

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成28年5月13日
【計算期間】 第14期
(自 平成27年2月17日 至 平成28年2月15日)
【ファンド名】 D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 >
【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】 上野 圭子
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【電話番号】 03-3287-3110
【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】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

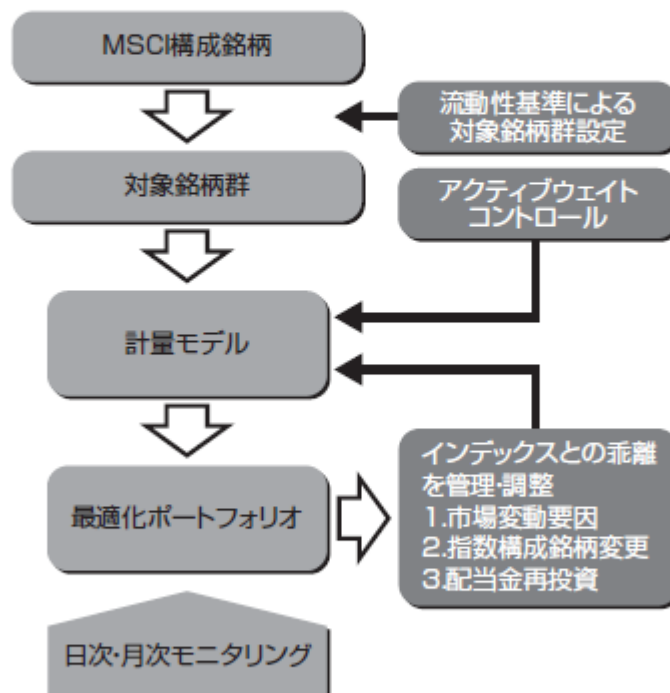
当ファンドの信託金の限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

ファンドの特色

- 1** 主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドに投資を行い、「MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）」^(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

(注)MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.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。

- 2** 流動性を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。



- 3** 株式への実質投資割合は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

- 4** 実質組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

分配方針

年1回の決算時(毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日。))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは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います。

投資対象地域

「海外」とは目論見書また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います。

投資対象資産

「株式」とは目論見書また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います。

補足分類

「インデックス型」とは目論見書また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めざす旨の記載があるものをいいます。

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 (日本を除く) 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 ()	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式))	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 (MSCIコクサイ ・インデックス (円換算ベース、 配当込み、為替 ヘッジなし))
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

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。

(注)当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（株式））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

(注)商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（株式））に分類されます。

決算頻度

「年1回」とは目論見書また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います。

投資対象地域

「グローバル（日本を除く）」とは目論見書また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世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態

「ファミリーファンド」とは目論見書また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います。

為替ヘッジ

「なし」とは目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

対象インデックス

「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

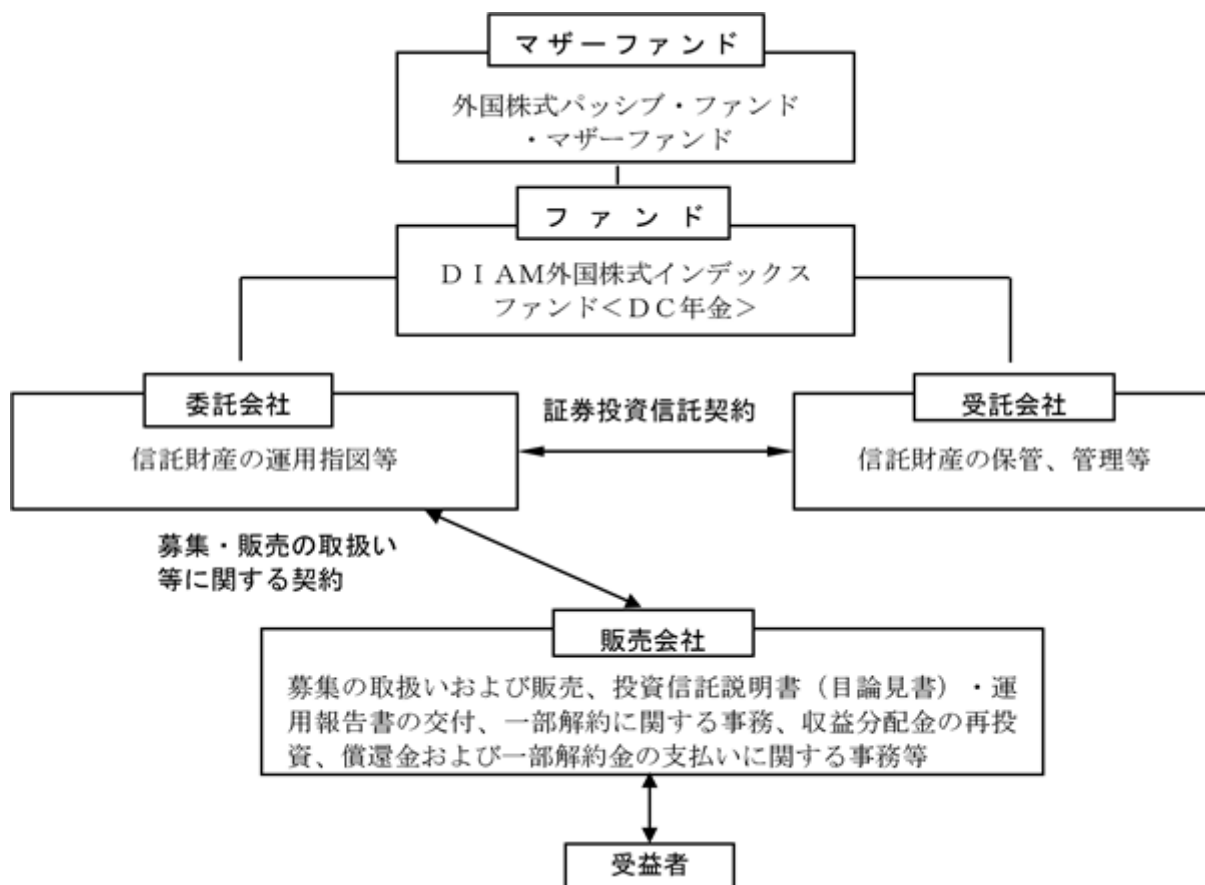
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

平成14年9月5日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



委託会社：D I A Mアセットマネジメント株式会社

当ファンドの委託会社として信託財産の運用の指図、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の作成等を行います。

受託会社：みずほ信託銀行株式会社

当ファンドの信託財産の保管・管理業務等を行います。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

販売会社

当ファンドの募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の支払いに関する事務等を行います。

・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

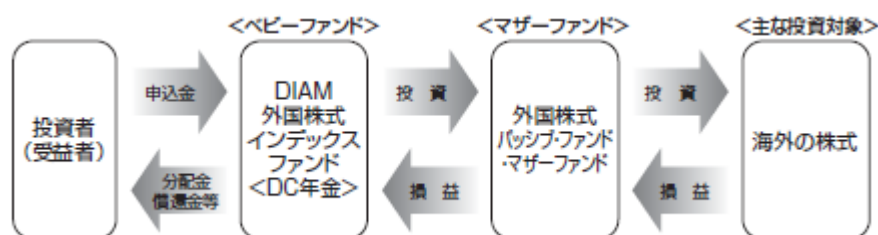
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行います。



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成28年2月29日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日 会社設立
平成10年3月31日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成28年2月29日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

<投資対象>

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

- 1)主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2)株式への実質投資割合は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3)実質組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1)ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>をご参照ください。

（２）【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1) 株券

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が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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（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（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)～11)の証券または証書の性質を有するもの

13) 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。）

14) 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、有価証券に係るものに限ります。）

15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

18) 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。)

19) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1)、12)ならびに15)の証券または証書のうち1)の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および12)ならびに15)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

委託会社は、信託金を、上記2.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(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

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5)の権利の性質を有するもの

4. 金融商品の指図範囲(約款第16条第3項)

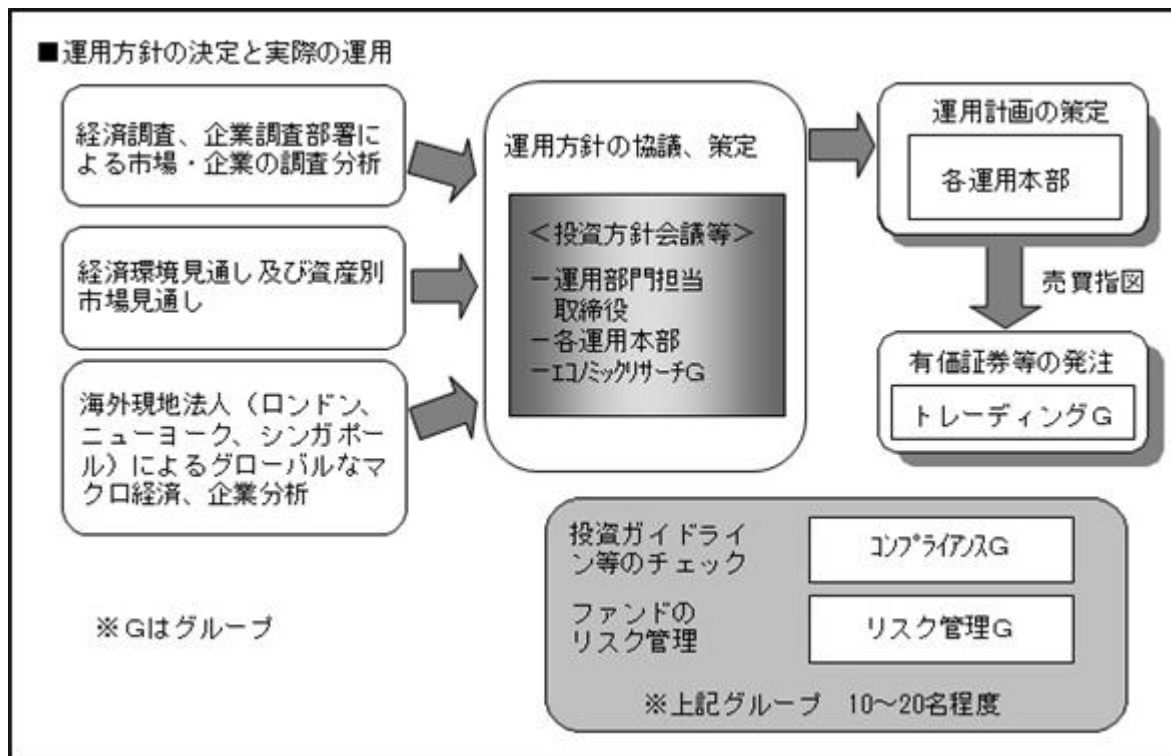
上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに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（以下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め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部の運用担当者、エコミックリサーチグループ等で構成される「投資方針会議」にて協議、策定致します。

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等から得られた情報も参考にされます。

国内債券の発注は、債券運用本部で執行されます。それ以外の個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年2月15日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

留保金の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配方式

- a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。
- 1) 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下、「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の配当金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - 2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、別に定める契約に基づき、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する。）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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。

（５）【投資制限】

- 1) 株式への実質投資割合（約款「運用の基本方針」（３）投資制限）
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（約款「運用の基本方針」（３）投資制限）
新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 同一銘柄の転換社債等への実質投資割合（約款「運用の基本方針」（３）投資制限）
同一銘柄の転換社債、ならびに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（以下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め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合（約款「運用の基本方針」（３）投資制限）
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

5) 投資する株式等の範囲（約款第18条）

- a. 委託会社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、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。
- b. 上記a.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会社が投資することを指図することができるものとします。

6) 信用取引の指図範囲（約款第20条）

- a. 委託会社は、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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a.の信用取引の指図は、次の1.～6.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うことができるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、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（5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

7) 先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第21条）

- a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行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て取扱うものとします（以下同じ。）。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマ

ザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

b. 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに別に定める外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲内で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

c. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金

等ならびに上記（２）投資対象3．金融商品の指図範囲1）～4）に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

2．先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記（２）投資対象3．金融商品の指図範囲1）～4）に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3．コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本項で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

8) スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第22条）

- a．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- b．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。
- c．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- d．上記c．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- e．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基に算出した価額で評価するものとします。

f. 委託会社は、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。

9) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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。

b. 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、原則として当ファンドの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。

c. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

d. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

e. 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。

f. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行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うものとします。

10) デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第23条の2）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、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ないものとします。

11) 有価証券の貸付けの指図および範囲（約款第24条）

a. 委託会社は、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1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1) 株式の貸付けは、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を超えないものとします。

b. 上記a. 1)～2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、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。

c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

12) 特別の場合の外貨建資産への投資制限（約款第25条）

外貨建有価証券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。

13) 外貨為替予約の指図（約款第26条）

- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- b. 上記a.の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、原則として信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- c. 上記b.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

14) 資金の借入れ（約款第33条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、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わないものとします。
- b. 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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または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。
- c. 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。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

15) 同一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）

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き、為替変動等により影響を受けますが、運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

株価変動リスク

当ファンドでは実質的に株式に投資します。株式の価格は一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

為替リスク

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがって、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に大きく影響します。

信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

< 分配金に関する留意点 >

収益分配は、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売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、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すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は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。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

< その他の留意点 >

当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。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流出入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額とMS

CIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）が乖離する場合があります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

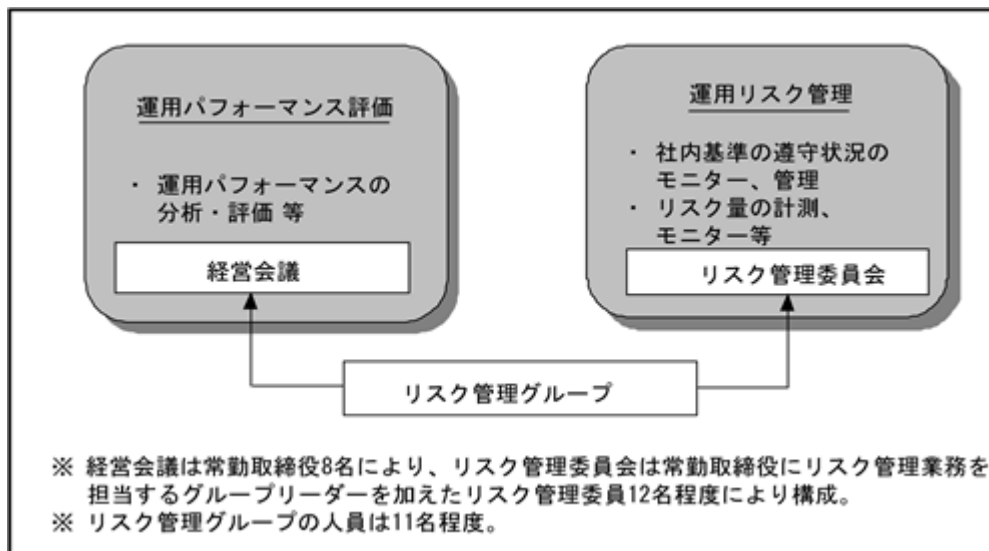
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<運用評価・運用リスク管理体制>

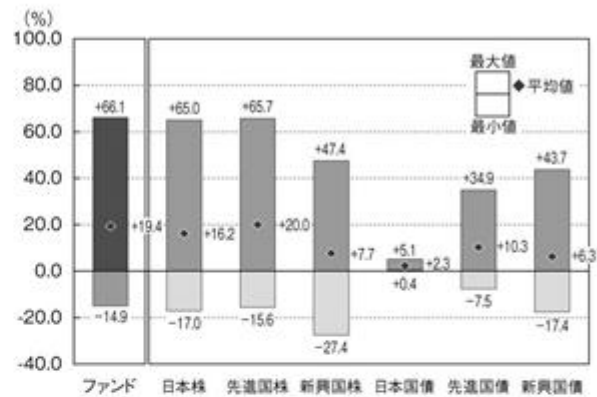


運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

運用リスク管理は、リスク管理グループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行います。また運用リスク管理の結果については月次で「リスク管理委員会」に報告致します。

上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

2011年3月～2016年2月

- * ファンドの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基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- * ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

- * 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- * 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 - 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 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、円ベース)
 - 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数(TOPIX)」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コクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.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」は、野村證券株式会社が公表している指数で、そ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、対象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、対象インデックスを用いて行われる事業活動・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」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.27%（税抜0.25%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.11%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.11%	購入後の情報提供、交付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等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

収益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%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、平成28年4月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

収益分配金には、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）の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	85,711,950,343	100.00
内 日本	85,711,950,343	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,815,550	0.00
純資産総額	85,708,134,793	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	243,349,551,835	95.98
内 アメリカ	149,347,831,545	58.90
内 イギリス	18,913,573,335	7.46
内 スイス	10,366,297,599	4.09
内 フランス	9,238,418,698	3.64
内 ドイツ	9,043,690,795	3.57
内 カナダ	8,926,291,199	3.52
内 オーストラリア	6,095,914,811	2.40
内 アイルランド	4,589,052,218	1.81
内 オランダ	4,242,125,943	1.67
内 スペイン	3,147,442,433	1.24
内 スウェーデン	2,953,244,512	1.16
内 香港	2,268,498,658	0.89
内 イタリア	1,992,557,058	0.79
内 デンマーク	1,990,907,787	0.79
内 シンガポール	1,536,237,346	0.61
内 ベルギー	1,454,373,690	0.57
内 ジャージー	1,345,569,093	0.53
内 フィンランド	1,036,618,818	0.41
内 オランダ領キュラソー	861,140,751	0.34
内 バミューダ	856,307,885	0.34
内 イスラエル	729,358,878	0.29
内 ケイマン諸島	623,687,853	0.25
内 ノルウェー	597,535,410	0.24
内 ルクセンブルグ	200,812,387	0.08
内 パナマ	178,348,914	0.07
内 オーストリア	164,833,150	0.07
内 ポルトガル	155,161,233	0.06
内 ニュージーランド	145,261,545	0.06
内 リベリア	129,632,814	0.05
内 イギリス領バージン諸島	106,522,226	0.04

