000	2,106.00	12,636,000	
伊藤忠エネクス	31,100	930.00	28,923,000	
サンリオ	43,400	2,266.00	98,344,400	貸付有価証券 15,700株
サンワテクノス	8,300	934.00	7,752,200	
リョーサン	20,900	3,505.00	73,254,500	
新光商事	15,400	1,219.00	18,772,600	
トーヨー	6,300	2,552.00	16,077,600	貸付有価証券 2,800株
三信電気	15,600	1,131.00	17,643,600	貸付有価証券 800株
東陽テクニカ	18,700	1,035.00	19,354,500	貸付有価証券 2,500株
モスフードサービス	18,400	3,525.00	64,860,000	貸付有価証券 100株（100株）
加賀電子	12,700	1,899.00	24,117,300	
ソーダニッカ	14,500	513.00	7,438,500	
立花エレテック	9,500	1,339.00	12,720,500	
フォーバル	6,100	709.00	4,324,900	
PALTA C	22,500	2,752.00	61,920,000	貸付有価証券 100株
三谷産業	14,900	342.00	5,095,800	貸付有価証券 5,800株
太平洋興発	59,000	100.00	5,900,000	貸付有価証券 27,000株
ヤマタネ	7,000	1,607.00	11,249,000	
丸紅建材リース	14,000	222.00	3,108,000	
日鉄住金物産	12,400	4,530.00	56,172,000	
トラスコ中山	16,100	4,930.00	79,373,000	貸付有価証券 7,500株（700株）
オートバックスセブン	52,200	1,767.00	92,237,400	貸付有価証券 2,700株
加藤産業	22,000	2,726.00	59,972,000	



イノテック	12,100	571.00	6,909,100	貸付有価証券 4,100株
イエローハット	13,300	2,469.00	32,837,700	
J Kホールディングス	14,100	595.00	8,389,500	
日伝	5,800	3,160.00	18,328,000	
北沢産業	11,600	185.00	2,146,000	
杉本商事	8,100	1,471.00	11,915,100	
因幡電機産業	19,800	4,025.00	79,695,000	
バイテックホールディングス	5,700	1,254.00	7,147,800	貸付有価証券 1,600株
ミスミグループ本社	158,400	1,934.00	306,345,600	貸付有価証券 34,400株(34,400株)
アルテック	12,000	194.00	2,328,000	貸付有価証券 5,800株
タキヒヨー	21,000	452.00	9,492,000	
蔵王産業	2,300	1,415.00	3,254,500	
スズケン	64,100	3,810.00	244,221,000	
ジェコス	9,700	1,050.00	10,185,000	
ルネサスイーストン	12,900	518.00	6,682,200	貸付有価証券 200株(200株)
ローソン	48,900	8,260.00	403,914,000	貸付有価証券 23,300株
サンエー	10,600	5,640.00	59,784,000	
カワチ薬品	10,900	2,869.00	31,272,100	
エービーシー・マート	25,600	6,640.00	169,984,000	貸付有価証券 6,000株(4,500株)
ハードオフコーポレーション	6,200	1,190.00	7,378,000	
アスクル	17,100	4,295.00	73,444,500	貸付有価証券 100株
ゲオホールディングス	23,500	1,387.00	32,594,500	貸付有価証券 10,900株
アダストリア	21,600	3,325.00	71,820,000	
ジーフット	8,500	789.00	6,706,500	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,800	709.00	1,276,200	
くらコーポレーション	9,200	4,865.00	44,758,000	
キャンドウ	7,400	1,756.00	12,994,400	貸付有価証券 2,100株(1,700株)
パルグループホールディ	7,200	2,810.00	20,232,000	貸付有価証券

ングス				3,300株(100株)
エディオン	54,600	1,119.00	61,097,400	貸付有価証券 25,600株(8,900株)
サーラコーポレーション	17,600	652.00	11,475,200	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
ワッツ	6,000	1,109.00	6,654,000	貸付有価証券 1,400株
ハローズ	4,600	2,384.00	10,966,400	貸付有価証券 2,100株
あみやき亭	2,700	3,900.00	10,530,000	
ひらまつ	19,400	674.00	13,075,600	貸付有価証券 7,700株(600株)
ゲンキー	2,800	5,600.00	15,680,000	貸付有価証券 1,300株(900株)
大黒天物産	3,400	5,050.00	17,170,000	貸付有価証券 1,500株
ハニーズ	12,400	1,201.00	14,892,400	貸付有価証券 5,800株
ファーマライズホールディングス	3,200	524.00	1,676,800	貸付有価証券 100株(100株)
アルペン	12,600	2,144.00	27,014,400	貸付有価証券 5,900株(1,700株)
クオール	15,900	1,425.00	22,657,500	貸付有価証券 6,600株
ジェイアイエヌ	9,600	5,220.00	50,112,000	貸付有価証券 4,500株(3,400株)
ビックカメラ	80,900	1,070.00	86,563,000	貸付有価証券 36,000株
DCMホールディングス	85,500	1,017.00	86,953,500	貸付有価証券 17,900株(17,700株)
Monotaro	49,800	2,465.00	122,757,000	貸付有価証券 23,700株(15,000株)
東京一番フーズ	3,500	543.00	1,900,500	貸付有価証券 1,600株(800株)
ダイヤモンドダイニング	3,100	1,215.00	3,766,500	貸付有価証券 700株
きちり	3,700	687.00	2,541,900	貸付有価証券 1,700株(1,200株)
アークランドサービスホールディングス	4,400	2,998.00	13,191,200	貸付有価証券 2,000株
J.フロントリテイリング	178,300	1,687.00	300,792,100	

ドトール・日レスホールディングス	24,700	2,142.00	52,907,400	
マツモトキヨシホールディングス	26,600	5,930.00	157,738,000	
ブロンコピリー	7,300	3,005.00	21,936,500	貸付有価証券 3,400株
スタートトゥデイ	128,600	2,044.00	262,858,400	
トレジャー・ファクトリー	4,000	892.00	3,568,000	貸付有価証券 400株
物語コーポレーション	3,700	4,235.00	15,669,500	貸付有価証券 1,700株
ココカラファイン	14,700	4,395.00	64,606,500	
三越伊勢丹ホールディングス	280,300	1,310.00	367,193,000	貸付有価証券 16,900株
H a m e e	2,100	925.00	1,942,500	貸付有価証券 900株（100株）
ウエルシアホールディングス	13,900	7,110.00	98,829,000	
クリエイイトSDホールディングス	20,700	2,551.00	52,805,700	
丸善CHIホールディングス	16,400	364.00	5,969,600	貸付有価証券 300株
ミサワ	2,500	485.00	1,212,500	貸付有価証券 1,000株
ティーライフ	1,300	1,384.00	1,799,200	
エー・ピーカンパニー	2,300	716.00	1,646,800	貸付有価証券 1,000株
チムニー	4,300	2,930.00	12,599,000	貸付有価証券 2,000株
シュッピン	5,300	1,439.00	7,626,700	貸付有価証券 2,400株（100株）
ネクステージ	2,700	2,004.00	5,410,800	貸付有価証券 1,100株（300株）
ジョイフル本田	22,900	3,195.00	73,165,500	貸付有価証券 1,900株
鳥貴族	3,500	2,485.00	8,697,500	貸付有価証券 700株（700株）
麒麟堂ホールディングス	4,500	840.00	3,780,000	
ホットランド	6,500	1,242.00	8,073,000	貸付有価証券 3,100株（1,600株）
すかいらーく	60,400	1,623.00	98,029,200	貸付有価証券

				28,300株
綿半ホールディングス	5,700	1,671.00	9,524,700	貸付有価証券 2,200株(500株)
ヨシックス	1,400	1,357.00	1,899,800	貸付有価証券 500株
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	46,700	985.00	45,999,500	貸付有価証券 13,900株
ブックオフコーポレー ション	8,000	789.00	6,312,000	貸付有価証券 3,700株(800株)
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	5,600	907.00	5,079,200	貸付有価証券 1,200株
B E E N O S	1,600	1,542.00	2,467,200	
あさひ	10,500	1,296.00	13,608,000	貸付有価証券 4,100株
日本調剤	5,000	4,515.00	22,575,000	貸付有価証券 2,300株
コスモス薬品	7,100	21,540.00	152,934,000	貸付有価証券 2,300株(1,600株)
トーエル	6,800	915.00	6,222,000	貸付有価証券 3,100株(800株)
一六堂	3,000	359.00	1,077,000	
オンリー	1,600	787.00	1,259,200	
セブン & アイ・ホール ディングス	589,700	4,512.00	2,660,726,400	
薬王堂	7,000	2,182.00	15,274,000	貸付有価証券 1,100株
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	37,800	1,023.00	38,669,400	貸付有価証券 2,500株
ツルハホールディングス	32,500	11,310.00	367,575,000	
サンマルクホールディン グス	9,100	3,535.00	32,168,500	貸付有価証券 3,300株
フェリシモ	4,000	1,021.00	4,084,000	
トリドールホールディン グス	17,300	2,467.00	42,679,100	貸付有価証券 6,900株
サツドラホールディン グス	1,900	1,953.00	3,710,700	貸付有価証券 100株
ダイユー・リックホール ディングス	4,500	697.00	3,136,500	
クスリのアオキホール ディングス	12,500	5,260.00	65,750,000	貸付有価証券 700株
メディカルシステムネッ	15,900	429.00	6,821,100	貸付有価証券

トワーク				7,400株
総合メディカル	6,800	4,015.00	27,302,000	貸付有価証券 1,000株
はるやま商事	6,600	859.00	5,669,400	
ノジマ	16,300	1,295.00	21,108,500	貸付有価証券 1,000株
カップ・クリエイト	19,700	1,301.00	25,629,700	貸付有価証券 9,300株(1,800株)
ライトオン	10,500	1,025.00	10,762,500	貸付有価証券 4,800株
ジーンズメイト	4,500	188.00	846,000	貸付有価証券 1,200株(1,000株)
良品計画	18,700	22,990.00	429,913,000	貸付有価証券 5,800株
三城ホールディングス	17,400	456.00	7,934,400	貸付有価証券 100株(100株)
アドヴァン	14,300	1,198.00	17,131,400	
アルピス	3,700	3,330.00	12,321,000	
コナカ	17,900	570.00	10,203,000	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,542.00	2,621,400	貸付有価証券 100株(100株)
G - 7ホールディングス	4,100	1,504.00	6,166,400	
イオン北海道	14,100	590.00	8,319,000	貸付有価証券 600株
コジマ	20,700	287.00	5,940,900	貸付有価証券 2,200株
ヒマラヤ	4,400	854.00	3,757,600	貸付有価証券 300株
コーナン商事	20,000	2,272.00	45,440,000	
エコス	5,400	1,272.00	6,868,800	貸付有価証券 200株(100株)
ワタミ	16,600	1,098.00	18,226,800	貸付有価証券 5,400株(5,400株)
マルシェ	3,100	821.00	2,545,100	貸付有価証券 1,300株(100株)
ドンキホーテホールディングス	91,100	4,375.00	398,562,500	貸付有価証券 3,800株
西松屋チェーン	24,700	1,427.00	35,246,900	
ゼンショーホールディングス	73,000	1,896.00	138,408,000	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
幸楽苑ホールディングス	8,900	1,628.00	14,489,200	貸付有価証券

				2,000株(1,900株)
ハークスレイ	3,400	1,089.00	3,702,600	
サイゼリヤ	23,200	2,701.00	62,663,200	
V Tホールディングス	47,600	584.00	27,798,400	
魚力	4,400	1,252.00	5,508,800	
ポブラ	3,500	501.00	1,753,500	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
フジ・コーポレーション	2,100	2,250.00	4,725,000	
ユナイテッドアローズ	18,800	3,405.00	64,014,000	貸付有価証券 300株
ハイデイ日高	12,800	2,731.00	34,956,800	貸付有価証券 600株
京都きもの友禅	8,900	938.00	8,348,200	貸付有価証券 3,300株
コロワイド	46,700	1,893.00	88,403,100	貸付有価証券 15,900株
ピーシーデポコーポレーション	18,700	675.00	12,622,500	貸付有価証券 8,800株
壱番屋	12,700	3,800.00	48,260,000	貸付有価証券 4,700株
トップカルチャー	5,100	481.00	2,453,100	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
P L A N T	3,200	1,204.00	3,852,800	貸付有価証券 800株
スギホールディングス	30,900	5,630.00	173,967,000	
スクロール	21,300	352.00	7,497,600	貸付有価証券 2,100株
ヨンドシーホールディングス	10,700	2,484.00	26,578,800	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
ユニー・ファミリーマートホールディングス	61,800	7,910.00	488,838,000	貸付有価証券 12,300株
木曽路	17,200	2,369.00	40,746,800	
サトレストランシステムズ	16,600	812.00	13,479,200	貸付有価証券 7,100株
千趣会	25,500	740.00	18,870,000	貸付有価証券 12,000株(200株)
タカキュー	10,800	190.00	2,052,000	
ケーヨー	23,700	553.00	13,106,100	貸付有価証券 11,100株
上新電機	33,000	960.00	31,680,000	
日本瓦斯	25,800	3,395.00	87,591,000	貸付有価証券

				1,600株
ベスト電器	45,400	157.00	7,127,800	貸付有価証券 14,100株(14,100株)
ロイヤルホールディングス	23,300	1,988.00	46,320,400	貸付有価証券 11,000株
東天紅	11,000	150.00	1,650,000	
いなげや	15,700	1,477.00	23,188,900	貸付有価証券 5,200株(4,700株)
島忠	36,400	3,160.00	115,024,000	貸付有価証券 12,000株
チヨダ	16,600	2,750.00	45,650,000	貸付有価証券 400株
ライフコーポレーション	10,700	3,380.00	36,166,000	貸付有価証券 700株(100株)
リンガーハット	15,900	2,251.00	35,790,900	
さが美	13,000	128.00	1,664,000	貸付有価証券 5,000株
MrMax	17,600	426.00	7,497,600	
テンアライド	13,000	377.00	4,901,000	貸付有価証券 6,100株
AOKIホールディングス	28,100	1,469.00	41,278,900	
オークワ	20,000	1,180.00	23,600,000	
コメリ	21,700	2,716.00	58,937,200	貸付有価証券 2,200株
青山商事	29,500	4,145.00	122,277,500	
しまむら	16,400	14,170.00	232,388,000	
はせがわ	7,400	441.00	3,263,400	貸付有価証券 1,500株(1,000株)
高島屋	236,000	1,036.00	244,496,000	貸付有価証券 85,000株(72,000株)
松屋	30,700	1,083.00	33,248,100	貸付有価証券 14,400株(300株)
エイチ・ツー・オー テイリング	72,200	1,835.00	132,487,000	貸付有価証券 1,900株
近鉄百貨店	54,000	352.00	19,008,000	貸付有価証券 22,000株
丸栄	29,000	87.00	2,523,000	貸付有価証券 7,000株
パルコ	13,500	1,035.00	13,972,500	貸付有価証券 700株

丸井グループ	148,200	1,757.00	260,387,400	貸付有価証券 8,000株(600株)
アクシアル リテイリング	10,900	3,970.00	43,273,000	
井筒屋	7,600	395.00	3,002,000	
イオン	579,800	1,699.00	985,080,200	貸付有価証券 203,700株
イズミ	28,000	5,100.00	142,800,000	貸付有価証券 8,900株
東武ストア	1,700	2,825.00	4,802,500	
平和堂	28,500	2,522.00	71,877,000	
フジ	15,600	2,441.00	38,079,600	
ヤオコー	16,000	4,660.00	74,560,000	貸付有価証券 7,100株
ゼビオホールディングス	19,100	1,848.00	35,296,800	
ケーズホールディングス	64,900	2,055.00	133,369,500	貸付有価証券 30,500株(29,000株)
O l y m p i c グループ	8,300	616.00	5,112,800	
日産東京販売ホールディングス	20,700	335.00	6,934,500	
アインホールディングス	17,000	7,670.00	130,390,000	貸付有価証券 7,700株(1,200株)
元気寿司	3,500	2,093.00	7,325,500	
ヤマダ電機	471,300	633.00	298,332,900	貸付有価証券 223,200株(156,100株)
アークランドサカモト	23,800	1,431.00	34,057,800	
ニトリホールディングス	60,900	13,220.00	805,098,000	
グルメ杵屋	10,000	1,002.00	10,020,000	貸付有価証券 2,000株
愛眼	10,300	198.00	2,039,400	貸付有価証券 4,500株(3,500株)
ケーユーホールディングス	7,300	824.00	6,015,200	貸付有価証券 100株
吉野家ホールディングス	49,100	1,582.00	77,676,200	貸付有価証券 18,000株(300株)
松屋フーズ	6,800	3,775.00	25,670,000	貸付有価証券 200株(200株)
サガミチェーン	17,600	1,288.00	22,668,800	貸付有価証券 1,400株
関西スーパーマーケット	11,500	1,509.00	17,353,500	貸付有価証券



				5,500株（5,200株）
王将フードサービス	10,300	4,360.00	44,908,000	貸付有価証券 1,900株
プレナス	15,700	2,287.00	35,905,900	貸付有価証券 7,400株（200株）
ミニストップ	10,400	2,087.00	21,704,800	貸付有価証券 4,900株
アークス	26,400	2,675.00	70,620,000	
バローホールディングス	30,300	3,140.00	95,142,000	
藤久	1,100	1,744.00	1,918,400	貸付有価証券 500株
ベルク	6,200	4,575.00	28,365,000	
大庄	7,500	1,559.00	11,692,500	貸付有価証券 1,300株
ファーストリテイリング	23,500	43,340.00	1,018,490,000	貸付有価証券 1,600株（500株）
サンドラッグ	26,800	8,140.00	218,152,000	
サックスパー ホール ディングス	13,200	1,177.00	15,536,400	貸付有価証券 6,200株
ヤマザワ	2,900	1,754.00	5,086,600	
やまや	2,900	1,724.00	4,999,600	
ベルーナ	35,100	714.00	25,061,400	
島根銀行	3,000	1,368.00	4,104,000	
じもとホールディングス	101,100	202.00	20,422,200	貸付有価証券 3,200株
めぶきフィナンシャルグ ループ	679,500	439.00	298,300,500	
東京T Yフィナンシャル グループ	20,400	4,175.00	85,170,000	貸付有価証券 1,700株
九州フィナンシャルグ ループ	231,100	806.00	186,266,600	貸付有価証券 99,500株
ゆうちょ銀行	399,000	1,421.00	566,979,000	貸付有価証券 130,400株
富山第一銀行	35,800	541.00	19,367,800	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	922,500	566.50	522,596,250	
西日本フィナンシャル ホールディングス	95,500	1,219.00	116,414,500	
新生銀行	1,341,000	202.00	270,882,000	貸付有価証券 593,000株（19,000

				株)
あおぞら銀行	891,000	423.00	376,893,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,677,700	736.20	7,860,922,740	貸付有価証券 1,364,000株
りそなホールディングス	1,648,400	613.50	1,011,293,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	294,200	4,355.00	1,281,241,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,128,300	4,564.00	5,149,561,200	貸付有価証券 112,100株
第四銀行	173,000	526.00	90,998,000	貸付有価証券 4,000株
北越銀行	15,200	2,622.00	39,854,400	貸付有価証券 700株
千葉銀行	543,000	718.00	389,874,000	
群馬銀行	313,100	651.00	203,828,100	
武蔵野銀行	22,500	3,430.00	77,175,000	貸付有価証券 1,400株
千葉興業銀行	38,600	600.00	23,160,000	
筑波銀行	58,600	350.00	20,510,000	
七十七銀行	221,000	574.00	126,854,000	
青森銀行	109,000	392.00	42,728,000	貸付有価証券 34,000株(34,000株)
秋田銀行	92,000	376.00	34,592,000	
山形銀行	79,000	491.00	38,789,000	貸付有価証券 37,000株(8,000株)
岩手銀行	9,200	4,740.00	43,608,000	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
東邦銀行	126,000	441.00	55,566,000	貸付有価証券 2,000株
東北銀行	72,000	154.00	11,088,000	
みちのく銀行	70,000	223.00	15,610,000	貸付有価証券 30,000株(18,000株)
ふくおかフィナンシャルグループ	572,000	531.00	303,732,000	貸付有価証券 13,000株
静岡銀行	383,000	1,003.00	384,149,000	貸付有価証券 3,000株
十六銀行	189,000	413.00	78,057,000	貸付有価証券 4,000株
スルガ銀行	144,100	2,619.00	377,397,900	貸付有価証券 67,700株
八十二銀行	271,900	694.00	188,698,600	

山梨中央銀行	87,000	570.00	49,590,000	
大垣共立銀行	188,000	456.00	85,728,000	貸付有価証券 30,000株
福井銀行	120,000	295.00	35,400,000	
北國銀行	150,000	414.00	62,100,000	貸付有価証券 20,000株
清水銀行	4,800	3,760.00	18,048,000	
富山銀行	2,700	4,430.00	11,961,000	貸付有価証券 100株
滋賀銀行	132,000	648.00	85,536,000	貸付有価証券 49,000株（44,000株）
南都銀行	13,600	4,500.00	61,200,000	貸付有価証券 200株
百五銀行	127,000	482.00	61,214,000	
京都銀行	252,000	902.00	227,304,000	貸付有価証券 124,000株
紀陽銀行	55,300	1,892.00	104,627,600	
三重銀行	6,300	2,352.00	14,817,600	
ほくほくフィナンシャル グループ	93,700	2,028.00	190,023,600	
広島銀行	416,000	557.00	231,712,000	貸付有価証券 104,000株
山陰合同銀行	84,700	977.00	82,751,900	貸付有価証券 900株
中国銀行	99,900	1,687.00	168,531,300	
鳥取銀行	4,500	1,898.00	8,541,000	
伊予銀行	150,700	843.00	127,040,100	貸付有価証券 22,900株
百十四銀行	155,000	401.00	62,155,000	貸付有価証券 1,000株
四国銀行	109,000	285.00	31,065,000	貸付有価証券 13,000株
阿波銀行	120,000	714.00	85,680,000	貸付有価証券 15,000株
大分銀行	81,000	444.00	35,964,000	貸付有価証券 38,000株
宮崎銀行	94,000	359.00	33,746,000	
佐賀銀行	85,000	301.00	25,585,000	
十八銀行	87,000	351.00	30,537,000	貸付有価証券 1,000株
沖縄銀行	13,700	4,275.00	58,567,500	貸付有価証券

				700株
琉球銀行	29,000	1,549.00	44,921,000	貸付有価証券 4,300株
セブン銀行	528,200	342.00	180,644,400	貸付有価証券 248,300株
みずほフィナンシャルグループ	19,131,100	214.90	4,111,273,390	
高知銀行	51,000	132.00	6,732,000	
山口フィナンシャルグループ	132,000	1,284.00	169,488,000	貸付有価証券 62,000株(27,000株)
長野銀行	4,600	2,022.00	9,301,200	貸付有価証券 2,100株(300株)
名古屋銀行	11,800	4,240.00	50,032,000	貸付有価証券 5,500株(1,000株)
北洋銀行	230,000	494.00	113,620,000	
愛知銀行	4,700	6,770.00	31,819,000	
第三銀行	8,000	1,834.00	14,672,000	貸付有価証券 500株(200株)
中京銀行	5,800	2,333.00	13,531,400	貸付有価証券 200株
大光銀行	50,000	271.00	13,550,000	
愛媛銀行	16,600	1,358.00	22,542,800	貸付有価証券 7,800株(5,600株)
トマト銀行	5,400	1,625.00	8,775,000	
みなと銀行	12,800	2,125.00	27,200,000	
京葉銀行	115,000	529.00	60,835,000	
関西アーバン銀行	19,600	1,460.00	28,616,000	貸付有価証券 300株
栃木銀行	77,700	577.00	44,832,900	
北日本銀行	4,400	3,035.00	13,354,000	
東和銀行	264,000	113.00	29,832,000	
福島銀行	153,000	97.00	14,841,000	貸付有価証券 44,000株
大東銀行	73,000	167.00	12,191,000	貸付有価証券 26,000株(11,000株)
トモニホールディングス	116,100	613.00	71,169,300	貸付有価証券 10,200株
フィデアホールディングス	136,700	212.00	28,980,400	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
池田泉州ホールディングス	149,500	547.00	81,776,500	貸付有価証券 2,400株

F P G	50,200	975.00	48,945,000	貸付有価証券 23,500株
S B Iホールディングス	159,300	1,527.00	243,251,100	
日本アジア投資	13,400	605.00	8,107,000	貸付有価証券 6,400株(300株)
ジャフコ	23,500	3,880.00	91,180,000	
大和証券グループ本社	1,318,000	742.50	978,615,000	
野村ホールディングス	2,880,700	709.40	2,043,568,580	
岡三証券グループ	120,000	734.00	88,080,000	
丸三証券	44,800	1,007.00	45,113,600	貸付有価証券 7,500株
東洋証券	50,000	278.00	13,900,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	161,700	637.00	103,002,900	貸付有価証券 76,000株
光世証券	34,000	204.00	6,936,000	
水戸証券	43,600	330.00	14,388,000	貸付有価証券 800株
いちよし証券	31,500	921.00	29,011,500	
松井証券	80,500	1,026.00	82,593,000	貸付有価証券 7,800株
だいこう証券ビジネス	6,800	648.00	4,406,400	
マネックスグループ	151,100	332.00	50,165,200	貸付有価証券 72,000株(17,400株)
カブドットコム証券	105,100	415.00	43,616,500	貸付有価証券 3,200株
極東証券	18,900	1,742.00	32,923,800	貸付有価証券 3,500株
岩井コスモホールディングス	13,300	1,123.00	14,935,900	貸付有価証券 300株
藍澤證券	26,300	657.00	17,279,100	
マネースクウェアHD	1,000	1,242.00	1,242,000	
マネーパートナーズグループ	18,000	545.00	9,810,000	貸付有価証券 8,400株
小林洋行	4,000	276.00	1,104,000	貸付有価証券 1,800株(1,500株)
かんぽ生命保険	53,200	2,541.00	135,181,200	貸付有価証券 4,500株
S O M P Oホールディングス	294,600	4,006.00	1,180,167,600	
アニコムホールディング	9,500	2,362.00	22,439,000	貸付有価証券

グス				4,500株
MS & A Dインシュアランスグループホール	421,100	3,676.00	1,547,963,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	135,000	1,857.00	250,695,000	貸付有価証券 11,200株(500株)
第一生命ホールディングス	849,700	1,950.00	1,656,915,000	
東京海上ホールディングス	570,900	4,863.00	2,776,286,700	
T & Dホールディングス	513,600	1,540.50	791,200,800	
アドバンスクリエイト	3,300	1,790.00	5,907,000	貸付有価証券 1,100株
全国保証	39,700	3,755.00	149,073,500	
クレディセゾン	106,900	2,145.00	229,300,500	貸付有価証券 5,300株
アクリーティブ	11,600	478.00	5,544,800	貸付有価証券 5,400株(300株)
芙蓉総合リース	16,100	5,680.00	91,448,000	
興銀リース	26,500	2,614.00	69,271,000	
東京センチュリー	28,400	4,015.00	114,026,000	
日本証券金融	62,100	651.00	40,427,100	貸付有価証券 6,700株
アイフル	236,300	347.00	81,996,100	貸付有価証券 28,000株(3,200株)
ポケットカード	10,500	547.00	5,743,500	貸付有価証券 900株
リコーリース	11,100	3,650.00	40,515,000	貸付有価証券 5,200株(900株)
イオンフィナンシャルサービス	90,000	2,136.00	192,240,000	貸付有価証券 42,300株
アコム	283,000	518.00	146,594,000	貸付有価証券 85,600株(300株)
ジャックス	78,000	532.00	41,496,000	
オリエントコーポレーション	304,700	218.00	66,424,600	
日立キャピタル	33,200	2,945.00	97,774,000	貸付有価証券 15,700株
アプラスフィナンシャル	67,600	123.00	8,314,800	貸付有価証券 20,800株
オリックス	997,800	1,833.50	1,829,466,300	
三菱UFJリース	357,400	609.00	217,656,600	

日本取引所グループ	438,100	1,711.00	749,589,100	
イー・ギャランティ	4,100	2,449.00	10,040,900	貸付有価証券 1,500株
アサックス	2,400	1,639.00	3,933,600	
NECキャピタルソ リューション	5,700	1,835.00	10,459,500	貸付有価証券 400株
いちご	133,800	435.00	58,203,000	貸付有価証券 63,700株（15,000株）
日本駐車場開発	169,800	168.00	28,526,400	貸付有価証券 41,400株
ヒューリック	293,800	1,075.00	315,835,000	貸付有価証券 600株
三栄建築設計	5,600	1,690.00	9,464,000	貸付有価証券 300株
野村不動産ホールディ ングス	93,500	2,020.00	188,870,000	貸付有価証券 3,500株
三重交通グループホール ディングス	25,000	391.00	9,775,000	貸付有価証券 1,900株
サムティ	11,300	1,116.00	12,610,800	貸付有価証券 5,400株（3,000株）
ディア・ライフ	9,500	384.00	3,648,000	貸付有価証券 100株（100株）
エー・ディー・ワークス	129,000	45.00	5,805,000	貸付有価証券 10,200株
日本商業開発	7,800	2,044.00	15,943,200	貸付有価証券 1,900株
プレサンスコーポレー ション	21,900	1,479.00	32,390,100	
ユニゾホールディングス	11,600	3,170.00	36,772,000	貸付有価証券 300株
THEグローバル社	4,900	465.00	2,278,500	
日本管理センター	10,100	1,381.00	13,948,100	貸付有価証券 4,700株
サンセイランディック	2,900	712.00	2,064,800	貸付有価証券 100株
エストラスト	2,500	625.00	1,562,500	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
フージャースホールディ ングス	18,200	619.00	11,265,800	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
オープンハウス	20,400	2,849.00	58,119,600	
東急不動産ホールディ ングス	340,900	706.00	240,675,400	貸付有価証券 900株

飯田グループホールディングス	117,500	2,243.00	263,552,500	
ムゲンエステート	4,900	747.00	3,660,300	貸付有価証券 2,300株
ファーストブラザーズ	1,400	1,734.00	2,427,600	
シーアールイー	2,000	1,533.00	3,066,000	貸付有価証券 400株
パーク24	71,400	3,180.00	227,052,000	貸付有価証券 33,500株
パラカ	4,000	1,994.00	7,976,000	貸付有価証券 200株
三井不動産	747,000	2,763.00	2,063,961,000	
三菱地所	1,048,000	2,364.50	2,477,996,000	貸付有価証券 4,000株
平和不動産	26,600	1,638.00	43,570,800	貸付有価証券 1,500株
東京建物	163,500	1,618.00	264,543,000	貸付有価証券 76,800株(76,800株)
ダイビル	36,300	1,015.00	36,844,500	
京阪神ビルディング	23,300	613.00	14,282,900	
住友不動産	338,000	3,211.00	1,085,318,000	
大京	262,000	239.00	62,618,000	貸付有価証券 2,000株
テーオーシー	54,600	941.00	51,378,600	貸付有価証券 11,300株
東京楽天地	23,000	518.00	11,914,000	
レオパレス21	177,800	629.00	111,836,200	
スターツコーポレーション	14,400	1,968.00	28,339,200	
フジ住宅	18,000	752.00	13,536,000	
空港施設	17,000	567.00	9,639,000	
明和地所	7,700	697.00	5,366,900	
住友不動産販売	12,700	2,826.00	35,890,200	
ゴールドクレスト	12,700	2,137.00	27,139,900	
日本エスリード	5,500	1,351.00	7,430,500	
日神不動産	16,700	553.00	9,235,100	
日本エスコン	18,800	449.00	8,441,200	貸付有価証券 8,800株(4,700株)
タカラレーベン	61,400	690.00	42,366,000	貸付有価証券 17,600株(4,800株)



サンヨーハウジング名古屋	7,300	1,082.00	7,898,600	
イオンモール	90,700	1,717.00	155,731,900	
ファースト住建	5,200	1,513.00	7,867,600	
トーセイ	19,300	890.00	17,177,000	貸付有価証券 300株（300株）
穴吹興産	15,000	258.00	3,870,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	87,500	1,072.00	93,800,000	
サンフロンティア不動産	15,200	1,060.00	16,112,000	貸付有価証券 2,300株
エフ・ジェー・ネクスト	12,300	734.00	9,028,200	
インテリックス	2,900	736.00	2,134,400	貸付有価証券 1,400株
ランドビジネス	8,300	271.00	2,249,300	
グランディハウス	12,300	401.00	4,932,300	
日本空港ビルデング	44,900	4,405.00	197,784,500	貸付有価証券 20,900株
日本工営	50,000	530.00	26,500,000	
ネクスト	36,900	754.00	27,822,600	貸付有価証券 17,500株
ジェイエイシーリクルートメント	9,200	1,298.00	11,941,600	貸付有価証券 4,200株（100株）
日本M&Aセンター	43,000	3,200.00	137,600,000	貸付有価証券 600株
アコーディア・ゴルフ	45,100	1,201.00	54,165,100	
中広	1,400	691.00	967,400	
タケエイ	13,100	903.00	11,829,300	貸付有価証券 3,500株
トラスト・テック	6,000	1,723.00	10,338,000	
パソナグループ	12,900	793.00	10,229,700	貸付有価証券 6,100株（4,500株）
CDS	3,400	1,047.00	3,559,800	貸付有価証券 300株
リンクアンドモチベーション	35,100	425.00	14,917,500	貸付有価証券 5,900株
GCA	13,200	868.00	11,457,600	貸付有価証券 3,300株
エス・エム・エス	20,400	2,576.00	52,550,400	貸付有価証券 9,500株（4,200株）
テンプホールディングス	115,300	1,791.00	206,502,300	貸付有価証券

				11,100株
リニカル	8,800	1,235.00	10,868,000	貸付有価証券 4,100株
クックパッド	33,300	1,107.00	36,863,100	貸付有価証券 15,600株(1,000株)
エスクリ	5,300	605.00	3,206,500	貸付有価証券 2,400株(1,400株)
アイ・ケイ・ケイ	6,600	672.00	4,435,200	貸付有価証券 3,100株
学情	6,200	1,189.00	7,371,800	貸付有価証券 2,800株(600株)
スタジオアリス	6,100	2,275.00	13,877,500	
シミックホールディングス	7,500	1,482.00	11,115,000	貸付有価証券 1,900株(1,600株)
N J S	3,300	1,398.00	4,613,400	
総合警備保障	54,300	4,510.00	244,893,000	貸付有価証券 8,100株
カカクコム	106,400	1,921.00	204,394,400	貸付有価証券 2,500株
ルネサンス	7,600	1,459.00	11,088,400	貸付有価証券 3,500株
ディップ	19,200	2,367.00	45,446,400	貸付有価証券 1,000株
オプトホールディング	10,700	720.00	7,704,000	貸付有価証券 200株
新日本科学	16,600	580.00	9,628,000	貸付有価証券 7,800株
ツクイ	35,300	749.00	26,439,700	貸付有価証券 600株
キャリアデザインセンター	3,100	1,241.00	3,847,100	
エムスリー	129,200	2,893.00	373,775,600	貸付有価証券 31,700株
ツカダ・グローバルホールディング	10,900	717.00	7,815,300	貸付有価証券 2,800株
アウトソーシング	8,500	3,340.00	28,390,000	貸付有価証券 3,900株(3,800株)
ウェルネット	11,200	1,306.00	14,627,200	貸付有価証券 4,200株
ワールドホールディングス	3,400	2,186.00	7,432,400	貸付有価証券 1,500株
ディー・エヌ・エー	66,900	2,576.00	172,334,400	貸付有価証券

