

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券報告書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成26年4月14日
<b>【計算期間】</b>	第7期（自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14日）
<b>【ファンド名】</b>	マネックス資産設計ファンド<育成型>
<b>【発行者名】</b>	D I A Mアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 中島 敬雄
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	大楽 信雄
<b>【連絡場所】</b>	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
<b>【電話番号】</b>	03-3287-3110
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。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 世界の6資産（国内外の株式・債券・リート）に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。



#### ●各資産への投資は各資産の市場を代表する指数に連動する投資成果をめざすファンド（マザーファンド）を通じて行います。

投資対象のマザーファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	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)
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)

※不動産投信等をリート(REIT)と呼びます。また、リート(REIT)はReal Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。

※パッシブ・ファンドとは市場(インデックス)そのものに連動する投資成果をめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

※グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用指図等に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。

※当ファンドはファミリーファンド方式により運用します。また、上記マザーファンドには運用管理費用(信託報酬)はかかりません。

### 2 基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。

#### ●基本資産配分比率は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

※分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への基本配分比率は50%以下にしております\*。

※時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。

※ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

\*2013年12月末時点

**3 購入時手数料、換金手数料がかからないノーロードファンドです。運用管理費用（信託報酬）は信託財産の純資産総額に対して年率1.026%（税抜0.95%）と、低水準に設定しました。**

●換金価額は、基準価額から信託財産留保額（換金申込日の翌営業日の基準価額の0.3%）を差し引いた価額となります。

**4 「育成型」（自動けいそく投資専用）のファンドです。**

信託財産の成長を重視します。分配金は、決算ごとに原則として経費控除後の利子・配当等収益の範囲内から支払われ、税引後、自動的に無手数料で全額再投資されます。

※決算は原則として毎年1月11日（休業日の場合は翌営業日。）です。

●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。

**5 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。**

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	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 （ ）	
		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

「内外」とは目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 投資対象資産

「資産複合」とは目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 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 (日本を含む)  日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア	ファミリー ファンド	あり ( )	TOPIX
クレジット属性 ( )	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ( )	中南米  アフリカ	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、NOMURA-BPI総合、シティグループ世界国債インデックス、東証REIT指数、S&P先進国REITインデックス)
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信、)資産配分変更型))		中近東 (中東)  エマージング			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

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（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型）」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、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）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資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））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（日本を含む）」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含む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

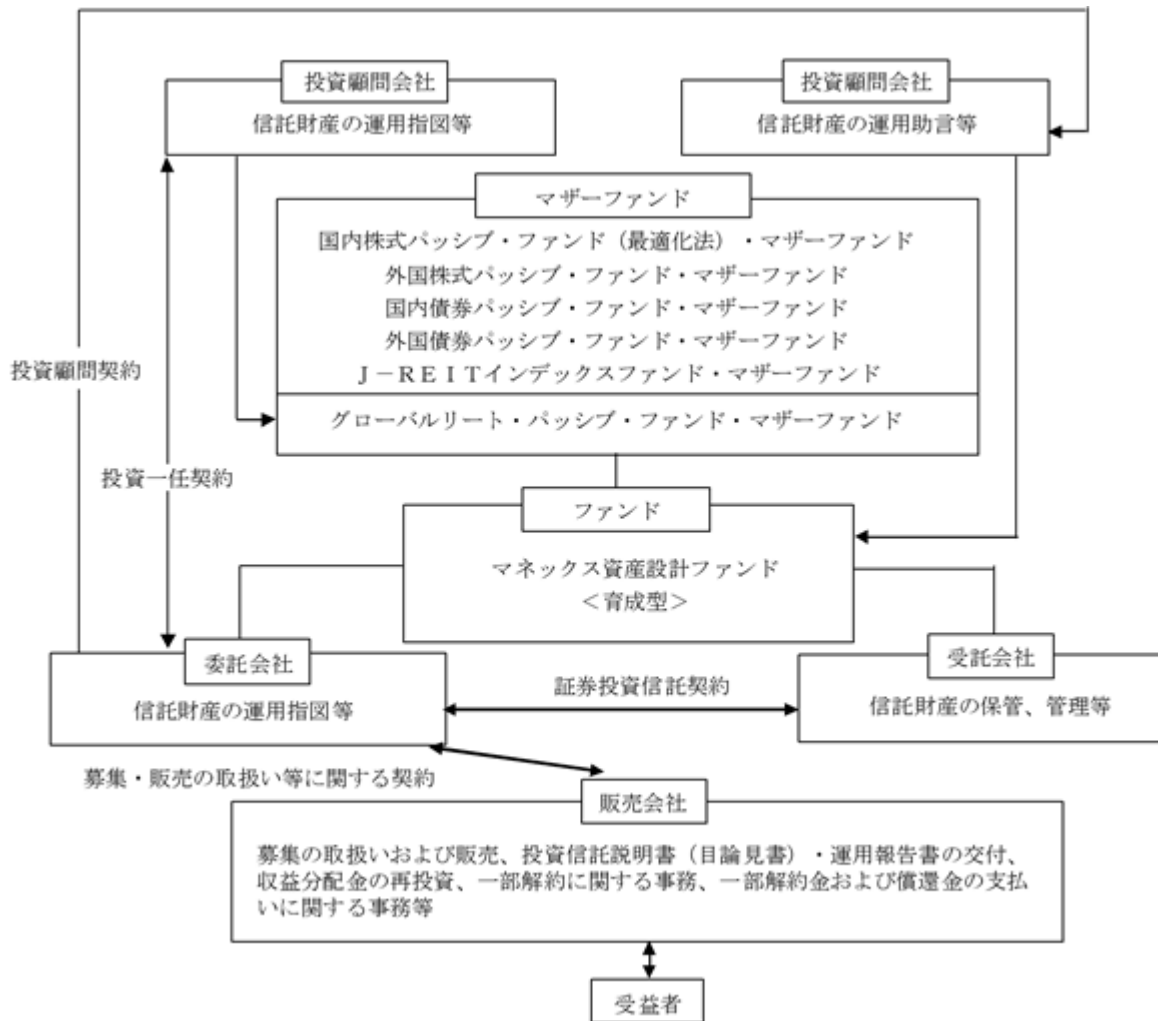
「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

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19年1月26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、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、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。

投資顧問会社：

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

DIAM International Ltd

委託会社との投資一任契約に基づき、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの信託財産の運用指図等を行います。

・「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、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、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。

・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）の間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものであります。

・「投資一任契約」の概要

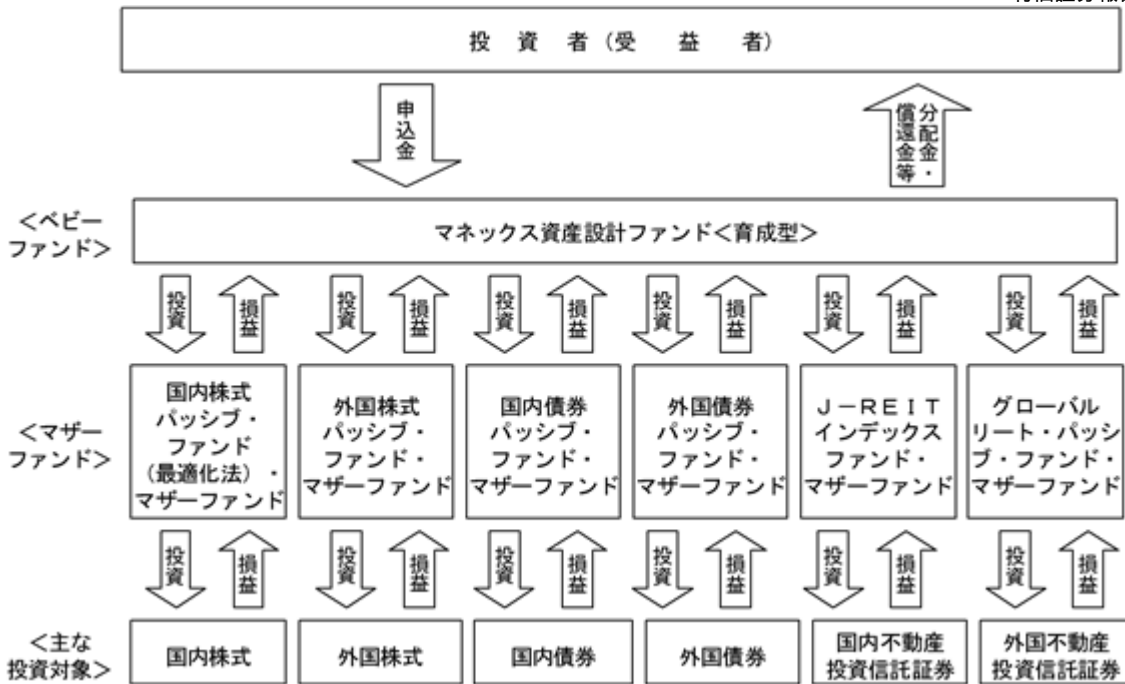
委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）の間においては、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものであります。

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各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26年1月31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ルユ・アセットマネジメント株式会社及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26年1月31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、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

#### <投資対象>

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、J-REITインデックスファンド・マザーファンド受益証券およびグローバルリート・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>

主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）の計6資産への分散投資を行います。

基本資産配分は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

基本資産配分比率については、分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

リート（REIT）とは

- ・リート（REIT）とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。（以下同じ。）
- ・REIT（リート）とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT（Listed Property Trust）と呼ばれる場合があります。
- ・リート（REIT）は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くのリート（REIT）は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート（REIT）は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート（REIT）に投資する投資家が、配当金（もしくは分配金）として享受する仕組みになっています。

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

## （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。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利(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23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

(2)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、主として次に掲げる(1)から(6)までの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親投資信託の受益証券ならびに(7)から(28)までの有価証券(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) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

(2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(5) J-REITインデックスファンド・マザーファンド

(6) グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

(7) 株券または新株引受権証書

(8) 国債証券

- (9) 地方債証券
  - (10) 特別の法律により法人の発行する債券
  - (11) 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。）
  - (12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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。）
  - (13) 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。）
  - (14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（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。）
  - (15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  - (16) コマーシャル・ペーパー
  - (17) 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
  - (18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
  - (19) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
  - (20) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  - (21) 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。）
  - (22) 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。）
  - (23) 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。）
  - (24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - (25) 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。）
  - (26) 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。）
  - (27) 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
  - (28) 外国の者に対する権利で上記(27)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(7)の証券または証書、(18)ならびに(23)の証券または証書のうち(7)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(8)から(12)までの証券および(18)ならびに(23)の証券または証書のうち(8)から(12)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(19)の証券および(20)の証券を以下「投資信託証券」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

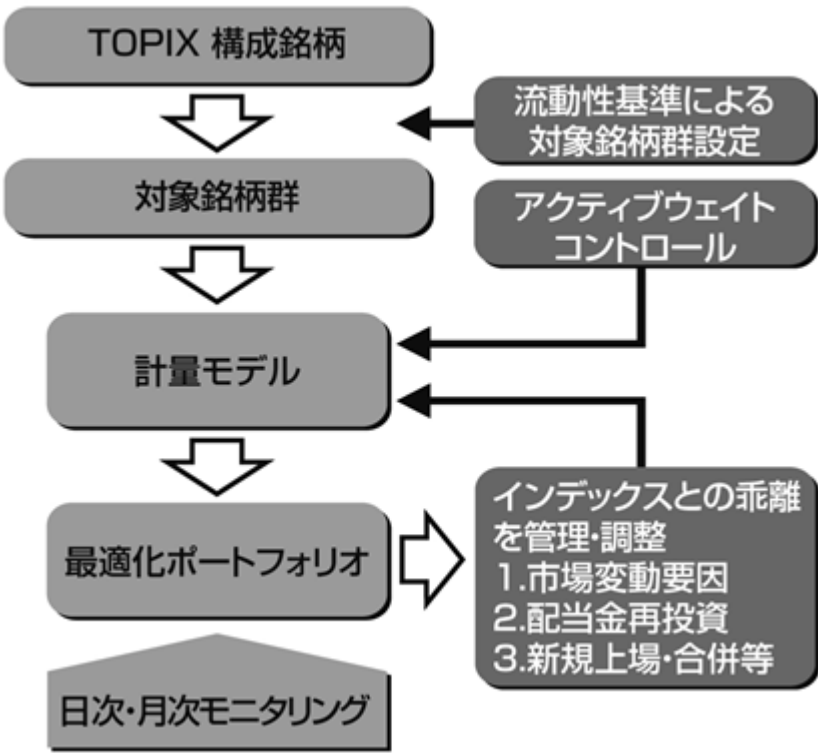
(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

4. 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には、委託会社は信託金を上記3.の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。（約款第16条第3項）

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

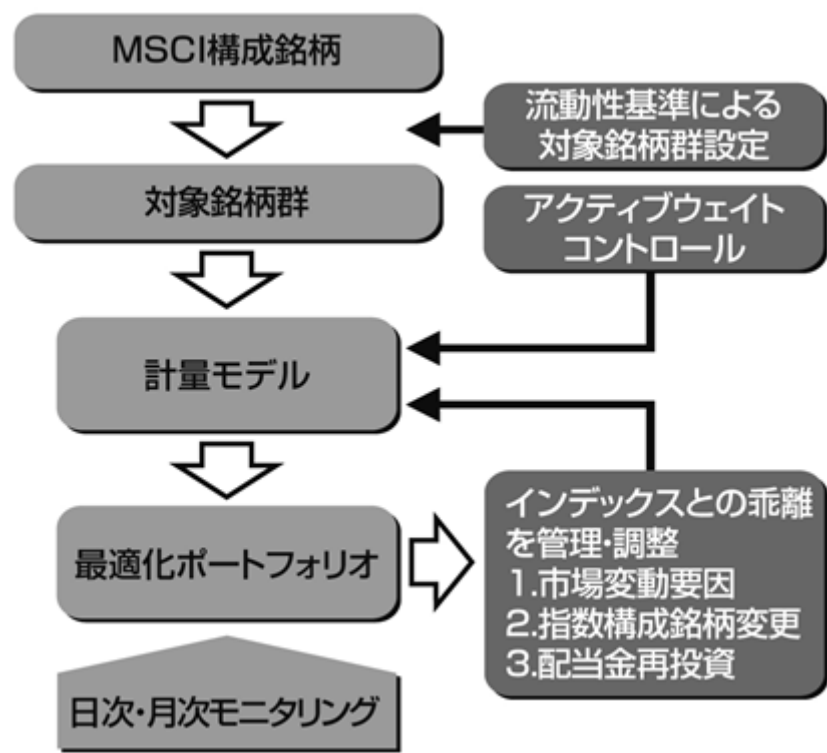
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
-------	-----------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）<sup>（注）</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>（注）TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資する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、責任を負いません。</p>
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p>
運用プロセス	<p>1)流動性基準による対象銘柄群設定        マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築        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。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理        日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、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。        インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>  <pre>       graph TD         A[TOPIX 構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]         C[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B         B --&gt; D[計量モデル]         E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; D         D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]         G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.配当金再投資 3.新規上場・合併等] --&gt; F         F --&gt; H[日次・月次モニタリング]       </pre>

主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。
--------	----------------------

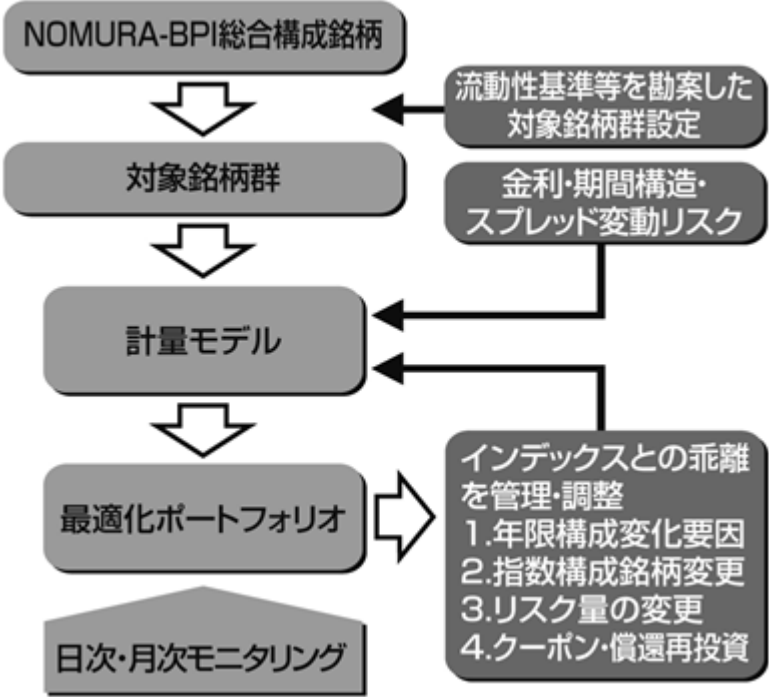
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）<sup>（注）</sup>に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 5px 0;"> <p>（注）MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. 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。</p> </div> <p>2. 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>3. 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>

運用プロセス	<p>1)流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 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。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]          F[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B     G[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C          H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --&gt; D   </pre>
--------	---



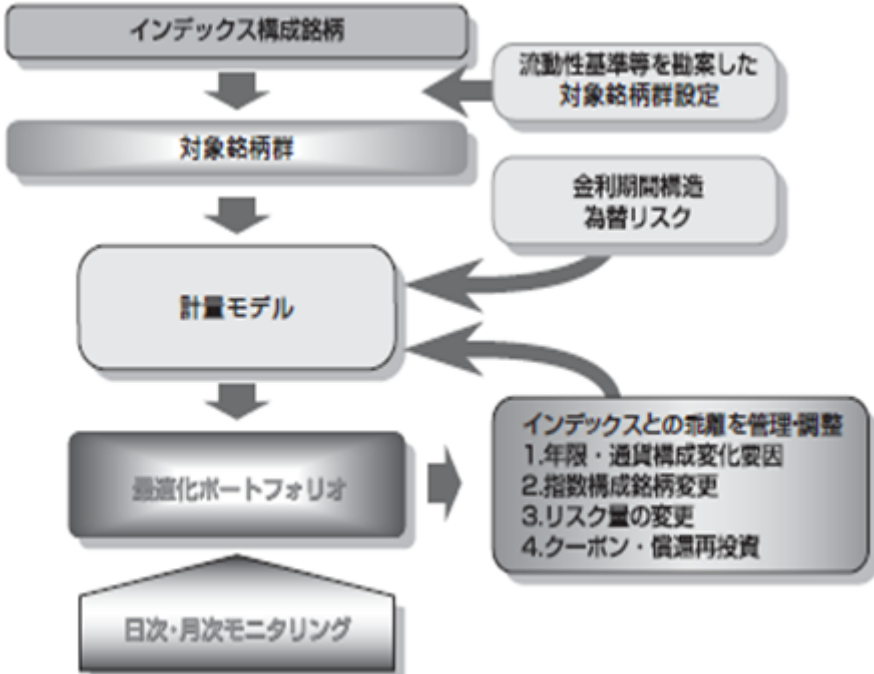
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の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>
--------	---

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合<sup>(注)</sup>に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div data-bbox="341 831 1374 1070" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>(注)NOMURA - B P I 総合は、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。</p> </div>
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</li> </ol>

運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 1.債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2.金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1.、2.が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、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。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 年限構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン、償還再投資</li> </ul> 
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時におい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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>

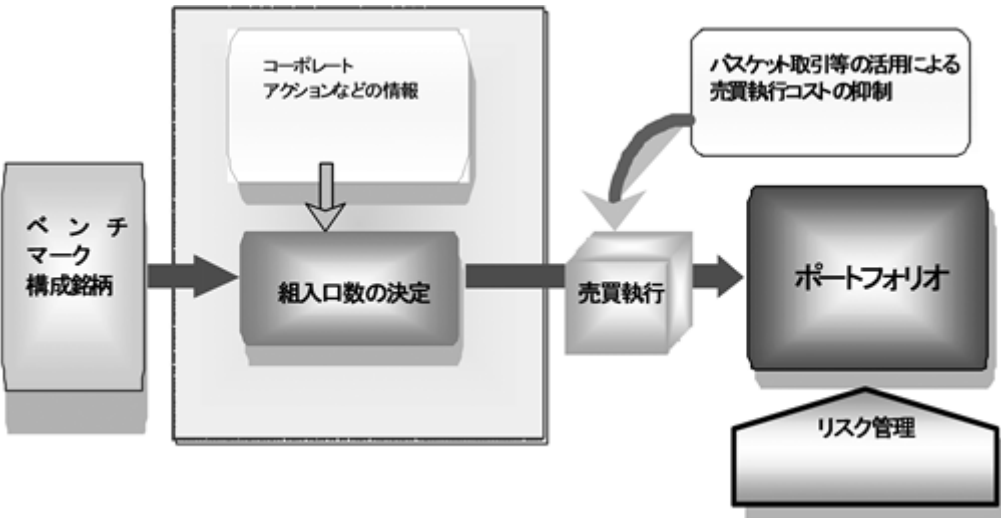
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-----------------------

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	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）<sup>（注）</sup>」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>（注）シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。 シティグループ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・グローバル・マーケット・インクに帰属します。</p></div> <p>2. 外国債券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>3. 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>

運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定 シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 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。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限・通貨構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン・償還再投資</li> </ul> 
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時におい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>

ファンド名	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
-------	-------------------------------

基本方針	<p>東証REIT指数（配当込み）<sup>（注）</sup>の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>（注）東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資する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、責任を負いません。</p>
主な投資対象	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。</p>

投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1.東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>3.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ol>
運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</li> <li>・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</li> </ul> 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>

ファンド名	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	----------------------------

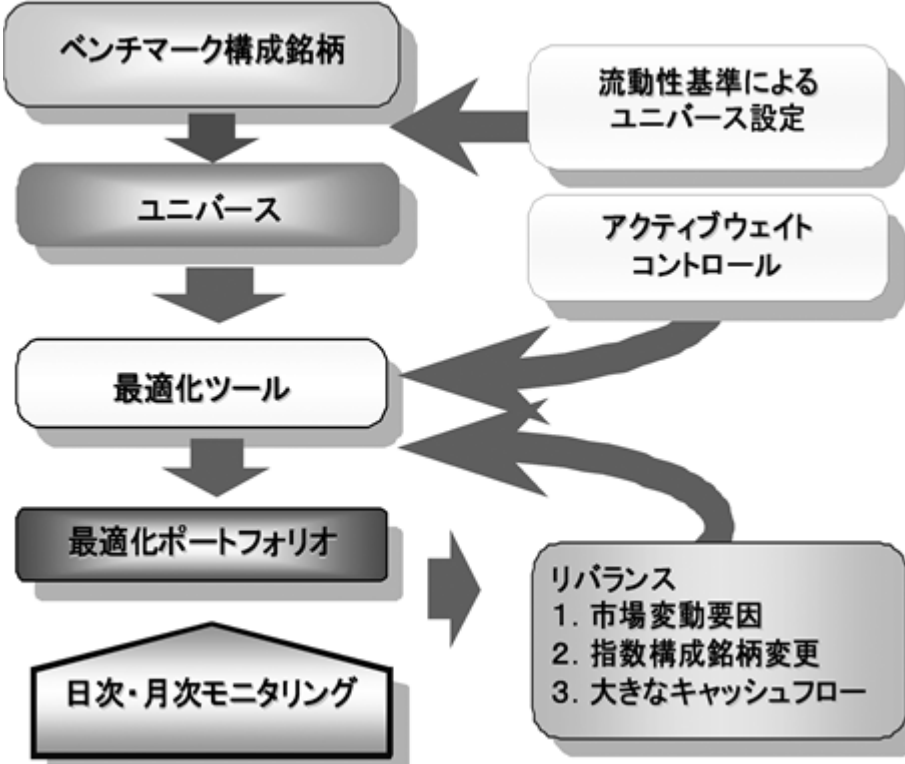
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REITインデックス(除く日本・円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) <sup>(注)</sup> に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--



(注) Standard & Poor's®並びに S&P®は、スタンダード&プアーズ・ファイナシヤル・サービシズLLC(以下「S&P」)の登録商標です。Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、DIAMアセットマネジメント株式会社に対しては特定の目的のために使用するサブライセン스가与えられています。S&P 先進国 REITインデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、DIAMアセットマネジメント株式会社に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ、S&P、およびその関連会社(以下総称してS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとする)は、DIAMアセットマネジメント株式会社の商品を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または商品に関する投資について、またS&P 先進国 REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追隨する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスのDIAMアセットマネジメント株式会社に対するS&P 先進国 REITインデックスに関わる唯一の関係は、該当する指数、登録商標、サービスマーク、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの商号についての使用許諾を与えることです。

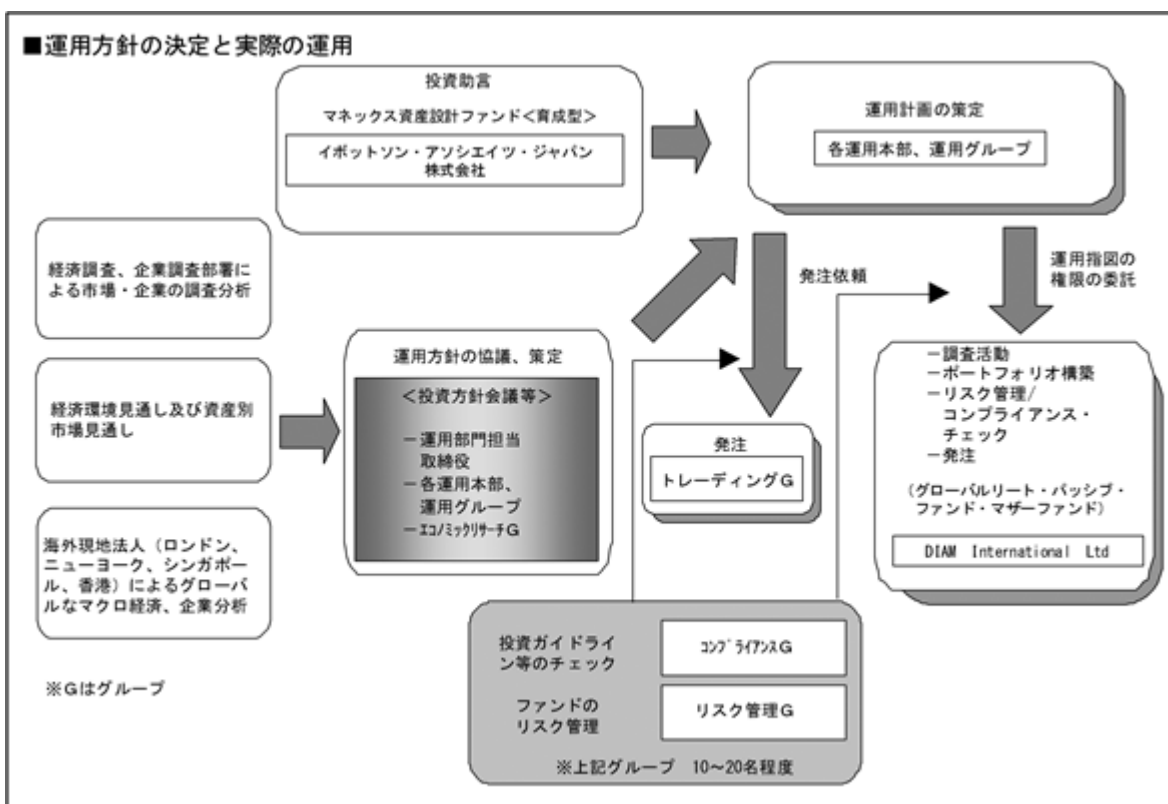
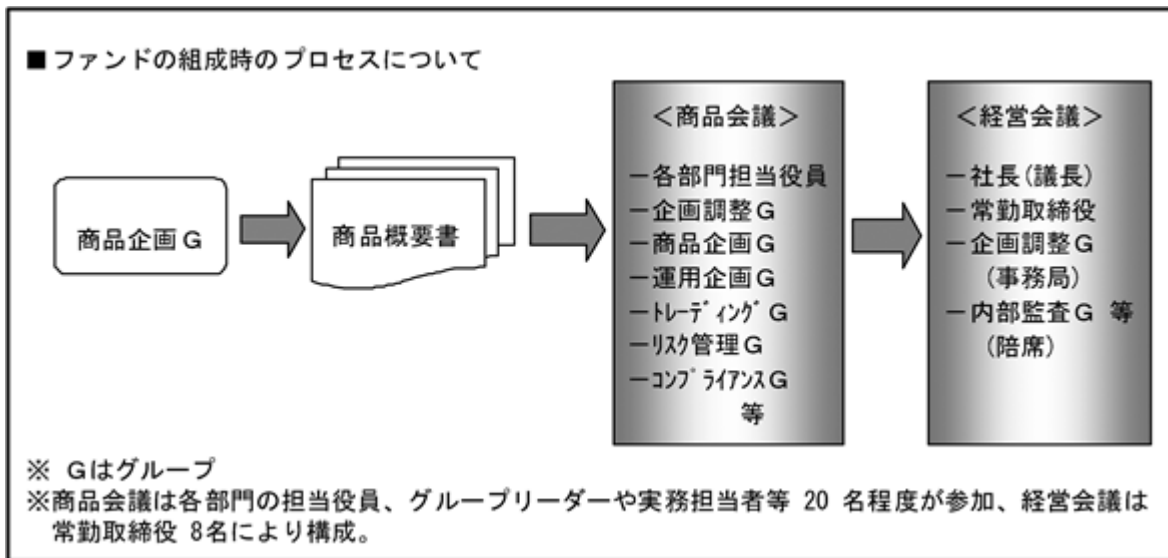
S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくはDIAMアセットマネジメント株式会社が得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合にお

	<p>いても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害(利益の損失、トレーディング損失、損失時間、のれんを含む)について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&amp;Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&amp;Pダウ・ジョーンズ・インデックスとDIAMアセットマネジメント株式会社間での合意及び協定において、S&amp;Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。</p>
主な投資対象	日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P先進国REITインデックス(除く日本、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。</li><li>2. 運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。</li><li>3. 不動産投資信託証券への投資割合は、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。</li><li>4. 外貨建資産については原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。</li></ol>

運用プロセス	<p>1)流動性基準によるユニバース設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、S &amp; P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築 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、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)リバランス 日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。 リバランス要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの</li> <li>・大きなキャッシュフローに伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul> 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資割合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】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

<ファンドの組成時のプロセスについて>

運用目標、運用プロセス、投資対象などの商品内容は、商品企画グループが関連各部署と協議のうえ、「商品概要書」として策定し、企画調整グループが事務局となる「商品会議」にて協議・検討致します。「商品会議」で協議・修正等された商品内容は「経営会議」で経営陣による討議を経て最終決定致します。なお、「経営会議」は、社長が議長を務め、常勤取締役を構成メンバーとし、監査役が同席のうえ、開催される会議であり、取締役会が決定した会社の基本方針に基づき全般的業務執行方針・計画および重要な業務の実施について協議・決定するとともに経営上の重要事項を審議しています。

<運用方針の決定と実際の運用>

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、運用グループの運用担当者、エコノ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に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。

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または、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。

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。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用指図の委託先の運用体制は以下の通りです。

・DIAM International Ltdの運用体制

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドについては、信託財産の運用指図に関する権限をDIAM International Ltdに委託します。	
運用体制	<ul style="list-style-type: none"> <li>・DIAM International Ltdでは、資産クラス別運用体制ではなく、マルチプラットフォーム体制を採用しており、全ての運用担当者は3つまたは4つのプラットフォームに所属しております。</li> <li>・マクロ分析・市場分析・企業分析プラットフォームにおいては、株式や債券などの特定の資産クラスのみならず、幅広い資産クラスに関連する様々なレベルの分析が行われております。</li> </ul>

運用プロセス	<p>情報収集・分析</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・マルチプラットフォーム体制のもと、DIAM International Ltd内の他の運用担当者との情報交換や議論を通じ、投資対象国・地域のマクロ経済環境や対象資産に関する情報収集や分析を行います。</li> </ul> <p>運用方針・戦略の決定</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・月次の各種テーマ別運用方針会議におけるマクロ経済環境や金融市場環境などに関する議論を踏まえ、当該ファンドの運用目標・ガイドラインに沿った運用方針・戦略を策定します。</li> </ul> <p>ポートフォリオの構築</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・策定した運用方針・戦略に基づき、運用担当者がポートフォリオを構築します。運用対象となる銘柄の執行については基本的にはそれぞれの運用担当者が自ら行います。</li> <li>・運用担当者は使用するポートフォリオ・マネジメント・システムでポートフォリオのリスク量やその変化をリアルタイムで把握することができる体制となっています。</li> </ul> <p>運用モニタリング</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・運用ガイドラインチェックは運用部門からは独立したコンプライアンスチームによってシステムを用いて日次で行われています。</li> <li>・同じく運用部門から独立したリスク管理チームが各ファンドのパフォーマンス評価や各種リスクのモニタリングを行っており、週次で開催されるモニタリング会議で報告されています。</li> </ul>
--------	---

上記運用体制は、平成26年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

当ファンドは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の運用助言を受けます。

#### （４）【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時（毎年1月11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、配当等収入および売買益（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

原則として、経費控除後の利子配当等収益の範囲内で、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。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

留保益の運用については、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します。

- 1) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、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た後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、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額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（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、繰越欠損金のある時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. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各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各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- c. 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、税引後自動的に全額無手数料で再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行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、）に対し支払われます。販売会社は、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】

マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。（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、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。（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。（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。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

同一銘柄の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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」(3)投資制限）

投資する株式等の範囲（約款第19条）

- 1) 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。
- 2) 上記1)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。

#### 信用取引の指図および範囲(約款第22条)

- 1) 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、当該売付けの決済については、株券の引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。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.から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.から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の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記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

#### 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

- 1) 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の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。)
- 2) 委託会社は、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行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、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行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利、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。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) 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。



3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

4)委託会社は、スワップ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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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25条）

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

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

3)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。

4)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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

1)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.公社債の貸付けは、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。

2)上記1)1.2.に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。

3)委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い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。

2)上記1)の売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の借入れ（約款第28条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

2)上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

4) 上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29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。

外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約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為替の買予約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。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約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為替の売予約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。

4) 上記2)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。

資金の借入れ（約款第37条）

1) 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に資す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。

2) 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、資金借入れ額は借入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。

3) 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、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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。

デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令 第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含む。）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

### 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。

#### 資産配分リスク

各資産（国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート）への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、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。

#### 株価変動リスク

当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

#### 金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券およびリートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリートの価格は下落し、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。

#### リートの価格変動リスク

一般にリートが投資対象とする不動産の価値および当該不動産から得る収入は、当該国または国際的な景気、経済、社会情勢等の変化等により変動し、リーートの価格および分配金はその影響を受けることになり、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。

リートは、実物資産である建物等を投資対象にしているため、火災、自然災害等に伴う損害を受けた場合は、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。

リートが投資対象とする建物の用途規制等、不動産等に係る規制の強化や新たな規制がかかることにより、規制下となる不動産等の価値が低下する可能性があります、その結果、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

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して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。

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。

#### 信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産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もあり、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およぼす場合があります。

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。

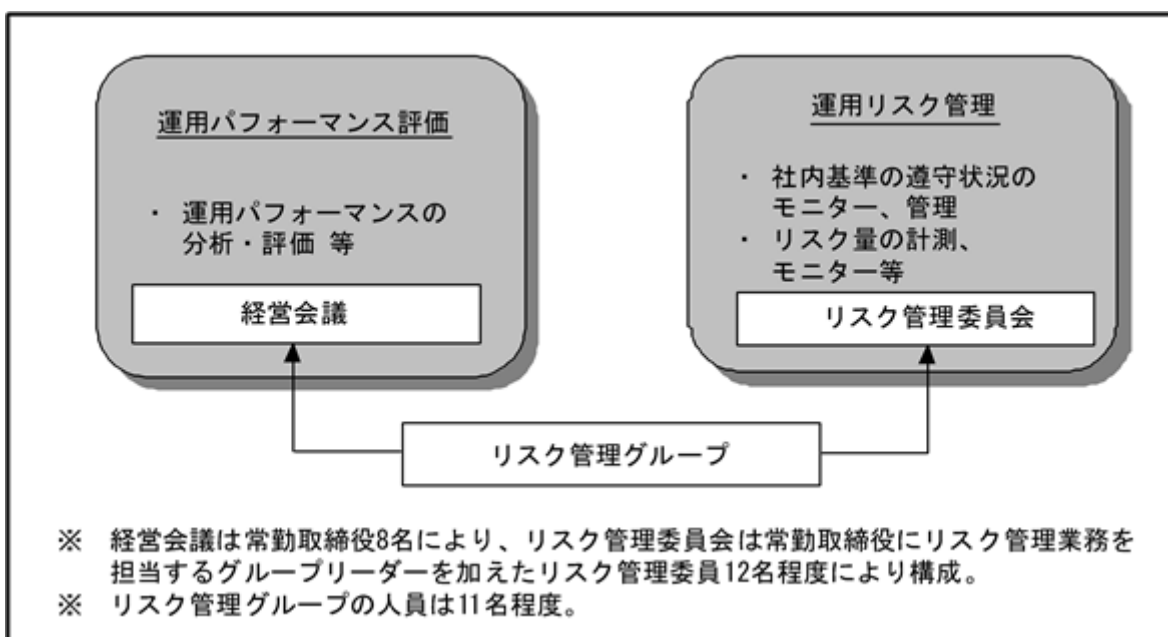
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができますものとします。

委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回った場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、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

- ・当ファンドは、実質的に株式、債券、リート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。
- ・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。
- ・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。
- ・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、これによる損失は購入者が負担することとなります。

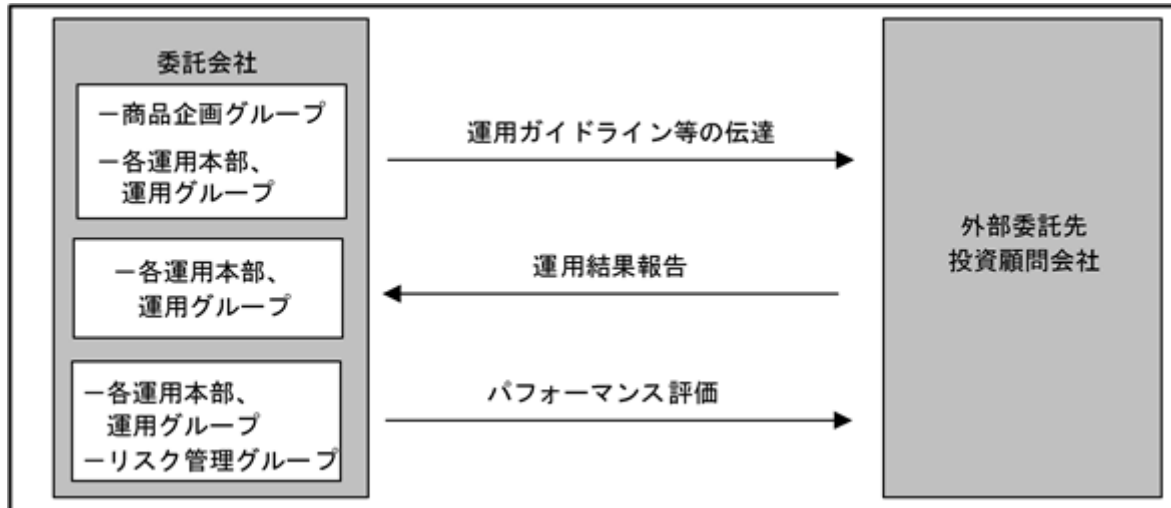
#### < 運用評価・運用リスク管理体制 >



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。

#### < 外部委託先に関する管理体制 >



マザーファンドの運用の外部委託先に対しては、投資一任契約に基づき、ファンドの運用目標、運用プロセス、投資対象などを伝達し、運用ガイドライン等の徹底を図ります。運用開始後は運用外部委託先と各運用本部、運用グループが連携し、運用を実施致します。運用内容については、リスク管理グループがパフォーマンス評価・分析等を行います。

上記体制は平成26年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### 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1.026%（税抜0.95%）

信託報酬の配分は、販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。

信託報酬の配分（税抜）			
販売会社の 取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社
100億円以下の部分	年率0.52%	年率0.36%	年率0.07%
100億円超 300億円以下の部分	年率0.47%	年率0.41%	年率0.07%

300億円超の部分	年率0.42%	年率0.46%	年率0.07%
-----------	---------	---------	---------

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎年7月11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。

委託会社の信託報酬には、当ファンドおよびマザーファンドの投資顧問会社への報酬が含まれます。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は、当該マザーファンドの信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た金額の合計に、当該マザーファンドの受益権総口数に占める信託財産に属する当該マザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額とします。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの純資産総額	報酬率
25億円以下の部分	年率0.20%
25億円超75億円以下の部分	年率0.18%
75億円超の部分	年率0.15%

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

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額とします。

##### 2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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て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、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、受益者の負担とし、計算期間を通じて毎日計算し、毎年7月11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係る消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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ならびに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。

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。

上場投資信託（リート）は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託（リート）の費用は表示しておりません。

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。

## （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。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の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。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成26年1月末現在のものです。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26年1月31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	8,971,955,249	98.63
内 日本	8,971,955,249	98.63
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	125,031,817	1.37
純資産総額	9,096,987,066	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) 投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	309,380,255,810	97.90
内 日本	309,380,255,810	97.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,645,971,305	2.10
純資産総額	316,026,227,115	100.00

その他資産の投資状況

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	6,743,250,000	2.13
内 日本	6,743,250,000	2.13

(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) 投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

(注3) 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。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	356,477,373,400	79.58
内 日本	356,477,373,400	79.58
地方債証券	29,455,263,509	6.58
内 日本	29,455,263,509	6.58
特殊債券	30,536,881,322	6.82
内 日本	30,536,881,322	6.82
社債券	28,314,501,320	6.32
内 日本	28,314,501,320	6.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,176,603,303	0.71
純資産総額	447,960,622,854	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）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	28,099,868,120	99.06
内 日本	28,099,868,120	99.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	267,376,951	0.94
純資産総額	28,367,245,071	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）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	291,088,043,166	94.98
内 アメリカ	173,259,727,788	56.53
内 ユーロ	40,943,116,078	13.36
内 イギリス	29,014,481,647	9.47
内 カナダ	13,107,510,970	4.28
内 スイス	12,243,054,131	3.99
内 オーストラリア	9,250,371,893	3.02
内 スウェーデン	4,358,482,683	1.42
内 香港	3,611,146,709	1.18
内 シンガポール	1,747,494,435	0.57
内 デンマーク	1,671,038,506	0.55
内 ノルウェー	1,075,964,162	0.35
内 イスラエル	645,092,178	0.21
内 ニュージーランド	160,561,986	0.05
投資信託受益証券	823,313,101	0.27
内 オーストラリア	703,782,216	0.23
内 シンガポール	119,530,885	0.04
投資証券	5,139,794,132	1.68
内 アメリカ	4,130,983,730	1.35
内 イギリス	403,702,071	0.13
内 ユーロ	390,927,667	0.13
内 香港	111,766,122	0.04
内 カナダ	102,414,542	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,415,565,284	3.07
純資産総額	306,466,715,683	100.00

## その他資産の投資状況

平成26年1月31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）	5,283,955,000	1.72
内 日本	5,283,955,000	1.72
株価指数先物取引（買建）	9,409,453,259	3.07
内 アメリカ	5,771,248,308	1.88
内 ユーロ	1,912,467,009	0.62
内 イギリス	935,607,036	0.31
内 カナダ	405,370,492	0.13
内 オーストラリア	384,760,414	0.13

（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）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で分けした地域別の内訳です。