	内 パプアニューギニア	55,585,314	0.02
	内 マン島	35,798,006	0.01
	内 モーリシャス	20,919,931	0.01
投資信託受益証券		800,893,292	0.32
	内 オーストラリア	663,373,138	0.26
	内 シンガポール	137,520,154	0.05
投資証券		5,743,683,136	2.27
	内 アメリカ	4,828,075,289	1.90
	内 フランス	411,129,098	0.16
	内 イギリス	344,289,471	0.14
	内 香港	109,578,727	0.04
	内 カナダ	50,610,551	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,647,980,318	1.44
純資産総額		253,542,108,581	100.00

その他資産の投資状況

平成28年2月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	1,405,825,000	0.55
-	1,405,825,000	0.55
株価指数先物取引（買建）	3,775,792,172	1.49
内 アメリカ	2,538,390,101	1.00
内 ドイツ	694,556,793	0.27
内 イギリス	296,893,696	0.12
内 カナダ	137,917,736	0.05
内 オーストラリア	108,033,846	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

（注4）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	34,295,754,779	2.3910 82,002,780,622	2.4992 85,711,950,343	- -	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年2月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	457,288	10,679.14 4,883,444,310	11,010.91 5,035,158,932	- -	1.99%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	608,817	5,737.80 3,493,276,270	5,828.70 3,548,615,300	- -	1.40%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	336,451	9,206.62 3,097,579,399	9,288.43 3,125,103,244	- -	1.23%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	220,226	11,568.78 2,547,747,994	12,018.72 2,646,835,423	- -	1.04%
5	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	759,442	3,210.90 2,438,493,229	3,340.42 2,536,861,321	- -	1.00%
6	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	389,402	5,375.36 2,093,176,791	5,461.71 2,126,802,121	- -	0.84%
7	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	171,240	11,590.37 1,984,736,020	12,261.87 2,099,722,687	- -	0.83%
8	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	487,453	4,143.72 2,019,869,427	4,218.71 2,056,423,138	- -	0.81%
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	254,437	8,193.00 2,084,603,613	8,027.77 2,042,563,623	- -	0.81%
10	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	31,822	57,614.42 1,833,406,378	63,085.23 2,007,498,271	- -	0.79%
11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	25,028	77,534.28 1,940,528,160	80,110.05 2,004,994,416	- -	0.79%
12	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	214,929	9,202.08 1,977,794,669	9,214.58 1,980,480,894	- -	0.78%
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	297,973	6,532.01 1,946,363,748	6,537.69 1,948,056,532	- -	0.77%
14	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	22,941	80,316.84 1,842,548,667	82,358.59 1,889,388,486	- -	0.75%
15	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	324,572	5,693.49 1,847,950,097	5,796.89 1,881,508,960	- -	0.74%

16	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	493,340	3,335.88 1,645,724,617	3,434.73 1,694,490,980	- -	0.67%
17	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	56,244	27,837.98 1,565,719,628	29,638.39 1,666,981,888	- -	0.66%
18	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	326,767	4,898.15 1,600,556,460	4,901.56 1,601,670,278	- -	0.63%
19	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	182,822	8,079.05 1,477,028,993	8,210.09 1,500,986,445	- -	0.59%
20	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	153,214	9,706.55 1,487,180,362	9,583.84 1,468,379,534	- -	0.58%
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	101,869	13,216.27 1,346,329,064	14,345.66 1,461,378,160	- -	0.58%
22	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	94,741	14,551.31 1,378,605,982	14,988.75 1,420,049,201	- -	0.56%
23	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	128,615	10,356.46 1,331,996,488	10,829.12 1,392,787,551	- -	0.55%
24	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	199,126	6,451.34 1,284,630,245	6,579.73 1,310,196,152	- -	0.52%
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	383,404	3,254.07 1,247,626,061	3,385.87 1,298,158,401	- -	0.51%
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	225,258	5,570.78 1,254,864,698	5,753.71 1,296,070,738	- -	0.51%
27	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	115,738	11,190.43 1,295,158,427	11,175.66 1,293,448,907	- -	0.51%
28	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	155,937	8,001.12 1,247,670,711	8,263.58 1,288,598,279	- -	0.51%
29	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	123,555	10,118.99 1,250,252,699	10,390.54 1,283,804,281	- -	0.51%
30	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	408,218	2,852.99 1,164,645,219	3,000.70 1,224,941,467	- -	0.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年2月29日現在

種類	投資比率
株式	95.98%
投資信託受益証券	0.32%
投資証券	2.27%
合計	98.56%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年2月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	8.19%
医薬品		6.96%
石油・ガス・消耗燃料		5.90%
保険		4.18%
ソフトウェア		3.26%
メディア		3.05%
各種電気通信サービス		2.99%
インターネットソフトウェア・サービス		2.75%
情報技術サービス		2.59%
化学		2.58%
飲料		2.52%
バイオテクノロジー		2.47%
コンピュータ・周辺機器		2.47%
食品		2.42%
食品・生活必需品小売り		2.24%
コングロマリット		2.12%
航空宇宙・防衛		2.08%
専門小売り		2.03%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.95%
ホテル・レストラン・レジャー		1.88%
資本市場		1.81%
電力		1.78%
ヘルスケア機器・用品		1.69%
半導体・半導体製造装置		1.68%
タバコ		1.66%
家庭用品		1.62%
各種金融サービス		1.42%
繊維・アパレル・贅沢品		1.32%
機械		1.32%
総合公益事業		1.31%
インターネット販売・カタログ販売		1.28%
通信機器		1.18%
金属・鉱業		1.07%
自動車		0.98%
陸運・鉄道		0.81%
エネルギー設備・サービス		0.74%
パーソナル用品		0.73%
電気設備		0.72%

不動産管理・開発	0.63%
航空貨物・物流サービス	0.58%
複合小売り	0.57%
自動車部品	0.57%
消費者金融	0.53%
専門サービス	0.49%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.45%
家庭用耐久財	0.45%
商業サービス・用品	0.42%
無線通信サービス	0.40%
電子装置・機器・部品	0.40%
建設・土木	0.32%
商社・流通業	0.32%
建設資材	0.31%
容器・包装	0.29%
建設関連製品	0.25%
運送インフラ	0.25%
旅客航空輸送業	0.18%
ガス	0.18%
販売	0.10%
水道	0.09%
レジャー用品	0.09%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
海運業	0.07%
紙製品・林産品	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.03%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年2月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2016年03月	買建	8,350,000	945,072,470	948,643,500	0.37%
		ユーロ買/円売201 6年03月	買建	2,020,000	251,595,546	250,682,000	0.10%
		イギリス・ポンド買/ 円売2016年03月	買建	700,000	110,458,838	110,257,000	0.04%
		オーストラリア・ドル 買/円売2016年0 3月	買建	630,000	51,434,202	50,990,500	0.02%
		カナダ・ドル買/円売 2016年03月	買建	540,000	45,121,190	45,252,000	0.02%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S & P 500 F U T U R E M a r 1 6	買建	46	2,478,770,846	2,538,390,101	1.00%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 M a r 1 6	買建	191	664,908,155	694,556,793	0.27%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E M a r 1 6	買建	31	283,339,887	296,893,696	0.12%
	モン トリ オール取引 所	S & P / T S E 6 0 I X F U T M a r 1 6	買建	11	136,305,231	137,917,736	0.05%
	シドニー先 物取引所	S P I 2 0 0 F U T U R E S M a r 1 6	買建	11	105,093,337	108,033,846	0.04%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(注3) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成28年2月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (平成19年2月15日)	18,263	18,263	2.1052	2.1052
第6計算期間末 (平成20年2月15日)	23,584	23,584	1.8342	1.8342
第7計算期間末 (平成21年2月16日)	15,060	15,060	0.9062	0.9062
第8計算期間末 (平成22年2月15日)	28,396	28,396	1.2246	1.2246
第9計算期間末 (平成23年2月15日)	39,647	39,647	1.4110	1.4110
第10計算期間末 (平成24年2月15日)	41,707	41,707	1.3008	1.3008
第11計算期間末 (平成25年2月15日)	60,080	60,080	1.7592	1.7592
第12計算期間末 (平成26年2月17日)	75,426	75,426	2.3012	2.3012
第13計算期間末 (平成27年2月16日)	98,769	98,769	2.9168	2.9168
第14計算期間末 (平成28年2月15日)	82,214	82,214	2.4126	2.4126
平成27年2月末日	100,703	-	2.9634	-
3月末日	100,847	-	2.9576	-
4月末日	101,382	-	2.9852	-
5月末日	105,694	-	3.1184	-
6月末日	101,588	-	2.9938	-
7月末日	103,757	-	3.0776	-
8月末日	94,682	-	2.8328	-
9月末日	88,928	-	2.6391	-
10月末日	98,965	-	2.9269	-
11月末日	99,532	-	2.9583	-
12月末日	97,602	-	2.8880	-
平成28年1月末日	89,592	-	2.6318	-
2月末日	85,708	-	2.5216	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第5計算期間	24.6
第6計算期間	12.9
第7計算期間	50.6
第8計算期間	35.1
第9計算期間	15.2
第10計算期間	7.8
第11計算期間	35.2
第12計算期間	30.8
第13計算期間	26.8
第14計算期間	17.3

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、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を乗じた数です。

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】

	設定口数	解約口数
第5計算期間	4,975,421,798	1,299,730,296
第6計算期間	7,585,114,440	3,402,164,832
第7計算期間	6,532,134,419	2,772,322,990
第8計算期間	9,353,757,517	2,783,451,128
第9計算期間	8,936,687,787	4,025,800,144
第10計算期間	9,290,705,463	5,326,900,557
第11計算期間	8,170,299,501	6,081,641,525
第12計算期間	8,496,275,034	9,870,472,114
第13計算期間	8,954,460,215	7,869,839,615
第14計算期間	7,855,082,565	7,640,340,280

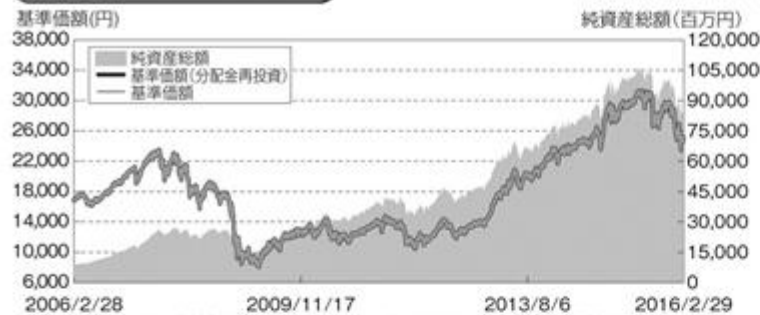
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年2月29日

基準価額・純資産の推移

(2006年2月28日～2016年2月29日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年9月5日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第10期	(2012.02.15)	0円
第11期	(2013.02.15)	0円
第12期	(2014.02.17)	0円
第13期	(2015.02.16)	0円
第14期	(2016.02.15)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 (注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	投資比率
1	外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド	100.00%

■外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.98
内 アメリカ	58.90
内 イギリス	7.46
内 スイス	4.09
内 フランス	3.64
内 ドイツ	3.57
内 その他	18.32
投資信託受益証券	0.32
内 オーストラリア	0.26
内 シンガポール	0.05
投資証券	2.27
内 アメリカ	1.90
内 フランス	0.16
内 イギリス	0.14
内 香港	0.04
内 カナダ	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.44
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	1.99%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.40%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.23%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.04%
5	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	1.00%
6	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.84%
7	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	0.83%
8	AT&T INC	株式	アメリカ	各種電気通信サービス	0.81%
9	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.81%
10	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・カタログ販売	0.79%

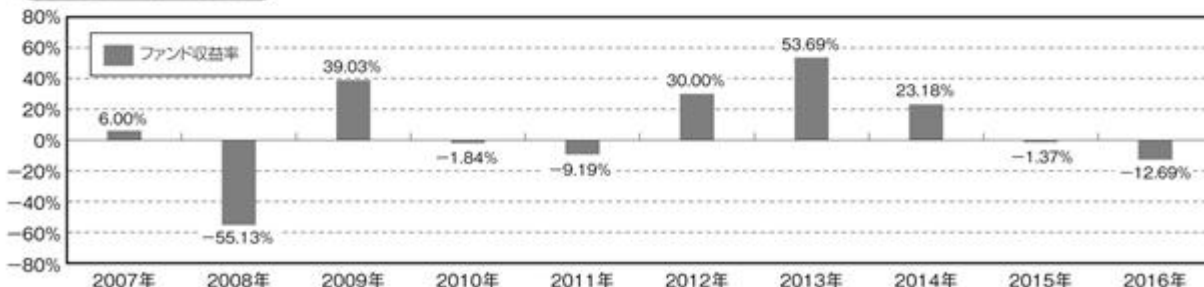
その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.55
株価指数先物取引(買建)	1.49

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	8.19%
2	医薬品	6.96%
3	石油・ガス・消耗燃料	5.90%
4	保険	4.18%
5	ソフトウェア	3.26%

年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度による取得のみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。
なお、販売会社によっては、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、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
なお、ニューヨーク証券取引所、またはロンドン証券取引所の休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）は、お申込みの受付を行いません。
- ・委託会社は、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、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

お申込価額（発行価格）

- ・お申込日の翌営業日の基準価額 とします。
収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。
「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当たり換算した基準価額で表示することがあります。）

- ・基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

お申込手数料

ありません。

払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

受益者が解約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うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

委託会社は、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、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用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）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
外国株式	原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。 外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

コールセンター：0120-506-860（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（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】

信託期間は平成14年9月5日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年2月16日から翌年2月15日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、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。

（５）【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、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、委託会社は、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. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、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、委託会社は、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。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.～f.の規定は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d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より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。
- i. 委託会社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、委託会社は、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会社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、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- j. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 上記 d. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、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、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。
- b. 委託会社は上記a.のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定にしたがいます。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。
- h. 上記b.に該当しない場合の約款変更のお知らせは、当ファンドの決算時に作成しております「運用報告書」にてお知らせいたします。

八. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <http://www.diam.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て行います。

ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年2月15日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金受領権

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、別に定める契約に基づき、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ます。）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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。

償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の
閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第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)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14期計算期間(平成27年2月17日から平成28年2月15日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 平成27年2月16日現在	第14期 平成28年2月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	338,352,241	298,620,124
親投資信託受益証券	98,768,320,936	82,211,069,336
未収入金	40,863,000	57,758,000
流動資産合計	99,147,536,177	82,567,447,460
資産合計		
99,147,536,177		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	249,509,641	224,257,340
未払受託者報酬	14,993,232	15,213,265
未払委託者報酬	109,950,650	111,564,306
その他未払費用	3,560,809	2,408,692
流動負債合計	378,014,332	353,443,603
負債合計		
378,014,332		
純資産の部		
元本等		
元本	1 33,862,334,883	1 34,077,077,168
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	64,907,186,962	48,136,926,689
（分配準備積立金）	38,327,909,054	30,568,008,373
元本等合計	98,769,521,845	82,214,003,857
純資産合計		
98,769,521,845		
負債純資産合計		
99,147,536,177		

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第13期		第14期	
	自	平成26年2月18日 平成27年2月16日	自	平成27年2月17日 平成28年2月15日
営業収益				
受取利息		151,107		172,112
有価証券売買等損益		20,879,757,999		16,864,711,600
営業収益合計		20,879,909,106		16,864,539,488
営業費用				
受託者報酬		27,518,929		31,703,773
委託者報酬		201,806,070		232,495,103
その他費用		6,535,585		6,099,910
営業費用合計		235,860,584		270,298,786
営業利益又は営業損失（ ）		20,644,048,522		17,134,838,274
経常利益又は経常損失（ ）		20,644,048,522		17,134,838,274
当期純利益又は当期純損失（ ）		20,644,048,522		17,134,838,274
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（ ）		1,946,060,484		130,026,011
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		42,649,057,324		64,907,186,962
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,964,732,229		14,911,711,307
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,964,732,229		14,911,711,307
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,404,590,629		14,677,159,317
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,404,590,629		14,677,159,317
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		64,907,186,962		48,136,926,689