				24,200株
博報堂D Yホールディングス	206,700	1,435.00	296,614,500	
ぐるなび	21,600	2,320.00	50,112,000	
エスアールジータカミヤ	16,100	610.00	9,821,000	貸付有価証券 7,500株
ジャパンベストレスキューシステム	18,500	245.00	4,532,500	貸付有価証券 8,600株(4,600株)
ファンコミュニケーションズ	37,900	736.00	27,894,400	貸付有価証券 8,500株(4,700株)
ライク	3,100	1,874.00	5,809,400	貸付有価証券 1,300株
WDBホールディングス	5,300	1,228.00	6,508,400	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ティア	7,200	631.00	4,543,200	貸付有価証券 500株(500株)
バリューコマース	13,800	326.00	4,498,800	貸付有価証券 300株(300株)
インフォマート	31,600	1,366.00	43,165,600	貸付有価証券 14,800株(200株)
J Pホールディングス	42,800	255.00	10,914,000	貸付有価証券 20,300株(1,400株)
E P Sホールディングス	18,500	1,344.00	24,864,000	
レッグス	3,400	885.00	3,009,000	貸付有価証券 1,500株
プレステージ・インターナショナル	21,100	747.00	15,761,700	貸付有価証券 600株
アミューズ	8,300	1,813.00	15,047,900	
ドリームインキュベータ	4,500	1,994.00	8,973,000	貸付有価証券 1,800株
クイック	7,600	1,047.00	7,957,200	
T A C	8,200	229.00	1,877,800	
ケネディクス	200,200	426.00	85,285,200	貸付有価証券 50,400株
電通	166,200	5,650.00	939,030,000	貸付有価証券 2,800株
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,900	727.00	5,016,300	貸付有価証券 3,100株
ぴあ	4,500	2,901.00	13,054,500	貸付有価証券 2,000株
イオンファンタジー	4,400	3,065.00	13,486,000	貸付有価証券

				2,000株
シーティーエス	4,000	1,242.00	4,968,000	貸付有価証券 100株
ネクシィーズグループ	5,400	1,473.00	7,954,200	貸付有価証券 2,500株(2,000株)
みらかホールディングス	38,100	5,190.00	197,739,000	
アルプス技研	6,000	2,510.00	15,060,000	
ダイオーズ	2,700	1,063.00	2,870,100	
日本空調サービス	14,300	613.00	8,765,900	貸付有価証券 400株
オリエンタルランド	161,200	6,659.00	1,073,430,800	貸付有価証券 4,400株(1,900株)
ダスキン	38,200	2,341.00	89,426,200	貸付有価証券 1,500株
明光ネットワークジャパン	18,500	1,079.00	19,961,500	貸付有価証券 6,100株(4,300株)
ファルコホールディングス	7,000	1,449.00	10,143,000	
秀英予備校	3,000	407.00	1,221,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
田谷	2,500	629.00	1,572,500	
ラウンドワン	46,500	785.00	36,502,500	
リゾートトラスト	57,700	2,183.00	125,959,100	貸付有価証券 25,500株(1,500株)
ビー・エム・エル	19,500	2,772.00	54,054,000	
ワタベウェディング	2,200	416.00	915,200	貸付有価証券 900株
りらいあコミュニケーションズ	24,600	1,130.00	27,798,000	貸付有価証券 5,600株
リソー教育	25,400	570.00	14,478,000	貸付有価証券 1,300株
早稲田アカデミー	1,900	993.00	1,886,700	
ユー・エス・エス	180,500	1,865.00	336,632,500	貸付有価証券 42,000株
東京個別指導学院	4,800	813.00	3,902,400	貸付有価証券 2,300株
サイバーエージェント	78,500	2,753.00	216,110,500	貸付有価証券 30,200株(30,200株)
楽天	761,800	1,158.00	882,164,400	貸付有価証券 2,600株
クリーク・アンド・リ	5,300	780.00	4,134,000	貸付有価証券

バー社				100株(100株)
テー・オー・ダブリュー	11,900	666.00	7,925,400	貸付有価証券 3,600株
セントラルスポーツ	5,100	2,681.00	13,673,100	貸付有価証券 100株
フルキャストホールディングス	15,400	949.00	14,614,600	貸付有価証券 7,200株
リソルホールディングス	15,000	328.00	4,920,000	
テクノプロ・ホールディングス	24,200	3,770.00	91,234,000	貸付有価証券 100株(100株)
アトラ	1,700	834.00	1,417,800	貸付有価証券 700株
インターワークス	3,000	1,010.00	3,030,000	
Keepers 技研	1,600	1,915.00	3,064,000	貸付有価証券 700株
ファーストロジック	800	2,129.00	1,703,200	
デザインワン・ジャパン	1,000	2,159.00	2,159,000	
イー・ガーディアン	4,800	1,264.00	6,067,200	貸付有価証券 2,300株
リブセンス	10,000	446.00	4,460,000	貸付有価証券 4,500株(2,400株)
ジャパンマテリアル	5,400	3,575.00	19,305,000	貸付有価証券 2,500株
ベクトル	12,000	1,099.00	13,188,000	貸付有価証券 4,300株(2,600株)
ウチヤマホールディングス	6,700	429.00	2,874,300	貸付有価証券 700株
サクセスホールディングス	1,200	1,203.00	1,443,600	
キャリアリンク	3,300	796.00	2,626,800	貸付有価証券 1,200株
I B J	11,600	635.00	7,366,000	貸付有価証券 5,400株
アサンテ	5,500	1,710.00	9,405,000	
N・フィールド	7,000	1,406.00	9,842,000	貸付有価証券 3,300株(100株)
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	3,045.00	5,785,500	貸付有価証券 800株
ライドオン・エクスプレス	3,700	868.00	3,211,600	貸付有価証券 1,700株(600株)
E R Iホールディングス	3,800	756.00	2,872,800	貸付有価証券

				900株
アビスト	2,300	3,135.00	7,210,500	貸付有価証券 700株(700株)
ウィルグループ	5,900	604.00	3,563,600	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	2,500	1,509.00	3,772,500	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
日本ビューホテル	2,100	1,488.00	3,124,800	貸付有価証券 900株(400株)
リクルートホールディン グス	325,800	4,655.00	1,516,599,000	
エラン	2,000	1,314.00	2,628,000	
土木管理総合試験所	1,500	793.00	1,189,500	
日本郵政	389,200	1,489.00	579,518,800	
ベルシステム24ホール ディングス	22,700	949.00	21,542,300	貸付有価証券 8,400株
ソラスト	6,800	1,185.00	8,058,000	
リログループ	5,600	16,250.00	91,000,000	貸付有価証券 2,600株
東祥	3,200	5,310.00	16,992,000	貸付有価証券 1,500株
エイチ・アイ・エス	24,300	3,025.00	73,507,500	貸付有価証券 11,500株(2,500株)
ラックランド	2,600	2,067.00	5,374,200	貸付有価証券 1,200株
共立メンテナンス	12,100	7,050.00	85,305,000	貸付有価証券 5,100株(4,900株)
イチネンホールディン グス	15,600	1,143.00	17,830,800	
建設技術研究所	9,400	1,070.00	10,058,000	
スペース	8,000	1,285.00	10,280,000	
燦ホールディングス	3,000	1,558.00	4,674,000	
スバル興業	11,000	492.00	5,412,000	貸付有価証券 5,000株
東京テアトル	57,000	154.00	8,778,000	貸付有価証券 26,000株(26,000株)
タナベ経営	2,900	1,288.00	3,735,200	
ナガワ	2,700	4,200.00	11,340,000	
よみうりランド	30,000	497.00	14,910,000	貸付有価証券 1,000株
東京都競馬	102,000	276.00	28,152,000	貸付有価証券 47,000株

常磐興産	5,500	1,555.00	8,552,500	貸付有価証券 2,100株(100株)
カナモト	20,800	3,120.00	64,896,000	
東京ドーム	59,500	1,170.00	69,615,000	貸付有価証券 300株
西尾レントオール	12,000	3,605.00	43,260,000	
トランス・コスモス	17,300	2,733.00	47,280,900	貸付有価証券 5,900株
乃村工藝社	31,900	1,680.00	53,592,000	
藤田観光	49,000	373.00	18,277,000	貸付有価証券 23,000株
KNT-CTホールディングス	84,000	144.00	12,096,000	貸付有価証券 39,000株
日本管財	12,800	1,800.00	23,040,000	
トーカイ	6,600	3,980.00	26,268,000	
白洋舎	1,400	2,732.00	3,824,800	貸付有価証券 600株
セコム	155,100	8,582.00	1,331,068,200	貸付有価証券 12,600株
セントラル警備保障	6,600	1,942.00	12,817,200	貸付有価証券 3,100株
丹青社	25,800	820.00	21,156,000	貸付有価証券 11,900株(8,500株)
メイテック	18,000	4,450.00	80,100,000	
アサツー ディ・ケイ	24,300	2,876.00	69,886,800	
応用地質	14,100	1,359.00	19,161,900	貸付有価証券 200株
船井総研ホールディングス	19,200	1,824.00	35,020,800	貸付有価証券 9,000株(5,500株)
進学会	6,200	567.00	3,515,400	貸付有価証券 200株
オオバ	10,800	456.00	4,924,800	
学究社	3,900	1,416.00	5,522,400	貸付有価証券 600株(600株)
ベネッセホールディングス	50,000	3,250.00	162,500,000	貸付有価証券 23,700株
イオンディライト	16,800	3,250.00	54,600,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
ナック	9,100	972.00	8,845,200	貸付有価証券 3,600株
ニチイ学館	25,900	862.00	22,325,800	貸付有価証券

					11,700株(9,200株)
	ダイセキ	26,000	2,286.00	59,436,000	
	ステップ	5,000	1,333.00	6,665,000	
小計	銘柄数：1,974			320,540,324,720	
	組入時価比率：99.0%			100.0%	
合計				320,540,324,720	

(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28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28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	3,046,353,000	-	3,190,720,000	144,265,912
合計	3,046,353,000	-	3,190,720,000	144,265,912

(注)時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,508,364,407
コール・ローン	192,508,978
株式	342,347,550,270
投資信託受益証券	26,207,799



(平成28年12月26日現在)

投資証券	9,073,008,460
派生商品評価勘定	33,033,346
未収入金	680,355
未収配当金	389,708,672
差入委託証拠金	2,277,666,507
流動資産合計	356,848,728,794
資産合計	356,848,728,794
負債の部	
流動負債	
未払解約金	929,644,548
未払利息	216
その他未払費用	5,247,600
流動負債合計	934,892,364
負債合計	934,892,364
純資産の部	
元本等	
元本	157,289,751,923
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	198,624,084,507
元本等合計	355,913,836,430
純資産合計	355,913,836,430
負債純資産合計	356,848,728,794

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成28年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	2.2628円
(10,000口当たり純資産額)	(22,628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 4月 1日 至 平成28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>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年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28年12月26日現在	
期首	平成28年 4月 1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	162,042,393,593円
同期中における追加設定元本額	17,021,361,943円
同期中における一部解約元本額	21,774,003,613円
期末元本額	157,289,751,923円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	66,369,469円
バランスセレクト50	193,798,955円
バランスセレクト70	180,407,213円
野村外国株式インデックスファンド	567,774,589円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,780,824,693円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	8,788,453,397円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	5,395,919,862円
野村資産設計ファンド2015	31,137,137円

野村資産設計ファンド2020	34,958,381円
野村資産設計ファンド2025	46,385,798円
野村資産設計ファンド2030	44,514,213円
野村資産設計ファンド2035	33,379,045円
野村資産設計ファンド2040	104,567,706円
野村外国株インデックス(野村投資一任口座向け)	15,584,392,262円
のむらップ・ファンド(保守型)	963,823,498円
のむらップ・ファンド(普通型)	5,186,102,659円
のむらップ・ファンド(積極型)	4,163,505,433円
野村資産設計ファンド2045	10,686,224円
野村インデックスファンド・外国株式	2,571,342,206円
マイ・ロード	1,512,101,080円
ネクストコア	112,503,519円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	89,885,458円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	516,588,910円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,003,880,443円
野村資産設計ファンド2050	8,285,040円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,672,742円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	666,068円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	431,940円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	385,836円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	91,148,841円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	32,645,151円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	16,386,545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)	490,218,646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)	415,390,445円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	6,217,767,557円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,448,695,186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)	3,419,460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)	24,724,367円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	15,380,213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)	116,038,678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)	1,279,650,218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)	502,130,893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)	204,383,481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)	30,813,556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)	239,903,452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)	4,420,041,197円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	553,947,269円
野村MSCI-KOKUSAインデックスファンド(適格機関投資家専用)	563,166,373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)	284,954,259円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,050,433,352円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,090,036円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	15,730,974円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	14,099,545円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA(確定拠出年金向け)	57,121,693,780円

マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,363,797,038円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,494,468,382円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,074,807,833円
マイバランスDC30	767,983,432円
マイバランスDC50	1,395,267,041円
マイバランスDC70	1,015,086,104円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	13,803,312,775円
野村DC運用戦略ファンド	169,303,369円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	609,875円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	49,800,161円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,078,858円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,639,805円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成28年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	39,600	64.93	2,571,228.00	
		CORE LABORATORIES N.V.	4,300	119.44	513,592.00	
		FMC TECHNOLOGIES INC	22,500	35.02	787,950.00	
		HALLIBURTON CO	84,200	54.84	4,617,528.00	
		HELMERICH & PAYNE	10,600	78.34	830,404.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,500	38.38	1,400,870.00	
		SCHLUMBERGER LTD	135,200	85.51	11,560,952.00	
		WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	85,000	5.02	426,700.00	
		ANADARKO PETE	53,600	71.25	3,819,000.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	14,700	24.27	356,769.00	
		APACHE CORPORATION	36,600	66.40	2,430,240.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	45,700	22.79	1,041,503.00	
		CHENIERE ENERGY INC	19,500	41.55	810,225.00	
		CHEVRON CORP	183,500	118.42	21,730,070.00	
		CIMAREX ENERGY CO	9,500	135.72	1,289,340.00	
		CONCHO RESOURCES INC	13,900	136.33	1,894,987.00	
CONOCOPHILLIPS	121,300	51.37	6,231,181.00			
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	9,400	52.58	494,252.00			

DEVON ENERGY CORP	45,800	46.54	2,131,532.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,700	102.93	792,561.00	
EOG RESOURCES INC	55,900	102.03	5,703,477.00	
EQT CORP	16,500	66.40	1,095,600.00	
EXXON MOBIL CORP	403,600	90.71	36,610,556.00	
HESS CORP	27,400	63.78	1,747,572.00	
HOLLYFRONTIER CORP	16,600	33.13	549,958.00	
KINDER MORGAN INC	185,600	21.13	3,921,728.00	
MARATHON OIL CORP	81,200	18.06	1,466,472.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	51,000	50.78	2,589,780.00	
MURPHY OIL CORP	16,700	32.31	539,577.00	
NEWFIELD EXPLORATION CO	18,800	42.40	797,120.00	
NOBLE ENERGY INC	42,600	39.19	1,669,494.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	74,800	72.11	5,393,828.00	
ONEOK INC	21,000	58.69	1,232,490.00	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	15,000	35.56	533,400.00	
PHILLIPS 66	46,000	87.72	4,035,120.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,680	185.01	3,085,966.80	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,012	35.32	318,303.84	
RANGE RESOURCES CORP	19,000	34.70	659,300.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	46,800	11.01	515,268.00	
SPECTRA ENERGY CORP	67,700	41.54	2,812,258.00	
TARGA RESOURCES CORP	16,400	58.04	951,856.00	
TESORO CORP	11,300	90.95	1,027,735.00	
VALERO ENERGY CORP	45,000	68.96	3,103,200.00	
WILLIAMS COS	69,400	31.56	2,190,264.00	
AIR PRODUCTS	19,900	146.48	2,914,952.00	
ALBEMARLE CORP	11,100	88.82	985,902.00	
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,800	110.02	638,116.00	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	21,200	27.05	573,460.00	
CELANESE CORP-SERIES A	14,300	80.68	1,153,724.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,900	30.71	703,259.00	
DOW CHEM CO	109,300	58.43	6,386,399.00	
DU PONT E I DE NEMOURS	84,800	74.93	6,354,064.00	
EASTMAN CHEMICAL CO.	14,100	76.56	1,079,496.00	

ECOLAB INC	25,600	118.76	3,040,256.00
FMC CORP	13,200	56.69	748,308.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	7,600	118.24	898,624.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34,500	87.70	3,025,650.00
MONSANTO CO	42,800	105.26	4,505,128.00
MOSAIC CO/THE	33,400	29.18	974,612.00
PPG INDUSTRIES	25,700	94.69	2,433,533.00
PRAXAIR INC	27,900	117.59	3,280,761.00
SHERWIN-WILLIAMS	7,540	272.30	2,053,142.00
VALSPAR CORP	7,300	103.48	755,404.00
WR GRACE & CO	6,700	67.78	454,126.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,910	225.11	1,330,400.10
VULCAN MATERIALS CO	12,800	125.59	1,607,552.00
AVERY DENNISON CORP	8,700	71.43	621,441.00
BALL CORP	15,800	76.22	1,204,276.00
CROWN HOLDINGS INC	13,100	53.49	700,719.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	37,600	54.03	2,031,528.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	9,600	86.48	830,208.00
SEALED AIR CORP	19,200	46.34	889,728.00
WESTROCK CO	24,300	51.89	1,260,927.00
FREEMONT-MCMORAN INC	124,100	13.81	1,713,821.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	51,000	32.46	1,655,460.00
NUCOR CORP	30,600	61.49	1,881,594.00
ARCONIC INC	43,666	19.78	863,713.48
B/E AEROSPACE INC	10,100	60.03	606,303.00
BOEING CO	57,600	157.81	9,089,856.00
GENERAL DYNAMICS	25,380	175.25	4,447,845.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,600	187.01	860,246.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	7,700	153.15	1,179,255.00
LOCKHEED MARTIN	25,620	249.59	6,394,495.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,590	232.99	3,865,304.10
RAYTHEON COMPANY	28,900	143.30	4,141,370.00
ROCKWELL COLLINS INC	12,800	93.97	1,202,816.00
TEXTRON INC	26,400	48.94	1,292,016.00
TRANSDIGM GROUP INC	5,230	250.10	1,308,023.00

UNITED TECHNOLOGIES	77,200	110.65	8,542,180.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	15,300	54.98	841,194.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	91,400	42.50	3,884,500.00
MASCO CORP	32,900	32.06	1,054,774.00
SMITH (A.O.) CORP	14,400	47.84	688,896.00
FLUOR CORP	13,900	53.51	743,789.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,300	58.19	715,737.00
ACUITY BRANDS INC	4,380	234.92	1,028,949.60
AMETEK INC	23,300	49.45	1,152,185.00
EATON CORP PLC	44,400	68.26	3,030,744.00
EMERSON ELEC	62,900	56.80	3,572,720.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,400	136.01	1,686,524.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16,900	40.04	676,676.00
3M CORP	58,720	178.75	10,496,200.00
GENERAL ELEC CO	871,900	31.88	27,796,172.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	70,200	116.99	8,212,698.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	24,100	54.65	1,317,065.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,960	185.93	1,851,862.80
AGCO CORP	6,300	57.76	363,888.00
CATERPILLAR INC DEL	57,200	94.32	5,395,104.00
CUMMINS INC	15,600	138.24	2,156,544.00
DEERE & COMPANY	25,800	103.12	2,660,496.00
DOVER CORP	15,300	75.60	1,156,680.00
FLOWSERVE CORP	12,200	48.82	595,604.00
FORTIVE CORP	30,700	54.51	1,673,457.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	31,200	124.85	3,895,320.00
INGERSOLL-RAND PLC	25,100	76.86	1,929,186.00
MIDDLEBY CORP	5,700	130.43	743,451.00
PACCAR	34,100	65.43	2,231,163.00
PARKER HANNIFIN CORP	13,300	142.74	1,898,442.00
PENTAIR PLC	16,700	56.82	948,894.00
SNAP-ON INC	5,830	173.41	1,010,980.30
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,400	116.69	1,680,336.00
WABCO HOLDINGS INC	5,200	108.35	563,420.00



WABTEC CORP	9,000	83.91	755,190.00
XYLEM INC	17,000	51.01	867,170.00
AERCAP HOLDINGS NV	15,000	42.20	633,000.00
FASTENAL CO	27,600	48.14	1,328,664.00
GRAINGER(W.W.) INC	5,540	237.06	1,313,312.40
UNITED RENTALS INC	8,600	108.06	929,316.00
CINTAS CORP	8,400	116.36	977,424.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	22,900	57.36	1,313,544.00
STERICYCLE INC	7,900	77.46	611,934.00
WASTE CONNECTIONS INC	17,500	79.07	1,383,725.00
WASTE MANAGEMENT INC	43,200	70.92	3,063,744.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	13,600	74.54	1,013,744.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	17,700	53.70	950,490.00
FEDEX CORPORATION	24,690	191.86	4,737,023.40
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	67,100	115.97	7,781,587.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,500	48.48	606,000.00
DELTA AIR LINES INC	17,700	49.89	883,053.00
SOUTHWEST AIRLINES	15,300	50.45	771,885.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	7,600	74.79	568,404.00
AMERCO	680	371.16	252,388.80
CSX CORP	92,400	36.65	3,386,460.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	8,700	97.47	847,989.00
KANSAS CITY SOUTHERN	10,600	85.29	904,074.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,600	109.28	3,125,408.00
UNION PAC CORP	80,900	105.18	8,509,062.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	7,600	82.81	629,356.00
AUTOLIV INC	8,400	111.46	936,264.00
BORGWARNER INC	21,300	39.73	846,249.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	26,900	67.80	1,823,820.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	24,800	31.64	784,672.00
LEAR CORP	6,900	133.55	921,495.00
FORD MOTOR COMPANY	363,000	12.46	4,522,980.00
GENERAL MOTORS CO	136,800	35.69	4,882,392.00
HARLEY-DAVIDSON INC	17,900	58.18	1,041,422.00

TESLA MOTORS INC	12,410	213.34	2,647,549.40
DR HORTON INC	33,600	27.56	926,016.00
GARMIN LTD	11,400	50.47	575,358.00
HARMAN INTERNATIONAL	7,000	110.96	776,720.00
LEGGETT & PLATT INC	13,400	49.68	665,712.00
LENNAR CORP-A	18,000	42.56	766,080.00
MOHAWK INDUSTRIES	6,310	203.71	1,285,410.10
NEWELL BRANDS INC	42,200	45.39	1,915,458.00
PULTEGROUP INC	28,900	18.38	531,182.00
TOLL BROTHERS INC	16,400	31.33	513,812.00
WHIRLPOOL CORP	7,500	181.95	1,364,625.00
HASBRO INC	10,700	78.36	838,452.00
MATTEL INC	33,400	28.34	946,556.00
POLARIS INDUSTRIES INC	6,200	80.22	497,364.00
COACH INC	27,900	34.36	958,644.00
HANESBRANDS INC	37,700	21.69	817,713.00
LULULEMON ATHLETICA INC	10,600	64.41	682,746.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,100	42.84	689,724.00
NIKE INC-B	130,900	51.91	6,795,019.00
PVH CORP	8,000	90.04	720,320.00
RALPH LAUREN CORPORATION	5,800	89.45	518,810.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	18,400	29.29	538,936.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	18,700	25.23	471,801.00
V F CORP	31,900	53.30	1,700,270.00
ARAMARK	23,200	36.22	840,304.00
CARNIVAL CORP	34,800	53.03	1,845,444.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,920	389.77	1,138,128.40
DARDEN RESTAURANTS INC	11,800	74.48	878,864.00
DOMINOS PIZZA INC	4,610	161.57	744,837.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	56,900	27.37	1,557,353.00
LAS VEGAS SANDS CORP	42,100	54.25	2,283,925.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	32,200	84.09	2,707,698.00
MCDONALD'S CORP	82,900	123.14	10,208,306.00
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	18,400	15.68	288,512.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,900	29.36	1,318,264.00

NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	16,100	43.51	700,511.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,900	84.25	1,423,825.00	
STARBUCKS CORP	142,400	57.01	8,118,224.00	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,900	77.23	841,807.00	
WYNN RESORTS LTD	7,700	88.34	680,218.00	
YUM BRANDS INC	36,100	63.81	2,303,541.00	
CBS CORP-CL B	39,600	64.67	2,560,932.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	21,020	290.43	6,104,838.60	
COMCAST CORP-CL A	233,600	70.65	16,503,840.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	14,300	28.00	400,400.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,200	27.30	578,760.00	
DISH NETWORK CORP-A	21,800	58.89	1,283,802.00	
DISNEY (WALT) CO	148,400	105.15	15,604,260.00	
INTERPUBRIC GROUP	39,200	23.60	925,120.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	10,100	74.72	754,672.00	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	59,500	29.79	1,772,505.00	
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	11,286	21.74	245,357.64	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	30.86	740,640.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	19,300	34.53	666,429.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	9,870	34.91	344,561.70	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	37,400	11.73	438,702.00	
OMNICOM GROUP	23,000	86.37	1,986,510.00	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,800	72.51	565,578.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	163,000	4.51	735,130.00	
TEGNA INC	20,600	21.99	452,994.00	
TIME WARNER INC	75,500	96.41	7,278,955.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	103,800	28.38	2,945,844.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	42,800	27.70	1,185,560.00	
VIACOM INC-CLASS B	34,100	35.15	1,198,615.00	
GENUINE PARTS CO	14,400	96.90	1,395,360.00	
LKQ CORP	30,000	30.93	927,900.00	
AMAZON.COM INC	39,210	760.59	29,822,733.90	
EXPEDIA INC	12,300	113.86	1,400,478.00	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	42,300	19.93	843,039.00	

NETFLIX INC	42,000	125.59	5,274,780.00
PRICELINE GROUP INC/THE	4,798	1,486.20	7,130,787.60
TRIPADVISOR INC	12,300	46.54	572,442.00
DOLLAR GENERAL CORP	27,100	74.14	2,009,194.00
DOLLAR TREE INC	22,700	78.70	1,786,490.00
KOHL'S CORP	18,500	49.86	922,410.00
MACYS INC	30,400	36.48	1,108,992.00
NORDSTROM INC	12,700	48.75	619,125.00
TARGET CORP	53,400	73.50	3,924,900.00
ADVANCE AUTO PARTS	7,110	170.89	1,215,027.90
AUTONATION INC	7,100	48.99	347,829.00
AUTOZONE	2,850	795.82	2,268,087.00
BED BATH & BEYOND	15,600	40.77	636,012.00
BEST BUY COMPANY INC	28,400	44.77	1,271,468.00
CARMAX INC	18,300	64.04	1,171,932.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,200	52.30	428,860.00
FOOT LOCKER INC	13,400	71.75	961,450.00
GAP INC	22,900	22.58	517,082.00
HOME DEPOT	120,100	135.05	16,219,505.00
L BRANDS, INC	24,000	66.69	1,600,560.00
LOWE'S COS INC	86,300	72.30	6,239,490.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,250	283.22	2,619,785.00
ROSS STORES INC	39,000	67.11	2,617,290.00
SIGNET JEWELERS LTD	7,100	93.21	661,791.00
STAPLES INC	62,000	9.22	571,640.00
TIFFANY & CO	11,900	77.13	917,847.00
TJX COS INC	64,300	76.44	4,915,092.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13,000	76.13	989,690.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,680	256.86	1,458,964.80
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	42,510	162.08	6,890,020.80
CVS HEALTH CORP	103,500	79.14	8,190,990.00
KROGER CO	88,000	35.08	3,087,040.00
RITE AID CORP	99,000	8.39	830,610.00
SYSCO CORP	51,400	56.23	2,890,222.00
WAL-MART STORES INC	150,300	69.54	10,451,862.00

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	89,300	84.28	7,526,204.00
WHOLE FOODS MARKET INC	31,600	31.91	1,008,356.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	20,000	44.83	896,600.00
COCA COLA CO	398,700	41.60	16,585,920.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	17,100	150.79	2,578,509.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,800	90.78	1,615,884.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	18,600	97.74	1,817,964.00
MONSTER BEVERAGE CORP	38,400	45.57	1,749,888.00
PEPSICO INC	139,900	105.09	14,702,091.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	56,700	45.15	2,560,005.00
BUNGE LIMITED	13,800	71.43	985,734.00
CAMPBELL SOUP CO	19,100	60.28	1,151,348.00
CONAGRA BRANDS INC	40,000	39.77	1,590,800.00
GENERAL MILLS	58,000	62.16	3,605,280.00
HERSHEY CO/THE	14,400	103.62	1,492,128.00
HORMEL FOODS CORP	29,200	35.31	1,031,052.00
INGREDION INC	7,300	125.87	918,851.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	11,300	129.46	1,462,898.00
KELLOGG CO	25,500	73.57	1,876,035.00
KRAFT HEINZ CO/THE	59,600	87.57	5,219,172.00
MCCORMICK & CO INC.	11,300	93.05	1,051,465.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,800	71.25	1,268,250.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	150,900	45.01	6,792,009.00
TYSON FOODS INC-CL A	28,900	62.55	1,807,695.00
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	17,500	55.50	971,250.00
ALTRIA GROUP INC	189,900	67.72	12,860,028.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	150,800	91.58	13,810,264.00
REYNOLDS AMERICAN INC	83,800	56.03	4,695,314.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	25,600	44.72	1,144,832.00
CLOROX CO	12,400	120.90	1,499,160.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	82,900	66.27	5,493,783.00
KIMBERLY-CLARK CORP	35,200	114.82	4,041,664.00
PROCTER & GAMBLE CO	248,700	84.96	21,129,552.00
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,600	121.28	315,328.00
COTY INC-CL A	47,635	18.67	889,345.45

EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,800	73.96	428,968.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,400	78.38	1,677,332.00	
ABBOTT LABORATORIES	144,000	38.42	5,532,480.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,100	98.50	699,350.00	
BARD (C R)	7,260	223.10	1,619,706.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	47,100	44.22	2,082,762.00	
BECTON,DICKINSON	20,590	166.48	3,427,823.20	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131,400	21.81	2,865,834.00	
DANAHER CORP	60,800	78.95	4,800,160.00	
DENTSPLY SIRONA INC	23,200	59.24	1,374,368.00	
DEXCOM INC	8,300	62.51	518,833.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	21,000	93.00	1,953,000.00	
HOLOGIC INC	24,700	40.33	996,151.00	
IDEXX LABORATORIES INC	8,600	119.88	1,030,968.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,710	640.75	2,377,182.50	
MEDTRONIC PLC	135,400	71.95	9,742,030.00	
RESMED INC	14,100	62.03	874,623.00	
ST JUDE MEDICAL INC	27,700	79.83	2,211,291.00	
STRYKER CORP	32,900	120.76	3,973,004.00	
TELEFLEX INC	4,330	161.43	698,991.90	
THE COOPER COMPANIES, INC.	4,700	175.43	824,521.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,500	91.01	864,595.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,800	102.32	2,025,936.00	
AETNA INC	34,300	125.95	4,320,085.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,200	78.56	1,429,792.00	
ANTHEM INC	25,700	146.02	3,752,714.00	
CARDINAL HEALTH INC	31,000	72.88	2,259,280.00	
CENTENE CORP	16,800	58.64	985,152.00	
CIGNA CORP	25,100	138.61	3,479,111.00	
DAVITA INC	15,700	65.20	1,023,640.00	
ENVISION HEALTHCARE CORP	11,600	65.34	757,944.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	61,700	69.00	4,257,300.00	
HCA HOLDINGS INC	29,500	74.46	2,196,570.00	
HENRY SCHEIN INC	8,060	152.79	1,231,487.40	
HUMANA INC	14,550	205.53	2,990,461.50	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,800	128.23	1,256,654.00	
MCKESSON CORP	21,800	141.18	3,077,724.00	
MEDNAX INC	9,100	67.76	616,616.00	
PATTERSON COS INC	8,700	40.85	355,395.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,300	92.41	1,229,053.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	92,600	163.03	15,096,578.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,600	107.93	928,198.00	
ABBVIE INC	158,200	62.34	9,862,188.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,600	127.19	2,747,304.00	
ALKERMES PLC	15,200	57.99	881,448.00	
AMGEN INC	72,700	147.55	10,726,885.00	
BIOGEN INC	21,250	287.53	6,110,012.50	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,800	85.66	1,439,088.00	
CELGENE CORP	75,300	118.93	8,955,429.00	
GILEAD SCIENCES INC	128,200	73.64	9,440,648.00	
INCYTE CORP	16,700	102.94	1,719,098.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,570	381.78	2,890,074.60	
SEATTLE GENETICS INC	9,700	61.86	600,042.00	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,340	142.01	616,323.40	
VERTEX PHARMACEUTICALS	23,800	74.31	1,768,578.00	
ALLERGAN PLC	38,430	199.08	7,650,644.40	
BRISTOL MYERS SQUIBB	162,300	59.61	9,674,703.00	
ELI LILLY & CO.	96,400	73.79	7,113,356.00	
ENDO INTERNATIONAL PLC	20,500	16.27	333,535.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,200	110.40	684,480.00	
JOHNSON & JOHNSON	266,200	115.96	30,868,552.00	
MALLINCKRODT PLC	11,100	53.18	590,298.00	
MERCK & CO INC	268,900	59.56	16,015,684.00	
MYLAN NV	44,900	37.50	1,683,750.00	
PERRIGO CO PLC	13,800	84.98	1,172,724.00	
PFIZER INC	590,000	32.48	19,163,200.00	
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	1,500	107.31	160,965.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	88,300	36.82	3,251,206.00	
ZOETIS INC	45,800	53.78	2,463,124.00	
	992,700	22.60	22,435,020.00	