（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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	374,202,737,121	97.42
内 ユーロ	163,462,937,251	42.56
内 アメリカ	148,442,813,511	38.65
内 イギリス	30,118,458,245	7.84
内 カナダ	8,679,735,411	2.26
内 オーストラリア	5,667,957,094	1.48
内 メキシコ	3,640,118,557	0.95
内 ポーランド	3,030,908,976	0.79
内 デンマーク	3,015,452,453	0.79
内 スウェーデン	2,090,279,518	0.54
内 マレーシア	1,893,666,847	0.49
内 南アフリカ	1,645,284,962	0.43
内 シンガポール	1,297,445,613	0.34
内 ノルウェー	1,217,678,683	0.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,908,868,292	2.58
純資産総額	384,111,605,413	100.00

## その他資産の投資状況

平成26年1月31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）	214,424,190	0.06
内 日本	214,424,190	0.06
為替予約取引（売建）	69,835,150	0.02
内 日本	69,835,150	0.02

（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）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

（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。

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	381,205,622	12.49
内 オーストラリア	276,371,480	9.06
内 シンガポール	104,834,142	3.44
投資証券	2,631,723,995	86.26
内 アメリカ	2,048,564,172	67.14
内 ユーロ	216,423,977	7.09
内 イギリス	214,365,904	7.03
内 カナダ	80,312,182	2.63
内 香港	61,437,041	2.01
内 ニュージーランド	10,620,719	0.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	38,051,291	1.25
純資産総額	3,050,980,908	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）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成26年1月31日現在

順位	銘柄名 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	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,361,940,019	1.7667 2,406,254,514	1.6991 2,314,072,286	- -	25.44%
2	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,911,394,169	1.1894 2,273,597,734	1.1921 2,278,572,988	- -	25.05%
3	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	951,052,055	2.2813 2,169,666,117	2.2265 2,117,517,400	- -	23.28%
4	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	544,713,817	1.6347 890,473,798	1.6307 888,264,821	- -	9.76%
5	グローバルリート・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	567,041,345	1.2148 688,843,527	1.2170 690,089,316	- -	7.59%
6	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	508,813,608	1.3195 671,390,011	1.3432 683,438,438	- -	7.51%

(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26年1月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.63%
合計	98.63%

(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)

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年1月31日現在

順位	銘柄名 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	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,484,000	4,905.54 12,185,384,654	5,922.00 14,710,248,000	- -	4.65%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	13,343,300	538.00 7,178,695,400	623.00 8,312,875,900	- -	2.63%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	865,000	3,478.23 3,008,672,733	7,563.00 6,541,995,000	- -	2.07%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,332,100	3,790.00 5,048,659,000	4,824.00 6,426,050,400	- -	2.03%
5	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,606,200	3,596.09 5,776,043,464	3,893.00 6,252,936,600	- -	1.98%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	22,803,700	209.00 4,766,008,273	219.00 4,994,010,300	- -	1.58%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	692,100	4,050.00 2,803,005,000	5,561.00 3,848,768,100	- -	1.22%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,108,300	3,026.02 3,353,742,070	3,197.00 3,543,235,100	- -	1.12%
9	日立 日本	株式 電気機器	4,286,000	536.48 2,299,359,689	792.00 3,394,512,000	- -	1.07%
10	武田薬品 日本	株式 医薬品	700,200	4,700.00 3,290,940,000	4,793.00 3,356,058,600	- -	1.06%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	199,100	14,861.33 2,958,891,304	16,770.00 3,338,907,000	- -	1.06%
12	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,233,000	2,143.00 2,642,319,000	2,545.00 3,137,985,000	- -	0.99%
13	KDDI 日本	株式 情報・通信業	546,800	3,558.10 1,945,569,128	5,705.00 3,119,494,000	- -	0.99%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	1,034,600	3,310.00 3,424,526,000	3,006.00 3,110,007,600	- -	0.98%
15	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	736,800	2,817.00 2,075,565,600	4,102.00 3,022,353,600	- -	0.96%
16	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	430,500	4,779.86 2,057,732,202	6,398.00 2,754,339,000	- -	0.87%
17	三井不動産 日本	株式 不動産業	830,000	2,095.00 1,738,850,000	3,289.00 2,729,870,000	- -	0.86%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,374,500	1,953.00 2,684,398,500	1,903.00 2,615,673,500	- -	0.83%
19	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	3,600,900	531.00 1,912,077,900	725.00 2,610,652,500	- -	0.83%
20	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	328,300	6,440.00 2,114,252,000	7,632.00 2,505,585,600	- -	0.79%
21	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	7,899,000	272.57 2,153,085,547	315.00 2,488,185,000	- -	0.79%



22	パナソニック 日本	株式 電気機器	2,039,100	757.00 1,543,598,700	1,184.00 2,414,294,400	- -	0.76%
23	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,451,300	1,369.00 1,986,829,700	1,663.00 2,413,511,900	- -	0.76%
24	デンソー 日本	株式 輸送用機器	441,000	3,700.00 1,631,700,000	5,339.00 2,354,499,000	- -	0.75%
25	三井物産 日本	株式 卸売業	1,621,900	1,406.19 2,280,699,615	1,385.00 2,246,331,500	- -	0.71%
26	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,505,100	993.85 2,489,705,365	885.00 2,217,013,500	- -	0.70%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	585,800	2,473.00 1,448,683,400	3,734.00 2,187,377,200	- -	0.69%
28	三菱重工業 日本	株式 機械	3,178,000	526.30 1,672,600,300	670.00 2,129,260,000	- -	0.67%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,785,000	812.00 1,449,420,000	1,178.00 2,102,730,000	- -	0.67%
30	東京海上HD 日本	株式 保険業	682,300	2,713.00 1,851,079,900	3,034.00 2,070,098,200	- -	0.66%

(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26年1月31日現在

種類	投資比率
株式	97.90%
合計	97.90%

(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26年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.85%
輸送用機器		11.62%
銀行業		9.57%
情報・通信業		7.00%
機械		5.27%
化学		5.25%
医薬品		4.43%
卸売業		4.41%
小売業		4.21%
食料品		3.73%
陸運業		3.57%
不動産業		3.40%
建設業		2.58%
サービス業		2.47%
保険業		2.16%
電気・ガス業		2.12%
証券、商品先物取引業		1.75%
鉄鋼		1.68%
その他製品		1.39%
その他金融業		1.34%
精密機器		1.33%
非鉄金属		1.05%
ガラス・土石製品		0.98%
ゴム製品		0.90%
繊維製品		0.69%
金属製品		0.68%
石油・石炭製品		0.58%
空運業		0.50%
鉱業		0.44%
海運業		0.38%
パルプ・紙		0.28%
倉庫・運輸関連業	0.22%	
水産・農林業	0.07%	
合計	97.90%	

(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。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

順位	銘柄名 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	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.96 5,553,060,000	102.00 5,610,000,000	0.800000 2023/6/20	1.25%
2	97回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.99 5,049,930,000	100.72 5,036,100,000	0.400000 2016/6/20	1.12%
3	328回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	98.42 4,921,365,000	100.34 5,017,350,000	0.600000 2023/3/20	1.12%
4	106回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.29 5,014,680,000	100.21 5,010,800,000	0.200000 2017/9/20	1.12%
5	306回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,600,000,000	106.70 4,908,290,000	106.96 4,920,344,000	1.400000 2020/3/20	1.10%
6	330回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,700,000,000	101.67 4,778,539,000	101.86 4,787,702,000	0.800000 2023/9/20	1.07%
7	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	102.69 4,621,170,000	104.14 4,686,525,000	1.000000 2022/3/20	1.05%
8	103回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.61 4,527,875,000	100.57 4,525,875,000	0.300000 2017/3/20	1.01%
9	105回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.32 4,514,535,000	100.23 4,510,575,000	0.200000 2017/6/20	1.01%
10	293回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	108.42 4,553,894,000	107.07 4,497,108,000	1.800000 2018/6/20	1.00%
11	89回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.82 4,335,561,000	100.43 4,318,834,000	0.400000 2015/6/20	0.96%
12	296回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	107.01 4,280,695,000	106.07 4,243,120,000	1.500000 2018/9/20	0.95%
13	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.45 4,258,300,000	105.84 4,233,720,000	1.400000 2018/12/20	0.95%
14	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	106.53 4,154,748,000	105.21 4,103,541,000	1.500000 2017/12/20	0.92%
15	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.49 4,019,680,000	102.35 4,094,120,000	0.800000 2022/9/20	0.91%

16	326回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.74 4,029,860,000	101.39 4,055,880,000	0.700000 2022/12/20	0.91%
17	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	105.84 4,021,992,000	106.48 4,046,582,000	1.300000 2021/3/20	0.90%
18	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.54 4,021,750,000	100.52 4,021,080,000	0.300000 2018/9/20	0.90%
19	92回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.65 4,026,320,000	100.35 4,014,240,000	0.300000 2015/9/20	0.90%
20	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	105.78 3,808,254,000	106.23 3,824,352,000	1.300000 2019/12/20	0.85%
21	315回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	104.92 3,672,480,000	105.76 3,701,810,000	1.200000 2021/6/20	0.83%
22	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	107.33 3,649,418,000	106.93 3,635,892,000	1.500000 2019/6/20	0.81%
23	282回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	105.79 3,596,962,000	104.18 3,542,392,000	1.700000 2016/9/20	0.79%
24	93回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.28 3,545,080,000	100.78 3,527,475,000	0.500000 2015/12/20	0.79%
25	113回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.26 3,509,380,000	100.54 3,518,970,000	0.300000 2018/6/20	0.79%
26	88回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.94 3,533,110,000	100.47 3,516,450,000	0.500000 2015/3/20	0.78%
27	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.30 3,510,830,000	100.19 3,506,720,000	0.200000 2017/12/20	0.78%
28	326回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.04 3,501,580,000	100.02 3,500,770,000	0.100000 2015/3/15	0.78%
29	285回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	106.48 3,513,939,000	104.94 3,463,152,000	1.700000 2017/3/20	0.77%
30	310回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	103.76 3,424,344,000	104.54 3,450,018,000	1.000000 2020/9/20	0.77%

(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26年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	79.58%
地方債証券	6.58%
特殊債券	6.82%
社債券	6.32%
合計	99.29%

（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。

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

順位	銘柄名 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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	5,158	566,751.32 2,923,303,349	583,000.00 3,007,114,000	- -	10.60%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	4,429	531,127.70 2,352,364,619	529,000.00 2,342,941,000	- -	8.26%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	8,603	198,270.09 1,705,717,595	205,700.00 1,769,637,100	- -	6.24%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	8,871	139,617.96 1,238,550,966	152,900.00 1,356,375,900	- -	4.78%
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	1,166	951,852.81 1,109,860,386	1,035,000.00 1,206,810,000	- -	4.25%
6	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	3,075	323,339.12 994,267,797	351,000.00 1,079,325,000	- -	3.80%
7	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	4,622	215,850.13 997,659,306	217,200.00 1,003,898,400	- -	3.54%
8	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,849	480,447.14 888,346,763	527,000.00 974,423,000	- -	3.44%
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,290	121,029.23 761,273,862	136,000.00 855,440,000	- -	3.02%
10	G L P 投資法人 日本	投資証券	7,818	98,825.37 772,616,772	106,300.00 831,053,400	- -	2.93%
11	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	984	818,708.56 805,609,231	831,000.00 817,704,000	- -	2.88%
12	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	936	794,547.66 743,696,617	855,000.00 800,280,000	- -	2.82%
13	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,475	427,802.93 631,009,332	487,500.00 719,062,500	- -	2.53%
14	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	3,094	203,952.10 631,027,816	227,300.00 703,266,200	- -	2.48%
15	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	5,162	127,946.55 660,460,136	135,900.00 701,515,800	- -	2.47%
16	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	6,207	103,350.80 641,498,421	108,200.00 671,597,400	- -	2.37%
17	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券	1,239	450,390.89 558,034,323	511,000.00 633,129,000	- -	2.23%
18	野村不動産オフィスファンド投資法人 日本	投資証券	1,389	472,144.56 655,808,797	452,500.00 628,522,500	- -	2.22%
19	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	860	675,021.94 580,518,875	710,000.00 610,600,000	- -	2.15%
20	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,393	401,166.00 558,824,249	427,500.00 595,507,500	- -	2.10%
21	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	4,490	117,974.93 529,707,445	122,200.00 548,678,000	- -	1.93%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	583	868,479.35 506,323,463	846,000.00 493,218,000	- -	1.74%
23	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	9,770	44,166.80 431,509,666	49,500.00 483,615,000	- -	1.70%

24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,541	136,922.10 484,841,160	132,300.00 468,474,300	- -	1.65%
25	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	3,644	118,423.91 431,536,756	123,300.00 449,305,200	- -	1.58%
26	福岡リート投資法人 日本	投資証券	514	797,670.08 410,002,423	860,000.00 442,040,000	- -	1.56%
27	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	457	765,617.58 349,887,236	861,000.00 393,477,000	- -	1.39%
28	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	5,498	65,312.58 359,088,614	64,000.00 351,872,000	- -	1.24%
29	プレミアム投資法人 日本	投資証券	815	386,856.25 315,287,846	398,000.00 324,370,000	- -	1.14%
30	野村不動産レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	599	524,053.65 313,908,139	534,000.00 319,866,000	- -	1.13%

(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26年1月31日現在

種類	投資比率
投資証券	99.06%
合計	99.06%

(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。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

順位	銘柄名 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	92,754	47,838.55 4,437,217,055	51,372.39 4,764,995,441	- -	1.55%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	449,640	9,108.11 4,095,374,462	9,667.81 4,347,034,717	- -	1.42%
3	GOOGLE INC アメリカ	株式 インターネットソ フトウェア・サー ビス	27,917	81,594.68 2,277,878,715	116,592.83 3,254,922,275	- -	1.06%
4	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	807,386	2,922.81 2,359,840,340	3,792.44 3,061,969,582	- -	1.00%
5	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	1,039,570	2,407.64 2,502,919,220	2,622.92 2,726,719,340	- -	0.89%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	287,687	7,819.90 2,249,685,365	9,205.96 2,648,437,891	- -	0.86%
7	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	328,388	7,174.89 2,356,148,776	7,516.98 2,468,486,356	- -	0.81%
8	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	515,521	3,635.32 1,874,086,301	4,736.70 2,441,869,867	- -	0.80%
9	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	197,149	11,907.63 2,347,579,217	11,978.04 2,361,459,988	- -	0.77%
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	279,844	7,899.14 2,210,528,832	7,906.84 2,212,684,027	- -	0.72%
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	383,778	5,070.34 1,945,888,523	5,760.15 2,210,622,684	- -	0.72%
12	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	676,001	2,783.39 1,881,575,504	3,170.14 2,143,021,325	- -	0.70%
13	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,903,533	1,227.47 2,336,530,518	1,069.32 2,035,492,302	- -	0.66%
14	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	71,471	23,449.90 1,675,988,317	28,415.21 2,030,863,759	- -	0.66%
15	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	106,042	20,524.29 2,176,437,085	18,243.24 1,934,550,674	- -	0.63%
16	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	234,010	7,209.35 1,687,061,670	8,235.05 1,927,085,220	- -	0.63%
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融サービス	1,093,077	1,249.26 1,365,545,901	1,741.41 1,903,505,930	- -	0.62%
18	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サービス	4,941,395	284.73 1,407,010,218	382.79 1,891,556,518	- -	0.62%
19	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サー ビス	542,288	3,630.03 1,968,522,690	3,430.38 1,860,254,451	- -	0.61%



20	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	298,696	4,249.26 1,269,237,606	5,504.03 1,644,034,313	- -	0.54%
21	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	406,611	3,799.44 1,544,894,988	3,926.16 1,596,422,364	- -	0.52%
22	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗 燃料	1,922,200	763.76 1,468,105,465	810.90 1,558,713,363	- -	0.51%
23	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販 売・カタログ販売	37,169	27,703.71 1,029,719,520	41,416.57 1,539,412,824	- -	0.50%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融サービス	308,990	4,575.43 1,413,764,235	4,968.13 1,535,104,960	- -	0.50%
25	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗 燃料	397,909	3,601.20 1,432,950,303	3,643.87 1,449,931,850	- -	0.47%
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サー ビス	291,965	4,574.20 1,335,507,936	4,899.22 1,430,401,292	- -	0.47%
27	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	353,534	3,576.26 1,264,331,869	3,846.96 1,360,032,570	- -	0.44%
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	164,815	9,251.95 1,524,861,545	8,135.19 1,340,802,559	- -	0.44%
29	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	499,201	2,491.95 1,243,984,794	2,675.00 1,335,365,269	- -	0.44%
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	157,377	7,456.78 1,173,526,007	8,339.88 1,312,506,679	- -	0.43%

（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26年1月31日現在

種類	投資比率
株式	94.98%
投資信託受益証券	0.27%
投資証券	1.68%
合計	96.93%

（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26年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
石油・ガス・消耗燃料	外国	8.36%
商業銀行		7.69%
医薬品		6.82%
保険		4.12%
各種金融サービス		3.13%
メディア		2.98%
化学		2.75%
各種電気通信サービス		2.57%
食品		2.49%
ソフトウェア		2.49%
情報技術サービス		2.20%
コンピュータ・周辺機器		2.16%
資本市場		2.15%
航空宇宙・防衛		2.15%
飲料		2.12%
食品・生活必需品小売り		2.11%
金属・鉱業		2.09%
コングロマリット		1.97%
インターネットソフトウェア・サービス		1.95%
バイオテクノロジー		1.73%
ホテル・レストラン・レジャー		1.67%
機械		1.63%
専門小売り		1.55%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.50%
電力		1.49%
家庭用品		1.49%
半導体・半導体製造装置		1.47%
ヘルスケア機器・用品		1.43%
エネルギー設備・サービス		1.36%
総合公益事業		1.27%
通信機器		1.26%
タバコ		1.26%
繊維・アパレル・贅沢品		1.15%
自動車		1.13%
陸運・鉄道		0.91%
電気設備		0.89%
インターネット販売・カタログ販売		0.88%
無線通信サービス		0.88%
自動車部品		0.59%
航空貨物・物流サービス		0.57%
消費者金融		0.57%
不動産管理・開発		0.55%
複合小売り		0.53%
専門サービス		0.47%
建設・土木		0.43%
商業サービス・用品		0.42%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.42%

電子装置・機器・部品	0.34%
建設資材	0.31%
家庭用耐久財	0.28%
パーソナル用品	0.27%
商社・流通業	0.26%
容器・包装	0.21%
建設関連製品	0.20%
ガス	0.19%
運送インフラ	0.17%
旅客航空輸送業	0.14%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13%
紙製品・林産品	0.11%
レジャー用品	0.10%
海運業	0.10%
水道	0.08%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.08%
販売	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
事務用電子機器	0.05%
各種消費者サービス	0.03%
合計	94.98%

(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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

順位	銘柄名 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	US T N/B 0.625 07/15/16 アメリカ	国債証券	3,908,680,000	100.11 3,913,269,613	100.26 3,919,194,349	0.625000 2016/7/15	1.02%
2	US T N/B 2.5 03/31/15 アメリカ	国債証券	3,085,800,000	104.64 3,229,104,552	102.71 3,169,425,180	2.500000 2015/3/31	0.83%
3	US T N/B 1.25 08/31/15 アメリカ	国債証券	3,085,800,000	102.27 3,155,940,234	101.59 3,134,956,794	1.250000 2015/8/31	0.82%
4	US T N/B 3.25 06/30/16 アメリカ	国債証券	2,571,500,000	109.20 2,808,155,145	106.62 2,741,939,020	3.250000 2016/6/30	0.71%
5	US T N/B 2.25 01/31/15 アメリカ	国債証券	2,571,500,000	103.83 2,670,219,885	102.10 2,625,630,075	2.250000 2015/1/31	0.68%
6	US T N/B 1.375 11/30/18 アメリカ	国債証券	2,571,500,000	99.75 2,565,179,253	99.55 2,560,031,110	1.375000 2018/11/30	0.67%
7	US T N/B 2.375 02/28/15 アメリカ	国債証券	2,365,780,000	104.20 2,465,308,364	102.37 2,422,038,248	2.375000 2015/2/28	0.63%
8	US T N/B 1.25 09/30/15 アメリカ	国債証券	2,365,780,000	102.31 2,420,571,464	101.63 2,404,484,160	1.250000 2015/9/30	0.63%
9	FRANCE OAT 3.25 04/25/16 ユーロ	国債証券	2,161,320,000	108.33 2,341,408,154	106.66 2,305,371,978	3.250000 2016/4/25	0.60%
10	FRANCE OAT 3.0 10/25/15 ユーロ	国債証券	2,161,320,000	106.71 2,306,495,864	104.85 2,266,295,312	3.000000 2015/10/25	0.59%
11	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	2,057,200,000	110.00 2,262,920,000	107.38 2,209,144,792	3.250000 2016/12/31	0.58%
12	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	2,057,200,000	109.31 2,248,766,464	106.75 2,196,122,716	3.000000 2017/2/28	0.57%
13	US T N/B 3.0 09/30/16 アメリカ	国債証券	2,057,200,000	108.71 2,236,546,696	106.35 2,188,017,348	3.000000 2016/9/30	0.57%
14	ITALY BTFS 3.75 08/01/15 ユーロ	国債証券	2,091,600,000	103.57 2,166,270,120	104.15 2,178,443,232	3.750000 2015/8/1	0.57%
15	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	2,108,630,000	104.03 2,193,724,020	102.96 2,171,045,448	1.750000 2016/5/31	0.57%
16	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17 ユーロ	国債証券	1,952,160,000	112.51 2,196,481,190	110.34 2,154,110,952	3.750000 2017/1/4	0.56%
17	US T N/B 2.375 03/31/16 アメリカ	国債証券	2,057,200,000	105.94 2,179,418,252	104.23 2,144,384,136	2.375000 2016/3/31	0.56%
18	US T N/B 4.0 02/15/15 アメリカ	国債証券	2,057,200,000	107.34 2,208,342,484	103.99 2,139,405,712	4.000000 2015/2/15	0.56%
19	US T N/B 2.5 04/30/15 アメリカ	国債証券	2,057,200,000	104.79 2,155,781,024	102.90 2,116,899,944	2.500000 2015/4/30	0.55%
20	ITALY BTFS 3.75 08/01/16 ユーロ	国債証券	1,952,160,000	103.91 2,028,489,456	105.70 2,063,433,120	3.750000 2016/8/1	0.54%
21	US T N/B 0.375 06/15/15 アメリカ	国債証券	2,057,200,000	100.12 2,059,833,216	100.25 2,062,404,716	0.375000 2015/6/15	0.54%
22	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,851,480,000	115.17 2,132,368,030	110.16 2,039,590,368	3.625000 2020/2/15	0.53%

23	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	2,057,200,000	99.64 2,049,958,656	99.10 2,038,870,348	0.625000 2017/5/31	0.53%
24	ITALY BTIPS 4.5 02/01/18 ユーロ	国債証券	1,854,552,000	105.86 1,963,405,278	108.98 2,021,276,224	4.500000 2018/2/1	0.53%
25	US T N/B 4.5 11/15/15 アメリカ	国債証券	1,851,480,000	111.15 2,057,957,049	107.52 1,990,840,899	4.500000 2015/11/15	0.52%
26	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 ユーロ	国債証券	1,798,776,000	111.80 2,011,121,506	110.48 1,987,449,614	3.750000 2017/4/25	0.52%
27	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	1,851,480,000	110.07 2,038,072,154	107.26 1,986,064,081	3.125000 2017/4/30	0.52%
28	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15 ユーロ	国債証券	1,882,440,000	106.66 2,007,942,274	103.38 1,946,198,242	3.750000 2015/1/4	0.51%
29	US T N/B 4.125 05/15/15 アメリカ	国債証券	1,851,480,000	108.45 2,008,059,663	105.06 1,945,275,976	4.125000 2015/5/15	0.51%
30	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	1,748,620,000	115.03 2,011,455,072	110.92 1,939,726,679	4.875000 2016/8/15	0.50%

(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26年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.42%
合計	97.42%

(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。

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

順位	銘柄名 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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	11,864	15,930.49 188,999,429	15,732.43 186,649,632	- -	6.12%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE ユーロ	投資証券	3,740	26,891.00 100,572,354	24,883.06 93,062,674	- -	3.05%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	5,539	16,941.62 93,839,641	16,129.47 89,341,170	- -	2.93%
4	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	19,194	4,097.11 78,640,115	3,991.99 76,622,382	- -	2.51%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	13,070	5,396.61 70,533,761	5,671.70 74,129,124	- -	2.43%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	11,295	6,562.35 74,121,767	6,359.83 71,834,322	- -	2.35%
7	HCP INC アメリカ	投資証券	17,452	4,184.18 73,022,480	4,000.22 69,811,933	- -	2.29%
8	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	73,458	988.06 72,581,104	921.31 67,677,993	- -	2.22%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	5,838	10,495.94 61,275,327	11,108.87 64,853,641	- -	2.13%
10	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	11,051	6,440.99 71,179,460	5,868.16 64,849,069	- -	2.13%
11	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	6,599	9,293.97 61,330,973	9,399.34 62,026,289	- -	2.03%
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	4,678	12,742.03 59,607,251	12,565.37 58,780,836	- -	1.93%
13	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	27,913	1,937.21 54,073,400	1,885.42 52,627,834	- -	1.72%
14	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	27,178	1,649.28 44,824,392	1,756.18 47,729,677	- -	1.56%
15	LINK REIT/THE 香港	投資証券	94,100	514.04 48,371,803	464.72 43,730,528	- -	1.43%
16	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	20,797	2,141.62 44,539,426	2,056.17 42,762,196	- -	1.40%
17	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	36,191	1,035.89 37,490,125	1,136.00 41,113,250	- -	1.35%
18	SL GREEN アメリカ	投資証券	3,905	9,642.09 37,652,386	9,642.09 37,652,386	- -	1.23%
19	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	8,030	4,263.54 34,236,282	4,193.60 33,674,625	- -	1.10%
20	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	15,322	2,197.08 33,663,806	2,143.60 32,844,275	- -	1.08%
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	2,874	10,980.48 31,557,913	11,147.96 32,039,256	- -	1.05%
22	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資信託 受益証券	114,200	278.68 31,825,817	275.03 31,408,780	- -	1.03%

23	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	5,290	6,053.31 32,022,015	5,773.53 30,541,983	- -	1.00%
24	STOCKLAND オーストラリア	投資信託 受益証券	87,717	366.97 32,190,236	334.03 29,300,425	- -	0.96%
25	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,670	16,413.20 27,410,056	16,084.21 26,860,644	- -	0.88%
26	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	60,752	454.75 27,627,439	422.98 25,697,379	- -	0.84%
27	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	4,860	4,928.02 23,950,189	5,137.85 24,969,985	- -	0.82%
28	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	27,200	884.03 24,045,692	897.60 24,414,915	- -	0.80%
29	UDR INC アメリカ	投資証券	9,169	2,493.32 22,861,309	2,509.78 23,012,209	- -	0.75%
30	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	14,400	1,685.87 24,276,605	1,584.04 22,810,233	- -	0.75%

（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26年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	12.49%
投資証券	86.26%
合計	98.75%

（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。

#### 【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）

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年1月31日現在

種類	地域	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
株価指数先 物取引	日本	TOPIX 先物 2603月	買建	555	6,978,902,561	6,743,250,000	2.13%

（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。

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

種類	地域	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	日本	アメリカ・ドル買/ 円売2014年02 月	買建	31,200,000	3,189,275,540	3,208,920,000	1.05%
		ユーロ買/円売20 14年02月	買建	7,700,000	1,074,489,920	1,073,611,000	0.35%
		イギリス・ポンド 買/円売2014年 02月	買建	3,100,000	524,697,900	525,976,000	0.17%
		オーストラリア・ド ル買/円売2014 年02月	買建	2,700,000	241,397,550	244,998,000	0.08%
		カナダ・ドル買/円 売2014年02月	買建	2,500,000	228,400,500	230,450,000	0.08%
株価指数先 物取引	アメリカ	S&P 500 F UTURE Mar 14	買建	126	5,808,131,332	5,771,248,308	1.88%
	ユーロ	DJ EURO S TOXX 50 M ar 14	買建	454	1,921,162,488	1,912,467,009	0.62%
	イギリス	FTSE 100 INDEX FUT URE Mar 14	買建	85	945,224,498	935,607,036	0.31%
	カナダ	S&P/TSE 6 0 IX FUT Mar 14	買建	28	402,215,751	405,370,492	0.13%
	オースト ラリア	SPI 200 F UTURES Ma r 14	買建	33	392,353,325	384,760,414	0.13%

(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。



## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

種類	地域	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	日本	ユーロ買 / 円売 20 14年02月	買建	843,000	117,639,301	117,539,490	0.03%
		アメリカ・ドル買 / 円売 2014年02 月	買建	942,000	96,271,646	96,884,700	0.03%
		アメリカ・ドル売 / 円買 2014年02 月	売建	679,000	69,841,736	69,835,150	0.02%

(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) 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。

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(平成26年1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1計算期間末 (平成20年1月11日)	7,975	7,975	0.9125	0.9125
第2計算期間末 (平成21年1月13日)	5,934	5,934	0.6383	0.6383
第3計算期間末 (平成22年1月12日)	7,473	7,473	0.7361	0.7361
第4計算期間末 (平成23年1月11日)	7,727	7,727	0.7224	0.7224
第5計算期間末 (平成24年1月11日)	7,492	7,492	0.6688	0.6688
第6計算期間末 (平成25年1月11日)	8,892	8,892	0.8003	0.8003
第7計算期間末 (平成26年1月14日)	9,193	9,193	0.9817	0.9817
平成25年1月末日	9,117	-	0.8243	-
2月末日	9,165	-	0.8385	-
3月末日	9,538	-	0.8767	-
4月末日	9,906	-	0.9237	-
5月末日	9,631	-	0.9155	-
6月末日	9,272	-	0.8949	-
7月末日	9,294	-	0.9013	-
8月末日	9,171	-	0.8889	-
9月末日	9,537	-	0.9309	-
10月末日	9,520	-	0.9461	-
11月末日	9,529	-	0.9730	-
12月末日	9,330	-	0.9972	-
平成26年1月末日	9,096	-	0.9676	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	8.8
第2計算期間	30.0
第3計算期間	15.3
第4計算期間	1.9
第5計算期間	7.4
第6計算期間	19.7
第7計算期間	22.7

(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。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

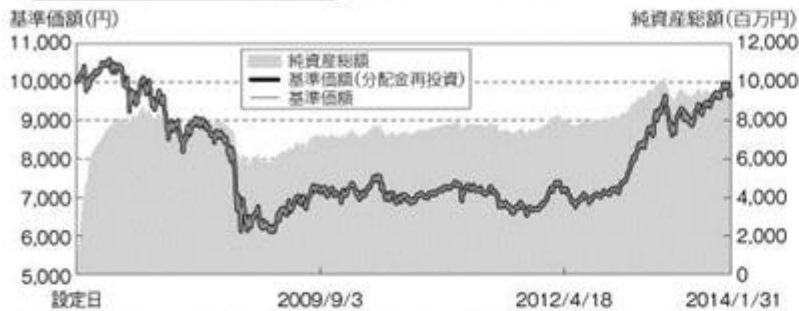
	設定口数	解約口数
第1計算期間	12,252,099,717	3,511,628,988
第2計算期間	2,271,286,181	1,714,151,191
第3計算期間	1,780,961,356	925,938,640
第4計算期間	1,561,559,539	1,016,414,248
第5計算期間	1,553,939,256	1,049,226,063
第6計算期間	1,341,335,454	1,433,126,499
第7計算期間	1,753,311,968	3,498,697,249

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日：2014年1月31日

## 基準価額・純資産の推移 (設定日(2007年1月26日)～2014年1月31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:2007年1月26日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第3期	(2010.01.12)	0円
第4期	(2011.01.11)	0円
第5期	(2012.01.11)	0円
第6期	(2013.01.11)	0円
第7期	(2014.01.14)	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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	25.44%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.05%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	23.28%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.76%
5	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.59%
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	7.51%

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.90
内 日本	97.90
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.10
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.65%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.63%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	2.07%
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.03%
5	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.98%

## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.85%
2	輸送用機器	11.62%
3	銀行業	9.57%
4	情報・通信業	7.00%
5	機械	5.27%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.13

## ■外国株式パッシブ・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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	94.98
内 アメリカ	56.53
内 ユーロ	13.36
内 イギリス	9.47
内 カナダ	4.28
内 スイス	3.99
内 その他	7.35
投資信託受益証券	0.27
内 オーストラリア	0.23
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.68
内 アメリカ	1.35
内 イギリス	0.13
内 ユーロ	0.13
内 香港	0.04
内 カナダ	0.03
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.07
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	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	1.55%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.42%
3	GOOGLE INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	1.06%
4	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.00%
5	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロメリット	0.89%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	石油・ガス・消耗燃料	8.36%
2	商業銀行	7.69%
3	医薬品	6.82%
4	保険	4.12%
5	各種金融サービス	3.13%

## 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)	1.72
株価指数先物取引(買建)	3.07

○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。

データの基準日: 2014年1月31日

## 主要な資産の状況

### ■国内債券パッシブ・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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	79.58
内 日本	79.58
地方債証券	6.58
内 日本	6.58
特殊債券	6.82
内 日本	6.82
社債券	6.32
内 日本	6.32
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.71
純資産総額	100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	329回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2023/6/20	1.25%
2	97回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.400000	2016/6/20	1.12%
3	328回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/3/20	1.12%
4	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.12%
5	306回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.400000	2020/3/20	1.10%

### ■外国債券パッシブ・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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	97.42
内 ユーロ	42.56
内 アメリカ	38.65
内 イギリス	7.84
内 カナダ	2.26
内 オーストラリア	1.48
内 その他	4.63
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.58
純資産総額	100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 0.625 07/15/16	国債証券	アメリカ	0.625000	2016/7/15	1.02%
2	US T N/B 2.5 03/31/15	国債証券	アメリカ	2.500000	2015/3/31	0.83%
3	US T N/B 1.25 08/31/15	国債証券	アメリカ	1.250000	2015/8/31	0.82%
4	US T N/B 3.25 06/30/16	国債証券	アメリカ	3.250000	2016/6/30	0.71%
5	US T N/B 2.25 01/31/15	国債証券	アメリカ	2.250000	2015/1/31	0.68%

#### 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)	0.06
為替予約取引(売建)	△0.02

### ■J-REITインデックスファンド・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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	99.06
内 日本	99.06
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.94
純資産総額	100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	10.60%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	8.26%
3	日本リートファンド投資法人	日本	6.24%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.78%
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.25%

### ■グローバルリート・パッシブ・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。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

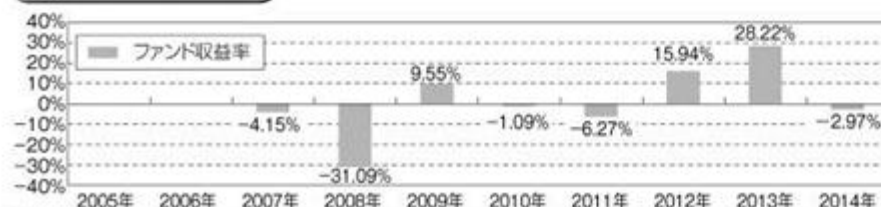
#### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	12.49
内 オーストラリア	9.06
内 シンガポール	3.44
投資証券	86.26
内 アメリカ	67.14
内 ユーロ	7.09
内 イギリス	7.03
内 カナダ	2.63
内 香港	2.01
内 ニュージーランド	0.35
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.25
純資産総額	100.00

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	6.12%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	ユーロ	3.05%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.93%
4	PROLOGIS INC	アメリカ	2.51%
5	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.43%

## 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として算出しております。

※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、2007年は設定日から年末までの収益率、および2014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。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○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、収益の分配がなされた場合に、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金再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。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）することができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。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、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれか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。）には、お申込みの受付は行いません。

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係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係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。受託会社は、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係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。

なお、収益分配金を再投資する場合には、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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

#### ・お申込手数料

ありません。

#### ・お申込単位

販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

#### ・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経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】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に販売会社の定める単位をもって解約を請求をすることができます。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。

解約のお申込みの受付は、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、解約の請求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、解約の請求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解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該解約に係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、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、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から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

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お支払いします。

### 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および借入有価証券を除きます。）を法令及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。

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19年1月26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1月12日から翌年1月11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、信託財産の純資産総額が10億円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、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.から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、その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出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、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係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係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.から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、当ファンドの計算期間末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。

#### ハ. 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。投資一任契約および投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドまたはマザーファンドの信託終了日まで存続します。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、毎計算期間の末日（原則として毎年1月11日。休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

(URL <http://www.diam.co.jp/>)

## 4【受益者の権利等】

### 収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資されます。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行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します。）に対し支払われます。販売会社は、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7期計算期間（平成25年1月12日から平成26年1月14日まで）の財務諸表について、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】

## マネックス資産設計ファンド&lt;育成型&gt;

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 平成25年1月11日現在	第7期 平成26年1月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	169,208,833	187,046,286
親投資信託受益証券	8,789,189,976	9,066,933,377
未収入金	11,557,000	3,369,000
流動資産合計	8,969,955,809	9,257,348,663
資産合計	8,969,955,809	9,257,348,663
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	36,791,671	15,308,809
未払受託者報酬	3,017,915	3,549,737
未払委託者報酬	37,939,950	44,625,880
その他未払費用	204,700	240,784
流動負債合計	77,954,236	63,725,210
負債合計	77,954,236	63,725,210
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 11,110,695,874	1 9,365,310,593
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 2,218,694,301	2 171,687,140
（分配準備積立金）	706,226,905	1,167,031,016
元本等合計	8,892,001,573	9,193,623,453
純資産合計	8,892,001,573	9,193,623,453
負債純資産合計	8,969,955,809	9,257,348,663

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第6期		第7期	
	自	平成24年1月12日 平成25年1月11日	自	平成25年1月12日 平成26年1月14日
<b>営業収益</b>				
受取利息		88,042		89,284
有価証券売買等損益		1,557,304,074		2,005,509,401
営業収益合計		1,557,392,116		2,005,598,685
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		5,912,614		6,997,193
委託者報酬		2,74,331,012		2,87,965,594
その他費用		401,036		474,630
営業費用合計		80,644,662		95,437,417
営業利益又は営業損失（ ）		1,476,747,454		1,910,161,268
経常利益又は経常損失（ ）		1,476,747,454		1,910,161,268
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,476,747,454		1,910,161,268
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（ ）		72,481,939		377,621,860
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,709,779,834		2,218,694,301
剰余金増加額又は欠損金減少額		471,158,078		671,782,673
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		471,158,078		671,782,673
剰余金減少額又は欠損金増加額		384,338,060		157,314,920
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		384,338,060		157,314,920
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,218,694,301		171,687,140



## ( 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1月11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、当計算期間末日を平成26年1月14日としております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第6期 平成25年1月11日現在	第7期 平成26年1月14日現在
1 . 1 期首元本額	11,202,486,919円	11,110,695,874円
期中追加設定元本額	1,341,335,454円	1,753,311,968円
期中一部解約元本額	1,433,126,499円	3,498,697,249円
2 . 受益権の総数	11,110,695,874口	9,365,310,593口
3 . 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,218,694,301円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は171,687,140円であります。

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第6期 自 平成24年1月12日 至 平成25年1月11日	第7期 自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14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（193,436,543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（314,925,157円）及び分配準備積立金（512,790,362円）より分配対象収益は1,021,152,062円（1万口当たり919.07円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（179,823,807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（484,440,850円）、信託約款に規定される収益調整金（359,621,359円）及び分配準備積立金（502,766,359円）より分配対象収益は1,526,652,375円（1万口当たり1,630.11円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。
2 . 2 当ファンドの主要投資対象であるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用	829,295円	1,406,531円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期	第7期
	自 平成24年1月12日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14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6期	第7期
	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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6期	第7期
	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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	1,473,804,199	1,693,962,734
合計	1,473,804,199	1,693,962,734

(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6期	第7期
	平成25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	0.8003円	0.9817円
(1万口当たり純資産額)	(8,003円)	(9,817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26年1月14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	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,356,765,982	2,396,998,460	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,904,283,775	2,265,145,550	
	J・REITインデックスファンド・マザーファンド	506,890,177	668,790,899	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	947,808,800	2,162,141,434	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	542,828,765	887,362,182	
	グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	565,155,884	686,494,852	
親投資信託受益証券 合計		5,823,733,383	9,066,933,377	
合計		5,823,733,383	9,066,933,377	

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、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「グローバルリート・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。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,274,614,333	5,895,360,972
株式	2	288,061,413,066	320,248,310,210
派生商品評価勘定		205,108,443	34,567,358
未収入金		3,376,637	1,288,606
未収配当金		324,804,849	273,846,443
流動資産合計		291,869,317,328	326,453,373,589
資産合計		291,869,317,328	326,453,373,589
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	51,798,776
前受金		169,900,000	117,119,000
未払解約金		125,621,000	110,521,000
流動負債合計		295,521,000	279,438,776
負債合計		295,521,000	279,438,776
純資産の部			
元本等			
元本	1	237,448,868,793	184,628,470,006
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		54,124,927,535	141,545,464,807
元本等合計		291,573,796,328	326,173,934,813
純資産合計		291,573,796,328	326,173,934,813
負債純資産合計		291,869,317,328	326,453,373,589

## 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	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。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
3 . 収益及び費用の計上基準	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。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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	254,010,406,324円	237,448,868,793円
同期中追加設定元本額	51,588,132,502円	33,232,963,873円
同期中一部解約元本額	68,149,670,033円	86,053,362,660円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	3,342,203,908円	3,900,764,442円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,124,411,816円	1,308,664,287円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	36,969,163,098円	37,386,437,254円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	957,396,034円	726,842,761円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	3,584,616,266円	2,805,437,849円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,627,226,257円	3,003,831,153円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	486,965,527円	378,149,242円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,564,883,551円	1,257,889,028円

D I A M D C バラン ス70インデックスファ ンド	1,208,432,963円	1,079,326,406円
マネックス資産設計ファ ンド<隔月分配型>	123,323,679円	109,772,183円
マネックス資産設計ファ ンド<育成型>	1,524,084,288円	1,356,765,982円
マネックス資産設計ファ ンド エポリューション	18,412,264円	19,179,120円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国10)	47,575円	7,069,809円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国20)	72,736円	9,887,126円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国30)	98,899円	22,348,148円
投資のソムリエ	2,463,013円	44,112,076円
クルーズコントロール	8,460,239円	86,707,019円
投資のソムリエ<DC年 金>	- 円	508,660円
D I A M 8資産 balan スファンドN<DC年金 >	- 円	580,141円
D I A Mワールド balan ス25VA(適格機関投 資家限定)	219,087,971円	147,803,854円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	9,902,179,526円	4,907,354,834円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,740,050,483円	978,877,750円
D I A M国際分散 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	205,408,632円	126,015,339円
D I A M国際分散 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	779,188,349円	419,728,031円
D I A M国内重視 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	201,556,717円	108,039,554円
D I A M国内重視 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	286,014,701円	179,391,499円
D I A M世界 balan スファンド40VA(適 格機関投資家限定)	19,405,357,081円	14,556,133,765円
D I A M世界 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	6,430,632,308円	4,839,311,271円

D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	4,819,546,621円	3,446,603,030円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	3,172,154,862円	2,349,448,692円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	7,355,651,520円	5,676,930,412円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	1,100,908,007円	669,358,539円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	2,408,510,938円	1,678,633,192円
D I A M アクサ グ ローバル バランスファ ンド30VA(適格機関 投資家限定)	2,416,554,459円	1,533,748,826円
D I A M世界アセットバ ランスファンドVA(適 格機関投資家向け)	13,895,228,477円	7,967,750,812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)	200,292,399円	92,608,020円
D I A M世界バランス ファンド55VA(適格 機関投資家限定)	4,434,605,750円	2,965,892,961円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	9,117,855,893円	7,262,788,775円
D I A Mグローバル分散 ファンドVA(適格機関 投資家限定)	438,508,601円	280,901,694円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	39,496,785,494円	27,214,805,359円
D I A M世界アセットバ ランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,468,429,367円	1,420,545,223円
D I A M世界アセットバ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,750,729,993円	3,195,419,506円
D I A M世界アセットバ ランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	24,377,132,725円	16,799,282,422円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	255,241,831円	39,341円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	103,294円	111,634,058円