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月15日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成27年2月16日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 平成27年2月16日現在	第14期 平成28年2月15日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	32,777,714,283円 8,954,460,215円 7,869,839,615円	33,862,334,883円 7,855,082,565円 7,640,340,280円
2 . 受益権の総数	33,862,334,883口	34,077,077,168口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期 自 平成26年2月18日 至 平成27年2月16日	第14期 自 平成27年2月17日 至 平成28年2月15日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（145,260円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（18,697,842,778円）、信託約款に規定される収益調整金（34,488,779,800円）及び分配準備積立金（19,629,921,016円）より分配対象収益は72,816,688,854円（1万口当たり21,503.74円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（42,710,450,304円）及び分配準備積立金（30,568,008,373円）より分配対象収益は73,278,458,677円（1万口当たり21,503.74円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第13期 自 平成26年2月18日 至 平成27年2月16日	第14期 自 平成27年2月17日 至 平成28年2月15日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、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。	同左
2． 金融商品の内容及び当該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、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、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等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 平成27年2月16日現在	第14期 平成28年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 平成27年2月16日現在	第14期 平成28年2月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	20,201,683,912	16,809,550,576
合計	20,201,683,912	16,809,550,576

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第13期 平成27年2月16日現在	第14期 平成28年2月15日現在
1口当たり純資産額	2.9168円	2.4126円
（1万口当たり純資産額）	(29,168円)	(24,126円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成28年2月15日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	34,384,988,639	82,211,069,336	
親投資信託受益証券	合計	34,384,988,639	82,211,069,336	
合計		34,384,988,639	82,211,069,336	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「外国株式パッシブ・ファンド・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あります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

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。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年2月16日現在	平成28年2月15日現在
資産の部			
流動資産			
預金		8,695,089,822	1,564,287,670
コール・ローン		355,928,823	602,874,620
株式		300,406,254,682	233,333,927,515
投資信託受益証券		932,289,554	769,684,591
投資証券		6,666,041,467	5,445,024,478
派生商品評価勘定		294,872,546	1,341,973
未収入金		18,444	14,841,207
未収配当金		444,615,935	341,694,398
差入委託証拠金		1,800,879,416	1,552,922,728
流動資産合計		319,595,990,689	243,626,599,180
資産合計		319,595,990,689	243,626,599,180
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	114,585,222
未払解約金		398,736,000	817,273,000
流動負債合計		398,736,000	931,858,222
負債合計		398,736,000	931,858,222
純資産の部			
元本等			
元本	1	110,732,995,447	101,509,653,233
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		208,464,259,242	141,185,087,725
元本等合計		319,197,254,689	242,694,740,958
純資産合計		319,197,254,689	242,694,740,958
負債純資産合計		319,595,990,689	243,626,599,180

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>先物取引 個別法に基づき、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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 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>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年2月16日現在	平成28年2月15日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	137,380,187,202円	110,732,995,447円
同期中追加設定元本額	10,102,645,885円	20,622,953,893円
同期中一部解約元本額	36,749,837,640円	29,846,296,107円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	973,154,815円	1,392,775,345円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	5,067,406円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	10,330,738円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	24,590,871円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	12,074,361円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	8,743,829円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	9,184,637円
たわらノーロード 先進国株式	- 円	708,548,184円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	34,263,623,443円	34,384,988,639円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	145,630,156円	156,636,797円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	828,101,362円	867,907,515円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	1,051,813,641円	1,060,659,656円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	140,375,493円	140,986,314円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	403,472,656円	406,671,520円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	323,794,483円	338,651,848円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	50,894,655円	43,158,141円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	797,824,206円	872,925,665円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	217,042,697円	243,924,223円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	12,141,369円	19,784,452円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	23,320,309円	38,998,777円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	58,619,745円	83,633,667円
投資のソムリエ	145,955,142円	477,923,774円
クルーズコントロール	183,875,871円	116,268,511円
投資のソムリエ< D C年金>	2,100,968円	8,615,916円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	25,258,882円	60,602,702円
D I A M D C バランス・F（成長型）	2,351,445円	20,975,704円

クルーズコントロール<DC年金>	53,723円	29,118円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	- 円	1,060,414円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	- 円	1,885,928円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	- 円	345,620円
D I A M外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	355,274,840円	246,314,667円
D I A M外国株式バシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	3,393,035,024円	3,399,475,875円
D I A Mアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	- 円	162,878,042円
D I A Mワールドバランス25V A (適格機関投資家限定)	41,036,078円	38,663,574円
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	1,550,714,989円	407,193,641円
D I A Mグローバル・バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	444,102,668円	379,427,377円
D I A M国際分散バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	49,749,289円	31,934,300円
D I A M国際分散バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	315,393,011円	198,593,205円
D I A M国内重視バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	22,081,415円	15,892,717円
D I A M国内重視バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	54,750,066円	30,800,758円
D I A M世界バランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	7,336,302,589円	4,197,174,605円
D I A M世界バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	3,863,283,091円	2,396,381,985円
D I A Mバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	1,404,687,172円	1,063,024,299円
D I A Mバランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定)	1,264,926,963円	1,116,721,442円
D I A Mバランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	3,651,391,136円	3,307,612,512円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	1,549,518,854円	1,277,927,291円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	2,513,938,189円	2,032,885,578円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	1,805,099,122円	1,594,950,129円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	1,334,876,713円	1,075,715,744円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	25,693,500円	12,333,699円
D I A M世界バランスファンド55V A (適格機関投資家限定)	6,363,628,305円	4,770,232,908円
D I A M世界バランスファンド35V A (適格機関投資家限定)	1,850,290,073円	1,737,870,621円

D I A Mグローバル分散ファンドV A (適格機関投資家限定)	48,192,540円	- 円
D I A M世界アセットバランスファンド 2 V A (適格機関投資家限定)	11,638,068,609円	11,129,004,178円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限定)	725,999,572円	633,720,005円
D I A M世界アセットバランスファンド 2 5 V A (適格機関投資家限定)	2,003,564,272円	1,907,460,150円
D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A (適格機関投資家限定)	7,305,136,593円	7,091,899,432円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投 資家限定)	138,291円	17,738,254円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投 資家限定)	31,289,480円	22,620,054円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投 資家限定)	127,498,395円	17,318,549円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定)	9,780,695,512円	9,556,343,224円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投 資家限定)	3,743,916円	92,569,470円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投 資家限定)	229,228,270円	28,741,863円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投 資家限定)	261,849円	282,813円
計	110,732,995,447円	101,509,653,233円
2 . 受益権の総数	110,732,995,447口	101,509,653,233口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年2月18日 至 平成27年2月16日	自 平成27年2月17日 至 平成28年2月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、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。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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、価格変動リスク、為替変動リスク、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等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成27年2月16日現在	平成28年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)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>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年2月16日現在	平成28年2月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	30,558,561,318	35,230,616,265
投資信託受益証券	218,282,510	40,748,574
投資証券	1,233,779,246	779,937,867
合計	32,010,623,074	36,051,302,706

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年2月16日 現在				平成28年2月15日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	318,138,310	-	317,918,000	220,310	412,093,874	-	413,802,400	1,708,526
アメリカ・ドル	189,872,390	-	189,728,000	144,390	263,962,756	-	265,168,800	1,206,044
イギリス・ポンド	36,629,440	-	36,556,000	73,440	50,741,324	-	50,995,000	253,676
オーストラリア・ドル	18,449,400	-	18,448,000	1,400	13,624,216	-	13,709,900	85,684
カナダ・ドル	19,074,920	-	19,074,000	920	13,803,306	-	13,924,700	121,394
ユーロ	54,112,160	-	54,112,000	160	69,962,272	-	70,004,000	41,728
合計	318,138,310	-	317,918,000	220,310	412,093,874	-	413,802,400	1,708,526

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買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。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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。
 ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	平成27年2月16日 現在				平成28年2月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	10,551,071,825	-	10,845,724,061	294,652,236	2,992,690,907	-	2,881,156,184	111,534,723
合計	10,551,071,825	-	10,845,724,061	294,652,236	2,992,690,907	-	2,881,156,184	111,534,723

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として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. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年2月16日現在	平成28年2月15日現在
1口当たり純資産額	2.8826円	2.3909円
(1万口当たり純資産額)	(28,826円)	(23,909円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年2月15日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	31,822	507.080	16,136,299.760	
	ABBOTT LABORATORIES	118,858	37.130	4,413,197.540	
	AES CORP	47,729	9.170	437,674.930	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,956	121.040	9,072,674.240	
	ADOBE SYSTEMS INC	40,204	76.670	3,082,440.680	
	CHUBB LTD	36,008	114.310	4,116,074.480	
	AGCO CORP	6,536	45.720	298,825.920	
	AIRGAS INC	4,576	140.100	641,097.600	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,674	130.350	2,303,805.900	
	ENERGEN CORP	5,191	22.910	118,925.810	
	ALLEGHANY CORP	1,188	462.200	549,093.600	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	74,567	58.400	4,354,712.800	
	RALPH LAUREN CORP	4,294	86.940	373,320.360	
	ALLSTATE CORP	31,687	63.910	2,025,116.170	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,395	103.480	6,042,714.600	
	ALCOA INC	102,779	7.690	790,370.510	
	AMGEN INC	61,101	144.720	8,842,536.720	
	HESS CORP	20,456	40.110	820,490.160	
	AMERICAN EXPRESS CO	74,970	52.660	3,947,920.200	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	38,075	60.600	2,307,345.000	
	AFLAC INC	36,014	57.310	2,063,962.340	
	AMERICAN INTL GROUP	105,671	53.000	5,600,563.000	
	AMERCO	551	320.610	176,656.110	
	JARDEN CORP	13,598	49.660	675,276.680	
	ANALOG DEVICES	26,862	49.640	1,333,429.680	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	38,745	37.810	1,464,948.450	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,216	141.110	2,570,459.760	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	31,929	33.520	1,070,260.080	
	TIME WARNER	66,411	62.260	4,134,748.860	
	JONES LANG LASALLE INC	4,328	98.940	428,212.320	
	VALERO ENERGY CORP	41,738	57.750	2,410,369.500	
	APACHE CORP	29,768	36.530	1,087,425.040	
ANSYS INC	7,266	84.060	610,779.960		
APPLE INC	457,288	93.990	42,980,499.120		
APPLIED MATERIALS INC	92,368	16.060	1,483,430.080		
ALBEMARLE CORP	7,690	51.380	395,112.200		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,013	32.450	1,525,571.850	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	67.220	629,179.200	
AMEREN CORP	19,716	45.250	892,149.000	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	53.730	417,320.910	
ASHLAND INC	5,128	91.930	471,417.040	
AGL RESOURCES INC	8,945	64.630	578,115.350	
AUTOLIV INC	7,264	104.730	760,758.720	
AUTODESK INC	16,361	44.920	734,936.120	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,207	81.740	3,041,300.180	
AUTOZONE INC	2,371	729.620	1,729,929.020	
AVERY DENNISON CORP	9,595	63.980	613,888.100	
AVNET INC	10,288	39.000	401,232.000	
BAKER HUGHES INC	34,030	39.900	1,357,797.000	
BALL CORP	10,625	65.170	692,431.250	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	94,741	128.070	12,133,479.870	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,330	33.830	2,852,883.900	
CR BARD INC	5,892	183.700	1,082,360.400	
BAXTER INTERNATIONAL INC	41,887	36.610	1,533,483.070	
BED BATH & BEYOND INC	15,902	42.940	682,831.880	
BECTON DICKINSON & CO	15,840	139.810	2,214,590.400	
AMETEK INC	19,168	45.630	874,635.840	
BE AEROSPACE INC	7,540	40.690	306,802.600	
VERIZON COMM INC	324,572	50.110	16,264,302.920	
WR BERKLEY CORP	6,604	51.390	339,379.560	
BEST BUY CO INC	23,778	28.120	668,637.360	
YUM! BRANDS INC	35,750	67.340	2,407,405.000	
FIRSTENERGY CORP	33,061	32.880	1,087,045.680	
H&R BLOCK INC	20,906	33.720	704,950.320	
ENSCO PLC-CL A	16,993	8.380	142,401.340	
BOEING CO	52,515	108.630	5,704,704.450	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	37.340	404,989.640	
BORGWARNER INC	17,824	31.740	565,733.760	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	108,273	16.640	1,801,662.720	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,592	70.160	813,294.720	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	307.070	676,475.210	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,814	60.200	7,995,402.800	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,276	124.420	532,019.920	
ONEOK INC	16,401	20.180	330,972.180	
UNITED RENTALS INC	7,795	45.450	354,282.750	
SEMPRA ENERGY	18,407	93.470	1,720,502.290	
FEDEX CORP	22,217	128.600	2,857,106.200	

VERISIGN INC	7,229	76.970	556,416.130	
AMPHENOL CORP	27,155	49.540	1,345,258.700	
BROWN-FORMAN CORP	9,485	97.020	920,234.700	
QUANTA SERVICES INC	16,615	17.660	293,420.900	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	26,032	46.660	1,214,653.120	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	179,873	3.460	622,360.580	
CSX CORP	85,294	24.190	2,063,261.860	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,517	32.430	503,216.310	
CABOT OIL & GAS CORP	33,871	19.750	668,952.250	
CAMPBELL SOUP CO	13,787	58.240	802,954.880	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,338	29.880	697,339.440	
WHITING PETROLEUM CORP	15,410	4.500	69,345.000	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,276	138.030	1,832,486.280	
CARDINAL HEALTH INC	26,820	78.850	2,114,757.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	32,472	44.060	1,430,716.320	
CATERPILLAR INC	43,844	63.150	2,768,748.600	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,933	78.670	466,749.110	
CELGENE CORP	63,929	102.450	6,549,526.050	
CORE LABORATORIES N.V.	3,159	99.380	313,941.420	
CITRIX SYSTEMS INC	12,490	64.310	803,231.900	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,606	1.590	70,923.540	
CENTURYLINK INC	50,491	28.610	1,444,547.510	
CERNER CORP	25,633	54.900	1,407,251.700	
JPMORGAN CHASE & CO	297,973	57.490	17,130,467.770	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,603	88.580	939,213.740	
CIGNA CORP	20,009	130.300	2,607,172.700	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,832	61.770	730,862.640	
CINTAS CORP	7,454	83.010	618,756.540	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	79,229	4.240	335,930.960	
CISCO SYSTEMS INC	408,218	25.110	10,250,353.980	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	7,706	32.420	249,828.520	
CLOROX COMPANY	9,481	127.540	1,209,206.740	
COCA-COLA CO/THE	326,767	43.110	14,086,925.370	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	16,090	48.190	775,377.100	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,256	65.700	4,484,419.200	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	16,077	63.800	1,025,712.600	
COMERICA INC	13,912	32.920	457,983.040	
NRG ENERGY, INC.	23,703	9.580	227,074.740	
COMCAST CORP-CL A	199,126	56.780	11,306,374.280	
CA INC	26,267	27.700	727,595.900	

CONAGRA FOODS INC	34,323	41.600	1,427,836.800	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,012	70.720	1,556,688.640	
CMS ENERGY CORP	20,017	39.190	784,466.230	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,009	64.360	1,094,699.240	
COOPER COS INC	3,794	133.580	506,802.520	
MOLSON COORS BREWING CO	14,823	84.140	1,247,207.220	
CORNING INC	101,420	18.390	1,865,113.800	
SEALED AIR CORP	15,017	43.240	649,335.080	
CUMMINS INC	12,850	97.010	1,246,578.500	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	115.330	763,369.270	
DR HORTON INC	26,166	24.210	633,478.860	
DANAHER CORP	49,531	84.920	4,206,172.520	
MOODY'S CORP	16,620	82.310	1,367,992.200	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	46,508	53.870	2,505,385.960	
TARGET CORP	47,633	69.950	3,331,928.350	
DEERE & CO	27,579	78.270	2,158,608.330	
MORGAN STANLEY	110,016	23.090	2,540,269.440	
REPUBLIC SERVICES INC	18,651	44.200	824,374.200	
THE WALT DISNEY CO	128,615	91.150	11,723,257.250	
DOLLAR TREE INC	18,245	75.230	1,372,571.350	
DOVER CORP	11,617	59.190	687,610.230	
DOW CHEMICAL	86,405	46.010	3,975,494.050	
OMNICOM GROUP	20,681	73.350	1,516,951.350	
DTE ENERGY CO	14,055	83.720	1,176,684.600	
XL GROUP PLC	23,051	34.580	797,103.580	
DUKE ENERGY CORP	54,951	76.240	4,189,464.240	
FLOWSERVE CORP	9,241	40.820	377,217.620	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	58.670	553,610.120	
EBAY INC	89,434	22.490	2,011,370.660	
EMC CORP/MASS	146,656	24.130	3,538,809.280	
BANK OF AMERICA CORP	842,414	11.950	10,066,847.300	
CITIGROUP INC	244,760	37.540	9,188,290.400	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,592	60.660	703,170.720	
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,478	21.150	433,109.700	
EATON CORP PLC	38,338	54.200	2,077,919.600	
EATON VANCE CORP	9,128	28.880	263,616.640	
DISH NETWORK CORP	20,344	43.310	881,098.640	
ECOLAB INC	22,552	106.630	2,404,719.760	
ELECTRONIC ARTS INC	23,902	59.250	1,416,193.500	
SALESFORCE.COM INC	51,055	59.680	3,046,962.400	
EMERSON ELECTRIC CO	49,885	46.020	2,295,707.700	
WEATHERFORD INTL PLC	58,791	6.470	380,377.770	
ENTERGY CORP	13,984	70.440	985,032.960	
EOG RESOURCES INC	42,044	67.700	2,846,378.800	
EQUIFAX INC	8,986	97.470	875,865.420	
EQT CORP	12,314	59.110	727,880.540	

ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,769	88.310	1,657,490.390	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	45.700	652,550.300	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	52,940	67.340	3,564,979.600	
EXXON MOBIL CORP	336,451	81.030	27,262,624.530	
FMC CORP	9,724	35.040	340,728.960	
NEXTERA ENERGY INC	34,147	111.670	3,813,195.490	
ASSURANT INC	7,098	67.070	476,062.860	
FASTENAL CO	25,574	43.040	1,100,704.960	
FIFTH THIRD BANCORP	73,757	14.870	1,096,766.590	
M&T BANK CORP	10,650	105.930	1,128,154.500	
FISERV INC	20,271	93.070	1,886,621.970	
FLIR SYSTEMS INC	8,840	29.300	259,012.000	
MACY'S INC	29,828	39.250	1,170,749.000	
FORD MOTOR CO	282,813	11.550	3,266,490.150	
FRANKLIN RESOURCES INC	30,371	32.320	981,590.720	
FREEMPORT-MCMORAN INC	85,535	5.530	473,008.550	
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	10.150	450,284.450	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,532	38.490	482,356.680	
TEGNA INC	14,989	22.170	332,306.130	
GAP INC/THE	18,180	23.730	431,411.400	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,729	54.730	587,198.170	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,277	130.180	2,900,019.860	
GENERAL MILLS INC	49,197	56.890	2,798,817.330	
GENUINE PARTS CO	14,221	87.860	1,249,457.060	
GILEAD SCIENCES INC	117,655	89.440	10,523,063.200	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	13,585	64.010	869,575.850	
GARTNER INC	5,772	80.000	461,760.000	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	19,208	29.690	570,285.520	
MCKESSON CORP	18,548	151.030	2,801,304.440	
NVIDIA CORP	47,038	25.730	1,210,287.740	
GENERAL ELECTRIC CO	759,442	28.260	21,461,830.920	
WW GRAINGER INC	5,593	211.090	1,180,626.370	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,464	90.050	762,183.200	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	17.270	384,015.720	
HALLIBURTON CO	64,473	29.110	1,876,809.030	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,657	122.370	1,426,467.090	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,674	146.130	4,774,651.620	
HARLEY-DAVIDSON INC	15,057	38.720	583,007.040	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,014	70.220	352,083.080	
HARRIS CORP	11,245	72.060	810,314.700	
HASBRO INC	8,909	70.080	624,342.720	
HENRY SCHEIN INC	6,256	158.990	994,641.440	
HELMERICH & PAYNE INC	7,163	47.410	339,597.830	

HERSHEY FOODS CORP	12,284	89.700	1,101,874.800	
HP INC	140,131	9.420	1,320,034.020	
F5 NETWORKS INC	5,809	87.830	510,204.470	
CROWN HOLDINGS INC NPR	9,809	45.020	441,601.180	
REYNOLDS AMERICAN INC	65,630	47.800	3,137,114.000	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	88.790	920,663.510	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	126.560	436,252.320	
JUNIPER NETWORKS INC	25,642	21.840	560,021.280	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	30.710	426,500.480	
HOLOGIC INC	18,649	32.600	607,957.400	
UNUM GROUP	23,743	25.140	596,899.020	
HOME DEPOT INC	101,869	116.320	11,849,402.080	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,610	70.080	883,708.800	
HORMEL FOODS CORP	23,322	41.500	967,863.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	17.970	574,177.440	
HUMANA INC	11,821	160.370	1,895,733.770	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,637	74.430	493,991.910	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,060	8.440	506,906.400	
RED HAT INC	14,283	64.110	915,683.130	
BIOGEN INC	18,893	247.220	4,670,727.460	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,965	91.880	2,569,424.200	
INTUIT INC	20,568	94.560	1,944,910.080	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	9,222	35.740	329,594.280	
INGERSOLL-RAND PLC	21,063	51.320	1,080,953.160	
INTEL CORP	383,404	28.640	10,980,690.560	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,217	106.750	770,414.750	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,541	34.160	1,077,440.560	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	37,561	20.400	766,244.400	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,297	36.080	335,435.760	
INCYTE CORP	12,683	68.360	867,009.880	
JOHNSON & JOHNSON	220,226	101.820	22,423,411.320	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,624	40.790	1,453,102.960	
JOHNSON CONTROLS INC	54,035	34.810	1,880,958.350	
KLA-TENCOR CORP	14,558	63.790	928,654.820	
DEVON ENERGY CORP	28,689	21.690	622,264.410	
KELLOGG CO	20,813	74.970	1,560,350.610	
KEYCORP	66,833	10.490	701,078.170	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,934	128.630	3,593,150.420	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,284	306.800	2,848,331.200	
KOHL'S CORP	15,787	40.810	644,267.470	

KROGER CO	73,891	38.330	2,832,242.030	
LAM RESEARCH CORP	12,091	66.050	798,610.550	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,466	46.600	394,515.600	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	50.760	729,268.920	
LEGG MASON INC	6,295	26.640	167,698.800	
LEGGETT & PLATT INC	12,274	42.330	519,558.420	
LENNAR CORP	12,932	39.700	513,400.400	
LEUCADIA NATIONAL CORP	23,605	14.780	348,881.900	
ELI LILLY & CO	79,275	71.270	5,649,929.250	
L BRANDS INC	19,395	81.870	1,587,868.650	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,267	32.650	596,417.550	
LINEAR TECH CORP	18,324	41.650	763,194.600	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,910	97.250	5,437,247.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,128	36.220	1,055,016.160	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,285	206.080	4,592,492.800	
LOEWS CORP	21,320	35.860	764,535.200	
RANGE RESOURCES CORP	12,431	27.430	340,982.330	
LOWE'S COS INC	72,969	64.870	4,733,499.030	
DOMINION RESOURCES INC/VA	47,796	68.940	3,295,056.240	
SCANA CORP	9,574	64.400	616,565.600	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,729	18.110	610,832.190	
MCCORMICK & CO INC	9,163	89.670	821,646.210	
MCDONALD'S CORPORATION	74,777	117.930	8,818,451.610	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	23,601	85.520	2,018,357.520	
EVEREST RE GROUP LTD	3,272	185.660	607,479.520	
MANPOWERGROUP INC	5,703	72.740	414,836.220	
MARKEL CORPORATION	1,049	841.220	882,439.780	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,526	81.040	1,339,267.040	
MARSH & MCLENNAN COS	42,209	56.080	2,367,080.720	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,542	75.360	417,645.120	
MASCO CORP	25,045	25.820	646,661.900	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,501	132.860	598,002.860	
MATTEL INC	25,152	30.760	773,675.520	
METLIFE INC	80,705	37.430	3,020,788.150	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,891	32.450	710,362.950	
MEDTRONIC PLC	112,777	73.400	8,277,831.800	
ACTIVISION BLIZZARD INC	37,543	28.120	1,055,709.160	
CVS HEALTH CORP	88,983	95.860	8,529,910.380	
MERCK & CO. INC.	225,258	49.030	11,044,399.740	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,810	103.020	804,586.200	
MICROSOFT CORP	608,817	50.500	30,745,258.500	
MICRON TECH INC	83,952	10.020	841,199.040	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,953	40.410	604,250.730	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,888	8.610	265,945.680	
3M CO	48,913	153.960	7,530,645.480	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,366	155.210	832,856.860	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,590	61.780	716,030.200	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,699	79.400	690,700.600	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	16.790	208,917.970	
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,883	50.090	795,579.470	
MYLAN NV	32,656	41.825	1,365,837.200	
ILLUMINA INC	12,052	142.720	1,720,061.440	
XCEL ENERGY INC	38,007	38.820	1,475,431.740	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,546	27.550	924,192.300	
NETAPP INC	24,525	21.890	536,852.250	
NEWELL RUBBERMAID INC	21,322	34.790	741,792.380	
DUN & BRADSTREET CORP	4,306	95.450	411,007.700	
NEWMONT MINING CORP	50,047	25.780	1,290,211.660	
NIKE INC-CL B	108,387	56.420	6,115,194.540	
NOBLE ENERGY INC	30,599	28.730	879,109.270	
NORDSTROM INC	11,509	48.910	562,905.190	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,576	72.560	1,638,114.560	
EVERSOURCE ENERGY	23,786	53.510	1,272,788.860	
COACH INC	24,737	34.530	854,168.610	
NORTHERN TRUST CORP	19,573	56.850	1,112,725.050	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,770	181.250	2,677,062.500	
WELLS FARGO & CO	389,402	47.310	18,422,608.620	
NUCOR CORP	24,612	40.030	985,218.360	
MONSANTO CO	38,812	87.030	3,377,808.360	
CHENIERE ENERGY INC	17,814	26.050	464,054.700	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,273	62.540	2,581,213.420	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	64,108	67.060	4,299,082.480	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	27.120	246,276.720	
OGE ENERGY CORP	16,028	25.910	415,285.480	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,954	253.020	2,012,521.080	
ORACLE CORP	270,567	35.540	9,615,951.180	
PACCAR INC	27,939	50.000	1,396,950.000	
EXELON CORP	67,643	30.460	2,060,405.780	
PARKER HANNIFIN CORP	12,188	97.250	1,185,283.000	
PARTNERRE LTD	3,890	140.500	546,545.000	
PATTERSON COS INC	10,152	42.480	431,256.960	
PAYCHEX INC	25,896	48.940	1,267,350.240	

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	52.300	445,543.700	
MEDNAX INC	7,106	63.420	450,662.520	
PPL CORPORATION	52,418	35.740	1,873,419.320	
PEPSICO INC	115,738	98.490	11,399,035.620	
PENTAIR PLC	14,306	44.400	635,186.400	
PFIZER INC	493,340	29.360	14,484,462.400	
CONOCOPHILLIPS	97,893	32.900	3,220,679.700	
PVH CORP	6,479	73.350	475,234.650	
PG&E CORP	36,973	55.210	2,041,279.330	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,784	115.360	1,705,482.240	
ALTRIA GROUP INC	155,451	59.970	9,322,396.470	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,993	80.930	3,398,493.490	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,980	79.800	397,404.000	
GARMIN LTD	9,959	34.360	342,191.240	
AETNA INC	28,172	99.300	2,797,479.600	
FLUOR CORP (NEW)	11,793	43.640	514,646.520	
PPG INDUSTRIES INC	22,588	91.780	2,073,126.640	
PRAXAIR INC	24,966	103.830	2,592,219.780	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,453	148.650	5,121,438.450	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,740	67.550	1,603,637.000	
QUEST DIAGNOSTICS	11,056	61.900	684,366.400	
PROCTER & GAMBLE CO	214,929	80.990	17,407,099.710	
PROGRESSIVE CORP	45,883	31.380	1,439,808.540	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,399	41.890	1,650,424.110	
PULTE GROUP INC	25,477	16.010	407,886.770	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	46,646	15.100	704,354.600	
GLOBAL PAYMENTS INC	9,632	56.800	547,097.600	
QUALCOMM INC	128,854	44.560	5,741,734.240	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	41.000	425,334.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	113.010	399,490.350	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,155	379.010	2,332,806.550	
AUTONATION INC	7,394	48.160	356,095.040	
RESMED INC	11,376	57.880	658,442.880	
US BANCORP	141,917	39.100	5,548,954.700	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,021	68.400	617,036.400	
RITE AID CORP	73,930	7.820	578,132.600	
ROSS STORES INC	33,529	53.750	1,802,183.750	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,573	163.590	1,402,457.070	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,766	96.330	940,758.780	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,174	68.770	1,043,515.980	

RAYTHEON COMPANY	24,384	120.240	2,931,932.160	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,362	182.650	979,369.300	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	23.120	433,245.680	
ACCENTURE PLC-CL A	49,522	94.700	4,689,733.400	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	129,340	38.100	4,927,854.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,266	107.840	1,107,085.440	
SANDISK CORP	16,366	67.490	1,104,541.340	
ROCKWELL COLLINS INC	9,595	80.950	776,715.250	
ST JUDE MEDICAL INC	23,176	50.400	1,168,070.400	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,590	107.490	2,535,689.100	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	20,743	57.570	1,194,174.510	
PRICELINE GROUP INC	4,120	1,058.010	4,359,001.200	
SCHLUMBERGER LTD	104,583	70.310	7,353,230.730	
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,107	22.820	2,307,261.740	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,768	91.780	1,263,627.040	
BUNGE LTD	11,801	51.460	607,279.460	
SEI INVESTMENTS CO	13,638	36.340	495,604.920	
ANTHEM INC	20,646	121.550	2,509,521.300	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,201	85.610	1,472,577.610	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	35.380	826,158.380	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,687	256.650	1,716,218.550	
CENTENE CORP	10,224	53.830	550,357.920	
ACUITY BRANDS INC	3,145	179.680	565,093.600	
SNAP-ON INC	5,313	140.010	743,873.130	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,611	61.640	2,133,422.040	
ADVANCE AUTO PARTS	5,295	140.770	745,377.150	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28,328	8.930	252,969.040	
EDISON INTERNATIONAL	23,842	61.760	1,472,481.920	
SOUTHERN CO	68,059	47.910	3,260,706.690	
BB&T CORP	60,610	31.580	1,914,063.800	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	36.240	498,155.040	
AT&T INC	487,453	36.470	17,777,410.910	
CHEVRON CORP	153,214	85.430	13,089,072.020	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,613	91.760	1,249,128.880	
STAPLES INC	58,400	8.320	485,888.000	
STATE STREET CORP	31,417	54.680	1,717,881.560	
STARBUCKS CORP	118,765	55.860	6,634,212.900	
STRYKER CORP	27,397	97.330	2,666,550.010	
NETFLIX INC	30,983	87.400	2,707,914.200	
STERICYCLE INC	6,853	106.920	732,722.760	
SUNTRUST BANKS INC	38,067	33.530	1,276,386.510	
SYMANTEC CORP	60,158	19.150	1,152,025.700	

SYNOPSYS INC	14,769	41.920	619,116.480	
SYSCO CORP	43,896	43.210	1,896,746.160	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,954	531.280	1,569,401.120	
TESORO CORP	9,395	71.070	667,702.650	
TEXAS INSTRUMENTS INC	77,930	51.140	3,985,340.200	
TEXTRON INC	21,846	32.080	700,819.680	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,898	126.480	4,034,459.040	
TIFFANY & CO	10,305	61.730	636,127.650	
TOLL BROTHERS INC	12,654	25.040	316,856.160	
TORCHMARK CORP	10,414	50.120	521,949.680	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	39.380	537,025.060	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	62.560	872,461.760	
TRACTOR SUPPLY CO	9,788	83.480	817,102.240	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	19,110	21.330	407,616.300	
TYSON FOODS INC	24,887	60.170	1,497,450.790	
MARATHON OIL CORP	52,743	7.490	395,045.070	
UNION PACIFIC CORP	71,455	77.200	5,516,326.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	69,845	85.950	6,003,177.750	
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,643	111.820	8,458,400.260	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,441	104.260	775,798.660	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	75.860	629,334.560	
VF CORP	25,690	58.790	1,510,315.100	
CBS CORP	33,562	43.180	1,449,207.160	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,746	83.230	1,560,229.580	
VULCAN MATERIALS CO	11,687	92.020	1,075,437.740	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	70,222	77.080	5,412,711.760	
WAL-MART STORES INC	129,153	66.180	8,547,345.540	
WASTE MANAGEMENT INC	34,984	53.980	1,888,436.320	
WATERS CORP	6,779	118.410	802,701.390	
ALLERGAN PLC	31,565	280.480	8,853,351.200	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,264	126.920	1,175,786.880	
WESTERN DIGITAL CORP	18,200	41.080	747,656.000	
WABTEC CORP	7,250	65.350	473,787.500	
WHIRLPOOL CORP	6,288	132.190	831,210.720	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,061	57.630	867,965.430	
WYNN RESORTS LTD	6,279	69.140	434,130.060	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	30.650	890,535.750	
NASDAQ INC	9,132	61.310	559,882.920	
CME GROUP INC	26,133	91.150	2,382,022.950	
WILLIAMS COS INC	53,337	13.470	718,449.390	
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,927	37.430	221,847.610	

LKQ CORP	25,910	25.030	648,527.300	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	26.590	483,805.050	
ALLIANT ENERGY CORP	11,212	66.960	750,755.520	
WEC ENERGY GROUP INC	24,880	55.670	1,385,069.600	
FOOT LOCKER INC	11,034	65.950	727,692.300	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,310	26.280	560,026.800	
CARMAX INC	18,912	43.630	825,130.560	
XEROX CORP	98,308	8.770	862,161.160	
XILINX INC	20,017	47.650	953,810.050	
YAHOO! INC	66,184	27.040	1,789,615.360	
CIMAREX ENERGY CO	10,340	84.670	875,487.800	
TJX COMPANIES INC	52,219	69.870	3,648,541.530	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	64,700	5.620	363,614.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,740	59.550	341,817.000	
SIGNATURE BANK	3,706	126.420	468,512.520	
CBRE GROUP INC	21,235	24.340	516,859.900	
LIBERTY GLOBAL PLC	23,599	32.830	774,755.170	
REGIONS FINANCIAL CORP	122,830	7.600	933,508.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,417	43.860	193,729.620	
T-MOBILE US INC	23,522	35.110	825,857.420	
LAS VEGAS SANDS CORP	35,011	44.090	1,543,634.990	
MEDIVATION INC	12,474	30.440	379,708.560	
MOSAIC CO/THE	25,355	22.910	580,883.050	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	36,077	24.670	890,019.590	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	90,569	24.550	2,223,468.950	
CELANESE CORP	11,777	57.310	674,939.870	
IHS INC-CLASS A	5,758	96.090	553,286.220	
DISCOVERY COMMNUCATIONS- A	9,144	25.000	228,600.000	
EXPEDIA INC	10,401	102.250	1,063,502.250	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,719	30.000	531,570.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,346	80.150	1,229,981.900	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	48,706	31.550	1,536,674.300	
GAMESTOP CORP. - CL. A	8,633	26.980	232,918.340	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,531	236.280	2,251,984.680	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,591	76.290	1,036,857.390	
VIACOM INC-CLASS B	27,414	32.810	899,453.340	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,433	480.570	1,169,226.810	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,961	48.350	336,564.350	