BANK OF AMERICA CORP			
BB&T CORPORATION	79,600	47.54	3,784,184.00
CIT GROUP INC	19,400	43.82	850,108.00
CITIGROUP	282,500	60.99	17,229,675.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,400	36.33	1,831,032.00
COMERICA INC	17,300	69.25	1,198,025.00
FIFTH THIRD BANCORP	73,700	27.68	2,040,016.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,500	91.57	1,327,765.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107,000	13.42	1,435,940.00
JPMORGAN CHASE & CO	351,500	87.05	30,598,075.00
KEYCORP	107,000	18.47	1,976,290.00
M & T BANK CORP	13,700	157.10	2,152,270.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	30,500	19.36	590,480.00
PNC FINANCIAL	48,100	117.96	5,673,876.00
REGIONS FINANCIAL CORP	121,000	14.56	1,761,760.00
SIGNATURE BANK	5,070	150.35	762,274.50
SUNTRUST BKS INC.	48,300	56.17	2,713,011.00
US BANCORP	166,200	52.20	8,675,640.00
WELLS FARGO CO	466,400	55.96	26,099,744.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	118,500	165.32	19,590,420.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	32,200	23.54	757,988.00
VOYA FINANCIAL INC	20,300	40.29	817,887.00
AFLAC INC	40,000	70.15	2,806,000.00
ALLEGHANY CORP	1,510	613.74	926,747.40
ALLSTATE CORP	36,200	74.58	2,699,796.00
AMERICAN INTL GROUP	103,900	66.41	6,899,999.00
AON PLC	25,700	112.89	2,901,273.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,100	87.25	1,055,725.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,900	52.01	930,979.00
ASSURANT INC	6,200	93.28	578,336.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,500	65.87	559,895.00
CHUBB LTD	45,100	133.11	6,003,261.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,500	76.49	1,185,595.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,010	217.46	872,014.60
FNF GROUP	24,400	34.02	830,088.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	37,500	48.25	1,809,375.00



LINCOLN NATIONAL CORP	22,300	67.59	1,507,257.00	
LOEWS CORP	27,700	47.51	1,316,027.00	
MARKEL CORP	1,340	904.03	1,211,400.20	
MARSH & MCLENNAN COS	50,700	68.52	3,473,964.00	
METLIFE INC	91,400	54.43	4,974,902.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	27,900	58.41	1,629,639.00	
PROGRESSIVE CO	56,500	35.60	2,011,400.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,700	106.20	4,534,740.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,300	126.95	799,785.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,200	136.45	573,090.00	
TORCHMARK CORP	11,200	74.27	831,824.00	
TRAVELERS COS INC/THE	28,100	122.12	3,431,572.00	
UNUM GROUP	22,500	44.47	1,000,575.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,600	124.49	1,568,574.00	
WR BERKLEY CORP	9,900	66.68	660,132.00	
XL GROUP LTD	26,400	37.99	1,002,936.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	16,600	67.63	1,122,658.00	
ALPHABET INC-CL A	28,680	807.80	23,167,704.00	
ALPHABET INC-CL C	30,090	789.91	23,768,391.90	
COSTAR GROUP INC	3,210	190.79	612,435.90	
EBAY INC	104,700	29.79	3,119,013.00	
FACEBOOK INC-A	226,000	117.27	26,503,020.00	
MERCADOLIBRE INC	3,910	156.66	612,540.60	
TWITTER INC	53,900	16.50	889,350.00	
VERISIGN INC	9,600	76.47	734,112.00	
YAHOO! INC	88,400	38.66	3,417,544.00	
ZILLOW GROUP INC - C	10,900	37.23	405,807.00	
ACCENTURE PLC-CL A	60,400	117.48	7,095,792.00	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,760	233.64	1,345,766.40	
AUTOMATIC DATA PROCESS	44,600	102.93	4,590,678.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	11,400	66.08	753,312.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	58,700	56.49	3,315,963.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	13,800	60.88	840,144.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	30,300	76.02	2,303,406.00	
	30,200	14.68	443,336.00	

FIRST DATA CORP- CLASS A			
FISERV INC	21,400	108.00	2,311,200.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,850	143.44	1,269,444.00
GARTNER INC	8,100	102.75	832,275.00
GLOBAL PAYMENTS INC	14,600	70.30	1,026,380.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	88,290	166.71	14,718,825.90
MASTERCARD INC	94,200	104.71	9,863,682.00
PAYCHEX INC	31,500	61.73	1,944,495.00
PAYPAL HOLDINGS INC	106,300	39.58	4,207,354.00
SABRE CORP	20,000	24.84	496,800.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,300	49.99	814,837.00
VANTIV INC - CL A	14,800	59.31	877,788.00
VISA INC-CLASS A SHARES	183,400	78.15	14,332,710.00
WESTERN UNION CO	49,100	21.85	1,072,835.00
XEROX CORP	84,000	8.95	751,800.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,700	36.50	2,106,050.00
ADOBE SYSTEMS INC.	48,800	105.02	5,124,976.00
ANSYS INC	8,300	92.80	770,240.00
AUTODESK INC.	19,900	76.00	1,512,400.00
CA INC	30,900	32.05	990,345.00
CADENCE DESIGN SYS INC	29,100	25.76	749,616.00
CDK GLOBAL INC	12,800	60.54	774,912.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	12,700	84.89	1,078,103.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,900	90.84	1,353,516.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	21,701	56.09	1,217,209.09
ELECTRONIC ARTS	29,000	80.67	2,339,430.00
FORTINET INC	13,900	29.17	405,463.00
INTUIT INC	23,500	116.92	2,747,620.00
MICROSOFT CORP	720,500	63.24	45,564,420.00
MOBILEYE NV	17,000	34.74	590,580.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	25,000	14.90	372,500.00
ORACLE CORPORATION	300,500	38.78	11,653,390.00
RED HAT INC	17,800	71.01	1,263,978.00
SALESFORCE.COM INC	63,000	69.87	4,401,810.00
SERVICENOW INC	15,700	76.02	1,193,514.00

SPLUNK INC	12,800	52.57	672,896.00
SYMANTEC CORP	60,800	24.14	1,467,712.00
SYNOPSYS INC	14,900	59.76	890,424.00
VMWARE INC - CLASS A	7,400	80.12	592,888.00
WORKDAY INC-CLASS A	12,000	67.47	809,640.00
CISCO SYSTEMS	489,000	30.53	14,929,170.00
F5 NETWORKS INC	6,700	145.45	974,515.00
HARRIS CORP	11,900	103.72	1,234,268.00
JUNIPER NETWORKS INC	33,500	28.46	953,410.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,500	83.41	1,209,445.00
PALO ALTO NETWORKS INC	8,500	127.40	1,082,900.00
APPLE INC	524,500	116.52	61,114,740.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	162,400	23.82	3,868,368.00
HP INC	167,000	15.10	2,521,700.00
NETAPP INC	26,700	36.32	969,744.00
SEAGATE TECHNOLOGY	28,600	39.11	1,118,546.00
WESTERN DIGITAL CORP	27,800	70.35	1,955,730.00
AMPHENOL CORP-CL A	30,500	68.30	2,083,150.00
ARROW ELECTRS INC	8,900	71.98	640,622.00
AVNET	12,200	48.07	586,454.00
CDW CORPORATION	14,000	53.03	742,420.00
CORNING INC	101,000	24.77	2,501,770.00
FLEX LTD	55,000	14.64	805,200.00
FLIR SYSTEMS INC	12,700	36.57	464,439.00
TE CONNECTIVITY LTD	34,300	70.62	2,422,266.00
TRIMBLE INC	25,500	30.42	775,710.00
ANALOG DEVICES INC	30,400	73.84	2,244,736.00
APPLIED MATERIALS	105,600	32.90	3,474,240.00
BROADCOM LTD	38,380	181.94	6,982,857.20
INTEL CORP	459,200	36.97	16,976,624.00
KLA TENCOR CORP	15,000	79.12	1,186,800.00
LAM RESEARCH	15,400	108.06	1,664,124.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	23,800	62.55	1,488,690.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	41,000	14.32	587,120.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,000	39.26	1,060,020.00

MICROCHIP TECHNOLOGY	20,600	65.40	1,347,240.00
MICRON TECHNOLOGY	100,900	23.26	2,346,934.00
NVIDIA CORP	52,400	109.78	5,752,472.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,700	98.20	2,818,340.00
QORVO INC	12,700	55.53	705,231.00
QUALCOMM INC	143,200	66.86	9,574,352.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,100	78.03	1,412,343.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	97,400	74.38	7,244,612.00
XILINX INC	25,000	60.56	1,514,000.00
AT & T INC	598,500	42.73	25,573,905.00
CENTURYLINK INC	52,200	24.06	1,255,932.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	114,000	3.42	389,880.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	30,100	56.78	1,709,078.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	12,000	104.84	1,258,080.00
VERIZON COMMUNICATIONS	396,500	53.68	21,284,120.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,500	33.46	518,630.00
SPRINT CORP	75,000	8.50	637,500.00
T-MOBILE US INC	28,300	58.02	1,641,966.00
ALLIANT ENERGY CORP	22,900	37.86	866,994.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	48,000	63.17	3,032,160.00
DUKE ENERGY CORP	67,400	77.62	5,231,588.00
EDISON INTERNATIONAL	31,700	71.90	2,279,230.00
ENTERGY CORP	17,100	72.89	1,246,419.00
EVERSOURCE ENERGY	30,700	55.46	1,702,622.00
EXELON CORPORATION	90,000	35.30	3,177,000.00
FIRSTENERGY CORP	41,800	31.27	1,307,086.00
NEXTERA ENERGY INC	45,200	119.23	5,389,196.00
OGE ENERGY CORP	19,600	33.74	661,304.00
PG&E CORP	49,600	61.19	3,035,024.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,100	77.66	862,026.00
PPL CORPORATION	66,900	34.29	2,294,001.00
SOUTHERN CO.	94,800	49.33	4,676,484.00
WESTAR ENERGY INC	13,400	56.16	752,544.00
XCEL ENERGY INC	49,400	40.67	2,009,098.00
ATMOS ENERGY CORP	10,500	74.61	783,405.00

UGI CORP	16,300	45.80	746,540.00	
AMEREN CORPORATION	24,200	52.45	1,269,290.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	41,200	24.83	1,022,996.00	
CMS ENERGY CORP	27,300	41.70	1,138,410.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,300	73.63	2,157,359.00	
DOMINION RESOURCES INC/VA	61,500	76.75	4,720,125.00	
DTE ENERGY COMPANY	17,700	98.74	1,747,698.00	
NISOURCE INC	30,300	22.30	675,690.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	48,700	43.68	2,127,216.00	
SCANA CORP	12,900	74.69	963,501.00	
SEMPRA ENERGY	22,900	101.67	2,328,243.00	
WEC ENERGY GROUP INC	30,600	58.73	1,797,138.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,800	72.95	1,298,510.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	47,100	15.79	743,709.00	
ALLY FINANCIAL INC	42,100	19.71	829,791.00	
AMERICAN EXPRESS CO	76,900	74.97	5,765,193.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	49,500	89.68	4,439,160.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	39,400	72.64	2,862,016.00	
NAVIENT CORP	29,900	16.66	498,134.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	80,500	36.97	2,976,085.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,200	143.98	748,696.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,700	111.93	1,757,301.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	104,500	47.58	4,972,110.00	
BLACKROCK INC	11,930	385.74	4,601,878.20	
CME GROUP INC	33,100	116.92	3,870,052.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	27,500	35.43	974,325.00	
EATON VANCE CORP	11,700	42.22	493,974.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	35,900	40.48	1,453,232.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	35,440	240.97	8,539,976.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	58,200	56.82	3,306,924.00	
INVESCO LTD	39,600	30.86	1,222,056.00	
MOODYS CORP	16,800	95.42	1,603,056.00	
MORGAN STANLEY	140,500	43.06	6,049,930.00	
MSCI INC	8,500	78.59	668,015.00	
NASDAQ INC	11,100	67.17	745,587.00	

	NORTHERN TRUST CORP	20,700	89.53	1,853,271.00	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,100	71.80	868,780.00	
	S&P GLOBAL INC	25,500	109.02	2,780,010.00	
	SCHWAB(CHARLES)CORP	116,500	40.32	4,697,280.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	14,100	49.40	696,540.00	
	STATE STREET CORP	38,100	78.69	2,998,089.00	
	T ROWE PRICE GROUP INC	23,900	76.59	1,830,501.00	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,300	44.47	1,125,091.00	
	H & R BLOCK INC	22,400	23.28	521,472.00	
	AES CORP	65,000	11.73	762,450.00	
	CALPINE CORP	34,700	11.64	403,908.00	
	CERNER CORP	30,300	48.04	1,455,612.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	31,200	46.20	1,441,440.00	
	ILLUMINA INC	14,200	128.75	1,828,250.00	
	METTLER-TOLEDO INTL	2,620	426.07	1,116,303.40	
	QUINTILES IMS HOLDINGS INC	14,200	76.22	1,082,324.00	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,600	141.84	5,475,024.00	
	WATERS CORP	8,000	136.21	1,089,680.00	
	DUN & BRADSTREET CORP	3,600	123.27	443,772.00	
	EQUIFAX INC	11,700	119.65	1,399,905.00	
	IHS MARKIT LTD	35,373	35.39	1,251,850.47	
	MANPOWERGROUP INC	7,000	90.39	632,730.00	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	34,200	42.75	1,462,050.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	13,300	48.95	651,035.00	
	VERISK ANALYTICS INC	15,900	82.11	1,305,549.00	
	CBRE GROUP INC	29,600	31.61	935,656.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,000	6.22	709,080.00	
	JONES LANG LASALLE INC	4,700	100.54	472,538.00	
小計	銘柄数：602			1,944,304,677.37	
				(227,522,533,345)	
	組入時価比率：63.9%			66.4%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	16,600	34.17	567,222.00	
	ARC RESOURCES LTD	32,900	22.85	751,765.00	
	CAMECO CORP	38,600	14.21	548,506.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	107,600	43.52	4,682,752.00	

CENOVUS ENERGY INC	83,000	20.47	1,699,010.00
CRESCENT POINT ENERGY CORP	53,700	18.17	975,729.00
ENBRIDGE INC	91,300	57.59	5,257,967.00
ENCANA CORP	95,000	16.36	1,554,200.00
HUSKY ENERGY INC	35,745	16.38	585,503.10
IMPERIAL OIL	28,500	47.34	1,349,190.00
INTER PIPELINE LTD	33,100	29.72	983,732.00
KEYERA CORP	17,800	40.58	722,324.00
PEMBINA PIPELINE CORP	37,400	42.50	1,589,500.00
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	17,200	33.58	577,576.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	20,726	31.88	660,744.88
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,600	30.60	691,560.00
SUNCOR ENERGY INC	163,000	44.36	7,230,680.00
TOURMALINE OIL CORP	21,600	36.01	777,816.00
TRANSCANADA CORP	83,600	62.13	5,194,068.00
VERESEN INC	29,000	12.63	366,270.00
VERMILION ENERGY INC	12,000	57.10	685,200.00
AGRIUM INC	13,100	135.76	1,778,456.00
METHANEX CORP	8,200	59.78	490,196.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	81,200	24.40	1,981,280.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,660	267.50	711,550.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	21,600	52.61	1,136,376.00
BARRICK GOLD	112,000	19.69	2,205,280.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	70,800	4.13	292,404.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,000	13.83	898,950.00
FRANCO-NEVADA CORP	16,900	78.42	1,325,298.00
GOLDCORP INC	82,900	17.04	1,412,616.00
KINROSS GOLD CORP	118,600	3.97	470,842.00
SILVER WHEATON CORP	41,600	23.74	987,584.00
TECK RESOURCES LTD	54,900	27.76	1,524,024.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	98,000	4.31	422,380.00
YAMANA GOLD INC	97,000	3.43	332,710.00
WEST FRASER TIMBER	6,800	48.47	329,596.00
BOMBARDIER B SHEARS	189,000	2.11	398,790.00
CAE INC	26,000	18.84	489,840.00

SNC-LAVALIN GROUP INC	14,500	58.50	848,250.00
FINNING INTERNATIONAL INC	15,200	26.26	399,152.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	75,800	91.52	6,937,216.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,600	193.87	2,636,632.00
LINAMAR CORP	4,800	58.77	282,096.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	37,700	59.79	2,254,083.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,800	34.59	719,472.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	21,300	64.53	1,374,489.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	40,400	26.98	1,089,992.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,000	139.32	975,240.00
DOLLARAMA INC	10,700	97.88	1,047,316.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	40,400	61.20	2,472,480.00
EMPIRE CO LTD A	16,200	15.32	248,184.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	20.89	196,366.00
LOBLAW COMPANIES	22,300	70.62	1,574,826.00
METRO INC	23,200	40.19	932,408.00
WESTON(GEORGE)LTD	4,800	113.62	545,376.00
SAPUTO INC	25,800	47.29	1,220,082.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	31,300	19.38	606,594.00
BANK OF MONTREAL	63,100	97.17	6,131,427.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	116,700	76.04	8,873,868.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	38,200	110.86	4,234,852.00
NATIONAL BANK OF CANADA	33,400	55.14	1,841,676.00
ROYAL BANK OF CANADA	144,300	91.68	13,229,424.00
TORONTO DOMINION BANK	180,100	67.07	12,079,307.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	36,000	12.41	446,760.00
ONEX CORPORATION	8,000	91.77	734,160.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,190	659.68	1,444,699.20
GREAT-WEST LIFECO INC	30,000	35.63	1,068,900.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,900	54.74	541,926.00
INTACT FINANCIAL CORP	12,600	97.13	1,223,838.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	192,700	24.43	4,707,661.00
POWER CORPORATION OF CANADA	37,600	30.45	1,144,920.00
	24,300	34.36	834,948.00



	POWER FINANCIAL CORP			
	SUN LIFE FINANCIAL INC	59,100	51.69	3,054,879.00
	CGI GROUP INC - CLASS A	21,400	63.73	1,363,822.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,920	612.54	1,176,076.80
	OPEN TEXT CORP	12,100	83.15	1,006,115.00
	BLACKBERRY LTD	50,900	9.51	484,059.00
	BCE INC	13,800	58.26	803,988.00
	TELUS CORP	19,300	42.77	825,461.00
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	34,700	52.07	1,806,829.00
	EMERA INC	4,900	45.28	221,872.00
	FORTIS INC	38,400	41.50	1,593,600.00
	HYDRO ONE LTD	17,300	23.49	406,377.00
	ATCO LTD CL1	6,800	44.30	301,240.00
	CANADIAN UTILITIES LTD A	12,400	36.05	447,020.00
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	83,300	44.62	3,716,846.00
	CI FINANCIAL CORP	24,200	28.98	701,316.00
	IGM FINANCIAL INC	10,300	38.92	400,876.00
	THOMSON REUTERS CORP	32,400	59.45	1,926,180.00
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,300	20.80	235,040.00
小計	銘柄数：91			160,009,703.98 (13,863,240,752)
	組入時価比率：3.9%			4.0%
ユーロ	SAIPEM SPA	589,700	0.51	302,516.10
	TECHNIP SA	10,400	67.85	705,640.00
	TENARIS SA	46,000	16.99	781,540.00
	ENI SPA	248,000	15.34	3,804,320.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	48,000	14.19	681,360.00
	NESTE OYJ	12,500	36.78	459,750.00
	OMV AG	13,800	33.99	469,062.00
	REPSOL SA	105,992	13.43	1,424,002.52
	REPSOL SA-RTS	105,992	0.35	37,839.14
	SNAM SPA	233,000	3.88	905,438.00
	TOTAL SA	218,900	48.36	10,586,004.00
	VOPAK	7,100	44.19	313,784.50
	AIR LIQUIDE	37,600	105.20	3,955,520.00
	AKZO NOBEL	23,700	59.37	1,407,069.00

ARKEMA	6,700	93.27	624,909.00
BASF SE	89,200	87.45	7,800,540.00
COVESTRO AG	6,800	66.62	453,016.00
EVONIK INDUSTRIES AG	16,900	28.48	481,396.50
FUCHS PETROLUB SE -PFD	6,400	39.69	254,016.00
K+S AG	18,800	22.35	420,180.00
KONINKLIJKE DSM NV	18,200	57.14	1,039,948.00
LANXESS	8,500	62.19	528,615.00
LINDE AG	18,120	158.10	2,864,772.00
SOLVAY SA	7,300	111.25	812,125.00
SYMRISE AG	12,100	57.89	700,469.00
UMICORE	9,400	53.55	503,370.00
CRH PLC	82,300	32.10	2,641,830.00
HEIDELBERGCEMENT AG	14,300	87.40	1,249,820.00
IMERYS	3,800	71.56	271,928.00
ARCELORMITTAL	178,000	7.08	1,261,308.00
THYSSENKRUPP AG	36,300	22.73	825,099.00
VOESTALPINE AG	11,000	37.09	408,045.00
STORA ENSO OYJ-R	54,000	10.07	543,780.00
UPM-KYMMENE OYJ	53,100	23.05	1,223,955.00
AIRBUS GROUP SE	56,600	62.90	3,560,140.00
DASSAULT AVIATION SA	200	1,071.30	214,260.00
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	41,000	13.48	552,680.00
SAFRAN SA	30,400	67.98	2,066,592.00
THALES SA	10,500	91.96	965,580.00
ZODIAC AEROSPACE	19,500	21.98	428,707.50
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	48,100	43.69	2,101,729.50
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,012	30.00	570,360.00
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	9,300	32.91	306,109.50
BOUYGUES	20,100	34.53	694,053.00
EIFFAGE SA	6,100	66.66	406,626.00
FERROVIAL SA	46,466	17.30	803,861.80
HOCHTIEF AG	2,000	134.45	268,900.00
VINCI	48,900	64.48	3,153,072.00
LEGRAND SA	26,400	54.02	1,426,128.00

OSRAM LICHT AG	8,850	49.75	440,287.50
PRYSMIAN SPA	19,400	24.31	471,614.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	54,400	65.15	3,544,160.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	91,600	28.96	2,652,736.00
SIEMENS AG	74,300	115.25	8,563,075.00
ALSTOM	15,500	25.87	400,985.00
ANDRITZ AG	7,200	47.61	342,828.00
CNH INDUSTRIAL NV	99,000	8.25	817,245.00
GEA GROUP AG	18,600	38.04	707,544.00
KONE OYJ	32,300	42.40	1,369,520.00
MAN SE	3,700	94.66	350,242.00
METSO OYJ	10,300	27.29	281,087.00
WARTSILA OYJ	14,700	43.18	634,746.00
ZARDOYA OTIS S.A	17,546	8.14	142,824.44
BRENNTAG AG	15,190	52.72	800,816.80
REXEL SA	28,600	15.73	450,021.00
EDENRED	21,400	18.63	398,789.00
SOCIETE BIC SA	2,810	128.60	361,366.00
BOLLORE	87,000	3.32	288,840.00
DEUTSCHE POST AG-REG	94,700	31.21	2,956,060.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,600	12.88	291,088.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	80,000	5.34	427,840.00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	63,010	13.40	844,334.00
ADP	2,800	101.20	283,360.00
AENA SA	6,500	132.20	859,300.00
ATLANTIA SPA	41,600	22.67	943,072.00
FRAPORT AG	3,800	55.96	212,648.00
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	45,000	8.94	402,345.00
CONTINENTAL AG	10,880	185.10	2,013,888.00
MICHELIN (CGDE)	17,500	106.45	1,862,875.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	11,300	35.39	399,907.00
SCHAEFFLER AG	16,000	13.99	223,840.00
VALEO SA	22,800	54.95	1,252,860.00
BAYER MOTOREN WERK	32,300	89.96	2,905,708.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	5,300	73.55	389,815.00

DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	93,400	71.03	6,634,202.00
FERRARI NV	11,600	55.90	648,440.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,000	8.63	768,515.00
PEUGEOT CITROEN	47,300	15.75	745,211.50
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	15,200	53.42	811,984.00
RENAULT SA	18,600	85.29	1,586,394.00
VOLKSWAGEN AG	3,250	141.85	461,012.50
VOLKSWAGEN AG-PREF	18,100	137.50	2,488,750.00
SEB SA	2,000	126.50	253,000.00
ADIDAS AG	18,400	144.50	2,658,800.00
CHRISTIAN DIOR SE	5,380	198.45	1,067,661.00
HERMES INTERNATIONAL	2,630	388.10	1,020,703.00
HUGO BOSS AG	6,300	57.40	361,620.00
KERING SA	7,550	212.05	1,600,977.50
LUXOTTICA GROUP SPA	16,500	51.55	850,575.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,330	179.30	4,900,269.00
ACCOR SA	17,300	36.00	622,886.50
PADDY POWER PLC	8,400	103.50	869,400.00
SODEXO	8,900	108.15	962,535.00
ALTICE NV - A	36,830	18.70	688,721.00
ALTICE NV - B	10,010	18.68	187,036.85
AXEL SPRINGER SE	4,400	45.46	200,046.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,300	18.68	304,484.00
JC DECAUX SA	6,800	27.94	189,992.00
LAGARDERE S.C.A	11,600	26.12	302,992.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	22,300	36.46	813,058.00
PUBLICIS GROUPE	19,100	65.46	1,250,286.00
RTL GROUP	3,900	69.06	269,334.00
SES FDR	34,400	21.02	723,260.00
TELENET GROUP HOLDING NV	5,200	52.70	274,040.00
VIVENDI SA	100,000	17.73	1,773,000.00
ZALANDO SE	8,100	36.07	292,167.00
INDITEX SA	106,600	32.19	3,431,454.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	56,300	22.60	1,272,380.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	45.56	268,833.50

COLRUYT SA	7,000	46.49	325,465.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	56,000	4.63	259,392.00
JERONIMO MARTINS	23,000	14.39	331,085.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	124,900	19.65	2,454,285.00
METRO AG	18,200	31.26	568,932.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	74,000	99.08	7,331,920.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	21,900	30.82	675,067.50
HEINEKEN HOLDING NV	9,700	66.00	640,200.00
HEINEKEN NV	22,300	71.08	1,585,084.00
PERNOD RICARD SA	20,700	102.05	2,112,435.00
REMY COINTREAU	2,300	80.28	184,644.00
DANONE	57,700	58.87	3,396,799.00
KERRY GROUP PLC-A	16,600	67.70	1,123,820.00
HENKEL AG & CO KGAA	9,900	98.75	977,625.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,300	113.05	1,955,765.00
BEIERSDORF AG	10,000	80.82	808,200.00
LOREAL-ORD	24,640	172.55	4,251,632.00
UNILEVER NV-CVA	158,000	39.13	6,183,330.00
ESSILOR INTERNATIONAL	20,400	105.45	2,151,180.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	20,800	81.39	1,692,912.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	39,600	73.54	2,912,184.00
GRIFOLS SA	28,800	18.68	537,984.00
BAYER AG-REG	80,300	98.50	7,909,550.00
MERCK KGAA	12,500	98.86	1,235,750.00
ORION OYJ	9,500	42.20	400,900.00
SANOFI	112,700	75.86	8,549,422.00
UCB SA	12,100	61.00	738,100.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	27,900	21.26	593,154.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	643,351	6.46	4,156,047.46
BANCO DE SABADELL SA	499,574	1.35	675,923.62
BANCO SANTANDER SA	1,417,341	4.97	7,048,436.79
BANK OF IRELAND	2,850,000	0.24	692,550.00
BANKIA SA	430,000	0.97	417,100.00
BANKINTER S.A.	65,000	7.44	483,600.00
BCO POPULAR ESPANOL	300,260	0.91	273,536.86

BNP PARIBAS	103,200	61.17	6,312,744.00
CAIXABANK	335,889	3.17	1,067,791.13
COMMERZBANK AG	102,000	7.49	764,694.00
CREDIT AGRICOLE SA	108,000	11.90	1,285,740.00
ERSTE GROUP BANK AG	30,700	28.69	880,936.50
ING GROEP NV	378,000	13.62	5,150,250.00
INTESA SANPAOLO	1,237,000	2.46	3,043,020.00
INTESA SANPAOLO-RSP	92,000	2.27	208,840.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	24,000	59.53	1,428,720.00
MEDIOBANCA S.P.A.	53,000	7.93	420,555.00
NATIXIS	87,000	5.37	467,712.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	11,000	17.77	195,470.00
SOCIETE GENERALE	74,200	46.81	3,473,302.00
UNICREDIT SPA	503,173	2.83	1,426,998.62
EURAZEO	4,069	55.10	224,201.90
EXOR NV	11,200	41.74	467,488.00
GROUPE BRUXELLES LAM	7,800	79.54	620,412.00
WENDEL	2,900	114.10	330,890.00
AEGON NV	180,000	5.26	948,060.00
AGEAS	19,000	37.80	718,200.00
ALLIANZ SE-REG	44,360	156.95	6,962,302.00
ASSICURAZIONI GENERALI	112,000	14.37	1,609,440.00
AXA	189,800	24.05	4,564,690.00
CNP ASSURANCES	16,500	17.60	290,400.00
HANNOVER RUECK SE	6,200	103.05	638,910.00
MAPFRE SA	98,000	2.90	284,592.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,550	178.50	2,775,675.00
NN GROUP NV	30,000	32.74	982,200.00
POSTE ITALIANE SPA	50,000	6.41	320,500.00
SAMPO OYJ-A SHS	43,000	43.16	1,855,880.00
SCOR SE	15,400	32.60	502,040.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	2.05	219,564.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,900	36.86	475,558.50
AMADEUS IT GROUP SA	42,600	43.18	1,839,468.00

ATOS SE	8,600	100.25	862,150.00	
CAP GEMINI SA	15,800	80.36	1,269,688.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,800	71.86	919,808.00	
GEMALTO	7,600	55.04	418,304.00	
SAP SE	95,400	82.01	7,823,754.00	
NOKIA OYJ	568,000	4.65	2,645,744.00	
INGENICO GROUP	5,500	78.30	430,650.00	
ASML HOLDING NV	36,000	105.85	3,810,600.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	108,900	16.54	1,801,206.00	
STMICROELECTRONICS NV	60,000	10.74	644,700.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	317,400	16.12	5,116,488.00	
ELISA OYJ	14,900	30.66	456,834.00	
ILIAD SA	2,710	181.90	492,949.00	
KONINKLIJKE KPN NV	343,000	2.79	959,028.00	
ORANGE SA	195,000	14.29	2,786,550.00	
PROXIMUS	15,100	27.19	410,569.00	
SFR GROUP SA	7,700	26.14	201,278.00	
TELECOM ITALIA SPA	990,000	0.85	848,925.00	
TELECOM ITALIA-RNC	570,000	0.70	399,570.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	74,600	4.07	303,995.00	
TELEFONICA SA	464,481	8.84	4,109,263.40	
ELECTRICITE DE FRANCE	22,800	9.67	220,658.40	
ENDESA S.A.	31,700	20.74	657,616.50	
ENEL SPA	744,000	4.12	3,065,280.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	235,000	2.88	678,445.00	
FORTUM OYJ	44,000	14.72	647,680.00	
IBERDROLA SA	528,458	6.13	3,243,675.20	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	43,200	17.71	765,072.00	
TERNA SPA	152,000	4.32	656,640.00	
ENAGAS	22,800	24.31	554,268.00	
GAS NATURAL SDG	32,800	17.59	577,116.00	
E.ON SE	199,000	6.65	1,323,350.00	
ENGIE	145,200	12.04	1,748,934.00	
INNOGY SE	14,500	32.43	470,307.50	
RWE AG	49,600	11.58	574,368.00	

	SUEZ	33,300	13.87	461,871.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	46,100	15.94	735,064.50	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	133,000	17.81	2,368,730.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	18,900	78.34	1,480,626.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,030	400.90	412,927.00	
	QIAGEN NV	22,300	26.54	591,953.50	
	BUREAU VERITAS SA	25,500	18.41	469,455.00	
	RANDSTAD HOLDING NV	11,600	51.95	602,620.00	
	RELX NV	95,400	15.94	1,521,153.00	
	WOLTERS KLUWER	29,900	34.39	1,028,261.00	
	DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	32,900	29.83	981,571.50	
	IMMOEAST AG-RIGHTS	50,000	0.00	0.00	
	VONOVIA SE	44,600	30.59	1,364,314.00	
小計	銘柄数：237			341,408,720.03	
				(41,716,731,500)	
	組入時価比率：11.7%			12.2%	
英債券	PETROFAC LTD	26,000	8.74	227,240.00	
	BP PLC	1,825,000	5.03	9,179,750.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	420,400	22.13	9,305,554.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	363,900	23.21	8,446,119.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,600	31.50	428,400.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,150	31.53	603,799.50	
	ANGLO AMERICAN PLC	136,400	11.25	1,535,182.00	
	ANTOFAGASTA PLC	41,000	6.75	276,955.00	
	BHP BILLITON PLC	206,300	12.57	2,594,222.50	
	FRESNILLO PLC	20,900	11.12	232,408.00	
	GLENCORE PLC	1,197,000	2.70	3,239,680.50	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	8,800	58.35	513,480.00	
	RIO TINTO PLC-REG	121,100	30.64	3,710,504.00	
	MONDI PLC	37,000	16.05	593,850.00	
	BAE SYSTEMS PLC	306,000	5.93	1,816,110.00	
	COBHAM PLC	169,500	1.67	283,743.00	
	MEGGITT PLC	78,000	4.66	363,714.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	183,000	6.80	1,245,315.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC C-ENTITLEMENT	8,418,000	0.00	8,418.00	



DCC PLC	8,600	60.55	520,730.00
SMITHS GROUP PLC	37,100	14.13	524,223.00
IMI PLC	25,900	10.24	265,216.00
WEIR GROUP PLC	22,000	18.75	412,500.00
ASHTED GROUP PLC	47,600	15.67	745,892.00
BUNZLE	33,100	20.88	691,128.00
TRAVIS PERKINS PLC	24,700	14.62	361,114.00
WOLSELEY PLC	24,200	49.39	1,195,238.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	9.44	244,496.00
G4S PLC	152,000	2.30	350,056.00
ROYAL MAIL PLC	88,000	4.56	401,456.00
EASYJET PLC	16,300	10.35	168,705.00
GKN PLC	169,000	3.30	558,545.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	98,000	4.69	459,914.00
PERSIMMON PLC	29,500	17.65	520,675.00
TAYLOR WIMPEY PLC	319,000	1.53	490,941.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	12,400	28.52	353,648.00
BURBERRY GROUP PLC	41,900	14.63	612,997.00
CARNIVAL PLC	18,700	41.47	775,489.00
COMPASS GROUP PLC	160,200	14.56	2,332,512.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	18,183	36.01	654,769.83
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	69,000	4.47	309,051.00
TUI AG-DI	49,000	11.48	562,520.00
WHITBREAD PLC	17,300	37.62	650,826.00
WILLIAM HILL PLC	85,000	2.97	252,535.00
ITV PLC	353,000	2.03	718,355.00
PEARSON	78,000	8.17	637,260.00
SKY PLC	99,000	9.82	972,675.00
WPP PLC	125,100	17.95	2,245,545.00
MARKS & SPENCER PLC	153,000	3.52	538,560.00
NEXT PLC	14,000	49.22	689,080.00
DIXONS CARPHONE PLC	92,000	3.49	321,724.00
KINGFISHER PLC	214,000	3.46	741,938.00
MORRISON SUPERMARKETS	213,000	2.29	489,261.00
SAINSBURY	170,000	2.48	422,790.00