	D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	161,931円		83,660,397円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	21,226,322,800円		14,880,840,688円
	D I A M世界バランス2 5VA(適格機関投資家 限定)	274,023,461円		185,393,173円
	D I A M国内バランス3 0VA(適格機関投資家 限定)	85,221,168円		55,660,343円
	D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	202,479,650円		114,554,615円
	D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	95,763円		4,903,437円
	D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	146,629円		121,576円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1212)(適格機関 投資家限定)	1,236,284,379円		952,190,469円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1303)(適格機関 投資家限定)	4,154,900円		2,443,408,346円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1306)(適格機関 投資家限定)	-円		3,341,912,869円
	D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA (1309)(適格機関 投資家限定)	-円		132,504,648円
	計	237,448,868,793円		184,628,470,006円
2.	受益権の総数	237,448,868,793口		184,628,470,006口
3.	2 差入代用有価証券	株式 2,130,000,000円	株式	3,072,000,000円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年1月12日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14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、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、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。 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、株価の変動によるリスクを有しております。	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	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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 「(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。 (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。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25年1月11日現在	平成26年1月14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	41,537,448,229	74,092,922,661
合計	41,537,448,229	74,092,922,661

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成24年2月8日から平成25年1月11日まで及び平成25年2月8日から平成26年1月14日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成25年1月11日 現在				平成26年1月14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	3,243,625,000	-	3,448,915,000	205,290,000	5,812,732,000	-	5,795,760,000	16,972,000
合計	3,243,625,000	-	3,448,915,000	205,290,000	5,812,732,000	-	5,795,760,000	16,972,000

## (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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.2279円	1.7667円
(1万口当たり純資産額)	(12,279円)	(17,667円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成26年1月14日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	81,000	266	21,546,000	
日本水産	246,700	230	56,741,000	
マルハニチロホールディングス	386,000	178	68,708,000	
ハウスイ	15,000	133	1,995,000	
サカタのタネ	29,700	1,317	39,114,900	
ホクト	22,400	1,929	43,209,600	
ショーボンドHD	17,800	4,830	85,974,000	
ミライト・ホールディングス	56,800	929	52,767,200	
タマホーム	8,500	957	8,134,500	
住石ホールディングス	56,800	141	8,008,800	
日鉄鉱業	51,000	495	25,245,000	
三井松島	132,000	164	21,648,000	
国際石油開発帝石	972,300	1,256	1,221,208,800	
日本海洋掘削	5,000	5,980	29,900,000	
石油資源開発	28,500	3,960	112,860,000	
K&Oエナジーグループ	10,500	1,472	15,456,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	2,007	3,411,900	
安藤・間	130,500	369	48,154,500	
東急建設	71,200	497	35,386,400	
コムシスホールディングス	97,200	1,528	148,521,600	
ミサワホーム	21,500	1,563	33,604,500	
高松コンストラクションGP	15,200	1,857	28,226,400	
東建コーポレーション	7,460	5,020	37,449,200	
ヤマウラ	10,100	290	2,929,000	
大成建設	1,011,000	462	467,082,000	
大林組	600,000	583	349,800,000	
清水建設	612,000	539	329,868,000	
飛島建設	123,300	173	21,330,900	
長谷工コーポレーション	266,900	812	216,722,800	
松井建設	2,000	435	870,000	
銭高組	22,000	281	6,182,000	
鹿島建設	879,000	390	342,810,000	
不動テトラ	142,400	178	25,347,200	
大末建設	77,000	124	9,548,000	
鉄建建設	122,000	304	37,088,000	
日鉄住金テックスエンジ	33,000	416	13,728,000	
西松建設	262,000	374	97,988,000	
三井住友建設	538,100	122	65,648,200	
大豊建設	57,000	423	24,111,000	
前田建設	123,000	669	82,287,000	
佐田建設	69,000	137	9,453,000	
ナカノフドー建設	15,900	246	3,911,400	
奥村組	177,000	477	84,429,000	

大和小田急建設	11,500	268	3,082,000
東鉄工業	24,100	1,962	47,284,200
イチケン	23,000	181	4,163,000
浅沼組	61,000	164	10,004,000
戸田建設	233,000	368	85,744,000
熊谷組	191,000	296	56,536,000
青木あすなる建設	12,400	590	7,316,000
北野建設	43,000	256	11,008,000
植木組	25,000	214	5,350,000
三井ホーム	26,000	504	13,104,000
矢作建設	27,300	891	24,324,300
ピーエス三菱	15,500	483	7,486,500
大東建託	75,900	9,761	740,859,900
新日本建設	24,100	328	7,904,800
N I P P O	46,000	1,671	76,866,000
東亜道路	38,000	511	19,418,000
前田道路	63,000	1,737	109,431,000
日本道路	54,000	565	30,510,000
東亜建設	175,000	246	43,050,000
若築建設	109,000	133	14,497,000
東洋建設	62,300	357	22,241,100
五洋建設	238,000	379	90,202,000
大林道路	24,000	598	14,352,000
世紀東急	104,000	140	14,560,000
福田組	30,000	467	14,010,000
住友林業	137,700	1,200	165,240,000
日本基礎技術	22,400	367	8,220,800
日成ビルド工業	52,000	246	12,792,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	91,000	138	12,558,000
巴コーポレーション	25,300	481	12,169,300
パナホーム	75,000	770	57,750,000
大和ハウス	549,000	1,917	1,052,433,000
ライト工業	41,900	746	31,257,400
積水ハウス	525,200	1,484	779,396,800
日特建設	24,600	396	9,741,600
北陸電気工事	10,000	408	4,080,000
ユアテック	32,000	332	10,624,000
西部電気工業	17,000	466	7,922,000
四電工	6,000	366	2,196,000
中電工	29,000	1,846	53,534,000
関電工	91,000	580	52,780,000
きんでん	133,000	1,036	137,788,000
東京エネシス	21,000	533	11,193,000
トーエネック	29,000	653	18,937,000
住友電設	13,900	1,536	21,350,400
日本電設工業	33,000	1,386	45,738,000
協和エクシオ	78,400	1,342	105,212,800
新日本空調	17,300	635	10,985,500
日本工営	63,000	452	28,476,000
N D S	31,000	291	9,021,000

九電工	37,000	809	29,933,000
三機工業	43,000	675	29,025,000
日 揮	201,000	4,011	806,211,000
中外炉工業	60,000	253	15,180,000
ヤマト	16,000	357	5,712,000
太平電業	29,000	622	18,038,000
高砂熱学	57,200	932	53,310,400
三晃金属	23,000	267	6,141,000
N E C ネットズエスアイ	19,400	2,506	48,616,400
朝日工業社	24,000	387	9,288,000
明星工業	29,000	470	13,630,000
アタカ大機	12,000	524	6,288,000
大 気 社	26,600	2,258	60,062,800
ダイダン	25,000	573	14,325,000
日比谷総合設備	24,600	1,305	32,103,000
東芝プラントシステム	32,000	1,514	48,448,000
日本製粉	123,000	500	61,500,000
日清製粉G本社	199,500	1,034	206,283,000
日東富士製粉	8,000	318	2,544,000
昭和産業	83,000	325	26,975,000
鳥越製粉	16,800	663	11,138,400
協同飼料	73,000	113	8,249,000
中部飼料	19,700	574	11,307,800
日本配合飼料	65,000	121	7,865,000
東洋精糖	34,000	103	3,502,000
日本甜菜糖	105,000	189	19,845,000
三井製糖	79,000	433	34,207,000
ネクスト	15,700	1,085	17,034,500
日本M & A センター	9,600	7,370	70,752,000
ノバレーゼ	5,000	761	3,805,000
アコーディア・ゴルフ	76,000	1,428	108,528,000
タケエイ	12,900	1,266	16,331,400
パソナグループ	18,600	719	13,373,400
リンクアンドモチベーション	243	24,210	5,883,030
G C A サヴィアン	11,100	996	11,055,600
エス・エム・エス	10,500	2,298	24,129,000
テンプホールディングス	40,800	2,918	119,054,400
リニカル	3,600	1,158	4,168,800
クックパッド	11,000	3,145	34,595,000
エスクリ	6,500	964	6,266,000
アイ・ケイ・ケイ	4,400	795	3,498,000
森永製菓	197,000	219	43,143,000
中 村 屋	48,000	398	19,104,000
江崎グリコ	72,000	1,255	90,360,000
名糖産業	9,300	1,051	9,774,300
不 二 家	116,000	193	22,388,000
山崎製パン	147,000	1,086	159,642,000
第一屋製パン	29,000	141	4,089,000
モロゾフ	33,000	318	10,494,000
亀田製菓	11,200	2,841	31,819,200

カルビー	73,300	2,437	178,632,100
森永乳業	170,000	308	52,360,000
六甲バター	9,600	820	7,872,000
ヤクルト	117,000	5,080	594,360,000
明治ホールディングス	59,200	6,600	390,720,000
雪印メグミルク	43,200	1,296	55,987,200
プリマハム	101,000	193	19,493,000
日本ハム	139,000	1,775	246,725,000
伊藤ハム	110,000	462	50,820,000
林兼産業	67,000	83	5,561,000
丸大食品	97,000	305	29,585,000
米 久	7,000	872	6,104,000
S Foods	13,000	1,077	14,001,000
学情	6,100	952	5,807,200
スタジオアリス	7,700	1,382	10,641,400
シミックホールディングス	7,100	1,281	9,095,100
システナ	17,200	843	14,499,600
NECフィールドディング	15,100	1,237	18,678,700
デジタルアーツ	4,800	941	4,516,800
新日鉄住金SOL	14,700	2,334	34,309,800
総合警備保障	67,900	2,017	136,954,300
日本駐車場開発	1,935	8,430	16,312,050
コア	6,700	766	5,132,200
カカクコム	113,100	2,024	228,914,400
アイロムホールディングス	4,200	1,020	4,284,000
ルネサンス	8,600	800	6,880,000
オプト	7,600	943	7,166,800
新日本科学	13,600	1,267	17,231,200
ツクイ	20,200	915	18,483,000
総合臨床HLDGS	5,600	572	3,203,200
キャリアデザインセンター	39	100,000	3,900,000
エムスリー	617	265,600	163,875,200
ベストブライダル	11,000	649	7,139,000
アウトソーシング	5,900	1,275	7,522,500
ディー・エヌ・エー	100,300	2,350	235,705,000
博報堂DYHLDGS	258,400	812	209,820,800
ぐるなび	13,000	3,110	40,430,000
一休	133	146,400	19,471,200
ジャパンベストレスキューS	118	64,700	7,634,600
ジェイコムホールディングス	3,500	781	2,733,500
PGMホールディングス	26,400	969	25,581,600
バリューコマース	11,500	1,415	16,272,500
サッポロホールディングス	328,000	402	131,856,000
アサヒグループホールディング	402,100	2,769	1,113,414,900
キリンHD	856,000	1,402	1,200,112,000
宝ホールディングス	157,000	885	138,945,000
オエノンホールディングス	49,000	235	11,515,000
養命酒	3,000	808	2,424,000
コカ・コーラウエスト	61,700	2,071	127,780,700
コカ・コーライーストジャパン	41,400	2,130	88,182,000



サントリー食品インター	102,700	3,290	337,883,000
ダイードリンコ	9,300	4,360	40,548,000
伊藤園	54,500	2,151	117,229,500
キーコーヒー	19,200	1,580	30,336,000
ユニカフェ	6,100	635	3,873,500
ジャパンフーズ	2,800	1,258	3,522,400
日清オイリオグループ	87,000	340	29,580,000
不二製油	48,700	1,522	74,121,400
J・オイルミルズ	85,000	288	24,480,000
ローソン	72,200	7,920	571,824,000
サンエー	13,300	3,105	41,296,500
キリン堂	6,600	698	4,606,800
ダイユーエイト	3,600	733	2,638,800
カワチ薬品	12,300	1,958	24,083,400
エービーシー・マート	25,000	4,685	117,125,000
ハードオフコーポレーション	8,600	895	7,697,000
高千穂交易	7,600	1,010	7,676,000
アスクル	15,100	3,115	47,036,500
ゲオホールディングス	30,100	957	28,805,700
アダストリアホールディング	13,500	3,610	48,735,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	23,000	271	6,233,000
伊藤忠食品	4,500	3,450	15,525,000
くらコーポレーション	10,400	1,739	18,085,600
キャンドウ	8,500	1,510	12,835,000
エレマテック	8,300	1,663	13,802,900
パル	10,300	2,483	25,574,900
JALUX	5,400	1,187	6,409,800
エディオン	80,700	595	48,016,500
あらた	39,000	330	12,870,000
サーラコーポレーション	15,400	499	7,684,600
トーメンデバイス	2,800	1,769	4,953,200
J Pホールディングス	31,500	425	13,387,500
あみやき亭	3,100	3,650	11,315,000
東京エレクトロンデバイス	3,700	1,594	5,897,800
ひらまつ	18,400	685	12,604,000
双日	1,181,600	186	219,777,600
ゲンキー	1,600	2,164	3,462,400
アルフレッサホールディングス	52,100	5,650	294,365,000
大黒天物産	3,600	2,784	10,022,400
ハニーズ	13,930	955	13,303,150
キッコーマン	163,000	1,853	302,039,000
味の素	477,000	1,428	681,156,000
キュービー	101,800	1,477	150,358,600
ハウス食品G本社	70,500	1,550	109,275,000
カゴメ	77,500	1,713	132,757,500
焼津水産化工	10,000	908	9,080,000
アリアケジャパン	18,300	2,591	47,415,300
ニチレイ	213,000	491	104,583,000
横浜冷凍	44,000	786	34,584,000
東洋水産	98,000	3,145	308,210,000

日清食品HD	78,200	4,380	342,516,000
永谷園	7,000	921	6,447,000
フジッコ	20,000	1,196	23,920,000
ロックフィールド	10,700	1,816	19,431,200
日本たばこ産業	1,108,300	3,172	3,515,527,600
ケンコーマヨネーズ	7,200	910	6,552,000
わらべや日洋	11,900	2,020	24,038,000
なとり	9,900	1,027	10,167,300
片倉工業	21,500	1,133	24,359,500
グンゼ	152,000	262	39,824,000
ヒューリック	297,000	1,365	405,405,000
神栄	25,000	252	6,300,000
山下医科器械	1,500	1,716	2,574,000
ラサ商事	8,900	489	4,352,100
アルペン	13,400	1,889	25,312,600
クオール	12,900	603	7,778,700
アルコニックス	5,400	2,294	12,387,600
神戸物産	1,800	2,425	4,365,000
ジェイアイエヌ	9,000	4,720	42,480,000
ピックカメラ	668	58,200	38,877,600
DCMホールディングス	86,800	709	61,541,200
MonotaRO	27,300	2,251	61,452,300
あいホールディングス	31,500	1,361	42,871,500
J. フロントリテイリング	416,000	706	293,696,000
ドトール・日レスHD	30,900	1,748	54,013,200
マツモトキヨシHLDGS	36,300	3,710	134,673,000
ブロンコビリー	2,900	1,901	5,512,900
スタートトゥデイ	54,900	2,441	134,010,900
物語コーポレーション	2,600	3,145	8,177,000
ココカラファイン	18,300	2,699	49,391,700
三越伊勢丹HD	350,100	1,365	477,886,500
東洋紡	790,000	186	146,940,000
ユニチカ	516,000	71	36,636,000
富士紡ホールディングス	98,000	233	22,834,000
日清紡ホールディングス	119,000	908	108,052,000
倉敷紡績	193,000	194	37,442,000
ダイワボウHD	160,000	211	33,760,000
シキボウ	109,000	136	14,824,000
日東紡績	137,000	489	66,993,000
トヨタ紡織	62,500	1,256	78,500,000
ウエルシアHD	6,400	5,810	37,184,000
クリエイトSDH	7,400	3,540	26,196,000
バイタルKSKHD	33,100	709	23,467,900
八洲電機	14,200	437	6,205,400
UKCホールディングス	11,300	1,742	19,684,600
丸善CHIHD	15,400	309	4,758,600
TOKAIホールディングス	86,100	346	29,790,600
エー・ピーカンパニー	1,600	1,999	3,198,400
三洋貿易	6,300	971	6,117,300
日本毛織	59,000	751	44,309,000

大東紡織	30,000	83	2,490,000
トーア紡コーポレーション	82,000	82	6,724,000
ガイドーリミテッド	21,300	687	14,633,100
東京建物不動産販	9,500	450	4,275,000
三栄建築設計	5,400	874	4,719,600
野村不動産HLDGS	116,300	2,271	264,117,300
プレサンスコーポレーション	3,200	2,923	9,353,600
常和ホールディングス	6,200	3,360	20,832,000
フージャースHD	26,300	712	18,725,600
オープンハウス	7,000	2,327	16,289,000
東急不動産HD	390,600	899	351,149,400
飯田GHD	77,200	1,960	151,312,000
帝国繊維	19,600	1,218	23,872,800
ブックオフコーポレーション	9,700	710	6,887,000
日本コークス工業	151,900	139	21,114,100
ミタチ産業	3,800	545	2,071,000
あさひ	10,200	1,487	15,167,400
日本調剤	2,260	2,763	6,244,380
コスモス薬品	8,900	12,270	109,203,000
シップヘルスケアHD	25,200	4,060	102,312,000
一六堂	2,800	476	1,332,800
ソフトクリエイトHD	5,800	1,032	5,985,600
セブン&アイ・HLDGS	736,800	4,267	3,143,925,600
クリエイト・レストランツ・ホール	2,200	2,975	6,545,000
ツルハホールディングス	17,300	9,770	169,021,000
サンマルクホールディングス	5,700	5,010	28,557,000
フェリシモ	5,000	1,030	5,150,000
トリドール	15,200	934	14,196,800
クスリのアオキ	2,600	5,880	15,288,000
帝人	765,000	235	179,775,000
東レ	1,356,000	691	936,996,000
クラレ	297,100	1,192	354,143,200
旭化成	1,166,000	830	967,780,000
サカイオーベックス	50,000	201	10,050,000
稲葉製作所	8,000	1,293	10,344,000
宮地エンジニアリングG	62,000	279	17,298,000
トーカロ	11,400	1,597	18,205,800
アルファCO	6,600	1,042	6,877,200
SUMCO	114,300	861	98,412,300
川田テクノロジーズ	3,900	2,690	10,491,000
住江織物	52,000	308	16,016,000
日本フェルト	11,000	464	5,104,000
イチカワ	13,000	318	4,134,000
日本バイリン	20,000	626	12,520,000
エコナックホールディングス	56,000	54	3,024,000
日東製網	23,000	184	4,232,000
芦森工業	42,000	140	5,880,000
アツギ	160,000	122	19,520,000
ダイニック	36,000	190	6,840,000

共和レザー	12,800	464	5,939,200
セーレン	50,300	836	42,050,800
東海染工	28,000	125	3,500,000
小松精練	32,000	548	17,536,000
ワコールホールディングス	112,000	1,072	120,064,000
ホギメディカル	11,800	5,530	65,254,000
レナウン	46,600	141	6,570,600
クラウドディア	2,400	1,153	2,767,200
T S Iホールディングス	90,000	675	60,750,000
I Tホールディングス	63,200	1,572	99,350,400
ネオス	3,500	1,426	4,991,000
電算システム	4,200	1,372	5,762,400
グリー	91,500	1,099	100,558,500
コーエーテクモHD	34,800	1,212	42,177,600
三菱総合研究所	6,800	2,124	14,443,200
ボルテージ	2,600	1,221	3,174,600
電算	1,300	2,070	2,691,000
ヒト・コミュニケーションズ	1,900	1,881	3,573,900
ブレインパッド	1,400	1,615	2,261,000
K L a b	11,800	806	9,510,800
ポルトゥウィン・ピットクル	10,800	1,933	20,876,400
イーブックイニシアティブ	2,500	2,260	5,650,000
ネクソン	146,000	934	136,364,000
アイスタイル	5,000	602	3,010,000
エムアップ	3,200	865	2,768,000
エイチーム	1,600	6,210	9,936,000
ブロードリーフ	17,400	1,910	33,234,000
ハーツユナイテッドグループ	4,000	2,617	10,468,000
特種東海製紙	108,000	212	22,896,000
ドワンゴ	15,900	2,725	43,327,500
ベリサーブ	1,100	1,779	1,956,900
マクロミル	28,100	783	22,002,300
ティーガイア	17,500	1,251	21,892,500
豆蔵ホールディングス	10,400	474	4,929,600
テクマトリックス	5,800	618	3,584,400
G M Oペイメントゲートウェイ	6,700	4,670	31,289,000
ザッパラス	9,900	790	7,821,000
インターネットイニシアティブ	25,900	2,785	72,131,500
ビットアイル	13,300	823	10,945,900
S R Aホールディングス	8,500	1,356	11,526,000
朝日ネット	16,300	564	9,193,200
王子ホールディングス	826,000	511	422,086,000
日本製紙	96,600	1,889	182,477,400
三菱製紙	266,000	92	24,472,000
北越紀州製紙	127,500	457	58,267,500
中越パルプ	71,000	218	15,478,000
巴川製紙	29,000	197	5,713,000
大王製紙	64,000	1,001	64,064,000
レンゴー	150,000	609	91,350,000
トーモク	59,000	355	20,945,000

ザ・パックス	13,300	1,811	24,086,300
コ-プケミカル	29,000	141	4,089,000
昭和電工	1,245,000	148	184,260,000
住友化学	1,376,000	428	588,928,000
日本化成	37,000	149	5,513,000
住友精化	39,000	911	35,529,000
日産化学	128,200	1,553	199,094,600
ラサ工業	71,000	195	13,845,000
クレハ	131,000	513	67,203,000
多木化学	8,000	755	6,040,000
テイカ	32,000	307	9,824,000
石原産業	337,000	127	42,799,000
片倉チツカリン	13,000	268	3,484,000
日本曹達	120,000	618	74,160,000
東ソー	500,000	461	230,500,000
トクヤマ	291,000	440	128,040,000
セントラル硝子	179,000	335	59,965,000
東亜合成	220,000	442	97,240,000
ダイソー	75,000	363	27,225,000
関東電化	45,000	263	11,835,000
電気化学	374,000	406	151,844,000
イビデン	108,700	2,000	217,400,000
信越化学	335,200	5,750	1,927,400,000
日本カ-パイド	55,000	302	16,610,000
堺化学	76,000	325	24,700,000
エア-ウォーター	154,000	1,443	222,222,000
大陽日酸	240,000	723	173,520,000
日本化学工業	70,000	144	10,080,000
日本パ-カラライジング	44,000	2,185	96,140,000
高压ガス	28,000	594	16,632,000
チタン工業	22,000	276	6,072,000
四国化成	27,000	792	21,384,000
戸田工業	34,000	290	9,860,000
ステラ ケミファ	9,600	1,610	15,456,000
保土谷化学	57,000	212	12,084,000
日本触媒	158,000	1,165	184,070,000
大日精化	72,000	492	35,424,000
カネカ	233,000	674	157,042,000
協和発酵キリン	224,000	1,076	241,024,000
三菱瓦斯化学	295,000	779	229,805,000
三井化学	850,000	240	204,000,000
J S R	171,500	1,982	339,913,000
東京応化工業	36,200	2,167	78,445,400
大阪有機化学	12,700	456	5,791,200
三菱ケミカルH L D G S	1,168,500	463	541,015,500
日本合成化学	38,000	967	36,746,000
ダイセル	243,000	843	204,849,000
住友ベ-クライト	146,000	380	55,480,000
積水化学	384,000	1,253	481,152,000
日本ゼオン	148,000	955	141,340,000

アイカ工業	52,600	2,108	110,880,800
宇部興産	942,000	224	211,008,000
積水樹脂	26,400	1,415	37,356,000
タキロン	44,000	446	19,624,000
旭有機材	66,000	220	14,520,000
日立化成	80,800	1,584	127,987,200
ニチバン	19,000	366	6,954,000
リケンテクノス	30,000	578	17,340,000
大倉工業	45,000	357	16,065,000
積水化成成品	53,000	280	14,840,000
群栄化学	50,000	473	23,650,000
タイガース ポリマー	9,400	455	4,277,000
ミライアル	4,700	1,664	7,820,800
日本化薬	132,000	1,405	185,460,000
カーリットホールディングス	15,100	492	7,429,200
イーピーエス	200	127,000	25,400,000
パナソニック インフォシス	3,600	3,180	11,448,000
フェイス	5,300	1,115	5,909,500
アミューズ	5,200	2,054	10,680,800
野村総合研究所	99,700	3,265	325,520,500
ドリームインキュベータ	49	165,800	8,124,200
サイバネットシステム	15,100	355	5,360,500
T A C	11,600	400	4,640,000
ケネディクス	220,100	489	107,628,900
電通	175,800	4,020	706,716,000
インテージホールディングス	9,600	1,319	12,662,400
テイクアンドギヴニーズ	8,000	2,190	17,520,000
ぴあ	5,600	1,840	10,304,000
イオンファンタジー	6,100	1,565	9,546,500
ソースネクスト	9,000	899	8,091,000
ネクシィーズ	6,800	820	5,576,000
メディカルシステムネットワーク	14,500	494	7,163,000
日本精化	15,800	641	10,127,800
A D E K A	80,600	1,149	92,609,400
日油	155,000	749	116,095,000
ミヨシ油脂	71,000	159	11,289,000
新日本理化	22,800	277	6,315,600
ハリマ化成グループ	16,200	475	7,695,000
花 王	486,100	3,207	1,558,922,700
第一工業製薬	35,000	251	8,785,000
三洋化成	59,000	739	43,601,000
武田薬品	700,200	4,782	3,348,356,400
アステラス製薬	430,500	6,027	2,594,623,500
大日本住友製薬	132,400	1,760	233,024,000
塩野義製薬	291,900	2,224	649,185,600
田辺三菱製薬	155,600	1,534	238,690,400
わかもと製薬	7,000	272	1,904,000
あすか製薬	22,000	787	17,314,000
日本新薬	43,000	2,032	87,376,000
ピオフェルミン製薬	3,100	2,508	7,774,800

中外製薬	186,100	2,225	414,072,500
科研製薬	68,000	1,580	107,440,000
エーザイ	230,100	3,926	903,372,600
ロート製薬	79,000	1,669	131,851,000
小野薬品	84,900	9,790	831,171,000
久光製薬	58,000	5,010	290,580,000
有機合成薬品	13,000	285	3,705,000
持田製薬	13,800	6,200	85,560,000
参天製薬	68,700	4,780	328,386,000
扶桑薬品	63,000	336	21,168,000
日本ケミファ	26,000	474	12,324,000
ツムラ	54,900	2,683	147,296,700
日医工	43,800	1,548	67,802,400
テルモ	136,800	4,785	654,588,000
みらかホールディングス	49,000	5,000	245,000,000
キッセイ薬品工業	34,700	2,538	88,068,600
生化学工業	39,100	1,364	53,332,400
栄研化学	14,600	1,910	27,886,000
日水製薬	7,900	1,094	8,642,600
鳥居薬品	12,800	3,075	39,360,000
JCRファーマ	10,800	2,101	22,690,800
東和薬品	9,500	4,245	40,327,500
富士製薬工業	5,400	1,910	10,314,000
沢井製薬	29,300	6,910	202,463,000
ゼリア新薬工業	29,500	2,537	74,841,500
第一三共	589,400	1,934	1,139,899,600
キョーリン製薬HD	49,900	2,324	115,967,600
大幸薬品	8,900	2,650	23,585,000
ダイト	6,200	1,527	9,467,400
大塚ホールディングス	370,900	3,105	1,151,644,500
大正製薬HD	45,000	7,200	324,000,000
大日本塗料	108,000	171	18,468,000
日本ペイント	162,000	1,783	288,846,000
関西ペイント	227,000	1,469	333,463,000
神東塗料	11,000	230	2,530,000
中国塗料	54,000	578	31,212,000
日本特殊塗料	14,700	635	9,334,500
藤倉化成	23,800	662	15,755,600
太陽ホールディングス	15,300	3,340	51,102,000
DIC	663,000	309	204,867,000
サカティンクス	38,300	965	36,959,500
東洋インキSCホールディング	168,000	514	86,352,000
T&K TOKA	6,800	2,317	15,755,600
アルプス技研	7,800	1,019	7,948,200
サニックス	27,200	990	26,928,000
ダイオーズ	3,600	893	3,214,800
日本空調サービス	4,700	1,203	5,654,100
オリエンタルランド	50,400	15,025	757,260,000
ダスキン	50,500	2,003	101,151,500
パーク24	92,000	2,073	190,716,000

明光ネットワークジャパン	18,600	1,101	20,478,600
ファルコSDホールディングス	9,600	1,227	11,779,200
クレスコ	4,200	972	4,082,400
フジ・メディア・HD	170,300	2,055	349,966,500
秀英予備校	4,000	334	1,336,000
田谷	3,700	765	2,830,500
ラウンドワン	53,000	927	49,131,000
リゾートトラスト	63,100	1,767	111,497,700
オービック	60,700	2,971	180,339,700
TDCソフトウェアエンジニア	4,100	826	3,386,600
ヤフー	1,275,000	623	794,325,000
ビー・エム・エル	12,200	3,580	43,676,000
ワタベウェディング	6,400	685	4,384,000
トレンドマイクロ	77,700	3,300	256,410,000
もしもしホットライン	34,700	1,121	38,898,700
リソー教育	21,000	591	12,411,000
日本オラクル	35,200	3,760	132,352,000
アルファシステムズ	5,800	1,433	8,311,400
フューチャーアーキテクト	21,300	576	12,268,800
シーエーシー	11,000	927	10,197,000
ソフトバンク・テクノ	4,200	1,605	6,741,000
トーセ	4,400	789	3,471,600
ユー・エス・エス	225,800	1,437	324,474,600
オービックビジネスC	8,900	3,385	30,126,500
伊藤忠テクノソリュー	19,900	4,165	82,883,500
アイティフォー	19,800	490	9,702,000
東京個別指導学院	9,700	247	2,395,900
東計電算	3,300	1,514	4,996,200
エクスネット	1,800	1,383	2,489,400
テー・オー・ダブリュー	6,600	668	4,408,800
大塚商会	15,800	12,460	196,868,000
総合メディカル	4,300	4,100	17,630,000
サイボウズ	26,500	462	12,243,000
ソフトブレーン	24,700	143	3,532,100
アグレックス	4,200	1,007	4,229,400
セントラルスポーツ	5,900	1,538	9,074,200
パラカ	4,600	788	3,624,800
電通国際情報S	10,900	1,132	12,338,800
イーエムシステムズ	2,400	2,044	4,905,600
ウェザーニューズ	4,600	2,505	11,523,000
C I J	16,800	419	7,039,200
WOWOW	5,400	3,520	19,008,000
フルキャストホールディングス	18,000	264	4,752,000
富士フィルムHLDS	427,800	2,969	1,270,138,200
コニカミノルタ	471,500	1,086	512,049,000
資生堂	332,500	1,613	536,322,500
ライオン	216,000	570	123,120,000
高砂香料	67,000	600	40,200,000
マンダム	18,700	3,345	62,551,500
ミルボン	11,900	4,140	49,266,000



ファンケル	43,500	1,141	49,633,500
コーセー	30,200	3,270	98,754,000
ドクターシーラボ	127	330,500	41,973,500
シーボン	1,800	2,245	4,041,000
ポーラ・オルビスHD	19,100	3,605	68,855,500
ノエビアホールディングス	12,500	1,911	23,887,500
エステー	11,600	989	11,472,400
コニシ	13,600	1,923	26,152,800
長谷川香料	23,800	1,441	34,295,800
星光PMC	8,200	528	4,329,600
小林製薬	30,600	5,700	174,420,000
荒川化学工業	15,800	928	14,662,400
メック	14,600	642	9,373,200
日本高純度化学	54	218,000	11,772,000
JCU	2,800	5,580	15,624,000
新田ゼラチン	11,300	1,000	11,300,000
アース製薬	13,500	3,565	48,127,500
イハラケミカル	29,000	764	22,156,000
北興化学	11,000	294	3,234,000
大成ラミック	4,900	2,624	12,857,600
クミアイ化学	39,000	670	26,130,000
日本農薬	43,000	1,515	65,145,000
昭和シエル石油	167,200	982	164,190,400
コスモ石油	516,000	198	102,168,000
富士興産	6,700	697	4,669,900
ニチレキ	23,000	990	22,770,000
東燃ゼネラル石油	282,000	927	261,414,000
ユシロ化学	10,200	1,017	10,373,400
ビービー・カストロール	8,400	471	3,956,400
富士石油	47,700	327	15,597,900
MORESCO	4,500	1,808	8,136,000
出光興産	88,600	2,379	210,779,400
JXホールディングス	2,073,500	522	1,082,367,000
横浜ゴム	209,000	976	203,984,000
東洋ゴム	155,000	614	95,170,000
ブリヂストン	585,800	3,846	2,252,986,800
住友ゴム	145,900	1,509	220,163,100
藤倉ゴム	11,800	1,437	16,956,600
オカモト	65,000	340	22,100,000
アキレス	148,000	151	22,348,000
フコク	8,100	1,045	8,464,500
ニッタ	18,500	2,291	42,383,500
クリエートメディック	6,100	961	5,862,100
東海ゴム工業	34,500	1,029	35,500,500
三ツ星ベルト	47,000	609	28,623,000
バンドー化学	68,000	435	29,580,000
鬼怒川ゴム	34,000	527	17,918,000
旭硝子	920,000	627	576,840,000
日本板硝子	902,000	149	134,398,000
石塚硝子	24,000	355	8,520,000

有沢製作所	31,200	633	19,749,600
日本山村硝子	74,000	183	13,542,000
日本電気硝子	386,000	513	198,018,000
オハラ	7,100	625	4,437,500
住友大阪セメント	355,000	390	138,450,000
太平洋セメント	1,098,000	401	440,298,000
デイ・シイ	19,300	656	12,660,800
リゾートソリューション	17,000	245	4,165,000
日本ヒユ-ム	18,000	921	16,578,000
日本コンクリ-ト	32,000	499	15,968,000
三谷セキサン	9,400	1,381	12,981,400
ジャパンパイル	15,300	1,027	15,713,100
東海カーボン	175,000	337	58,975,000
日本カーボン	99,000	197	19,503,000
東洋炭素	10,300	2,132	21,959,600
ノリタケ	106,000	268	28,408,000
TOTO	275,000	1,660	456,500,000
日本碍子	236,000	1,853	437,308,000
日本特殊陶業	161,000	2,455	395,255,000
ダントーホールディングス	26,000	145	3,770,000
MARUWA	4,800	3,585	17,208,000
品川リフラクトリーズ	47,000	226	10,622,000
黒崎播磨	40,000	249	9,960,000
ヨータイ	11,000	307	3,377,000
イソライト	7,400	197	1,457,800
東京窯業	23,000	231	5,313,000
ニッカトー	6,700	417	2,793,900
フジミインコーポレーテッド	17,000	1,332	22,644,000
エーアンドエーマテリアル	39,000	155	6,045,000
ニチアス	90,000	723	65,070,000
新日鐵住金	7,899,000	335	2,646,165,000
神戸製鋼所	2,589,000	179	463,431,000
中山製鋼所	105,000	94	9,870,000
合同製鐵	95,000	181	17,195,000
JFEホールディングス	476,700	2,295	1,094,026,500
日新製鋼HD	79,100	1,208	95,552,800
東京製鐵	103,200	507	52,322,400
共英製鋼	17,400	1,840	32,016,000
大和工業	38,600	3,195	123,327,000
東京鐵鋼	39,000	393	15,327,000
大阪製鐵	9,400	1,759	16,534,600
淀川製鋼所	133,000	450	59,850,000
東洋鋼鈑	45,000	477	21,465,000
丸一鋼管	62,500	2,629	164,312,500
モリ工業	29,000	426	12,354,000
大同特殊鋼	313,000	498	155,874,000
日本高周波	74,000	113	8,362,000
日本冶金工	146,500	331	48,491,500
山陽特殊製鋼	102,000	492	50,184,000
愛知製鋼	99,000	420	41,580,000

日立金属	166,000	1,507	250,162,000
日本金属	49,000	157	7,693,000
大太平洋金属	130,000	369	47,970,000
日本電工	80,000	307	24,560,000
栗本鉄工所	97,000	251	24,347,000
虹 技	20,000	202	4,040,000
日本鋳鉄管	20,000	237	4,740,000
日本製鋼所	267,000	553	147,651,000
三菱製鋼	113,000	263	29,719,000
日亜鋼業	26,000	387	10,062,000
日本精線	14,000	457	6,398,000
大紀アルミニウム	29,000	278	8,062,000
日本軽金属HD	423,300	141	59,685,300
三井金属	476,000	308	146,608,000
東邦亜鉛	105,000	348	36,540,000
三菱マテリアル	1,166,000	357	416,262,000
住友鉱山	483,000	1,389	670,887,000
DOWAホールディングス	206,000	976	201,056,000
古河機金	314,000	208	65,312,000
エス・サイエンス	66,300	57	3,779,100
大阪チタニウム	20,400	1,701	34,700,400
東邦チタニウム	31,600	687	21,709,200
U A C J	237,000	399	94,563,000
古河電工	587,000	264	154,968,000
住友電工	704,000	1,707	1,201,728,000
フジクラ	300,000	474	142,200,000
昭和電線HLDGS	240,000	110	26,400,000
東京特殊電線	27,000	165	4,455,000
タツタ電線	27,300	629	17,171,700
沖 電 線	20,000	208	4,160,000
カナレ電気	2,800	1,483	4,152,400
平河ヒューテック	4,200	862	3,620,400
リョービ	114,000	421	47,994,000
アサヒHD	28,100	1,880	52,828,000
東洋製罐グループHD	132,700	2,020	268,054,000
ホッカンホールディングス	45,000	349	15,705,000
コロナ	9,800	1,130	11,074,000
横河ブリッジHLDGS	35,000	1,536	53,760,000
日本橋梁	41,400	202	8,362,800
駒井ハルテック	36,000	336	12,096,000
高田機工	17,000	221	3,757,000
三和ホールディングス	157,000	708	111,156,000
文化シャッタ -	44,000	642	28,248,000
三協立山	24,500	2,243	54,953,500
東洋シャッタ -	5,400	601	3,245,400
L I X I Lグループ	260,200	2,917	759,003,400
日本ファイルコン	12,500	429	5,362,500
ノーリツ	36,700	2,226	81,694,200
長府製作所	20,000	2,345	46,900,000
リンナイ	28,900	8,070	233,223,000

ユニプレス	28,900	2,101	60,718,900
ダイニチ工業	9,500	786	7,467,000
日東精工	26,000	331	8,606,000
三洋工業	24,000	194	4,656,000
岡 部	36,900	1,217	44,907,300
中国工業	3,000	781	2,343,000
東 プ レ	36,000	1,534	55,224,000
高周波熱錬	27,300	849	23,177,700
東京製綱	127,000	162	20,574,000
モリテックスチル	10,000	301	3,010,000
パイオラックス	8,700	4,050	35,235,000
日本発条	148,900	1,201	178,828,900
中央発條	24,000	310	7,440,000
アドバネクス	38,000	156	5,928,000
三浦工業	27,700	2,618	72,518,600
タ ク マ	58,000	901	52,258,000
リブセンス	9,300	2,491	23,166,300
E R Iホールディングス	3,700	1,189	4,399,300
ツ ガ ミ	58,000	620	35,960,000
オークマ	122,000	1,134	138,348,000
東芝機械	102,000	630	64,260,000
ア マ ダ	286,000	893	255,398,000
アイダエンジニア	43,900	1,162	51,011,800
滝澤鉄工所	47,000	160	7,520,000
富士機械製造	56,800	885	50,268,000
牧野フライス	93,000	924	85,932,000
オーエスジー	76,800	1,908	146,534,400
ダイジェット	22,000	158	3,476,000
旭ダイヤモンド	48,000	1,109	53,232,000
D M G 森精機	98,500	1,992	196,212,000
ディスコ	20,700	6,770	140,139,000
日東工器	10,800	1,823	19,688,400
豊田自動織機	162,500	4,675	759,687,500
豊和工業	10,600	883	9,359,800
大阪機工	73,000	144	10,512,000
石川製作所	43,000	127	5,461,000
東洋機械金属	14,100	425	5,992,500
津田駒工業	45,000	172	7,740,000
エンシュウ	46,000	161	7,406,000
島精機製作所	24,300	1,781	43,278,300
日阪製作所	24,000	1,002	24,048,000
やまびこ	7,300	3,150	22,995,000
ベガサスミシン製造	17,200	403	6,931,600
ナブテスコ	85,300	2,520	214,956,000
三井海洋開発	15,500	2,947	45,678,500
レオン自動機	17,000	671	11,407,000
S M C	53,400	27,210	1,453,014,000
新川	15,700	686	10,770,200
ホソカワミクロン	31,000	684	21,204,000
ユニオンツール	8,100	2,407	19,496,700

オイルス工業	17,700	2,131	37,718,700
日精エーエスビー	5,100	2,741	13,979,100
サト-ホールディングス	19,500	2,477	48,301,500
日本エアータック	5,800	530	3,074,000
日精樹脂工業	13,600	648	8,812,800
ワイエイシイ	7,800	564	4,399,200
小松製作所	871,600	2,038	1,776,320,800
住友重機械	511,000	459	234,549,000
日立建機	95,300	2,088	198,986,400
日 工	28,000	641	17,948,000
巴工業	6,400	1,698	10,867,200
井関農機	191,000	305	58,255,000
T O W A	15,300	505	7,726,500
丸山製作所	39,000	266	10,374,000
北川鉄工所	86,000	203	17,458,000
シンニッタン	17,700	402	7,115,400
クボタ	975,000	1,703	1,660,425,000
荏原実業	5,000	1,350	6,750,000
東洋エンジニア	107,000	438	46,866,000
三菱化工機	62,000	173	10,726,000
月島機械	30,000	1,125	33,750,000
帝国電機製作所	6,300	2,746	17,299,800
東京機械	66,000	113	7,458,000
新東工業	43,800	800	35,040,000
渋谷工業	11,700	2,662	31,145,400
アイチ コーポレーション	26,400	473	12,487,200
小森コーポレーション	45,400	1,723	78,224,200
鶴見製作所	14,000	1,101	15,414,000
住友精密	29,000	462	13,398,000
酒井重工業	36,000	392	14,112,000
荏原製作所	413,000	686	283,318,000
石井鉄工所	28,000	303	8,484,000
西島製作所	19,900	1,145	22,785,500
千代田化工建	159,000	1,529	243,111,000
ダイキン工業	243,700	6,004	1,463,174,800
オルガノ	29,000	482	13,978,000
ト-ヨ-カネツ	100,000	302	30,200,000
栗田工業	112,200	2,209	247,849,800
椿本チエイン	95,000	809	76,855,000
大同工業	37,000	331	12,247,000
日本コンベヤ	59,000	146	8,614,000
日 機 装	58,000	1,340	77,720,000
木村化工機	17,200	468	8,049,600
新興プランテック	41,100	768	31,564,800
アネスト岩田	30,000	678	20,340,000
ダイフク	75,500	1,271	95,960,500
加藤製作所	42,000	631	26,502,000
油研工業	35,000	260	9,100,000
タダノ	79,000	1,395	110,205,000
フジテック	52,000	1,349	70,148,000

