

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年1月15日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 中島 敬雄
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	大楽 信雄
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A M外国株式パッシブ・ファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

D I A M外国株式パッシブ・ファンド

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、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。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：パ外国株）

### (5)【申込手数料】

ありません。

#### (6)【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。  
当初元本は1口当たり1円です。

#### (7)【申込期間】

継続申込期間：平成26年1月16日から平成27年1月14日まで

ニューヨーク証券取引所、またはロンドン証券取引所の休業日に該当する日（以下「海外休業日」といいます。）には、お申込みの受付を行いません。

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

#### (8)【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・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）

#### (9)【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。

#### (10)【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社所定の方法により、販売会社を買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・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）

#### (11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

#### (12)【その他】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい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）を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の受付は、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が完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、海外休業日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かかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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かかる信託を設定した旨の通知を行います。

#### 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。

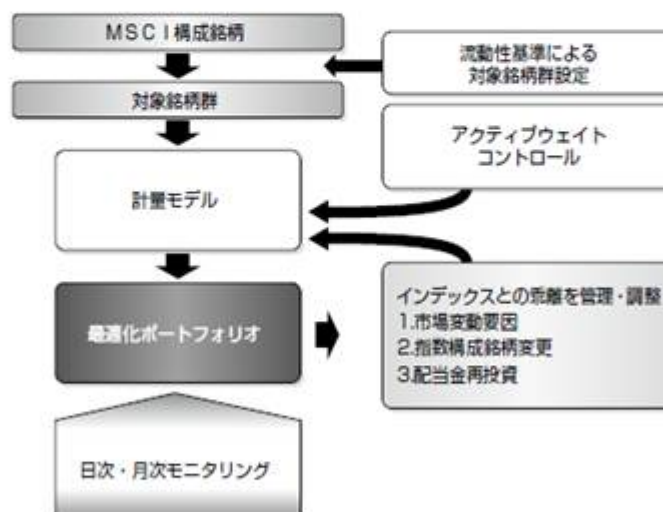
ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### ファンドの特色

- ① 主に外国株式バシブ・ファンド・マザーファンドに投資を行い、「MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）<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。

(注)MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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