TESCO PLC	787,000	2.05	1,620,039.50
COCA-COLA HBC AG-CDI	16,700	17.16	286,572.00
DIAGEO PLC	244,300	20.97	5,122,971.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,000	26.99	917,660.00
TATE & LYLE ORD.	48,000	7.06	338,880.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	181,100	45.58	8,254,538.00
IMPERIAL BRANDS PLC	93,800	35.39	3,319,582.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	61,900	68.11	4,216,009.00
UNILEVER PLC	125,600	32.72	4,110,260.00
SMITH & NEPHEW PLC	89,000	12.03	1,070,670.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	7.52	282,000.00
SHIRE PLC	88,100	45.48	4,006,788.00
ASTRAZENECA PLC	122,700	44.07	5,407,389.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	473,500	15.49	7,334,515.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,900	18.10	251,590.00
BARCLAYS PLC	1,655,000	2.24	3,722,922.50
HSBC HOLDINGS PLC	1,934,000	6.46	12,503,310.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,290,000	0.63	4,013,020.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	341,000	2.31	788,051.00
STANDARD CHARTERED PLC	320,000	6.61	2,117,120.00
ADMIRAL GROUP PLC	21,900	17.99	393,981.00
AVIVA PLC	395,000	4.80	1,897,185.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	136,083	3.67	500,513.27
LEGAL & GENERAL	577,000	2.47	1,425,190.00
OLD MUTUAL PLC	488,000	1.98	970,632.00
PRUDENTIAL PLC	252,500	16.05	4,052,625.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	98,750	5.77	569,787.50
ST JAMES S PLACE PLC	49,000	9.98	489,265.00
STANDARD LIFE PLC	187,000	3.64	681,054.00
AUTO TRADER GROUP PLC	95,000	4.04	384,655.00
WORLDPAY GROUP PLC	185,000	2.67	495,245.00
SAGE GROUP PLC (THE)	105,000	6.54	686,700.00
BT GROUP PLC	816,000	3.70	3,022,056.00
INMARSAT PLC	42,500	7.53	320,025.00
VODAFONE GROUP PLC	2,582,000	2.00	5,178,201.00

	SSE PLC	99,600	15.54	1,547,784.00	
	CENTRICA PLC	524,000	2.30	1,207,820.00	
	NATIONAL GRID PLC	368,000	9.51	3,500,784.00	
	SEVERN TRENT PLC	23,700	22.28	528,036.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,000	9.00	603,000.00	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	14,300	28.15	402,545.00	
	3I GROUP PLC	97,000	6.95	674,150.00	
	ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	94,000	2.58	242,520.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,000	12.20	305,000.00	
	INVESTEC PLC	61,000	5.25	320,250.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	30,000	28.44	853,200.00	
	NEX GROUP PLC	54,000	4.62	249,480.00	
	SCHRODERS PLC	13,300	29.85	397,005.00	
	CAPITA PLC	64,000	5.20	333,120.00	
	EXPERIAN PLC	94,600	15.53	1,469,138.00	
	INTERTEK GROUP PLC	16,300	33.97	553,711.00	
	RELX PLC	105,800	14.38	1,521,404.00	
小計	銘柄数：106			172,256,758.10	
				(24,784,302,355)	
	組入時価比率：7.0%			7.2%	
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	830	516.50	428,695.00	
	GIVAUDAN-REG	886	1,838.00	1,628,468.00	
	SIKA AG-BR	204	4,894.00	998,376.00	
	SYNGENTA AG-REG	9,150	408.10	3,734,115.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	43,900	53.35	2,342,065.00	
	GEBERIT AG-REG	3,580	407.20	1,457,776.00	
	ABB LTD	184,000	21.65	3,983,600.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,930	177.50	342,575.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,870	178.40	690,408.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,250	134.90	708,225.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	51,000	66.50	3,391,500.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,930	315.10	923,243.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	61.40	282,440.00	
	DUFREY AG-REG	4,500	125.80	566,100.00	
	ARYZTA AG	8,500	43.99	373,915.00	

	BARRY CALLEBAUT AG	230	1,204.00	276,920.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	104	5,225.00	543,400.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	10	61,215.00	612,150.00	
	NESTLE SA-REG	302,700	73.10	22,127,370.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,000	122.70	613,500.00	
	ACTELION LTD	9,390	222.40	2,088,336.00	
	GALENICA AG-REG	360	1,140.00	410,400.00	
	NOVARTIS-REG	217,100	73.90	16,043,690.00	
	ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	68,310	232.20	15,861,582.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	3,200	65.65	210,080.00	
	BALOISE HOLDING AG	5,000	129.40	647,000.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,180	290.30	923,154.00	
	SWISS RE LTD	31,600	97.05	3,066,780.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,720	281.50	4,143,680.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,560	455.40	1,165,824.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	194,000	15.19	2,946,860.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,000	45.73	1,006,060.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,690	477.25	806,552.50	
	UBS GROUP AG	354,800	16.08	5,705,184.00	
	LONZA AG-REG	5,320	173.50	923,020.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	16,300	66.90	1,090,470.00	
	SGS SA-REG	546	2,063.00	1,126,398.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,800	82.35	559,980.00	
	小計銘柄数：38			104,749,891.50	
				(11,945,677,626)	
	組入時価比率：3.4%			3.5%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	17,100	195.30	3,339,630.00	
	BOLIDEN AB	27,400	237.00	6,493,800.00	
	ASSA ABLOY AB-B	96,300	170.10	16,380,630.00	
	SKANSKA AB-B SHS	34,200	217.10	7,424,820.00	
	ALFA LAVAL AB	27,700	152.10	4,213,170.00	
	ATLAS COPCO AB-A	64,600	279.40	18,049,240.00	
	ATLAS COPCO AB-B	38,200	250.00	9,550,000.00	
	SANDVIK AB	103,000	114.10	11,752,300.00	
	SKF AB-B SHARES	38,800	167.10	6,483,480.00	

	VOLVO AB-B SHS	149,000	107.30	15,987,700.00	
	SECURITAS AB-B SHS	32,500	142.00	4,615,000.00	
	ELECTROLUX AB-B	23,300	226.40	5,275,120.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,000	70.10	2,663,800.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	91,700	253.80	23,273,460.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,800	275.60	2,149,680.00	
	SWEDISH MATCH AB	18,900	288.60	5,454,540.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	60,000	255.40	15,324,000.00	
	GETINGE AB-B SHS	19,100	147.20	2,811,520.00	
	NORDEA BANK AB	297,000	102.50	30,442,500.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	151,000	96.50	14,571,500.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	148,000	127.40	18,855,200.00	
	SWEDBANK AB	88,100	222.00	19,558,200.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,800	167.90	2,820,720.00	
	INVESTOR AB-B SHS	44,100	343.30	15,139,530.00	
	KINNEVIK AB - B	23,600	218.70	5,161,320.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,400	554.00	1,883,600.00	
	ERICSSON LM-B	297,000	53.70	15,948,900.00	
	HEXAGON AB-B SHS	25,800	327.80	8,457,240.00	
	TELIA CO AB	247,000	36.83	9,097,010.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	6,800	396.70	2,697,560.00	
	TELE 2 AB-B SHS	34,000	72.90	2,478,600.00	
小計	銘柄数：31			308,353,770.00	
				(3,900,675,190)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	110,500	157.80	17,436,900.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,800	338.10	5,680,080.00	
	NORSK HYDRO	130,000	40.83	5,307,900.00	
	SCHIBSTED ASA	7,800	195.20	1,522,560.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,100	180.50	1,642,550.00	
	MARINE HARVEST ASA	35,900	156.60	5,621,940.00	
	ORKLA ASA	80,000	77.45	6,196,000.00	
	DNB ASA	94,000	129.20	12,144,800.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,700	136.10	2,681,170.00	

	TELENOR ASA	74,900	127.60	9,557,240.00	
小計	銘柄数：10			67,791,140.00	
				(910,435,010)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,000	386.00	3,860,000.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,500	242.20	5,449,500.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	21,200	438.70	9,300,440.00	
	ISS A/S	16,100	236.30	3,804,430.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	375	10,760.00	4,035,000.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	620	11,400.00	7,068,000.00	
	DSV A/S	19,300	310.70	5,996,510.00	
	PANDORA A/S	11,000	896.50	9,861,500.00	
	CARLSBERG B	10,500	601.50	6,315,750.00	
	COLOPLAST-B	11,700	480.20	5,618,340.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	123.00	1,599,000.00	
	GENMAB A/S	5,490	1,141.00	6,264,090.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	185,500	255.00	47,302,500.00	
	DANSKE BANK AS	66,900	215.00	14,383,500.00	
	TRYG A/S	11,800	127.80	1,508,040.00	
	TDC A/S	76,800	35.20	2,703,360.00	
	DONG ENERGY A/S	7,600	266.40	2,024,640.00	
小計	銘柄数：17			137,094,600.00	
				(2,253,835,224)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	25,500	30.60	780,300.00	
	OIL SEARCH LTD	129,000	6.96	897,840.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	175,000	6.44	1,127,000.00	
	SANTOS LTD.	148,000	3.95	584,600.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	73,500	31.68	2,328,480.00	
	INCITEC PIVOT LTD	161,000	3.59	577,990.00	
	ORICA LTD	36,600	17.59	643,794.00	
	BORAL LTD	115,000	5.39	619,850.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	44,000	22.00	968,000.00	
	AMCOR	112,000	15.07	1,687,840.00	
	ALUMINA LTD	233,000	1.79	418,235.00	

BHP BILLITON LIMITED	311,500	24.63	7,672,245.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	148,000	5.77	853,960.00
NEWCREST MINING	75,000	18.08	1,356,000.00
RIO TINTO LTD	40,800	58.77	2,397,816.00
SOUTH32 LTD	507,000	2.73	1,384,110.00
CIMIC GROUP LTD	8,938	34.31	306,662.78
BRAMBLES LTD	153,000	12.40	1,897,200.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	44,133	3.38	149,169.54
AURIZON HOLDINGS LTD	209,000	5.04	1,053,360.00
SYDNEY AIRPORT	107,900	6.02	649,558.00
TRANSURBAN GROUP	198,000	10.53	2,084,940.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,000	15.30	795,600.00
CROWN RESORTS LTD	36,000	11.45	412,200.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	5,900	64.78	382,202.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,200	31.19	162,188.00
TABCORP HOLDINGS	78,000	4.76	371,280.00
TATTS GROUP LTD	147,000	4.42	649,740.00
REA GROUP LTD	5,400	54.55	294,570.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	5.02	266,060.00
WESFARMERS LIMITED	110,000	42.08	4,628,800.00
WOOLWORTHS LIMITED	126,600	23.85	3,019,410.00
COCA-COLA AMATIL LTD	60,000	9.93	595,800.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	10.43	750,960.00
COCHLEAR LTD	5,800	119.93	695,594.00
HEALTHSCOPE LTD	176,000	2.24	394,240.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,100	66.99	944,559.00
SONIC HEALTHCARE LTD	40,500	21.37	865,485.00
CSL LIMITED	44,600	97.80	4,361,880.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	284,000	30.73	8,727,320.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	35,115	11.95	419,624.25
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	44,300	12.69	562,167.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	166,600	82.50	13,744,500.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	260,200	30.65	7,975,130.00
WESTPAC BANKING CORP	324,900	32.64	10,604,736.00
AMP LIMITED	281,000	5.04	1,416,240.00

	CHALLENGER LIMITED	56,000	11.18	626,080.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	245,000	5.99	1,467,550.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	261,000	2.78	725,580.00	
	QBE INSURANCE	132,000	12.47	1,646,040.00	
	SUNCORP GROUP LTD	126,000	13.52	1,703,520.00	
	COMPUTERSHARE LTD	47,000	12.44	584,680.00	
	TELSTRA CORP LTD	414,000	5.04	2,086,560.00	
	TPG TELECOM LTD	33,000	6.73	222,090.00	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	54,000	3.84	207,360.00	
	AUSNET SERVICES	163,400	1.55	253,270.00	
	APA GROUP	111,000	8.68	963,480.00	
	AGL ENERGY LTD	65,700	22.18	1,457,226.00	
	DUET GROUP	229,000	2.82	645,780.00	
	ASX LTD	19,600	49.11	962,556.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,500	86.93	2,564,435.00	
	SEEK LTD	32,800	14.95	490,360.00	
小計	銘柄数：62			110,085,802.57	
				(9,262,619,428)	
	組入時価比率：2.6%			2.7%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	69,000	10.75	741,750.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,110	6.66	646,752.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,000	8.29	290,150.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	168,000	3.45	579,600.00	
	CONTACT ENERGY LTD	76,000	4.66	354,160.00	
	MERCURY NZ LTD	60,000	2.93	175,800.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	120,000	2.57	309,000.00	
小計	銘柄数：7			3,097,212.60	
				(250,254,778)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	263,540	88.10	23,217,874.00	
	NWS HOLDINGS LTD	159,500	12.50	1,993,750.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	107,000	10.22	1,093,540.00	
	MTR CORP	148,500	37.30	5,539,050.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	140,000	27.90	3,906,000.00	
	LI & FUNG LTD	563,600	3.49	1,966,964.00	



YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	75,000	28.05	2,103,750.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	223,000	33.10	7,381,300.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	94,000	14.72	1,383,680.00	
SANDS CHINA LTD	233,600	33.15	7,743,840.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	108,333	8.14	881,830.62	
SJM HOLDINGS LIMITED	166,000	5.88	976,080.00	
WYNN MACAU LTD	168,400	12.20	2,054,480.00	
WH GROUP LIMITED	810,000	6.22	5,038,200.00	
BANK OF EAST ASIA	120,860	29.80	3,601,628.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	363,500	27.80	10,105,300.00	
HANG SENG BANK	76,200	143.90	10,965,180.00	
FIRST PACIFIC CO	226,000	5.43	1,227,180.00	
AIA GROUP LTD	1,169,000	43.95	51,377,550.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,900	82.80	1,813,320.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	259,600	9.46	2,455,816.00	
PCCW LTD	386,000	4.20	1,621,200.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	65,000	60.40	3,926,000.00	
CLP HLDGS	159,000	71.60	11,384,400.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	132,000	68.15	8,995,800.00	
HONG KONG & CHINA GAS	758,809	13.60	10,319,802.40	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	112,900	179.90	20,310,710.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	261,040	47.40	12,373,296.00	
HANG LUNG GROUP LTD	81,000	26.70	2,162,700.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	213,000	16.08	3,425,040.00	
HENDERSON LAND	107,818	40.50	4,366,629.00	
HYSAN DEVELOPMENT	65,000	32.05	2,083,250.00	
KERRY PROPERTIES	57,000	20.90	1,191,300.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	569,666	8.16	4,648,474.56	
SINO LAND CO.LTD	314,000	11.38	3,573,320.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	97.25	13,517,750.00	
SWIRE PACIFIC-A	53,500	73.10	3,910,850.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	21.50	2,511,200.00	
WHARF(HOLDING)	133,000	50.25	6,683,250.00	
WHEELOCK & COMPANY LTD	75,000	43.05	3,228,750.00	
小計銘柄数：40			267,060,034.58	

				(4,027,265,321)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
シンガポール ド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	161,000	3.21	516,810.00	
	KEPPEL CORP.	142,700	5.80	827,660.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	99,040	2.86	283,254.40	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	163,000	0.80	131,215.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	55,040	9.69	533,337.60	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	207,000	2.54	525,780.00	
	SATS LTD	59,000	4.83	284,970.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	614,600	0.90	556,213.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	148,000	3.53	522,440.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	39.37	393,700.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	620,320	0.42	263,636.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	184,000	3.59	660,560.00	
	DBS GROUP HLDGS	173,000	17.39	3,008,470.00	
	OCBC-ORD	303,000	8.93	2,705,790.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	125,000	20.35	2,543,750.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	775,000	3.65	2,828,750.00	
	STARHUB LTD	69,000	2.77	191,130.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	7.13	549,010.00	
	CAPITALAND LIMITED	246,000	2.98	733,080.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	41,000	8.10	332,100.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	266,000	2.21	587,860.00		
UOL GROUP LIMITED	48,700	5.97	290,739.00		
小計	銘柄数：22			19,270,255.00	
				(1,559,349,034)	
	組入時価比率：0.4%			0.5%	
新シェケル	FRUTAROM	3,800	199.50	758,100.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	50,000	15.25	762,500.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,300	384.70	884,810.00	
	BANK HAPOALIM BM	105,000	22.83	2,397,150.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	142,000	15.86	2,252,120.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,000	55.97	727,610.00	
	NICE LTD	5,900	257.40	1,518,660.00	

		BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	204,000	7.09	1,447,380.00	
		AZRIELI GROUP	4,100	162.30	665,430.00	
	小計	銘柄数：9			11,413,760.00	
					(350,630,707)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
	合計				342,347,550,270	
					(342,347,550,270)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成28年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	223,960.00	
	小計	銘柄数：1	509,000	223,960.00	
		組入時価比率：0.0%		(26,207,799)	0.3%
	合計			26,207,799	(26,207,799)
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,900	597,135.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	830,680.00	
		AMERICAN TOWER CORP	41,600	4,410,848.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	95,000	978,500.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,230	2,308,502.70	
		BOSTON PROPERTIES	14,900	1,848,643.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,000	723,300.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,200	682,076.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,900	2,870,196.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,300	1,474,155.00	
		DUKE REALTY CORP	34,000	882,640.00	
		EQUINIX INC	7,010	2,499,836.10	
		EQUITY RESIDENTIAL	36,100	2,272,495.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,540	1,508,581.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,700	949,452.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,910	965,050.60			

	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	56,500	1,387,640.00	
	HCP INC	44,700	1,307,922.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	73,900	1,398,927.00	
	IRON MOUNTAIN INC	24,400	793,976.00	
	KIMCO REALTY CORP	40,000	1,002,400.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	563,992.00	
	MACERICH CO /THE	12,300	838,491.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,200	1,069,936.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	622,630.00	
	PROLOGIS INC	51,400	2,659,950.00	
	PUBLIC STORAGE	14,380	3,145,193.60	
	REALTY INCOME CORP	24,700	1,393,327.00	
	REGENCY CENTERS CORP	10,300	694,735.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	30,470	5,361,196.50	
	SL GREEN REALTY CORP	9,800	1,034,782.00	
	UDR INC	25,300	899,921.00	
	VENTAS INC	34,600	2,105,756.00	
	VEREIT INC	95,000	798,950.00	
	VORNADO REALTY TRUST	16,500	1,697,355.00	
	WELLTOWER INC	35,300	2,312,503.00	
	WEYERHAEUSER CO	72,200	2,207,154.00	
小計	銘柄数：37	1,106,640	59,098,828.30	
			(6,915,744,887)	
	組入時価比率：1.9%		76.1%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	299,744.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	445,822.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	220,041.00	
小計	銘柄数：3	37,400	965,607.00	
			(83,660,190)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	3,100	254,107.00	
	GECINA SA	4,000	513,600.00	
	ICADE	3,700	245,939.00	
	KLEPIERRE	22,400	822,752.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	9,570	2,120,233.50	

小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.1%	42,770	3,956,631.50 (483,460,802) 5.3%
英ポンド	BRITISH LAND	92,000	589,720.00
	HAMMERSON PLC	74,000	421,060.00
	INTU PROPERTIES PLC	88,000	243,408.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,500	829,250.00
	SEGRO PLC	86,000	391,042.00
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.1%	417,500	2,474,480.00 (356,028,182) 3.9%
豪ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	91,000	895,440.00
	GOODMAN GROUP	174,000	1,261,500.00
	GPT GROUP	179,000	907,530.00
	LENDLEASE GROUP	53,000	769,560.00
	MIRVAC GROUP	381,000	830,580.00
	SCENTRE GROUP	527,000	2,403,120.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	227,000	1,053,280.00
	VICINITY CENTRES	328,704	982,824.96
	WESTFIELD CORP	191,000	1,759,110.00
小計	銘柄数：9 組入時価比率：0.3%	2,151,704	10,862,944.96 (914,008,188) 10.0%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,656,200.00
	LINK REIT	215,000	10,578,000.00
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.1%	475,000	12,234,200.00 (184,491,736) 2.0%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	239,000	537,750.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	192,000	278,400.00
	CAPITALAND MALL TRUST	249,900	467,313.00
	SUNTEC REIT	243,000	392,445.00
小計	銘柄数：4 組入時価比率：0.0%	923,900	1,675,908.00 (135,614,475) 1.5%
合計			9,073,008,460

		(9,073,008,460)	
合計		9,099,216,259	(9,099,216,259)

(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28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	3,973,794,481	-	4,002,491,637	28,697,156
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	775,113,290	-	770,777,100	4,336,190
米ドル	636,381,790	-	633,024,100	3,357,690
カナダドル	61,302,500	-	60,641,000	661,500
ユーロ	36,727,500	-	36,657,000	70,500
シンガポールドル	40,701,500	-	40,455,000	246,500
合計	-	-	-	33,033,346

### (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28年12月26日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	265,240,390
コール・ローン	10,728,517
株式	16,857,304,476
投資証券	82,372,666
派生商品評価勘定	125,780
未収配当金	18,675,341
差入委託証拠金	135,224,375
流動資産合計	17,369,671,545
<b>資産合計</b>	<b>17,369,671,545</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,729,957
未払解約金	26,531,115
未払利息	12
その他未払費用	2,051,700
流動負債合計	42,312,784
<b>負債合計</b>	<b>42,312,784</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	17,122,250,107
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	205,108,654
元本等合計	17,327,358,761
純資産合計	17,327,358,761
<b>負債純資産合計</b>	<b>17,369,671,545</b>

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>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> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p>
--------------------	---

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成28年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	1.0120円
(10,000口当たり純資産額)	(10,120円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

<p>自 平成28年 4月 1日 至 平成28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、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> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>



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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年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28年12月26日現在	
期首	平成28年 4月 1日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	14,626,243,220円
同期中における追加設定元本額	3,331,070,004円
同期中における一部解約元本額	835,063,117円
期末元本額	17,122,250,107円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	44,324,140円
野村資産設計ファンド2020	49,763,725円
野村資産設計ファンド2025	64,595,090円
野村資産設計ファンド2030	62,175,492円
野村資産設計ファンド2035	46,712,901円
野村資産設計ファンド2040	146,726,866円
野村資産設計ファンド2045	15,014,927円
野村インデックスファンド・新興国株式	2,715,036,848円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	191,929,709円
野村資産設計ファンド2050	11,652,084円

野村ターゲットデートファンド2016	2026 - 2028年目標型	5,228,199円
野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	934,613円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	603,182円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	540,239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)		145,446,906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)		620,714,165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)		13,000,851,021円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成28年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	8,800	8.90	78,320.00	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	16,070	55.71	895,259.70	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	3,390	124.50	422,055.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	222,800	4.88	1,089,046.40	
		ROSNEFT OJSC - GDR	41,560	6.25	259,750.00	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	53,000	4.88	258,746.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	8,850	38.86	343,911.00	
		TRANSNEFT PJSC	58	3,198.84	185,532.89	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	3,700	14.60	54,020.00	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	3,500	28.37	99,295.00	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	6,600	10.40	68,640.00	
		PJSC ALROSA	100,220	1.56	156,698.98	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	21,469	16.30	349,944.70	
		SEVERSTAL-GDR REG S	8,140	14.62	119,006.80	
		SOUTHERN COPPER CORP	3,342	32.09	107,244.78	
		LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	10,900	8.21	89,489.00	
		DP WORLD LTD	6,780	17.05	115,599.00	
		YUM CHINA HOLDINGS INC	15,100	26.01	392,751.00	
		CTIP.COM INTERNATIONAL -ADR	14,100	39.98	563,718.00	
		JD.COM INC-ADR	25,500	25.49	649,995.00	
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	1,300	30.00	39,000.00			

VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	15,200	11.11	168,872.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	11,880	40.20	477,576.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	2,500	20.43	51,075.00	
BANCO DE CHILE-ADR	1,601	68.62	109,860.62	
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	5,896	21.54	126,999.84	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	4,200	36.28	152,376.00	
CREDICORP LTD	2,500	155.78	389,450.00	
ITAU CORPBANCA-ADR	3,966	11.97	47,473.02	
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	405,000	2.79	1,132,720.20	
STATE BANK OF INDIA-GDR	5,650	36.90	208,485.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	92,400	2.28	210,856.80	
58.COM INC-ADR	3,000	28.76	86,280.00	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	42,340	86.79	3,674,688.60	
BAIDU INC - SPON ADR	10,240	163.62	1,675,468.80	
NETEASE INC-ADR	3,000	223.67	671,010.00	
SINA CORP	2,100	62.41	131,061.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	1,200	41.25	49,500.00	
YY INC-ADR	1,000	41.55	41,550.00	
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	5,654	8.21	46,419.34	
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	20,250	9.04	183,060.00	
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	5,670	8.74	49,555.80	
ENEL AMERICAS S.A-ADR	21,741	7.89	171,536.49	
ENEL CHILE SA-ADR	13,525	4.40	59,510.00	
INTER RAO UES PJSC	1,100,000	0.06	67,584.00	
PJSC RUSHYDRO	3,891,000	0.01	56,808.60	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	51,620	1.90	98,416.62	
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	5,000	42.50	212,500.00	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,700	68.71	116,807.00	
ENEL GENERACION CHILE-SP ADR	4,400	18.51	81,444.00	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	27,540	1.47	40,621.50	
小計 銘柄数：51			16,927,589.48	
			(1,980,866,520)	
				11.8%
組入時価比率：11.4%				
メキシコペソ				
MEXICHEM SAB DE CV-*	38,958	47.68	1,857,517.44	
CEMEX SAB - CPO	528,170	16.05	8,477,128.50	

	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	146,383	56.54	8,276,494.82	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,210	387.28	2,017,728.80	
	ALFA S.A.B. -A	99,200	26.30	2,608,960.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	23,200	80.80	1,874,560.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	7,600	295.31	2,244,356.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	14,300	167.08	2,389,244.00	
	OHL MEXICO SAB DE CV	24,100	20.00	482,000.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	10,000	174.54	1,745,400.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	94,000	85.99	8,083,060.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	7,600	150.00	1,140,000.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	200,700	37.53	7,532,271.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	16,700	107.12	1,788,904.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	17,795	129.94	2,312,282.30	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	69,400	156.39	10,853,466.00	
	GRUMA S.A.B. -B	8,200	258.13	2,116,666.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	61,400	44.54	2,734,756.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	19,800	30.18	597,564.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	52,500	36.44	1,913,100.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	62,600	30.95	1,937,470.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	93,700	99.91	9,361,567.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	93,000	30.31	2,818,830.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,241,200	12.87	15,974,244.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	20,000	87.53	1,750,600.00	
	GENTERA SAB DE CV	36,200	31.66	1,146,092.00	
小計	銘柄数：26			104,034,261.86	
				(591,954,949)	
	組入時価比率：3.4%			3.5%	
リアル	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	4,200	36.89	154,938.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	111,600	16.57	1,849,212.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	148,100	14.24	2,108,944.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	13,400	65.90	883,060.00	
	BRASKEM SA-PREF A	6,300	33.12	208,656.00	
	KLABIN SA-UNIT	20,200	16.80	339,360.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	21,500	9.95	213,925.00	
	GERDAU SA PFD NPV	36,300	10.30	373,890.00	

VALE SA	49,700	25.19	1,251,943.00	
VALE SA-PREF A	73,300	22.27	1,632,391.00	
DURATEX SA	11,340	6.30	71,442.00	
FIBRIA CELULOSE SA	9,973	30.30	302,181.90	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA-PREF	16,300	13.18	214,834.00	
EMBRAER SA	27,200	15.30	416,160.00	
WEG SA	21,380	14.85	317,493.00	
LOCALIZA RENT A CAR	6,170	34.49	212,803.30	
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	26,600	5.92	157,472.00	
CCR SA	32,900	15.29	503,041.00	
LOJAS AMERICANAS S.A.(PREF)	20,292	16.55	335,832.60	
LOJAS AMERICANAS SA	4,650	12.01	55,846.50	
LOJAS RENNEN S.A.	25,500	21.51	548,505.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	5,703	53.08	302,715.24	
RAIA DROGASIL SA	8,600	58.40	502,240.00	
AMBEV SA	177,256	16.00	2,836,096.00	
BRF SA	23,400	46.48	1,087,632.00	
JBS SA	28,000	11.40	319,200.00	
M DIAS BRANCO SA	1,300	110.15	143,195.00	
HYPERMARCAS S.A	14,200	24.99	354,858.00	
NATURA COSMETICOS SA	6,300	22.09	139,167.00	
ODONTOPREV S.A.	10,600	12.51	132,606.00	
QUALICORP SA	7,700	18.51	142,527.00	
BANCO BRADESCO S.A.	31,028	27.34	848,305.52	
BANCO BRADESCO SA - PREF	105,841	27.31	2,890,517.71	
BANCO DO BRASIL SA	32,200	26.74	861,028.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	16,200	27.15	439,830.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	122,694	32.47	3,983,874.18	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	149,307	7.90	1,179,525.30	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	25,500	27.25	694,875.00	
PORTO SEGURO SA	3,200	25.60	81,920.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	5,316	17.30	91,966.80	
CIELO SA	37,803	27.95	1,056,593.85	
TELEFONICA BRASIL-PREF	17,605	42.74	752,437.70	
TIM PARTICIPACOES SA	30,152	7.61	229,456.72	

	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	8,700	25.17	218,979.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	7,500	22.34	167,550.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	30,229	7.52	227,322.08	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,400	26.36	89,624.00	
	CPFL ENERGIA SA	6,664	25.15	167,599.60	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	11,200	13.41	150,192.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	8,000	52.60	420,800.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	12,500	27.43	342,875.00	
	BM&F BOVESPA SA	62,900	15.74	990,046.00	
	CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	7,606	43.99	334,587.94	
	KROTON EDUCACIONAL SA	49,856	13.03	649,623.68	
	AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	7,018	13.62	95,585.16	
	ENGIE BRASIL SA	5,400	34.14	184,356.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	19,500	11.55	225,225.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,900	57.52	166,808.00	
小計	銘柄数：58			35,653,670.78	
				(1,276,044,877)	
	組入時価比率：7.4%			7.6%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	17,200	6,277.60	107,974,720.00	
	EMPRESAS CMPC SA	50,051	1,312.30	65,681,927.30	
	S.A.C.I. FALABELLA	23,200	5,065.60	117,521,920.00	
	CENCOSUD SA	56,238	1,838.00	103,365,444.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	10,300	2,411.10	24,834,330.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,304	32,305.00	42,125,720.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	5,372	6,761.30	36,321,703.60	
	AGUAS ANDINAS SA-A	95,300	345.45	32,921,385.00	
	AES GENER SA	121,560	225.31	27,388,683.60	
	COLBUN SA	292,000	125.26	36,575,920.00	
小計	銘柄数：10			594,711,753.50	
				(103,241,960)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
コロンビアペソ	CEMENTOS ARGOS SA	17,600	11,760.00	206,976,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	10,200	18,900.00	192,780,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	129,900	1,180.00	153,282,000.00	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA	3,588	36,420.00	130,674,960.00	

	GRUPO DE INV SURAMERICANA	9,200	36,500.00	335,800,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF	4,100	35,600.00	145,960,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	15,100	9,820.00	148,282,000.00	
小計	銘柄数：7			1,313,754,960.00	
				(51,236,443)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ユーロ	TITAN CEMENT CO	1,580	21.80	34,444.00	
	OPAP SA	7,560	8.18	61,840.80	
	FF GROUP	1,300	18.43	23,959.00	
	JUMBO SA	4,002	15.11	60,470.22	
	ALPHA BANK A.E.	55,409	1.86	103,060.74	
	EUROBANK ERGASIAS SA	67,678	0.61	41,283.58	
	NATIONAL BANK OF GREECE	199,986	0.23	46,596.73	
	PIRAEUS BANK S.A.	261,636	0.19	51,019.02	
	HELLENIC TELECOM	9,250	8.70	80,475.00	
小計	銘柄数：9			503,149.09	
				(61,479,787)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	4,870	70.60	343,822.00	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	20,550	3.54	72,747.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	56,040	5.09	285,243.60	
	KOC HLDGS	23,504	13.32	313,073.28	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	27,375	3.67	100,466.25	
	TURK HAVA YOLLARI AO	18,316	4.94	90,481.04	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	6,760	13.79	93,220.40	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	2,330	30.18	70,319.40	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,370	23.80	104,006.00	
	ARCELIK A.S	8,423	20.94	176,377.62	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,140	48.36	393,650.40	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYI I	7,820	17.58	137,475.60	
	COCA-COLA ICECEK AS	2,880	32.82	94,521.60	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	6,040	16.90	102,076.00	
	AKBANK T.A.S	85,650	7.72	661,218.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	89,860	7.61	683,834.60	
	TURKIYE HALK BANKASI	22,250	9.31	207,147.50	

	TURKIYE IS BANKASI AS-C	65,110	5.11	332,712.10	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	24,010	4.33	103,963.30	
	YAPI VE KREDI BANKASI A.S.	33,170	3.37	111,782.90	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	33,450	9.18	307,071.00	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	15,500	5.14	79,670.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	35,500	9.45	335,475.00	
小計	銘柄数：23			5,200,354.59	
				(173,379,822)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,890	869.60	2,513,144.00	
	MONETA MONEY BANK AS	16,000	82.25	1,316,000.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	1,860	254.50	473,370.00	
	CEZ AS	5,880	420.50	2,472,540.00	
小計	銘柄数：4			6,775,054.00	
				(30,690,994)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	1,330	20,100.00	26,733,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	5,290	6,144.00	32,501,760.00	
	OTP BANK NYRT	8,990	8,370.00	75,246,300.00	
小計	銘柄数：3			134,481,060.00	
				(53,173,811)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	3,589	38.60	138,535.40	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	12,450	86.08	1,071,696.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	68,820	5.47	376,445.40	
	GRUPA AZOTY SA	1,560	62.00	96,720.00	
	SYNTHOS SA	18,130	4.42	80,134.60	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	1,930	70.40	135,872.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	5,700	91.20	519,840.00	
	CCC SA	1,010	197.70	199,677.00	
	LPP SA	50	5,635.90	281,795.00	
	CYFROWY POLSAT SA	7,520	24.04	180,780.80	
	EUROCASH SA	2,510	38.65	97,011.50	
	ALIOR BANK SA	2,933	54.15	158,821.95	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1,250	76.17	95,212.50	
	BANK MILLENNIUM SA	19,060	5.08	96,824.80	