C K D	50,000	1,138	56,900,000
キトー	10,500	2,038	21,399,000
平和	38,600	1,760	67,936,000
理想科学工業	13,800	2,105	29,049,000
S A N K Y O	54,100	4,980	269,418,000
日本金銭機械	16,500	2,019	33,313,500
マースエンジニアリング	10,100	1,971	19,907,100
福島工業	9,800	1,528	14,974,400
オーイズミ	6,300	1,168	7,358,400
ダイコク電機	7,400	2,192	16,220,800
ア マ ノ	51,000	1,016	51,816,000
J U K I	115,000	239	27,485,000
サンデン	101,000	506	51,106,000
蛇の目マシン	174,000	92	16,008,000
ブラザー工業	230,700	1,388	320,211,600
マックス	28,000	1,154	32,312,000
モリタホールディングス	31,000	870	26,970,000
グローリー	53,200	2,671	142,097,200
新晃工業	12,500	817	10,212,500
大和冷機工業	29,000	707	20,503,000
セガサミーホールディングス	191,800	2,666	511,338,800
日本ピストンリング	71,000	215	15,265,000
リ ケ ン	71,000	481	34,151,000
T P R	19,900	1,872	37,252,800
ホシザキ電機	39,000	3,740	145,860,000
大豊工業	12,900	1,158	14,938,200
日本精工	397,000	1,260	500,220,000
N T N	413,000	484	199,892,000
ジェイテクト	189,600	1,651	313,029,600
不 二 越	166,000	612	101,592,000
ミネベア	243,000	768	186,624,000
日本トムソン	57,000	553	31,521,000
T H K	111,300	2,482	276,246,600
ユーシン精機	7,900	2,434	19,228,600
前澤給装工業	7,000	1,336	9,352,000
イーグル工業	22,000	1,741	38,302,000
前澤工業	13,500	344	4,644,000
日本ピラ - 工業	19,000	717	13,623,000
キッツ	80,000	523	41,840,000
日 立	4,286,000	833	3,570,238,000
東 芝	3,522,000	462	1,627,164,000
三菱電機	1,785,000	1,288	2,299,080,000
富士電機	497,000	494	245,518,000
東洋電機製造	35,000	340	11,900,000
安川電機	196,000	1,537	301,252,000
シンフォニア テクノロジー	107,000	173	18,511,000
明 電 舎	164,000	406	66,584,000
オリジン電気	26,000	333	8,658,000
山洋電気	27,000	669	18,063,000
デンヨー	17,600	1,481	26,065,600

日立工機	47,600	737	35,081,200
三桜工業	23,200	738	17,121,600
マキタ	116,400	5,440	633,216,000
東芝テック	112,000	719	80,528,000
芝浦メカトロニクス	32,000	266	8,512,000
マブチモーター	25,200	6,010	151,452,000
日本電産	96,500	10,415	1,005,047,500
東光高岳HD	9,900	1,930	19,107,000
宮越ホールディングス	6,200	284	1,760,800
ダイヘン	105,000	488	51,240,000
ヤーマン	2,400	1,393	3,343,200
JVCケンウッド	123,300	206	25,399,800
第一精工	7,400	1,228	9,087,200
日新電機	36,000	626	22,536,000
大崎電気	28,000	545	15,260,000
オムロン	201,400	4,570	920,398,000
日東工業	26,200	1,838	48,155,600
I D E C	23,300	942	21,948,600
ジーエス・ユアサ コーポ	344,000	586	201,584,000
サクサホールディングス	45,000	172	7,740,000
メルコホールディングス	8,600	1,550	13,330,000
テクノメディカ	4,100	2,160	8,856,000
日本電気	2,453,000	272	667,216,000
富士通	1,721,000	526	905,246,000
沖電気	689,000	262	180,518,000
岩崎通信機	85,000	102	8,670,000
電気興業	51,000	741	37,791,000
サンケン電気	97,000	758	73,526,000
ナカヨ通信機	17,000	349	5,933,000
アイホン	10,400	1,762	18,324,800
ルネサスエレクトロニクス	92,400	620	57,288,000
セイコーエプソン	121,800	2,944	358,579,200
ワコム	140,500	705	99,052,500
アルバック	30,100	1,559	46,925,900
アクセル	9,000	1,835	16,515,000
ピクセラ	7,400	165	1,221,000
E I Z O	16,400	2,781	45,608,400
日本信号	45,000	914	41,130,000
京三製作所	42,000	351	14,742,000
能美防災	24,000	1,047	25,128,000
ホーチキ	13,000	573	7,449,000
エレコム	6,400	1,362	8,716,800
日本無線	46,000	381	17,526,000
パナソニック	2,039,100	1,319	2,689,572,900
シャープ	1,287,000	334	429,858,000
アンリツ	103,800	1,146	118,954,800
富士通ゼネラル	42,000	1,066	44,772,000
日立国際電気	35,000	1,458	51,030,000
ソ ニ ー	978,500	1,793	1,754,450,500
T D K	107,700	4,680	504,036,000

帝国通信工業	44,000	184	8,096,000
ミツミ電機	68,000	799	54,332,000
タムラ製作所	69,000	316	21,804,000
アルプス電気	130,900	1,133	148,309,700
池上通信機	57,000	112	6,384,000
パイオニア	247,800	221	54,763,800
日本電波工業	16,100	931	14,989,100
日本トリム	3,900	8,100	31,590,000
ローランド ディー . ジー .	7,900	3,650	28,835,000
日本コロムビア	8,800	604	5,315,200
フオスタ - 電機	18,300	1,883	34,458,900
クラリオン	110,000	165	18,150,000
S M K	53,000	686	36,358,000
ヨコオ	15,300	549	8,399,700
東 光	84,000	353	29,652,000
ティアック	97,000	103	9,991,000
ホシデン	52,400	577	30,234,800
ヒロセ電機	31,000	14,350	444,850,000
日本航空電子	46,000	1,404	64,584,000
T O A	19,200	1,030	19,776,000
古野電気	17,300	801	13,857,300
ユニデン	56,000	358	20,048,000
アルパイン	38,700	1,489	57,624,300
スミダコーポレーション	14,800	554	8,199,200
アイコム	9,900	2,468	24,433,200
リオン	5,100	1,579	8,052,900
船井電機	18,000	1,401	25,218,000
横河電機	193,600	1,559	301,822,400
新電元工業	57,000	633	36,081,000
アズビル	54,100	2,505	135,520,500
日本光電工業	38,100	3,810	145,161,000
チ ノ ー	33,000	225	7,425,000
共和電業	21,000	435	9,135,000
日本電子材料	8,300	657	5,453,100
堀場製作所	33,000	3,625	119,625,000
アドバンテスト	121,700	1,171	142,510,700
小野測器	19,000	445	8,455,000
エスベック	18,500	874	16,169,000
パナソニックデバイス	15,900	499	7,934,100
キーエンス	40,400	43,680	1,764,672,000
日置電機	9,400	1,392	13,084,800
シスメックス	74,700	6,190	462,393,000
メガチップス	16,000	1,551	24,816,000
O B A R A G R O U P	11,600	3,355	38,918,000
日本電産コバル電子	18,600	645	11,997,000
澤藤電機	11,000	231	2,541,000
デンソー	441,000	5,466	2,410,506,000
コーセル	26,000	1,209	31,434,000
新日本無線	13,000	385	5,005,000
オブテックス	11,400	1,653	18,844,200



千代田インテグレ	7,900	1,910	15,089,000
レーザーテック	12,800	1,032	13,209,600
スタンレー電気	128,600	2,399	308,511,400
岩崎電気	65,000	219	14,235,000
ウシオ電機	108,300	1,355	146,746,500
岡谷電機	10,100	396	3,999,600
ヘリオステクノH	15,300	403	6,165,900
日本セラミック	10,300	1,660	17,098,000
遠藤照明	7,400	2,140	15,836,000
日本デジタル研究所	13,200	1,522	20,090,400
古河電池	13,000	930	12,090,000
双信電機	9,000	411	3,699,000
山一電機	19,900	421	8,377,900
図 研	11,700	880	10,296,000
日本電子	62,000	524	32,488,000
カ シ オ	185,600	1,208	224,204,800
ファナック	199,100	17,270	3,438,457,000
日本シイエムケイ	42,000	302	12,684,000
エンプラス	6,700	7,410	49,647,000
大真空	25,000	434	10,850,000
ロ - ム	94,300	5,250	495,075,000
浜松ホトニクス	69,600	4,425	307,980,000
三井ハイテック	23,600	786	18,549,600
新光電気工業	60,000	859	51,540,000
京 セ ラ	318,000	4,921	1,564,878,000
協栄産業	22,000	191	4,202,000
太陽誘電	86,900	1,289	112,014,100
村田製作所	187,200	9,564	1,790,380,800
ユーシン	25,100	826	20,732,600
双葉電子工業	33,100	1,419	46,968,900
日東電工	154,100	4,244	654,000,400
北陸電気工業	72,000	165	11,880,000
東海理化電機	47,200	1,996	94,211,200
ニチコン	56,200	997	56,031,400
日本ケミコン	113,000	401	45,313,000
K O A	22,500	1,170	26,325,000
三井造船	691,000	213	147,183,000
日立造船	132,400	807	106,846,800
佐世保重工業	126,000	135	17,010,000
三菱重工業	3,178,000	671	2,132,438,000
川崎重工業	1,390,000	457	635,230,000
I H I	1,220,000	477	581,940,000
名村造船所	26,200	1,369	35,867,800
サノヤスホールディングス	16,400	216	3,542,400
日本車輛	65,000	539	35,035,000
ニチユ三菱フォークリフト	21,000	719	15,099,000
近畿車輛	31,000	325	10,075,000
F P G	11,600	1,066	12,365,600
島根銀行	4,100	1,329	5,448,900
じもとホールディングス	126,200	220	27,764,000

全国保証	21,000	4,410	92,610,000	
日産自動車	2,505,100	938	2,349,783,800	
いすゞ自動車	1,035,000	634	656,190,000	
トヨタ自動車	2,484,000	6,144	15,261,696,000	*
日野自動車	223,000	1,593	355,239,000	
三菱自動車工業	414,300	1,071	443,715,300	
エフテック	6,300	1,499	9,443,700	
G M B	1,900	1,386	2,633,400	
武蔵精密工業	19,100	2,240	42,784,000	
日産車体	87,000	1,482	128,934,000	
新明和工業	72,000	907	65,304,000	
極東開発工業	30,800	1,384	42,627,200	
日信工業	36,400	2,253	82,009,200	
トピー工業	147,000	187	27,489,000	
ティラド	70,000	282	19,740,000	
曙ブレーキ	83,200	448	37,273,600	
タチエス	26,400	1,451	38,306,400	
N O K	86,400	1,709	147,657,600	
フタバ産業	54,600	390	21,294,000	
カヤバ工業	152,000	518	78,736,000	
シロキ工業	41,000	227	9,307,000	
市光工業	44,000	167	7,348,000	
大同メタル工業	25,000	1,114	27,850,000	
プレス工業	70,000	431	30,170,000	
カルソニックカンセイ	121,000	510	61,710,000	
太平洋工業	36,600	708	25,912,800	
ケーヒン	41,200	1,628	67,073,600	
河西工業	24,000	724	17,376,000	
アイシン精機	163,300	4,080	666,264,000	
富士機工	21,000	360	7,560,000	
マ ッ ダ	2,660,000	551	1,465,660,000	
ダイハツ	189,400	1,724	326,525,600	
今仙電機製作所	13,300	1,521	20,229,300	
本田技研	1,606,200	4,115	6,609,513,000	
スズキ	373,100	2,893	1,079,378,300	
富士重工業	607,500	2,955	1,795,162,500	
ヤマハ発動機	271,500	1,510	409,965,000	
ショーワ	42,300	1,643	69,498,900	
小糸製作所	98,000	1,931	189,238,000	
T B K	20,000	586	11,720,000	
エクセディ	21,600	3,260	70,416,000	
ミツバ	32,900	1,815	59,713,500	
豊田合成	57,800	2,295	132,651,000	
愛三工業	22,000	972	21,384,000	
ヨ ロ ズ	13,200	1,983	26,175,600	
エフ・シー・シー	29,300	2,071	60,680,300	
新家工業	42,000	167	7,014,000	
シマノ	77,100	8,970	691,587,000	
タカタ	32,300	2,974	96,060,200	
テイ・エス テック	37,800	3,595	135,891,000	

小野建	15,400	1,373	21,144,200
はるやま商事	7,400	746	5,520,400
佐島電機	13,200	696	9,187,200
カップ・クリエイトHD	12,950	1,964	25,433,800
エコトレーディング	4,700	731	3,435,700
伯東	10,800	1,060	11,448,000
コンドーテック	14,700	718	10,554,600
中山福	10,200	824	8,404,800
ライトオン	13,100	705	9,235,500
ナガイレーベン	23,500	1,576	37,036,000
ジーンズメイト	5,900	259	1,528,100
三菱食品	19,400	2,509	48,674,600
良品計画	18,700	10,250	191,675,000
三城ホールディングス	21,700	474	10,285,800
松田産業	13,200	1,380	18,216,000
メディバルHD	176,200	1,475	259,895,000
アドヴァン	9,100	1,204	10,956,400
S P K	4,400	1,868	8,219,200
アズワン	11,500	2,527	29,060,500
スズデン	6,500	544	3,536,000
尾家産業	6,400	826	5,286,400
シモジマ	12,100	974	11,785,400
ドウシシャ	19,100	1,485	28,363,500
コナカ	22,500	891	20,047,500
高速	10,500	930	9,765,000
ハウスローゼ	2,300	1,376	3,164,800
G-7ホールディングス	5,300	802	4,250,600
イオン北海道	11,200	691	7,739,200
コジマ	25,800	289	7,456,200
ヒマラヤ	4,200	1,248	5,241,600
コーナン商事	22,900	1,089	24,938,100
黒田電気	25,400	1,588	40,335,200
ネットワンシステムズ	69,000	679	46,851,000
エコス	6,300	645	4,063,500
ワタミ	20,700	1,420	29,394,000
マルシェ	4,800	830	3,984,000
ドンキホーテホールディング	52,000	6,080	316,160,000
丸文	15,700	587	9,215,900
西松屋チェーン	34,700	826	28,662,200
ゼンショーホールディングス	67,000	1,136	76,112,000
ハビネット	10,700	902	9,651,400
幸楽苑	10,900	1,333	14,529,700
トーメンエレクトロニクス	9,100	1,257	11,438,700
ハークスレイ	5,100	782	3,988,200
サイゼリヤ	26,000	1,291	33,566,000
エクセル	8,200	1,287	10,553,400
マルカキカイ	5,700	1,376	7,843,200
アルゴグラフィックス	6,600	1,815	11,979,000
ガリバーインターナショナル	59,700	698	41,670,600
日本エム・ディ・エム	15,000	328	4,920,000

ポプラ	4,900	532	2,606,800
ユナイテッドアローズ	23,100	3,860	89,166,000
進和	10,400	1,238	12,875,200
エスケイジャパン	5,100	309	1,575,900
ダイトエレクトロン	8,400	398	3,343,200
ハイデイ日高	9,300	2,285	21,250,500
シークス	11,200	1,408	15,769,600
京都きもの友禅	11,800	1,100	12,980,000
コロワイド	58,500	1,059	61,951,500
田中商事	6,000	607	3,642,000
オーハシテクニカ	9,500	989	9,395,500
壱番屋	7,100	3,825	27,157,500
マクニカ	9,100	2,824	25,698,400
白銅	5,800	939	5,446,200
トップカルチャー	6,600	467	3,082,200
P L A N T	3,500	1,003	3,510,500
スギホールディングス	31,600	4,295	135,722,000
島津製作所	230,000	927	213,210,000
J M S	33,000	303	9,999,000
クボテック	4,600	298	1,370,800
ショットモリテックス	4,000	337	1,348,000
長野計器	11,500	691	7,946,500
ブイ・テクノロジー	37	269,600	9,975,200
スター精密	33,900	1,367	46,341,300
東京計器	62,000	314	19,468,000
愛知時計	24,000	302	7,248,000
東京精密	32,100	2,144	68,822,400
マニー	5,400	3,825	20,655,000
ニコン	333,200	1,909	636,078,800
トプコン	48,000	1,545	74,160,000
オリンパス	265,900	3,080	818,972,000
理研計器	15,900	885	14,071,500
大日本スクリーン	169,000	578	97,682,000
キヤノン電子	16,400	1,951	31,996,400
タムロン	13,700	2,797	38,318,900
H O Y A	433,900	2,990	1,297,361,000
ノーリツ鋼機	16,200	674	10,918,800
エー・アンド・デイ	16,300	681	11,100,300
キヤノン	1,034,600	3,210	3,321,066,000
リコー	537,000	1,095	588,015,000
シチズンホールディングス	219,800	855	187,929,000
リズム時計	81,000	143	11,583,000
大研医器	6,200	1,747	10,831,400
パラマウントベッドH D	17,100	3,495	59,764,500
S H O B I	5,600	414	2,318,400
前田工織	13,100	1,181	15,471,100
永大産業	24,000	536	12,864,000
ダンロップスポーツ	9,900	1,264	12,513,600
バンダイナムコH L D G S	196,800	2,208	434,534,400
共立印刷	33,000	282	9,306,000

フランスベッドHLDGS	112,000	202	22,624,000
マーベラスAQL	26,800	783	20,984,400
パイロットコーポレーション	15,600	3,470	54,132,000
エイベックス・グループHD	32,500	2,484	80,730,000
トッパン・フォームズ	31,900	942	30,049,800
フジシールインターナショナル	21,700	3,130	67,921,000
タカラトミー	58,600	473	27,717,800
廣済堂	16,700	601	10,036,700
アーク	53,100	302	16,036,200
レック	6,000	1,221	7,326,000
タカノ	8,000	541	4,328,000
プロネクサス	18,300	675	12,352,500
ホクシン	13,500	154	2,079,000
ウッドワン	30,000	316	9,480,000
大建工業	73,000	275	20,075,000
きもと	13,700	935	12,809,500
凸版印刷	504,000	796	401,184,000
大日本印刷	543,000	1,062	576,666,000
図書印刷	29,000	395	11,455,000
共同印刷	55,000	291	16,005,000
日本写真印刷	30,000	1,578	47,340,000
光村印刷	3,000	277	831,000
藤森工業	16,000	2,510	40,160,000
宝印刷	10,300	705	7,261,500
前澤化成工業	13,300	1,065	14,164,500
アシックス	177,300	1,839	326,054,700
ツツミ	8,900	2,357	20,977,300
ジェイエスピー	12,200	1,580	19,276,000
ニチハ	22,800	1,492	34,017,600
ローランド	17,200	1,449	24,922,800
エフピコ	9,200	7,390	67,988,000
小松ウオール工業	6,100	2,107	12,852,700
ヤマハ	131,200	1,607	210,838,400
河合楽器	62,000	189	11,718,000
クリナップ	18,400	923	16,983,200
ビジョン	29,200	5,050	147,460,000
天馬	14,900	1,485	22,126,500
兼松日産農林	28,000	167	4,676,000
キングジム	15,000	682	10,230,000
リンテック	42,400	1,855	78,652,000
TASAKI	3,800	735	2,793,000
信越ポリマー	37,000	390	14,430,000
東リ	49,000	211	10,339,000
イトーキ	37,600	592	22,259,200
任天堂	109,900	15,500	1,703,450,000
三菱鉛筆	14,700	2,400	35,280,000
松風	9,000	882	7,938,000
タカラスタンダード	74,000	772	57,128,000
コクヨ	92,700	745	69,061,500
ナカバヤシ	38,000	205	7,790,000

ニフコ	41,700	2,759	115,050,300
グロープライド	94,000	158	14,852,000
岡村製作所	69,000	888	61,272,000
日本バルカー	78,000	287	22,386,000
MUTOHホールディングス	24,000	556	13,344,000
伊藤忠	1,405,500	1,312	1,844,016,000
丸紅	1,541,000	745	1,148,045,000
スクロール	22,900	333	7,625,700
高島	33,000	258	8,514,000
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,581	21,343,500
三陽商会	100,000	285	28,500,000
長瀬産業	99,700	1,272	126,818,400
ナイガイ	70,000	99	6,930,000
蝶理	11,400	1,202	13,702,800
豊田通商	196,300	2,411	473,279,300
オンワ-ドホールディングス	125,000	777	97,125,000
三共生興	30,900	372	11,494,800
兼松	376,000	186	69,936,000
美津濃	88,000	529	46,552,000
ツカモトコーポレーション	32,000	162	5,184,000
ファミリーマート	59,500	4,890	290,955,000
ルック	34,000	287	9,758,000
三井物産	1,621,900	1,453	2,356,620,700
日本紙パルプ	91,000	331	30,121,000
東京エレクトロン	160,200	5,579	893,755,800
日立ハイテクノロジーズ	53,400	2,674	142,791,600
カメイ	22,900	798	18,274,200
東都水産	32,000	213	6,816,000
OUGホールディングス	28,000	194	5,432,000
スターゼン	65,000	274	17,810,000
セイコーHD	115,000	546	62,790,000
山善	68,100	646	43,992,600
椿本興業	20,000	296	5,920,000
住友商事	1,039,700	1,306	1,357,848,200
日本ユニシス	42,600	968	41,236,800
内田洋行	41,000	285	11,685,000
三菱商事	1,374,500	1,968	2,705,016,000
第一実業	41,000	471	19,311,000
キヤノンマーケティングJPN	50,200	1,443	72,438,600
西華産業	61,000	248	15,128,000
佐藤商事	15,800	692	10,933,600
菱洋エレクトロ	20,900	1,091	22,801,900
東京産業	17,700	378	6,690,600
ユアサ商事	182,000	222	40,404,000
神鋼商事	46,000	232	10,672,000
小林産業	11,900	340	4,046,000
阪和興業	176,000	567	99,792,000
カナデン	2,000	730	1,460,000
菱電商事	26,000	741	19,266,000
ニプロ	95,100	933	88,728,300

フルサト工業	9,700	1,322	12,823,400
岩谷産業	196,000	538	105,448,000
すてきナイスグループ	75,000	239	17,925,000
昭光通商	60,000	162	9,720,000
二チモウ	29,000	200	5,800,000
極東貿易	22,000	227	4,994,000
イワキ	28,000	217	6,076,000
兼松エレクトロニクス	11,200	1,391	15,579,200
三愛石油	41,000	492	20,172,000
稲畑産業	43,600	1,175	51,230,000
G S Iクレオス	48,000	163	7,824,000
明和産業	16,900	381	6,438,900
ゴ-ルドウイン	43,000	470	20,210,000
ユニ・チャ-ム	114,700	5,796	664,801,200
デサント	43,000	704	30,272,000
キング	10,000	438	4,380,000
ワキタ	26,000	1,168	30,368,000
ヤマトインタ-ナショナル	12,400	444	5,505,600
東邦ホールディングス	56,400	1,768	99,715,200
サンゲツ	31,200	2,596	80,995,200
ミツウロコグループ	28,400	553	15,705,200
シナネン	38,000	417	15,846,000
伊藤忠エネクス	39,000	590	23,010,000
サンリオ	44,400	4,585	203,574,000
サンワテクノス	8,800	882	7,761,600
リョ-サン	26,200	2,183	57,194,600
新光商事	19,400	884	17,149,600
トーホ-	38,000	381	14,478,000
三信電気	22,000	789	17,358,000
東陽テクニカ	24,200	1,102	26,668,400
モスフードサービス	23,100	2,119	48,948,900
加賀電子	16,000	1,271	20,336,000
三益半導体	15,900	911	14,484,900
ソーダニツカ	2,000	446	892,000
立花エレテック	10,700	1,317	14,091,900
木曽路	21,600	1,870	40,392,000
サトレストランシステムズ	16,600	719	11,935,400
千趣会	31,900	879	28,040,100
タカキュー	14,000	310	4,340,000
ケーヨー	29,600	470	13,912,000
アデランス	22,300	1,120	24,976,000
上新電機	38,000	825	31,350,000
日本瓦斯	26,300	1,094	28,772,200
ベスト電器	56,600	158	8,942,800
マルエツ	36,000	352	12,672,000
ロイヤルホールディングス	29,500	1,536	45,312,000
東天紅	13,000	196	2,548,000
いなげや	19,600	992	19,443,200
島忠	39,900	2,404	95,919,600
チヨダ	20,700	1,975	40,882,500

ライフコーポレーション	13,300	1,587	21,107,100
カスミ	36,200	678	24,543,600
リンガーハット	17,200	1,526	26,247,200
さが美	15,000	114	1,710,000
MR MAX	17,400	331	5,759,400
テンアライド	13,800	312	4,305,600
AOKIホールディングス	30,400	1,803	54,811,200
オークワ	27,000	894	24,138,000
コメリ	27,100	2,585	70,053,500
青山商事	44,200	2,754	121,726,800
しまむら	20,400	9,670	197,268,000
CFSコーポレーション	11,800	448	5,286,400
はせがわ	6,300	862	5,430,600
高島屋	238,000	984	234,192,000
松屋	35,400	1,148	40,639,200
エイチ・ツー・オーリテイリング	103,000	822	84,666,000
近鉄百貨店	68,000	368	25,024,000
丸栄	29,000	217	6,293,000
ニッセンHD	35,200	398	14,009,600
パルコ	16,900	987	16,680,300
丸井グループ	229,600	993	227,992,800
クレディセゾン	143,900	2,625	377,737,500
アクシアルリテイリング	9,700	1,519	14,734,300
井筒屋	97,000	89	8,633,000
ダイエー	109,000	317	34,553,000
イズミヤ	66,000	462	30,492,000
イオン	703,400	1,388	976,319,200
ユニーグループ・HD	168,500	631	106,323,500
イズミ	39,300	3,285	129,100,500
東武ストア	24,000	261	6,264,000
平和堂	35,700	1,475	52,657,500
フジ	19,500	1,756	34,242,000
ヤオコー	8,900	4,105	36,534,500
ゼビオ	21,200	1,976	41,891,200
ケーズホールディングス	37,200	3,000	111,600,000
Paltac	24,600	1,353	33,283,800
OLYMPICグループ	10,400	772	8,028,800
日産東京販売HD	26,000	447	11,622,000
新生銀行	1,525,000	241	367,525,000
あおぞら銀行	916,000	300	274,800,000
三菱UFJフィナンシャルG	13,343,300	667	8,899,981,100
りそなホールディングス	1,674,400	540	904,176,000
三井住友トラストHD	3,461,000	537	1,858,557,000
三井住友フィナンシャルG	1,332,100	5,249	6,992,192,900
第四銀行	224,000	363	81,312,000
北越銀行	192,000	211	40,512,000
西日本シティ銀行	618,000	282	174,276,000
千葉銀行	679,000	684	464,436,000
横浜銀行	1,162,000	576	669,312,000
常陽銀行	656,000	523	343,088,000



群馬銀行	395,000	591	233,445,000
武蔵野銀行	28,100	3,555	99,895,500
千葉興業銀行	36,500	787	28,725,500
筑波銀行	73,300	369	27,047,700
東京都民銀行	31,100	1,096	34,085,600
七十七銀行	276,000	518	142,968,000
青森銀行	129,000	276	35,604,000
秋田銀行	121,000	287	34,727,000
山形銀行	107,000	436	46,652,000
岩手銀行	11,500	5,130	58,995,000
東邦銀行	157,000	335	52,595,000
東北銀行	92,000	155	14,260,000
みちのく銀行	95,000	205	19,475,000
ふくおかフィナンシャルG	715,000	449	321,035,000
静岡銀行	516,000	1,079	556,764,000
十六銀行	221,000	386	85,306,000
スルガ銀行	172,000	1,866	320,952,000
八十二銀行	325,000	613	199,225,000
山梨中央銀行	112,000	466	52,192,000
大垣共立銀行	220,000	295	64,900,000
福井銀行	151,000	249	37,599,000
北國銀行	198,000	366	72,468,000
清水銀行	6,000	2,817	16,902,000
滋賀銀行	165,000	530	87,450,000
南都銀行	172,000	387	66,564,000
百五銀行	158,000	435	68,730,000
京都銀行	336,000	903	303,408,000
紀陽銀行	69,100	1,448	100,056,800
三重銀行	73,000	226	16,498,000
ほくほくフィナンシャルG	1,199,000	211	252,989,000
広島銀行	519,000	423	219,537,000
山陰合同銀行	109,000	757	82,513,000
中国銀行	130,900	1,319	172,657,100
鳥取銀行	57,000	191	10,887,000
伊予銀行	188,400	1,028	193,675,200
百十四銀行	193,000	361	69,673,000
四国銀行	126,000	236	29,736,000
阿波銀行	144,000	515	74,160,000
鹿児島銀行	122,000	653	79,666,000
大分銀行	111,000	408	45,288,000
宮崎銀行	118,000	307	36,226,000
肥後銀行	144,000	569	81,936,000
佐賀銀行	107,000	228	24,396,000
十八銀行	109,000	237	25,833,000
沖縄銀行	13,100	4,005	52,465,500
琉球銀行	34,200	1,420	48,564,000
八千代銀行	8,400	2,855	23,982,000
セブン銀行	660,100	413	272,621,300
みずほフィナンシャルG	22,803,700	232	5,290,458,400
高知銀行	69,000	166	11,454,000

山口フィナンシャルG	176,000	1,014	178,464,000
アクリーティブ	124	22,000	2,728,000
芙蓉総合リース	18,500	3,910	72,335,000
興銀リース	30,700	3,035	93,174,500
東京センチュリーリース	41,400	3,230	133,722,000
S B Iホールディングス	211,600	1,478	312,744,800
日本証券金融	77,400	760	58,824,000
アイフル	320,600	412	132,087,200
日本アジア投資	120,000	116	13,920,000
ポケットカード	17,700	848	15,009,600
長野銀行	59,000	186	10,974,000
名古屋銀行	159,000	355	56,445,000
北洋銀行	265,400	441	117,041,400
愛知銀行	6,400	5,160	33,024,000
第三銀行	100,000	184	18,400,000
中京銀行	73,000	183	13,359,000
東日本銀行	77,000	260	20,020,000
大光銀行	63,000	224	14,112,000
愛媛銀行	103,000	220	22,660,000
トマト銀行	69,000	176	12,144,000
みなと銀行	160,000	177	28,320,000
京葉銀行	145,000	495	71,775,000
関西アーバン銀行	245,000	125	30,625,000
栃木銀行	89,000	416	37,024,000
北日本銀行	5,500	2,588	14,234,000
東和銀行	209,000	106	22,154,000
福島銀行	219,000	101	22,119,000
大東銀行	114,000	129	14,706,000
リコーリース	12,100	2,942	35,598,200
イオンフィナンシャルサービス	102,100	2,673	272,913,300
アコム	353,700	345	122,026,500
ジャックス	107,000	513	54,891,000
オリコ	393,300	253	99,504,900
日立キャピタル	34,600	2,860	98,956,000
アプラスフィナンシャル	63,100	143	9,023,300
オリックス	1,085,100	1,733	1,880,478,300
三菱UFJリース	446,800	610	272,548,000
ジャフコ	24,100	5,200	125,320,000
トモニホールディングス	135,000	415	56,025,000
大和証券G本社	1,745,000	1,000	1,745,000,000
野村ホールディングス	3,600,900	791	2,848,311,900
岡三証券グループ	138,000	1,046	144,348,000
丸三証券	52,300	981	51,306,300
東洋証券	71,000	375	26,625,000
東海東京HD	186,600	1,027	191,638,200
光世証券	42,000	286	12,012,000
水戸証券	52,000	498	25,896,000
いちよし証券	34,500	1,699	58,615,500
松井証券	89,500	1,246	111,517,000
N K S Jホールディングス	391,300	2,838	1,110,509,400

だいこう証券ビジ	8,600	938	8,066,800
日本取引所グループ	258,700	2,712	701,594,400
マネックスG	191,400	452	86,512,800
カブドットコム証券	68,200	595	40,579,000
極東証券	21,900	2,115	46,318,500
岩井コスモホールディング	16,700	1,493	24,933,100
フィデアホール	101,200	216	21,859,200
池田泉州HD	131,800	483	63,659,400
MS&AD	526,400	2,603	1,370,219,200
SONY FH	168,700	1,865	314,625,500
マネーパートナーズGP	13,600	272	3,699,200
小林洋行	5,200	287	1,492,400
第一生命	886,600	1,695	1,502,787,000
東京海上HD	682,300	3,265	2,227,709,500
イー・ギャランティ	5,100	2,508	12,790,800
アサックス	3,100	1,394	4,321,400
NECキャピタルソリューション	6,000	2,735	16,410,000
T&Dホールディングス	604,200	1,421	858,568,200
三井不動産	830,000	3,501	2,905,830,000
三菱地所	1,233,000	2,869	3,537,477,000
平和不動産	35,600	1,673	59,558,800
東京建物	360,000	1,072	385,920,000
ダイビル	51,800	1,229	63,662,200
京阪神ビルディング	29,300	559	16,378,700
住友不動産	422,000	4,809	2,029,398,000
太平洋興発	66,000	117	7,722,000
大京	296,000	288	85,248,000
テーオーシー	60,700	792	48,074,400
東京楽天地	27,000	495	13,365,000
レオパレス21	202,500	569	115,222,500
フジ住宅	22,600	723	16,339,800
空港施設	21,500	816	17,544,000
明和地所	8,700	507	4,410,900
住友不動産販売	12,700	3,135	39,814,500
ゴールドクレスト	13,900	2,670	37,113,000
リロ・ホールディング	7,000	5,370	37,590,000
日本エスリード	6,900	1,166	8,045,400
日神不動産	23,600	416	9,817,600
タカラレーベン	58,700	357	20,955,900
サンヨーハウジ 名古屋	9,200	1,197	11,012,400
イオンモール	113,600	2,954	335,574,400
ファースト住建	5,000	1,461	7,305,000
ランド	40,500	15	607,500
トーセイ	24,200	851	20,594,200
穴吹興産	12,000	312	3,744,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	109,400	1,095	119,793,000
サンフロンティア不動産	16,600	1,563	25,945,800
エフ・ジェー・ネクスト	7,300	563	4,109,900
ランドビジネス	11,900	454	5,402,600
グランディハウス	10,600	363	3,847,800

東武鉄道	1,013,000	484	490,292,000
相鉄ホールディングス	305,000	358	109,190,000
東京急行	1,050,000	648	680,400,000
京浜急行	458,000	824	377,392,000
小田急電鉄	572,000	897	513,084,000
京王電鉄	499,000	668	333,332,000
京成電鉄	268,000	920	246,560,000
富士急行	49,000	860	42,140,000
新京成電鉄	24,000	367	8,808,000
東日本旅客鉄道	328,300	7,940	2,606,702,000
西日本旅客鉄道	161,100	4,411	710,612,100
東海旅客鉄道	159,800	11,985	1,915,203,000
鴻池運輸	9,500	1,556	14,782,000
西日本鉄道	231,000	389	89,859,000
ハマキョウレックス	5,100	2,833	14,448,300
サカイ引越センター	2,900	3,230	9,367,000
近畿日本鉄道	1,795,000	362	649,790,000
阪急阪神HLDGS	1,197,000	546	653,562,000
南海電鉄	372,000	363	135,036,000
京阪電鉄	376,000	391	147,016,000
神戸電鉄	44,000	335	14,740,000
名糖運輸	7,600	676	5,137,600
名古屋鉄道	623,000	304	189,392,000
山陽電鉄	66,000	415	27,390,000
トランコム	5,200	3,450	17,940,000
日本通運	706,000	493	348,058,000
ヤマトホールディングス	332,300	1,999	664,267,700
山 九	217,000	402	87,234,000
日 新	68,000	293	19,924,000
丸 運	11,200	252	2,822,400
丸全昭和運輸	60,000	353	21,180,000
センコー	72,000	536	38,592,000
トナミホールディングス	37,000	213	7,881,000
日本梱包運輸	54,500	1,873	102,078,500
日石輸送	21,000	235	4,935,000
福山通運	108,000	565	61,020,000
セイノーホールディングス	127,000	1,034	131,318,000
神奈川中央交通	22,000	505	11,110,000
日立物流	37,100	1,536	56,985,600
日本郵船	1,508,000	316	476,528,000
商船三井	1,003,000	450	451,350,000
川崎汽船	781,000	253	197,593,000
NSユナイテッド海運	77,000	282	21,714,000
乾 汽 船	21,700	369	8,007,300
明治海運	16,100	457	7,357,700
飯野海運	74,000	614	45,436,000
共栄タンカー	15,000	245	3,675,000
第一中央汽船	132,000	113	14,916,000
日本航空	150,800	5,230	788,684,000
ANAホールディングス	3,508,000	223	782,284,000

スカイマーク	38,200	454	17,342,800
パスコ	17,000	516	8,772,000
三菱倉庫	117,000	1,461	170,937,000
三井倉庫	90,000	468	42,120,000
住友倉庫	119,000	565	67,235,000
渋沢倉庫	42,000	397	16,674,000
ヤマタネ	89,000	177	15,753,000
東陽倉庫	31,000	255	7,905,000
日本トランスシティ	37,000	345	12,765,000
ケイヒン	33,000	177	5,841,000
中央倉庫	10,500	920	9,660,000
安田倉庫	14,000	1,089	15,246,000
東洋埠頭	52,000	259	13,468,000
宇徳	14,600	384	5,606,400
上組	213,000	962	204,906,000
サンリツ	1,700	563	957,100
キムラユニティー	4,200	973	4,086,600
キューソー流通システム	5,800	1,067	6,188,600
郵船ロジスティクス	16,400	1,268	20,795,200
近鉄エクスプレス	16,000	4,030	64,480,000
東海運	9,900	287	2,841,300
エーアイティー	6,600	774	5,108,400
東京放送HD	94,900	1,261	119,668,900
日本テレビHLDS	175,400	1,873	328,524,200
テレビ朝日	44,600	2,241	99,948,600
スカパーJSATHD	133,700	544	72,732,800
テレビ東京HD	14,400	1,648	23,731,200
コネクシオ	15,700	847	13,297,900
日本電信電話	692,100	5,586	3,866,070,600
KDDI	546,800	6,209	3,395,081,200
光通信	16,400	8,560	140,384,000
NTTドコモ	1,451,300	1,733	2,515,102,900
GMOインターネット	58,800	1,334	78,439,200
学研ホールディングス	59,000	316	18,644,000
ゼンリン	23,300	1,000	23,300,000
昭文社	10,700	715	7,650,500
KADOKAWA	17,000	3,455	58,735,000
インプレスホールディングス	13,000	173	2,249,000
東京電力	1,514,000	491	743,374,000
中部電力	588,000	1,270	746,760,000
関西電力	728,300	1,139	829,533,700
中国電力	246,700	1,472	363,142,400
北陸電力	174,800	1,356	237,028,800
東北電力	445,900	1,102	491,381,800
四国電力	160,700	1,559	250,531,300
九州電力	394,100	1,240	488,684,000
北海道電力	167,000	1,105	184,535,000
沖縄電力	11,700	3,315	38,785,500
電源開発	110,800	2,869	317,885,200
東京瓦斯	2,093,000	499	1,044,407,000

大阪瓦斯	1,847,000	403	744,341,000
東邦瓦斯	454,000	497	225,638,000
北海道瓦斯	36,000	278	10,008,000
西部瓦斯	201,000	243	48,843,000
静岡瓦斯	46,600	611	28,472,600
アイネット	7,600	855	6,498,000
松竹	116,000	961	111,476,000
東宝	125,700	2,227	279,933,900
エイチ・アイ・エス	15,200	5,160	78,432,000
東映	74,000	585	43,290,000
AOI Pro.	7,500	683	5,122,500
NTTデータ	124,300	3,555	441,886,500
共立メンテナンス	9,300	3,700	34,410,000
イチネンホールディングス	19,600	803	15,738,800
建設技術研究所	11,100	1,087	12,065,700
スペース	9,200	909	8,362,800
アインファーマシーズ	10,600	5,300	56,180,000
燦ホールディングス	3,900	1,408	5,491,200
スバル興業	3,000	384	1,152,000
東京テアトル	72,000	158	11,376,000
よみうりランド	37,000	708	26,196,000
東京都競馬	144,000	389	56,016,000
常磐興産	60,000	167	10,020,000
カナモト	24,000	2,612	62,688,000
東京ドーム	138,000	648	89,424,000
D T S	16,800	1,901	31,936,800
スクウェア・エニックス・HD	64,100	1,751	112,239,100
シーイーシー	10,700	697	7,457,900
カプコン	45,000	1,855	83,475,000
西尾レントオール	10,100	2,769	27,966,900
アゴーラ・ホスピタリティーG	78,000	53	4,134,000
日本空港ビルデング	60,900	2,182	132,883,800
トランス・コスモス	24,400	2,173	53,021,200
乃村工藝社	36,700	857	31,451,900
ジャステック	11,500	822	9,453,000
S C S K	41,900	2,720	113,968,000
藤田観光	48,000	382	18,336,000
K N T - C Tホールディングス	60,000	191	11,460,000
日本管財	8,000	1,968	15,744,000
トーカイ	8,300	3,105	25,771,500
白洋舎	5,000	239	1,195,000
セコム	193,900	5,890	1,142,071,000
日本システムウエア	6,800	498	3,386,400
セントラル警備保障	8,500	972	8,262,000
アイネス	24,000	732	17,568,000
丹青社	18,000	699	12,582,000
メイテック	25,600	2,849	72,934,400
T K C	14,800	1,848	27,350,400
アサツー ディ・ケイ	32,700	2,399	78,447,300
富士ソフト	22,400	2,467	55,260,800

応用地質	17,800	1,654	29,441,200
船井総合研究所	19,500	823	16,048,500
NSD	37,500	1,338	50,175,000
進学会	8,100	433	3,507,300
丸紅建材リース	16,000	219	3,504,000
コナミ	79,500	2,398	190,641,000
ベネッセホールディングス	62,400	4,220	263,328,000
イオンディライト	18,000	2,110	37,980,000
ナック	9,400	1,785	16,779,000
福井コンピュータHLD S	2,600	922	2,397,200
ニチイ学館	40,500	860	34,830,000
ダイセキ	27,600	2,007	55,393,200
ステップ	5,800	826	4,790,800
日鉄住金物産	116,000	373	43,268,000
元気寿司	5,500	1,459	8,024,500
トラスコ中山	20,200	2,467	49,833,400
ヤマダ電機	696,100	380	264,518,000
オートバックスセブン	61,800	1,686	104,194,800
アークランドサカモト	11,500	1,872	21,528,000
ニトリホールディングス	34,850	9,790	341,181,500
グルメ杵屋	13,000	714	9,282,000
愛眼	14,400	285	4,104,000
ケーユーホールディングス	3,700	1,482	5,483,400
吉野家ホールディングス	47,700	1,369	65,301,300
加藤産業	25,500	1,936	49,368,000
イノテック	16,400	499	8,183,600
イエローハット	15,200	1,856	28,211,200
富士エレクトロニクス	9,200	1,417	13,036,400
松屋フーズ	8,500	1,787	15,189,500
J B C Cホールディングス	14,800	796	11,780,800
J Kホールディングス	15,300	575	8,797,500
サガミチェーン	22,000	914	20,108,000
日伝	7,900	2,232	17,632,800
関西スーパーマーケット	13,300	853	11,344,900
ミロク情報サービス	12,000	423	5,076,000
北沢産業	11,000	201	2,211,000
杉本商事	9,500	1,006	9,557,000
因幡電機産業	24,100	3,300	79,530,000
王将フードサービス	8,700	3,390	29,493,000
プレナス	19,700	2,251	44,344,700
ミニストップ	13,100	1,625	21,287,500
アークス	30,000	1,936	58,080,000
バロ-	37,900	1,411	53,476,900
バイテック	6,200	940	5,828,000
ミスミグループ本社	70,500	3,305	233,002,500
江守商事	5,700	2,298	13,098,600
アルテック	8,900	258	2,296,200
ベルク	8,800	1,869	16,447,200
大庄	8,300	1,330	11,039,000
タキヒヨー	29,000	425	12,325,000

ファーストリテイリング	41,100	39,015	1,603,516,500	
ソフトバンク	865,000	8,741	7,560,965,000	
スズケン	72,900	3,440	250,776,000	
サンドラッグ	37,200	4,685	174,282,000	
東京デリカ	8,900	1,513	13,465,700	
ジェコス	12,300	828	10,184,400	
ヤマザワ	4,200	1,548	6,501,600	
やまや	3,600	2,430	8,748,000	
ベルーナ	44,000	501	22,044,000	
合計	286,092,394		320,248,310,210	

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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。