TRANSDIGM GROUP INC	4,845	195.100	945,259.500	
MASTERCARD INC	80,766	84.890	6,856,225.740	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	38,306	23.170	887,550.020	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	8,473	65.590	555,744.070	
HANESBRANDS INC	32,964	26.580	876,183.120	
WESTERN UNION CO	41,207	17.560	723,594.920	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	27,621	7.490	206,881.290	
AERCAP HOLDINGS NV	13,624	28.060	382,289.440	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	15,025	14.180	213,054.500	
SPECTRA ENERGY CORP	52,852	28.490	1,505,753.480	
TIME WARNER CABLE INC	22,777	184.990	4,213,517.230	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	40,198	14.360	577,243.280	
DELTA AIR LINES INC	17,228	42.990	740,631.720	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,680	19.330	167,784.400	
DISCOVER FINANCIAL	32,943	44.520	1,466,622.360	
TE CONNECTIVITY LTD	34,756	54.490	1,893,854.440	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	12,877	87.150	1,122,230.550	
WABCO HOLDING INC	4,395	89.720	394,319.400	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	58.840	451,891.200	
VMWARE INC	8,246	45.010	371,152.460	
TERADATA CORP	12,117	23.070	279,539.190	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	158.490	777,710.430	
INVESCO LTD	34,162	26.500	905,293.000	
NETSUITE INC	3,281	53.110	174,253.910	
CALPINE CORP NPR	26,738	12.350	330,214.300	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,555	89.060	11,003,808.300	
VISA INC	155,937	70.420	10,981,083.540	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,201	91.970	1,490,005.970	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,027	65.080	847,797.160	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,702	53.720	252,591.440	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	98.630	601,149.850	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,028	24.440	513,924.320	
MARATHON PETROLEUM CORP	46,329	31.730	1,470,019.170	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	14,093	46.860	660,397.980	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	141,646	14.960	2,119,024.160	

XYLEM INC	17,859	37.040	661,497.360	
ALKERMES PLC	11,218	32.450	364,024.100	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	30,416	76.460	2,325,607.360	
LINKEDIN CORP	9,511	101.110	961,657.210	
SPLUNK INC	9,277	31.320	290,555.640	
HCA HOLDINGS INC	27,659	66.010	1,825,770.590	
VERISK ANALYTICS INC	13,563	68.060	923,097.780	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,874	113.780	554,563.720	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,223	117.460	730,953.580	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,369	70.530	1,225,035.570	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,944	58.390	639,020.160	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,182	167.750	1,037,030.500	
CIT GROUP INC	13,340	26.560	354,310.400	
NXP SEMICONDUCTOR NV	11,421	67.300	768,633.300	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	562,500	0.420	236,250.000	
LEAR CORP	6,259	100.710	630,343.890	
DOLLAR GENERAL CORP	23,585	70.460	1,661,799.100	
FORTINET INC	10,861	24.110	261,858.710	
AON PLC	21,841	93.800	2,048,685.800	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	28.450	326,150.800	
TESLA MOTORS INC	7,097	151.040	1,071,930.880	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,990	31.950	383,080.500	
GENERAL MOTORS CO	120,253	27.710	3,332,210.630	
VANTIV INC	12,141	47.800	580,339.800	
TRIPADVISOR INC	9,263	59.900	554,853.700	
ALLY FINANCIAL INC	42,461	16.340	693,812.740	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,570	49.570	821,374.900	
VOYA FINANCIAL INC	16,634	26.600	442,464.400	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	25,937	61.240	1,588,381.880	
PHILLIPS 66	40,891	75.200	3,075,003.200	
LIBERTY MEDIA CORP	5,006	32.490	162,644.940	
FACEBOOK INC	171,240	102.010	17,468,192.400	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	7,204	60.430	435,337.720	
ADT CORP	11,734	26.870	315,292.580	
SERVICENOW INC	10,829	50.080	542,316.320	
WHITEWAVE FOODS CO	12,239	36.090	441,705.510	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,614	123.740	694,676.360	
TABLEAU SOFTWARE INC	5,133	40.250	206,603.250	
WORKDAY INC	7,948	49.250	391,439.000	
ABBVIE INC	133,635	52.580	7,026,528.300	

ZOETIS INC	39,109	40.430	1,581,176.870	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,645	39.330	497,327.850	
NEWS CORP/NEW-CL A	33,106	10.750	355,889.500	
MALLINCKRODT PLC	9,419	62.350	587,274.650	
CDW CORP	10,726	34.310	368,009.060	
SPRINT CORP	57,295	2.660	152,404.700	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	19,598	19.160	375,497.680	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,283	37.820	540,183.060	
FIREEYE INC	8,532	12.000	102,384.000	
BROADCOM LTD	23,711	121.660	2,884,680.260	
ANTERO RESOURCES CORP	8,460	26.020	220,129.200	
TWITTER INC	43,632	15.880	692,876.160	
PLAINS GP HOLDINGS LP	16,533	6.040	99,859.320	
PERRIGO CO PLC	12,194	138.600	1,690,088.400	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	36,830	18.540	682,828.200	
ARAMARK	20,586	30.300	623,755.800	
IMS HEALTH HOLDINGS INC	12,407	24.200	300,249.400	
SABRE CORP	17,624	25.910	456,637.840	
NAVIENT CORP	28,699	9.130	262,021.870	
FNF GROUP	18,087	32.550	588,731.850	
LIBERTY MEDIA CORP-C	18,330	32.140	589,126.200	
SYNCHRONY FINANCIAL	64,620	25.370	1,639,409.400	
MOBILEYE NV	12,750	25.180	321,045.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	44,329	18.890	837,374.810	
CDK GLOBAL INC	9,646	42.210	407,157.660	
QORVO INC	12,235	37.550	459,424.250	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,524	23.380	292,811.120	
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,438	47.290	1,392,123.020	
WESTROCK CO	19,981	31.030	620,010.430	
KRAFT HEINZ CO	48,703	71.920	3,502,719.760	
ALPHABET INC-CL A	22,941	706.890	16,216,763.490	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	140,131	12.290	1,722,209.990	
PAYPAL HOLDINGS INC	89,501	34.300	3,069,884.300	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	17.810	144,866.540	
ALPHABET INC-CL C	25,028	682.400	17,079,107.200	
COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	25,231	16.280	410,760.680	
BAXALTA INC	48,546	38.670	1,877,273.820	
アメリカ・ドル 小計	25,906,673		1,332,762,443.120 (151,041,967,679)	
イギリス・ポンド				
ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	2.204	157,235.560	
AMEC FOSTER WHEELER PLC	28,599	3.631	103,842.960	

ANTOFAGASTA PLC	25,905	4.333	112,246.360	
ASHTED GROUP	38,160	8.050	307,188.000	
SEVERN TRENT PLC	19,770	20.600	407,262.000	
BHP BILLITON PLC	160,521	6.966	1,118,189.280	
BARCLAYS PLC	1,270,807	1.572	1,997,708.600	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	95,491	5.450	520,425.950	
BT GROUP PLC	681,176	4.482	3,053,030.830	
SKY PLC	82,222	9.775	803,720.050	
AGGREKO PLC	18,550	8.360	155,078.000	
BUNZL PLC	26,929	17.900	482,029.100	
EASYJET PLC	13,628	14.860	202,512.080	
CAPITA PLC	50,523	10.740	542,617.020	
AVIVA PLC	299,716	4.192	1,256,409.470	
CRODA INTERNATIONAL	9,774	27.260	266,439.240	
DIAGEO PLC	202,256	17.580	3,555,660.480	
SCHRODERS PLC	10,331	23.830	246,187.730	
NATIONAL GRID PLC	300,529	9.374	2,817,158.840	
GKN PLC	134,097	2.554	342,483.730	
KINGFISHER PLC	196,101	3.279	643,015.170	
BAE SYSTEMS PLC	245,770	4.671	1,147,991.670	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,370	30.190	343,260.300	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	150,176	37.085	5,569,276.960	
COBHAM PLC	88,449	2.381	210,597.060	
NEXT PLC	10,966	67.600	741,301.600	
REXAM PLC	54,770	5.940	325,333.800	
IMPERIAL BRANDS PLC	77,589	35.535	2,757,125.110	
IMI PLC	22,272	7.765	172,942.080	
JOHNSON MATTHEY PLC	13,463	22.480	302,648.240	
SABMILLER PLC	77,950	41.480	3,233,366.000	
ANGLO AMERICAN PLC	109,290	3.739	408,635.310	
COMPASS GROUP PLC	125,596	11.900	1,494,592.400	
HSBC HOLDINGS PLC	1,590,588	4.404	7,004,949.550	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	462,703	2.077	961,034.130	
ARM HOLDINGS PLC	120,951	8.855	1,071,021.100	
CENTRICA PLC	444,241	1.896	842,280.930	
UNILEVER PLC	102,250	29.445	3,010,751.250	
MEGGITT PLC	54,676	3.691	201,809.110	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	228,774	1.731	396,007.790	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	53,266	9.055	482,323.630	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	73,187	3.892	284,843.800	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,749	30.520	846,899.480	
PEARSON PLC	65,464	7.610	498,181.040	
PERSIMMON PLC	23,150	18.950	438,692.500	

PRUDENTIAL PLC	197,057	11.575	2,280,934.770	
RIO TINTO PLC	110,210	18.475	2,036,129.750	
VODAFONE GROUP PLC	2,081,451	2.054	4,275,300.350	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,222	59.660	2,996,244.520	
RELX PLC	91,193	11.390	1,038,688.270	
OLD MUTUAL PLC	389,986	1.601	624,367.580	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	145,152	6.060	879,621.120	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	259,456	2.401	622,953.850	
ST JAMES'S PLACE PLC	41,514	8.300	344,566.200	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	17.240	342,989.800	
SSE PLC	76,640	13.460	1,031,574.400	
BP PLC	1,435,182	3.325	4,771,980.150	
SHIRE PLC	48,495	36.390	1,764,733.050	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.660	482,633.860	
SMITHS GROUP PLC	27,324	9.160	250,287.840	
STANDARD CHARTERED PLC	245,759	4.290	1,054,306.110	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,735,568	0.584	2,765,571.710	
TATE & LYLE PLC	39,915	5.355	213,744.820	
BG GROUP PLC	263,658	10.620	2,800,047.960	
TAYLOR WIMPLEY PLC	306,496	1.708	523,495.160	
TESCO PLC	631,592	1.770	1,117,917.840	
3I GROUP PLC	70,216	4.009	281,495.940	
SMITH & NEPHEW PLC	74,628	10.650	794,788.200	
GLAXOSMITHKLINE PLC	393,536	13.635	5,365,863.360	
WEIR GROUP	18,336	8.540	156,589.440	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	25,036	22.870	572,573.320	
BABCOCK INT'L GROUP	15,650	8.685	135,920.250	
WPP PLC	108,159	13.910	1,504,491.690	
WOLSELEY PLC	23,413	33.920	794,168.960	
ASTRAZENECA PLC	101,390	40.465	4,102,746.350	
WHITBREAD PLC	13,806	37.070	511,788.420	
CARNIVAL PLC	14,275	31.060	443,381.500	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	147,471	4.174	615,543.950	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	26.680	358,739.280	
WILLIAM HILL PLC	60,095	3.664	220,188.080	
BURBERRY GROUP PLC	36,044	11.740	423,156.560	
INVESTEC PLC	50,655	4.302	217,917.810	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,882	22.740	406,636.680	
ICAP PLC	36,584	4.057	148,421.280	
ITV PLC	328,003	2.411	790,815.230	
SAINSBURY (J) PLC	89,174	2.393	213,393.380	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	61.550	533,823.150	
G4S PLC	124,374	2.001	248,872.370	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	16.740	266,048.820	

	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	307,710	15.255	4,694,116.050	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	188,550	15.260	2,877,273.000	
	INMARSAT PLC	34,127	9.465	323,012.050	
	PETROFAC LTD	21,025	7.040	148,016.000	
	TUI AG-DI	19,394	10.080	195,491.520	
	STANDARD LIFE PLC	194,084	3.334	647,076.050	
	EXPERIAN PLC	83,009	11.020	914,759.180	
	MONDI PLC	25,855	12.210	315,689.550	
	SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC	21,006	3.798	79,780.780	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	11.300	240,577.000	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	8.970	140,281.830	
	GLENCORE PLC	927,273	0.984	912,436.630	
	DIXONS CARPHONE PLC	84,639	4.311	364,878.720	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	98,404	3.578	352,089.510	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	13.030	174,680.180	
	ROYAL MAIL PLC	79,209	4.275	338,618.470	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	71,339	3.944	281,361.010	
	AUTO TRADER GROUP PLC	58,105	3.458	200,927.090	
イギリス・ポンド	小計	23,303,925		116,362,823.040 (19,142,848,018)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,152	18.170	1,856,101.840	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	12.500	1,553,375.000	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	8.229	1,548,944.670	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	38,983	15.570	606,965.310	
	NICE SYSTEMS LTD	3,882	223.200	866,462.400	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	72,855	216.000	15,736,680.000	
イスラエル・シュケル	小計	530,372		22,168,529.220 (646,877,683)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,312	56.680	811,204.160	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,911	22.180	4,855,445.980	
	AMCOR LTD	105,429	12.230	1,289,396.670	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	274,473	28.060	7,701,712.380	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	10.490	353,533.980	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	1.620	241,713.720	
	TELSTRA CORP LTD	328,099	5.570	1,827,511.430	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	9.230	294,197.020	

AMP LTD	240,810	5.170	1,244,987.700	
ASX LTD	23,079	40.320	930,545.280	
BHP BILLITON LTD	246,516	15.090	3,719,926.440	
CALTEX AUSTRALIA LTD	27,545	35.630	981,428.350	
COMPUTERSHARE LT	34,030	9.280	315,798.400	
CSL LIMITED	37,056	103.300	3,827,884.800	
REA GROUP LTD	4,119	49.500	203,890.500	
TRANSURBAN GROUP	179,333	10.740	1,926,036.420	
COCA-COLA AMATIL LTD	35,256	8.230	290,156.880	
COCHLEAR LTD	5,226	103.200	539,323.200	
ORIGIN ENERGY LTD	132,102	3.640	480,851.280	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	138,660	73.330	10,167,937.800	
BORAL LIMITED	43,430	5.610	243,642.300	
RIO TINTO LIMITED	42,724	40.470	1,729,040.280	
APA GROUP	87,434	8.530	745,812.020	
ARISTOCRAT LEISU	40,226	9.250	372,090.500	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,933	5.150	1,153,254.950	
TPG TELECOM LTD	12,142	9.830	119,355.860	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	15.920	569,776.800	
ORICA LTD	34,301	12.550	430,477.550	
CIMIC GROUP LTD	7,290	26.120	190,414.800	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.380	543,129.400	
MACQUARIE GROUP LTD	23,603	58.340	1,376,999.020	
SUNCORP GROUP LTD	103,375	11.060	1,143,327.500	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	199,962	24.140	4,827,082.680	
NEWCREST MINING LTD	57,418	16.300	935,913.400	
OIL SEARCH LTD	103,413	6.660	688,730.580	
INCITEC PIVOT LTD	112,083	2.720	304,865.760	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	106,137	9.630	1,022,099.310	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	44,294	6.620	293,226.280	
SANTOS LTD	133,862	3.160	423,003.920	
SONIC HEALTHCARE	33,734	17.420	587,646.280	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.150	293,720.400	
WESFARMERS LTD	87,657	42.430	3,719,286.510	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.110	204,920.430	
ILUKA RESOURCES LIM I	45,912	6.400	293,836.800	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	26.610	1,541,331.030	
WOOLWORTHS LTD	107,196	22.170	2,376,535.320	
DUET GROUP	170,429	2.310	393,690.990	
SEEK LTD	29,830	12.370	368,997.100	
TATTS GROUP LTD	109,937	3.860	424,356.820	
AUSNET SERVICES	122,966	1.460	179,530.360	
AGL ENERGY LTD	48,662	18.200	885,648.400	