	BANK PEKAO SA	6,120	123.65	756,738.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	1,200	311.50	373,800.00	
	MBANK	580	330.85	191,893.00	
	PKO BANK POLSKI SA	33,970	28.15	956,255.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	20,430	32.60	666,018.00	
	ORANGE POLSKA SA	21,780	5.25	114,345.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	29,950	10.53	315,373.50	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	40,110	2.94	117,923.40	
小計	銘柄数：22			7,021,713.35	
				(194,782,328)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	72,000	7.05	507,600.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	88,000	3.54	311,520.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	964,900	5.48	5,287,652.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	133,000	14.30	1,901,900.00	
	CNOOC LTD	673,000	9.57	6,440,610.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	118,000	5.83	687,940.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	786,000	5.81	4,566,660.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	70,000	5.19	363,300.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	114,000	4.09	466,260.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	45,000	21.20	954,000.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	107,000	3.69	394,830.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	132,000	3.11	410,520.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	45,000	10.66	479,700.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	201,000	2.32	466,320.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	57,000	6.93	395,010.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	72,000	5.20	374,400.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	160,000	8.50	1,360,000.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	148,000	6.20	917,600.00	
	CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	75,000	9.77	732,750.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	72,000	11.38	819,360.00	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	47,500	6.33	300,675.00	
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	88,000	3.36	295,680.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	22,500	38.40	864,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	17,000	34.85	592,450.00	

CITIC LTD	171,000	10.90	1,863,900.00
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	97,440	10.78	1,050,403.20
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	19,000	20.60	391,400.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	49,500	13.66	676,170.00
CRRC CORP LTD-H	153,350	6.89	1,056,581.50
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	23,000	14.56	334,880.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	38,400	12.06	463,104.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	98,000	8.24	807,520.00
SINOTRANS LIMITED-H	61,000	3.38	206,180.00
AIR CHINA LIMITED-H	54,000	5.02	271,080.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	50,000	4.10	205,000.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	48,000	7.30	350,400.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	48,000	18.86	905,280.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	52,000	7.72	401,440.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	48,000	9.48	455,040.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	46,000	7.33	337,180.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	18,000	23.25	418,500.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	124,000	10.14	1,257,360.00
BYD CO LTD-H	24,500	40.30	987,350.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE-B	26,800	10.67	285,956.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	112,000	7.50	840,000.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	190,000	7.09	1,347,100.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	113,000	7.10	802,300.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	73,922	9.03	667,515.66
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	42,000	11.86	498,120.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	40,000	22.30	892,000.00
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	248,000	4.29	1,063,920.00
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	820,000	0.37	303,400.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	21,000	47.55	998,550.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	430,000	1.32	567,600.00
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	383,360	0.91	348,857.60
SUN ART RETAIL GROUP LTD	97,500	6.69	652,275.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	61,333	14.64	897,915.12
TSING TAO BREWERY CO-H	14,000	29.30	410,200.00

CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	2.83	407,520.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	105,000	14.34	1,505,700.00
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	74,000	9.29	687,460.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	236,000	4.77	1,125,720.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	27,000	55.10	1,487,700.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	72,000	4.99	359,280.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,100	16.80	404,880.00
SINOPHARM GROUP CO-H	42,800	31.45	1,346,060.00
3SBIO, INC	33,500	7.32	245,220.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	47,000	11.80	554,600.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	152,000	8.03	1,220,560.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	13,000	22.70	295,100.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	154,000	5.25	808,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	945,000	3.13	2,957,850.00
BANK OF CHINA LTD-H	2,979,000	3.35	9,979,650.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	346,790	5.46	1,893,473.40
CHINA CITIC BANK-H	321,000	4.81	1,544,010.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,180,000	5.62	17,871,600.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	96,000	3.40	326,400.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	152,192	17.74	2,699,886.08
CHINA MINSHENG BANKING-H	225,000	8.03	1,806,750.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	96,000	4.40	422,400.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,761,000	4.49	12,396,890.00
FAR EAST HORIZON LTD	77,000	6.38	491,260.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	276,000	20.05	5,533,800.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	98,000	26.60	2,606,800.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	66,072	15.64	1,033,366.08
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	31,700	34.95	1,107,915.00
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	271,000	3.01	815,710.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	172,280	11.90	2,050,132.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	198,500	38.40	7,622,400.00
TENCENT HOLDINGS LTD	214,000	179.70	38,455,800.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	37,000	15.70	580,900.00
KINGSOFT CORP LTD	27,000	15.46	417,420.00

ZTE CORP-H	23,452	12.56	294,557.12	
LENOVO GROUP LTD	288,000	4.67	1,344,960.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,500	67.45	1,787,425.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	26,000	32.80	852,800.00	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	538,200	0.95	511,290.00	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD	367,000	0.21	78,905.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	112,000	10.94	1,225,280.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	86,400	4.86	419,904.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	518,000	3.56	1,844,080.00	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	224,000	8.98	2,011,520.00	
CHINA MOBILE LTD	232,000	80.50	18,676,000.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	66,000	10.22	674,520.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	32,000	21.20	678,400.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	32,000	31.40	1,004,800.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	151,000	4.91	741,410.00	
GUANGDONG INVESTMENT	106,000	9.96	1,055,760.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	357,000	2.62	935,340.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	36,000	14.34	516,240.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	114,000	6.86	782,040.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	186,000	2.56	476,160.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	83,000	15.50	1,286,500.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	49,600	15.98	792,608.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	122,800	13.10	1,608,680.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	55,800	14.64	816,912.00	
CGN POWER CO LTD-H	392,000	2.10	823,200.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	123,000	5.76	708,480.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	115,000	2.73	313,950.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	70,000	12.02	841,400.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	146,000	4.91	716,860.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	156,000	2.35	366,600.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	108,000	3.79	409,320.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	147,000	4.74	696,780.00	

	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	128,000	2.03	259,840.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	146,000	20.40	2,978,400.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	104,444	17.32	1,808,970.08	
	CHINA VANKE CO LTD-H	53,700	17.54	941,898.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	193,380	4.28	827,666.40	
	FULLSHARE HOLDINGS LIMITED	250,000	3.43	857,500.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	38,000	9.09	345,420.00	
	LONGFOR PROPERTIES	50,000	9.63	481,500.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	42,000	9.96	418,320.00	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	101,500	3.31	335,965.00	
	SOHO CHINA LTD	65,500	3.74	244,970.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	74,000	6.43	475,820.00	
小計	銘柄数：136			231,236,878.24	
				(3,487,052,123)	
	組入時価比率：20.1%			20.6%	
リンギ	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	155,300	1.60	248,480.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	8,300	23.50	195,050.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	94,000	6.90	648,600.00	
	LAFARGE MALAYSIA BHD	12,900	6.85	88,365.00	
	DIALOG GROUP BHD	123,144	1.53	188,410.32	
	GAMUDA BERHAD	66,300	4.80	318,240.00	
	IJM CORP	101,700	3.18	323,406.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	25,700	8.18	210,226.00	
	SIME DARBY BERHAD	93,700	8.03	752,411.00	
	AIRASIA BHD	45,600	2.31	105,336.00	
	MISC BHD	43,460	7.23	314,215.80	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	24,360	6.01	146,403.60	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	33,200	4.20	139,440.00	
	UMW HOLDINGS BHD	21,300	4.65	99,045.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	17,305	2.95	51,049.75	
	GENTING BHD	81,300	7.72	627,636.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	116,400	4.54	528,456.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	50,000	2.65	132,500.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	38,600	1.53	59,058.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	8,500	10.58	89,930.00	

	IOI CORP	91,000	4.36	396,760.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	16,600	23.54	390,764.00	
	PPB GROUP BERHAD	18,500	15.74	291,190.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	4,500	42.50	191,250.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	19,700	4.66	91,802.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	128,600	6.34	815,324.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	39,500	3.68	145,360.00	
	AMMB HOLDING	65,700	4.26	279,882.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	112,700	4.58	516,166.00	
	HONG LEONG BANK	25,260	13.08	330,400.80	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	6,322	14.54	91,921.88	
	MALAYAN BANKING	132,600	7.74	1,026,324.00	
	PUBLIC BANK BHD	105,160	19.68	2,069,548.80	
	RHB BANK BHD	22,223	4.65	103,336.95	
	TELEKOM MALAYSIA	40,100	5.95	238,595.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	103,000	4.50	463,500.00	
	DIGI.COM BERHAD	135,100	4.95	668,745.00	
	MAXIS BHD	63,400	5.95	377,230.00	
	TENAGA NASIONAL	129,300	13.66	1,766,238.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	25,100	21.20	532,120.00	
	YTL CORPORATION	157,313	1.53	240,688.89	
	YTL POWER INTL	72,073	1.42	102,343.66	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	56,432	2.02	113,992.64	
小計	銘柄数：43			16,509,742.09	
				(432,059,950)	
	組入時価比率：2.5%			2.6%	
パーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	42,900	18.70	802,230.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	36,300	28.50	1,034,550.00	
	IRPC PCL - NVDR	339,200	4.78	1,621,376.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	55,100	91.00	5,014,100.00	
	PTT PCL-NVDR	38,500	365.00	14,052,500.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	32,600	71.75	2,339,050.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	53,567	32.75	1,754,319.25	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	85,394	62.75	5,358,473.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	4,000	484.00	1,936,000.00	

	SIAM CEMENT PUBLIC (F)	11,600	482.00	5,591,200.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	44,400	49.50	2,197,800.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	238,700	8.40	2,005,080.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	16,400	388.00	6,363,200.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	260,000	7.35	1,911,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	81,600	34.25	2,794,800.00	
	BEC WORLD PCL NVDR	27,600	16.50	455,400.00	
	ROBINSON DEPT STORE-NVDR	16,600	61.25	1,016,750.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	135,097	10.00	1,350,970.00	
	CP ALL PCL-NVDR	186,000	60.75	11,299,500.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	96,300	28.75	2,768,625.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	57,700	20.50	1,182,850.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	143,600	22.40	3,216,640.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	13,200	174.00	2,296,800.00	
	BANGKOK BANK(F)	7,500	158.50	1,188,750.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	23,500	173.00	4,065,500.00	
	KASIKORNBANK PCL(F)	44,500	173.00	7,698,500.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	117,250	17.40	2,040,150.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	66,600	146.50	9,756,900.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	440,400	2.08	916,032.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	15,100	80.00	1,208,000.00	
	KCE ELECTRONICS-NVDR	10,700	118.50	1,267,950.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	373,900	7.00	2,617,300.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	39,600	144.50	5,722,200.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	4,400	194.00	853,600.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	18,700	77.00	1,439,900.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	51,400	55.25	2,839,850.00	
小計	銘柄数：36			119,977,845.75	
				(389,927,998)	
	組入時価比率：2.3%			2.3%	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	80,600	66.95	5,396,170.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	54,600	12.30	671,580.00	
	DMCI HOLDINGS INC	127,500	12.60	1,606,500.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	105,100	66.00	6,936,600.00	
	SM INVESTMENTS CORP	9,645	615.00	5,931,675.00	

	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	20,360	69.85	1,422,146.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	15,600	190.60	2,973,360.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	33,900	150.00	5,085,000.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	27,249	87.40	2,381,562.60	
	BDO UNIBANK INC	66,957	105.00	7,030,485.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	21,545	71.55	1,541,544.75	
	SECURITY BANK CORP	8,000	200.00	1,600,000.00	
	AYALA CORPORATION	8,942	708.00	6,330,936.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	3,050	1,209.00	3,687,450.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	433,800	5.99	2,598,462.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,040	1,445.00	1,502,800.00	
	PLDT INC	3,970	1,313.00	5,212,610.00	
	ABOITIZ POWER CORP	53,600	41.50	2,224,400.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORPORATION	341,500	4.94	1,687,010.00	
	AYALA LAND LTD	263,900	30.05	7,930,195.00	
	MEGAWORLD CORP	374,000	3.53	1,320,220.00	
	ROBINSONS LAND CO	49,100	24.95	1,225,045.00	
	SM PRIME HLDGS	309,375	27.00	8,353,125.00	
小計	銘柄数：23			84,648,876.35	
				(199,771,348)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	533,700	1,655.00	883,273,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	64,050	19,675.00	1,260,183,750.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	57,700	14,800.00	853,960,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	121,600	9,050.00	1,100,480,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	157,500	2,300.00	362,250,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	53,300	5,575.00	297,147,500.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	73,859	4,170.00	307,992,030.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	755,400	7,325.00	5,533,305,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	146,500	1,620.00	237,330,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	196,100	2,760.00	541,236,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	90,800	14,275.00	1,296,170,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	89,000	7,550.00	671,950,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	175,700	7,275.00	1,278,217,500.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	255,700	2,900.00	741,530,000.00	



	GUDANG GARAM TBK	19,500	60,300.00	1,175,850,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	340,000	3,640.00	1,237,600,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	56,200	37,875.00	2,128,575,000.00	
	KALBE FARMA PT	768,500	1,440.00	1,106,640,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	459,000	14,450.00	6,632,550,000.00	
	BANK DANAMON PT	125,196	3,330.00	416,902,680.00	
	BANK MANDIRI	362,500	10,775.00	3,905,937,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	298,700	5,250.00	1,568,175,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	430,100	10,875.00	4,677,337,500.00	
	TELEKOMUNIKASI	1,908,100	3,690.00	7,040,889,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	88,700	4,980.00	441,726,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	138,200	2,250.00	310,950,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	440,800	2,520.00	1,110,816,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	293,700	1,600.00	469,920,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	592,500	710.00	420,675,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	920,000	540.00	496,800,000.00	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	323,300	1,255.00	405,741,500.00	
小計	銘柄数：31			48,912,110,460.00	
				(425,535,361)	
	組入時価比率：2.5%			2.5%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,110	53,600.00	113,096,000.00	
	S-OIL CORPORATION	1,630	84,900.00	138,387,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	2,520	146,500.00	369,180,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	4,200	25,650.00	107,730,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	770	148,500.00	114,345,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	678	82,400.00	55,867,200.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	274	180,000.00	49,320,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	1,776	266,500.00	473,304,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	610	356,000.00	217,160,000.00	
	OCI COMPANY LTD	620	77,300.00	47,926,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,889	59,200.00	171,028,800.00	
	KOREA ZINC CO LTD	310	479,000.00	148,490,000.00	
	POSCO	2,840	264,500.00	751,180,000.00	
	HANWHA TECHWIN CO LTD	1,430	43,700.00	62,491,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,780	67,000.00	186,260,000.00	
		235	369,000.00	86,715,000.00	

KCC CORP				
DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	940	82,800.00	77,832,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	4,990	5,150.00	25,698,500.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,988	25,700.00	51,091,600.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	2,260	44,850.00	101,361,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	2,500	43,000.00	107,500,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1,770	28,000.00	49,560,000.00	
CJ CORP	547	184,500.00	100,921,500.00	
HANWHA CORPORATION	1,860	35,100.00	65,286,000.00	
LG CORP	3,700	59,000.00	218,300,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,868	128,500.00	368,538,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,762	230,000.00	405,260,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,623	148,500.00	241,015,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	9,747	9,430.00	91,914,210.00	
POSCO DAEWOO CORP	1,809	28,100.00	50,832,900.00	
SK NETWORKS CO LTD	4,820	6,830.00	32,920,600.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	790	57,000.00	45,030,000.00	
S-1 CORPORATION	620	89,100.00	55,242,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	650	155,000.00	100,750,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,047	28,750.00	30,101,250.00	
CJ KOREA EXPRESS CO LTD	270	179,500.00	48,465,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	2,703	57,100.00	154,341,300.00	
HANON SYSTEMS	6,200	9,890.00	61,318,000.00	
HYUNDAI MOBIS	2,540	266,500.00	676,910,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	542	73,500.00	39,837,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	5,800	144,000.00	835,200,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,340	101,500.00	136,010,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	810	96,500.00	78,165,000.00	
KIA MOTORS CORP	9,680	39,100.00	378,488,000.00	
COWAY CO LTD	1,950	90,900.00	177,255,000.00	
HANSSEM CO LTD	410	191,000.00	78,310,000.00	
LG ELECTRONICS INC	4,045	49,650.00	200,834,250.00	
KANGWON LAND INC	4,270	37,550.00	160,338,500.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	2,240	15,400.00	34,496,000.00	
CJ E&M CORP	570	67,900.00	38,703,000.00	

HYUNDAI DEPT STORE CO	600	111,000.00	66,600,000.00
LOTTE SHOPPING CO	390	220,500.00	85,995,000.00
SHINSEGAE CO LTD	229	178,500.00	40,876,500.00
HOTEL SHILLA CO LTD	1,242	48,400.00	60,112,800.00
BGF RETAIL CO LTD	740	83,200.00	61,568,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	1,010	27,150.00	27,421,500.00
E-MART CO	741	184,500.00	136,714,500.00
GS RETAIL CO LTD	810	47,200.00	38,232,000.00
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	20	1,470,000.00	29,400,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	320	365,000.00	116,800,000.00
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	190	183,000.00	34,770,000.00
ORION CORP	131	653,000.00	85,543,000.00
OTTOGI CORPORATION	40	666,000.00	26,640,000.00
KT & G CORP	4,370	105,000.00	458,850,000.00
AMOREPACIFIC CORP	1,230	322,500.00	396,675,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	300	194,000.00	58,200,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	1,020	129,000.00	131,580,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	369	848,000.00	312,912,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	70	527,000.00	36,890,000.00
CELLTRION INC	2,934	104,000.00	305,136,000.00
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	178	321,000.00	57,138,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	456	64,200.00	29,275,200.00
YUHAN CORPORATION	286	205,000.00	58,630,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	10,437	8,930.00	93,202,410.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	6,269	9,970.00	62,501,930.00
HANA FINANCIAL HOLDINGS	11,025	32,950.00	363,273,750.00
INDUSTRIAL BK OF KOREA	10,420	13,450.00	140,149,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	15,100	43,550.00	657,605,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP	15,900	46,800.00	744,120,000.00
WOORI BANK	11,190	13,250.00	148,267,500.00
DONGBU INSURANCE CO LTD	1,870	63,700.00	119,119,000.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	8,610	6,740.00	58,031,400.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	2,080	31,650.00	65,832,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,290	273,000.00	352,170,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	2,630	114,500.00	301,135,000.00

	KAKAO CORP	1,220	75,000.00	91,500,000.00	
	NAVER CORP	1,050	768,000.00	806,400,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,370	138,000.00	189,060,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	680	249,500.00	169,660,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS	3,740	1,782,000.00	6,664,680,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	660	1,396,000.00	921,360,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	460	87,000.00	40,020,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	8,420	31,300.00	263,546,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	2,070	49,400.00	102,258,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	1,975	108,500.00	214,287,500.00	
	SK HYNIX INC	21,970	46,300.00	1,017,211,000.00	
	KT CORP	880	30,250.00	26,620,000.00	
	LG UPLUS CORP	8,699	11,950.00	103,953,050.00	
	SK TELECOM CO LTD	770	230,500.00	177,485,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	9,960	45,950.00	457,662,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,099	48,250.00	53,026,750.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,360	41,600.00	56,576,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,390	42,000.00	58,380,000.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	5,525	7,250.00	40,056,250.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	2,646	20,500.00	54,243,000.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	4,330	9,980.00	43,213,400.00	
	SAMSUNG SECURITIES	1,847	32,200.00	59,473,400.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	640	144,000.00	92,160,000.00	
小計	銘柄数：108			25,874,503,950.00	
				(2,530,526,486)	
	組入時価比率：14.6%			15.0%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	46,360	105.00	4,867,800.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	120,998	93.20	11,277,013.60	
	FORMOSA PLASTIC	160,424	86.10	13,812,506.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	179,726	70.40	12,652,710.40	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	23,000	40.00	920,000.00	
	ASIA CEMENT	95,980	26.20	2,514,676.00	
	TAIWAN CEMENT	131,323	34.35	4,510,945.05	
	CHINA STEEL	460,544	24.60	11,329,382.40	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	68,000	26.80	1,822,400.00	

FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	114,454	24.00	2,746,896.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	6,885	143.50	987,997.50
CHINA AIRLINES	79,561	9.28	738,326.08
EVA AIRWAYS CORP	59,629	14.55	867,601.95
EVERGREEN MARINE	44,741	11.00	492,151.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	74,036	59.00	4,368,124.00
YULON MOTOR CO	29,089	26.50	770,858.50
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	5,000	315.50	1,577,500.00
GIANT MANUFACTURING	9,752	181.50	1,769,988.00
MERIDA INDUSTRY CO LTD	8,250	138.00	1,138,500.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	6,278	333.50	2,093,713.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	14,315	117.00	1,674,855.00
FORMOSA TAFFETA CO.	20,000	28.60	572,000.00
POU CHEN CORP	88,468	39.15	3,463,522.20
RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,785	53.20	1,105,762.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	9,000	360.50	3,244,500.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20,816	228.50	4,756,456.00
STANDARD FOODS CORP	15,038	74.90	1,126,346.20
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	185,836	52.20	9,700,639.20
OBI PHARMA INC	4,000	246.00	984,000.00
TAI MED BIOLOGICS INC	5,000	161.00	805,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	175,284	16.70	2,927,242.80
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	484,789	7.96	3,858,920.44
CTBC FINANCIAL HOLDING	676,212	17.45	11,799,899.40
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	307,128	18.05	5,543,660.40
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	372,302	16.80	6,254,673.60
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	292,416	16.00	4,678,656.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	413,380	22.90	9,466,402.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	383,189	8.95	3,429,541.55
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	349,244	11.70	4,086,154.80
TAIWAN BUSINESS BANK	117,429	8.08	948,826.32
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	314,553	13.85	4,356,559.05
CHAILEASE HOLDING CO LTD	34,632	54.40	1,883,980.80
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	246,541	49.80	12,277,741.80

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	301,510	47.00	14,170,970.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	131,330	31.50	4,136,895.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	274,547	7.80	2,141,466.60	
ACER INC	91,767	13.00	1,192,971.00	
ADVANTECH CO.,LTD.	13,268	247.50	3,283,830.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	26,805	264.00	7,076,520.00	
CASETEK HOLDINGS LTD	5,000	82.70	413,500.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	23,840	221.50	5,280,560.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	20,397	72.40	1,476,742.80	
COMPAL ELECTRONICS	157,590	18.05	2,844,499.50	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	34,834	82.70	2,880,771.80	
HTC CORPORATION	23,792	77.20	1,836,742.40	
INVENTEC CO.,LTD	102,911	20.85	2,145,694.35	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	74,897	47.50	3,557,607.50	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	25,000	72.00	1,800,000.00	
PEGATRON CORP	74,692	76.10	5,684,061.20	
QUANTA COMPUTER INC	99,684	58.40	5,821,545.60	
TRANSCEND INFORMATION INC	4,301	84.00	361,284.00	
WISTRON CORP	88,687	23.15	2,053,104.05	
AU OPTRONICS CORP	327,008	12.00	3,924,096.00	
DELTA ELECTRONICS INC	72,681	155.00	11,265,555.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	579,812	82.70	47,950,452.40	
INNOLUX CORP	358,322	11.65	4,174,451.30	
LARGAN PRECISION CO LTD	4,040	3,550.00	14,342,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	44,566	32.35	1,441,710.10	
WPG HOLDINGS CO LTD	49,030	37.45	1,836,173.50	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	13,410	63.20	847,512.00	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	246,615	32.35	7,977,995.25	
MEDIATEK INC	56,538	216.50	12,240,477.00	
NANYA TECHNOLOGY CO	23,000	49.55	1,139,650.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	20,058	103.50	2,076,003.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	4,306	255.50	1,100,183.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	27,147	84.20	2,285,777.40	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	15,417	99.20	1,529,366.40	
SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES	84,220	46.75	3,937,285.00	

	TAIWAN SEMICONDUCTOR	928,000	178.50	165,648,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	454,500	11.30	5,135,850.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	34,000	54.00	1,836,000.00	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	56,000	10.25	574,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	147,065	101.00	14,853,565.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	58,000	70.50	4,089,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	59,200	102.00	6,038,400.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	349,377	11.70	4,087,710.90	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	28,110	44.70	1,256,517.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	27,232	36.15	984,436.80	
小計	銘柄数：88			570,935,362.29	
				(2,078,204,718)	
	組入時価比率：12.0%			12.3%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	19,200	610.90	11,729,280.00	
	CAIRN INDIA LIMITED	18,370	243.95	4,481,361.50	
	COAL INDIA LTD	26,510	287.85	7,630,903.50	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,200	420.55	6,392,360.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	49,890	192.95	9,626,275.50	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	49,630	1,057.30	52,473,799.00	
	ASIAN PAINTS LTD	10,440	874.00	9,124,560.00	
	UPL LTD	13,790	627.00	8,646,330.00	
	ACC LIMITED	1,840	1,296.30	2,385,192.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	23,660	200.05	4,733,183.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	280	13,628.45	3,815,966.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	3,340	3,107.10	10,377,714.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	40,630	159.30	6,472,359.00	
	JSW STEEL LTD	3,010	1,568.05	4,719,830.50	
	TATA STEEL LIMITED	10,100	390.85	3,947,585.00	
	VEDANTA LTD	40,344	216.65	8,740,527.60	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	11,430	1,337.45	15,287,053.50	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	23,980	119.00	2,853,620.00	
	HAVELLS INDIA LTD	9,110	325.55	2,965,760.50	
	SIEMENS INDIA LIMITED	2,310	1,070.85	2,473,663.50	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	46,480	77.70	3,611,496.00	
	EICHER MOTORS LTD	530	20,921.90	11,088,607.00	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	970	1,102.20	1,069,134.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	28,709	262.90	7,547,596.10
BHARAT FORGE LIMITED	3,630	911.95	3,310,378.50
BOSCH LTD	300	19,715.95	5,914,785.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	16,175	309.10	4,999,692.50
BAJAJ AUTO LIMITED	2,910	2,618.80	7,620,708.00
HERO MOTOCORP LTD	1,940	3,040.10	5,897,794.00
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	14,520	1,171.60	17,011,632.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,870	5,197.15	20,112,970.50
TATA MOTORS LTD	58,129	465.65	27,067,768.85
TATA MOTORS LTD-A-DVR	14,960	293.70	4,393,752.00
TITAN CO LTD	11,330	314.30	3,561,019.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	22,800	442.65	10,092,420.00
UNITED SPIRITS LIMITED	2,423	1,852.55	4,488,728.65
NESTLE INDIA LIMITED	940	5,803.60	5,455,384.00
ITC LTD	131,205	224.70	29,481,763.50
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	24,660	789.50	19,469,070.00
DABUR INDIA LTD	17,676	262.05	4,631,995.80
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,420	1,433.60	6,336,512.00
MARICO LIMITED	15,650	245.40	3,840,510.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,120	1,136.40	3,545,568.00
AUROBINDO PHARMA LTD	9,356	647.55	6,058,477.80
CADILA HEALTHCARE LTD	6,140	336.85	2,068,259.00
CIPLA LIMITED	13,550	582.30	7,890,165.00
DR.REDDYS LABORATORIES	4,660	2,998.55	13,973,243.00
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	5,040	925.70	4,665,528.00
LUPIN LTD	7,860	1,445.80	11,363,988.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,960	1,468.30	4,346,168.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	35,182	623.50	21,935,977.00
AXIS BANK LIMITED	62,580	438.10	27,416,298.00
ICICI BANK LTD	39,290	251.85	9,895,186.50
IDFC BANK LTD	50,500	58.75	2,966,875.00
YES BANK LTD	12,280	1,124.70	13,811,316.00
POWER FINANCE CORPORATION	24,180	119.70	2,894,346.00
BAJAJ FINSERV LTD	1,420	2,620.40	3,720,968.00



	HCL TECHNOLOGIES LTD	20,480	793.75	16,256,000.00	
	INFOSYS LTD	69,980	988.45	69,171,731.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	17,930	2,288.10	41,025,633.00	
	TECH MAHINDRA LTD	9,020	467.10	4,213,242.00	
	WIPRO LTD	22,708	458.75	10,417,295.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	19,700	336.40	6,627,080.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	36,650	295.55	10,831,907.50	
	IDEA CELLULAR LIMITED	47,580	70.80	3,368,664.00	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	45,274	73.95	3,348,012.30	
	GAIL INDIA LTD	11,830	431.55	5,105,236.50	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	57,230	1,224.85	70,098,165.50	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	11,810	639.25	7,549,542.50	
	LIC HOUSING FINANCE	11,240	541.80	6,089,832.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	5,900	808.95	4,772,805.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	11,380	256.05	2,913,849.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	5,470	803.65	4,395,965.50	
	NTPC LIMITED	60,140	161.05	9,685,547.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	2,580	861.50	2,222,670.00	
小計	銘柄数：75			800,526,582.60	
				(1,392,916,253)	
	組入時価比率：8.0%			8.3%	
カタールリヤル	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	9,660	22.82	220,441.20	
	INDUSTRIES QATAR	5,800	116.50	675,700.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	5,698	30.90	176,068.20	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR-RIGHTS	1,026	4.77	4,894.02	
	DOHA BANK LTD	4,200	34.65	145,530.00	
	MASRAF AL RAYAN	13,370	37.60	502,712.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	2,150	102.50	220,375.00	
	QATAR NATIONAL BANK	7,888	161.00	1,269,968.00	
	QATAR INSURANCE CO	4,638	83.10	385,417.80	
	OOREDOO QSC	3,310	102.90	340,599.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,080	218.10	235,548.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	3,230	32.90	106,267.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	30,190	15.78	476,398.20	
小計	銘柄数：13			4,759,918.42	

				(153,269,373)	
				0.9%	
エジプト債券	COMMERICAL INTERNATIONAL BANK	38,881	71.23	2,769,493.63	
	GLOBAL TELECOM HOLDING	95,560	7.45	711,922.00	
	T M G HOLDING	24,785	9.67	239,670.95	
小計	銘柄数：3			3,721,086.58	
				(23,219,580)	
				0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	5,750	85.44	491,280.00	
	SASOL LTD	20,630	396.23	8,174,224.90	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,100	253.21	531,741.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	15,620	135.90	2,122,758.00	
	GOLD FIELDS LTD	28,850	39.56	1,141,306.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	20,960	40.96	858,521.60	
	SIBANYE GOLD LTD	28,500	22.07	628,995.00	
	MONDI LTD	4,720	274.72	1,296,678.40	
	SAPPI LIMITED	21,500	85.70	1,842,550.00	
	BIDVEST GROUP LTD	13,040	176.50	2,301,560.00	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	114,410	69.50	7,951,495.00	
	TSOGO SUN HOLDINGS LTD	12,650	27.00	341,550.00	
	NASPERS LTD-N SHS	16,560	1,936.82	32,073,739.20	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	5,320	181.50	965,580.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	37,200	68.12	2,534,064.00	
	MR PRICE GROUP LTD	9,730	152.20	1,480,906.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	8,260	153.01	1,263,862.60	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	17,960	76.99	1,382,740.40	
	BID CORP LTD	12,060	241.00	2,906,460.00	
	MASSMART HOLDINGS LTD	4,140	122.59	507,522.60	
	PICKN PAY STORES LTD	12,960	62.55	810,648.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,910	169.03	2,689,267.30	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	6,870	191.84	1,317,940.80	
	PIONEER FOODS LTD	5,010	150.91	756,059.10	
	TIGER BRANDS LTD	6,270	387.47	2,429,436.90	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	33,560	31.65	1,062,174.00	
	NETCARE LTD	38,480	30.78	1,184,414.40	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	13,410	271.80	3,644,838.00	

	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	15,560	164.50	2,559,620.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,620	672.78	1,089,903.60	
	NEDBANK GROUP LTD	7,690	232.21	1,785,694.90	
	STANDARD BANK GROUP LTD	49,870	149.02	7,431,627.40	
	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	34,440	0.00	0.00	
	FIRSTRAND LTD	128,530	51.30	6,593,589.00	
	PSG GROUP LTD	2,940	206.07	605,845.80	
	REMGRO LTD	20,230	218.51	4,420,457.30	
	RMB HOLDINGS LTD	25,060	64.00	1,603,840.00	
	DISCOVERY LTD	13,580	112.50	1,527,750.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	4,240	107.03	453,807.20	
	MMI HOLDINGS LTD	40,092	22.87	916,904.04	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	23,760	38.43	913,096.80	
	SANLAM LIMITED	54,320	61.06	3,316,779.20	
	TELKOM SA SOC LTD	9,950	70.67	703,166.50	
	MTN GROUP LTD	61,930	120.22	7,445,224.60	
	VODACOM GROUP	13,080	144.52	1,890,321.60	
	BRAIT SE	11,590	84.64	980,977.60	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	6,880	66.40	456,832.00	
	INVESTEC LTD	8,580	89.23	765,593.40	
	NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENT PLC	9,590	153.73	1,474,270.70	
小計	銘柄数：49			131,627,614.84	
				(1,093,825,479)	
	組入時価比率：6.3%			6.5%	
UAE	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	118,900	1.29	153,381.00	
ディール	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	73,800	6.74	497,412.00	
ム	DUBAI ISLAMIC BANK	45,012	5.54	249,366.48	
	FIRST GULF BANK	32,367	12.60	407,824.20	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	25,116	9.75	244,881.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	66,900	18.15	1,214,235.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	109,260	2.65	289,539.00	
	EMAAR MALLS PJSC	66,000	2.63	173,580.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	134,110	7.25	972,297.50	

	小計	銘柄数：9		4,202,516.18	
				(134,144,316)	
		組入時価比率：0.8%		0.8%	
合計				16,857,304,476	
				(16,857,304,476)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(平成28年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	94,400	2,950,944.00		
		小計	銘柄数：1	94,400	2,950,944.00	
			組入時価比率：0.1%		(16,790,871)	20.4%
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	64,400	189,980.00		
		小計	銘柄数：1	64,400	189,980.00	
			組入時価比率：0.0%		(6,333,933)	7.7%
	ランド	FORTRESS INCOME FUND LTD	29,020	943,730.40		
		FORTRESS INCOME FUND LTD-A	29,380	481,244.40		
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	75,380	1,884,500.00		
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	7,790	887,514.70		
		REDEFINE PROPERTIES LTD	161,710	1,681,784.00		
		RESILIENT REIT LTD	11,572	1,250,933.20		
		小計	銘柄数：6	314,852	7,129,706.70	
	組入時価比率：0.3%		(59,247,862)	71.9%		
合計				82,372,666		
				(82,372,666)		

(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28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	382,474,604	-	368,744,647	13,729,957
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	23,527,780	-	23,402,000	125,780
米ドル	23,527,780	-	23,402,000	125,780
合計	-	-	-	13,604,177

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,883,427,552
国債証券	540,681,239,930
地方債証券	50,133,080,074