## 「国内債券パッシブ・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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		876,030,630	1,326,472,089
国債証券		334,182,536,300	363,862,299,000
地方債証券		28,812,766,678	30,290,111,383
特殊債券		33,064,745,956	31,233,393,096
社債券		29,476,121,980	29,226,433,340
未収利息		1,194,438,844	1,273,563,484
前払費用		64,014,583	41,158,715
流動資産合計		427,670,654,971	457,253,431,107
資産合計		427,670,654,971	457,253,431,107
負債の部			
流動負債			
未払解約金		191,180,000	127,301,000
流動負債合計		191,180,000	127,301,000
負債合計		191,180,000	127,301,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	368,547,050,465	384,301,757,056
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		58,932,424,506	72,824,373,051
元本等合計		427,479,474,971	457,126,130,107
純資産合計		427,479,474,971	457,126,130,107
負債純資産合計		427,670,654,971	457,253,431,107

## 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	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
--------------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	355,473,910,842円  65,764,231,532円 52,691,091,909円	368,547,050,465円  79,671,229,054円 63,916,522,463円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	3,991,216,113円	6,688,627,446円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>	9,774,671,371円	9,883,532,093円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	3,017,915,316円	3,738,906,961円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	4,653,416,935円	5,921,633,266円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	1,837,401,615円	2,490,067,683円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	1,205,781,061円	1,460,154,240円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	1,246,466,334円	1,597,267,216円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	164,434,297円	222,960,116円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	171,444,580円	153,559,854円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,111,906,126円	1,904,283,775円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,544,968円	5,003,057円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	252,886円	61,780,972円

D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国20)	140,671円	31,092,320円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国30)	23,301円	8,500,512円
投資のソムリエ	15,516,654円	223,737,416円
クルーズコントロール	9,210,180円	152,229,038円
投資のソムリエ<DC年 金>	-円	2,575,074円
D I A M 8資産 balan スファンドN<DC年金 >	-円	4,894,743円
みずほエマージングボン ドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファ ンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債 券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファ ンド	6,676,001円	-円
D I A M国内債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	14,957,916,660円	14,105,425,650円
D I A Mワールド balan ス25VA(適格機関投 資家限定)	728,798,402円	744,486,049円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	12,032,808,688円	9,022,079,241円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	705,141,298円	599,365,688円
D I A M国際分散 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	485,451,984円	450,702,488円
D I A M国際分散 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	1,184,383,018円	964,855,359円
D I A M国内重視 balan スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	510,141,484円	414,001,445円
D I A M国内重視 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	385,983,341円	366,538,877円
D I A M世界 balan スファンド40VA(適 格機関投資家限定)	29,480,241,613円	33,458,041,082円
D I A M世界 balan スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	9,769,462,046円	11,123,880,558円

D I A Mバランスファン ド25VA(適格機関投 資家限定)	13,019,722,192円	14,089,795,868円
D I A Mバランスファン ド37.5VA(適格機 関投資家限定)	4,819,111,382円	5,401,245,203円
D I A Mバランスファン ド50VA(適格機関投 資家限定)	7,448,476,648円	8,698,267,858円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	1,670,954,094円	1,538,935,431円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	6,098,817,308円	6,433,940,797円
D I A M アクサ グ ローバル バランスファ ンド30VA(適格機関 投資家限定)	7,346,245,786円	7,054,769,081円
D I A M世界アセットバ ランスファンドVA(適 格機関投資家向け)	14,072,147,308円	12,209,720,687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)	608,623,338円	507,069,889円
D I A M世界バランス ファンド55VA(適格 機関投資家限定)	13,481,093,387円	13,646,929,146円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド35 VA(適格機関投資家限 定)	7,151,217,773円	8,472,967,585円
D I A Mグローバル分散 ファンドVA(適格機関 投資家限定)	1,494,650,417円	1,418,178,474円
D I A M世界アセットバ ランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	106,724,960,968円	111,231,367,099円
D I A M世界アセットバ ランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,499,662,584円	2,176,780,242円
D I A M世界アセットバ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	9,625,232,600円	9,797,400,827円
D I A M世界アセットバ ランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	32,937,435,569円	34,326,382,186円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限 定)	2,071,352,106円	483,433円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	261,734円	420,386,914円

D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	163,175円	124,094,157円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	35,827,613,691円	38,015,228,752円
D I A M世界バランス2 5VA(適格機関投資家 限定)	912,114,674円	933,930,861円
D I A M国内バランス3 0VA(適格機関投資家 限定)	201,397,299円	199,033,079円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	2,054,001,727円	1,748,356,268円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	339,154円	26,145,578円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	247,769円	304,583円
計	368,547,050,465円	384,301,757,056円
2. 受益権の総数	368,547,050,465口	384,301,757,056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24年1月12日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14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、価格変動リスク、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	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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)
国債証券	1,367,061,600	4,779,705,100
地方債証券	12,073,749	147,909,892
特殊債券	10,446,711	181,654,816
社債券	46,541,540	90,495,920
合計	1,391,082,680	4,359,644,472

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成24年2月15日から平成25年1月11日まで及び平成25年2月15日から平成26年1月14日まで)に対応する金額であります。

## (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)

	平成25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.1599円	1.1895円
(1万口当たり純資産額)	(11,599円)	(11,895円)



## 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26年1月14日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 2 5 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,000,630,000	
	3 2 6 回 利付国庫債券(2年)	3,500,000,000	3,500,805,000	
	3 2 7 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,240,000	
	3 2 8 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,000,780,000	
	3 2 9 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,502,430,000	
	3 3 0 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,420,000	
	3 3 1 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,460,000	
	3 3 2 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,240,000	
	3 3 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,520,000	
	3 3 4 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,000,810,000	
	3 3 5 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,280,000	
	8 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,517,010,000	
	8 9 回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,319,264,000	
	9 1 回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,412,648,000	
	9 2 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,014,360,000	
	9 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,527,895,000	
	9 5 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,022,100,000	
	9 6 回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,219,558,000	
	9 7 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,036,850,000	
	9 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,024,000,000	
	1 0 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,016,900,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,513,850,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,525,560,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,514,025,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,011,850,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,010,700,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	2,992,530,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,400,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,515,150,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,519,950,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,022,240,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,000,480,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	681,786,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,136,170,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,476,644,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	1,400,000,000	1,512,980,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	525,985,000	
	2 6 9 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,521,435,000	
	2 7 0 回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,424,192,000	
	2 7 2 回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	919,809,000	

274回	利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,465,280,000	
277回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,581,850,000	
280回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,565,490,000	
282回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,545,214,000	
284回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,406,651,000	
285回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,465,330,000	
286回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,277,599,000	
288回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,749,344,000	
289回	利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	4,107,090,000	
290回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,103,220,000	
293回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,501,602,000	
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,246,800,000	
297回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,237,240,000	
299回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,274,561,000	
301回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,633,274,000	
303回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,982,728,000	
305回	利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,879,174,000	
306回	利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,912,570,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,912,842,000	
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,100,180,000	
310回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,442,164,000	
312回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,380,480,000	
313回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,782,375,000	
315回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,693,900,000	
317回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,094,900,000	
318回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,288,088,000	
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,094,680,000	
320回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,078,600,000	
321回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,674,825,000	
324回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,065,310,000	
325回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,103,500,000	
326回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,042,440,000	
328回	利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,502,795,000	
329回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,593,115,000	
330回	利付国庫債券(10年)	4,700,000,000	4,775,012,000	
332回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	995,330,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,141,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	118,100,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	233,078,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	250,624,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	228,378,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	233,556,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	344,427,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	531,015,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	415,152,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	330,864,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	325,254,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	575,930,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	233,828,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	467,924,000	

17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	230,502,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	930,642,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	227,046,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	351,660,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	567,870,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	551,408,700	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	704,226,000	
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	704,502,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	681,882,000	
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,155,750,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,059,093,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	942,752,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,509,352,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,711,455,000	
31回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,345,728,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,828,528,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,941,876,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,683,195,000	
35回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,155,520,000	
36回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,155,340,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,900,000,000	2,004,158,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,444,198,000	
39回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,266,948,000	
40回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,546,350,000	
41回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	604,194,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	665,082,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	440,636,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	791,150,400	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	898,520,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	988,939,800	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,016,694,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	560,105,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,066,099,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	572,720,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	862,539,600	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	668,280,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	617,589,500	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	793,443,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	906,495,300	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,257,373,600	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	668,184,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,060,686,000	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	828,536,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,322,009,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	671,334,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,231,648,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,129,653,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,465,712,500	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,430,237,500	
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,351,126,000	

75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,605,590,000		
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,633,193,000		
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,593,018,000		
83回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,840,480,000		
85回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,957,074,000		
88回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,115,882,000		
90回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,863,168,000		
92回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,958,893,000		
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	797,720,000		
94回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,267,387,000		
95回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,000,628,000		
97回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,095,164,000		
99回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,839,872,000		
100回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,323,880,000		
102回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,256,649,000		
105回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,407,965,000		
107回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,290,180,000		
109回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,119,678,000		
111回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,311,440,000		
113回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,507,560,000		
114回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,504,920,000		
116回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,877,575,000		
118回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,343,688,000		
119回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,416,727,000		
121回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,313,906,000		
123回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,485,538,000		
125回	利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,629,337,000		
128回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,312,536,000		
129回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,078,690,000		
130回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,364,890,000		
132回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,534,016,000		
134回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,282,536,000		
135回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,263,132,000		
137回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,310,198,000		
140回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,302,828,000		
141回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,608,300,000		
143回	利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,764,881,000		
145回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,594,700,000		
146回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,587,750,000		
国債証券 合計		343,820,000,000	363,862,299,000		
地方債証券	622回	東京都公募公債	106,800,000	108,541,908	
	623回	東京都公募公債	200,000,000	203,346,000	
	627回	東京都公募公債	100,000,000	102,309,000	
	628回	東京都公募公債	100,000,000	102,785,000	
	629回	東京都公募公債	494,000,000	506,429,040	
	632回	東京都公募公債	115,300,000	119,944,284	
	633回	東京都公募公債	100,000,000	103,963,000	
	634回	東京都公募公債	200,000,000	208,332,000	
	638回	東京都公募公債	200,000,000	209,382,000	
	640回	東京都公募公債	150,000,000	157,132,500	

641回	東京都公募公債	100,000,000	104,843,000	
659回	東京都公募公債	203,500,000	216,092,580	
664回	東京都公募公債	300,000,000	317,115,000	
667回	東京都公募公債	300,000,000	320,322,000	
680回	東京都公募公債	200,000,000	212,896,000	
685回	東京都公募公債	500,000,000	524,365,000	
688回	東京都公募公債	200,000,000	207,162,000	
697回	東京都公募公債	500,000,000	522,595,000	
701回	東京都公募公債	700,000,000	724,318,000	
708回	東京都公募公債	500,000,000	512,230,000	
720回	東京都公募公債	300,000,000	305,454,000	
16年度11回	北海道公募公債	250,000,000	253,087,500	
18年度4回	北海道公募公債	190,500,000	198,838,185	
18年度6回	北海道公募公債	100,000,000	104,940,000	
19年度4回	北海道公募公債	300,000,000	317,991,000	
21年度6回	北海道公募公債	200,000,000	213,876,000	
22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	210,842,000	
135回	神奈川県公募公債	200,000,000	205,202,000	
136回	神奈川県公募公債	100,000,000	102,649,000	
166回	神奈川県公募公債	300,000,000	318,030,000	
194回	神奈川県公募公債	300,000,000	303,837,000	
278回	大阪府公募公債	200,000,000	203,056,000	
285回	大阪府公募公債	100,000,000	102,538,000	
286回	大阪府公募公債	200,000,000	205,326,000	
289回	大阪府公募公債	200,000,000	207,294,000	
293回	大阪府公募公債	200,000,000	209,926,000	
301回	大阪府公募公債	100,000,000	105,248,000	
307回	大阪府公募公債	100,000,000	106,031,000	
310回	大阪府公募公債	240,000,000	253,209,600	
336回	大阪府公募公債	200,000,000	213,034,000	
345回	大阪府公募公債	300,000,000	315,831,000	
356回	大阪府公募公債	200,000,000	207,064,000	
364回	大阪府公募公債	300,000,000	303,333,000	
374回	大阪府公募公債	300,000,000	305,829,000	
83回	大阪府公募公債 5年	300,000,000	300,849,000	
18年度1回	京都府公募公債	100,000,000	104,501,000	
17年度2回	兵庫県公募公債	200,000,000	203,138,000	
17年度9回	兵庫県公募公債	306,000,000	314,154,900	
17年度13回	兵庫県公募公債	105,000,000	108,475,500	
18年度1回	兵庫県公募公債	120,000,000	124,404,000	
19年度2回	兵庫県公募公債	200,000,000	210,586,000	
18年度5回	静岡県公募公債	129,800,000	135,892,812	
21年度5回	静岡県公募公債	197,000,000	208,764,840	
22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	208,694,000	
23年度9回	静岡県公募公債	200,000,000	207,622,000	
18年度2回	愛知県公募公債	160,300,000	167,558,384	
20年度4回	愛知県公募公債	100,000,000	106,436,000	
22年度6回	愛知県公募公債	200,000,000	210,256,000	
23年度20回	愛知県公募公債	500,000,000	520,245,000	
25年度4回	愛知県公募公債	300,000,000	304,779,000	

16年度2回	広島県公募公債	200,000,000	203,212,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	212,572,000	
17年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	203,154,000	
18年度1回	埼玉県公募公債	200,000,000	207,528,000	
21年度4回	埼玉県公募公債	440,000,000	468,485,600	
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	210,170,000	
17年度5回	福岡県公募公債	100,000,000	102,750,000	
17年度1回	福岡県公募公債	100,000,000	102,029,000	
18年度1回	福岡県公募公債	104,000,000	109,304,000	
21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	214,026,000	
17年度2回	千葉県公募公債	200,000,000	203,342,000	
19年度5回	千葉県公募公債	300,000,000	318,735,000	
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	212,608,000	
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	302,547,000	
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	202,698,000	
18年度2回	新潟県公募公債	169,000,000	177,216,780	
25回	共同発行市場公募地方債	304,000,000	308,876,160	
28回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,526,000	
29回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,050,000	
31回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,792,000	
32回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,406,000	
33回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,466,000	
35回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,134,000	
36回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,178,000	
37回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,632,500	
38回	共同発行市場公募地方債	170,000,000	177,413,700	
39回	共同発行市場公募地方債	146,000,000	152,234,200	
40回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,381,500	
47回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	169,780,192	
54回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	422,316,000	
55回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,490,000	
57回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,390,000	
61回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	317,064,000	
65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,402,000	
75回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	536,890,000	
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	749,763,000	
94回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,503,000	
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	734,181,000	
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,573,000	
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,745,000	
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	716,569,000	
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	802,172,438	
17年度3回	大阪市公募公債	100,000,000	101,721,000	
17年度7回	大阪市公募公債	200,000,000	204,170,000	
17年度8回	大阪市公募公債	200,000,000	205,068,000	
17年度11回	大阪市公募公債	100,000,000	102,984,000	
18年度2回	大阪市公募公債	100,000,000	104,401,000	
18年度3回	大阪市公募公債	150,000,000	157,219,500	
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	143,345,700	
12回ひ号	名古屋市公募公債	200,000,000	203,506,000	

	1 2 回せ号 名古屋市公募公債	359,500,000	367,200,490	
	1 7 年度 1 回 京都市公募公債	100,000,000	101,993,000	
	1 8 年度 3 回 京都市公募公債	101,700,000	107,110,440	
	1 7 年度 1 3 回 神戸市公募公債	103,000,000	106,095,150	
	1 7 年度 1 回 横浜市公募公債	300,000,000	304,110,000	
	2 2 年度 3 回 横浜市公募公債	200,000,000	210,058,000	
	2 2 年度 5 回 横浜市公募公債	200,000,000	211,330,000	
	2 3 年度 4 回 横浜市公募公債	450,000,000	467,253,000	
	2 5 年度 2 回 横浜市公募公債	400,000,000	407,412,000	
	1 6 年度 7 回 札幌市公募公債	100,000,000	101,618,000	
	1 9 年度 7 回 札幌市公募公債	300,000,000	315,777,000	
	2 回 川崎市公募公債 1 5 年	100,000,000	107,988,000	
	2 1 年度 2 回 北九州市公募公債	200,000,000	212,002,000	
	1 8 年度 4 回 福岡市公募公債	100,000,000	104,517,000	
地方債証券 合計		29,155,900,000	30,290,111,383	
特殊債券	1 3 回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	126,873,340	
	2 7 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	209,502,000	
	4 6 回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	211,862,000	
	1 5 回 高速道路機構債	400,000,000	419,640,000	
	2 5 回 高速道路機構債	300,000,000	317,181,000	
	3 5 回 高速道路機構債	400,000,000	422,712,000	
	4 8 回 高速道路機構債	700,000,000	748,986,000	
	9 6 回 高速道路機構債	700,000,000	705,215,000	
	3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	308,397,000	
	5 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	215,510,350	
	8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	111,477,600	
	9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,213,000	
	1 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	315,222,250	
	1 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	127,975,560	
	1 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	337,830,000	
	1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,492,000	
	2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	392,835,000	
	2 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,716,000	
	3 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,862,000	
	3 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	312,028,200	
3 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	364,540,240		
4 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	351,766,940		

4 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,394,000	
5 4 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	525,235,000	
5 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,246,000	
6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	757,126,300	
6 6 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	171,810,720	
6 7 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	427,554,220	
7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	634,644,000	
7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	742,497,000	
8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,724,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,370,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,009,700,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	495,005,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	337,421,700	
4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	304,689,000	
8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	207,333,360	
8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	310,156,000	
8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	204,860,000	
8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	212,762,880	
8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	248,034,200	
8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,840,000	
8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	208,912,000	
8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	105,636,910	
8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	106,810,320	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	506,876,020	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	526,470,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	694,317,540	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,912,440	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	529,775,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,754,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	529,910,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,100,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,978,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,316,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,899,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,200,000	
1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	101,525,000	
1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	304,974,000	
1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	102,372,000	



20回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	209,076,000	
24回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	315,303,000	
148回 政保阪神高速道路債	107,000,000	109,135,720	
186回 政保中小企業債券	104,000,000	106,025,920	
19回 都市再生機構債券	200,000,000	214,534,000	
11回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,976,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	317,283,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	86,535,000	93,464,722	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,646,000	65,242,966	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	89,859,000	96,761,968	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	98,178,000	106,062,675	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	46,828,000	49,701,366	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	240,705,000	253,050,759	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,933,000	60,767,082	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,898,000	44,248,364	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	155,460,000	168,419,145	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	123,375,000	132,955,068	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	213,535,000	228,681,037	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	323,075,000	343,331,802	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	615,264,000	649,854,142	
723号 利付商工債	300,000,000	301,596,000	
732号 利付商工債	400,000,000	404,004,000	
736号 利付商工債	300,000,000	302,142,000	
740号 利付商工債	300,000,000	302,307,000	
717号 利附農林債	300,000,000	301,944,000	
721号 利附農林債	120,000,000	120,735,600	
737号 利附農林債	300,000,000	302,496,000	
743号 利附農林債	300,000,000	302,169,000	
753号 利附農林債	300,000,000	299,694,000	
760号 利附農林債	300,000,000	301,530,000	
253回 利附信金中金債	300,000,000	302,529,000	
261回 利附信金中金債	300,000,000	302,151,000	
275回 利附信金中金債	400,000,000	401,200,000	
282回 利附信金中金債	300,000,000	300,630,000	
156号 利附商工債（3年）	500,000,000	500,300,000	
1回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	103,759,320	
2回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	103,669,430	
8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,139,600	
4回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	175,453,600	
10回 政保中日本高速道路債券	215,000,000	225,079,200	
21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	319,440,000	
5回 中日本高速道路債券	200,000,000	214,350,000	
1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	206,491,320	
5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	271,887,840	
6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	122,976,360	

	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	505,865,000	
特殊債券 合計		30,016,291,000	31,233,393,096	
社債券	1 2 回 G Eキャピタル円貨債	100,000,000	101,712,000	
	1 4 回 G Eキャピタル円貨債	100,000,000	102,837,000	
	2 回 J Pモルガン・チェース劣後債	100,000,000	102,768,000	
	1 2 回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	106,089,000	
	1 6 回 シティグループ円貨社債	100,000,000	102,041,000	
	7 回 ウエストパック銀行円貨社債	100,000,000	101,314,000	
	2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	310,197,000	
	3 2 回 アサヒビール社債	100,000,000	100,524,000	
	7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	107,108,000	
	3 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	107,254,000	
	4 1 回 住友化学社債	100,000,000	106,423,000	
	3 7 回 三菱化学社債	100,000,000	107,747,000	
	3 4 回 三井化学社債	100,000,000	103,225,000	
	1 1 回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,349,000	
	1 2 回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,637,000	
	2 4 回 新日本石油社債	100,000,000	101,828,000	
	2 9 回 新日本製鐵社債	100,000,000	109,551,000	
	6 4 回 新日本製鐵社債	100,000,000	106,178,000	
	1 5 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,427,000	
	1 回 日本電産社債	100,000,000	100,367,000	
	1 0 回 パナソニック社債	200,000,000	201,910,000	
	1 1 回 パナソニック社債	100,000,000	102,801,000	
	1 7 回 ソニー社債	100,000,000	101,638,000	
	3 回 パナソニック電工社債	100,000,000	101,966,000	
	1 9 回 三菱重工業社債	100,000,000	104,763,000	
	5 1 回 日産自動車社債	100,000,000	100,769,000	
	1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,516,000	
	4 9 回 伊藤忠商事社債	100,000,000	108,574,000	
	5 8 回 伊藤忠商事社債	100,000,000	100,879,000	
	6 6 回 伊藤忠商事社債	200,000,000	200,554,000	
	7 7 回 丸紅社債	100,000,000	100,815,000	
	9 1 回 丸紅社債	100,000,000	100,620,000	
	3 0 回 住友商事社債	100,000,000	103,066,000	
	6 9 回 三菱商事社債	300,000,000	321,732,000	
	7 7 回 三菱商事社債	150,000,000	151,408,500	
	7 回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	319,191,000	
	2 0 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,252,000	
	2 4 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,502,000	
	2 5 回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	303,585,000	
	2 7 回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	302,346,000	
	2 9 回 みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	503,395,000	
	3 1 回 みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	300,741,000	
	3 2 回 みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	199,954,000	
	7 回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	110,703,000	
	1 1 4 回 三菱東京U F J 銀行社債	200,000,000	201,292,000	
	1 2 6 回 三菱東京U F J 銀行社債	300,000,000	302,799,000	

134回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,058,000	
140回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,120,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	219,168,000	
8回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	204,342,000	
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	211,180,000	
12回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,082,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,560,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	212,948,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	111,967,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,976,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	212,834,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,134,000	
10回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,996,000	
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	101,685,000	
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,257,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	105,110,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,850,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	100,956,000	
50回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,014,000	
51回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,644,000	
54回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,590,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	300,735,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,411,000	
10回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,132,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	214,342,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	219,020,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,062,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,410,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,365,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,794,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	218,254,000	
19回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	213,916,000	
38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	200,918,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,672,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,711,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,657,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,995,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	217,162,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	104,002,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	314,172,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	104,393,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	205,684,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,276,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	200,844,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,484,000	
12回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,750,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	101,071,000	
20回	野村ホールディングス社債	100,000,000	100,854,000	

2 2 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,864,000	
3 9 回	野村ホールディングス社債	300,000,000	305,136,000	
8 回	野村ホールディングス社債	100,000,000	106,140,000	
2 4 回	三井不動産社債	100,000,000	102,769,000	
3 8 回	三井不動産社債	200,000,000	213,172,000	
7 9 回	三菱地所社債	200,000,000	209,906,000	
9 0 回	三菱地所社債	100,000,000	105,859,000	
9 6 回	三菱地所社債	200,000,000	213,966,000	
7 3 回	住友不動産社債	100,000,000	100,897,000	
8 4 回	住友不動産社債	100,000,000	100,013,000	
8 回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	107,164,000	
4 1 回	小田急電鉄社債	100,000,000	105,172,000	
3 回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	215,908,000	
7 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,052,000	
1 5 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	343,005,000	
1 9 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,734,000	
4 1 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,316,000	
5 2 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,355,000	
5 6 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	320,799,000	
3 回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	218,974,000	
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	335,922,000	
2 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	217,096,000	
5 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,177,000	
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,965,000	
1 0 回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	198,325,800	
2 3 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,005,000	
3 回	東京地下鉄社債	100,000,000	104,510,000	
5 回	K D D I 社債	100,000,000	109,627,000	
5 0 回	日本電信電話社債	100,000,000	102,306,000	
5 1 回	日本電信電話社債	200,000,000	208,972,000	
5 4 回	日本電信電話社債	200,000,000	212,848,000	
6 0 回	日本電信電話社債	300,000,000	316,785,000	
1 5 回	N T T ドコモ社債	200,000,000	214,776,000	
4 5 5 回	東京電力社債	200,000,000	187,746,000	
5 1 6 回	東京電力社債	100,000,000	98,045,000	
5 1 9 回	東京電力社債	372,000,000	361,517,040	
5 4 2 回	東京電力社債	500,000,000	464,230,000	
4 0 7 回	中部電力社債	100,000,000	104,708,000	
4 0 9 回	中部電力社債	300,000,000	326,094,000	
4 6 8 回	中部電力社債	100,000,000	101,267,000	
4 7 1 回	中部電力社債	300,000,000	304,290,000	
4 7 6 回	中部電力社債	100,000,000	107,464,000	
4 7 8 回	中部電力社債	100,000,000	104,134,000	
4 8 0 回	中部電力社債	200,000,000	208,634,000	
4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	519,380,000	
4 1 0 回	関西電力社債	300,000,000	317,715,000	
4 4 1 回	関西電力社債	200,000,000	202,652,000	
4 4 6 回	関西電力社債	200,000,000	205,810,000	
2 9 8 回	中国電力社債	200,000,000	210,310,000	
3 1 0 回	中国電力社債	200,000,000	220,216,000	

245回	北陸電力社債	200,000,000	209,986,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	110,765,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	213,174,000	
375回	東北電力社債	100,000,000	104,752,000	
380回	東北電力社債	300,000,000	326,610,000	
427回	東北電力社債	200,000,000	203,488,000	
432回	東北電力社債	500,000,000	519,625,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	107,524,000	
257回	四国電力社債	200,000,000	202,400,000	
382回	九州電力社債	100,000,000	101,165,000	
383回	九州電力社債	100,000,000	101,352,000	
387回	九州電力社債	200,000,000	205,560,000	
257回	北海道電力社債	200,000,000	215,494,000	
284回	北海道電力社債	500,000,000	511,215,000	
14回	電源開発社債	100,000,000	102,014,000	
17回	電源開発社債	100,000,000	104,137,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	110,345,000	
9回	大阪ガス社債	100,000,000	110,695,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	101,500,000	
社債券 合計		28,112,000,000	29,226,433,340	
合計		431,104,191,000	454,612,236,819	

## 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。

## 「J - R E I Tインデックスファンド・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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		7,994,465	1,481,571,982
投資証券		13,890,668,820	17,369,800,780
未収入金		12,783,910	-
未収配当金		162,043,930	142,457,948
流動資産合計		14,073,491,125	18,993,830,710
資産合計		14,073,491,125	18,993,830,710
負債の部			
流動負債			
未払金		8,445,000	1,414,710,940
未払解約金		964,000	248,000
流動負債合計		9,409,000	1,414,958,940
負債合計		9,409,000	1,414,958,940
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,227,610,808	13,323,636,866
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	163,528,683	4,255,234,904
元本等合計		14,064,082,125	17,578,871,770
純資産合計		14,064,082,125	17,578,871,770
負債純資産合計		14,073,491,125	18,993,830,710

## 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	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。
2 . 収益及び費用の計上基準	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。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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	5,093,136,025円	14,227,610,808円
同期中追加設定元本額	11,080,757,712円	14,513,502,714円
同期中一部解約元本額	1,946,282,929円	15,417,476,656円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	48,566,424円	41,017,905円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	596,048,209円	506,890,177円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,524,222円	1,678,558円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	16,922円	2,914,314円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	34,942円	5,414,120円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	52,962円	13,767,469円
投資のソムリエ	518,423円	26,829,709円
投資のソムリエ<DC年金>	- 円	301,687円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	- 円	235,000円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201210（適格機関投資家限定）	4,521,953,369円	2,158,973,286円

	D I A M J - R E I T インデックス私募ファン ド201212(適格機 関投資家限定)	1,530,009,840円	1,167,041,128円
	D I A M J - R E I T インデックスファンド (適格機関投資家向け)	6,867,544,748円	6,334,891,129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)	295,961,762円	140,888,123円
	D I A Mグローバル分散 ファンドVA(適格機関 投資家限定)	364,378,985円	249,108,638円
	D I A Mグローバル・リ スクファクター・パリ ティ戦略ファンド(適格 機関投資家限定)	- 円	50,509,031円
	D I A M リスクコント ロールJ - R E I Tファ ンド(適格機関投資家限 定)	- 円	2,623,176,592円
	計	14,227,610,808円	13,323,636,866円
2 .	受益権の総数	14,227,610,808口	13,323,636,866口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は163,528,683円であります。	



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年1月12日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14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、価格変動リスク、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	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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)
投資証券	1,845,180,295	1,095,382,568
合計	1,845,180,295	1,095,382,568

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成24年6月7日から平成25年1月11日まで及び平成25年6月7日から平成26年1月14日まで)に対応する金額であります。

## (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)

	平成25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	0.9885円	1.3194円
(1万口当たり純資産額)	(9,885円)	(13,194円)

## 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26年1月14日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	4,918	494,750,800	
	MIDリート投資法人	431	100,293,700	
	SIA不動産投資法人	176	68,816,000	
	いちご不動産投資法人	2,386	151,033,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	582	468,510,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,907	650,295,900	
	イオンリート投資法人	2,227	286,614,900	
	インヴィンシブル投資法人	3,689	68,689,180	
	オリックス不動産投資法人	3,957	504,517,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	227	155,722,000	
	ケネディクスレジデンシャル投資法人	567	127,801,800	
	ケネディクス不動産投資法人	780	380,640,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	158	113,602,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,146	295,315,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,637	301,145,400	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,786	1,515,584,000	
	スタートアップリート投資法人	340	59,194,000	
	トップリート投資法人	413	194,729,500	
	フロンティア不動産投資法人	1,163	586,152,000	
	プレミア投資法人	513	202,635,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,581	824,313,700	
	阪急リート投資法人	247	134,368,000	
	産業ファンド投資法人	367	316,721,000	
	森トラスト総合リート投資法人	619	508,199,000	
	森ヒルズリート投資法人	649	440,671,000	
	星野リゾート・リート投資法人	47	30,785,000	
	積水ハウス・SI投資法人	374	190,740,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	877	362,639,500	
	大和ハウスリート投資法人	287	226,156,000	
	大和証券オフィス投資法人	928	432,912,000	
	東急リアル・エステート投資法人	458	283,960,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	541	383,569,000	
	日本ビルファンド投資法人	3,245	1,885,345,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,934	654,659,000	
日本プロロジスリート投資法人	733	742,529,000		
日本リテールファンド投資法人	5,412	1,128,402,000		
日本ロジスティクスファンド投資法人	389	427,900,000		
日本賃貸住宅投資法人	3,459	220,338,300		
福岡リート投資法人	324	268,596,000		
平和不動産リート投資法人	2,057	159,828,900		

	野村不動産オフィスファンド投資法人	874	402,914,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	3,904	415,385,600	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	377	202,826,000	
投資証券	合計	70,686	17,369,800,780	
合計		70,686	17,369,800,780	

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。

## 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。

## 「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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,995,117,588	4,172,666,831
コール・ローン		105,600,490	143,379,026
株式		299,969,453,942	298,535,209,958
投資信託受益証券		1,193,561,263	858,691,616
投資証券		5,865,091,266	5,115,634,900
派生商品評価勘定		96,096,811	38,917,107
未収入金		3,025,308	12,541,185
未収配当金		343,037,809	366,142,712
差入委託証拠金		1,563,569,155	883,876,270
流動資産合計		312,134,553,632	310,127,059,605
資産合計		312,134,553,632	310,127,059,605
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,400	14,954,691
未払解約金		84,532,000	65,294,000
流動負債合計		84,534,400	80,248,691
負債合計		84,534,400	80,248,691
純資産の部			
元本等			
元本	1	192,607,329,918	135,913,743,805
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		119,442,689,314	174,133,067,109
元本等合計		312,050,019,232	310,046,810,914
純資産合計		312,050,019,232	310,046,810,914
負債純資産合計		312,134,553,632	310,127,059,605

## 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25年1月11日現在	平成26年1月14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	223,825,007,857円	192,607,329,918円
	同期中追加設定元本額	24,312,045,994円	11,957,902,513円
	同期中一部解約元本額	55,529,723,933円	68,651,488,626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	1,264,941,534円	1,159,121,996円
	D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	34,663,194,038円	33,296,459,708円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	192,635,419円	150,534,125円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,074,560,241円	890,329,376円
	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,293,270,382円	1,112,032,575円
	D I A M D C バランス30インデックスファンド	192,757,103円	148,892,745円
	D I A M D C バランス50インデックスファンド	517,224,432円	423,004,157円
	D I A M D C バランス70インデックスファンド	369,633,085円	337,783,336円
	マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	65,245,313円	76,219,172円
	マネックス資産設計ファンド< 育成型>	805,866,848円	947,808,800円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	153,265,189円	163,376,187円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	35,866円	5,540,548円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	55,158円	7,687,612円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	75,205円	17,375,983円
	投資のソムリエ	219,014円	41,909,527円
	クルーズコントロール	3,128,081円	35,598,562円
	投資のソムリエ< D C年金>	- 円	483,907円



D I A M 8資産バラン スファンドN<DC年金 >	- 円	452,734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)	542,138,384円	446,333,455円
D I A M外国株式パッシ ブ私募ファンド(適格機 関投資家向け)	5,707,368,590円	4,223,297,292円
D I A M為替リスクコン トロール型グローバル株 式私募ファンド(適格機 関投資家限定)	12,254,128,984円	- 円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	72,514,634円	48,987,699円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	7,675,157,100円	3,797,958,766円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,345,528,917円	757,583,234円
D I A M国際分散バラン スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	158,826,564円	97,541,633円
D I A M国際分散バラン スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	906,017,627円	487,450,822円
D I A M国内重視バラン スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	77,853,986円	41,788,110円
D I A M国内重視バラン スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	147,335,281円	92,550,138円
D I A M世界バラン スファンド40VA(適 格機関投資家限定)	15,008,817,486円	11,265,455,225円
D I A M世界バラン スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	7,461,861,312円	5,618,861,756円
D I A Mバラン スファンド25VA(適 格機関投資家限定)	2,484,248,662円	1,777,730,776円
D I A Mバラン スファンド37.5VA(適 格機関投資家限定)	2,146,629,341円	1,590,948,161円
D I A Mバラン スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	5,689,028,414円	4,393,683,480円
D I A Mグローバル・ア セット・バラン スVA(適 格機関投資家限定)	4,219,738,741円	2,616,588,063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)	5,538,044,320円	3,936,646,960円
D I A M アクサ グ ローバル バランスファ ンド3 0 V A (適格機関 投資家限定)	3,739,745,900円	2,375,066,041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)	3,576,182,757円	2,049,442,154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)	51,515,013円	29,321,084円
D I A M世界バランス ファンド5 5 V A (適格 機関投資家限定)	15,300,439,503円	10,441,316,927円
D I A Mアイエヌジー世 界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限 定)	2,846,622,975円	2,275,077,315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)	115,996,456円	73,011,333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)	20,371,140,933円	14,039,586,099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)	1,909,202,112円	1,099,526,644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)	3,674,405,812円	2,473,239,583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)	12,575,501,262円	8,666,421,148円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	- 円	155,731円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限 定)	159,888円	347,414,773円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限 定)	250,516円	238,514,023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)	16,414,596,880円	11,517,045,938円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限 定)	- 円	268,844,682円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限 定)	73,576円	11,460,038円

	D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	151,084円	283,672円
計		192,607,329,918円	135,913,743,805円
2.	受益権の総数	192,607,329,918口	135,913,743,805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24年1月12日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14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、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。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。	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25年1月11日現在	平成26年1月14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 「(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。 (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。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25年1月11日現在	平成26年1月14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	23,967,239,175	42,184,166,839
投資信託受益証券	226,723,888	28,406,461
投資証券	570,431,456	226,080,969
合計	24,764,394,519	41,929,679,409

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成24年2月16日から平成25年1月11日まで及び平成25年2月16日から平成26年1月14日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成25年1月11日 現在				平成26年1月14日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	37,729,980	-	37,728,000	1,980
カナダ・ドル	-	-	-	-	9,488,400	-	9,488,000	400
ユーロ	-	-	-	-	28,241,580	-	28,240,000	1,580
買 建	29,594,900	-	29,592,500	2,400	53,340,050	-	52,691,000	649,050
アメリカ・ドル	-	-	-	-	10,494,800	-	10,331,000	163,800
ユーロ	29,594,900	-	29,592,500	2,400	42,845,250	-	42,360,000	485,250
合計	29,594,900	-	29,592,500	2,400	91,070,030	-	90,419,000	647,070

(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25年1月11日 現在				平成26年1月14日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	4,869,107,168	-	4,965,203,979	96,096,811	5,361,842,494	-	5,386,451,980	24,609,486
合計	4,869,107,168	-	4,965,203,979	96,096,811	5,361,842,494	-	5,386,451,980	24,609,486

## (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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.6201円	2.2812円
(1万口当たり純資産額)	(16,201円)	(22,812円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成26年1月14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	37,169	390.980	14,532,335.620	
	ABBOTT LABORATORIES	157,441	39.110	6,157,517.510	
	AES CORP	75,129	14.260	1,071,339.540	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	106,042	184.160	19,528,694.720	
	ADOBE SYSTEMS INC	47,588	58.600	2,788,656.800	
	ACE LTD	35,827	96.920	3,472,352.840	
	AGCO CORP	11,661	56.480	658,613.280	
	AIRGAS INC	6,292	110.000	692,120.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,869	108.580	2,265,956.020	
	ENERGEN CORP	8,985	65.640	589,775.400	
	ALLEGHANY CORP	1,956	391.020	764,835.120	
	ALLERGAN INC	30,222	114.420	3,458,001.240	
	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	93,314	62.660	5,847,055.240	
	RALPH LAUREN CORP	5,290	167.500	886,075.000	
	ALLSTATE CORP	48,737	53.460	2,605,480.020	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	77,010	88.870	6,843,878.700	
	ALTERA CORPORATION	28,796	31.380	903,618.480	
	ALCOA INC	102,779	10.100	1,038,067.900	
	AMGEN INC	76,489	116.400	8,903,319.600	
	HESS CORP	30,613	78.870	2,414,447.310	
	BEAM INC	14,795	83.420	1,234,198.900	
	AMERICAN EXPRESS CO	98,830	86.990	8,597,221.700	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	48,454	46.670	2,261,348.180	
	AFLAC INC	47,249	64.100	3,028,660.900	
	AMERICAN INTL GROUP	144,852	51.460	7,454,083.920	
	ANALOG DEVICES	32,150	48.850	1,570,527.500	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	51,454	78.370	4,032,449.980	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,920	130.590	2,601,352.800	
	NABORS INDUSTRIES LTD	36,022	16.530	595,443.660	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	50,231	40.340	2,026,318.540	
	TIME WARNER	95,165	65.470	6,230,452.550	
	VALERO ENERGY CORP	56,486	51.490	2,908,464.140	
	APACHE CORP	40,751	84.290	3,434,901.790	
ANSYS INC	9,305	83.400	776,037.000		
APPLE INC	92,754	535.730	49,691,100.420		
APPLIED MATERIALS INC	128,032	17.320	2,217,514.240		
ALBEMARLE CORP	7,690	65.750	505,617.500		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65,752	41.530	2,730,680.560		



PINNACLE WEST CAPITAL CORP	13,584	52.970	719,544.480	
AMEREN CORP	25,297	36.230	916,510.310	
ARROW ELECTRONICS INC	11,621	52.210	606,732.410	
ASHLAND INC	6,333	98.330	622,723.890	
AUTOLIV INC	10,829	90.200	976,775.800	
AUTODESK INC	20,701	51.570	1,067,550.570	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	48,043	79.050	3,797,799.150	
AUTOZONE INC	3,337	486.380	1,623,050.060	
AVERY DENNISON CORP	8,865	50.360	446,441.400	
AVNET INC	15,099	42.120	635,969.880	
AVON PRODUCTS INC	41,317	16.490	681,317.330	
BAKER HUGHES INC	44,146	52.550	2,319,872.300	
BALL CORP	12,188	50.780	618,906.640	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	112,890	114.010	12,870,588.900	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	115,464	33.500	3,868,044.000	
CR BARD INC	6,949	133.690	929,011.810	
BAXTER INTERNATIONAL INC	55,596	70.100	3,897,279.600	
BED BATH & BEYOND INC	20,557	68.300	1,404,043.100	
BECTON DICKINSON & CO	19,000	111.060	2,110,140.000	
AMETEK INC	25,338	51.660	1,308,961.080	
BE AEROSPACE INC	10,265	82.920	851,173.800	
VERIZON COMM INC	291,965	47.030	13,731,113.950	
WR BERKLEY CORP	11,053	41.510	458,810.030	
BEST BUY CO INC	26,686	36.860	983,645.960	
YUM! BRANDS INC	46,751	73.410	3,431,990.910	
FIRSTENERGY CORP	45,992	31.960	1,469,904.320	
SLM CORP	49,666	26.950	1,338,498.700	
H&R BLOCK INC	26,590	29.410	782,011.900	
ENSCO PLC-CL A	22,819	55.290	1,261,662.510	
BOEING CO	72,809	140.700	10,244,226.300	
ROBERT HALF INTL INC	14,807	40.370	597,758.590	
BORGWARNER INC	20,836	55.570	1,157,856.520	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131,498	12.920	1,698,954.160	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,632	57.450	1,012,958.400	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,922	247.270	722,522.940	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	167,571	55.420	9,286,784.820	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,422	208.920	1,132,764.240	
ONEOK INC	20,139	63.310	1,275,000.090	
SEMPRA ENERGY	22,909	90.860	2,081,511.740	
FEDEX CORP	31,403	140.490	4,411,807.470	
VERISIGN INC	16,877	60.330	1,018,189.410	
AMPHENOL CORP	15,769	89.190	1,406,437.110	
BROWN-FORMAN CORP	14,456	78.220	1,130,748.320	

QUANTA SERVICES INC	25,480	31.150	793,702.000	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	18,492	33.130	612,639.960	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	345,664	3.670	1,268,586.880	
CSX CORP	105,721	28.430	3,005,648.030	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	20,538	16.710	343,189.980	
CABOT OIL & GAS CORP	46,124	36.440	1,680,758.560	
CAMPBELL SOUP CO	22,764	42.250	961,779.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	32,204	58.540	1,885,222.160	
WHITING PETROLEUM CORP	13,133	58.710	771,038.430	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,362	80.060	1,309,941.720	
CARDINAL HEALTH INC	33,720	67.950	2,291,274.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	37,957	41.420	1,572,178.940	
CATERPILLAR INC	65,969	89.890	5,929,953.410	
CELGENE CORP	42,543	164.900	7,015,340.700	
CORE LABORATORIES N.V.	4,891	187.210	915,644.110	
CITRIX SYSTEMS INC	19,857	58.790	1,167,393.030	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	58,295	25.150	1,466,119.250	
CENTURYLINK INC	63,731	30.870	1,967,375.970	
CERNER CORP	33,863	53.830	1,822,845.290	
JPMORGAN CHASE & CO	383,778	57.700	22,143,990.600	
CHUBB CORP	26,934	90.110	2,427,022.740	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,581	65.260	821,036.060	
CIGNA CORP	29,425	88.780	2,612,351.500	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16,516	50.510	834,223.160	
CINTAS CORP	8,876	58.480	519,068.480	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	134,501	4.700	632,154.700	
CISCO SYSTEMS INC	543,117	22.190	12,051,766.230	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	9,607	80.450	772,883.150	
CLOROX COMPANY	15,155	89.100	1,350,310.500	
EQUINIX INC	5,159	174.920	902,412.280	
COCA-COLA CO/THE	406,611	39.530	16,073,332.830	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	24,325	43.910	1,068,110.750	
COLGATE-PALMOLIVE CO	94,230	64.690	6,095,738.700	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	21,321	48.750	1,039,398.750	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	48,067	50.240	2,414,886.080	
COMERICA INC	18,671	47.220	881,644.620	
NRG ENERGY, INC.	33,814	27.460	928,532.440	
COMCAST CORP-CL A	217,413	52.160	11,340,262.080	
CA INC	30,767	33.440	1,028,848.480	
COMPUTER SCIENCES CORP	16,463	54.750	901,349.250	
CONAGRA FOODS INC	45,240	33.570	1,518,706.800	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,579	53.920	1,540,979.680	