	BRAMBLES LTD	123,431	10.200	1,258,996.200	
	ASCIANO LTD	47,166	8.850	417,419.100	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.220	368,700.420	
	AURIZON HOLDINGS LTD	180,471	3.850	694,813.350	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,922	8.550	546,533.100	
	HEALTHSCOPE LTD	120,242	2.150	258,520.300	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.440	573,031.560	
	SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	1.075	464,429.020	
オーストラリア・ドル 小計		6,060,889		74,967,668.790 (6,046,892,165)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	13,502	49.400	666,998.800	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	34,037	55.140	1,876,800.180	
	BARRICK GOLD CORP	89,708	16.950	1,520,550.600	
	ATCO LTD	7,193	37.650	270,816.450	
	BANK OF MONTREAL	53,681	71.900	3,859,663.900	
	BANK OF NOVA SCOTIA	93,334	54.020	5,041,902.680	
	NATIONAL BANK OF CANADA	33,308	36.790	1,225,401.320	
	BCE INC	9,856	57.700	568,691.200	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	76,037	39.790	3,025,512.230	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,546	122.690	3,134,238.740	
	SAPUTO INC	20,680	36.990	764,953.200	
	BLACKBERRY LTD	38,780	9.250	358,715.000	
	CGI GROUP INC	17,094	55.490	948,546.060	
	CCL INDUSTRIES INC	2,207	186.760	412,179.320	
	CAE INC	17,352	13.700	237,722.400	
	CAMECO CORP	29,078	15.850	460,886.300	
	ROGERS COMM-CL B	29,459	47.580	1,401,659.220	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,622	87.060	2,927,131.320	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	80,262	27.750	2,227,270.500	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,911	112.180	663,095.980	
	CANADIAN UTILITIES LTD	15,398	33.880	521,684.240	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,409	76.540	4,623,704.860	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.110	218,178.870	
	AGRIUM INC	9,963	114.370	1,139,468.310	
	YAMANA GOLD INC	67,520	3.710	250,499.200	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,758	32.690	613,199.020	
	OPEN TEXT CORP	8,895	66.410	590,716.950	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	4.350	203,536.500	
	EMPIRE CO LTD	15,093	24.850	375,061.050	
	KINROSS GOLD CORP	125,461	4.170	523,172.370	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	17.110	293,607.600		
FORTIS INC	20,884	36.200	756,000.800		

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,435	3.290	156,061.150	
TELUS CORP	18,945	39.450	747,380.250	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	33.230	825,333.510	
IMPERIAL OIL LTD	22,883	41.140	941,406.620	
ENBRIDGE INC	65,595	44.130	2,894,707.350	
IGM FINANCIAL INC	8,010	32.910	263,609.100	
JEAN COUTU GROUP INC	3,791	19.600	74,303.600	
MANULIFE FINANCIAL CORP	165,426	16.310	2,698,098.060	
LINAMAR CORP	3,827	50.960	195,023.920	
LOBLAW CO LTD	17,936	63.870	1,145,572.320	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	36.470	351,206.100	
MAGNA INTERNATIONAL INC	38,264	45.830	1,753,639.120	
SUN LIFE FINANCIAL INC	53,005	38.860	2,059,774.300	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,614	763.220	1,231,837.080	
METRO INC	16,790	40.500	679,995.000	
HUSKY ENERGY INC	27,568	12.130	334,399.840	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,920	14.430	532,755.600	
METHANEX CORP	7,381	36.240	267,487.440	
ONEX CORP	6,646	78.500	521,711.000	
GOLDCORP INC	67,652	21.710	1,468,724.920	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	65,526	21.370	1,400,290.620	
POWER CORP OF CANADA	38,592	27.580	1,064,367.360	
POWER FINANCIAL CORP	18,286	29.960	547,848.560	
ROYAL BANK OF CANADA	120,016	67.980	8,158,687.680	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,939	40.130	479,112.070	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,142	171.710	1,913,192.820	
SHAW COMM INC-B	29,011	22.690	658,259.590	
SUNCOR ENERGY INC	124,823	30.570	3,815,839.110	
ENCANA CORP	59,596	4.910	292,616.360	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,683	6.440	281,318.520	
THOMSON REUTERS CORP	26,087	49.460	1,290,263.020	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	150,826	50.810	7,663,469.060	
TRANSCANADA CORP	63,774	48.660	3,103,242.840	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,200	40.970	172,074.000	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	102.730	487,248.390	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	85.210	913,280.780	
SILVER WHEATON CORP	28,408	21.150	600,829.200	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	480.240	717,478.560	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	11,057	75.420	833,918.940	

	CI FINANCIAL CORP	16,683	27.790	463,620.570	
	VERESEN INC	17,460	6.730	117,505.800	
	TOURMALINE OIL CORP	15,779	25.490	402,206.710	
	KEYERA CORP	13,728	34.460	473,066.880	
	ALTAGAS LTD	12,358	30.630	378,525.540	
	PEMBINA PIPELINE CORP	24,082	30.230	727,998.860	
	DOLLARAMA INC	9,286	71.600	664,877.600	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	68,440	14.510	993,064.400	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	33.630	278,826.330	
	ARC RESOURCES LTD	30,676	18.270	560,450.520	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	47,227	8.700	410,874.900	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	29.500	329,456.000	
	ELEMENT FINANCIAL CORP	30,631	12.490	382,581.190	
	INTER PIPELINE LTD	29,717	20.750	616,627.750	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,330	19.260	179,695.800	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	12,162	14.800	179,997.600	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,471	44.300	729,665.300	
カナダ・ドル 小計		2,969,960		103,126,970.680 (8,448,161,438)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	2.690	336,250.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	92,000	2.390	219,880.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.580	442,846.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.360	249,170.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	148,700	13.020	1,936,074.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	6.840	253,080.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	37.750	386,711.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	57,800	6.860	396,508.000	
	CAPITALAND LTD	184,415	2.820	520,050.300	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	0.675	394,470.000	
	KEPPEL CORP LTD	106,500	4.840	515,460.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	135,400	2.790	377,766.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	239,253	7.460	1,784,827.380	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	626,022	3.580	2,241,158.760	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.000	522,500.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	17.560	1,659,420.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	220,600	2.910	641,946.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	389,100	0.890	346,299.000	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	1.595	454,575.000		
シンガポール・ドル 小計		4,199,274		13,678,991.840	

(1,110,050,188)

スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	137,671	13.100	1,803,490.100	
	SYNGENTA AG	7,721	393.000	3,034,353.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	254,437	71.900	18,294,020.300	
	CIE FINANC RICHEMONT	44,767	62.400	2,793,460.800	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	56,244	244.300	13,740,409.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,548	154.500	548,166.000	
	SIKA INHABER	157	3,531.000	554,367.000	
	SGS SA-REG	533	1,870.000	996,710.000	
	SULZER AG-REG	683	89.100	60,855.300	
	NOVARTIS AG-REG SHS	182,822	70.900	12,962,079.800	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,687	115.700	426,585.900	
	BARRY CALLEBAUT AG	232	1,046.000	242,672.000	
	SWISSCOM AG-REG	2,105	467.900	984,929.500	
	ABB LTD	168,155	16.570	2,786,328.350	
	ADECCO SA-REG	11,997	53.800	645,438.600	
	GEBERIT AG	3,062	345.400	1,057,614.800	
	LONZA GROUP AG-REG	3,997	138.100	551,985.700	
	LINDT & SPRUENGLI PART	65	5,500.000	357,500.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	65,590.000	590,310.000	
	GIVAUDAN-REG	795	1,765.000	1,403,175.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,988	205.600	2,670,332.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	18,410	35.340	650,609.400	
	ACTELION	8,330	129.900	1,082,067.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	113.100	511,098.900	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	126.600	563,749.800	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,193	324.000	710,532.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,655	62.950	418,932.250	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	153.800	255,769.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,263	224.800	508,722.400	
	GALENICA HLDG NAMEN (NEW	305	1,285.000	391,925.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	808	450.000	363,600.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	79.100	473,809.000	
	DUFREY GROUP	3,162	94.500	298,809.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,056	339.250	358,248.000		
ARYZTA AG	5,959	43.190	257,369.210		
JULIUS BAER GROUP LTD	17,617	38.340	675,435.780		
SWISS RE LTD	28,457	86.000	2,447,302.000		
TRANSOCEAN LTD	26,823	8.890	238,456.470		
UBS GROUP AG	287,690	14.500	4,171,505.000		
スイス・フラン 小計	1,322,028		80,882,724.760 (9,376,734,281)		
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	47,392	181.000	8,577,952.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,729	170.600	5,754,167.400	

	ERICSSON LM-B SHS	264,062	73.050	19,289,729.100	
	GETINGE AB-B SHS	19,578	179.300	3,510,335.400	
	SKF AB-B SHS	32,306	142.000	4,587,452.000	
	SANDVIK AB	77,917	73.100	5,695,732.700	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	110,157	80.300	8,845,607.100	
	SKANSKA AB-B SHS	26,640	163.600	4,358,304.000	
	SWEDBANK AB	70,859	153.500	10,876,856.500	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	50,376	241.100	12,145,653.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	104.400	12,414,099.600	
	VOLVO AB-B SHS	118,487	80.050	9,484,884.350	
	SWEDISH MATCH AB	19,509	281.300	5,487,881.700	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	68.000	1,652,740.000	
	NORDEA AB	227,871	80.200	18,275,254.200	
	INDUSTRIVARDEN C	10,813	127.300	1,376,494.900	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,296	180.500	3,121,928.000	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	116.500	3,175,906.500	
	INVESTOR AB-B SHS	35,865	264.800	9,497,052.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	78,662	269.000	21,160,078.000	
	ASSA ABLOY AB-B	85,163	151.900	12,936,259.700	
	TELIASONERA AB	194,938	37.930	7,393,998.340	
	LUNDIN PETROLEUM AB	17,555	126.700	2,224,218.500	
	BOLIDEN AB	17,761	111.800	1,985,679.800	
	ALFA LAVAL AB	24,553	133.500	3,277,825.500	
	KINNEVIK INVESTMENT B	18,310	194.000	3,552,140.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,145	357.000	1,836,765.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	248.700	1,472,304.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	31,087	52.650	1,636,730.550	
	HEXAGON AB	18,226	271.400	4,946,536.400	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,830,652		210,550,566.840 (2,836,116,135)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	7,563	590.000	4,462,170.000	
	A P MOLLER A/S	550	7,930.000	4,361,500.000	
	AP MOLLER MAERSK A	291	7,745.000	2,253,795.000	
	DANSKE BANK A/S	60,349	175.000	10,561,075.000	
	NOVOZYMES-B SHS	16,988	275.800	4,685,290.400	
	NOVO NORDISK A/S-B	157,144	321.200	50,474,652.800	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,857	411.300	7,344,584.100	
	TDC A/S	70,447	28.360	1,997,876.920	
	COLOPLAST-B	8,513	489.800	4,169,667.400	
	DSV A/S	14,315	259.400	3,713,311.000	
	WILLIAM DEMANT	2,595	544.000	1,411,680.000	
	TRYG A/S	11,107	116.900	1,298,408.300	
	PANDORA A/S	8,054	771.000	6,209,634.000	

	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	388.200	2,992,245.600	
	ISS A/S	14,618	225.900	3,302,206.200	
デンマーク・クローネ 小計		398,099		109,238,096.720 (1,862,509,549)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	5.680	556,594.560	
	CONTACT ENERGY L	64,605	4.380	282,969.900	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	6.670	493,526.640	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	149,990	3.290	493,467.100	
ニュージーランド・ドル 小計		386,579		1,826,558.200 (137,137,990)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	68,855	92.550	6,372,530.250	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	28.710	3,073,750.020	
	TELENOR ASA	60,554	119.200	7,218,036.800	
	SCHIBSTED ASA	5,731	226.900	1,300,363.900	
	ORKLA ASA	77,644	67.700	5,256,498.800	
	STATOIL ASA	88,513	114.200	10,108,184.600	
	YARA INTERNATIONAL ASA	17,756	316.000	5,610,896.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,642	132.100	1,802,108.200	
	SCHIBSTED ASA	6,671	213.500	1,424,258.500	
ノルウェー・クローネ 小計		446,428		42,166,627.070 (555,334,479)	
ユーロ	CRH PLC	74,912	21.655	1,622,219.360	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	115.000	718,290.000	
	KERRY GROUP PLC-A	11,920	70.250	837,380.000	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.267	587,036.070	
	UMICORE	6,363	36.625	233,044.870	
	AIR LIQUIDE	26,318	93.850	2,469,944.300	
	AIRBUS GROUP SE	44,733	51.310	2,295,250.230	
	AXA	150,698	19.350	2,916,006.300	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,227	20.210	732,147.670	
	ADIDAS AG	16,367	88.140	1,442,587.380	
	ASSICURAZIONI GENERALI	99,122	11.150	1,105,210.300	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	39,703	12.330	489,537.990	
	DANONE	47,942	58.600	2,809,401.200	
	SAFRAN SA	25,619	50.510	1,294,015.690	
	INTESA SANPAOLO	1,029,888	2.396	2,467,611.640	
	INTESA SANPAOLO-RNC	112,465	2.270	255,295.550	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,541	70.260	1,935,030.660	
	ACCOR SA	14,860	31.000	460,660.000	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	5,933	32.300	191,635.900	
	BOUYGUES	15,864	32.010	507,806.640	
BNP PARIBAS	81,517	39.570	3,225,627.690		
RELX NV	80,368	13.785	1,107,872.880		

THALES SA	8,128	61.270	498,002.560	
CAP GEMINI SA	15,271	69.210	1,056,905.910	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,109	40.135	164,914.710	
CHRISTIAN DIOR SE	4,128	153.250	632,616.000	
INGENICO GROUP	4,239	95.800	406,096.200	
UNICREDIT SPA	354,830	3.290	1,167,390.700	
NATIXIS	70,166	4.409	309,361.890	
KONINKLIJKE DSM NV	13,718	42.200	578,899.600	
DELHAIZE GROUP	8,529	88.450	754,390.050	
COMMERZBANK AG	80,064	7.537	603,442.360	
FRESENIUS SE & CO KGAA	29,762	53.820	1,601,790.840	
UNITED INTERNET	12,876	41.400	533,066.400	
FUCHS PETROLUB SE PEF	4,422	34.660	153,266.520	
PUBLICIS GROUPE	14,367	55.620	799,092.540	
MAN SE	3,396	92.190	313,077.240	
IBERDROLA SA	440,361	5.877	2,588,001.590	
ENI SPA	193,698	11.660	2,258,518.680	
IMERYS SA	2,738	52.860	144,730.680	
JERONIMO MARTINS	19,517	12.155	237,229.130	
KBC GROUPE	17,923	46.535	834,046.800	
HANNOVER RUECK SE	4,399	85.710	377,038.290	
WARTSILA OYJ	11,298	36.660	414,184.680	
L'OREAL	19,100	150.150	2,867,865.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,488	146.000	3,137,248.000	
LAGARDERE S.C.A.	14,725	24.675	363,339.370	
GEA GROUP AG	18,086	38.505	696,401.430	
BOLLORE	76,431	3.398	259,712.530	
MEDIOBANCA SPA	42,404	5.865	248,699.460	
MICHELIN(CGDE)-B	14,584	79.210	1,155,198.640	
CONTINENTAL AG	8,194	178.950	1,466,316.300	
DEUTSCHE POST AG-REG	75,581	19.870	1,501,794.470	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	31.490	295,974.510	
AXEL SPRINGER SE	3,067	43.425	133,184.470	
OMV AG	9,779	23.450	229,317.550	
PERNOD-RICARD	18,470	93.310	1,723,435.700	
PEUGEOT SA	33,969	11.940	405,589.860	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,007	37.440	449,542.080	
RENAULT SA	14,323	68.330	978,690.590	
REPSOL SA	78,034	8.788	685,762.790	
REMY COINTREAU	905	58.910	53,313.550	
MERCK KGAA	9,627	73.480	707,391.960	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	65,276	102.300	6,677,734.800	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,989	33.010	1,187,996.890	
SAIPEM	12,974	0.301	3,905.170	
RWE AG	41,149	11.410	469,510.090	

ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	13,658	50.550	690,411.900	
SOCIETE GENERALE-A	59,007	28.400	1,675,798.800	
VINCI S.A.	36,668	58.630	2,149,844.840	
SODEXO	7,368	83.630	616,185.840	
SOLVAY SA	5,034	74.500	375,033.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,735	46.030	1,921,062.050	
VIVENDI SA	90,768	17.235	1,564,386.480	
SAP SE	80,396	65.290	5,249,054.840	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	6,985	40.000	279,400.000	
TELEFONICA S.A	380,757	8.716	3,318,678.010	
TOTAL SA	170,265	38.000	6,470,070.000	
VALEO	7,056	104.600	738,057.600	
E.ON SE	182,365	8.450	1,540,984.250	
VOEST-ALPINE AG	9,875	25.450	251,318.750	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	17.895	273,471.390	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	79.460	684,468.440	
METRO AG	15,629	23.145	361,733.200	
SIEMENS AG-REG	62,794	80.650	5,064,336.100	
UPM-KYMMENE OYJ	38,638	14.140	546,341.320	
ING GROEP NV-CVA	296,220	9.773	2,894,958.060	
BAYER AG	64,911	94.770	6,151,615.470	
STORA ENSO OYJ-R SHS	44,611	6.785	302,685.630	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,837	91.700	1,360,552.900	
DAIMLER AG	73,572	60.910	4,481,270.520	
BASF SE	73,655	57.850	4,260,941.750	
BEIERSDORF AG	9,149	78.390	717,190.110	
HEIDELBERGCEMENT AG	10,251	62.970	645,505.470	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,988	73.810	1,327,694.280	
ORANGE	148,319	14.895	2,209,211.500	
SAMPO OYJ-A SHS	33,916	37.840	1,283,381.440	
RANDSTAD HOLDINGS	8,654	41.990	363,381.460	
ALLIANZ SE	37,602	129.000	4,850,658.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.745	524,553.030	
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,600	19.180	1,354,108.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,917	42.215	714,151.150	
HERMES INTL	2,185	299.000	653,315.000	
ENDESA S.A.	27,930	15.750	439,897.500	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	28,244	12.395	350,084.380	
ERSTE GROUP BANK AG	21,896	23.905	523,423.880	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,853	164.100	2,273,277.300	
ARCELOR MITTAL (NL)	76,767	2.845	218,402.110	
SOCIETE BIC SA	2,165	134.150	290,434.750	
DASSAULT SYSTEMES SA	9,429	65.760	620,051.040	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,099	19.540	275,494.460	
HEINEKEN NV	19,424	71.460	1,388,039.040	
AKZO NOBEL	18,274	50.170	916,806.580	
ASML HOLDING NV	25,963	72.170	1,873,749.710	
AEGON NV	144,321	4.120	594,602.520	
BANKINTER S.A.	52,241	5.846	305,400.880	
VOLKSWAGEN AG	2,794	110.600	309,016.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,091	95.200	1,341,463.200	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	482,863	5.502	2,656,712.220	
KERING	6,033	145.700	879,008.100	
FORTUM OYJ	46,085	11.450	527,673.250	
AGEAS	14,964	32.790	490,669.560	
UCB SA	10,367	73.490	761,870.830	
THYSSENKRUPP AG	29,522	14.020	413,898.440	
UNILEVER NV-CVA	132,890	37.670	5,005,966.300	
CARREFOUR SA	51,966	22.630	1,175,990.580	
GAS NATURAL SDG SA	38,086	15.265	581,382.790	
ATOS SE	6,025	62.900	378,972.500	
NOKIA OYJ	439,256	5.225	2,295,112.600	
TUI AG	19,196	12.995	249,452.020	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	72,718	21.000	1,527,078.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	28.865	712,128.410	
SANOFI	92,276	68.800	6,348,588.800	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	4.737	279,530.370	
ELISA OYJ	13,644	30.940	422,145.360	
BANCO SANTANDER SA	1,159,051	3.482	4,035,815.580	
METSO OYJ	10,879	18.930	205,939.470	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	8,282	69.860	578,580.520	
QIAGEN N.V.	19,737	18.380	362,766.060	
LINDE AG	13,880	119.200	1,654,496.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	103,124	15.300	1,577,797.200	
BMW VORZUG	4,116	59.990	246,918.840	
K & S	13,745	17.935	246,516.570	
ZARDOYA OTIS	28,325	8.420	238,496.500	
ENEL SPA	611,051	3.538	2,161,898.430	
COLRUYT NV	4,673	47.375	221,383.370	
VOPAK (KON.)	5,364	36.970	198,307.080	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,385,733	0.032	108,343.450	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	267,546	14.570	3,898,145.220	
BANCO POPULAR ESPANOL	118,655	2.084	247,277.020	
FINMECCANICA SPA	34,431	8.860	305,058.660	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	82,012	10.500	861,126.000	
KONINKLIJKE KPN NV	257,686	3.267	841,860.160	
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.722	158,410.220	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,463	71.410	1,032,802.830	

EURAZEO	3,870	49.640	192,106.800	
BANCO SABADELL	410,991	1.414	581,141.270	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,276	65.950	545,802.200	
FRAPORT AG	3,149	50.100	157,764.900	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	63.290	507,206.060	
INDITEX	89,590	27.110	2,428,784.900	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	195,575	0.459	89,768.920	
JC DECAUX SA	5,728	32.730	187,477.440	
ANDRITZ AG	4,704	39.420	185,431.680	
MAPFRE SA	80,219	1.710	137,174.490	
ESSILOR INTL	17,154	104.100	1,785,731.400	
SNAM SPA	158,640	4.798	761,154.720	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	7.993	684,080.900	
ENAGAS	16,043	24.755	397,144.460	
WENDEL	1,994	81.030	161,573.820	
TENARIS SA	33,458	9.330	312,163.140	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	3.284	246,148.930	
TELECOM ITALIA SPA	873,707	0.859	750,514.310	
TELECOM ITALIA-RNC	615,947	0.680	418,843.960	
ATLANTIA SPA	33,870	22.600	765,462.000	
ILIAD SA	2,102	210.150	441,735.300	
PROXIMUS	13,498	29.415	397,043.670	
SES FDR	24,850	22.105	549,309.250	
TERNA SPA	110,846	4.604	510,334.980	
GRIFOLS SA	20,422	18.000	367,596.000	
FERROVIAL SA	43,345	17.565	761,354.920	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	34.160	234,200.960	
EXOR SPA	6,823	26.070	177,875.610	
NESTE OYJ	10,692	26.150	279,595.800	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	8,947	10.850	97,074.950	
KONE OYJ	25,273	37.360	944,199.280	
ENGIE	132,035	13.350	1,762,667.250	
ALSTOM	17,252	20.120	347,110.240	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	44.060	221,401.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	18,706	27.340	511,422.040	
ELECTRICITE DE FRANCE	38,234	10.430	398,780.620	
DEUTSCHE WOHNEN AG	23,808	23.475	558,892.800	
ARKEMA SA	5,658	49.370	279,335.460	
LEGRAND SA	20,657	42.340	874,617.380	
ADP	2,313	100.600	232,687.800	
ORION OYJ	8,051	28.560	229,936.560	
RTL GROUP SA	2,768	69.920	193,538.560	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	10.270	349,364.860	

SYMRISE AG	9,463	55.570	525,858.910	
SCOR SE	17,385	29.450	511,988.250	
REXEL SA	20,799	8.528	177,373.870	
PRYSMIAN SPA	14,445	16.640	240,364.800	
BANCO POPOLARE SC	29,282	7.185	210,391.170	
CAIXABANK	202,918	2.475	502,222.050	
BUREAU VERITAS SA	23,255	16.505	383,823.770	
GROUPE EUROTUNNEL SE	51,096	9.515	486,178.440	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	34,238	15.840	542,329.920	
ENGIE	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	33,641	34.150	1,148,840.150	
TNT EXPRESS NV W/I	44,157	7.904	349,016.920	
ENEL GREEN POWER SPA	188,905	1.707	322,460.830	
BRENTAG AG	11,108	41.180	457,427.440	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	67,082	6.180	414,566.760	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	38,477	4.650	178,918.050	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,928	25.805	256,192.040	
EDENRED	18,682	14.060	262,668.920	
BANKIA SA	330,088	0.740	244,265.120	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	39,139	4.319	169,041.340	
HUGO BOSS AG -ORD	5,197	64.300	334,167.100	
OSRAM LICHT AG	7,598	37.545	285,266.910	
GEMALTO	5,952	51.260	305,099.520	
VONOVIA SE	42,578	26.490	1,127,891.220	
FERRARI NV	12,402	30.040	372,556.080	
CNH INDUSTRIAL NV	67,754	5.590	378,744.860	
NUMERICABLE-SFR	9,058	30.000	271,740.000	
NN GROUP NV	20,757	27.700	574,968.900	
ZALANDO SE	6,674	27.470	183,334.780	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	5.435	381,047.850	
AENA SA	5,256	95.560	502,263.360	
ALTICE NV-A	41,585	11.370	472,821.450	
LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	32.260	455,027.300	
ユーロ 小計	21,539,413		230,346,127.420 (29,318,455,098)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	17,100	61.500	1,051,650.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	13.320	3,343,320.000	
BANK OF EAST ASIA	111,660	22.550	2,517,933.000	
CLP HOLDINGS LTD	155,000	66.250	10,268,750.000	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	11.360	976,960.000	
LI & FUNG LTD	532,400	4.620	2,459,688.000	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	76.050	3,726,450.000	

HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,640	163.000	15,426,320.000	
MTR CORP	103,000	35.550	3,661,650.000	
HANG SENG BANK LTD	57,100	124.100	7,086,110.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	85,657	38.850	3,327,774.450	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	102,500	72.050	7,385,125.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	119,750	36.300	4,346,925.000	
HONG KONG & CHINA GAS	560,535	13.660	7,656,908.100	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	23.250	4,394,250.000	
KERRY PROPERTIES LTD	65,000	17.540	1,140,100.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	344,500	18.980	6,538,610.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	54,000	25.650	1,385,100.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	643,266	6.050	3,891,759.300	
SINO LAND CO	255,400	10.120	2,584,648.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	80.800	11,231,200.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	71.700	3,047,250.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	28.050	2,538,525.000	
WHEELOK & CO LTD	76,000	28.050	2,131,800.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	5.140	1,007,440.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	7.770	1,317,792.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	8.910	374,220.000	
AIA GROUP LTD	980,027	37.250	36,506,005.750	
HKT TRUST / HKT LTD	178,000	10.360	1,844,080.000	
SANDS CHINA LTD	179,600	24.750	4,445,100.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	19.520	2,033,984.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	270,000	6.370	1,719,900.000	
WH GROUP LTD	530,500	4.240	2,249,320.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	221,332	91.950	20,351,477.400	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	236,332	39.000	9,216,948.000	
香港・ドル 小計	7,332,099		193,185,073.000 (2,810,842,812)	
合計	96,226,391		233,333,927,515 (233,333,927,515)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28年2月15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	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	631,330.220	
		GOODMAN GROUP	128,133.000	813,644.550	
		GPT GROUP	131,618.000	642,295.840	
		LENLEASE GROUP	46,860.000	541,233.000	

		MIRVAC GROUP	407,090.000	747,010.150	
		SCENTRE GROUP	412,770.000	1,795,549.500	
		STOCKLAND	163,015.000	650,429.850	
		VICINITY CENTRES	252,110.000	736,161.200	
		WESTFIELD CORP	140,072.000	1,339,088.320	
	オーストラリア・ドル	小計	1,769,597.000	7,896,742.630 (636,951,261)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	276,306.000	649,319.100	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	280,630.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	407,950.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	297,755.000	
	シンガポール・ドル	小計	878,406.000	1,635,654.100 (132,733,330)	
投資信託受益証券 合計			2,648,003	769,684,591 (769,684,591)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,741.000	451,239.730	
		AMERICAN TOWER CORP	33,923.000	2,906,183.410	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	754,347.440	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,455.000	1,719,011.100	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,437.000	1,242,172.570	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13,569.000	307,473.540	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	450,697.350	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,026.000	2,163,541.380	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,854.000	860,070.960	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	551,214.180	
		EQUINIX INC	5,413.000	1,542,055.440	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,730.000	1,976,871.700	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,825.000	943,480.500	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,578.000	698,163.420	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	831,813.490	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	48,619.000	1,242,701.640	
		HCP INC	36,231.000	951,426.060	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	838,465.320	
		IRON MOUNTAIN INC	13,906.000	381,024.400	
		KIMCO REALTY	32,980.000	867,044.200	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	10,299.000	286,621.170	
		PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	480,805.520	
		PROLOGIS INC	40,935.000	1,476,525.450	
		PUBLIC STORAGE	11,398.000	2,662,686.780	

	REALTY INCOME CORP	16,761.000	1,013,705.280	
	REGENCY CENTERS CORP	9,409.000	656,371.840	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24,449.000	4,487,124.970	
	SL GREEN	7,116.000	576,467.160	
	THE MACERICH COMPANY	10,631.000	800,407.990	
	UDR INC	21,797.000	727,801.830	
	VENTAS INC	24,973.000	1,209,442.390	
	VEREIT INC	65,404.000	477,449.200	
	VORNADO REALTY TRUST	13,114.000	1,063,938.820	
	WELLTOWER INC	26,264.000	1,428,761.600	
	WEYERHAEUSER CO	44,589.000	1,007,711.400	
アメリカ・ドル 小計		827,232.000	40,034,819.230 (4,537,146,063)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	90,641.000	591,432.520	
	HAMMERSON PLC	79,855.000	427,224.250	
	INTU PROPERTIES PLC	59,605.000	164,390.590	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	629,780.760	
	SEGRO PLC	82,229.000	337,303.350	
イギリス・ポンド 小計		375,561.000	2,150,131.470 (353,718,128)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	198,623.040	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	390,159.000	
カナダ・ドル 小計		26,512.000	588,782.040 (48,233,025)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	182,528.640	
	GECINA SA	2,710.000	289,428.000	
	ICADE	3,001.000	179,699.880	
	KLEPIERRE	15,834.000	576,515.940	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,861.000	1,899,798.400	
ユーロ 小計		32,998.000	3,127,970.860 (398,128,131)	
香港・ドル	LINK REIT	172,500.000	7,408,875.000	
香港・ドル 小計		172,500.000	7,408,875.000 (107,799,131)	
投資証券 合計		1,434,803	5,445,024,478 (5,445,024,478)	
合計			6,214,709,069 (6,214,709,069)	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における () 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 601銘柄	62.24%	-%	-%	64.95%
	投資証券 35銘柄	-%	-%	1.87%	
イギリス・ポンド	株式 107銘柄	7.89%	-%	-%	8.14%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.15%	
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.27%	-%	-%	0.27%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.49%	-%	-%	2.79%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.26%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.48%	-%	-%	3.55%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 19銘柄	0.46%	-%	-%	0.52%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.05%	-%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.86%	-%	-%	3.91%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.17%	-%	-%	1.18%
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.77%	-%	-%	0.78%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.23%	-%	-%	0.23%
ユーロ	株式 232銘柄	12.08%	-%	-%	12.41%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.16%	
香港・ドル	株式 35銘柄	1.16%	-%	-%	1.22%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.04%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 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

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成28年2月29日現在

資産総額	85,780,562,316円
負債総額	72,427,523円
純資産総額（ - ）	85,708,134,793円
発行済数量	33,989,478,508口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5216円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年2月29日現在

資産総額	253,668,429,468円
負債総額	126,320,887円
純資産総額（ - ）	253,542,108,581円
発行済数量	101,449,615,942口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4992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

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ます。委託会社は、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、委託会社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) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社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、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(5) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

本書提出日現在の資本金の額	20億円
発行する株式総数	80,000株
発行済株式総数	24,000株

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後2年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役会長1名、取締役社長1名、取締役副社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

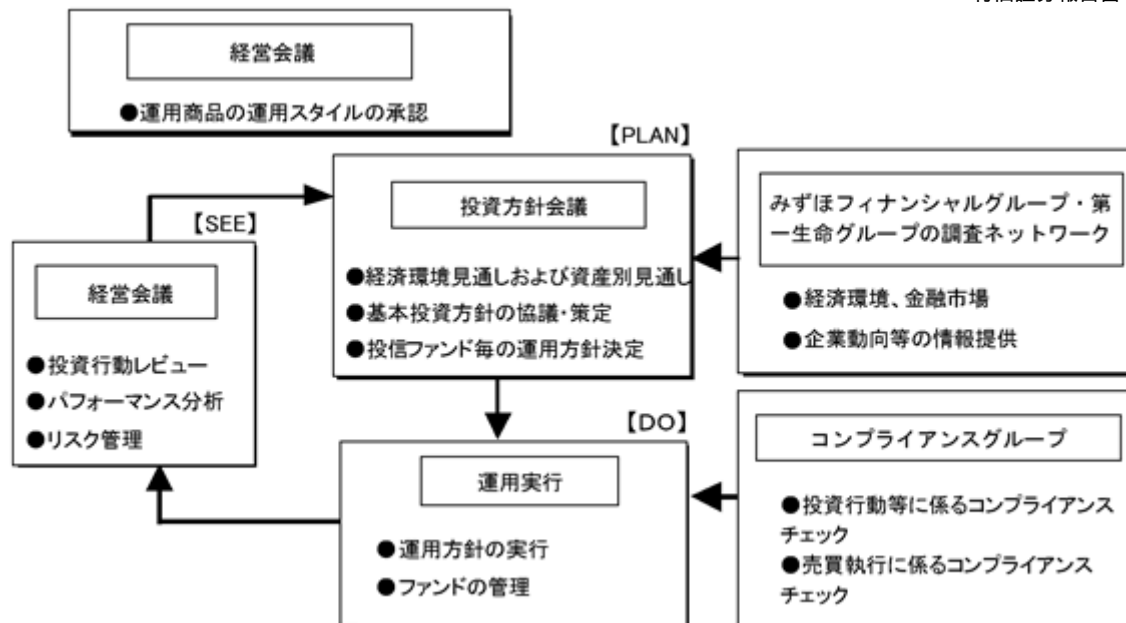
投資運用の意思決定機構

委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

ファンド全般に係る経済環境見通しおよび資産別市場見通しならびにファンド毎の運用方針は、投資方針会議において協議し、策定します。投資方針会議は原則として月1回開催され、議長は運用部門担当取締役とします。

各ファンドにおける有価証券の売買等の意思決定は、原則として運用担当者が行います。すなわち、運用担当者は、投資方針会議において決定された運用方針を受けて、各ファンドの投資方針に基づき運用計画を策定し、有価証券への運用指図を行います。

運用担当者による運用計画の策定および有価証券等の運用指図に関する意思決定は、運用担当者自身の調査活動、アナリスト等の調査活動、その他の活動によって得られた当該有価証券等に関する情報に基づいて行われ、それらの活動の成果である各ファンドの投資運用の実績は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月1回検討・評価されます。



上記体制は平成28年2月29日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「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り、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」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成28年2月29日現在、委託会社の運用する投資信託は415本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	5	23,629,020,732
追加型株式投資信託	370	5,576,357,548,539
単位型公社債投資信託	40	294,039,557,704
追加型公社債投資信託	0	0
合計	415	5,894,026,126,975