(平成28年12月26日現在)

特殊債券	53,442,923,218
社債券	28,282,379,850
未収利息	1,082,231,661
前払費用	15,640,105
流動資産合計	678,520,922,390
資産合計	678,520,922,390
負債の部	
流動負債	
未払金	1,506,690,000
未払解約金	314,220,625
未払利息	5,480
流動負債合計	1,820,916,105
負債合計	1,820,916,105
純資産の部	
元本等	
元本	519,403,348,938
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	157,296,657,347
元本等合計	676,700,006,285
純資産合計	676,700,006,285
負債純資産合計	678,520,922,390

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28年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	1.3028円
(10,000口当たり純資産額)	(13,028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 4月 1日
至 平成28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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

### 市場リスクの管理

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

### 信用リスクの管理

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

### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年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28年12月26日現在

期首	平成28年 4月 1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	499,328,368,105円
同期中における追加設定元本額	64,104,275,208円
同期中における一部解約元本額	44,029,294,375円
期末元本額	519,403,348,938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	412,024,869円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	17,951,338,306円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	18,910,979,540円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,488,056,350円
野村資産設計ファンド2015	502,506,350円
野村資産設計ファンド2020	322,385,486円
野村資産設計ファンド2025	240,853,388円

野村資産設計ファンド2030	145,839,159円
野村資産設計ファンド2035	76,435,443円
野村資産設計ファンド2040	154,288,737円
野村日本債券インデックスファンド	1,295,577,731円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	272,811,714,666円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	9,631,977,255円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	4,281,731,482円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	708,475,014円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	14,748,898,343円
野村資産設計ファンド2045	11,616,321円
野村円債投資インデックスファンド	1,843,655,583円
野村インデックスファンド・国内債券	1,431,595,795円
マイ・ロード	34,621,688,508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	265,533,838円
野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）	53,252,184円
野村時間分散投資「日経225・国内債券」（限定追加型）	29,646,575円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	6,015,431,467円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,136,096,617円
野村資産設計ファンド2050	6,749,446円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	7,244,431円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,312,957円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	864,633円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	796,217円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	291,341,699円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	13,113,517円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	98,588,132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）	949,367,986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）	268,151,247円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	8,497,663,441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）	1,696,774,509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）	20,231,190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）	29,016,200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）	4,512,563円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,181,754,514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）	374,537,789円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	2,065,163,869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）	879,584,439円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	198,913,702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）	387,130,291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）	891,538,629円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,787,544,484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）	879,839,265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）	977,811,949円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	12,203,090,683円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	17,895,949,302円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	7,989,836,029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）	42,082,371,494円



マイバランスDC30	6,969,370,584円
マイバランスDC50	4,588,967,168円
マイバランスDC70	1,383,332,102円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	8,614,610,423円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	67,731,546円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	3,472,800円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	3,470,701円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成28年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28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360回	2,200,000,000	2,208,778,000	
		国庫債券 利付(2年)第362回	1,400,000,000	1,405,950,000	
		国庫債券 利付(2年)第366回	4,000,000,000	4,018,880,000	
		国庫債券 利付(2年)第368回	1,500,000,000	1,507,470,000	
		国庫債券 利付(2年)第369回	1,500,000,000	1,507,695,000	
		国庫債券 利付(5年)第109回	2,800,000,000	2,812,208,000	
		国庫債券 利付(5年)第110回	1,000,000,000	1,006,810,000	
		国庫債券 利付(5年)第111回	1,400,000,000	1,411,256,000	
		国庫債券 利付(5年)第112回	2,200,000,000	2,220,196,000	
		国庫債券 利付(5年)第113回	7,000,000,000	7,053,900,000	
		国庫債券 利付(5年)第114回	1,500,000,000	1,512,870,000	
		国庫債券 利付(5年)第115回	7,300,000,000	7,349,348,000	
		国庫債券 利付(5年)第116回	8,100,000,000	8,161,074,000	
		国庫債券 利付(5年)第117回	5,900,000,000	5,948,734,000	
		国庫債券 利付(5年)第118回	5,000,000,000	5,045,350,000	
		国庫債券 利付(5年)第119回	4,700,000,000	4,730,973,000	
国庫債券 利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,552,690,000			

国庫債券 利付(5年)第121回	3,500,000,000	3,523,940,000	
国庫債券 利付(5年)第122回	7,800,000,000	7,854,756,000	
国庫債券 利付(5年)第123回	7,300,000,000	7,353,144,000	
国庫債券 利付(5年)第124回	8,100,000,000	8,160,750,000	
国庫債券 利付(5年)第125回	8,200,000,000	8,264,452,000	
国庫債券 利付(5年)第126回	5,500,000,000	5,544,990,000	
国庫債券 利付(5年)第127回	6,000,000,000	6,050,880,000	
国庫債券 利付(5年)第128回	6,200,000,000	6,252,948,000	
国庫債券 利付(5年)第129回	3,500,000,000	3,530,730,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	1,960,000,000	2,899,212,400	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,288,845,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,297,107,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,300,000,000	1,885,234,000	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,300,000,000	1,813,409,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,781,676,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,835,092,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,822,125,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	1,500,000,000	1,318,890,000	
国庫債券 利付(10年)第290回	1,250,000,000	1,275,325,000	
国庫債券 利付(10年)第291回	1,400,000,000	1,426,656,000	
国庫債券 利付(10年)第292回	1,600,000,000	1,638,320,000	
国庫債券 利付(10年)第293回	750,000,000	772,440,000	
国庫債券 利付(10年)第294回	500,000,000	514,220,000	
国庫債券 利付(10年)第295回	1,600,000,000	1,640,640,000	
国庫債券 利付(10年)第297回	1,100,000,000	1,134,386,000	
国庫債券 利付(10年)第298回	1,500,000,000	1,543,905,000	
国庫債券 利付(10年)第299回	1,400,000,000	1,445,794,000	
国庫債券 利付(10年)第300回	1,000,000,000	1,037,170,000	
国庫債券 利付(10年)第301回	1,500,000,000	1,561,515,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第302回	700,000,000	726,971,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	3,300,000,000	3,439,656,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,039,580,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,275,890,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,147,600,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,778,132,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,783,640,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,126,660,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,853,032,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,860,966,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,207,004,000	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,389,344,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,311,496,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	2,600,000,000	2,750,124,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,474,550,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,901,268,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,364,832,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,958,613,500	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,687,985,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,379,520,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,522,064,000	

国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,843,181,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,352,128,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,900,000,000	5,142,207,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,195,088,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,258,968,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,500,000,000	5,723,190,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,590,864,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	4,015,346,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,982,042,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	4,400,000,000	4,592,192,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	5,000,000,000	5,218,600,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,282,286,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	4,700,000,000	4,877,848,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	2,700,000,000	2,804,328,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,784,027,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	4,900,000,000	5,052,880,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	5,900,000,000	6,087,148,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	6,000,000,000	6,195,960,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	7,200,000,000	7,370,712,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	7,500,000,000	7,541,325,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	6,900,000,000	6,939,054,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,828,072,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第345回	1,500,000,000	1,506,690,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	133,016,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	257,356,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	204,355,200	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,228,536,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	191,164,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	915,474,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	778,836,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	122,579,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	75,613,200	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	278,785,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	193,800,000	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	280,621,000	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	365,510,200	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,062,104,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,211,688,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,234,115,400	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,599,840,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,974,045,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,108,512,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,900,000,000	2,572,771,000	
国庫債券 利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,848,000,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	814,032,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	840,000,000	1,141,207,200	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	952,252,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	662,270,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,143,479,500	
国庫債券 利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,126,243,500	
国庫債券 利付(30年)第28回	700,000,000	964,929,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	800,000,000	1,091,488,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	900,000,000	1,214,316,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,000,000,000	1,334,700,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,587,401,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	2,000,000,000	2,605,940,000	

国庫債券 利付（30年）第34回	2,300,000,000	3,111,233,000	
国庫債券 利付（30年）第35回	2,300,000,000	3,016,105,000	
国庫債券 利付（30年）第36回	1,800,000,000	2,370,276,000	
国庫債券 利付（30年）第37回	2,300,000,000	2,986,366,000	
国庫債券 利付（30年）第38回	1,400,000,000	1,788,780,000	
国庫債券 利付（30年）第39回	1,600,000,000	2,084,736,000	
国庫債券 利付（30年）第40回	1,100,000,000	1,408,924,000	
国庫債券 利付（30年）第41回	1,000,000,000	1,256,870,000	
国庫債券 利付（30年）第42回	1,200,000,000	1,508,904,000	
国庫債券 利付（30年）第43回	1,300,000,000	1,637,298,000	
国庫債券 利付（30年）第44回	1,400,000,000	1,764,014,000	
国庫債券 利付（30年）第45回	1,900,000,000	2,298,639,000	
国庫債券 利付（30年）第46回	1,300,000,000	1,574,794,000	
国庫債券 利付（30年）第47回	1,900,000,000	2,353,511,000	
国庫債券 利付（30年）第48回	1,400,000,000	1,664,250,000	
国庫債券 利付（30年）第49回	1,400,000,000	1,666,196,000	
国庫債券 利付（30年）第50回	1,900,000,000	1,960,363,000	
国庫債券 利付（30年）第51回	2,400,000,000	2,157,504,000	
国庫債券 利付（30年）第52回	2,000,000,000	1,903,900,000	
国庫債券 利付（20年）第38回	170,000,000	176,159,100	
国庫債券 利付（20年）第39回	511,000,000	528,885,000	
国庫債券 利付（20年）第40回	525,000,000	547,622,250	
国庫債券 利付（20年）第41回	255,000,000	264,450,300	
国庫債券 利付（20年）第42回	683,000,000	725,079,630	
国庫債券 利付（20年）第43回	400,000,000	433,368,000	
国庫債券 利付（20年）第44回	150,000,000	162,694,500	
国庫債券 利付（20年）第45回	242,000,000	261,698,800	
国庫債券 利付（20年）第46回	90,000,000	97,283,700	
国庫債券 利付（20年）第47回	1,230,000,000	1,336,198,200	
国庫債券 利付（20年）第48回	200,000,000	220,738,000	
国庫債券 利付（20年）第49回	200,000,000	218,644,000	
国庫債券 利付（20年）第50回	183,000,000	198,505,590	
国庫債券 利付（20年）第51回	310,000,000	339,062,500	
国庫債券 利付（20年）第52回	100,000,000	110,353,000	
国庫債券 利付（20年）第53回	250,000,000	277,237,500	
国庫債券 利付（20年）第54回	250,000,000	278,487,500	

国庫債券 利付(20年)第55回	231,000,000	256,019,610	
国庫債券 利付(20年)第56回	120,000,000	133,656,000	
国庫債券 利付(20年)第57回	210,000,000	232,743,000	
国庫債券 利付(20年)第58回	180,000,000	200,395,800	
国庫債券 利付(20年)第59回	230,000,000	254,285,700	
国庫債券 利付(20年)第60回	780,000,000	848,320,200	
国庫債券 利付(20年)第61回	300,000,000	319,866,000	
国庫債券 利付(20年)第62回	440,000,000	464,147,200	
国庫債券 利付(20年)第63回	300,000,000	335,952,000	
国庫債券 利付(20年)第64回	400,000,000	452,356,000	
国庫債券 利付(20年)第65回	455,000,000	516,402,250	
国庫債券 利付(20年)第66回	300,000,000	338,388,000	
国庫債券 利付(20年)第67回	310,000,000	352,807,900	
国庫債券 利付(20年)第68回	290,000,000	336,336,200	
国庫債券 利付(20年)第69回	560,000,000	645,428,000	
国庫債券 利付(20年)第70回	540,000,000	636,660,000	
国庫債券 利付(20年)第71回	200,000,000	232,810,000	
国庫債券 利付(20年)第72回	670,000,000	778,138,000	
国庫債券 利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,853,072,000	
国庫債券 利付(20年)第74回	1,300,000,000	1,515,982,000	
国庫債券 利付(20年)第75回	600,000,000	702,474,000	
国庫債券 利付(20年)第76回	910,000,000	1,050,467,600	
国庫債券 利付(20年)第77回	700,000,000	813,806,000	
国庫債券 利付(20年)第78回	800,000,000	926,880,000	
国庫債券 利付(20年)第79回	860,000,000	1,003,671,600	
国庫債券 利付(20年)第80回	900,000,000	1,057,959,000	
国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	421,923,600	
国庫債券 利付(20年)第82回	820,000,000	968,190,400	
国庫債券 利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,623,915,800	
国庫債券 利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,411,668,000	
国庫債券 利付(20年)第85回	400,000,000	476,168,000	
国庫債券 利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,692,348,000	
国庫債券 利付(20年)第87回	500,000,000	599,810,000	
国庫債券 利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,335,323,000	
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	566,110,300	
国庫債券 利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,813,110,000	

国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	304,605,000	
国庫債券 利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,865,471,500	
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	359,142,000	
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	241,462,000	
国庫債券 利付(20年)第95回	700,000,000	862,344,000	
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	484,448,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	1,300,000,000	1,594,008,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	364,656,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,560,236,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,875,345,600	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	313,997,500	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	630,125,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	749,346,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	490,492,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,336,449,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	496,516,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	369,921,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,935,152,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,091,034,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,359,941,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	1,001,472,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,231,244,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	1,800,000,000	2,237,004,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	2,500,000,000	3,114,650,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	500,000,000	629,280,000	



国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,387,914,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,900,000,000	2,372,739,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	618,915,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	969,240,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	947,592,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,500,000,000	1,840,725,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,335,169,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	2,000,000,000	2,513,300,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,243,070,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,145,790,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,244,650,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	800,000,000	984,696,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,500,000,000	1,848,360,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	500,000,000	609,125,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,600,000,000	1,950,912,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	964,096,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,567,618,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,708,350,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	900,000,000	1,099,755,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	400,000,000	482,940,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	834,918,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,208,840,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	942,680,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	835,821,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	3,000,000,000	3,628,110,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	2,056,609,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	1,250,000,000	1,531,212,500	
国庫債券 利付(20年)第143回	2,500,000,000	2,986,650,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,767,540,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,600,000,000	3,149,250,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	3,700,000,000	4,478,739,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,700,000,000	3,225,339,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,500,000,000	2,945,500,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,600,000,000	3,064,672,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	2,930,000,000	3,403,781,000	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,041,847,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	3,200,000,000	3,601,184,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	3,450,000,000	3,940,141,500	
国庫債券 利付(20年)第154回	3,500,000,000	3,929,625,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,800,000,000	3,037,384,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,900,000,000	2,824,368,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	3,900,000,000	3,643,809,000	
国庫債券 利付(20年)第158回	3,700,000,000	3,654,046,000	

小計		メキシコ合衆国 第22回円貨社債 (2016)	300,000,000	297,549,000	
		ポーランド共和国 第15回円貨債 券(2013)	100,000,000	100,829,000	
		銘柄数: 265 組入時価比率: 79.9%	491,765,000,000	540,681,239,930	80.4%
	合計			540,681,239,930	
地方債証券	日本円	東京都 公募第655回	100,000,000	101,735,000	
		東京都 公募第659回	300,000,000	307,161,000	
		東京都 公募第660回	100,000,000	102,327,000	
		東京都 公募第664回	100,000,000	102,757,000	
		東京都 公募第668回	200,000,000	206,824,000	
		東京都 公募第671回	100,000,000	103,500,000	
		東京都 公募第685回	100,000,000	103,895,000	
		東京都 公募第690回	200,000,000	210,182,000	
		東京都 公募第703回	100,000,000	104,803,000	
		東京都 公募第707回	100,000,000	104,382,000	
		東京都 公募第708回	100,000,000	104,678,000	
		東京都 公募第710回	100,000,000	104,241,000	
		東京都 公募第712回	100,000,000	104,177,000	
		東京都 公募第715回	100,000,000	104,267,000	
		東京都 公募第716回	200,000,000	208,654,000	
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	134,000,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	262,362,000	
		東京都 公募(7年)第3回	100,000,000	100,988,000	
		東京都 公募第1回	300,000,000	328,758,000	
		東京都 公募(20年)第3回	100,000,000	115,626,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	117,630,000	
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	239,974,000	
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	241,828,000	
		東京都 公募第23回	100,000,000	123,191,000	
		東京都 公募(20年)第26回	300,000,000	355,974,000	
		北海道 公募平成20年度第7回	300,000,000	308,967,000	
		北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	104,247,000	
		北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	104,350,000	
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	104,356,000	
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	104,192,000	

北海道	公募平成25年度第1回	300,000,000	309,441,000	
北海道	公募(5年)平成25年度第8回	100,000,000	100,524,000	
北海道	公募(5年)平成26年度第8回	200,000,000	200,922,000	
北海道	公募(5年)平成26年度第10回	100,000,000	100,400,000	
北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	103,200,000	
宮城県	公募(5年)第9回1号	500,000,000	502,685,000	
神奈川県	公募第155回	100,000,000	102,371,000	
神奈川県	公募第156回	101,000,000	103,889,610	
神奈川県	公募第184回	100,000,000	104,515,000	
神奈川県	公募第188回	200,000,000	210,422,000	
神奈川県	公募第196回	100,000,000	103,771,000	
神奈川県	公募第200回	100,000,000	104,987,000	
神奈川県	公募第205回	100,000,000	103,972,000	
神奈川県	公募第206回	100,000,000	103,960,000	
神奈川県	公募第210回	200,000,000	205,072,000	
神奈川県	公募(30年)第3回	100,000,000	134,394,000	
神奈川県	公募第7回	300,000,000	359,631,000	
神奈川県	公募(5年)第56回	100,000,000	100,345,000	
大阪府	公募第320回	400,000,000	414,056,000	
大阪府	公募第337回	200,000,000	209,540,000	
大阪府	公募第346回	100,000,000	105,070,000	
大阪府	公募第356回	100,000,000	105,250,000	
大阪府	公募第378回	104,000,000	108,290,000	
大阪府	公募第384回	100,000,000	103,970,000	
大阪府	公募第387回	300,000,000	308,793,000	
大阪府	公募第5回	100,000,000	122,723,000	
大阪府	公募第8回	100,000,000	119,123,000	
大阪府	公募第98回	200,000,000	200,998,000	
大阪府	公募(5年)第99回	240,000,000	241,017,600	
大阪府	公募(5年)第101回	148,000,000	148,649,720	
大阪府	公募第102回	100,000,000	100,446,000	
大阪府	公募(5年)第130回	600,000,000	599,736,000	
京都府	公募平成20年度第3回	140,000,000	144,326,000	
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	104,673,000	

京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	104,291,000
京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	113,981,000
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	206,724,000
兵庫県	公募平成20年度第3回	100,000,000	102,455,000
兵庫県	公募平成20年度第12回	100,000,000	103,475,000
兵庫県	公募平成20年度第16回	100,000,000	103,302,000
兵庫県	公募平成21年度第13回	100,000,000	103,757,000
兵庫県	公募平成21年度第25回	100,000,000	104,438,000
兵庫県	公募平成22年度第1回	100,000,000	104,790,000
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	132,230,000
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	342,345,000
兵庫県	公募(15年)第3回	100,000,000	111,021,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	310,215,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	121,889,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	123,364,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,700,000
静岡県	公募平成21年度第2回	100,000,000	104,092,000
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	104,459,000
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	103,775,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	106,620,650
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	171,779,850
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	103,369,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	206,650,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	114,873,776
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	297,816,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	119,176,000
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	118,429,000
愛知県	公募平成20年度第7回	210,000,000	216,073,200
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	120,195,000
愛知県	公募平成20年度第10回	100,000,000	103,306,000
愛知県	公募平成21年度第3回	114,000,000	118,700,220
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	104,437,000
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	104,628,000
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	104,298,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	104,935,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	104,958,000

愛知県 公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	117,700,000	
愛知県 公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	446,376,000	
愛知県 公募平成24年度第17回	100,000,000	119,892,000	
愛知県 公募平成26年度第8回	100,000,000	123,657,000	
愛知県 公募平成26年度第13回	100,000,000	112,306,000	
愛知県 公募平成27年度第15回	100,000,000	102,825,000	
広島県 公募平成20年度第3回	300,000,000	308,340,000	
広島県 公募平成22年度第6回	200,000,000	210,202,000	
広島県 公募平成24年度第4回	100,000,000	104,396,000	
広島県 公募平成25年度第3回	200,000,000	209,658,000	
広島県 公募(5年)平成25年度第6回	300,000,000	301,299,000	
広島県 公募平成26年度第5回	109,650,000	111,360,540	
埼玉県 公募平成19年度第7回	200,000,000	203,848,000	
埼玉県 公募平成20年度第1回	100,000,000	102,042,000	
埼玉県 公募平成21年度第5回	100,000,000	103,847,000	
埼玉県 公募平成22年度第2回	200,000,000	209,280,000	
埼玉県 公募平成24年度第4回	100,000,000	104,365,000	
埼玉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	105,530,000	
埼玉県 公募平成25年度第6回	148,000,000	155,213,520	
埼玉県 公募(5年)平成25年度第7回	100,000,000	100,459,000	
埼玉県 公募平成25年度第10回	100,000,000	104,021,000	
埼玉県 公募平成25年度第11回	100,000,000	103,918,000	
埼玉県 公募平成26年度第3回	100,000,000	104,071,000	
埼玉県 公募平成26年度第6回	200,000,000	206,586,000	
埼玉県 公募平成26年度第7回	400,000,000	410,952,000	
埼玉県 公募平成26年度第9回	100,000,000	102,375,000	
福岡県 公募平成20年度第3回	100,000,000	102,342,000	
福岡県 公募平成22年度第5回	100,000,000	103,569,000	
福岡県 公募平成23年度第5回	100,000,000	104,876,000	
福岡県 公募平成24年度第10回	100,000,000	100,186,000	
福岡県 公募平成26年度第4回	100,000,000	100,343,000	
福岡県 公募平成23年度第1回	100,000,000	112,506,000	
福岡県 公募(30年)平成19年	100,000,000	134,873,000	

度第1回			
福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	123,952,000	
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	120,311,000	
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,885,000	
千葉県 公募平成20年度第1回	100,000,000	102,047,000	
千葉県 公募平成20年度第6回	200,000,000	205,964,000	
千葉県 公募平成21年度第1回	100,000,000	103,539,000	
千葉県 公募平成21年度第11回	180,000,000	187,813,800	
千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	105,315,000	
千葉県 公募平成24年度第2回	100,000,000	104,613,000	
千葉県 公募平成24年度第8回	100,000,000	104,695,000	
千葉県 公募平成25年度第2回	900,000,000	903,168,000	
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	105,258,000	
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	105,526,000	
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	123,353,000	
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	113,077,000	
新潟県 公募平成20年度第2回	200,000,000	206,562,000	
新潟県 公募平成21年度第2回	150,000,000	156,744,000	
長野県 公募平成25年度第1回	1,100,000,000	1,105,049,000	
群馬県 公募第8回	100,000,000	105,011,000	
群馬県 公募第12回	100,000,000	103,190,000	
群馬県 公募(5年)第4回	600,000,000	602,574,000	
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	117,741,000	
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	192,826,376	
共同発行市場地方債 公募第58回	270,500,000	275,125,550	
共同発行市場地方債 公募第62回	100,000,000	102,441,000	
共同発行市場地方債 公募第63回	200,000,000	205,594,000	
共同発行市場地方債 公募第64回	262,000,000	269,320,280	
共同発行市場地方債 公募第65回	700,000,000	718,704,000	
共同発行市場地方債 公募第66回	181,000,000	185,872,520	
共同発行市場地方債 公募第68回	900,000,000	928,827,000	
共同発行市場地方債 公募第70回	110,000,000	113,229,600	
共同発行市場地方債 公募第74回	500,000,000	518,780,000	
共同発行市場地方債 公募第75回	310,000,000	322,607,700	

共同発行市場地方債 公募第 8 2 回	300,000,000	313,023,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 4 回	500,000,000	522,215,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 5 回	100,000,000	104,754,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 8 回	100,000,000	104,145,000	
共同発行市場地方債 公募第 8 9 回	100,000,000	103,771,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 2 回	110,000,000	114,392,300	
共同発行市場地方債 公募第 9 3 回	300,000,000	314,868,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 4 回	300,000,000	315,054,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 6 回	100,000,000	105,429,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 1 回	300,000,000	314,538,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 2 回	150,000,000	157,257,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 3 回	100,000,000	104,780,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 8 回	200,000,000	210,042,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 0 回	200,000,000	209,010,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 1 回	200,000,000	209,146,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 3 回	200,000,000	208,014,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 5 回	100,000,000	104,299,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 6 回	200,000,000	208,662,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 8 回	100,000,000	104,664,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 1 9 回	200,000,000	208,962,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 0 回	300,000,000	311,370,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 1 回	100,000,000	103,148,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 2 回	400,000,000	413,888,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 4 回	100,000,000	105,461,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 6 回	100,000,000	104,896,000	



共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	311,745,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	104,641,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	103,953,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	207,374,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	206,690,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	159,973,950	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	553,651,200	
共同発行市場地方債 公募第145回	500,000,000	510,950,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	100,000,000	99,452,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	100,000,000	99,264,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	120,995,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	119,610,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	104,191,000	
島根県 公募平成25年度第3回	700,000,000	703,122,000	
福島県 公募平成24年度第2回	100,000,000	100,187,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	205,724,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,854,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	146,064,040	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,854,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	243,334,872	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,598,000	
大阪市 公募平成20年度第3回	110,000,000	113,130,600	
大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	104,547,000	
大阪市 公募平成25年度第1回	800,000,000	804,392,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	104,145,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,594,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	115,050,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	124,885,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	122,234,000	

大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	118,244,000	
名古屋市 公募第464回	300,000,000	308,325,000	
名古屋市 公募第469回	100,000,000	103,967,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	105,279,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	310,869,000	
名古屋市 公募(6年)第1回	200,000,000	200,808,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	214,972,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	106,833,000	
京都市 公募平成19年度第4回	190,000,000	193,579,600	
京都市 公募平成20年度第4回	200,000,000	206,638,000	
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	105,271,000	
京都市 公募平成25年度第3回	100,000,000	100,529,000	
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	117,082,000	
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	112,258,000	
神戸市 公募平成21年度第7回	100,000,000	104,170,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	303,480,000	
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	198,530,000	
横浜市 公募平成20年度第3回	100,000,000	102,632,000	
横浜市 公募公債平成20年度5回	200,000,000	206,228,000	
横浜市 公募平成21年度第4回	200,000,000	207,326,000	
横浜市 公募平成22年度第5回	100,000,000	104,967,000	
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	208,740,000	
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	207,488,000	
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	207,738,000	
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	205,376,000	
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	119,072,000	
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	112,564,000	
札幌市 公募平成22年度第4回	100,000,000	103,616,000	
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	119,333,000	
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	103,114,000	
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	204,740,000	
川崎市 公募第81回	100,000,000	103,478,000	
川崎市 公募第82回	100,000,000	104,129,000	
川崎市 公募第85回	100,000,000	103,904,000	
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	115,172,000	

		北九州市 公募(5年)平成25年度第2回	100,000,000	100,529,000	
		北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	118,384,000	
		福岡市 公募平成20年度第3回	100,000,000	102,238,000	
		福岡市 公募(5年)平成25年度第2回	300,000,000	301,608,000	
		福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	114,628,000	
		福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,173,000	
		福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	164,304,000	
		広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	103,986,000	
		広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	102,580,000	
		仙台市 公募平成25年度第1回	600,000,000	602,886,000	
		千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	105,315,000	
		鹿児島県 公募(5年)平成25年度第1回	100,000,000	100,424,000	
		福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	102,423,000	
		福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	198,618,000	
		徳島県 公募平成22年度第1回	400,000,000	416,340,000	
		山梨県 公募平成21年度第1回	100,000,000	103,867,000	
		岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	104,497,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	121,904,000	
		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	367,755,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	120,509,000	
	小計	銘柄数:275 組入時価比率:7.4%	47,636,420,000	50,133,080,074 7.5%	
	合計			50,133,080,074	
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	102,135,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	157,785,940	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	201,745,660	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,596,000	
		原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第3回	2,100,000,000	2,103,444,000	

韓国産業銀行 第45回円貨社債 (2014)	100,000,000	100,595,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第 22回	100,000,000	114,139,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第26回	100,000,000	101,397,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第31回	300,000,000	312,630,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債 第47回	100,000,000	108,109,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 5回	100,000,000	103,221,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 9回	141,000,000	146,240,970	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 16回	102,000,000	106,789,920	
日本政策投資銀行社債 政府保証第 19回	140,000,000	145,723,200	
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	211,438,000	
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	133,477,000	
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	241,764,000	
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	120,925,000	
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	243,924,000	
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	299,610,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第38回	100,000,000	102,758,000	
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	123,462,000	
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	124,761,000	
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	105,147,000	
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	420,120,000	
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	209,268,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	117,727,000	

券 財投機関債第 8 9 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 2 回	100,000,000	103,729,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 3 回	350,000,000	410,826,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 0 5 回	100,000,000	119,907,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 2 7 回	300,000,000	301,293,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 3 0 回	200,000,000	206,678,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 3 4 回	200,000,000	206,218,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 3 6 回	200,000,000	207,176,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 4 5 回	300,000,000	342,507,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 4 9 回	100,000,000	116,200,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 財投機関債第 1 7 3 回	100,000,000	86,477,000	
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	108,009,000	
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	108,076,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 5 6 回	205,000,000	208,683,850	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 5 8 回	136,000,000	139,292,560	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 0 回	283,000,000	290,674,960	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 2 回	100,000,000	102,710,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 7 回	341,000,000	351,073,140	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 6 9 回	100,000,000	103,077,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 7 1 回	100,000,000	102,796,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 2 回	200,000,000	245,120,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 7 回	200,000,000	245,352,000	

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	312,084,000	
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	247,570,000	
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	417,780,000	
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	245,548,000	
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	240,540,000	
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	129,079,000	
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	463,839,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	146,872,600	
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	104,588,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	146,519,800	
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	124,102,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	104,689,000	
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	117,419,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	227,916,820	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	116,258,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	379,122,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	209,436,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	209,248,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	208,690,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	400,000,000	420,092,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	118,866,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	196,000,000	202,522,880	

券 政府保証債第189回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第190回	400,000,000	415,132,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第193回	200,000,000	211,264,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第197回	272,000,000	286,777,760	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第207回	300,000,000	313,686,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第211回	137,000,000	142,977,310	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第213回	145,000,000	151,236,450	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第216回	100,000,000	114,809,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第217回	100,000,000	122,746,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第219回	100,000,000	114,740,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第220回	100,000,000	104,363,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第224回	100,000,000	122,827,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第225回	190,000,000	197,126,900	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第234回	100,000,000	103,151,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第239回	300,000,000	328,326,000	
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	149,890,150	
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	137,869,000	
公営企業債券 政府保証第881回	200,000,000	203,230,000	
公営企業債券 政府保証第886回	203,000,000	208,405,890	
公営企業債券 30年第4回財投機 関債	100,000,000	138,256,000	
公営企業債券 政府保証15年第1 回	300,000,000	316,746,000	
政保 地方公営企業等金融機構債 券 第2回	400,000,000	412,096,000	
地方公営企業等金融機構債券 第1	200,000,000	206,152,000	

回			
地方公営企業等金融機構債券(20年)第1回	100,000,000	120,333,000	
地方公共団体金融機構債券第1回	100,000,000	104,101,000	
地方公共団体金融機構債券第2回	100,000,000	103,602,000	
地方公共団体金融機構債券政府保証第5回	200,000,000	206,746,000	
地方公共団体金融機構債券20年第4回	100,000,000	121,933,000	
地方公共団体金融機構債券20年第6回	300,000,000	371,409,000	
地方公共団体金融機構債券F24回	100,000,000	110,015,000	
地方公共団体金融機構債券第13回	200,000,000	208,830,000	
地方公共団体金融機構債券政府保証第16回	100,000,000	103,717,000	
地方公共団体金融機構債券第16回	100,000,000	104,313,000	
地方公共団体金融機構債券第27回	300,000,000	314,112,000	
地方公共団体金融機構債券第28回	100,000,000	104,860,000	
地方公共団体金融機構債券F104回	100,000,000	109,512,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(6年)第4回	500,000,000	502,470,000	
地方公共団体金融機構債券F106回	100,000,000	108,317,000	
地方公共団体金融機構債券第37回	400,000,000	417,724,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第38回	194,000,000	203,034,580	
政保 地方公共団体金融機構債券第39回	100,000,000	104,514,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第40回	101,000,000	105,726,800	
政保 地方公共団体金融機構債券第41回	102,000,000	106,634,880	
地方公共団体金融機構債券第41回	600,000,000	626,412,000	
地方公共団体金融機構債券F14	100,000,000	107,033,000	



2回			
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 4回	200,000,000	204,196,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5回	200,000,000	214,952,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 2回	108,000,000	113,115,960	
地方公共団体金融機構債券 第4 2 回	100,000,000	104,466,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 3回	202,000,000	210,730,440	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 4回	102,000,000	107,097,960	
地方公共団体金融機構債券 第4 4 回	100,000,000	104,402,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 5回	223,000,000	234,025,120	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0回	100,000,000	108,230,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第5 0回	100,000,000	105,821,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第1 0回	300,000,000	302,973,000	
地方公共団体金融機構債券 第5 1 回	300,000,000	315,453,000	
地方公共団体金融機構債券 第5 2 回	300,000,000	315,717,000	
地方公共団体金融機構債券(1 5 年) 第2回	200,000,000	219,310,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第5 9回	116,000,000	121,173,600	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第1 4回	300,000,000	302,079,000	
地方公共団体金融機構債券(2 0 年) 第3 8回	100,000,000	114,286,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第6 4回	100,000,000	103,677,000	
地方公共団体金融機構債券 第6 4 回	100,000,000	103,527,000	
地方公共団体金融機構債券(2 0 年) 第3 9回	100,000,000	113,221,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第6 5回	400,000,000	414,564,000	

政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	300,000,000	308,232,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	195,769,980	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	522,071,120	
地方公共団体金融機構債券 第79 回	100,000,000	102,874,000	
公営企業債券(20年) 第2回財 投機関債	100,000,000	108,256,000	
公営企業債券(20年) 第5回財 投機関債	200,000,000	227,420,000	
公営企業債券(20年) 第25回 財投機関債	100,000,000	124,550,000	
首都高速道路社債 第12回	100,000,000	100,561,000	
首都高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	103,989,000	
阪神高速道路 第13回	100,000,000	100,464,000	
阪神高速道路債券 政府保証第5回	100,000,000	104,192,000	
日本政策金融公庫債券 政府保証第 22回	2,000,000,000	2,008,900,000	
中小企業債券 第6回財投機関債	100,000,000	100,960,000	
都市再生債券 財投機関債第21回	300,000,000	308,895,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	104,952,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,987,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7回	100,000,000	117,774,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 16回	120,000,000	125,415,600	
東京交通債券 第342回	200,000,000	223,934,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	176,920,160	
関西国際空港社債 財投機関債第2 6回	300,000,000	312,756,000	
関西国際空港社債 財投機関債第3 2回	100,000,000	105,377,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機 関債	100,000,000	104,840,000	
中部国際空港債券 政府保証第18 回	368,000,000	383,091,680	
預金保険機構債券 政府保証第20 9回	2,000,000,000	2,007,900,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債	200,000,000	241,036,000	