CMS ENERGY CORP	20,017	26.730	535,054.410	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	26,380	57.650	1,520,807.000	
MOLSON COORS BREWING CO	17,190	55.940	961,608.600	
CORNING INC	155,504	18.020	2,802,182.080	
DIRECTV	54,604	70.710	3,861,048.840	
CREE INC	13,242	61.060	808,556.520	
SEALED AIR CORP	20,323	33.270	676,146.210	
BROADCOM CORP-CL A	55,671	28.720	1,598,871.120	
CUMMINS INC	18,380	136.150	2,502,437.000	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	8,350	105.660	882,261.000	
DR HORTON INC	34,671	21.550	747,160.050	
DANAHER CORP	59,746	76.150	4,549,657.900	
MOODY'S CORP	19,691	75.080	1,478,400.280	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	30,639	98.210	3,009,056.190	
TARGET CORP	63,175	61.500	3,885,262.500	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,668	54.570	363,872.760	
DEERE & CO	37,524	89.510	3,358,773.240	
MORGAN STANLEY	147,597	30.870	4,556,319.390	
REPUBLIC SERVICES INC	29,354	32.040	940,502.160	
THE WALT DISNEY CO	172,342	73.270	12,627,498.340	
DOLLAR TREE INC	24,068	55.130	1,326,868.840	
DOVER CORP	18,750	93.150	1,746,562.500	
DOW CHEMICAL	121,961	41.890	5,108,946.290	
OMNICOM GROUP	27,703	71.510	1,981,041.530	
DTE ENERGY CO	19,035	66.050	1,257,261.750	
XL GROUP PLC	26,332	29.860	786,273.520	
DUKE ENERGY CORP	71,547	67.770	4,848,740.190	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	32,561	71.600	2,331,367.600	
FLOWSERVE CORP	12,469	75.400	940,162.600	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,828	50.830	702,877.240	
EBAY INC	119,842	52.540	6,296,498.680	
EMC CORP/MASS	210,363	25.140	5,288,525.820	
BANK OF AMERICA CORP	1,093,077	16.430	17,959,255.110	
CITIGROUP INC	308,990	53.720	16,598,942.800	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,731	78.170	1,307,862.270	
EATON CORP PLC	48,113	74.070	3,563,729.910	
EATON VANCE CORP	12,917	40.430	522,234.310	
DISH NETWORK CORP	23,833	55.950	1,333,456.350	
ECOLAB INC	27,290	103.100	2,813,599.000	
ELECTRONIC ARTS INC	35,610	22.380	796,951.800	
SALESFORCE.COM INC	59,007	56.210	3,316,783.470	
EMERSON ELECTRIC CO	72,168	68.050	4,911,032.400	
WEATHERFORD INTL LTD	73,546	14.290	1,050,972.340	
ENTERGY CORP	16,359	60.620	991,682.580	
EOG RESOURCES INC	27,383	163.460	4,476,025.180	

EQUIFAX INC	11,487	67.450	774,798.150	
EQT CORP	14,624	84.350	1,233,534.400	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	23,912	73.840	1,765,662.080	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	20,066	44.220	887,318.520	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	82,264	72.620	5,974,011.680	
EXXON MOBIL CORP	449,640	98.550	44,312,022.000	
FMC CORP	12,155	72.850	885,491.750	
NEXTERA ENERGY INC	42,705	86.680	3,701,669.400	
FAMILY DOLLAR STORES	10,460	65.000	679,900.000	
ASSURANT INC	8,352	66.630	556,493.760	
FASTENAL CO	30,809	47.430	1,461,270.870	
FIFTH THIRD BANCORP	87,505	21.250	1,859,481.250	
M&T BANK CORP	11,528	114.350	1,318,226.800	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	11,007	72.220	794,925.540	
FISERV INC	26,258	57.390	1,506,946.620	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	32.460	468,138.120	
MACY'S INC	40,826	55.260	2,256,044.760	
FORD MOTOR CO	371,524	16.110	5,985,251.640	
FOREST LABORATORIES INC	24,901	67.730	1,686,544.730	
FOSSIL GROUP INC	5,086	114.580	582,753.880	
FRANKLIN RESOURCES INC	39,798	56.780	2,259,730.440	
FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	105,847	35.630	3,771,328.610	
FLEXTRONICS INTL LTD	74,709	7.620	569,282.580	
GAP INC/THE	34,421	38.250	1,316,603.250	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	15,658	48.310	756,437.980	
GENERAL DYNAMICS CORP	29,851	95.010	2,836,143.510	
GENERAL MILLS INC	65,106	48.810	3,177,823.860	
GENUINE PARTS CO	14,679	81.630	1,198,246.770	
GILEAD SCIENCES INC	155,525	73.140	11,375,098.500	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	17,970	77.240	1,388,002.800	
MCKESSON CORP	23,752	167.140	3,969,909.280	
NVIDIA CORP	51,123	15.360	785,249.280	
GENERAL ELECTRIC CO	1,039,570	26.730	27,787,706.100	
WW GRAINGER INC	5,965	261.660	1,560,801.900	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	12,666	79.410	1,005,807.060	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	16,876	75.850	1,280,044.600	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	14.820	329,537.520	
HALLIBURTON CO	88,400	49.580	4,382,872.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,686	69.720	1,163,347.920	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	43,162	175.880	7,591,332.560	
HARLEY-DAVIDSON INC	21,132	67.190	1,419,859.080	
HARRIS CORP	10,776	67.950	732,229.200	
CONSOL ENERGY INC	22,051	36.410	802,876.910	
HASBRO INC	11,176	52.250	583,946.000	

HENRY SCHEIN INC	7,142	114.310	816,402.020	
DENBURY RESOURCES INC	28,517	16.070	458,268.190	
HELMERICH & PAYNE INC	9,929	83.700	831,057.300	
HERSHEY FOODS CORP	16,263	97.850	1,591,334.550	
HEWLETT-PACKARD CO	197,600	28.120	5,556,512.000	
F5 NETWORKS INC	7,198	92.010	662,287.980	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	43.130	557,196.470	
REYNOLDS AMERICAN INC	32,398	48.110	1,558,667.780	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	14,788	89.120	1,317,906.560	
JUNIPER NETWORKS INC	48,236	25.320	1,221,335.520	
HOLLYFRONTIER CORP	19,247	48.730	937,906.310	
HOLOGIC INC	24,876	21.800	542,296.800	
UNUM GROUP	30,372	33.960	1,031,433.120	
HOME DEPOT INC	147,644	80.970	11,954,734.680	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,878	68.640	952,585.920	
HORMEL FOODS CORP	14,878	45.110	671,146.580	
HUDSON CITY BANCORP INC	61,279	9.250	566,830.750	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,422	23.040	1,000,442.880	
HUMANA INC	15,524	96.030	1,490,769.720	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,635	77.800	749,603.000	
RED HAT INC	20,247	57.560	1,165,417.320	
BIOGEN IDEC INC	24,030	283.670	6,816,590.100	
ILLINOIS TOOL WORKS	42,995	81.110	3,487,324.450	
INTUIT INC	27,600	75.010	2,070,276.000	
INGERSOLL-RAND PLC	28,100	61.730	1,734,613.000	
INTEL CORP	506,921	25.500	12,926,485.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,998	84.790	847,730.420	
INTL GAME TECH	20,749	16.950	351,695.550	
INTERNATIONAL PAPER CO	43,061	48.130	2,072,525.930	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,872	17.410	641,941.520	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,497	64.340	932,736.980	
JOHNSON & JOHNSON	287,687	94.500	27,186,421.500	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	41,564	34.770	1,445,180.280	
JOHNSON CONTROLS INC	69,702	51.190	3,568,045.380	
KLA-TENCOR CORP	16,662	62.310	1,038,209.220	
DEVON ENERGY CORP	38,601	59.180	2,284,407.180	
KELLOGG CO	28,361	60.430	1,713,855.230	
KEYCORP	86,740	13.470	1,168,387.800	
KIMBERLY-CLARK CORP	38,888	104.730	4,072,740.240	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,098	306.470	4,320,614.060	
KOHL'S CORP	23,092	53.460	1,234,498.320	
KROGER CO	48,049	38.610	1,855,171.890	
LSI CORP	55,560	10.970	609,493.200	

LAM RESEARCH CORP	14,133	54.580	771,379.140	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,064	46.300	790,063.200	
LEGG MASON INC	13,165	43.260	569,517.900	
LEGETT & PLATT INC	8,522	29.790	253,870.380	
LENNAR CORP	18,341	38.180	700,259.380	
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,049	27.370	986,661.130	
ELI LILLY & CO	102,969	52.070	5,361,595.830	
L BRANDS INC	26,970	56.610	1,526,771.700	
LINCOLN NATIONAL CORP	28,925	51.060	1,476,910.500	
LINEAR TECH CORP	23,086	44.490	1,027,096.140	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	73,308	100.230	7,347,660.840	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34,061	58.930	2,007,214.730	
LOCKHEED MARTIN CORP	27,544	150.920	4,156,940.480	
LOEWS CORP	33,738	46.330	1,563,081.540	
RANGE RESOURCES CORP	17,434	79.670	1,388,966.780	
LOWE'S COS INC	106,220	48.660	5,168,665.200	
DOMINION RESOURCES INC/VA	60,588	67.170	4,069,695.960	
IRON MOUNTAIN INC	12,968	27.690	359,083.920	
SCANA CORP	9,574	46.400	444,233.600	
MDU RESOURCES GROUP INC	21,313	30.470	649,407.110	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,258	25.250	1,041,764.500	
MCCORMICK & CO INC	14,416	69.230	998,019.680	
MCDONALD'S CORPORATION	102,385	94.830	9,709,169.550	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	26,382	76.630	2,021,652.660	
EVEREST RE GROUP LTD	5,049	147.010	742,253.490	
MANPOWERGROUP INC	7,953	84.260	670,119.780	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	12,156	68.740	835,603.440	
MARSH & MCLENNAN COS	56,000	47.390	2,653,840.000	
ENERGIZER HOLDINGS INC	7,466	104.990	783,855.340	
MASCO CORP	37,719	22.700	856,221.300	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	105.250	536,985.500	
MATTEL INC	37,311	44.660	1,666,309.260	
METLIFE INC	93,799	52.970	4,968,533.030	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	34,242	27.960	957,406.320	
MEDTRONIC INC	103,783	59.250	6,149,142.750	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,156	17.870	967,767.720	
CVS CAREMARK CORP	127,599	68.550	8,746,911.450	
MERCK & CO. INC.	298,696	53.120	15,866,731.520	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,600	90.700	961,420.000	
MICROSOFT CORP	807,386	34.990	28,250,436.140	
MICRON TECH INC	103,537	23.330	2,415,518.210	
RACKSPACE HOSTING INC	13,630	35.830	488,362.900	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,985	45.150	857,172.750	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	50,668	15.230	771,673.640	

3M CO	66,174	134.680	8,912,314.320	
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,039	146.690	1,032,550.910	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,610	65.490	1,611,708.900	
KANSAS CITY SOUTHERN	10,506	116.010	1,218,801.060	
MURPHY OIL CORPORATION	17,184	62.340	1,071,250.560	
MYLAN LABORATORIES	37,298	45.240	1,687,361.520	
ILLUMINA INC	13,717	113.930	1,562,777.810	
XCEL ENERGY INC	48,810	28.040	1,368,632.400	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	45,346	76.740	3,479,852.040	
NETAPP INC	33,354	39.700	1,324,153.800	
SEARS HOLDINGS CORP	4,862	35.460	172,406.520	
NEWELL RUBBERMAID INC	29,362	31.680	930,188.160	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	119.380	438,960.260	
NEWMONT MINING CORP	49,529	23.880	1,182,752.520	
NIKE INC-CL B	72,273	75.180	5,433,484.140	
NOBLE ENERGY INC	35,626	63.170	2,250,494.420	
NORDSTROM INC	13,411	59.490	797,820.390	
NORFOLK SOUTHERN CORP	32,257	90.190	2,909,258.830	
NORTHEAST UTILITIES	34,447	42.330	1,458,141.510	
NISOURCE INC	33,928	33.240	1,127,766.720	
COACH INC	30,955	54.300	1,680,856.500	
TOWERS WATSON & COMPANY	6,639	127.070	843,617.730	
NORTHERN TRUST CORP	22,009	60.430	1,330,003.870	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,819	115.630	2,522,930.970	
WELLS FARGO & CO	515,521	45.560	23,487,136.760	
NUCOR CORP	35,421	51.540	1,825,598.340	
MONSANTO CO	54,120	111.400	6,028,968.000	
CHENIERE ENERGY INC	23,885	45.060	1,076,258.100	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	61,482	76.370	4,695,380.340	
OCWEN FINANCIAL CORP	12,196	55.200	673,219.200	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	82,883	91.540	7,587,109.820	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	74.030	672,266.430	
OGE ENERGY CORP	22,050	33.580	740,439.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,078	130.220	1,572,797.160	
OMNICARE INC	12,226	62.210	760,579.460	
ORACLE CORP	353,534	37.750	13,345,908.500	
OWENS-ILLINOIS INC	19,173	33.870	649,389.510	
PACCAR INC	34,453	58.400	2,012,055.200	
PALL CORP	10,048	83.190	835,893.120	
EXELON CORP	85,567	26.980	2,308,597.660	
PARKER HANNIFIN CORP	16,001	125.620	2,010,045.620	
PARTNERRE LTD	3,890	99.900	388,611.000	
PATTERSON COS INC	4,032	40.510	163,336.320	
PAYCHEX INC	32,595	43.580	1,420,490.100	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,943	45.770	638,171.110	
PPL CORPORATION	64,994	30.140	1,958,919.160	

PEPSICO INC	157,377	82.370	12,963,143.490	
PENTAIR LTD	19,696	75.080	1,478,775.680	
PFIZER INC	676,001	30.540	20,645,070.540	
CONOCOPHILLIPS	118,436	67.740	8,022,854.640	
PVH CORP	7,894	129.550	1,022,667.700	
PETSMART INC	8,567	66.780	572,104.260	
PG&E CORP	44,930	40.290	1,810,229.700	
PHARMACYCLICS INC	5,559	130.530	725,616.270	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,788	164.780	2,436,766.640	
ALTRIA GROUP INC	208,659	37.090	7,739,162.310	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	56,300	77.370	4,355,931.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	6,387	138.970	887,601.390	
GARMIN LTD	13,579	45.410	616,622.390	
AETNA INC	38,540	71.040	2,737,881.600	
FLUOR CORP (NEW)	17,508	78.040	1,366,324.320	
PPG INDUSTRIES INC	14,182	187.760	2,662,812.320	
PRAXAIR INC	30,530	130.800	3,993,324.000	
PRECISION CASTPARTS CORP	15,193	269.000	4,086,917.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	45,160	114.770	5,183,013.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,682	82.350	2,279,612.700	
QUEST DIAGNOSTICS	14,594	53.750	784,427.500	
PROCTER & GAMBLE CO	279,844	80.010	22,390,318.440	
PROGRESSIVE CORP	63,937	25.700	1,643,180.900	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,488	31.570	1,562,336.160	
PULTE GROUP INC	40,688	19.400	789,347.200	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	47,010	16.940	796,349.400	
QUALCOMM INC	174,034	73.220	12,742,769.480	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	52.580	545,464.920	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,570	90.200	502,414.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,865	268.680	2,113,168.200	
RESMED INC	16,867	46.830	789,881.610	
US BANCORP	187,987	40.780	7,666,109.860	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,613	55.140	805,760.820	
ROSS STORES INC	21,400	73.290	1,568,406.000	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,374	99.660	834,552.840	
ROPER INDUSTRIES INC	9,399	137.980	1,296,874.020	
ROWAN COMPANIES PLC-A	13,327	32.830	437,525.410	
PEABODY ENERGY CORP	33,467	17.360	580,987.120	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,791	115.070	1,702,000.370	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,326	48.760	796,055.760	
RAYTHEON COMPANY	33,183	89.930	2,984,147.190	



KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,615	75.100	872,286.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,580	251.010	1,149,625.800	
FMC TECHNOLOGIES INC	22,653	51.050	1,156,435.650	
ACCENTURE PLC-CL A	65,120	81.060	5,278,627.200	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	170,829	35.200	6,013,180.800	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	18,347	44.070	808,552.290	
SANDISK CORP	24,773	71.180	1,763,342.140	
SAFEWAY INC	23,620	31.670	748,045.400	
ROCKWELL COLLINS INC	13,494	75.140	1,013,939.160	
ST JUDE MEDICAL INC	30,560	66.380	2,028,572.800	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	39,444	86.340	3,405,594.960	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	29,320	52.040	1,525,812.800	
PRICELINE.COM INC	5,196	1,139.720	5,921,985.120	
SCHLUMBERGER LTD	134,571	87.460	11,769,579.660	
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,670	24.830	2,921,746.100	
JOY GLOBAL INC	12,702	54.890	697,212.780	
ZIMMER HOLDINGS INC	17,978	95.650	1,719,595.700	
SPX CORP	3,361	99.480	334,352.280	
BUNGE LTD	13,535	81.060	1,097,147.100	
SEI INVESTMENTS CO	15,882	33.740	535,858.680	
WELLPOINT INC	31,319	90.840	2,845,017.960	
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,772	70.610	1,607,930.920	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	32,264	47.720	1,539,638.080	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8,538	191.190	1,632,380.220	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,617	24.820	412,433.940	
SIGMA-ALDRICH	11,301	91.470	1,033,702.470	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	46,269	88.530	4,096,194.570	
ADVANCE AUTO PARTS	7,875	114.290	900,033.750	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	34,348	38.070	1,307,628.360	
EDISON INTERNATIONAL	34,152	45.480	1,553,232.960	
SOUTHERN CO	87,757	41.270	3,621,731.390	
BB&T CORP	73,195	38.540	2,820,935.300	
SOUTHWEST AIRLINES	17,528	20.720	363,180.160	
AT&T INC	542,288	33.300	18,058,190.400	
CHEVRON CORP	197,149	119.250	23,510,018.250	
MEADWESTVACO CORP	16,496	35.020	577,689.920	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,726	80.150	1,180,288.900	
STAPLES INC	72,899	14.500	1,057,035.500	
STATE STREET CORP	47,154	72.930	3,438,941.220	
STARBUCKS CORP	78,597	75.120	5,904,206.640	
STRYKER CORP	29,747	77.430	2,303,310.210	
NETFLIX INC	5,640	336.810	1,899,608.400	

STERICYCLE INC	7,859	115.020	903,942.180	
SUNTRUST BANKS INC	54,576	38.150	2,082,074.400	
SYMANTEC CORP	76,489	22.200	1,698,055.800	
SYNOPSYS INC	14,312	40.640	581,639.680	
SYSCO CORP	59,058	36.280	2,142,624.240	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,432	393.350	1,743,327.200	
TESORO CORP	15,352	54.810	841,443.120	
TEXAS INSTRUMENTS INC	110,530	42.240	4,668,787.200	
TEXTRON INC	25,116	34.750	872,781.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,264	112.990	4,210,459.360	
TIFFANY & CO	12,040	87.440	1,052,777.600	
TOLL BROTHERS INC	17,142	36.070	618,311.940	
TORCHMARK CORP	9,110	77.170	703,018.700	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	32.030	436,793.110	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	17,040	64.470	1,098,568.800	
TRACTOR SUPPLY CO	15,159	73.400	1,112,670.600	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,388	33.670	787,473.960	
TYSON FOODS INC	28,867	33.900	978,591.300	
MARATHON OIL CORP	70,393	34.110	2,401,105.230	
UNION PACIFIC CORP	47,799	168.050	8,032,621.950	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	88,532	112.800	9,986,409.600	
UNITEDHEALTH GROUP INC	105,909	73.940	7,830,911.460	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,035	83.990	758,849.650	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,927	79.500	868,696.500	
VF CORP	37,944	60.230	2,285,367.120	
CBS CORP	57,668	60.940	3,514,287.920	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23,298	77.040	1,794,877.920	
VULCAN MATERIALS CO	15,610	58.660	915,682.600	
URBAN OUTFITTERS INC	13,462	36.890	496,613.180	
WALGREEN CO	91,195	60.200	5,489,939.000	
WAL-MART STORES INC	167,855	77.490	13,007,083.950	
WASTE MANAGEMENT INC	46,499	43.030	2,000,851.970	
WATERS CORP	8,002	100.510	804,281.020	
ACTAVIS PLC	18,272	181.290	3,312,530.880	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,083	97.390	981,983.370	
WESTERN DIGITAL CORP	23,595	84.610	1,996,372.950	
WHIRLPOOL CORP	7,676	153.500	1,178,266.000	
WYNN RESORTS LTD	7,511	203.470	1,528,263.170	
WHOLE FOODS MARKET INC	34,963	52.500	1,835,557.500	
NASDAQ OMX GROUP	10,282	39.150	402,540.300	
CME GROUP INC	33,607	74.020	2,487,590.140	
WILLIAMS COS INC	69,554	39.040	2,715,388.160	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	54.260	472,930.160	
LKQ CORP	28,289	32.260	912,603.140	

PEPCO HOLDINGS INC	18,195	18.790	341,884.050	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	51.350	544,772.150	
WISCONSIN ENERGY CORP	20,446	40.990	838,081.540	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,824	53.610	419,444.640	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	30.570	759,664.500	
CARMAX INC	24,979	45.220	1,129,550.380	
XEROX CORP	127,501	12.210	1,556,787.210	
XILINX INC	24,251	45.180	1,095,660.180	
YAHOO! INC	99,997	39.990	3,998,880.030	
CIMAREX ENERGY CO	9,368	92.730	868,694.640	
TJX COMPANIES INC	71,898	62.910	4,523,103.180	
HOSPIRA INC	15,624	41.690	651,364.560	
CBRE GROUP INC	28,979	26.200	759,249.800	
LIBERTY GLOBAL PLC	24,021	89.760	2,156,124.960	
REGIONS FINANCIAL CORP	138,567	10.310	1,428,625.770	
GOOGLE INC	27,917	1,122.980	31,350,232.660	
T-MOBILE US INC	19,051	32.490	618,966.990	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,336	79.170	3,351,741.120	
MOSAIC CO/THE	29,078	46.150	1,341,949.700	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	46,732	31.930	1,492,152.760	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	150,198	32.350	4,858,905.300	
HERBALIFE LTD	7,528	79.840	601,035.520	
CELANESE CORP	14,767	53.860	795,350.620	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	73,694	7.910	582,919.540	
IHS INC-CLASS A	5,758	119.700	689,232.600	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	13,414	81.440	1,092,436.160	
EXPEDIA INC	10,399	67.870	705,780.130	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,285	244.640	1,537,562.400	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,034	113.180	2,154,268.120	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	15,627	84.920	1,327,044.840	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	21,690	30.860	669,353.400	
GAMESTOP CORP. - CL. A	14,066	45.320	637,471.120	
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	11,889	220.510	2,621,643.390	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,718	84.930	655,489.740	
VIACOM INC-CLASS B	44,238	84.420	3,734,571.960	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,447	529.800	1,826,220.600	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	10,239	44.600	456,659.400	
TRANSDIGM GROUP INC	4,774	167.420	799,263.080	
MASTERCARD INC	10,780	810.000	8,731,800.000	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	46,990	27.750	1,303,972.500	

WYNDHAM WORLDWIDE CORP	12,025	71.480	859,547.000	
WESTERN UNION CO	61,119	16.380	1,001,129.220	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,629	46.510	401,334.790	
KBR INC	15,988	31.920	510,336.960	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	45,731	27.150	1,241,596.650	
SPECTRA ENERGY CORP	67,253	34.560	2,324,263.680	
TIME WARNER CABLE INC	28,718	132.400	3,802,263.200	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	35,585	15.410	548,364.850	
DELTA AIR LINES INC	22,701	30.920	701,914.920	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,877	104.680	405,844.360	
DISCOVER FINANCIAL	51,410	53.660	2,758,660.600	
COVIDIEN PLC	47,677	68.770	3,278,747.290	
TE CONNECTIVITY LTD	40,997	55.550	2,277,383.350	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	95.630	963,663.510	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,339	49.700	613,248.300	
VMWARE INC	10,086	93.010	938,098.860	
TERADATA CORP	19,646	44.030	865,013.380	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	7,107	88.890	631,741.230	
INVESCO LTD	43,479	35.050	1,523,938.950	
NETSUITE INC	3,281	103.000	337,943.000	
CALPINE CORP NPR	42,931	19.140	821,699.340	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	164,815	82.450	13,588,996.750	
VISA INC	52,252	218.900	11,437,962.800	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	22,285	47.430	1,056,977.550	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,289	41.590	677,459.510	
LORILLARD INC	38,414	49.270	1,892,657.780	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	7,259	76.310	553,934.290	
DISCOVERY COMMUNICATIONS- C	9,733	75.210	732,018.930	
MARATHON PETROLEUM CORP	33,263	88.160	2,932,466.080	
CAREFUSION CORP	20,958	40.750	854,038.500	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	67,126	35.460	2,380,287.960	
XYLEM INC	22,549	35.020	789,665.980	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	42,755	79.820	3,412,704.100	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	26,085	52.640	1,373,114.400	
LINKEDIN CORP	10,629	213.540	2,269,716.660	
HCA HOLDINGS INC	28,526	50.960	1,453,684.960	
NIELSEN HOLDINGS NV	26,310	43.680	1,149,220.800	
VERISK ANALYTICS INC	16,556	62.450	1,033,922.200	

	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,162	113.500	812,887.000	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	20,925	82.900	1,734,682.500	
	FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	7,892	51.570	406,990.440	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	32,899	15.900	523,094.100	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	7,245	134.220	972,423.900	
	CIT GROUP INC	20,577	50.200	1,032,965.400	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	713,000	0.675	481,275.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	30,790	60.690	1,868,645.100	
	AON PLC	29,492	80.920	2,386,492.640	
	REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	48.000	550,272.000	
	QEP RESOURCES INC	18,552	29.330	544,130.160	
	TESLA MOTORS INC	9,661	139.340	1,346,163.740	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	37.980	584,626.140	
	GENERAL MOTORS CO	101,523	39.580	4,018,280.340	
	VANTIV INC	12,141	31.590	383,534.190	
	TRIPADVISOR INC	12,944	84.450	1,093,120.800	
	MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	19,210	76.670	1,472,830.700	
	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	29,892	60.200	1,799,498.400	
	PHILLIPS 66	58,928	75.810	4,467,331.680	
	LIBERTY MEDIA CORP	9,165	135.200	1,239,108.000	
	FACEBOOK INC	175,797	55.910	9,828,810.270	
	ADT CORP	23,368	39.010	911,585.680	
	SERVICENOW INC	12,789	57.090	730,124.010	
	WORKDAY INC	6,561	87.880	576,580.680	
	KRAFT FOODS GROUP INC	59,385	53.490	3,176,503.650	
	ABBVIE INC	161,206	49.830	8,032,894.980	
	ZOETIS INC	51,278	31.780	1,629,614.840	
	NEWS CORP/NEW-CL A	43,948	17.150	753,708.200	
	SPRINT CORP	97,357	9.090	884,975.130	
	NOBLE CORP PLC	24,088	35.170	847,174.960	
	PERRIGO CO PLC	14,130	160.880	2,273,234.400	
	アメリカ・ドル 小計	31,599,855		1,707,967,174.270 (176,467,168,446)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	92,697	4.599	426,313.500	
	AMEC PLC	28,599	11.050	316,018.950	
	ANTOFAGASTA PLC	44,020	7.840	345,116.800	
	SEVERN TRENT PLC	28,908	16.550	478,427.400	
	BHP BILLITON PLC	214,510	17.970	3,854,744.700	
	BARCLAYS PLC	1,567,569	2.917	4,572,598.770	
	BT GROUP PLC	800,927	3.847	3,081,166.160	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	104,248	8.395	875,161.960	
	AGGREKO PLC	27,635	17.140	473,663.900	
	TULLOW OIL PLC	97,933	8.780	859,851.740	

BUNZL PLC	34,501	14.170	488,879.170	
EASYJET PLC	13,628	16.910	230,449.480	
CAPITA PLC	64,410	10.370	667,931.700	
AVIVA PLC	295,997	4.762	1,409,537.710	
CRODA INTERNATIONAL	12,849	23.520	302,208.480	
DIAGEO PLC	258,978	19.960	5,169,200.880	
SCHRODERS PLC	12,609	25.900	326,573.100	
NATIONAL GRID PLC	375,807	7.770	2,920,020.390	
GKN PLC	182,053	3.897	709,460.540	
KINGFISHER PLC	234,699	3.850	903,591.150	
BAE SYSTEMS PLC	323,539	4.297	1,390,247.080	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	193,252	30.425	5,879,692.100	
COBHAM PLC	88,449	2.889	255,529.160	
NEXT PLC	15,179	61.950	940,339.050	
REXAM PLC	94,964	5.035	478,143.740	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	100,666	22.240	2,238,811.840	
IMI PLC	37,027	15.640	579,102.280	
JOHNSON MATTHEY PLC	21,473	33.760	724,928.480	
SABMILLER PLC	96,580	30.205	2,917,198.900	
ANGLO AMERICAN PLC	140,108	12.730	1,783,574.840	
COMPASS GROUP PLC	184,252	9.585	1,766,055.420	
HSBC HOLDINGS PLC	1,903,533	6.770	12,886,918.410	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	574,217	2.281	1,309,788.970	
ARM HOLDINGS PLC	141,802	9.780	1,386,823.560	
CENTRICA PLC	543,390	3.262	1,772,538.180	
UNILEVER PLC	128,821	24.020	3,094,280.420	
MEGGITT PLC	71,707	5.350	383,632.450	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	202,760	2.513	509,535.880	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82,325	6.595	542,933.370	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	411,297	0.987	405,950.130	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	38,784	26.600	1,031,654.400	
PEARSON PLC	89,377	13.180	1,177,988.860	
PERSIMMON PLC	29,923	13.460	402,763.580	
PRUDENTIAL PLC	257,589	13.700	3,528,969.300	
RIO TINTO PLC	129,113	31.770	4,101,920.010	
VODAFONE GROUP PLC	4,941,395	2.337	11,548,040.110	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	65,566	46.490	3,048,163.340	
REED ELSEVIER PLC	127,990	9.070	1,160,869.300	
OLD MUTUAL PLC	538,950	1.955	1,053,647.250	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	194,037	12.450	2,415,760.650	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	234,054	3.680	861,318.720	

TRAVIS PERKINS PLC	19,895	18.800	374,026.000	
SSE PLC	99,390	13.440	1,335,801.600	
SERCO GROUP PLC	50,772	5.145	261,221.940	
BP PLC	1,922,200	4.958	9,530,267.600	
SHIRE PLC	57,161	29.110	1,663,956.710	
SAGE GROUP PLC(THE)	98,062	4.017	393,915.050	
INVENSYS PLC	71,055	5.090	361,669.950	
SMITHS GROUP PLC	36,935	15.050	555,871.750	
STANDARD CHARTERED PLC	245,267	12.920	3,168,849.640	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,053,661	0.840	4,245,075.240	
TATE & LYLE PLC	36,876	7.755	285,973.380	
BG GROUP PLC	350,815	13.150	4,613,217.250	
TESCO PLC	818,585	3.265	2,672,680.020	
3I GROUP PLC	119,685	3.940	471,558.900	
SMITH & NEPHEW PLC	93,652	8.745	818,986.740	
GLAXOSMITHKLINE PLC	499,201	15.910	7,942,287.910	
WEIR GROUP	18,336	21.030	385,606.080	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	17,421	18.000	313,578.000	
BABCOCK INT'L GROUP	43,025	13.920	598,908.000	
WPP PLC	130,749	13.590	1,776,878.910	
WOLSELEY PLC	27,936	34.660	968,261.760	
ASTRAZENECA PLC	130,210	36.635	4,770,243.350	
WHITBREAD PLC	19,002	38.910	739,367.820	
CARNIVAL PLC	17,669	25.990	459,217.310	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	158,973	4.744	754,167.910	
INTERTEK GROUP PLC	19,178	30.690	588,572.820	
WILLIAM HILL PLC	104,797	3.807	398,962.170	
BURBERRY GROUP PLC	41,539	14.610	606,884.790	
INVESTEC PLC	50,655	4.390	222,375.450	
INTERCONTINENTAL HOTELS	25,287	19.930	503,969.910	
ICAP PLC	52,823	4.519	238,707.130	
ITV PLC	345,353	2.028	700,375.880	
SAINSBURY (J) PLC	147,222	3.512	517,043.660	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	10,689	38.350	409,923.150	
G4S PLC	171,953	2.510	431,602.030	
ADMIRAL GROUP PLC	22,361	13.350	298,519.350	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	397,909	21.900	8,714,207.100	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	248,943	23.030	5,733,157.290	
INMARSAT PLC	46,334	7.500	347,505.000	
PETROFAC LTD	29,942	12.580	376,670.360	
STANDARD LIFE PLC	223,263	3.770	841,701.510	
EXPERIAN PLC	98,499	11.310	1,114,023.690	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	14.850	385,015.950	
TUI TRAVEL PLC	52,043	4.213	219,257.150	
MELROSE PLC	106,965	3.047	325,922.350	
FRESNILLO PLC NPR	23,779	7.035	167,285.260	

	RESOLUTION LTD	122,660	3.587	439,981.420	
	GLENCORE XSTRATA PLC	1,079,568	3.189	3,442,742.350	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	107,350	2.491	267,408.850	
	COCA-COLA HBC AG	25,293	17.980	454,768.140	
イギリス・ポンド	小計	30,211,561		177,196,207.840 (30,020,581,532)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	133,450	19.230	2,566,243.500	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	181,502	14.010	2,542,843.020	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.890	1,108,674.700	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	66,569	28.800	1,917,187.200	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	89,826	146.200	13,132,561.200	
イスラエル・シュケル	小計	659,577		21,267,509.620 (630,156,310)	
オーストラリア・ ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	43.950	562,340.250	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	283,459	31.330	8,880,770.470	
	AMCOR LTD	123,722	10.360	1,281,759.920	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	321,420	32.010	10,288,654.200	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,216	12.300	371,656.800	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	5.140	766,918.840	
	TELSTRA CORP LTD	448,020	5.250	2,352,105.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	11.890	378,981.860	
	AMP LTD	324,183	4.450	1,442,614.350	
	ASX LTD	22,288	36.500	813,512.000	
	BHP BILLITON LTD	328,942	36.560	12,026,119.520	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	14,149	19.340	273,641.660	
	ALS LTD	34,895	8.880	309,867.600	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	3.310	336,789.190	
	COMPUTERSHARE LT	50,472	11.350	572,857.200	
	CSL LIMITED	50,259	67.800	3,407,560.200	
	TRANSURBAN GROUP	160,451	6.820	1,094,275.820	
	COCA-COLA AMATIL LTD	60,500	12.170	736,285.000	
	COCHLEAR LTD	5,226	59.880	312,932.880	
	ORIGIN ENERGY LTD	107,742	13.810	1,487,917.020	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	163,026	77.000	12,553,002.000		
BORAL LIMITED	84,744	4.790	405,923.760		
RIO TINTO LIMITED	42,941	63.510	2,727,182.910		
APA GROUP	86,227	6.070	523,397.890		



	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,859	5.790	1,296,143.610	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,423	46.000	203,458.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	12.940	463,122.600	
	ORICA LTD	34,301	23.900	819,793.900	
	LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	16.200	352,463.400	
	SYDNEY AIRPORT	115,539	3.730	430,960.470	
	MACQUARIE GROUP LTD	30,846	53.980	1,665,067.080	
	WORLEYPARSONS LTD	23,411	16.840	394,241.240	
	SUNCORP GROUP LTD	140,404	13.150	1,846,312.600	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	236,120	34.240	8,084,748.800	
	NEWCREST MINING LTD	92,633	8.870	821,654.710	
	INCITEC PIVOT LTD	165,148	2.850	470,671.800	
	TOLL HOLDINGS LTD	72,011	5.730	412,623.030	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	127,737	1.120	143,065.440	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	121,525	11.890	1,444,932.250	
	SANTOS LTD	104,285	14.260	1,487,104.100	
	SONIC HEALTHCARE	45,868	17.050	782,049.400	
	TABCORP HOLDINGS LTD	30,088	3.560	107,113.280	
	WESFARMERS LTD	103,161	43.620	4,499,882.820	
	ALUMINA LIMITED	388,179	1.155	448,346.740	
	ILUKA RESOURCES LIMI	55,637	8.280	460,674.360	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	64,556	37.570	2,425,368.920	
	WOOLWORTHS LTD	124,027	34.210	4,242,963.670	
	METCASH LTD	79,084	3.100	245,160.400	
	SEEK LTD	29,830	13.190	393,457.700	
	TATTS GROUP LTD	141,350	3.050	431,117.500	
	SP AUSNET	234,780	1.250	293,475.000	
	AGL ENERGY LTD	57,550	15.050	866,127.500	
	BRAMBLES LTD	152,289	9.070	1,381,261.230	
	ASCIANO LTD	108,957	5.640	614,517.480	
	CROWN RESORTS LTD	46,332	17.210	797,373.720	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	109,246	2.550	278,577.300	
	AURIZON HOLDINGS LTD	210,167	4.860	1,021,411.620	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	4.860	274,113.720	
	オーストラリア・ドル 小計	6,625,798		103,806,421.730 (9,691,367,533)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,334	31.030	537,874.020	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	15,943	77.420	1,234,307.060	
	BARRICK GOLD CORP	120,690	19.730	2,381,213.700	
	ATCO LTD	7,193	47.250	339,869.250	
	TALISMAN ENERGY INC	100,146	12.170	1,218,776.820	
	BANK OF MONTREAL	65,347	71.700	4,685,379.900	

BANK OF NOVA SCOTIA	124,468	64.270	7,999,558.360	
NATIONAL BANK OF CANADA	17,129	88.100	1,509,064.900	
BCE INC	26,643	46.410	1,236,501.630	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	55,291	40.590	2,244,261.690	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	32,566	141.820	4,618,510.120	
BOMBARDIER INC 'B'	155,097	4.490	696,385.530	
SAPUTO INC	15,632	50.190	784,570.080	
BLACKBERRY LTD	56,591	9.110	515,544.010	
CGI GROUP INC	22,652	34.360	778,322.720	
CAE INC	31,436	14.010	440,418.360	
CAMECO CORP	45,703	21.780	995,411.340	
ROGERS COMM-CL B	35,628	47.040	1,675,941.120	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	40,469	88.650	3,587,576.850	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	111,566	35.850	3,999,641.100	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,877	99.170	681,992.090	
CANADIAN UTILITIES LTD	15,036	36.760	552,723.360	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,758	58.830	4,927,483.140	
AGRIUM INC	16,162	99.260	1,604,240.120	
YAMANA GOLD INC	67,520	10.130	683,977.600	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,491	59.020	678,198.820	
OPEN TEXT CORP	7,329	96.500	707,248.500	
ELDORADO GOLD CORP	78,309	6.820	534,067.380	
EMPIRE CO LTD	5,031	72.420	364,345.020	
KINROSS GOLD CORP	125,461	4.970	623,541.170	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	26.220	449,935.200	
FORTIS INC	20,884	30.300	632,785.200	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	60,600	18.660	1,130,796.000	
TELUS CORP	26,152	36.810	962,655.120	
GREAT WEST LIFECO INC	32,106	31.690	1,017,439.140	
IMPERIAL OIL LTD	32,537	45.360	1,475,878.320	
ENBRIDGE INC	80,635	46.710	3,766,460.850	
IGM FINANCIAL INC	6,816	55.150	375,902.400	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	49,079	3.610	177,175.190	
MANULIFE FINANCIAL CORP	190,370	21.590	4,110,088.300	
LOBLAW CO LTD	12,181	44.000	535,964.000	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	35,435	17.780	630,034.300	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	45.690	439,994.700	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,217	90.750	2,106,942.750	
SUN LIFE FINANCIAL INC	61,535	37.740	2,322,330.900	

FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,025	417.500	427,937.500	
METRO INC	10,154	66.000	670,164.000	
HUSKY ENERGY INC	35,673	33.280	1,187,197.440	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	37,273	39.630	1,477,128.990	
METHANEX CORP	9,418	63.090	594,181.620	
ONEX CORP	10,676	58.200	621,343.200	
GOLDCORP INC	75,826	25.040	1,898,683.040	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	88,758	36.420	3,232,566.360	
POWER CORP OF CANADA	39,841	30.660	1,221,525.060	
POWER FINANCIAL CORP	23,521	34.670	815,473.070	
ROYAL BANK OF CANADA	146,553	71.210	10,436,039.130	
SNC-LAVALIN GROUP INC	16,326	49.430	806,994.180	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	17,692	163.440	2,891,580.480	
SHAW COMM INC-B	39,522	25.310	1,000,301.820	
SHOPPERS DRUG MART CORP	22,208	59.080	1,312,048.640	
NEW GOLD INC	51,627	5.950	307,180.650	
SUNCOR ENERGY INC	150,001	37.270	5,590,537.270	
ENCANA CORP	71,646	18.770	1,344,795.420	
TECK RESOURCES LTD-CL B	60,753	26.060	1,583,223.180	
THOMSON REUTERS CORP	41,062	40.700	1,671,223.400	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	93,830	97.800	9,176,574.000	
TRANSCANADA CORP	73,427	48.200	3,539,181.400	
TRANSALTA CORP	34,014	13.960	474,835.440	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	78.540	372,515.220	
INTACT FINANCIAL CORP	12,288	69.490	853,893.120	
SILVER WHEATON CORP	41,308	23.580	974,042.640	
CATAMARAN CORP	20,272	54.540	1,105,634.880	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,024	46.940	752,166.560	
CI FINANCIAL CORP	16,122	35.250	568,300.500	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	45.500	717,944.500	
KEYERA CORP	8,738	65.770	574,698.260	
ALTAGAS LTD	12,358	40.670	502,599.860	
PEMBINA PIPELINE CORP	28,565	37.250	1,064,046.250	
TIM HORTONS INC	14,007	59.980	840,139.860	
DOLLARAMA INC	6,908	82.490	569,840.920	
BAYTEX ENERGY CORP	11,962	39.990	478,360.380	
MEG ENERGY CORP	17,794	30.960	550,902.240	
ATHABASCA OIL CORP	42,987	6.790	291,881.730	
CENOVUS ENERGY INC W/I	72,925	29.760	2,170,248.000	
ENERPLUS CORP	20,814	18.940	394,217.160	
VERMILION ENERGY INC	8,291	60.800	504,092.800	
PENN WEST PETROLEUM LTD	52,457	9.040	474,211.280	
ARC RESOURCES LTD	30,599	28.150	861,361.850	
CANADIAN OIL SANDS LTD	53,022	20.000	1,060,440.000	