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A M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）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。

また、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）、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金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、第30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	617,159	613,137
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	760,493	1,605,579
未払金	1,972,562	2,515,377
未払償還金	51,109	49,873
未払手数料	1,554,065	1,836,651
その他未払金	367,387	628,852
未払費用	2 1,466,924	2 2,196,267
未払法人税等	1,721,861	1,539,263
未払消費税等	195,272	671,243
賞与引当金	668,366	722,343
その他	10,000	30,000
流動負債計	6,795,481	9,280,074
固定負債		
退職給付引当金	947,759	868,928
役員退職慰労引当金	136,010	110,465
固定負債計	1,083,769	979,394
負債合計	7,879,251	10,259,468
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	22,488,744	25,417,784
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	17,130,000	19,480,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	4,735,451	5,314,491
株主資本計	26,917,222	29,846,262
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	243,159	252,905
評価・換算差額等計	243,159	252,905
純資産合計	27,160,381	30,099,168
負債・純資産合計	35,039,633	40,358,637

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第29期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	25,437,511		28,170,831	
運用受託報酬	6,328,414		7,064,021	
投資助言報酬	926,837		1,032,659	
その他営業収益	835,020		828,240	
営業収益計		33,527,783		37,095,752
営業費用				
支払手数料	11,284,530		12,416,659	
広告宣伝費	316,226		527,620	
公告費	319		288	
調査費	5,226,606		6,317,052	
調査費	3,635,440		4,129,778	
委託調査費	1,591,166		2,187,273	
委託計算費	356,496		385,121	
営業雑経費	540,260		488,963	
通信費	32,834		34,089	
印刷費	466,075		414,215	
協会費	25,048		24,177	
諸会費	38		37	
支払販売手数料	16,264		16,443	
営業費用計		17,724,440		20,135,705
一般管理費				
給料	5,009,676		5,260,910	
役員報酬	255,603		242,666	
給料・手当	4,171,884		4,378,307	
賞与	582,188		639,936	
交際費	34,917		37,625	
寄付金	2,515		2,697	
旅費交通費	232,436		242,164	
租税公課	103,775		127,947	
不動産賃借料	683,633		686,770	
退職給付費用	221,376		218,863	
固定資産減価償却費	561,503		628,056	
福利厚生費	32,812		33,310	
修繕費	9,184		13,807	
賞与引当金繰入額	668,366		722,343	
役員退職慰労引当金繰入額	47,298		50,327	
役員退職慰労金	6,528		25,501	
機器リース料	35		87	
事務委託費	215,100		231,303	
事務用消耗品費	67,394		67,208	
器具備品費	3,191		5,869	
諸経費	118,672		135,032	
一般管理費計		8,018,417		8,489,827
営業利益		7,784,925		8,470,220

（単位：千円）

	第29期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	15,024		17,346	
受取利息	2,318		2,404	
時効成立分配金・償還金	33,872		974	
為替差益	-		652	
雑収入	4,746		1,822	
営業外収益計		55,962		23,200
営業外費用				
為替差損	7,364		-	
金銭の信託運用損	213,744		163,033	
時効成立後支払分配金・償還金	-		65	
外国税支払損失	-		47,515	
雑損失	10,952		-	
営業外費用計		232,061		210,614
経常利益		7,608,826		8,282,806
特別損失				
固定資産除却損	1	22	1	12,988
固定資産売却損	2	1,448	2	-
ゴルフ会員権売却損		-		1,080
関係会社株式評価損		-		202,477
特別損失計		1,470		216,547
税引前当期純利益		7,607,355		8,066,259
法人税、住民税及び事業税		2,934,516		2,969,684
法人税等調整額		13,207		29,428
法人税等合計		2,921,308		2,940,256
当期純利益		4,686,047		5,126,003

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
会計方針の変 更による累積 的影響額									
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金の 積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
会計方針の変 更による累積 的影響額		
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の配当		3,096,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	139,391	139,391
当期変動額合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変 更による累積 的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の 積立				2,350,000			2,350,000	-	-
当期純利益							5,126,003	5,126,003	5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	448,003	2,798,003	2,798,003
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262

	評価・換算 差額等	純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変 更による累積 的影響額		131,037
会計方針の変更 を反映した当期 首残高	243,159	27,291,419
当期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の 積立		-
当期純利益		5,126,003
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	9,746	9,746
当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

重要な会計方針

項目	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算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) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 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。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。また、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は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度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（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ9,168千円増加しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
建物	562,127	582,075
車両運搬具	3,308	3,981
器具備品	664,016	735,461
商標権	742	836
ソフトウェア	1,502,289	2,015,473
電信電話専用施設利用権	1,365	1,408

2. 関係会社項目

関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。

（千円）

		第29期 （平成26年3月31日現在）	第30期 （平成27年3月31日現在）
流動資産	未収投資助言報酬	255,084	311,994
流動負債	未払費用	392,646	492,035

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	22	0
ソフトウェア	0	12,988

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

	第29期 （自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）	第30期 （自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
器具備品	1,448	-

（株主資本等変動計算書関係）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

第30期（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

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成27年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(金融商品関係)

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

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブ取引は、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等でありませ

金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替及び市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰計画を確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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含まれておりません（（注2）参照）。

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	11,487,360	11,487,360	-
(2) 金銭の信託	10,952,459	10,952,459	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	536,913	536,913	-
資産計	22,976,732	22,976,732	-
(1) 未払法人税等	1,721,861	1,721,861	-
負債計	1,721,861	1,721,861	-

第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額に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

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 投資有価証券

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、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額に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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
差入保証金	731,197	733,907

非上場株式は、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、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、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、記載しておりません。

当事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(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

第29期（平成26年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	11,486,870	-	-	-
合計	11,486,870	-	-	-

第30期（平成27年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額
該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円、第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	522,887	146,101	376,785
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,551	3,000	1,551
小計	527,439	149,101	378,337
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	9,474	10,000	526
小計	9,474	10,000	526
合計	536,913	159,101	377,811

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

区 分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	532,891	159,101	373,789

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	10,952,459	1,628,835

第30期（平成27年3月31日現在）

	貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円）	当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円）
運用目的の金銭の信託	14,169,657	2,544,066

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

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退職一時金制度(非積立型制度であります)を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

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

(千円)

	第29期 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	936,125	1,079,828
会計方針の変更による累積的影響額	-	203,600
会計方針の変更を反映した期首残高	936,125	876,227
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の発生額	14,996	10,345
退職給付の支払額	34,684	49,633
過去勤務費用の発生額	24,260	-
退職給付債務の期末残高	1,079,828	973,035

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828	973,035
未積立退職給付債務	1,079,828	973,035
未認識数理計算上の差異	112,660	89,550
未認識過去勤務費用	19,408	14,556
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928
退職給付引当金	947,759	868,928
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759	868,928

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
勤務費用	124,724	128,297
利息費用	14,405	7,798
数理計算上の差異の費用処理額	35,858	33,455
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840	174,402

(4) 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

	第29期	第30期
	(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
割引率	1.5%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第29期事業年度41,536千円、第30期事業年度43,461千円であり
ます。

（税効果会計関係）

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

	第29期	第30期
	(平成26年3月31日現在)	(平成27年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	123,518	118,238
未払事業所税	5,841	5,527
賞与引当金	238,205	239,095
未払法定福利費	31,036	30,557
未払確定拠出年金掛金	2,724	2,650
外国税支払損失	-	15,727
減価償却超過額（一括償却資産）	3,183	2,158
減価償却超過額	152,470	130,844
繰延資産償却超過額（税法上）	10,908	2,710
退職給付引当金	337,781	281,232
役員退職慰労引当金	48,474	35,724
ゴルフ会員権評価損	2,138	1,940
関係会社株式評価損	121,913	176,106
繰延税金資産合計	1,078,198	1,042,515
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	54,172	47,855
繰延税金負債合計	54,172	47,855
差引繰延税金資産の純額	1,024,025	994,659

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要な項目別の内訳

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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。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35.64%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33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は89,582千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は94,466千円増加し、その他有価証券評価差額金は12,335千円増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2．関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	25,437,511	7,255,251	835,020	33,527,783

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する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、記載を省略しております。

有形固定資産

当社は、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、記載を省略しております。

（3）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

	投資信託 （千円）	投資顧問 （千円）	その他 （千円）	合計 （千円）
営業収益	28,170,831	8,096,680	828,240	37,095,752

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する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、記載を省略しております。

有形固定資産

当社は、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、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険 株式会 社	東京都 千代田 区	2,102 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	801,412	未収投資 助言報酬	212,159

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険 株式会 社	東京都 千代田 区	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接 50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	627,855	未払費用	224,758
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	251,110	未払費用	97,587

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	658,756	未払費用	235,583
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	383,980	未払費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000千円	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	増資の引受	400,000	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その 他 の 関 係 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行 (旧株式 会社みず ほコーポ レート銀 行)	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	1,629,874	未払 手数料	224,525
								預金の預入 (純額)	775,579	現金・ 預金	10,724,847
								受取利息	2,073	未収 収益	12
	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	7,000 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	432,201	-	-
							預金の引出 (純額)	203,876			
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	287,136	未払 費用	155,413
							業務委託料 の支払	11,810	未払金	2,646	
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)	1,000,000	金銭の 信託	10,952,459
							信託報酬の 支払	7,933			

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係 会社 の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	2,217,439 551,351 2,139	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	306,365 11,276,198 71
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	407,531 8,540	未払 費用 未払金	240,725 6,501
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額) 信託報酬の 支払	3,500,000 8,254	金銭の 信託	14,169,657

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- (注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- (注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	1,131,682円58銭	1,254,132円02銭
1株当たり当期純利益金額	195,251円97銭	213,583円46銭

(注1) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,686,047千円	5,126,003千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(注3) 「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の1株当たり純資産額が5,718円34銭増加し、1株当たり当期純利益金額が258円46銭増加しております。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,613,571
金銭の信託		14,000,363
前払費用		141,040
未収委託者報酬		4,528,913
未収運用受託報酬		2,131,544
未収投資助言報酬		268,863
未収収益		240,459
繰延税金資産		392,452
その他		37,555
	流動資産計	32,354,763
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	200,557
車両運搬具	1	745
器具備品	1	246,491
無形固定資産		
商標権	1	54
ソフトウェア	1	1,688,242
ソフトウェア仮勘定		142,901
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	167
投資その他の資産		
投資有価証券		574,051
関係会社株式		2,316,596
繰延税金資産		600,727
差入保証金		771,427
その他		90,932
	固定資産計	6,640,044
資産合計		38,994,807

（単位：千円）

	第31期中間会計期間末 （平成27年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	956,031
未払金	2,105,195
未払収益分配金	44
未払償還金	49,873
未払手数料	1,770,062
その他未払金	285,213
未払費用	1,927,420
未払法人税等	1,486,583
未払消費税等	289,515
賞与引当金	724,368
その他	20,000
流動負債計	7,509,114
固定負債	
退職給付引当金	920,913
役員退職慰労引当金	137,750
固定負債計	1,058,663
負債合計	8,567,778
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	25,771,823
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	22,030,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	3,118,530
株主資本計	30,200,301
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	226,727
評価・換算差額等計	226,727
純資産合計	30,427,029
負債・純資産合計	38,994,807

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日至平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	15,465,477	
運用受託報酬	3,695,539	
投資助言報酬	510,549	
その他営業収益	383,893	
	営業収益計	20,055,459
営業費用		
支払手数料	6,672,717	
広告宣伝費	217,738	
公告費	129	
調査費	3,678,769	
調査費	2,272,268	
委託調査費	1,406,500	
委託計算費	207,057	
営業雑経費	280,193	
通信費	17,208	
印刷費	226,482	
協会費	11,849	
諸会費	17	
支払販売手数料	24,635	
	営業費用計	11,056,605
一般管理費		
給料	2,351,238	
役員報酬	121,094	
給料・手当	2,230,144	
交際費	19,774	
寄付金	2,156	
旅費交通費	119,653	
租税公課	94,838	
不動産賃借料	363,395	
退職給付費用	114,178	
固定資産減価償却費	1 362,235	
福利厚生費	10,385	
修繕費	30,844	
賞与引当金繰入額	724,368	
役員退職慰労引当金繰入額	27,285	
機器リース料	76	
事務委託費	137,814	
事務用消耗品費	33,473	
器具備品費	14,115	
諸経費	84,703	
	一般管理費計	4,490,538
営業利益		4,508,315

（単位：千円）

	第31期中間会計期間 （自平成27年4月1日至平成27年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	8,323	
受取利息	1,015	
雑収入	5,491	
		営業外収益計 14,830
営業外費用		
為替差損	3,664	
金銭の信託運用損	166,406	
		営業外費用計 170,070
経常利益		4,353,076
特別損失		
固定資産除却損	182	
固定資産売却損	2,654	
ゴルフ会員権評価損	3,806	
		特別損失計 6,642
税引前中間純利益		4,346,433
法人税、住民税及び事業税		1,434,006
法人税等調整額		14,388
法人税等合計		1,448,394
中間純利益		2,898,038

(3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							2,898,038	2,898,038	2,898,038
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	-	-	-	2,550,000	-	-	2,195,961	354,038	354,038
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	3,118,530	25,771,823	30,200,301

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	252,905	30,099,168
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の 積立		-
中間純利益		2,898,038
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)	26,178	26,178
当中間期変動額 合計	26,178	327,860
当中間期末残高	226,727	30,427,029

重要な会計方針

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
1. 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） 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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 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）に基づく定額法を採用しております。
5. 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勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、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。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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方式によっております。

追加情報

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
<p>当社は、平成27年9月30日開催の取締役会の決議に基づき、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」)の資産運用部門、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」)、及び新光投信株式会社(以下「新光投信」)の機能統合に向けた具体的な準備を開始すべく、同日付で当社、TB、MHAM及び新光投信の間で「統合基本合意書」を締結いたしました。今後、統合に必要な各社の取締役会決議及び株主総会決議、国内外の関係当局への届出、許認可の取得等を前提として、平成28年度上期中の統合を予定しております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 30%; text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)						
1. 減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 30%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 60%; text-align: right;">68,441千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">293,794千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	68,441千円	無形固定資産	...	293,794千円
有形固定資産	...	68,441千円					
無形固定資産	...	293,794千円					

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	10,613,571	10,613,571	-
(2) 金銭の信託	14,000,363	14,000,363	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	493,805	493,805	-
資産計	25,107,739	25,107,739	-
(1) 未払法人税等	1,486,583	1,486,583	-
負債計	1,486,583	1,486,583	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額に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

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 投資有価証券

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、投資信託は基準価額によっております。

負債

(1) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額に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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,316,596
差入保証金	771,427

非上場株式は、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、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、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、時価開示の対象としておりません。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃貸契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)			
1. 満期保有目的の債券 該当事項はありません。			
2. 子会社株式及び関連会社株式 関係会社株式(中間貸借対照表計上額2,316,596千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
3. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	477,924	146,101	331,822
債券	-	-	-
その他(投資信託)	15,880	13,000	2,880
小計	493,805	159,101	334,703
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	-	-	-
小計	-	-	-
合計	493,805	159,101	334,703
(注)非上場株式(中間貸借対照表計上額80,246千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

(金銭の信託関係)

第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)
1. 満期保有目的の金銭の信託 該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託(運用目的及び満期保有目的以外) 該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2．関連情報

(1) サービスごとの情報

	投資信託 (千円)	投資顧問 (千円)	その他 (千円)	合計 (千円)
営業収益	15,465,477	4,206,088	383,893	20,055,459

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する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、記載を省略しております。

有形固定資産

当社は、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、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で中間損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

(1株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)		
1株当たり純資産額	1,267,792円	89銭
1株当たり中間純利益金額	120,751円	62銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。		

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
中間純利益	2,898,038千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,898,038千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第31期中間会計期間
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

当社は、平成27年9月25日開催の取締役会において、子会社であるDIAM International Ltdの増資引受を決議いたしました。

1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「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。

- (1) 自己またはその取締役も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、もしくは取引の公正を害し、また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。)
- (2) 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、もしくは取引の公正を害し、また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。)
- (3) 通常の実行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、委託会社の親法人等(委託会社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(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社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または金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等また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、運用財産の額も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。
- (5) 上記(3) (4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、もしくは取引の公正を害し、また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) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・公告の方法の変更(電子公告(ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告をすることができない場合は、日本経済新聞に掲載して行う。)に変更)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社及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)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

平成27年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	343,104	日本において保険業務を営んでおります。
株式会社SBI証券	47,937	「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おります。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000	「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おります。

(注) 資本金の額は平成27年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2)信託財産の計算
- (3)信託財産に関する報告書の作成
- (4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

第一生命保険株式会社は、委託会社の株式を12,000株（持株比率50.00%）所有しています。

この他に、委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間の間に、次の書類を提出いたしました。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成27年5月15日
有価証券報告書	平成27年5月15日
半期報告書	平成27年11月16日
有価証券届出書の訂正届出書	平成27年11月16日

独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A M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	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印

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D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30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、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年3月31日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
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D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 > の平成27年2月17日から平成28年2月15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、D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 > の平成28年2月15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

D I A M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

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。

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25日

D I A M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	山内 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印

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D I A M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31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的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、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。