第3回			
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第14回	200,000,000	204,554,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	113,978,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第25回	300,000,000	309,879,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第41回	100,000,000	104,428,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	114,643,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	120,385,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第73回	100,000,000	105,500,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	122,363,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	344,577,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	122,254,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	104,928,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	209,638,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	227,856,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	130,858,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	208,350,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,718,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	105,286,000	
商工債券 利付第753回い号	100,000,000	100,275,000	
農林債券 利付第752回い号	100,000,000	100,309,000	
農林債券 利付第756回い号	100,000,000	100,402,000	
農林債券 利付第759回い号	100,000,000	100,625,000	
農林債券 利付第760回い号	100,000,000	100,657,000	
農林債券 利付第761回い号	100,000,000	100,503,000	
農林債券 利付第764回い号	100,000,000	100,676,000	
農林債券 利付第765回い号	300,000,000	301,791,000	

農林債券 利付第767回い号	300,000,000	301,920,000	
農林債券 利付第773回い号	300,000,000	301,779,000	
農林債券 利付第777回い号	300,000,000	302,043,000	
農林債券 利付第781回い号	100,000,000	100,801,000	
しんきん中金債券 利付第284回	100,000,000	100,601,000	
しんきん中金債券 利付第286回	100,000,000	100,578,000	
しんきん中金債券 利付第287回	100,000,000	100,513,000	
しんきん中金債券 利付第290回	100,000,000	100,582,000	
しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	100,524,000	
しんきん中金債券 利付第308回	100,000,000	100,714,000	
商工債券 利付(3年)第181回	500,000,000	500,790,000	
商工債券 利付(3年)第182回	100,000,000	100,156,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	100,000,000	122,462,000	
東日本高速道路 第21回	100,000,000	100,844,000	
東日本高速道路 第26回	100,000,000	100,732,000	
東日本高速道路 第27回	100,000,000	100,590,000	
中日本高速道路社債 第32回	200,000,000	202,184,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	101,438,000	
中日本高速道路社債 第47回	100,000,000	100,328,000	
中日本高速道路 第62回	100,000,000	100,782,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	103,191,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	208,600,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	103,268,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	298,614,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回	200,000,000	208,572,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回	200,000,000	207,104,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	100,000,000	113,565,000	
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	13,872,000	14,342,122	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	47,511,000	49,099,767	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	85,090,000	88,474,880	
貸付債権担保第10回住宅金融公庫	86,502,000	88,633,409	

債券			
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	53,982,000	56,527,251	
貸付債権担保第4回2回住宅金融公庫債券	64,995,000	69,482,904	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	18,931,000	20,176,281	
貸付債権担保第3回9回住宅金融公庫債券	43,822,000	46,001,706	
貸付債権担保第4回0回住宅金融公庫債券	48,480,000	51,385,891	
貸付債権担保第1回5回住宅金融公庫債券	52,692,000	54,779,657	
貸付債権担保第3回2回住宅金融公庫債券	96,004,000	100,321,299	
貸付債権担保第2回0回住宅金融公庫債券	90,790,000	95,607,317	
貸付債権担保第4回4回住宅金融公庫債券	84,124,000	90,063,995	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	48,636,000	51,563,400	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	24,023,000	25,528,521	
貸付債権担保第2回5回住宅金融支援機構債券	34,629,000	37,602,245	
貸付債権担保第2回8回住宅金融支援機構債券	117,795,000	126,480,025	
貸付債権担保S種第1回6回住宅金融支援機構債券	29,899,000	31,071,937	
貸付債権担保第4回2回住宅金融支援機構債券	124,686,000	131,134,759	
貸付債権担保S種第1回7回住宅金融支援機構債券	61,180,000	63,739,159	
貸付債権担保第4回5回住宅金融支援機構債券	163,125,000	173,961,393	
貸付債権担保第5回2回住宅金融支援機構債券	117,438,000	123,991,040	
貸付債権担保第2回4回住宅金融支援機構債券	65,116,000	70,722,487	
貸付債権担保第4回8回住宅金融支援機構債券	156,132,000	167,293,876	
貸付債権担保第4回0回住宅金融支援機構債券	164,604,000	172,068,791	

貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	207,588,000	216,703,189	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	204,672,000	214,766,423	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	134,308,000	140,526,460	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	55,820,000	59,251,255	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	123,594,000	130,992,336	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	70,250,000	72,947,600	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	147,376,000	153,138,401	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	70,199,000	72,919,211	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	36,830,000	38,505,028	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	206,712,000	216,572,162	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	43,342,000	46,324,363	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	44,948,000	48,029,185	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	46,667,000	49,756,822	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	54,957,000	58,755,627	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	134,710,000	141,861,753	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	196,137,000	206,595,024	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	65,954,000	69,514,196	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	132,340,000	138,378,674	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	17,776,000	18,634,936	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	137,045,000	142,156,778	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	55,540,000	57,541,106	
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債	23,472,000	23,917,968	

券			
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	49,984,000	51,136,631	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	259,235,000	272,767,067	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	135,588,000	142,692,811	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	216,627,000	225,614,854	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	203,685,000	211,404,661	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	148,746,000	156,550,702	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	132,426,000	138,869,849	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	306,692,000	318,177,615	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	536,368,000	555,623,611	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	79,347,000	81,805,170	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	81,118,000	83,747,845	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	81,684,000	83,936,027	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	168,228,000	171,824,714	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	172,144,000	174,166,692	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	88,048,000	90,300,267	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	90,373,000	92,342,227	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	268,845,000	276,364,594	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	273,366,000	282,285,932	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	182,704,000	188,382,440	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	91,568,000	94,140,145	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	92,423,000	95,345,415	

		貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,271,000	
		貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,740,000	
	小計	銘柄数：283 組入時価比率：7.9%	50,526,494,000	53,442,923,218	7.9%
	合計			53,442,923,218	
社債券	日本円	クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	101,251,000	
		ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング 第2回円貨社債	200,000,000	199,780,000	
		マラヤン・バンキング・ベルハッド 第2回円貨社債(2015)	200,000,000	193,800,000	
		スタンダード・チャータード 第2回円貨社債(2015)	100,000,000	99,366,000	
		スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015)	100,000,000	96,819,000	
		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	99,786,000	
		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	101,150,000	
		エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第12回	100,000,000	107,631,000	
		パークレイズ・バンク・ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	99,541,000	
		ナショナル・オーストラリア銀行 第11回円貨社債(2015)	200,000,000	199,992,000	
		ラボバンク・ネダーランド 第23回円貨社債(2013)	100,000,000	100,426,000	
		ラボバンク・ネダーランド 第25回円貨社債(2014)	100,000,000	100,186,000	
		ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債(2014)	200,000,000	200,808,000	
		清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,775,000	
		大和ハウス工業 第5回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,701,000	
		森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,299,000	
		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	100,248,000	



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	100,496,000	
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	203,732,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,655,000	
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	102,040,000	
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	197,328,000	
森ビル 第13回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,646,000	
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	102,435,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,779,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,004,000	
住友化学 第43回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	104,577,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,231,000	
エア・ウォーター 第2回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,044,000	
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	202,372,000	
宇部興産 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,363,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,399,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,819,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	103,895,000	
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	103,204,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,648,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	200,518,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,492,000	
住友大阪セメント 第14回社債間	100,000,000	100,294,000	

限定同順位特約付			
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,455,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,932,000	
神戸製鋼所 第63回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,616,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFE)保証	100,000,000	101,454,000	
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,296,000	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,358,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	217,810,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,851,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,783,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,715,000	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,259,000	
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,302,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,924,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,003,000	
ソニー 第26回	100,000,000	104,652,000	
ソニー 第32回	200,000,000	199,070,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,814,000	
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	301,248,000	
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,904,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	104,760,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,944,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同	100,000,000	101,807,000	

順位特約付			
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,390,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,130,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,805,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,189,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,960,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,278,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,274,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,211,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,888,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,328,000	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,217,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,358,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,832,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,688,000	
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,412,000	
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	102,681,000	
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	204,432,000	
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	123,426,000	
みずほコーポレート銀行 第32回特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,837,000	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	105,512,000	
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	108,432,000	

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	112,138,000	
三菱東京UFJ銀行 第119回特 定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,758,000	
三菱東京UFJ銀行 第140回特 定社債間限定同順位特約付	500,000,000	501,210,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	305,676,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	102,209,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	106,211,000	
りそな銀行 第4回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	106,221,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	317,052,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特 約付	100,000,000	106,003,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約 付	300,000,000	316,623,000	
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	100,581,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	103,896,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	102,377,000	
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	204,802,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	105,803,000	
みずほ銀行 第35回特定社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,552,000	
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	1,006,130,000	
興銀リース 第4回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,396,000	
NTTファイナンス 第46回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,298,000	
ホンダファイナンス 第26回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,382,000	
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	100,273,000	
ジャックス 第12回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,001,000	

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	200,218,000	
日立キャピタル 第52回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,810,000	
日立キャピタル 第56回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,964,000	
日立キャピタル 第57回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	101,336,000	
オリックス 第164回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,328,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,552,000	
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	100,146,000	
三菱UFJリース 第30回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,559,000	
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	100,514,000	
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	100,496,000	
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	102,338,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	105,419,000	
野村ホールディングス 第41回	200,000,000	201,982,000	
第1回財政融資マスタートラスト特 定目的会社 第1回特定社債	100,000,000	101,888,000	
三井不動産 第34回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	104,232,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等 財務上特約無	100,000,000	111,254,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等 財務上特約無	100,000,000	103,178,000	
三菱地所 第110回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	100,963,000	
三菱地所 第111回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	103,272,000	
東京建物 第17回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,967,000	
住友不動産 第95回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	103,143,000	
住友不動産 第97回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	205,104,000	

住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,895,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,810,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	104,098,000	
オリックス不動産投資法人 第5回特定投資法人債間限定同順位特	100,000,000	100,675,000	
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	101,523,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,844,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,044,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,466,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	213,750,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	109,286,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	222,722,000	
東日本旅客鉄道 第58回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,794,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,015,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,022,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	121,491,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,342,000	
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,911,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	247,558,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,984,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,691,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,662,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,346,000	

日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,822,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,573,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	100,908,000	
住友倉庫 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,592,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	104,484,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,865,000	
N T Tドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,824,000	
東京電力 第455回	200,000,000	206,480,000	
東京電力 第459回	100,000,000	104,981,000	
東京電力 第542回	100,000,000	101,811,000	
東京電力 第544回	100,000,000	102,564,000	
東京電力 第547回	100,000,000	105,492,000	
東京電力 第548回	100,000,000	113,927,000	
東京電力 第559回	100,000,000	102,903,000	
東京電力 第560回	100,000,000	111,802,000	
東京電力 第565回	300,000,000	309,483,000	
中部電力 第482回	200,000,000	210,098,000	
中部電力 第500回	200,000,000	207,956,000	
関西電力 第448回	200,000,000	206,020,000	
関西電力 第469回	100,000,000	102,810,000	
関西電力 第482回	100,000,000	103,381,000	
関西電力 第484回	100,000,000	102,789,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,771,000	
関西電力 第497回	200,000,000	209,276,000	
関西電力 第498回	200,000,000	201,300,000	
中国電力 第314回	100,000,000	103,731,000	
中国電力 第330回	100,000,000	107,902,000	
中国電力 第377回	200,000,000	210,924,000	
中国電力 第378回	100,000,000	104,780,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	105,482,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	104,679,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	106,284,000	

	北陸電力 第308回	100,000,000	103,277,000	
	東北電力 第431回	400,000,000	409,776,000	
	東北電力 第473回	100,000,000	101,459,000	
	東北電力 第475回	100,000,000	103,306,000	
	東北電力 第481回	200,000,000	206,856,000	
	四国電力 第281回	200,000,000	211,210,000	
	九州電力 第400回	100,000,000	105,123,000	
	九州電力 第409回	100,000,000	103,419,000	
	九州電力 第420回	300,000,000	302,847,000	
	九州電力 第424回	200,000,000	211,702,000	
	北海道電力 第296回	100,000,000	102,870,000	
	北海道電力 第316回	207,000,000	213,737,850	
	北海道電力 第323回	100,000,000	109,438,000	
	北海道電力 第338回	100,000,000	98,065,000	
	電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,539,000	
	電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,639,000	
	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,246,000	
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,027,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,277,000	
	東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,781,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	124,314,000	
	大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,139,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,505,000	
	東京都競馬 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,332,000	
	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	100,850,000	
小計	銘柄数：205	27,407,000,000	28,282,379,850	
	組入時価比率：4.2%		4.2%	
合計			28,282,379,850	



合計		672,539,623,072
----	--	-----------------

(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28年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	16,743,007
コール・ローン	33,114,785
国債証券	13,474,334,616
派生商品評価勘定	1,789,805
未収利息	59,313,524
前払費用	40,642,811
差入委託証拠金	119,022,096
流動資産合計	13,744,960,644
資産合計	13,744,960,644
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	225,067,920
未払金	238,770
未払解約金	8,133,106
未払利息	37
その他未払費用	908,700
流動負債合計	234,348,533
負債合計	234,348,533
純資産の部	
元本等	
元本	12,046,706,370
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,463,905,741
元本等合計	13,510,612,111
純資産合計	13,510,612,111
負債純資産合計	13,744,960,644

#### 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	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。 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28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	1,1215円
(10,000口当たり純資産額)	(11,215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 4月 1日 至 平成28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、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。
3.金融商品に係るリスク管理体制
委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。
市場リスクの管理
市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。
信用リスクの管理
信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。
流動性リスクの管理
流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年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28年12月26日現在	
期首	平成28年 4月 1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	2,320,844,382円
同期中における追加設定元本額	10,699,377,453円
同期中における一部解約元本額	973,515,465円
期末元本額	12,046,706,370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	309,508,302円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	726,724,009円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	8,444,169円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,530,394円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,007,855円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	928,078円
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	167,847,381円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	49,161,479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)	10,781,554,703円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式(平成28年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28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	87,084.37	
		US TREASURY BOND	240,000.00	239,231.23	
		US TREASURY BOND	210,000.00	269,677.71	
		US TREASURY BOND	80,000.00	107,643.74	
		US TREASURY BOND	80,000.00	102,681.24	
		US TREASURY BOND	20,000.00	25,235.93	
		US TREASURY BOND	340,000.00	430,578.10	
		US TREASURY BOND	160,000.00	152,737.48	
		US TREASURY BOND	100,000.00	112,085.93	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,816.40	
		US TREASURY N/B	300,000.00	305,320.29	
		US TREASURY N/B	40,000.00	39,892.18	
		US TREASURY N/B	720,000.00	717,553.08	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,097,980.40	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,295,175.70	
		US TREASURY N/B	200,000.00	199,796.86	
		US TREASURY N/B	360,000.00	358,495.30	
		US TREASURY N/B	320,000.00	335,037.46	
		US TREASURY N/B	800,000.00	797,406.24	
		US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,354,113.18	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	994,335.90	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,090,933.58	
		US TREASURY N/B	100,000.00	100,027.34	
		US TREASURY N/B	400,000.00	399,921.84	
		US TREASURY N/B	200,000.00	200,460.92	
		US TREASURY N/B	250,000.00	249,169.90	
		US TREASURY N/B	390,000.00	389,710.54	
		US TREASURY N/B	250,000.00	250,419.90	
		US TREASURY N/B	300,000.00	296,941.38	
		US TREASURY N/B	230,000.00	230,691.79	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,086,464.83			
US TREASURY N/B	460,000.00	462,515.60			

US TREASURY N/B	200,000.00	197,257.80	
US TREASURY N/B	70,000.00	73,994.92	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,004,804.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	985,039.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	987,304.60	
US TREASURY N/B	800,000.00	805,874.96	
US TREASURY N/B	150,000.00	149,027.34	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,968.75	
US TREASURY N/B	330,000.00	347,647.24	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,005,297.61	
US TREASURY N/B	140,000.00	148,750.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,234.37	
US TREASURY N/B	130,000.00	127,785.93	
US TREASURY N/B	400,000.00	396,312.48	
US TREASURY N/B	80,000.00	84,793.74	
US TREASURY N/B	150,000.00	149,050.77	
US TREASURY N/B	150,000.00	149,507.80	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,250.00	
US TREASURY N/B	140,000.00	144,265.61	
US TREASURY N/B	300,000.00	303,914.04	
US TREASURY N/B	900,000.00	887,273.37	
US TREASURY N/B	40,000.00	41,206.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,023.43	
US TREASURY N/B	400,000.00	398,375.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	302,765.61	
US TREASURY N/B	200,000.00	213,921.86	
US TREASURY N/B	580,000.00	582,039.04	
US TREASURY N/B	350,000.00	354,921.87	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,012,890.60	
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,417,078.12	
US TREASURY N/B	130,000.00	130,192.95	
US TREASURY N/B	350,000.00	352,105.46	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,313,609.31	
US TREASURY N/B	350,000.00	351,531.25	
US TREASURY N/B	600,000.00	599,296.86	

US TREASURY N/B	1,000,000.00	960,859.30	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,003,984.30	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	997,734.30	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,734.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,234.37	
US TREASURY N/B	120,000.00	117,600.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	294,843.75	
US TREASURY N/B	350,000.00	338,542.96	
US TREASURY N/B	260,000.00	258,192.16	
US TREASURY N/B	250,000.00	242,695.30	
US TREASURY N/B	210,000.00	206,915.62	
US TREASURY N/B	350,000.00	334,386.71	
US TREASURY N/B	820,000.00	782,395.29	
US TREASURY N/B	230,000.00	222,507.01	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,882.81	
US TREASURY N/B	200,000.00	202,234.36	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	940,156.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	470,000.00	
US TREASURY N/B	600,000.00	615,656.22	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,593.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	705,195.26	
US TREASURY N/B	1,350,000.00	1,330,699.18	
US TREASURY N/B	500,000.00	482,812.50	
US TREASURY N/B	330,000.00	320,873.42	
US TREASURY N/B	280,000.00	268,953.10	
US TREASURY N/B	740,000.00	724,217.13	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,129,739.03	
US TREASURY N/B	20,000.00	26,382.81	
US TREASURY N/B	300,000.00	376,171.86	
US TREASURY N/B	200,000.00	265,828.12	
US TREASURY N/B	60,000.00	75,023.43	
US TREASURY N/B	400,000.00	480,718.72	
US TREASURY N/B	100,000.00	126,546.87	
US TREASURY N/B	200,000.00	244,562.50	
US TREASURY N/B	90,000.00	102,283.57	

	US TREASURY N/B	550,000.00	552,363.24	
	US TREASURY N/B	60,000.00	56,076.55	
	US TREASURY N/B	490,000.00	457,499.18	
	US TREASURY N/B	870,000.00	871,427.32	
	US TREASURY N/B	90,000.00	98,690.62	
	US TREASURY N/B	180,000.00	197,325.00	
	US TREASURY N/B	30,000.00	31,434.37	
	US TREASURY N/B	60,000.00	60,056.25	
	US TREASURY N/B	380,000.00	370,975.00	
	US TREASURY N/B	490,000.00	431,582.78	
	US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,112,568.75	
	US TREASURY N/B	410,000.00	390,076.54	
	US TREASURY N/B	170,000.00	165,763.27	
	US TREASURY N/B	380,000.00	333,746.85	
	US TREASURY N/B	350,000.00	307,480.46	
	US TREASURY NOTE	250,000.00	255,742.17	
小計	銘柄数：118	50,860,000.00	50,934,413.50 (5,960,345,067)	
	組入時価比率：44.1%		44.3%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	596,208.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	161,243.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	198,940.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	152,994.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	416,605.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	118,016.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	391,800.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	100,127.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	106,293.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	177,202.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	116,946.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	40,000.00	63,003.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	154,114.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	70,000.00	103,236.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	20,000.00	28,450.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	296,718.40	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	257,271.00
	銘柄数：17	3,210,000.00	3,439,169.70 (297,969,662)
	組入時価比率：2.2%		2.2%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,800,000.00	5,657,296.80
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	952,279.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	1,033,841.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,174,104.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,800,000.00	1,749,231.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	2,009,258.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	1,075,878.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,202,809.20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	700,000.00	858,541.60
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,288,573.20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000.00	496,640.50
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	2,000,000.00	2,085,368.00
	小計	銘柄数：12	19,400,000.00
	組入時価比率：0.8%		0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	220,000.00
	BELGIUM KINGDOM	110,000.00	127,957.50
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	293,436.00
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	289,317.00
	BELGIUM KINGDOM	280,000.00	329,560.00
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	260,189.25
	BELGIUM KINGDOM	80,000.00	80,130.80
	BELGIUM KINGDOM	70,000.00	100,129.12
	BELGIUM KINGDOM	80,000.00	90,096.48
	BELGIUM KINGDOM	90,000.00	145,453.50
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	153,961.40
	BELGIUM KINGDOM	50,000.00	50,681.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	200,000.00	221,278.60
	BELGIUM KINGDOM GOVT	120,000.00	183,436.32
	BELGIUM KINGDOM GOVT	190,000.00	314,801.88
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	459,710.42
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	302,642.70



BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	138,861.71
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	337,080.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	385,963.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	50,000.00	56,602.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	220,000.00	259,820.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	368,560.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	132,966.99
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	190,000.00	242,308.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	128,440.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	520,407.72
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	120,050.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	416,509.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	110,000.00	140,746.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	337,760.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	60,000.00	84,498.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	150,000.00	149,167.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	60,000.00	82,704.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	204,680.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	357,948.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	110,000.00	167,497.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,000.00	21,390.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,000.00	33,508.65
BUNDES Obligation	400,000.00	415,764.00
BUNDES Obligation	300,000.00	307,110.00
BUNDES Obligation	100,000.00	103,466.00
BUNDES Obligation	150,000.00	153,832.50
BUNDES Obligation	100,000.00	102,458.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	646,368.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	150,000.00	164,019.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	565,795.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	221,970.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	280,000.00	317,200.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	250,000.00	281,402.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	112,010.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	110,770.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	222,398.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	80,000.00	89,196.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	230,182.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	160,000.00	182,030.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	190,000.00	205,849.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	208,554.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	324,816.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	340,000.00	351,301.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	130,000.00	127,223.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	344,015.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	120,000.00	201,733.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	260,000.00	438,959.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	110,000.00	177,560.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	110,000.00	189,073.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	150,000.00	277,389.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	140,000.00	216,797.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	240,000.00	337,900.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	200,000.00	202,032.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	140,000.00	147,239.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	342,012.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	322,323.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	160,549.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	600,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000.00	175,936.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	415,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	300,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	308,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	192,117.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	216,277.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,610.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	70,000.00	79,819.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	467,974.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	299,970.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	344,130.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	11,942.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	197,874.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	236,693.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	498,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	544,631.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	61,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	241,775.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	80,000.00	121,112.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	146,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	161,895.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	90,000.00	114,264.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,000.00	29,866.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	308,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	271,502.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	415,632.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	240,000.00	227,983.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	270,459.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	90,000.00	121,914.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000.00	185,776.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	376,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	754,765.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000.00	157,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	90,000.00	111,177.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	69,865.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	110,000.00	153,087.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	50,000.00	68,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	205,390.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	116,412.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	40,000.00	36,296.00	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	123,780.00	
FINNISH GOVERNMENT	20,000.00	22,614.00	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	206,616.80	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	110,803.20	
FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	91,280.00	
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	161,878.56	
FINNISH GOVERNMENT	30,000.00	29,995.05	

FINNISH GOVERNMENT	20,000.00	27,334.16	
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	416,060.00	
FRANCE (GOVT OF)	150,000.00	154,727.25	
FRANCE (GOVT OF)	360,000.00	365,915.52	
FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	424,956.00	
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	332,956.20	
FRANCE (GOVT OF)	160,000.00	184,223.52	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	604,328.40	
FRANCE (GOVT OF)	150,000.00	143,525.40	
FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	525,087.20	
FRANCE (GOVT OF)	230,000.00	227,493.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	425,290.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	653,760.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	503,927.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	220,000.00	249,509.48	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	445,040.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	290,000.00	341,489.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	250,000.00	292,513.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	120,000.00	140,280.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	410,000.00	465,484.07	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	461,796.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	430,000.00	479,305.95	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	70,000.00	103,968.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	350,000.00	363,930.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	250,000.00	316,250.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	260,000.00	313,092.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	120,000.00	185,465.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	340,000.00	360,464.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	200,000.00	319,980.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	250,000.00	376,262.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	70,000.00	113,950.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	210,000.00	291,470.34	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	180,000.00	300,717.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	70,000.00	120,042.16	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	170,000.00	191,043.11	

	IRISH GOVERNMENT	140,000.00	163,063.04	
	IRISH GOVERNMENT	160,000.00	221,368.48	
	IRISH TSY 2.4% 2030	60,000.00	69,080.46	
	IRISH TSY 2% 2045	50,000.00	53,511.75	
	IRISH TSY 3.4% 2024	50,000.00	60,617.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	504,904.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	224,340.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	114,885.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	375,571.20	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	150,000.00	171,594.45	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	30,000.00	37,365.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	229,120.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	240,000.00	240,631.92	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	80,000.00	80,936.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	216,665.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	476,245.25	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	127,896.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	150,351.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	236,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	170,000.00	191,336.53	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	156,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	108,100.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	133,645.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	50,000.00	80,253.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	189,320.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	102,419.94	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	30,000.00	54,507.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	30,000.00	37,044.36	
	SPANISH GOVERNMENT	260,000.00	385,761.74	
	SPANISH GOVERNMENT	80,000.00	122,008.00	
	SPANISH GOVERNMENT	150,000.00	199,320.00	
小計	銘柄数：188	38,160,000.00	44,315,013.59	
			(5,414,851,510)	
	組入時価比率：40.1%		40.2%	
英債券	UK TREASURY	280,000.00	285,208.00	

	UK TREASURY	200,000.00	219,560.00	
	UK TREASURY	360,000.00	395,280.00	
	UK TREASURY	380,000.00	401,888.00	
	UK TREASURY	210,000.00	236,313.00	
	UK TREASURY	250,000.00	332,900.00	
	UK TREASURY	220,000.00	257,950.00	
	UK TREASURY	160,000.00	168,848.00	
	UK TREASURY	420,000.00	457,128.00	
	UK TREASURY	100,000.00	112,590.00	
	UK TREASURY	120,000.00	127,920.00	
	UK TREASURY	240,000.00	243,456.00	
	UK TREASURY	90,000.00	134,748.00	
	UK TREASURY	190,000.00	264,062.00	
	UK TREASURY	70,000.00	93,968.00	
	UK TREASURY	160,000.00	225,152.00	
	UK TREASURY	300,000.00	415,320.00	
	UK TREASURY	160,000.00	241,840.00	
	UK TREASURY	250,000.00	381,025.00	
	UK TREASURY	160,000.00	212,880.00	
	UK TREASURY	230,000.00	350,313.00	
	UK TREASURY	80,000.00	126,560.00	
	UK TREASURY	100,000.00	149,740.00	
	UK TREASURY	90,000.00	150,822.00	
	UK TREASURY	280,000.00	346,864.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	250,000.00	317,525.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	130,000.00	219,700.00	
小計	銘柄数：27	5,480,000.00	6,869,560.00	
			(988,392,292)	
	組入時価比率：7.3%		7.3%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	230,000.00	257,278.00	
小計	銘柄数：1	230,000.00	257,278.00	
			(29,339,983)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,212,069.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	800,000.00	955,440.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	400,000.00	436,040.00	

小計	SWEDISH GOVERNMENT	700,000.00	821,100.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	500,000.00	518,388.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	300,000.00	406,221.90	
	銘柄数：6	3,700,000.00	4,349,259.40	(55,018,131)
	組入時価比率：0.4%			0.4%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	200,000.00	222,950.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	600,000.00	622,020.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	300,000.00	330,735.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	300,000.00	303,540.00	
	小計	銘柄数：4	1,400,000.00	1,479,245.00
	組入時価比率：0.1%			0.1%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	700,000.00	791,140.00	
	KINGDOM OF DENMARK	800,000.00	924,920.00	
	KINGDOM OF DENMARK	450,000.00	495,180.00	
	KINGDOM OF DENMARK	800,000.00	897,040.00	
	小計	銘柄数：5	3,640,000.00	4,653,026.30
	組入時価比率：0.6%			0.6%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	272,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	580,000.00	565,790.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	227,220.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	640,000.00	674,464.00	
	小計	銘柄数：5	1,910,000.00	1,961,630.00
	組入時価比率：0.4%			0.4%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	481,531.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	203,843.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	70,000.00	75,289.62	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	383,362.59	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	492,618.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	117,256.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	110,000.00	110,484.00	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	300,217.86	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	279,100.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	349,996.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	110,000.00	108,055.64	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	110,000.00	111,834.58	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	30,000.00	34,358.01	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	190,000.00	169,969.82	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	40,000.00	36,972.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	50,000.00	41,905.00	
	小計	銘柄数：16 組入時価比率：2.1%	3,110,000.00	3,296,794.82 (277,392,316) 2.1%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	40,000.00	39,632.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	174,080.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	350,000.00	350,805.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	162,640.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	97,187.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	150,000.00	158,205.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	198,640.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	97,567.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	108,950.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	80,000.00	81,728.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,800.00	
	小計	銘柄数：11 組入時価比率：0.9%	1,550,000.00	1,570,235.80 (127,063,480) 0.9%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	660,640.61	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,250,000.00	2,151,760.50	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,550,000.00	1,389,508.81	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	650,320.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,100,000.00	1,491,663.81	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	250,000.00	177,204.72	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,000,000.00	910,022.00	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.5%	8,650,000.00	7,431,120.45 (61,752,610) 0.5%



合計		13,474,334,616	
		(13,474,334,616)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年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	13,493,980,895	-	13,717,259,010	223,278,115
米ドル	5,927,425,314	-	6,080,255,280	152,829,966
カナダドル	299,346,620	-	304,623,620	5,277,000
メキシコペソ	109,922,022	-	112,878,360	2,956,338
ユーロ	5,437,668,038	-	5,487,840,050	50,172,012
英ポンド	1,006,364,376	-	1,012,419,370	6,054,994
スイスフラン	29,460,406	-	29,888,960	428,554
スウェーデンクローナ	56,356,196	-	57,544,850	1,188,654
ノルウェークローネ	20,638,032	-	20,666,800	28,768
デンマーククローネ	78,619,694	-	79,421,640	801,946
ズロチ	54,303,000	-	55,400,000	1,097,000
豪ドル	283,834,385	-	282,760,950	1,073,435
シンガポールドル	128,383,812	-	130,217,130	1,833,318
ランド	61,659,000	-	63,342,000	1,683,000
合計	13,493,980,895	-	13,717,259,010	223,278,115

(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28年12月26日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	648,517,270
コール・ローン	301,603,888
国債証券	658,740,740,727
派生商品評価勘定	4,077,260
未収入金	450,286,672
未収利息	6,319,323,765
前払費用	297,028,215
流動資産合計	666,761,577,797
<b>資産合計</b>	
666,761,577,797	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	35,014,121
未払解約金	1,208,181,152
未払利息	338
その他未払費用	10,641,700
流動負債合計	1,253,837,311
<b>負債合計</b>	
1,253,837,311	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	301,949,646,048
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	363,558,094,438
元本等合計	665,507,740,486
<b>純資産合計</b>	
665,507,740,486	
<b>負債純資産合計</b>	
666,761,577,797	

### 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

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28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	2,2040円
(10,000口当たり純資産額)	(22,040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 4月 1日 至 平成28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、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成28年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28年12月26日現在	
期首	平成28年 4月 1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	288,024,418,427円
同期中における追加設定元本額	34,422,656,376円
同期中における一部解約元本額	20,497,428,755円
期末元本額	301,949,646,048円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	92,976,907円
バランスセレクト50	94,460,072円
バランスセレクト70	71,608,720円
野村外国債券インデックスファンド	288,436,998円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,830,561,637円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	28,926,323,288円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,522,297,339円
野村資産設計ファンド2015	42,531,194円
野村資産設計ファンド2020	48,079,504円
野村資産設計ファンド2025	49,785,198円
野村資産設計ファンド2030	41,310,369円
野村資産設計ファンド2035	27,837,113円
野村資産設計ファンド2040	73,751,734円
野村外国債券インデックス(野村投資一任口座向け)	187,574,587,915円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	4,560,273,777円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	6,617,896,648円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	1,597,907,523円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	1,819,183,010円
野村資産設計ファンド2045	5,904,635円
野村インデックスファンド・外国債券	634,347,076円
マイ・ロード	8,053,286,279円
ネクストコア	518,093,348円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	88,754,747円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	2,377,217,910円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	712,573,239円
野村資産設計ファンド2050	3,461,125円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,550,987円

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	761,040円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	615,596円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	736,983円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	200,984,741円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	23,179,405円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	7,782,886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)	36,113,683円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,323,448,474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)	656,326,643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)	7,278,937,539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)	1,730,260,098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)	3,376,764円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	26,635,015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)	2,761,455円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,325,159,162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)	515,654,157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)	1,895,509,808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)	201,831,590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)	106,500,858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)	236,884,823円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	2,182,384,672円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,093,899,287円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,624,077,565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)	373,615,381円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	4,576,453円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,658,834円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,618,675円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	530,291,793円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,025,827,989円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	2,736,010,278円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,441,787,044円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	12,573,257,738円
マイバランスDC30	1,149,036,726円
マイバランスDC50	695,990,879円
マイバランスDC70	414,665,447円
野村DC外国債券インデックスファンド	3,023,147,431円
野村DC運用戦略ファンド	791,662,428円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	4,626,362円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	19,828,090円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	535,269円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	688,695円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1)株式(平成28年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28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	10,500,000.00	12,202,558.20	
		US TREASURY BOND	19,300,000.00	22,640,557.87	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	15,840,273.12	
		US TREASURY BOND	21,100,000.00	26,925,577.07	
		US TREASURY BOND	16,600,000.00	20,651,437.50	
		US TREASURY BOND	51,200,000.00	51,035,996.16	
		US TREASURY BOND	43,200,000.00	55,476,558.72	
		US TREASURY BOND	13,800,000.00	18,568,545.84	
		US TREASURY BOND	23,700,000.00	31,558,031.25	
		US TREASURY BOND	12,000,000.00	15,402,187.20	
		US TREASURY BOND	5,000,000.00	6,308,984.00	
		US TREASURY BOND	800,000.00	1,013,124.96	
		US TREASURY BOND	100,000.00	123,007.81	
		US TREASURY BOND	25,300,000.00	24,151,615.29	
		US TREASURY BOND	16,000,000.00	17,933,748.80	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,594,921.68	
		US TREASURY N/B	16,300,000.00	16,589,069.09	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,995,624.80	
		US TREASURY N/B	300,000.00	299,273.43	
		US TREASURY N/B	41,000,000.00	42,132,301.10	
		US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,002,343.60	
		US TREASURY N/B	6,200,000.00	6,323,757.58	
		US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,080,862.66	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,999,843.60	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,993,203.00	
		US TREASURY N/B	34,000,000.00	33,873,826.00	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,675,644.00			
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,192,781.16			
US TREASURY N/B	15,200,000.00	15,796,718.56			