	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	33.200	370,777.600	
	PENGROWTH ENERGY CORP	36,505	6.550	239,107.750	
カナダ・ドル 小計		3,879,297		141,543,466.780 (13,431,059,562)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.870	483,750.000	
	SEBFCORP INDUSTRIES	139,000	5.310	738,090.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	169,000	4.030	681,070.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.530	435,469.200	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	174,000	17.250	3,001,500.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	9.510	351,870.000	
	SEBFCORP MARINE	108,000	4.280	462,240.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	36.630	476,190.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	7.060	614,220.000	
	CAPITALAND LTD	276,000	2.950	814,200.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	1.495	873,678.000	
	KEPPEL CORP LTD	137,500	10.980	1,509,750.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	90,000	2.030	182,700.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	1.040	428,233.520	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	280,200	9.730	2,726,346.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	819,867	3.550	2,910,527.850	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	10.070	658,578.000	
	KEPPEL LAND LTD	95,000	3.150	299,250.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	125,000	20.990	2,623,750.000	
	STARHUB LTD	65,000	4.250	276,250.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.310	662,000.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.240	286,440.000		
CAPITAMALLS ASIA LTD	120,000	1.930	231,600.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	2.920	832,200.000		
シンガポール・ドル 小計		5,459,770		22,559,902.570 (1,841,339,248)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	157,904	29.770	4,700,802.080	
	SYNGENTA AG	9,713	351.900	3,418,004.700	
	NESTLE SA-REGISTERED	328,388	66.350	21,788,543.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	52,226	88.150	4,603,721.900	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	71,471	256.600	18,339,458.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,842	130.900	633,817.800	
	SIKA INHABER	188	3,145.000	591,260.000	
	SGS SA-REG	576	2,069.000	1,191,744.000	
	SULZER AG-REG	3,187	138.900	442,674.300	
	NOVARTIS AG-REG SHS	234,010	73.150	17,117,831.500	

BALOISE HOLDING AG -R	5,702	113.700	648,317.400	
BARRY CALLEBAUT AG	69	1,108.000	76,452.000	
SWISSCOM AG-REG	2,309	478.200	1,104,163.800	
ABB LTD	220,149	23.700	5,217,531.300	
ADECCO SA-REG	11,879	71.850	853,506.150	
GEBERIT AG	4,109	275.200	1,130,796.800	
LONZA GROUP AG-REG	5,846	92.700	541,924.200	
LINDT & SPRUENGLI PART	91	4,036.000	367,276.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	49,045.000	637,585.000	
UBS AG-REGISTERED	372,228	18.760	6,982,997.280	
GIVAUDAN-REG	909	1,249.000	1,135,341.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	15,295	265.300	4,057,763.500	
HOLCIM LTD-REG	22,704	68.750	1,560,900.000	
ACTELION	12,017	83.250	1,000,415.250	
SONOVA HOLDING AG	4,519	122.700	554,481.300	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,445	125.000	805,625.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,715	565.500	1,535,332.500	
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	97.850	543,263.200	
SCHINDLER NAMEN	1,824	132.400	241,497.600	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,553	196.700	698,875.100	
EMS-CHEMIE HOLDING	1,280	315.750	404,160.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,477	70.700	387,223.900	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	239.000	480,390.000	
ARYZTA AG	8,596	71.800	617,192.800	
JULIUS BAER GROUP LTD	23,855	43.400	1,035,307.000	
SWISS RE LTD	36,822	80.000	2,945,760.000	
TRANSOCEAN LTD	39,921	43.480	1,735,765.080	
スイス・フラン 小計	1,678,394		110,127,701.840 (12,648,166,557)	
スウェーデン・ クローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	66,188	177.900	11,774,845.200	
ATLAS COPCO AB-B SHS	42,459	164.300	6,976,013.700	
ELEKTA AB	32,078	99.450	3,190,157.100	
ERICSSON LM-B SHS	319,794	78.150	24,991,901.100	
GETINGE AB-B SHS	22,760	217.100	4,941,196.000	
SKF AB-B SHS	43,481	171.600	7,461,339.600	
SANDVIK AB	108,906	88.500	9,638,181.000	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	162,348	85.550	13,888,871.400	
SKANSKA AB-B SHS	39,626	130.200	5,159,305.200	
SWEDBANK AB	88,783	182.300	16,185,140.900	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	63,427	197.000	12,495,119.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	48,233	321.400	15,502,086.200	
VOLVO AB-B SHS	144,477	88.100	12,728,423.700	
SCANIA AB	35,390	125.400	4,437,906.000	
SWEDISH MATCH AB	24,727	194.200	4,801,983.400	
TELE2 AB-B SHS	24,305	75.550	1,836,242.750	

	NORDEA AB	312,909	88.200	27,598,573.800	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	126.200	2,316,148.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	28,642	163.600	4,685,831.200	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	69.800	1,902,817.800	
	INVESTOR AB-B SHS	44,529	220.200	9,805,285.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	94,656	286.200	27,090,547.200	
	ASSA ABLOY AB-B	32,006	337.600	10,805,225.600	
	TELIASONERA AB	243,599	52.600	12,813,307.400	
	LUNDIN PETROLEUM AB	28,131	121.000	3,403,851.000	
	BOLIDEN AB	17,761	98.450	1,748,570.450	
	ALFA LAVAL AB	31,389	160.100	5,025,378.900	
	KINNEVIK INVESTMENT B	23,218	303.500	7,046,663.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,723	656.000	5,066,288.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	54,633	39.940	2,182,042.020	
	HEXAGON AB	21,871	213.400	4,667,271.400	
スウェーデン・クローナ 小計		2,253,663		282,166,514.420 (4,483,625,914)	
デンマーク・ クローネ	CARLSBERG AS-B	10,483	581.000	6,090,623.000	
	A P MOLLER A/S	124	65,250.000	8,091,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	62	62,450.000	3,871,900.000	
	DANSKE BANK A/S	74,115	129.900	9,627,538.500	
	NOVOZYMES-B SHS	24,240	235.100	5,698,824.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	206,880	211.300	43,713,744.000	
	TDC A/S	84,208	50.000	4,210,400.000	
	COLOPLAST-B	12,458	371.200	4,624,409.600	
	DSV A/S	15,918	182.300	2,901,851.400	
	WILLIAM DEMANT	2,595	510.500	1,324,747.500	
デンマーク・クローネ 小計		431,083		90,155,038.000 (1,705,733,318)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	118,545	3.600	426,762.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	41,674	8.120	338,392.880	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	9.000	665,928.000	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	209,231	2.330	487,508.230	
ニュージーランド・ドル 小計		443,442		1,918,591.110 (166,034,875)	
ノルウェー・ クローネ	DNB ASA	98,819	111.000	10,968,909.000	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	27.700	2,965,617.400	
	TELENOR ASA	65,096	145.000	9,438,920.000	
	SUBSEA 7 SA	22,609	120.000	2,713,080.000	
	ORKLA ASA	86,098	46.260	3,982,893.480	
	STATOIL ASA	117,819	152.000	17,908,488.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	21,131	262.000	5,536,322.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	18,936	106.400	2,014,790.400	
	SEADRILL LTD	38,772	245.800	9,530,157.600	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	21,678	115.800	2,510,312.400	
ノルウェー・クローネ 小計		598,020		67,569,490.280 (1,140,572,996)	
ユーロ	CRH PLC	73,961	19.775	1,462,578.770	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	50.510	717,999.650	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.314	760,772.380	
	UMICORE	13,643	32.565	444,284.290	
	AIR LIQUIDE	32,433	98.570	3,196,920.810	
	AIRBUS GROUP NV	62,297	55.780	3,474,926.660	
	AXA	177,702	20.150	3,580,695.300	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,954	12.285	478,549.890	
	ADIDAS AG	20,732	89.040	1,845,977.280	
	ASSICURAZIONI GENERALI	112,448	17.080	1,920,611.840	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	157,125	1.234	193,892.250	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	40,778	16.720	681,808.160	
	DANONE	57,035	51.320	2,927,036.200	
	SAFRAN SA	28,086	51.530	1,447,271.580	
	INTESA SANPAOLO	1,125,068	1.932	2,173,631.370	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,402	84.150	2,894,928.300	
	ACCOR SA	17,313	34.575	598,596.970	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	9,683	37.905	367,034.110	
	BOUYGUES	22,659	28.970	656,431.230	
	BNP PARIBAS	99,978	57.950	5,793,725.100	
	REED ELSEVIER NV	68,686	15.435	1,060,168.410	
	THALES SA	8,128	47.195	383,600.960	
	CAP GEMINI SA	15,406	51.550	794,179.300	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	83.920	551,102.640	
	CHRISTIAN DIOR	5,133	131.250	673,706.250	
	CGG	16,618	12.665	210,466.970	
	ALCATEL-LUCENT	298,978	3.271	977,957.030	
	UNICREDIT SPA	437,673	6.005	2,628,226.360	
	NATIXIS	102,266	4.734	484,127.240	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,919	56.910	905,950.290	
	DELHAIZE GROUP	12,505	45.155	564,663.270	
	COMMERZBANK AG	96,311	13.685	1,318,016.030	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	13,555	114.400	1,550,692.000	
	UNITED INTERNET	9,260	32.005	296,366.300	
FUCHS PETROLUB SE PREF	4,411	73.610	324,693.710		
PUBLICIS GROUPE	17,067	65.130	1,111,573.710		
MAN SE	3,396	89.550	304,111.800		
IBERDROLA SA	492,622	4.636	2,283,795.590		
ENI SPA	253,048	17.330	4,385,321.840		
IMERYS SA	4,401	63.000	277,263.000		
JERONIMO MARTINS	33,291	14.000	466,074.000		
KBC GROUPE	24,972	45.200	1,128,734.400		
LAFARGE SA	19,853	56.120	1,114,150.360		
HANNOVER RUECK SE	5,730	60.220	345,060.600		

WARTSILA OYJ	21,069	38.940	820,426.860	
L'OREAL	25,480	122.850	3,130,218.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	25,343	126.350	3,202,088.050	
LAGARDERE S.C.A.	13,927	27.070	377,003.890	
GEA GROUP AG	20,171	34.650	698,925.150	
MEDIOBANCA SPA	55,752	6.900	384,688.800	
MICHELIN(CGDE)-B	20,134	78.770	1,585,955.180	
CONTINENTAL AG	10,728	159.950	1,715,943.600	
DEUTSCHE POST AG-REG	90,507	25.990	2,352,276.930	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	34.030	319,847.970	
AXEL SPRINGER SE	6,021	49.320	296,955.720	
OMV AG	15,010	35.670	535,406.700	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA- REG	67,989	3.529	239,933.180	
PERNOD-RICARD	20,773	81.510	1,693,207.230	
PIRELLI & C	30,073	11.660	350,651.180	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	14,295	77.990	1,114,867.050	
RENAULT SA	21,020	64.770	1,361,465.400	
REPSOL SA	86,855	18.910	1,642,428.050	
REMY COINTREAU	3,877	59.050	228,936.850	
MERCK KGAA	6,349	130.000	825,370.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	82,955	76.090	6,312,045.950	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,154	41.130	1,816,054.020	
SAIPEM	35,323	16.380	578,590.740	
RWE AG	50,913	25.525	1,299,554.320	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	19,633	38.220	750,373.260	
SOCIETE GENERALE-A	73,735	44.945	3,314,019.570	
VINCI S.A.	47,191	48.200	2,274,606.200	
SODEXO	9,625	75.260	724,377.500	
SOLVAY SA	5,471	108.200	591,962.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	55,445	63.250	3,506,896.250	
VIVENDI SA	123,403	19.020	2,347,125.060	
SAP AG	95,146	61.210	5,823,886.660	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	9,593	69.160	663,451.880	
TELEFONICA S.A	419,237	12.260	5,139,845.620	
TOTAL SA	217,116	43.055	9,347,929.380	
VALLOUREC	11,847	40.345	477,967.210	
VALEO	8,400	85.000	714,000.000	
E.ON SE	185,310	13.130	2,433,120.300	
VOEST-ALPINE AG	9,875	35.610	351,648.750	
ZODIAC AEROSPACE	3,509	129.800	455,468.200	
HENKEL AG & CO KGAA	14,673	74.160	1,088,149.680	
METRO AG	11,655	35.850	417,831.750	
SIEMENS AG-REG	80,638	98.520	7,944,455.760	
UPM-KYMMENE OYJ	46,308	12.880	596,447.040	



ING GROEP NV-CVA	388,916	10.595	4,120,565.020	
BAYER AG	84,009	98.220	8,251,363.980	
STORA ENSO OYJ-R SHS	67,549	7.585	512,359.160	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,679	81.450	1,358,504.550	
DAIMLER AG	97,645	62.870	6,138,941.150	
BASF SE	94,899	77.490	7,353,723.510	
CELESIO AG	8,447	24.165	204,121.750	
BEIERSDORF AG	10,562	73.530	776,623.860	
HOCHTIEF AG	1,935	63.930	123,704.550	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,234	57.800	764,925.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	21,622	51.600	1,115,695.200	
ORANGE	192,070	9.526	1,829,658.820	
SAMPO OYJ-A SHS	46,036	35.450	1,631,976.200	
RANDSTAD HOLDINGS	13,985	48.550	678,971.750	
ALLIANZ SE	46,088	128.500	5,922,308.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	203,441	2.852	580,213.730	
KONINKLIJKE AHOLD NV	101,654	13.120	1,333,700.480	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	19,236	34.150	656,909.400	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	17.600	480,462.400	
ERSTE GROUP BANK AG	30,671	29.000	889,459.000	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	18,428	152.600	2,812,112.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	102,748	12.700	1,304,899.600	
SOCIETE BIC SA	3,322	84.930	282,137.460	
DASSAULT SYSTEMES SA	5,838	86.310	503,877.780	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,046	26.855	538,335.330	
HEINEKEN NV	21,379	47.120	1,007,378.480	
AKZO NOBEL	24,058	56.030	1,347,969.740	
ASML HOLDING NV	37,808	66.440	2,511,963.520	
AEGON NV	167,051	6.807	1,137,116.150	
VOLKSWAGEN AG	3,623	196.800	713,006.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,120	202.600	2,860,712.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	592,047	9.492	5,619,710.120	
KERING	7,231	145.350	1,051,025.850	
CNP ASSURANCES	22,463	15.350	344,807.050	
FORTUM OYJ	43,978	16.500	725,637.000	
AGEAS	19,877	32.780	651,568.060	
UCB SA	10,367	52.090	540,017.030	
THYSSENKRUPP AG	44,483	18.210	810,035.430	
UNILEVER NV-CVA	166,176	28.475	4,731,861.600	
CARREFOUR SA	61,756	28.500	1,760,046.000	
GAS NATURAL SDG SA	36,738	18.240	670,101.120	
ATOS	6,025	66.480	400,542.000	
NOKIA OYJ	391,422	5.960	2,332,875.120	
POHJOLA BANK PLC	9,831	15.000	147,465.000	

KONINKLIJKE PHILIPS NV	100,900	27.670	2,791,903.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,008	21.260	723,010.080	
SANOFI	121,234	73.200	8,874,328.800	
IMMOFINANZ AG	131,110	3.474	455,476.140	
STMICROELECTRONICS NV	80,884	5.763	466,134.490	
ELISA OYJ	13,898	19.500	271,011.000	
BANCO SANTANDER SA	1,164,908	6.809	7,931,858.570	
METSO OYJ	10,879	24.400	265,447.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	11,690	52.680	615,829.200	
QIAGEN N.V.	27,019	17.825	481,613.670	
LINDE AG	19,271	147.400	2,840,545.400	
FIAT SPA	92,315	6.790	626,818.850	
DEUTSCHE BANK AG-REG	102,711	38.565	3,961,049.710	
BMW VORZUG	6,146	62.850	386,276.100	
K & S	18,738	23.220	435,096.360	
SUEDZUCKER AG	11,866	21.590	256,186.940	
ENEL SPA	672,106	3.304	2,220,638.220	
COLRUYT NV	7,116	40.715	289,727.940	
VOPAK (KON.)	8,976	41.300	370,708.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	297,815	12.205	3,634,832.070	
BANCO POPULAR ESPANOL	144,093	5.559	801,012.980	
FINMECCANICA SPA	55,583	5.765	320,435.990	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	103,908	7.667	796,662.630	
KONINKLIJKE KPN NV	366,685	2.638	967,315.030	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.288	210,477.690	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,044	61.790	1,238,518.760	
BANCO SABADELL	344,219	2.132	733,874.900	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,358	67.450	631,197.100	
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VPR	516	0.001	0.510	
FRAPORT AG	3,149	55.100	173,509.900	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	44.420	355,981.880	
INDITEX	22,630	117.900	2,668,077.000	
JC DECAUX INTERNATIONAL	8,589	31.135	267,418.510	
ANDRITZ AG	9,129	43.400	396,198.600	
MAPFRE SA	80,219	3.416	274,028.100	
ESSILOR INTL	19,980	81.400	1,626,372.000	
SNAM SPA	225,511	4.042	911,515.460	
CREDIT AGRICOLE SA	111,051	10.200	1,132,720.200	
ENAGAS	15,332	19.710	302,193.720	
WENDEL	4,087	106.000	433,222.000	
TENARIS SA	46,257	15.810	731,323.170	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	5.530	414,495.620	
TELECOM ITALIA SPA	1,035,863	0.806	834,905.570	
TELECOM ITALIA-RNC	792,074	0.630	499,006.620	
ATLANTIA SPA	38,919	17.180	668,628.420	

ILIAD SA	2,821	162.100	457,284.100	
BELGACOM SA	13,498	21.280	287,237.440	
SES FDR	28,786	23.470	675,607.420	
TERNA SPA	179,290	3.636	651,898.440	
GRIFOLS SA	17,550	37.935	665,759.250	
FERROVIAL SA	45,760	14.515	664,206.400	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	47.390	324,905.840	
SKY DEUTSCHLAND AG	45,911	7.502	344,424.320	
EXOR SPA	9,585	29.600	283,716.000	
NESTE OIL OYJ	10,692	14.620	156,317.040	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	26.600	242,033.400	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.000	0.000	
FUGRO CERT	7,283	42.605	310,292.210	
KONE OYJ	31,230	32.230	1,006,542.900	
GDF SUEZ	136,591	16.770	2,290,631.070	
ALSTOM	22,916	26.195	600,284.620	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	43.295	217,557.370	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	22.035	384,510.750	
ELECTRICITE DE FRANCE	23,911	24.980	597,296.780	
DEUTSCHE WOHNEN AG	32,216	14.410	464,232.560	
ARKEMA SA	5,658	80.540	455,695.320	
LEGRAND SA	27,260	38.550	1,050,873.000	
ADP	2,540	82.810	210,337.400	
ORION OYJ	8,051	20.530	165,287.030	
RTL GROUP SA	3,848	96.930	372,986.640	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	11.955	406,685.190	
SCOR SE	14,425	25.640	369,857.000	
REXEL SA	20,799	19.965	415,252.030	
PRYSMIAN SPA	14,445	18.620	268,965.900	
CAIXABANK	156,629	4.313	675,540.870	
BUREAU VERITAS SA	24,211	21.045	509,520.490	
GROUPE EUROTUNNEL SA	46,533	8.400	390,877.200	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	13.320	302,004.360	
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	42,576	30.560	1,301,122.560	
TNT EXPRESS NV W/I	34,234	6.849	234,468.660	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,019	96.010	193,844.190	
ENEL GREEN POWER SPA	224,723	1.885	423,602.850	
BRENTAG AG	5,161	128.450	662,930.450	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	119,317	5.166	616,391.620	

	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	6.575	385,341.020	
	DELTA LLOYD NV	19,898	18.940	376,868.120	
	EDENRED	18,682	23.700	442,763.400	
	ZIGGO NV	16,833	33.800	568,955.400	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	31,777	6.145	195,269.660	
	HUGO BOSS AG -ORD	4,016	97.740	392,523.840	
	OSRAM LICHT AG	9,503	44.000	418,132.000	
	GEMALTO	8,626	80.200	691,805.200	
	OCI NV	10,713	33.400	357,814.200	
	CNH INDUSTRIAL NV	109,614	8.420	922,949.880	
	REPSOL SA - RTS	95,127	0.506	48,134.260	
	IBERDROLA SA - RTS	492,622	0.129	63,548.230	
ユーロ 小計		21,101,265		300,936,179.530 (42,495,197,912)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	36,200	70.000	2,534,000.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	23.950	5,221,100.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	31.600	3,528,456.000	
	CLP HOLDINGS LTD	204,000	60.200	12,280,800.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	114,000	17.080	1,947,120.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	10.600	5,643,440.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	136,000	120.100	16,333,600.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	47.200	2,312,800.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	108,200	126.900	13,730,580.000	
	MTR CORP	165,500	28.550	4,725,025.000	
	FIRST PACIFIC CO	223,500	8.300	1,855,050.000	
	HANG SENG BANK LTD	85,500	122.500	10,473,750.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	111,700	44.500	4,970,650.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	130,500	59.150	7,719,075.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	163,750	59.600	9,759,500.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	564,740	17.160	9,690,938.400	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	222,000	106.400	23,620,800.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	88,000	33.300	2,930,400.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	208,000	77.050	16,026,400.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	88,000	26.150	2,301,200.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	451,500	24.300	10,971,450.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	86,000	24.500	2,107,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	430,700	9.920	4,272,544.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	14.960	3,440,800.000	
	SINO LAND CO	257,400	10.700	2,754,180.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	164,000	96.900	15,891,600.000	

	SWIRE PACIFIC LTD A	73,500	88.150	6,479,025.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	107,000	36.100	3,862,700.000	
	SJM HOLDINGS LTD	196,000	25.350	4,968,600.000	
	WYNN MACAU LTD	169,600	36.700	6,224,320.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	89,600	33.850	3,032,960.000	
	AIA GROUP LTD	1,241,200	37.200	46,172,640.000	
	SANDS CHINA LTD	240,000	63.500	15,240,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	20.400	3,329,280.000	
香港・ドル	小計	7,460,350		286,351,783.400 (3,814,205,755)	
合計		112,402,075		298,535,209,958 (298,535,209,958)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成26年1月14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	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	235,579.000	467,624.310	
		DEXUS PROPERTY GROUP	553,747.000	575,896.880	
		FEDERATION CENTRES	146,114.000	346,290.180	
		GOODMAN GROUP	155,160.000	740,113.200	
		GPT GROUP	198,416.000	714,297.600	
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	520,614.600	
		MIRVAC GROUP	399,690.000	689,465.250	
		STOCKLAND	210,736.000	796,582.080	
		WESTFIELD GROUP	201,312.000	2,039,290.560	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	326,593.000	996,108.650	
	オーストラリア・ドル	小計	2,474,207.000	7,886,283.310 (736,263,410)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.000	642,116.020	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	308,060.000	
CAPITAMALL TRUST		294,800.000	549,802.000		
シンガポール・ドル	小計	801,706.000	1,499,978.020 (122,428,206)		
投資信託受益証券	合計		3,275,913	858,691,616 (858,691,616)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	45,817.000	936,957.650	
		AMERICAN TOWER CORP	40,012.000	3,286,585.680	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	88,038.000	914,714.820	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,610.000	1,402,836.300	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,442.000	1,703,391.200	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	369,872.250	
		COLE REAL ESTATE INVESTMENT INC	50,958.000	725,641.920	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,517.000	779,108.570	
		DUKE REALTY TRUST	38,117.000	568,705.640	
		EQUITY RESIDENTIAL	37,715.000	2,007,192.300	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,764.000	809,552.280	

	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,720.000	951,686.400	
	HCP INC	44,698.000	1,703,440.780	
	HEALTH CARE REIT INC	30,578.000	1,710,839.100	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	80,629.000	1,538,401.320	
	KIMCO REALTY	32,980.000	667,515.200	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.000	557,700.000	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	586,419.840	
	PROLOGIS INC	53,944.000	1,982,442.000	
	PUBLIC STORAGE	14,278.000	2,198,240.880	
	RAYONIER INC	10,834.000	449,936.020	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	641,778.690	
	REGENCY CENTERS CORP	10,144.000	476,260.800	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,510.000	4,889,406.700	
	SL GREEN	10,737.000	989,414.550	
	THE MACERICH COMPANY	15,776.000	922,264.960	
	UDR INC	28,307.000	661,251.520	
	VENTAS INC	31,176.000	1,867,442.400	
	VORNADO REALTY TRUST	16,326.000	1,484,686.440	
	WEYERHAEUSER CO	60,041.000	1,836,053.780	
アメリカ・ドル 小計		923,316.000	39,619,739.990 (4,093,511,536)	
イギリス・債券	BRITISH LAND CO PLC	82,388.000	531,814.540	
	HAMMERSON PLC	68,046.000	344,993.220	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	279,359.850	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	85,101.000	847,180.450	
	SEGRO PLC	87,111.000	298,529.390	
イギリス・債券 小計		411,756.000	2,301,877.450 (389,984,078)	
カナダ・ドル	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	24,845.000	502,117.450	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	209,119.190	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	399,932.680	
カナダ・ドル 小計		50,340.000	1,111,169.320 (105,438,857)	
ユーロ	CORIO NV	7,710.000	252,309.750	
	GECINA SA	2,977.000	286,566.020	
	ICADE	3,001.000	198,066.000	
	KLEPIERRE	13,172.000	443,896.400	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	9,344.000	1,748,262.400	
ユーロ 小計		36,204.000	2,929,100.570 (413,618,291)	
香港・ドル	LINK REIT/THE	240,500.000	8,489,650.000	
香港・ドル 小計		240,500.000	8,489,650.000 (113,082,138)	
投資証券 合計		1,662,116	5,115,634,900 (5,115,634,900)	
合計			5,974,326,516	



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 581銘柄	56.92%	-%	-%	59.30%
	投資証券 30銘柄	-%	-%	1.32%	
イギリス・ポンド	株式 101銘柄	9.68%	-%	-%	9.99%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
イスラエル・シケル	株式 5銘柄	0.20%	-%	-%	0.21%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	3.13%	-%	-%	3.42%
	投資信託 受益証券 10銘柄	-%	0.24%	-%	
カナダ・ドル	株式 91銘柄	4.33%	-%	-%	4.45%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.03%	
シンガポール・ドル	株式 24銘柄	0.59%	-%	-%	0.64%
	投資信託 受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	4.08%	-%	-%	4.15%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.45%	-%	-%	1.47%
デンマーク・クローネ	株式 10銘柄	0.55%	-%	-%	0.56%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.05%	-%	-%	0.05%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.37%	-%	-%	0.37%
ユーロ	株式 230銘柄	13.71%	-%	-%	14.09%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 34銘柄	1.23%	-%	-%	1.29%
	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。



## 「外国債券パッシブ・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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,694,113,013	6,230,132,062
コール・ローン		215,455,666	237,609,652
国債証券		391,575,850,371	379,095,794,508
派生商品評価勘定		2,611	155,013
未収利息		4,422,869,430	4,376,904,703
前払費用		78,430,631	138,879,680
流動資産合計		398,986,721,722	390,079,475,618
資産合計		398,986,721,722	390,079,475,618
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,627,128	-
未払解約金		104,449,000	93,908,000
流動負債合計		106,076,128	93,908,000
負債合計		106,076,128	93,908,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	286,407,723,256	238,565,930,026
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		112,472,922,338	151,419,637,592
元本等合計		398,880,645,594	389,985,567,618
純資産合計		398,880,645,594	389,985,567,618
負債純資産合計		398,986,721,722	390,079,475,618

## 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	<p>国債証券</p> <p>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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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25年1月11日現在	平成26年1月14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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	320,315,770,753円  20,040,695,235円 53,948,742,732円	286,407,723,256円  16,750,273,193円 64,592,066,423円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	1,850,163,418円	3,039,043,112円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	4,311,702,246円	4,192,829,760円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	343,786,882円	331,588,356円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	1,211,058,264円	1,211,540,212円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,225,792,520円	1,297,002,520円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	323,665,802円	305,504,835円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	655,695,333円	657,173,695円

D I A M D C バラン ス70インデックスファ ンド	415,250,363円	466,569,731円
マネックス資産設計ファ ンド<隔月分配型>	121,221,242円	44,234,392円
マネックス資産設計ファ ンド<育成型>	1,496,007,439円	542,828,765円
マネックス資産設計ファ ンド エポリューション	8,724,668円	10,923,133円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国10)	12,613円	2,338,758円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国20)	16,817円	2,890,778円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国30)	21,021円	6,126,264円
クルーズコントロール D I A M 8資産バラン スファンドN<DC年金 >	8,741,221円 - 円	117,498,202円 186,505円
D I A Mパッシブ資産分 散ファンド	4,451,690,602円	3,440,686,045円
D I A M為替フルヘッジ 型外国債券パッシブ私募 ファンド(適格機関投資 家向け)	7,131,480,399円	6,098,970,874円
D I A M外国債券パッシ ブファンド(適格機関投 資家向け)	5,734,231,221円	5,014,585,495円
外国債券パッシブファン ド(適格機関投資家限 定)	945,275,864円	1,257,533,068円
D I A Mワールドバラン ス25VA(適格機関投 資家限定)	189,689,387円	161,634,689円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	41,361,461,845円	25,769,761,023円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,419,766,409円	1,712,617,113円
D I A M国際分散バラン スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	415,543,665円	321,639,201円
D I A M国際分散バラン スファンド50VA(適 格機関投資家限定)	677,038,410円	458,934,133円
D I A M国内重視バラン スファンド30VA(適 格機関投資家限定)	174,534,936円	118,123,204円

D I A M国内重視バ ランスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	82,504,720円	65,337,270円
D I A M世界バラン スファンド4 0 V A (適格 機関投資家限定)	25,235,045,884円	23,877,040,685円
D I A M世界バラン スファンド5 0 V A (適格 機関投資家限定)	5,574,133,390円	5,291,240,792円
D I A Mバランスマ ンド2 5 V A (適格機関 投資家限定)	9,751,296,935円	8,797,892,655円
D I A Mバランスマ ンド3 7 . 5 V A (適格機 関投資家限定)	4,469,007,110円	4,175,851,723円
D I A Mバランスマ ンド5 0 V A (適格機関 投資家限定)	6,375,815,282円	6,207,298,430円
D I A Mグローバル・ アセット・バランスマ (適格機関投資家限定)	2,394,947,927円	1,830,825,882円
D I A Mグローバル・ アセット・バランスマ (適格機関投資家限定)	7,335,988,361円	6,428,666,026円
D I A M アクサ グ ローバル バランスマ ンド3 0 V A (適格機関 投資家限定)	8,363,346,865円	6,743,216,078円
D I A M世界アセ ットバランスマン ドV A (適格機関 投資家向け)	43,960,553,746円	32,345,707,774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)	191,554,608円	110,138,149円
D I A M世界バラン スファンド5 5 V A (適 格機関投資家限定)	5,767,871,794円	4,867,304,630円
D I A Mアイエヌ ジー世界バラン スマンド3 5 V A (適 格機関投資家限 定)	14,182,632,850円	14,012,489,632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)	263,993,496円	205,099,524円
D I A M世界アセ ットバランスマ ンド2 V A (適格機 関投資家限定)	22,830,229,976円	19,837,454,276円
D I A M世界アセ ットバランスマ ンド3 V A (適格機 関投資家限定)	28,194,161,543円	24,496,839,166円
D I A Mバランスマ ンド3 0 V A (適格 機関投資家限 定)	664,615,246円	130,809円

D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	223,959円	305,404,315円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	140,474円	91,450,251円
D I A M世界アセットバ ランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	24,532,037,030円	21,701,242,973円
D I A M世界バランス2 5VA(適格機関投資家 限定)	237,498,841円	202,670,862円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限 定)	527,215,625円	376,321,065円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	207,824円	13,410,530円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	127,183円	132,666円
計	286,407,723,256円	238,565,930,026円
2. 受益権の総数	286,407,723,256口	238,565,930,026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24年1月12日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14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、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。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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 「(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。 (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。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25年1月11日現在	平成26年1月14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)
国債証券	6,527,210,258	6,031,225,829
合計	6,527,210,258	6,031,225,829

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成24年2月22日から平成25年1月11日まで及び平成25年2月22日から平成26年1月14日まで)に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成25年1月11日 現在				平成26年1月14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  ユーロ	89,283,643	-	90,908,160	1,624,517	152,792,213	-	152,637,200	155,013
合計	89,283,643	-	90,908,160	1,624,517	152,792,213	-	152,637,200	155,013

## （注）時価の算定方法

- 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。
- 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。
- 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。

## （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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3927円 (13,927円)	1.6347円 (16,347円)



## 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26年1月14日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 12/15/15	11,000,000.000	10,980,640.000	
		US T N/B 0.375 01/15/16	15,000,000.000	15,002,250.000	
		US T N/B 0.375 06/15/15	20,000,000.000	20,046,000.000	
		US T N/B 0.5 07/31/17	15,000,000.000	14,732,700.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	20,000,000.000	19,797,600.000	
		US T N/B 0.625 07/15/16	38,000,000.000	38,081,320.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	11,500,000.000	11,256,430.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	19,000,000.000	18,663,700.000	
		US T N/B 1.0 05/31/18	15,000,000.000	14,756,250.000	
		US T N/B 1.0 08/31/16	10,000,000.000	10,105,800.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	7,000,000.000	6,681,150.000	
		US T N/B 1.0 09/30/16	6,000,000.000	6,059,280.000	
		US T N/B 1.0 10/31/16	8,000,000.000	8,073,120.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	9,000,000.000	8,536,590.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	8,000,000.000	7,741,200.000	
		US T N/B 1.25 08/31/15	30,000,000.000	30,482,700.000	
		US T N/B 1.25 09/30/15	23,000,000.000	23,378,120.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	13,000,000.000	12,550,070.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	10,000,000.000	9,870,300.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	15,500,000.000	14,846,055.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	17,500,000.000	17,391,850.000	
		US T N/B 1.375 11/30/15	17,000,000.000	17,329,970.000	
		US T N/B 1.375 11/30/18	25,000,000.000	24,795,750.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	3,000,000.000	2,765,850.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	10,500,000.000	9,623,880.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	8,000,000.000	7,500,000.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	19,000,000.000	17,404,190.000	
		US T N/B 1.75 05/31/16	20,500,000.000	21,106,185.000	
		US T N/B 1.75 07/31/15	15,000,000.000	15,348,600.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,826,060.000	
		US T N/B 1.875 06/30/15	15,000,000.000	15,359,700.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	16,000,000.000	15,783,040.000	
		US T N/B 1.875 08/31/17	8,000,000.000	8,234,960.000	
		US T N/B 1.875 09/30/17	18,000,000.000	18,517,500.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	12,000,000.000	11,542,440.000			
US T N/B 2.0 02/15/23	16,000,000.000	15,068,640.000			
US T N/B 2.0 04/30/16	18,000,000.000	18,630,000.000			
US T N/B 2.0 09/30/20	16,000,000.000	15,817,440.000			
US T N/B 2.0 11/15/21	3,000,000.000	2,900,850.000			
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,799,690.000			

US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,994,120.000	
US T N/B 2.25 01/31/15	25,000,000.000	25,546,750.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	17,000,000.000	17,701,250.000	
US T N/B 2.375 02/28/15	23,000,000.000	23,566,720.000	
US T N/B 2.375 03/31/16	20,000,000.000	20,857,000.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	6,000,000.000	6,252,600.000	
US T N/B 2.5 03/31/15	30,000,000.000	30,835,500.000	
US T N/B 2.5 04/30/15	20,000,000.000	20,595,200.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	8,000,000.000	8,418,720.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	16,000,000.000	15,608,640.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	17,019,420.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,166,860.000	
US T N/B 2.625 12/31/14	25,000,000.000	25,594,500.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	11,000,000.000	11,605,000.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	6,000,000.000	4,917,600.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	6,900,000.000	5,642,337.000	
US T N/B 2.75 11/30/16	14,000,000.000	14,816,480.000	
US T N/B 2.875 03/31/18	10,000,000.000	10,647,600.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	13,500,000.000	11,308,275.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	20,000,000.000	21,346,800.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	7,000,000.000	6,069,210.000	
US T N/B 3.0 09/30/16	20,000,000.000	21,276,400.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	7,900,000.000	7,038,979.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	11,500,000.000	10,173,820.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	18,000,000.000	19,306,260.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,950,040.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	16,000,000.000	16,878,720.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	5,000,000.000	4,460,900.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	12,000,000.000	12,916,800.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	25,000,000.000	26,674,750.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	20,000,000.000	21,486,600.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,340,280.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	14,000,000.000	15,258,880.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	5,000,000.000	4,851,550.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	15,248,940.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	18,000,000.000	19,763,280.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	10,500,000.000	11,458,125.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	9,000,000.000	9,886,230.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	10,000,000.000	9,742,900.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	5,000,000.000	5,026,150.000	
US T N/B 3.75 11/15/18	10,000,000.000	11,039,800.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	2,800,000.000	2,792,328.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	8,000,000.000	8,863,120.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	5,200,000.000	5,361,668.000	
US T N/B 4.0 02/15/15	20,000,000.000	20,832,000.000	
US T N/B 4.0 08/15/18	12,000,000.000	13,375,200.000	
US T N/B 4.125 05/15/15	18,000,000.000	18,939,240.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	3,000,000.000	3,292,950.000	
US T N/B 4.25 08/15/15	15,000,000.000	15,949,800.000	

US T N/B 4.25 11/15/17	9,000,000.000	10,053,900.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	4,700,000.000	5,153,832.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	2,500,000.000	2,796,075.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	4,600,000.000	5,146,250.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	3,000,000.000	3,352,590.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	3,100,000.000	3,468,342.000	
US T N/B 4.5 02/15/16	16,000,000.000	17,369,280.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	4,400,000.000	5,022,864.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,500,000.000	1,709,880.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	3,200,000.000	3,650,496.000	
US T N/B 4.5 11/15/15	18,000,000.000	19,373,040.000	
US T N/B 4.625 02/15/17	14,000,000.000	15,632,960.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	6,000,000.000	6,975,180.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	5,500,000.000	6,515,740.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	15,000,000.000	16,987,500.000	
US T N/B 4.875 08/15/16	17,000,000.000	18,882,580.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,700,000.000	2,076,244.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	2,500,000.000	3,069,725.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	3,000,000.000	3,682,500.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	4,000,000.000	5,012,480.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,000,000.000	1,257,180.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	4,000,000.000	5,191,840.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,800,000.000	3,711,736.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	3,000,000.000	4,090,290.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	5,000,000.000	6,508,000.000	
US T N/B 7.25 05/15/16	10,000,000.000	11,572,200.000	
US T N/B 7.5 11/15/16	4,000,000.000	4,765,920.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	8,422,020.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	5,365,920.000	
US T N/B 8.75 05/15/17	7,000,000.000	8,804,670.000	
US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	5,433,880.000	
アメリカ・ドル 小計	1,403,800,000.000 (145,040,616,000)	1,452,139,276.000 (150,035,029,996)	
イギリス・ポンド			
UK TREASURY 1.0 09/07/17	7,100,000.000	7,017,640.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	4,100,000.000	4,023,330.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/17	3,800,000.000	3,879,800.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	6,700,000.000	6,225,640.000	
UK TREASURY 2.0 01/22/16	7,000,000.000	7,189,700.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,050,000.000	2,901,953.000	
UK TREASURY 2.75 01/22/15	3,700,000.000	3,787,690.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,600,000.000	1,508,960.000	

UK TREASURY 3.5 07/22/68	600,000.000	599,640.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	4,000,000.000	4,197,600.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	5,000,000.000	5,462,500.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	5,700,000.000	6,227,820.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	5,000,000.000	5,449,950.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	4,700,000.000	5,261,180.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	3,900,000.000	4,320,810.000	
UK TREASURY 4.0 09/07/16	6,600,000.000	7,147,800.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	5,000,000.000	5,598,500.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	5,200,000.000	5,817,760.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	3,000,000.000	3,374,700.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,300,000.000	3,688,410.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	4,300,000.000	4,845,240.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	5,000,000.000	5,709,000.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	4,000,000.000	4,611,600.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	4,200,000.000	4,913,160.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	5,500,000.000	6,210,050.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	4,500,000.000	5,204,250.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	4,800,000.000	5,662,080.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	4,800,000.000	5,524,320.000	
UK TREASURY 4.75 09/07/15	6,000,000.000	6,418,800.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	4,600,000.000	5,439,960.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	4,500,000.000	5,445,900.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/18	5,500,000.000	6,274,950.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	4,450,000.000	5,307,960.000	

	UK TREASURY 6.0 12/07/28	3,000,000.000	3,985,800.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	3,500,000.000	4,827,550.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	2,000,000.000	2,284,200.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	2,500,000.000	3,157,750.000	
イギリス・ボンド 小計		162,200,000.000 (27,479,924,000)	179,503,953.000 (30,411,559,717)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	5,100,000.000	5,327,103.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	4,100,000.000	4,438,824.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	4,800,000.000	5,371,872.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	2,721,552.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,300,000.000	2,084,720.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,800,000.000	1,531,098.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,100,000.000	1,141,602.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	450,000.000	433,845.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,000,000.000	3,087,240.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	4,950,000.000	5,173,393.500	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/15	1,800,000.000	1,864,620.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	5,100,000.000	5,531,001.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	5,100,000.000	5,635,857.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,500,000.000	5,047,920.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	7,500,000.000	8,164,050.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	4,100,000.000	4,287,698.000	
オーストラリア・ドル 小計		58,800,000.000 (5,489,568,000)	61,842,395.500 (5,773,606,044)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,584,090.000	
	CANADA 1.0 11/01/15	4,100,000.000	4,099,508.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,700,000.000	1,677,985.000	
	CANADA 1.25 09/01/18	2,050,000.000	2,007,360.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	2,000,000.000	2,016,180.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,900,000.000	3,563,625.000	
	CANADA 1.5 08/01/15	2,000,000.000	2,016,040.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	3,000,000.000	3,008,760.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,200,000.000	2,170,190.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,400,000.000	3,489,046.000	

	CANADA 2.75 09/01/16	4,000,000.000	4,165,440.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	6,000,000.000	6,220,260.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	3,050,000.000	3,275,791.500	
	CANADA 3.5 06/01/20	3,000,000.000	3,268,440.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,500,000.000	3,784,025.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	5,500,000.000	6,037,130.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	8,500,000.000	9,087,265.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	3,500,000.000	3,814,790.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	3,900,000.000	4,554,420.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	3,500,000.000	3,893,190.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	8,000,000.000	8,385,920.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	3,400,000.000	4,506,020.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	2,900,000.000	3,934,256.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	3,200,000.000	4,489,728.000	
カナダ・ドル 小計		87,300,000.000 (8,283,897,000)	95,049,459.500 (9,019,243,212)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.75 04/01/42	700,000.000	666,211.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	300,000.000	308,928.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	2,400,000.000	2,488,680.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	800,000.000	788,544.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	300,000.000	310,041.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,100,000.000	2,224,341.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,700,000.000	1,830,951.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	300,000.000	316,122.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,400,000.000	1,495,354.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	2,100,000.000	2,282,595.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	3,000,000.000	3,373,170.000	
シンガポール・ドル 小計		15,100,000.000 (1,232,462,000)	16,084,937.000 (1,312,852,558)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	21,000,000.000	19,402,950.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	13,000,000.000	13,631,150.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	10,600,000.000	11,338,926.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	16,000,000.000	17,576,320.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	12,000,000.000	13,018,320.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	20,500,000.000	23,088,945.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	18,000,000.000	19,042,020.000	
SWEDEN 5.0 12/01/20	12,100,000.000	14,420,780.000		
スウェーデン・クローナ 小計		123,200,000.000 (1,957,648,000)	131,519,411.000 (2,089,843,441)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	7,500,000.000	7,245,000.000	
	DENMARK 2.5 11/15/16	2,000,000.000	2,125,500.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	25,500,000.000	28,154,550.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	24,000,000.000	25,715,040.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	14,100,000.000	15,958,380.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	23,600,000.000	27,465,680.000	