US TREASURY N/B	600,000.00	599,648.40	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,632,128.25	
US TREASURY N/B	15,500,000.00	15,484,256.65	
US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,405,850.76	
US TREASURY N/B	31,200,000.00	31,774,030.08	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,535,526.60	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,953,655.92	
US TREASURY N/B	18,400,000.00	18,470,437.04	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,590,065.30	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	5,025,562.08	
US TREASURY N/B	19,600,000.00	19,550,233.64	
US TREASURY N/B	20,800,000.00	20,920,248.96	
US TREASURY N/B	800,000.00	797,406.24	
US TREASURY N/B	27,400,000.00	27,483,482.32	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,922,265.00	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,386,406.16	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,998,612.91	
US TREASURY N/B	21,400,000.00	21,415,046.34	
US TREASURY N/B	700,000.00	694,230.46	
US TREASURY N/B	35,700,000.00	37,405,510.38	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,347.65	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,001,640.40	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,514,979.90	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,526,210.80	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,096,214.78	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,008,593.60	
US TREASURY N/B	27,500,000.00	28,351,853.75	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,507,558.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,016,250.00	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,243,909.43	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,015,468.40	
US TREASURY N/B	25,500,000.00	25,671,326.85	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,632,374.72	
US TREASURY N/B	27,600,000.00	28,741,731.96	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,631,882.68	

US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,386,054.60	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,943,202.73	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,574,764.90	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	27,589,534.83	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,968,007.70	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,842,280.48	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,961,913.80	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,829,983.49	
US TREASURY N/B	49,300,000.00	51,936,391.45	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,673,155.92	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,799,226.54	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,853,750.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,810,093.56	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,987,812.40	
US TREASURY N/B	51,800,000.00	55,037,500.00	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,670,679.62	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,936,562.40	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	21,121,944.78	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,170,499.84	
US TREASURY N/B	47,700,000.00	50,558,269.86	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,458,866.70	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,703,750.00	
US TREASURY N/B	13,200,000.00	13,156,686.84	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,134,530.20	
US TREASURY N/B	42,500,000.00	43,794,919.75	
US TREASURY N/B	37,600,000.00	38,090,559.68	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,046,875.00	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,597,374.88	
US TREASURY N/B	52,600,000.00	54,186,216.12	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,937,593.24	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,348,859.11	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	48,988,105.94	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,017,578.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,685,156.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,825,312.50	



US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,937,382.74	
US TREASURY N/B	38,400,000.00	40,308,000.00	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,533,396.75	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,204,530.40	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,801,546.39	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	26,917,250.00	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,291,445.13	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,063,748.80	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,977,343.00	
US TREASURY N/B	26,000,000.00	25,930,936.20	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,931,874.40	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,437,780.32	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,857,812.50	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	33,544,663.22	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,171,109.01	
US TREASURY N/B	5,900,000.00	5,787,069.87	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,899,218.50	
US TREASURY N/B	11,900,000.00	11,662,000.00	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	26,940,937.50	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	17,939,218.75	
US TREASURY N/B	12,800,000.00	12,380,999.68	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,909,608.40	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	21,357,186.40	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,750,312.50	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	23,884,765.00	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,495,546.60	
US TREASURY N/B	42,200,000.00	40,825,199.96	
US TREASURY N/B	15,400,000.00	14,765,952.74	
US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,616,732.92	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	17,238,374.16	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	27,495,125.00	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	30,625,622.72	
US TREASURY N/B	25,100,000.00	24,741,147.81	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,366,562.50	
US TREASURY N/B	26,500,000.00	25,767,108.05	

	US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,368,748.80	
	US TREASURY N/B	19,600,000.00	19,181,967.28	
	US TREASURY N/B	300,000.00	395,742.18	
	US TREASURY N/B	500,000.00	625,195.30	
	US TREASURY N/B	100,000.00	108,257.81	
	US TREASURY N/B	5,200,000.00	6,463,437.24	
	US TREASURY N/B	7,200,000.00	8,796,936.96	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	10,123,749.60	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,782,500.00	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,091,874.40	
	US TREASURY N/B	7,800,000.00	9,372,796.68	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	9,032,734.20	
	US TREASURY N/B	7,000,000.00	8,575,546.70	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,527,929.20	
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,214,499.84	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,414,921.65	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	8,691,866.49	
	US TREASURY N/B	9,600,000.00	8,963,249.28	
	US TREASURY N/B	18,200,000.00	18,229,858.92	
	US TREASURY N/B	15,400,000.00	16,887,062.50	
	US TREASURY N/B	23,200,000.00	25,433,000.00	
	US TREASURY N/B	18,900,000.00	19,803,656.25	
	US TREASURY N/B	30,600,000.00	30,628,687.50	
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	36,023,625.00	
	US TREASURY N/B	26,000,000.00	22,900,311.20	
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,177,843.75	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,902,812.40	
	US TREASURY N/B	15,500,000.00	15,113,710.55	
	US TREASURY NOTE	33,600,000.00	34,371,748.32	
小計	銘柄数：163	2,419,300,000.00	2,499,074,111.44	
			(292,441,652,520)	
	組入時価比率：43.9%		44.4%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	4,600,000.00	4,937,318.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,000,000.00	9,057,780.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,221,472.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	6,300,000.00	6,612,417.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	9,573,815.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	9,648,590.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,875,848.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	7,165,918.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,300,000.00	4,398,212.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,657,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,447,790.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,767,100.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,064,454.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	11,433,030.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	768,568.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,605,842.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,058,701.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	8,860,145.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	5,827,833.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,680,000.00	7,957,907.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	4,424,430.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	7,112,500.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	8,256,512.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,500,000.00	11,638,450.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,945,980.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	554,695.00	
小計	銘柄数：26	145,180,000.00	160,873,303.20	
			(13,938,062,989)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	146,200,000.00	142,602,895.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	104,500,000.00	108,031,055.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,000,000.00	31,425,207.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	70,700,000.00	73,092,558.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	124,300,000.00	121,617,606.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	48,400,000.00	47,034,878.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,700,000.00	35,668,488.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,000,000.00	7,148,504.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	83,100,000.00	83,484,669.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,100,000.00	50,673,853.80	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,500,000.00	44,884,302.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,023,410.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	56,418,448.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,500,000.00	32,751,235.50
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	63,768,640.20
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	86,542,772.00
	銘柄数：16	974,200,000.00	995,168,523.30 (5,662,508,897)
組入時価比率：0.9%		0.9%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	6,588,217.60
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,410,000.00
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	8,142,750.00
	BELGIUM KINGDOM	7,200,000.00	8,803,080.00
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	6,147,280.00
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	8,050,560.00
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,763,455.00
	BELGIUM KINGDOM	10,000,000.00	11,770,000.00
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,515,358.40
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,006,456.00
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	10,343,360.00
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	8,929,761.20
	BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,428,596.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	2,500,000.00	2,648,000.00
	BELGIUM KINGDOM GOVT	5,200,000.00	5,753,243.60
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,600,000.00	16,203,541.60
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,225,372.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,700,000.00	32,301,619.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,021,000.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,800,000.00	19,029,873.20
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	7,626,699.30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,300,000.00	14,206,621.10
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,900,000.00	9,981,928.50
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	9,887,680.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	27,500,000.00	31,131,375.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,600,000.00	12,518,621.20

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,900,000.00	9,705,426.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	920,540.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,200,000.00	11,732,852.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	17,000,000.00	21,834,800.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	7,434,396.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,100,000.00	9,014,870.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,900,000.00	9,483,950.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000,000.00	17,913,252.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,912,720.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,800,000.00	6,616,320.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	7,895,620.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,400,000.00	9,163,475.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	11,877,060.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,116,955.00
BUNDES OBLIGATION	600,000.00	617,976.00
BUNDES OBLIGATION	6,000,000.00	6,172,680.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,700,000.00	19,634,433.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	4,153,065.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,639,519.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,761,005.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,300,000.00	9,363,479.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	8,232,140.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	9,516,024.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,400,000.00	16,208,784.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,500,000.00	9,520,850.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,538,500.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,782,348.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,797,740.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,000,000.00	16,112,740.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,100,000.00	20,496,324.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,484,833.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,680,975.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,300,000.00	4,658,706.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	8,342,160.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,066,480.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,600,000.00	33,927,994.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,453,060.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,085,448.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	11,310,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,909,883.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	10,636,327.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	8,716,593.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000,000.00	13,750,832.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	15,163,964.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	8,517,047.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	6,544,021.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000.00	12,671,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,700,000.00	8,786,304.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	16,722,189.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	12,736,581.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,600,000.00	31,802,536.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,562,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,300,000.00	16,692,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,078,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,144,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	519,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,080,000.00	12,328,716.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,100,000.00	12,596,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	32,998,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	18,440,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,032,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,999,169.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,989,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	8,947,380.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,800,000.00	15,285,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,442,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,600,000.00	12,067,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,700,000.00	26,079,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	8,108,956.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	7,658,240.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,712,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	19,405,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,690,540.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	18,917,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	10,489,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,600,000.00	12,908,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,200,000.00	26,399,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	9,401,670.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,500,000.00	25,060,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	26,932,110.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	9,344,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	11,527,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	8,276,510.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	11,178,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,600,000.00	21,710,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,541,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	8,756,100.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,547,250.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,465,731.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,261,400.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,342,138.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,545,702.40	
FINNISH GOVERNMENT	4,200,000.00	4,629,466.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	3,176,880.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,052,291.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,023,482.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,375,570.50	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	699,884.50	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,186,732.80	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,321,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,500,000.00	9,799,392.50	
FRANCE (GOVT OF)	4,500,000.00	5,370,210.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,978,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,400,000.00	5,741,420.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,600,000.00	6,760,155.60	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,800,000.00	11,767,680.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,800,000.00	27,661,164.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	12,820,223.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,039,272.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,500,000.00	12,920,767.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	16,785,183.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,300,000.00	30,373,980.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,050,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	13,895,090.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	17,667,785.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	17,301,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,600,000.00	23,387,736.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	12,622,440.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	32,000,000.00	41,075,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000.00	8,917,320.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	29,408,148.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	4,159,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	41,871,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,670,240.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000.00	37,865,852.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,600,000.00	32,972,688.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,400,000.00	11,839,260.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	17,759,590.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,400,000.00	18,557,604.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,200,000.00	18,320,992.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	7,852,055.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,800,000.00	6,516,574.40	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	3,600,000.00	4,045,618.80	
IRISH GOVERNMENT	5,600,000.00	6,116,012.00	
IRISH GOVERNMENT	3,400,000.00	4,020,139.60	
IRISH GOVERNMENT	5,300,000.00	6,173,100.80	
IRISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,230,471.00	
IRISH GOVERNMENT	7,000,000.00	9,684,871.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	2,600,000.00	2,993,486.60	
IRISH TSY 2% 2045	1,500,000.00	1,605,352.50	



IRISH TSY 3.4% 2024	1,900,000.00	2,303,446.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,200,000.00	5,311,186.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	7,630,370.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,603,155.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,100,000.00	7,964,070.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,059,032.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,800,000.00	6,663,330.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,924,594.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,715,944.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	7,348,450.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	6,330,460.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,574,477.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,465,600.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,046,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	11,272,660.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,700,000.00	7,264,650.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,000,000.00	7,998,225.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,200,000.00	8,539,570.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	6,531,210.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,378,890.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,777,500.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,500,000.00	2,664,500.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,400,000.00	2,462,400.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,600,000.00	5,320,130.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,209,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,300,000.00	3,984,750.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	6,065,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,900,000.00	4,389,485.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,360,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,638,300.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	6,100,000.00	9,790,914.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,900,000.00	9,308,253.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,800,000.00	8,486,223.60	
REPUBLIC OF IRELAND	3,400,000.00	4,198,360.80	
SPANISH GOVERNMENT	18,500,000.00	27,448,431.50	

小計	SPANISH GOVERNMENT	8,500,000.00	12,963,350.00		
	SPANISH GOVERNMENT	5,200,000.00	6,909,760.00		
	銘柄数：203	1,705,980,000.00	2,147,925,217.90		
	組入時価比率：39.4%		(262,454,982,375)	39.8%	
英ポンド	UK TREASURY	100,000.00	105,870.00		
	UK TREASURY	9,850,000.00	10,033,210.00		
	UK TREASURY	4,500,000.00	4,940,100.00		
	UK TREASURY	18,900,000.00	19,688,130.00		
	UK TREASURY	2,600,000.00	2,854,800.00		
	UK TREASURY	5,300,000.00	6,061,610.00		
	UK TREASURY	16,090,000.00	17,016,784.00		
	UK TREASURY	7,000,000.00	7,877,100.00		
	UK TREASURY	2,200,000.00	2,290,420.00		
	UK TREASURY	9,340,000.00	12,437,144.00		
	UK TREASURY	8,900,000.00	10,223,430.00		
	UK TREASURY	4,650,000.00	5,452,125.00		
	UK TREASURY	8,300,000.00	8,758,990.00		
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,550,840.00		
	UK TREASURY	11,200,000.00	12,610,080.00		
	UK TREASURY	13,450,000.00	17,558,975.00		
	UK TREASURY	9,530,000.00	12,245,097.00		
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,010,020.00		
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,921,860.00		
	UK TREASURY	7,250,000.00	9,732,400.00		
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,287,520.00		
	UK TREASURY	4,900,000.00	6,783,560.00		
	UK TREASURY	4,400,000.00	6,650,600.00		
	UK TREASURY	4,200,000.00	5,989,620.00		
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,225,100.00		
	UK TREASURY	5,600,000.00	8,534,960.00		
	UK TREASURY	20,000,000.00	26,610,000.00		
	UK TREASURY	5,950,000.00	9,062,445.00		
	UK TREASURY	4,350,000.00	6,881,700.00		
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,102,250.00		

小計	UK TREASURY	2,500,000.00	3,097,000.00	
	UK TREASURY	5,800,000.00	9,194,740.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	21,050,000.00	26,735,605.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,400,000.00	10,816,000.00	
	銘柄数：34	261,510,000.00	332,340,085.00	(47,817,091,429)
	組入時価比率：7.2%			7.3%
スイスフラン 小計	SWITZERLAND GOVERNMENT	7,100,000.00	7,942,060.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,600,000.00	5,252,040.00	
	銘柄数：2	10,700,000.00	13,194,100.00	(1,504,655,164)
	組入時価比率：0.2%			0.2%
スウェーデンク ローナ 小計	SWEDISH GOVERNMENT	4,600,000.00	5,100,061.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	49,400,000.00	59,876,208.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	53,400,000.00	63,775,620.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	26,600,000.00	28,996,660.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	41,700,000.00	48,914,100.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	9,100,000.00	9,434,670.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,300,000.00	22,071,389.90	
	銘柄数：7	201,100,000.00	238,168,710.60	(3,012,834,189)
組入時価比率：0.5%			0.5%	
ノルウェークロ ネ 小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	24,800,000.00	27,005,960.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	30,767,100.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,824,810.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	49,500,005.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,755,460.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,633,025.00	
	銘柄数：6	121,000,000.00	131,486,360.00	(1,765,861,814)
組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーククロ ネ	KINGDOM OF DENMARK	16,500,000.00	16,764,000.00	
	KINGDOM OF DENMARK	30,800,000.00	34,810,160.00	
	KINGDOM OF DENMARK	41,100,000.00	47,517,765.00	
	KINGDOM OF DENMARK	31,000,000.00	34,112,400.00	
	KINGDOM OF DENMARK	5,280,000.00	8,129,404.80	

小計	KINGDOM OF DENMARK	29,000,000.00	32,517,700.00
	KINGDOM OF DENMARK	48,300,000.00	83,832,861.00
	銘柄数：7	201,980,000.00	257,684,290.80 (4,236,329,740)
	組入時価比率：0.6%		0.6%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,079,200.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	14,400,000.00	14,558,400.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,158,480.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	5,956,600.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,100,000.00	12,076,800.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	6,128,010.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	33,754,650.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	7,611,870.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	10,770,520.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,173,125.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	22,874,650.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,091,075.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,509,486.00
	小計	銘柄数：13	133,300,000.00
	組入時価比率：0.6%		0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,844,152.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	9,928,920.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,600,000.00	12,412,812.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,363,416.10
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,100,000.00	14,089,914.60
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,300,000.00	6,192,780.30
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	11,679,469.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,500,490.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,794,222.50
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	7,934,760.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	16,300,000.00	16,874,314.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,300,000.00	13,731,720.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,250,000.00	13,124,868.75
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	785,859.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	371,360.00

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,268,447.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	4,122,961.20
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,610,240.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,509,522.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	2,957,760.00
	銘柄数：20	146,550,000.00	157,097,991.05 (13,218,224,966)
	組入時価比率：2.0%		2.0%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,671,680.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,600,000.00	5,734,400.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,000,000.00	4,218,800.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,380,000.00	3,435,770.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,476,580.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,090,000.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,400,050.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,595,350.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,451,864.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	543,500.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,900,000.00	2,923,200.00
	銘柄数：11	30,380,000.00	31,541,194.00 (2,552,313,418)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
リンギ	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,716,556.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,694,176.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	4,994,410.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	904,699.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,405,678.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	12,141,736.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,000,000.00	9,943,540.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,416,773.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,095,904.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,724,594.90
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,445,021.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	9,930,003.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,722,889.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	8,772,112.80

	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	5,531,718.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,675,342.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,859,421.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,410,132.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,194,713.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,365,430.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	355,072.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,570,785.40	
小計	銘柄数：22	111,400,000.00	109,870,713.00	
			(2,875,316,559)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	26,110,899.36	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,300,000.00	24,665,574.67	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,100,000.00	24,632,457.03	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	25,200,000.00	24,099,717.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	70,000,000.00	76,985,034.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,000,000.00	24,204,347.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	24,387,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	41,000,000.00	36,817,048.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	47,100,000.00	33,455,888.31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,500,000.00	24,532,750.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	24,600,000.00	17,436,944.94	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,100,000.00	24,661,596.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,100,000.00	41,945,707.72	
小計	銘柄数：13	443,100,000.00	403,934,965.73	
			(3,356,699,565)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
合計			658,740,740,727	
			(658,740,740,727)	

(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

平成28年12月26日現在

種類	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	935,637,560	-	931,560,300	4,077,260
米ドル	407,892,655	-	405,990,000	1,902,655
メキシコペソ	11,406,320	-	11,360,000	46,320
ユーロ	425,207,825	-	423,999,300	1,208,525
英ポンド	72,711,700	-	71,935,000	776,700
デンマーククローネ	9,911,760	-	9,864,000	47,760
豪ドル	8,507,300	-	8,412,000	95,300
合計	935,637,560	-	931,560,300	4,077,260

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	53,069,928
コール・ローン	8,950,611
国債証券	3,846,438,361
派生商品評価勘定	292,264
未収入金	36,555,824
未収利息	57,673,876
前払費用	8,367,686
流動資産合計	4,011,348,550
資産合計	4,011,348,550
負債の部	

(平成28年12月26日現在)

<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	288,342
未払解約金	59,004,797
未払利息	10
その他未払費用	565,600
流動負債合計	59,858,749
<b>負債合計</b>	<b>59,858,749</b>
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	3,151,858,537
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	799,631,264
元本等合計	3,951,489,801
純資産合計	3,951,489,801
<b>負債純資産合計</b>	<b>4,011,348,550</b>

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

平成28年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	1.2537円
(10,000口当たり純資産額)	(12,537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 4月 1日

至 平成28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、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っております。

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成28年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28年12月26日現在

期首	平成28年 4月 1日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	1,581,753,619円
同期中における追加設定元本額	1,769,926,261円
同期中における一部解約元本額	199,821,343円
期末元本額	3,151,858,537円
期末元本額の内訳*	

野村資産設計ファンド2015	15,719,940円
野村資産設計ファンド2020	17,055,878円
野村資産設計ファンド2025	17,979,036円
野村資産設計ファンド2030	14,909,463円
野村資産設計ファンド2035	10,046,781円
野村資産設計ファンド2040	26,617,692円
野村資産設計ファンド2045	2,170,511円
野村インデックスファンド・新興国債券 ネクストコア	455,315,797円 88,282,206円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	160,163,385円
野村資産設計ファンド2050	1,206,555円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	1,272,510円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	271,279円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	219,882円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	264,861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)	1,955,561,721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	250,720,760円
野村DC運用戦略ファンド	133,814,578円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	265,702円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成28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28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	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,850,000.00	6,681,462.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,800,000.00	4,962,192.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,200,000.00	2,095,013.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,950,000.00	8,219,035.95	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,600,000.00	1,565,472.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,200,000.00	7,968,719.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,600,000.00	5,344,464.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	3,574,252.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,350,000.00	4,370,136.15	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,337,134.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	2,004,682.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,700,000.00	2,085,029.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	5,369,055.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,200,000.00	3,178,499.20	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	3,400,000.00	3,545,125.60	
	銘柄数：15	64,150,000.00	65,300,273.70	(371,558,557)
組入時価比率：9.4%			9.7%	
リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	830,000.00	743,267.49	
	LETRA TESOURO NACIONAL	2,140,000.00	1,823,468.32	
	LETRA TESOURO NACIONAL	400,000.00	332,212.80	
	LETRA TESOURO NACIONAL	1,950,000.00	1,577,793.75	
	LETRA TESOURO NACIONAL	2,310,000.00	1,770,631.17	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	256,000.00	2,584,422.40	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	50,000.00	495,505.50	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	251,000.00	2,448,944.25	
小計	銘柄数：8	8,187,000.00	11,776,245.68	(421,471,832)
組入時価比率：10.7%			10.9%	
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,820,000,000.00	3,988,733,220.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,750,000,000.00	3,238,125,000.00	
	小計	銘柄数：2	6,570,000,000.00	7,226,858,220.00
組入時価比率：7.1%			7.3%	
ヌエボソル	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	594,659.40	
	PERU BONO SOBERANO	480,000.00	521,902.56	
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	513,676.00	
	PERU BONO SOBERANO	620,000.00	622,836.50	
	小計	銘柄数：4	2,200,000.00	2,253,074.46
組入時価比率：2.0%			2.0%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	800,000.00	781,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,410,000.00	1,420,222.50	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,050,000.00	966,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	950,000.00	919,362.50	

小計	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,050,000.00	999,337.50	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,390,000.00	1,257,255.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	570,000.00	476,520.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	460,000.00	416,070.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	220,000.00	216,040.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,010,000.00	915,312.50	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,620,000.00	1,373,760.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	600,000.00	590,400.00	
	銘柄数：12	11,130,000.00	10,331,680.00	(344,458,211)
組入時価比率：8.7%			9.0%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	62,000,000.00	70,819,500.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	48,000,000.00	51,768,000.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	81,000,000.00	100,022,850.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	24,000,000.00	30,301,200.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	94,998,750.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	30,000,000.00	30,541,500.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	92,000,000.00	109,834,200.00	
	銘柄数：7	414,000,000.00	488,286,000.00	(193,068,284)
組入時価比率：4.9%			5.0%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	910,000.00	934,024.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	990,000.00	1,016,730.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	380,000.00	413,440.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,730,000.00	1,682,771.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	830,000.00	912,585.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,700,000.00	1,658,350.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	576,600.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	568,050.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	980,000.00	1,122,884.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,140,000.00	1,201,389.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	2,088,555.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,650,000.00	1,527,322.50	
	銘柄数：12	13,510,000.00	13,702,700.50	(380,112,911)
組入時価比率：9.6%			9.9%	

ルール	RUSSIA FOREIGN BOND	130,000,000.00	128,841,310.00	
小計	銘柄数：1 組入時価比率：6.2%	130,000,000.00	128,841,310.00 (246,086,902) 6.4%	
レイ	ROMANIA	790,000.00	851,311.90	
	ROMANIA	440,000.00	444,857.60	
	ROMANIA	300,000.00	309,391.50	
	ROMANIA	300,000.00	343,318.50	
	ROMANIA	950,000.00	1,096,053.00	
	ROMANIA	820,000.00	888,252.70	
	ROMANIA	610,000.00	718,851.45	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：3.2%	4,210,000.00	4,652,036.65 (125,744,550) 3.3%	
リング	MALAYSIAN GOVERNMENT	510,000.00	513,127.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,960,000.00	1,957,808.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,760,000.00	1,795,752.64	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,298,261.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,036,303.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	501,413.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	750,000.00	724,731.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	880,000.00	840,231.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,184,046.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,240,000.00	1,236,070.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	486,530.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	740,000.00	688,752.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	200,000.00	192,810.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	550,000.00	510,848.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	355,072.80	
小計	銘柄数：15 組入時価比率：8.8%	13,510,000.00	13,321,760.68 (348,630,476) 9.1%	
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	625,029.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,200,000.00	11,599,817.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,700,000.00	10,179,655.30	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,700,000.00	9,890,042.40	

小計	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,943,320.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,916,603.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,700,000.00	9,230,265.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,721,250.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,200,000.00	6,681,498.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	7,038,041.80	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,807,610.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,004,503.00	
	銘柄数：12	83,300,000.00	88,637,635.30	(288,072,314)
組入時価比率：7.3%			7.5%	
小計	REPUBLIC OF PHILIPPINES	5,000,000.00	5,012,550.00	
	銘柄数：1	5,000,000.00	5,012,550.00	(11,829,618)
組入時価比率：0.3%			0.3%	
小計	INDONESIA GOVERNMENT	2,700,000,000.00	2,733,750,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,900,000,000.00	2,133,510,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,700,000,000.00	2,018,112,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,880,000,000.00	1,831,076,760.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,330,000,000.00	5,505,890,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,880,000,000.00	8,185,218,560.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,450,000,000.00	3,276,682,350.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,330,000,000.00	1,407,805,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,317,903,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,400,000,000.00	1,548,541,400.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,300,000,000.00	3,324,103,200.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,500,000,000.00	3,865,329,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,280,000,000.00	4,327,080,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,600,000,000.00	3,649,968,000.00	
銘柄数：14	43,360,000,000.00	45,124,969,770.00	(392,587,236)	
組入時価比率：9.9%			10.2%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,980,000.00	2,905,273.22	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,340,000.00	3,152,199.48	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,300,000.00	3,155,915.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,800,000.00	6,378,759.96	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	5,378,743.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,160,000.00	5,007,464.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,000,000.00	936,216.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,700,000.00	2,628,169.57	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,700,000.00	4,192,870.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,450,000.00	4,571,881.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000.00	5,368,322.68	
小計	銘柄数：11	49,330,000.00	43,675,816.21	
			(362,946,032)	
	組入時価比率：9.2%		9.4%	
合計			3,846,438,361	
			(3,846,438,361)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	平成28年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	36,542,200	-	36,292,258	249,942
米ドル	36,542,200	-	36,292,258	249,942
売建	88,241,464	-	87,987,600	253,864
米ドル	51,699,264	-	51,480,000	219,264
トルコリラ	10,026,000	-	9,993,000	33,000
フォリント	12,611,200	-	12,649,600	38,400
ズロチ	13,905,000	-	13,865,000	40,000
合計	-	-	-	3,922

(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29年 1月31日現在

資産総額	56,842,037円
負債総額	57,796円
純資産総額（ - ）	56,784,241円
発行済口数	54,115,703口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0493円

## 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

平成29年 1月31日現在

資産総額	11,153,994円
負債総額	11,157円
純資産総額（ - ）	11,142,837円
発行済口数	10,653,912口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0459円

## 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

平成29年 1月31日現在

資産総額	7,781,870円
負債総額	7,683円
純資産総額（ - ）	7,774,187円
発行済口数	7,468,460口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0409円

## 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

平成29年 1月31日現在

資産総額	7,145,064円
負債総額	7,624円
純資産総額（ - ）	7,137,440円
発行済口数	6,903,931口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0338円

## （参考）国内株式マザーファンド

平成29年 1月31日現在

資産総額	363,634,175,493円
負債総額	44,793,386,069円
純資産総額（ - ）	318,840,789,424円
発行済口数	222,118,952,247口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4355円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

平成29年 1月31日現在

資産総額	351,212,037,876円
負債総額	1,291,058,808円
純資産総額（ - ）	349,920,979,068円
発行済口数	156,054,392,738口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2423円

## （参考）新興国株式マザーファンド

平成29年 1月31日現在

資産総額	18,574,303,652円
負債総額	113,372,994円
純資産総額（ - ）	18,460,930,658円
発行済口数	17,320,688,766口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0658円

## （参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

平成29年 1月31日現在

資産総額	690,752,435,819円
負債総額	9,589,456,969円
純資産総額（ - ）	681,162,978,850円
発行済口数	525,276,722,898口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2968円

## （参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

平成29年 1月31日現在

資産総額	25,116,006,799円
負債総額	13,207,506,733円
純資産総額（ - ）	11,908,500,066円
発行済口数	10,705,032,661口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1124円

## （参考）外国債券マザーファンド

平成29年 1月31日現在

資産総額	652,652,148,962円
負債総額	819,943,390円
純資産総額（ - ）	651,832,205,572円
発行済口数	302,108,867,158口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1576円

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

平成29年 1月31日現在

資産総額	4,082,387,561円
負債総額	17,804,439円
純資産総額（ - ）	4,064,583,122円
発行済口数	3,253,592,396口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2493円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 受益権の譲渡

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

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

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

#### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### (5) 受益権の再分割

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

#### (6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額

平成29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28年12月30日現在次の通りです（ただし、親投資信託を除きます。）。

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	938	20,027,932
単位型株式投資信託	67	311,767
追加型公社債投資信託	15	6,008,627
単位型公社債投資信託	316	1,931,751
合計	1,336	28,280,077

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

#### (1)【貸借対照表】

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

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

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



その他利益剰余金		60,497		68,011
別途積立金		24,606		24,606
繰越利益剰余金		35,890		43,405
評価・換算差額等			6,893	5,349
その他有価証券評価差額金			6,893	5,349
純資産合計			96,985	104,956
負債・純資産合計			130,903	135,799

## (2) 【損益計算書】

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

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

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金

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

(単位：百万円)

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

## [重要な会計方針]

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

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

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

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

## 損益計算書関係

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

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

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

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

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## （２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## ２．金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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



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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬

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

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### （1）金融商品に対する取組方針

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

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

### （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

    その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

#### 有価証券関係

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

##### 1．売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

##### 2．満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

##### 3．子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

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

##### 4．その他有価証券(平成27年3月31日)

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

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

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

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

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

## 当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(平成28年3月31日)

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

## 4．その他有価証券(平成28年3月31日)

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

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

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

## 退職給付関係

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

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

## 及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	15,775 百万円
年金資産	15,764
	11
非積立型制度の退職給付債務	2,917
未積立退職給付債務	2,928
未認識数理計算上の差異	3,409
未認識過去勤務費用	411
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69
退職給付引当金	2,708
前払年金費用	2,777
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	811 百万円
利息費用	181
期待運用収益	402
数理計算上の差異の費用処理額	314
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	863

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	43%
株式	43%
生保一般勘定	13%
その他	1%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、191百万円でした。

## 税効果会計関係

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



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

## 企業結合等関係

## 1. 会社分割について

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

## (1) 企業結合の概要

### 会社分割の目的

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

### 会社分割日程

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

### 会社分割の方法

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

## (2) 実施した会計処理の概要

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

## 2. 吸収合併について

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

## (1) 企業結合の概要

### 吸収合併の目的

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

### 吸収合併日程

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

### 吸収合併の方法

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

## (2) 実施した会計処理の概要

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

### セグメント情報等

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

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

品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## （２）地域ごとの情報

### 売上高

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

### 有形固定資産

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

## （３）主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

### （１）製品・サービスごとの情報

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

### （２）地域ごとの情報

#### 売上高

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

#### 有形固定資産

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

### （３）主要な顧客ごとの情報

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

## 関連当事者情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### （ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

### （イ）子会社等

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

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

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

(百万円)

(株)野村総合研究所

流動資産合計 229,418

固定資産合計 273,220

流動負債合計 87,832

固定負債合計 65,965

380/400

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

### (イ) 子会社等

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

### (ウ) 兄弟会社等

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

### (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

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

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

### 1株当たり情報

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

### 中間財務諸表

#### 中間貸借対照表

		平成28年9月30日現在
--	--	--------------

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

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

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

## 中間損益計算書

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

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本							株主 資本 合計	
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			利益 剰余金 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越 利益 剰余金		



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

(単位:百万円)

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

## [重要な会計方針]

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

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

## [会計方針の変更]

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

なお、当中間会計期間において、中間財務諸表に与える影響額は軽微であります。

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

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

## 中間損益計算書関係

自 平成28年4月1日	至 平成28年9月30日
-------------	--------------

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

## 中間株主資本等変動計算書関係

自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日				
1	発行済株式に関する事項			
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少
	普通株式	5,150,693株	-	-
				当中間会計期間末 5,150,693株
2	配当に関する事項			
	配当金支払額			
	平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。			
	・普通株式の配当に関する事項			
	(1) 配当金の総額		34,973百万円	
	(2) 1株当たり配当額		6,790円	
	(3) 基準日		平成28年3月31日	
	(4) 効力発生日		平成28年6月24日	

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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

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

## 有価証券関係

当中間会計期間末（平成28年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(平成28年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(平成28年9月30日)

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

## 3．その他有価証券(平成28年9月30日)

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

## セグメント情報等

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

## 1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 1 株当たり情報

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

## [ 重要な後発事象 ]

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

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

## 1. 配当財産の種類及び帳簿価額

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

## 2. 剰余金の配当効力発生日

平成28年10月27日（木）

## 3. 配当原資

利益剰余金

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

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

\* 平成28年12月末現在

#### (2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
------------	-----------	--------------------

\* 平成28年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・連絡等を行いません。

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

### (1) 受託者

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間における提出書類はありません。



## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月6日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

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

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

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

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

平成29年2月17日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型の平成28年4月1日から平成28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28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29年2月17日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型の平成28年4月1日から平成28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28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29年2月17日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型の平成28年4月1日から平成28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28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29年2月17日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型の平成28年4月1日から平成28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28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28年11月21日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

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

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

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

#### 中間監査意見

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

#### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。