	DENMARK 4.5 11/15/39	30,200,000.000	40,468,000.000	
	DENMARK 7.0 11/10/24	8,000,000.000	11,986,400.000	
デンマーク・クローネ 小計		134,900,000.000 (2,552,308,000)	159,118,550.000 (3,010,522,966)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 2.0 05/24/23	9,300,000.000	8,619,984.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	14,000,000.000	15,005,200.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	14,600,000.000	15,766,540.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	13,500,000.000	15,008,625.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	18,300,000.000	19,173,825.000	
ノルウェー・クローネ 小計		69,700,000.000 (1,176,536,000)	73,574,174.000 (1,241,932,057)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.75 04/25/18	2,800,000.000	2,830,380.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,400,000.000	3,302,930.000	
	POLAND 4.75 10/25/16	10,300,000.000	10,754,230.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	7,000,000.000	7,310,450.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	12,000,000.000	12,814,680.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	9,000,000.000	9,642,600.000	
	POLAND 5.5 04/25/15	7,000,000.000	7,243,600.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	9,000,000.000	9,779,400.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,000,000.000	3,337,140.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	7,400,000.000	8,162,274.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	5,500,000.000	6,048,240.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	11,400,000.000	12,086,280.000	
ポーランド・ズロチ 小計		87,800,000.000 (2,979,932,000)	93,312,204.000 (3,167,016,204)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,753,950.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	5,700,000.000	5,135,472.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	7,000,000.000	7,067,970.000	
	MALAYSIA 3.835 08/12/15	10,000,000.000	10,120,200.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	2,000,000.000	1,875,220.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,039,280.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	10,000,000.000	10,195,000.000	
	MALAYSIA 4.262 09/15/16	7,000,000.000	7,183,610.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	9,000,000.000	9,276,930.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	2,000,000.000	2,139,160.000	
マレーシア・リングgit 小計		61,700,000.000 (1,949,720,000)	61,786,792.000 (1,952,462,627)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	20,000,000.000	25,633,400.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	55,000,000.000	70,481,400.000	
	MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16	19,500,000.000	20,511,270.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	22,000,000.000	22,652,080.000	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/15/16	50,000,000.000	53,866,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	20,000,000.000	20,559,400.000	

	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	70,000,000.000	76,797,700.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	58,000,000.000	65,026,120.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/17/15	30,000,000.000	32,262,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	52,000,000.000	59,394,920.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	29,000,000.000	32,385,460.000	
	メキシコ・ペソ 小計	425,500,000.000 (3,361,450,000)	479,569,750.000 (3,788,601,025)	
ユーロ	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,500,000.000	1,441,500.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	500,000.000	519,950.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	800,000.000	830,280.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,700,000.000	1,841,950.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	2,300,000.000	2,557,554.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	2,400,000.000	2,517,600.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	3,500,000.000	3,919,300.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	2,100,000.000	2,373,000.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	1,000,000.000	1,204,710.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	3,500,000.000	4,011,000.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	4,000,000.000	4,382,000.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,300,000.000	3,958,350.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	3,000,000.000	3,388,500.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	3,700,000.000	4,294,035.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	2,750,000.000	3,163,875.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,500,000.000	3,127,625.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,600,000.000	2,270,480.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	2,500,000.000	2,454,575.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	3,000,000.000	3,159,720.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	3,000,000.000	3,244,470.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	4,000,000.000	4,292,400.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	1,600,000.000	1,663,888.000	
	BELGIUM 3.5 06/28/17	2,000,000.000	2,187,560.000	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	1,000,000.000	1,040,610.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	4,000,000.000	4,240,880.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	5,100,000.000	5,748,210.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	3,700,000.000	4,092,533.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	3,000,000.000	3,369,600.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	2,650,000.000	3,008,412.500	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	4,500,000.000	5,125,365.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	2,000,000.000	2,209,960.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	3,100,000.000	3,551,670.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	3,900,000.000	4,523,415.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/22	3,100,000.000	3,579,539.000	
	BELGIUM 4.5 03/28/26	2,000,000.000	2,343,200.000	
	BELGIUM 5.0 03/28/35	4,600,000.000	5,776,910.000	
	BELGIUM 5.5 03/28/28	4,200,000.000	5,413,086.000	



BELGIUM 5.5 09/28/17	3,000,000.000	3,504,600.000	
BUNDESUBL 0.5 02/23/18	5,700,000.000	5,669,847.000	
BUNDESUBL 2.75 04/08/16	8,500,000.000	8,983,225.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	4,500,000.000	4,411,305.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	4,500,000.000	4,391,595.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	4,000,000.000	3,951,360.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	6,300,000.000	6,373,773.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	5,500,000.000	5,710,650.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	4,600,000.000	4,672,220.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	5,000,000.000	5,337,400.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	4,500,000.000	4,772,250.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	4,200,000.000	4,542,510.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	4,000,000.000	3,831,600.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	5,500,000.000	6,131,950.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	5,000,000.000	5,635,250.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	11,600,000.000	12,130,352.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	5,500,000.000	6,233,700.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	3,600,000.000	3,989,880.000	
DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	13,000,000.000	13,853,190.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	6,500,000.000	7,388,550.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	13,500,000.000	13,978,845.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	14,000,000.000	15,422,820.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	6,000,000.000	6,857,100.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	11,000,000.000	12,488,630.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	5,800,000.000	7,087,310.000	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	9,000,000.000	9,834,300.000	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	7,000,000.000	7,920,360.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	6,000,000.000	6,942,600.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	3,400,000.000	4,363,220.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,500,000.000	3,226,750.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,000,000.000	6,663,000.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,200,000.000	5,815,740.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	4,100,000.000	5,769,930.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,900,000.000	5,430,750.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	2,600,000.000	3,643,640.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	2,500,000.000	3,743,250.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	3,200,000.000	4,779,520.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,200,000.000	1,144,680.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	1,300,000.000	1,268,345.000	
FINLAND 1.75 04/15/16	2,500,000.000	2,582,000.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	700,000.000	672,070.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	800,000.000	815,880.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	1,550,000.000	1,731,970.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,500,000.000	1,689,450.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	2,400,000.000	2,674,800.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,700,000.000	1,982,880.000	
FINLAND 4.25 07/04/15	700,000.000	741,601.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	1,400,000.000	1,635,200.000	
FR TREASURY 1.0 07/25/17	3,000,000.000	3,030,390.000	
FR TREASURY 2.5 07/25/16	6,700,000.000	7,057,043.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	3,000,000.000	4,587,660.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/15	12,000,000.000	12,501,840.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	6,000,000.000	6,005,220.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,700,000.000	2,580,579.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	500,000.000	489,295.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,700,000.000	4,739,339.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	9,500,000.000	10,024,400.000	

FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,500,000.000	4,426,875.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	10,000,000.000	10,750,000.000	
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	15,500,000.000	16,261,050.000	
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	15,500,000.000	16,524,550.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,700,000.000	8,457,526.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	9,000,000.000	10,070,010.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	8,000,000.000	8,610,400.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	12,900,000.000	14,209,221.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	8,500,000.000	9,653,450.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,500,000.000	7,356,440.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	9,000,000.000	10,158,660.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	4,750,000.000	5,248,275.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,900,000.000	3,223,495.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	6,300,000.000	7,031,430.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	9,500,000.000	10,962,430.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	8,000,000.000	9,038,000.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	8,000,000.000	9,177,600.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	10,800,000.000	12,585,780.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,800,000.000	6,980,880.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,100,000.000	6,298,959.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	9,000,000.000	10,132,200.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	6,900,000.000	9,035,274.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	6,100,000.000	8,391,465.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	5,000,000.000	6,698,700.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	3,000,000.000	4,184,400.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,700,000.000	1,892,865.000	
IRISH 4.5 04/18/20	3,000,000.000	3,337,380.000	
IRISH 4.5 10/18/18	3,000,000.000	3,359,700.000	
IRISH 4.6 04/18/16	3,000,000.000	3,253,350.000	
IRISH 5.0 10/18/20	2,000,000.000	2,282,400.000	
IRISH 5.4 03/13/25	3,700,000.000	4,258,071.000	
IRISH 5.5 10/18/17	1,500,000.000	1,716,000.000	
IRISH 5.9 10/18/19	1,500,000.000	1,787,925.000	
ITALY BTPS 3.0 04/15/15	13,000,000.000	13,350,220.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	7,000,000.000	7,270,200.000	
ITALY BTPS 3.75 04/15/16	10,000,000.000	10,552,000.000	

ITALY BTPS 3.75 08/01/15	15,000,000.000	15,633,450.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	14,000,000.000	14,823,200.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	7,500,000.000	7,767,000.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	11,900,000.000	12,721,100.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	6,500,000.000	6,077,500.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	5,400,000.000	5,740,740.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/15	3,900,000.000	4,040,556.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	2,900,000.000	3,145,340.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	8,000,000.000	8,617,600.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	7,300,000.000	7,903,710.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	13,300,000.000	14,510,300.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,908,150.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,500,000.000	8,223,000.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,000,000.000	2,106,220.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,900,000.000	4,087,980.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	3,500,000.000	3,709,195.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	7,000,000.000	7,670,600.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	7,000,000.000	7,579,600.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	7,000,000.000	7,693,000.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,000,000.000	3,163,560.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,200,000.000	2,225,608.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,500,000.000	4,983,300.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	6,100,000.000	6,644,486.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	5,500,000.000	5,828,350.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,650,000.000	4,896,915.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	5,250,000.000	5,509,875.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	11,200,000.000	12,468,960.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	7,500,000.000	8,240,250.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	6,000,000.000	6,838,500.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	4,400,000.000	5,013,844.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	4,300,000.000	4,980,260.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	7,200,000.000	8,535,600.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	7,500,000.000	9,249,750.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	3,500,000.000	4,554,550.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	4,000,000.000	5,700,800.000	

NETHERLANDS 0.75 04/15/15	1,000,000.000	1,007,250.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,500,000.000	1,450,305.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	4,500,000.000	4,611,645.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	3,500,000.000	3,708,600.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,700,000.000	2,588,463.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/15	3,800,000.000	3,898,914.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/15	6,000,000.000	6,272,400.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,000,000.000	5,529,500.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	4,000,000.000	4,496,800.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,600,000.000	4,226,652.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,100,000.000	3,697,370.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/16	4,000,000.000	4,359,600.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	7,700,000.000	8,726,410.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	5,000,000.000	5,729,250.000	
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	5,000,000.000	5,661,000.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,900,000.000	3,899,630.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	4,000,000.000	5,806,400.000	
SPAIN 2.75 03/31/15	2,000,000.000	2,047,500.000	
SPAIN 3.0 04/30/15	6,000,000.000	6,166,800.000	
SPAIN 3.15 01/31/16	7,000,000.000	7,279,300.000	
SPAIN 3.25 04/30/16	7,000,000.000	7,310,800.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	2,700,000.000	2,874,393.000	
SPAIN 3.8 01/31/17	6,000,000.000	6,399,000.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	6,000,000.000	6,384,300.000	
SPAIN 4.0 07/30/15	7,000,000.000	7,332,850.000	
SPAIN 4.1 07/30/18	5,500,000.000	5,955,125.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	4,200,000.000	3,950,478.000	
SPAIN 4.25 10/31/16	5,000,000.000	5,378,800.000	
SPAIN 4.3 10/31/19	5,500,000.000	5,985,925.000	
SPAIN 4.4 01/31/15	4,800,000.000	4,977,168.000	
SPAIN 4.5 01/31/18	3,000,000.000	3,283,500.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	5,500,000.000	6,076,400.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	4,000,000.000	4,233,600.000	

	SPAIN 4.7 07/30/41	2,900,000.000	2,902,320.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	4,700,000.000	5,068,480.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	5,000,000.000	5,544,750.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	3,300,000.000	3,407,910.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,000,000.000	1,058,700.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	4,500,000.000	5,066,910.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	6,500,000.000	7,441,850.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	5,500,000.000	6,201,470.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	4,000,000.000	4,676,400.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,800,000.000	5,584,656.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	2,939,000.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	5,300,000.000	6,287,761.000	
	ユーロ 小計	1,056,700,000.000 (149,216,607,000)	1,172,071,691.500 (165,508,243,557)	
	南アフリカ・ランド			
	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	36,000,000.000	42,648,840.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	30,000,000.000	22,230,000.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	13,000,000.000	9,654,450.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	45,000,000.000	42,829,200.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	14,000,000.000	13,884,640.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	45,500,000.000	47,002,865.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	9,000,000.000	8,648,550.000	
	南アフリカ・ランド 小計	192,500,000.000 (1,838,375,000)	186,898,545.000 (1,784,881,105)	
	国債証券 合計	352,559,043,000 (352,559,043,000)	379,095,794,508 (379,095,794,508)	
	合計	352,559,043,000 (352,559,043,000)	379,095,794,508 (379,095,794,508)	

(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	組入債券 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	国債証券 120銘柄	38.47%	39.58%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	7.80%	8.02%
オーストラリア・ドル	国債証券 16銘柄	1.48%	1.52%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	2.31%	2.38%
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.34%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.54%	0.55%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.77%	0.79%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.32%	0.33%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.81%	0.84%
マレーシア・リンギット	国債証券 10銘柄	0.50%	0.52%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	0.97%	1.00%
ユーロ	国債証券 210銘柄	42.44%	43.66%
南アフリカ・ランド	国債証券 7銘柄	0.46%	0.47%

（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。

## 「グローバルリート・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25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
預金		26,075,947	9,766,709
コール・ローン		23,776,901	23,453,840
投資信託受益証券		445,484,133	395,509,153
投資証券		2,412,674,916	2,590,366,609
未収配当金		14,406,397	15,706,111
流動資産合計		2,922,418,294	3,034,802,422
資産合計		2,922,418,294	3,034,802,422
負債の部			
流動負債			
未払解約金		700,000	253,000
流動負債合計		700,000	253,000
負債合計		700,000	253,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	2,807,145,592	2,498,251,197
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		114,572,702	536,298,225
元本等合計		2,921,718,294	3,034,549,422
純資産合計		2,921,718,294	3,034,549,422
負債純資産合計		2,922,418,294	3,034,802,422



## 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	<p>投資信託受益証券</p> <p>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</p> <p>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>
2 . 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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25年1月11日現在	平成26年1月14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	3,472,218,155円	2,807,145,592円
	同期中追加設定元本額	198,987,156円	456,429,619円
	同期中一部解約元本額	864,059,719円	765,324,014円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	38,177,163円	45,374,620円
	マネックス資産設計ファンド<育成型>	470,694,534円	565,155,884円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	41,933,299円	37,731,897円
	D I A Mパッシブ資産分散ファンド	2,111,558,594円	1,771,208,187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）	144,782,002円	78,780,609円
	計	2,807,145,592円	2,498,251,197円
2 .	受益権の総数	2,807,145,592口	2,498,251,197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24年1月12日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成26年1月14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、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。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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	平成25年1月11日現在	平成26年1月14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)
投資信託受益証券	9,044,830	17,604,396
投資証券	93,659,538	72,884,461
合計	102,704,368	90,488,857

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成24年11月7日から平成25年1月11日まで及び平成25年11月7日から平成26年1月14日まで)に対応する金額であります。

## (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)

	平成25年1月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.0408円	1.2147円
(1万口当たり純資産額)	(10,408円)	(12,147円)

## 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26年1月14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	ABACUS PROPERTY GROUP	16,920.000	39,931.200		
		BWP TRUST	20,500.000	45,715.000		
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	108,529.000	215,430.060		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	17,480.000	64,676.000		
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	93,300.000	115,692.000		
		DEXUS PROPERTY GROUP	172,400.000	179,296.000		
		FEDERATION CENTRES	68,000.000	161,160.000		
		GOODMAN GROUP	60,752.000	289,787.040		
		GPT GROUP	64,200.000	231,120.000		
		INVESTA OFFICE FUND	29,270.000	92,785.900		
		MIRVAC GROUP	137,137.000	236,561.320		
		STOCKLAND	87,717.000	331,570.260		
		WESTFIELD GROUP	73,458.000	744,129.540		
	WESTFIELD RETAIL TRUST	114,200.000	348,310.000			
	オーストラリア・ドル 小計			1,063,863.000	3,096,164.320 (289,057,901)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	92,000.000	199,640.000		
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	123,000.000	179,580.000		
		CAPITAMALL TRUST	126,000.000	234,990.000		
		CAPITARETAIL CHINA TRUST	71,000.000	92,300.000		
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	58,000.000	95,700.000		
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		77,000.000	81,235.000			
FRASERS COMMERCIAL TRUST		96,000.000	121,440.000			
STARHILL GLOBAL REIT		120,000.000	91,200.000			
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	133,000.000	208,145.000				
シンガポール・ドル 小計			896,000.000	1,304,230.000 (106,451,252)		
投資信託受益証券	合計		1,959,863	395,509,153 (395,509,153)		
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	3,285.000	81,862.200		
		AGREE REALTY CORP	1,000.000	28,510.000		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,603.000	167,685.260		
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	4,409.000	149,112.380		

AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	7,200.000	93,744.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	6,615.000	173,908.350	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	643.000	11,561.140	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3,219.000	26,653.320	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,678.000	565,242.740	
BIOMED REALTY TRUST INC	8,300.000	152,471.000	
BOSTON PROPERTIES INC	5,838.000	604,816.800	
BRANDYWINE REALTY TRUST	6,100.000	84,424.000	
BRE PROPERTIES -CL A	3,300.000	188,793.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,070.000	180,669.500	
CBL & ASSOCIATES	7,630.000	136,348.100	
CEDAR REALTY TRUST INC	3,200.000	20,544.000	
COMMONWEALTH REIT	4,525.000	102,672.250	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,800.000	92,910.000	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	4,734.000	158,446.980	
COUSINS PROPERTIES INC	9,409.000	98,229.960	
CUBESMART	6,100.000	96,685.000	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	18,300.000	126,819.000	
DDR CORP	11,082.000	171,881.820	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,372.000	96,194.280	
DIGITAL REALTY TRUST INC	4,860.000	244,020.600	
DOUGLAS EMMETT INC	5,445.000	131,333.400	
DUKE REALTY TRUST	14,400.000	214,848.000	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	3,500.000	85,295.000	
EAST GROUP	1,800.000	102,456.000	
EDUCATION REALTY TRUST INC	7,800.000	70,434.000	
EPR PROPERTIES	2,200.000	107,910.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,710.000	136,231.200	
EQUITY RESIDENTIAL	13,070.000	695,585.400	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,670.000	252,787.900	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,800.000	207,840.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,874.000	299,671.980	
FELCOR LODGING TR INC	3,200.000	26,624.000	
FIRST INDUSTRIAL RT	4,600.000	76,360.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,700.000	68,514.000	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	20,797.000	423,634.890	

GEO GROUP INC	2,800.000	91,280.000	
GETTY REALTY CORP	1,700.000	31,586.000	
GLIMCHER REALTY TRUST	6,400.000	58,432.000	
HCP INC	17,452.000	665,095.720	
HEALTH CARE REIT INC	11,051.000	618,303.450	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	4,600.000	100,280.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,400.000	58,032.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,600.000	165,140.000	
HOME PROPERTIES INC	2,400.000	132,480.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	5,800.000	153,584.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	27,913.000	532,580.040	
INLAND REAL ESTATE CORP	4,900.000	51,744.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	8,000.000	67,840.000	
KILROY REALTY CORP	3,275.000	166,042.500	
KIMCO REALTY	15,322.000	310,117.280	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	3,900.000	118,404.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	9,421.000	94,775.260	
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,228.000	179,424.960	
LTC PROPERTIES INC	1,601.000	56,995.600	
MACK CALI	2,800.000	56,868.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	6,000.000	74,880.000	
MID AMERICA	2,760.000	169,491.600	
NATIONAL HEALTH INVS INC	1,500.000	87,210.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	5,000.000	156,550.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	5,400.000	165,672.000	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,500.000	107,205.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	7,400.000	121,878.000	
POST PROPERTIES, INC	2,330.000	108,042.100	
PROLOGIS INC	19,194.000	705,379.500	
PS BUSINESS PARKS	1,400.000	106,890.000	
PUBLIC STORAGE	5,539.000	852,784.440	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3,600.000	55,872.000	
REALTY INCOME CORP	8,030.000	307,468.700	
REGENCY CENTERS CORP	3,747.000	175,921.650	
RLJ LODGING TRUST	6,900.000	172,017.000	
ROUSE PROPERTIES INC	1,411.000	28,375.210	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,000.000	85,480.000	
SAUL CENTERS INC	870.000	41,307.600	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	8,100.000	177,309.000	



	SIMON PROPERTY GROUP INC	11,864.000	1,840,936.880	
	SL GREEN	3,905.000	359,845.750	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	1,546.000	101,572.200	
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	8,000.000	74,800.000	
	SUN COMMUNITIES INC	2,300.000	97,451.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6,400.000	83,904.000	
	TANGER FACTORY OUTLET	4,700.000	155,523.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	2,700.000	177,579.000	
	THE MACERICH COMPANY	5,290.000	309,253.400	
	UDR INC	9,169.000	214,187.840	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	900.000	37,260.000	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	2,600.000	47,970.000	
	VENTAS INC	11,295.000	676,570.500	
	VORNADO REALTY TRUST	6,599.000	600,113.060	
	WASHINGTON REIT	4,000.000	91,560.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	4,731.000	132,231.450	
	WP CAREY INC	2,600.000	160,134.000	
アメリカ・ドル 小計		570,681.000	19,323,362.140 (1,996,489,776)	
イギリス・ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	10,000.000	49,190.000	
	BRITISH LAND CO PLC	36,191.000	233,612.900	
	DERWENT LONDON PLC	3,860.000	99,588.000	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	17,800.000	109,203.000	
	HAMMERSON PLC	27,200.000	137,904.000	
	INTU PROPERTIES PLC	17,804.000	55,815.540	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	27,178.000	270,556.990	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	36,000.000	49,536.000	
	SEGRO PLC	33,790.000	115,798.330	
	SHAFTESBURY PLC	12,700.000	81,407.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	7,067.000	39,327.850	
イギリス・ポンド 小計		229,590.000	1,241,939.610 (210,409,408)	
カナダ・ドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,440.000	86,169.600	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	3,400.000	86,870.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	2,681.000	57,561.070	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	2,700.000	116,208.000	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCE	4,700.000	47,846.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV TR	3,500.000	64,610.000	

	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	7,981.000	171,511.690	
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	12,300.000	58,056.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	7,500.000	190,275.000	
カナダ・ドル 小計		46,202.000	879,107.360 (83,418,497)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	73,600.000	72,496.000	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	50,000.000	55,000.000	
ニュージーランド・ドル 小計		123,600.000	127,496.000 (11,033,504)	
ユーロ	BEFIMMO	1,104.000	55,939.680	
	COFINIMMO SA	730.000	63,729.000	
	CORIO NV	4,080.000	133,518.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	1,300.000	39,260.000	
	FONCIERE DES REGIONS	1,600.000	98,736.000	
	GECINA SA	1,116.000	107,426.160	
	ICADE	956.000	63,096.000	
	KLEPIERRE	4,268.000	143,831.600	
	MERCIALYS	2,220.000	33,488.700	
	NIEUWE STEEN INVS	991.000	4,578.420	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,740.000	699,754.000	
	VASTNED RETAIL	1,480.000	52,170.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	904.000	48,499.600	
WERELDHAVE NV	1,040.000	59,779.200		
ユーロ 小計		25,529.000	1,603,806.360 (226,473,496)	
香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	78,000.000	478,140.000	
	LINK REIT/THE	94,100.000	3,321,730.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	203,000.000	440,510.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	121,000.000	454,960.000	
香港・ドル 小計		496,100.000	4,695,340.000 (62,541,928)	
投資証券 合計		1,491,702	2,590,366,609 (2,590,366,609)	
合計			2,985,875,762 (2,985,875,762)	

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 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	投資証券 96銘柄	-%	65.79%	66.86%
イギリス・ポンド	投資証券 11銘柄	-%	6.93%	7.05%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 14銘柄	9.53%	-%	9.68%
カナダ・ドル	投資証券 9銘柄	-%	2.75%	2.79%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 9銘柄	3.51%	-%	3.57%
ニュージーランド・ドル	投資証券 2銘柄	-%	0.36%	0.37%
ユーロ	投資証券 14銘柄	-%	7.46%	7.58%
香港・ドル	投資証券 4銘柄	-%	2.06%	2.09%

(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

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成26年1月31日現在

資産総額	9,115,952,441円
負債総額	18,965,375円
純資産総額（ - ）	9,096,987,066円
発行済数量	9,401,434,529口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9676円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	318,437,334,268円
負債総額	2,411,107,153円
純資産総額（ - ）	316,026,227,115円
発行済数量	185,996,176,970口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6991円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	453,458,509,854円
負債総額	5,497,887,000円
純資産総額（ - ）	447,960,622,854円
発行済数量	375,765,680,884口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1921円

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	29,167,686,961円
負債総額	800,441,890円
純資産総額（ - ）	28,367,245,071円
発行済数量	21,119,255,647口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3432円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	306,801,481,481円
負債総額	334,765,798円
純資産総額（ - ）	306,466,715,683円
発行済数量	137,643,547,397口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2265円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	392,244,772,001円
負債総額	8,133,166,588円
純資産総額（ - ）	384,111,605,413円
発行済数量	235,547,211,068口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6307円

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	3,051,001,908円
負債総額	21,000円
純資産総額（ - ）	3,050,980,908円
発行済数量	2,506,970,774口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2170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ヵ年の資本金の変動

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

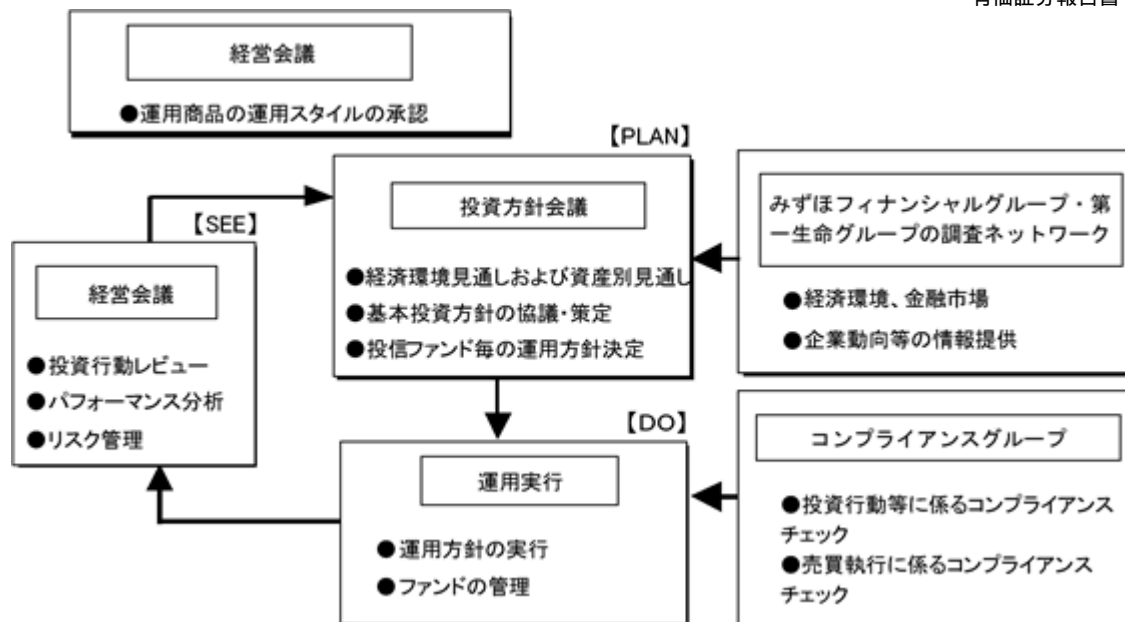
委託会社が運用指図権を有するファンドに係る運用スタイルの承認は、原則として月3回開催される経営会議のうち、月2回の経営会議において決定します。なお、議長は社長とします。

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26年1月31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26年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は313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	9	21,961,797,499
追加型株式投資信託	294	4,918,644,239,908
単位型公社債投資信託	9	89,747,666,936
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	102,550,316
合計	313	5,030,456,254,659

### 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28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25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29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,520,748	10,806,745
金銭の信託	6,548,577	10,214,440
前払費用	25,744	69,143
未収委託者報酬	2,780,527	3,073,481
未収運用受託報酬	1,167,998	1,173,744
未収投資助言報酬	2 241,851	2 245,819
未収収益	212,226	244,974
繰延税金資産	344,793	426,229
その他	22,264	25,354
流動資産計	23,864,733	26,279,933
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 167,433	1 142,820
車両運搬具	1 4,752	1 2,770
器具備品	1 188,367	1 231,732
建設仮勘定	109,529	1,207
無形固定資産		
商標権	1 383	1 289
ソフトウェア	1 1,101,685	1 1,261,335
ソフトウェア仮勘定	152,513	68,920
電話加入権	7,148	7,148
電話施設利用権	1 371	1 292
投資その他の資産		
投資有価証券	3,982,258	4,002,042
関係会社株式	450,882	400,579
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	590,822	661,777
長期差入保証金	731,197	731,564
その他	90,282	89,047
固定資産計	5,714,444	5,718,557
資産合計	29,579,177	31,998,491

（単位：千円）

	第27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	132,805	571,153
未払金	1,460,128	1,547,527
未払収益分配金	670	48
未払償還金	86,391	84,932
未払手数料	1,088,348	1,195,452
その他未払金	284,718	267,093
未払費用	2 1,105,512	2 1,306,837
未払法人税等	1,195,056	1,299,068
未払消費税等	92,354	116,872
賞与引当金	574,646	724,974
その他	-	100,000
流動負債計	4,560,503	5,666,434
固定負債		
退職給付引当金	680,768	802,603
役員退職慰労引当金	56,690	98,510
固定負債計	737,458	901,113
負債合計	5,297,962	6,567,548
（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	19,716,594	20,898,697
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	15,630,000	16,330,000
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	3,463,300	3,945,403
株主資本計	24,145,072	25,327,175
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	136,143	103,768
評価・換算差額等計	136,143	103,768
純資産合計	24,281,215	25,430,943
負債・純資産合計	29,579,177	31,998,491



一般管理費計		7,429,267		7,824,126
営業利益		6,644,580		6,152,691

（単位：千円）

	第27期		第28期	
	（自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）		（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	61,720		10,223	
受取利息	3,921		3,554	
時効成立分配金	11,383		2,080	
為替差益	1,660		-	
金銭の信託運用益	-		168,444	
雑収入	5,992		4,957	
営業外収益計		84,678		189,260
営業外費用				
為替差損	-		6,549	
時効成立後支払分配金	36		-	
金銭の信託運用損	417,812		-	
雑損失	1,152		-	
営業外費用計		419,001		6,549
経常利益		6,310,257		6,335,402
特別利益				
ゴルフ会員権売却益	1,959		-	
特別利益計		1,959		-
特別損失				
固定資産除却損	1 36,415		1 1,752	
固定資産売却損	381		115	
関係会社株式評価損	338,244		-	
特別損失計		375,042		1,868
税引前当期純利益		5,937,173		6,333,533
法人税、住民税及び事業税		2,582,251		2,573,893
法人税等調整額		56,997		134,463
法人税等合計		2,525,253		2,439,430
当期純利益		3,411,920		3,894,102

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

( 単位：千円 )

	第27期	第28期
	( 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日 )	( 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日 )
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	13,430,000	15,630,000
当期変動額	2,200,000	700,000
当期末残高	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
当期首残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	4,459,380	3,463,300
当期変動額		
剰余金の配当	2,208,000	2,712,000
別途積立金の積立	2,200,000	700,000
当期純利益	3,411,920	3,894,102
当期末残高	3,463,300	3,945,403
利益剰余金合計		
当期首残高	18,512,674	19,716,594
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	19,716,594	20,898,697
株主資本合計		
当期首残高	22,941,152	24,145,072
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	24,145,072	25,327,175



評価・換算差額等	その他有価証券評価差額金		
	当期首残高	216,534	136,143
	当期変動額(純額)	80,390	32,375
	当期末残高	136,143	103,768
純資産合計			
	当期首残高	23,157,686	24,281,215
	当期変動額	1,123,529	1,149,727
	当期末残高	24,281,215	25,430,943

## 重要な会計方針

項目	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31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：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 定率法によっております。  (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。  (会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。
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	(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。  (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。  (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期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。  (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。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

## 未適用の会計基準等

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25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）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 平成24年5月17日）

## （1）概要

財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。

## （2）適用予定日

平成25年4月1日以後に開始する事業年度の期末から適用予定であります。ただし、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

## （3）当該会計基準等の適用による影響

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

## 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27期 （平成24年3月31日現在）	第28期 （平成25年3月31日現在）
建物	513,080	539,393
車両運搬具	171	2,152
器具備品	462,449	565,794
商標権	2,555	649
ソフトウェア	961,584	1,071,133
電話施設利用権	1,225	1,304

## 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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	238,121	241,190
流動負債	未払費用	292,536	334,888

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
建物	1,892	-
器具備品	18,917	-
ソフトウェア	15,606	1,752

(株主資本等変動計算書関係)

第27期(自平成23年4月1日 至平成24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23年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2日

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,712,000	113,000	平成24年3月31日	平成24年7月2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25年6月28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25年6月28日 定時株主総会	普通 株式	利益剰余金	3,096,000	129,000	平成25年3月31日	平成25年7月1日

## (リース取引関係)

## 1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額  
該当事項はありません。

未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

## 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

	第27期 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
支払リース料	588	-
減価償却費相当額	543	-
支払利息相当額	1	-

## 減価償却費相当額の算定方法

該当事項はありません。

## 利息相当額の算定方法

該当事項はありません。

## 2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

## （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であります。

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、株価指数先物取引およ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およ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27期（平成24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	12,520,748	12,520,748	-
(2) 金銭の信託	6,548,577	6,548,577	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	370,636	370,636	-
資産計	19,439,962	19,439,962	-
(1) 未払法人税等	1,195,056	1,195,056	-
負債計	1,195,056	1,195,056	-

## 第28期（平成25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	10,806,745	10,806,745	-
(2) 金銭の信託	10,214,440	10,214,440	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	320,332	320,332	-
資産計	21,341,518	21,341,518	-
(1) 未払法人税等	1,299,068	1,299,068	-
負債計	1,299,068	1,299,068	-

## (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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25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	2,119,074
長期差入保証金	731,197	731,564

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。

長期差入保証金は、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27期(平成24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	12,520,524	-	-	-
合計	12,520,524	-	-	-

第28期(平成25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	10,806,412	-	-	-
合計	10,806,412	-	-	-

(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27期及び第28期の貸借対照表計上額2,119,074千円)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27期（平成24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	359,540	146,101	213,438
債券	-	-	-
その他（投資信託）	3,482	3,000	482
小計	363,022	149,101	213,920
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）	7,614	10,000	2,386
小計	7,614	10,000	2,386
合計	370,636	159,101	211,534

（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28期（平成25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	307,639	146,101	161,537
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
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）	8,688	10,000	1,312
小計	8,688	10,000	1,312
合計	320,332	159,101	161,231

（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

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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27期（平成24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	6,548,577	495,939

## 第28期（平成25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	10,214,440	946,377

## 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. 退職給付債務に関する事項

(千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(1) 退職給付債務	740,560	936,125
(2) 未認識数理計算上の差異	59,792	133,522
退職給付引当金	680,768	802,603

## 3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
(1) 勤務費用	102,728	102,125
(2) 利息費用	9,549	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	13,388	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	38,960	41,923
(5) その他	-	314
退職給付費用	164,627	173,065

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

## (1) 割引率

第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1.5%	1.5%

## (2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

## (3) 数理計算上の差異の処理年数

5年（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する方法）

## （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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	87,682	107,022
未払事業所税	5,792	5,986
賞与引当金	218,423	275,562
未払法定福利費	24,791	34,566
未払確定拠出年金掛金	2,607	3,091
減価償却超過額（一括償却資産）	5,496	5,192
減価償却超過額	150,369	159,737
繰延資産償却超過額（税法上）	47,261	27,873
退職給付引当金	243,845	286,796
役員退職慰労引当金	20,204	35,109
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	4,410	22,907
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	678	109
繰延税金資産合計	935,615	1,088,007
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
差引繰延税金資産の純額	935,615	1,088,007

## 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。

## （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せん。

## 2．関連情報

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24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	23,208,602	5,910,049	697,063	29,815,715

（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28期（自平成24年4月1日 至平成25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	23,374,427	6,260,086	715,164	30,349,678

（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27期（自平成23年4月1日 至平成24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	687,972	未収投資 助言報酬	177,282



## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	710,289	未収投資 助言報酬	203,114

## 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27期（自平成23年4月1日 至平成24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	523,845	未払 費用	158,645
	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	203,092	未払 費用	75,484

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	520,967	未払 費用	175,664
	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	214,290	未払 費用	89,815

## 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。

## (3)兄弟会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24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	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  預金の引出 (純額)  受取利息	1,548,354  91,135  104	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	122,786  433,779  -
	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  預金の預入 (純額)  受取利息	450,766  392,267  3,654	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	83,446  11,440,025  -
	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  業務委託料 の支払	237,031  15,140	未払 費用  未払 費用	127,757  6,373
	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	1,000,000  5,087	金銭の 信託	6,548,577

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25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	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  預金の預入 (純額)  受取利息	1,661,638  191,782  106	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	142,323  625,561  -
	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  預金の引出 (純額)  受取利息	460,605  1,912,442  3,210	未払 手数料  現金・ 預金  未収 収益	100,875  9,527,582  61
	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  業務委託料 の支払	259,435  11,140	未払 費用  未払 費用	132,250  5,848
	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  5,908	金銭の 信託	10,214,440

## 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) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。

(注4) 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5) 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6) 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27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,011,717円32銭	1,059,622円64銭
1株当たり当期純利益金額	142,163円33銭	162,254円29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、新株引受権付社債及び転換社債を発行し  
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27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,411,920千円	3,894,102千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(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29期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,422,331
金銭の信託		9,988,674
前払費用		81,570
未収委託者報酬		3,539,476
未収運用受託報酬		1,927,231
未収投資助言報酬		233,557
未収収益		265,944
繰延税金資産		365,930
その他		77,287
	流動資産計	25,902,003
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	131,728
車両運搬具	1	2,193
器具備品	1	192,157
建設仮勘定		6,839
無形固定資産		
商標権	1	242
ソフトウェア	1	1,141,508
ソフトウェア仮勘定		292,572
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	258
投資その他の資産		
投資有価証券		409,446
関係会社株式		2,119,074
繰延税金資産		675,426
差入保証金		731,197
その他		87,266
	固定資産計	5,797,060
資産合計		31,699,064

（単位：千円）

	第29期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	915,630
未払金	1,777,659
未払収益分配金	48
未払償還金	51,109
未払手数料	1,403,573
その他未払金	322,928
未払費用	1,320,067
未払法人税等	1,362,916
未払消費税等	149,912
賞与引当金	592,328
	流動負債計
	6,118,515
固定負債	
退職給付引当金	870,468
役員退職慰労引当金	121,100
	固定負債計
	991,568
負債合計	7,110,084
（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	20,051,026
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	19,927,733
別途積立金	17,130,000
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	2,297,733
	株主資本計
	24,479,504
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	109,475
	評価・換算差額等計
	109,475
純資産合計	24,588,979
負債・純資産合計	31,699,064

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,617,519	
運用受託報酬	3,032,543	
投資助言報酬	455,315	
その他営業収益	409,599	
	営業収益計	16,514,977
営業費用		
支払手数料	5,584,176	
広告宣伝費	113,543	
調査費	2,650,938	
調査費	1,833,878	
委託調査費	817,060	
委託計算費	178,138	
営業雑経費	239,279	
通信費	16,255	
印刷費	206,531	
協会費	12,524	
諸会費	15	
支払販売手数料	3,952	
	営業費用計	8,766,076
一般管理費		
給料	2,201,917	
役員報酬	125,877	
給料・手当	2,076,040	
交際費	17,522	
寄付金	2,515	
旅費交通費	97,277	
租税公課	53,858	
不動産賃借料	341,829	
退職給付費用	110,074	
固定資産減価償却費	1 279,285	
福利厚生費	11,941	
修繕費	5,939	
賞与引当金繰入額	592,328	
役員退職慰労引当金繰入額	26,388	
役員退職慰労金	528	
機器リース料	23	
事務委託費	105,422	
事務用消耗品費	32,711	
器具備品費	2,550	
諸経費	56,566	
	一般管理費計	3,938,680
営業利益		3,810,221



（単位：千円）

	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日至平成25年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,371	
受取利息	1,297	
時効成立分配金・償還金	33,823	
雑収入	3,864	
		営業外収益計 45,357
営業外費用		
為替差損	5,352	
金銭の信託運用損	205,313	
		営業外費用計 210,666
経常利益		3,644,913
特別損失		
固定資産除却損	22	
固定資産売却損	1,448	
		特別損失計 1,470
税引前中間純利益		3,643,442
法人税、住民税及び事業税		1,351,622
法人税等調整額		43,490
法人税等合計		1,395,112
中間純利益		2,248,329

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	当期首残高	16,330,000
	当中間期変動額	800,000
	当中間期末残高	17,130,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	3,945,403
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	3,096,000
	別途積立金の積立	800,000
	中間純利益	2,248,329
	当中間期末残高	2,297,733
	利益剰余金合計	
	当期首残高	20,898,697
	当中間期変動額	847,670
	当中間期末残高	20,051,026
	株主資本合計	
	当期首残高	25,327,175
	当中間期変動額	847,670
	当中間期末残高	24,479,504
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	103,768
	当中間期変動額（純額）	5,706
	当中間期末残高	109,475
純資産合計		
	当期首残高	25,430,943
	当中間期変動額	841,963
	当中間期末残高	24,588,979

## 重要な会計方針

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25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、数理計算上の差異及び過去勤務債務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 過去勤務債務：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。

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
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。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

項目	第29期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)
1. 固定資産の減価償却累計額	建物 ... 550,694千円
	車両運搬具 ... 2,730千円
	器具備品 ... 610,752千円
	商標権 ... 696千円
	ソフトウェア ... 1,285,419千円
	電信電話専用施設利用権 ... 1,338千円

## (中間損益計算書関係)

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
1. 減価償却実施額	有形固定資産 ... 64,676千円
	無形固定資産 ... 214,609千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25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

## (金融商品関係)

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成25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	9,422,331	9,422,331	-
(2) 金銭の信託	9,988,674	9,988,674	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	329,200	329,200	-
資産計	19,740,206	19,740,206	-
(1) 未払法人税等	1,362,916	1,362,916	-
負債計	1,362,916	1,362,916	-

## (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	2,119,074
差入保証金	731,197

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。

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。

## （有価証券関係）

## 第29期中間会計期間末（平成25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2,119,074千円）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	315,920	146,101	169,818
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,263	3,000	1,263
小計	320,184	149,101	171,082
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）	9,016	10,000	984
小計	9,016	10,000	984
合計	329,200	159,101	170,098

（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29期中間会計期間末（平成25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29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25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	12,617,519	3,487,859	409,599	16,514,977

（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29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,024,540円	82銭
1株当たり中間純利益金額	93,680円	39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29期中間会計期間 （自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
中間純利益	2,248,329千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,248,329千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
該当事項はありません。

#### 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) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（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25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
マネックス証券株式会社	7,425	「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。

\*平成25年3月末日現在

## (3) 投資顧問会社

## a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

## b. 資本金の額

平成25年3月末日現在 9,557.5万円

## c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

## (4) 投資顧問会社

## a. 名称

DIAM International Ltd

## b. 資本金の額

平成25年12月末日現在 400万ポンド

## c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

## 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)・運用報告書の送付
- (7)その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

委託会社は、DIAM International Ltdの株式について100%保有しています。

その他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
有価証券報告書	平成25年4月11日
有価証券届出書	平成25年4月11日
有価証券届出書の訂正届出書	平成25年10月11日
半期報告書	平成25年10月11日

# 独立監査人の監査報告書

平成25年6月6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	浅野 功 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘 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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28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25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、独立監査人の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) 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年2月26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

## あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 渉 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成25年1月12日から平成26年1月14日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成26年1月14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25年12月6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	浅野 功 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	近藤 敏弘 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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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25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25年4月1日から平成25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、独立監査人の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）中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。