- ③ 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

- ④ 実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

## 分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日。))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

### 単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

### 投資対象地域

「海外」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

### 投資対象資産

「株式」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

### 補足分類

「インデックス型」とは目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

## 投資対象資産

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

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

## 決算頻度

「年1回」とは目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

## 投資対象地域

「グローバル（日本を除く）」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 投資形態

「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ

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

対象インデックス

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

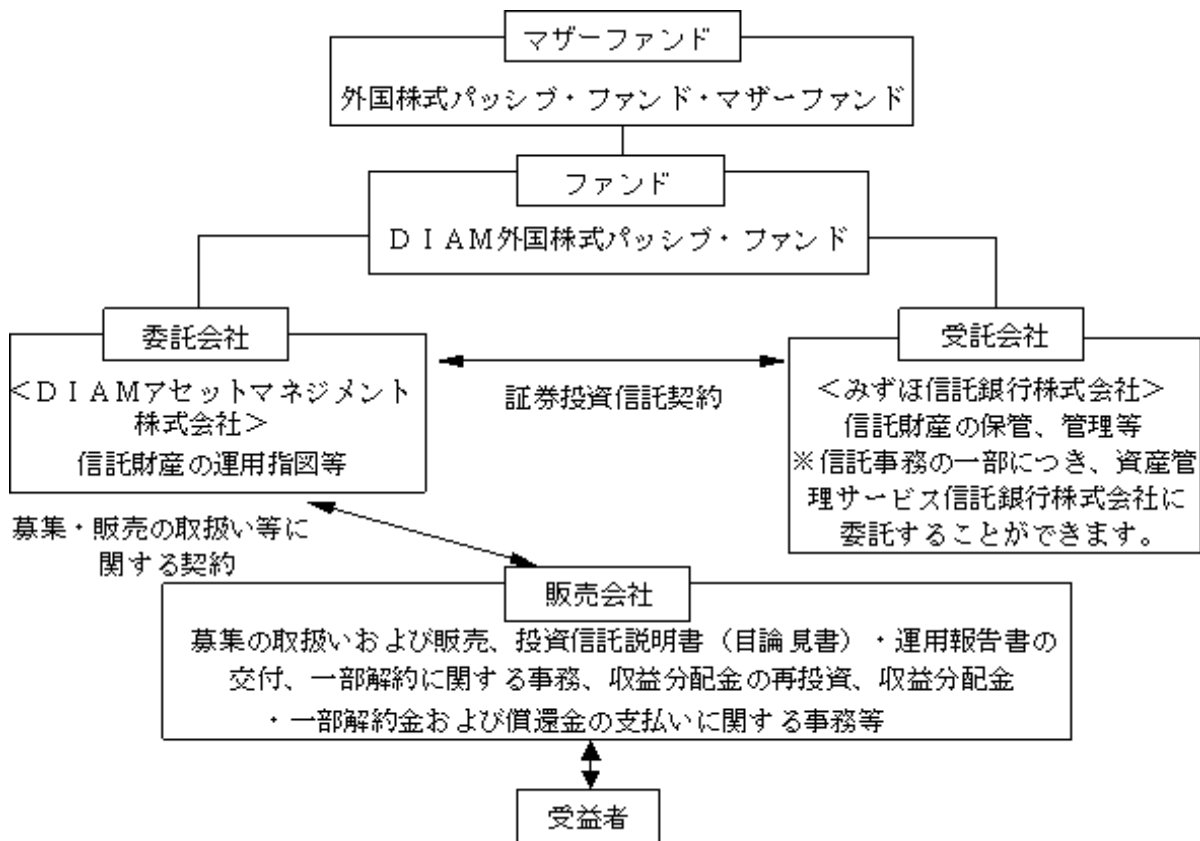
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

## (2)【ファンドの沿革】

平成21年1月30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】



### ・「証券投資信託契約」の概要

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



・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

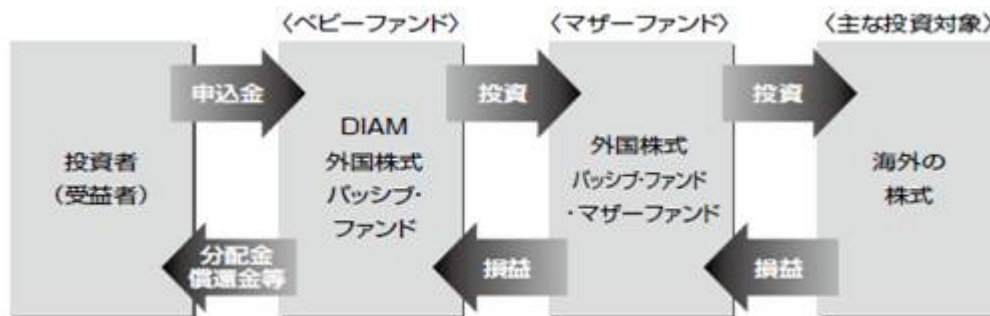
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成25年10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リュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

平成20年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成25年10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	東京都千代田区丸の内二丁目5番1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、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）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

#### <投資対象>

この投資信託は、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

#### <投資態度>

主として「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券に投資し、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）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

ただし、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、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場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

### (2)【投資対象】

#### 1. 投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

#### 2. 運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

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

6) 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。 ）

- 7) 投資法人債券(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、振替投資法人債を含みません。)
- 8) 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。)
- 9) 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。)
- 10) 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。)
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 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
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)～12)の証券または証書の性質を有するもの
- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。 )
- 15) 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。 )
- 16) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。 )
- 17) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。 )
- 18) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。 )
- 19) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 20) 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。 )
- 21) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。 )
- 22) 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
- 23) 外国の者に対する権利で上記22)の有価証券の性質を有するもの

なお、1)の証券または証書、13)ならびに18)の証券または証書のうち1)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、2)から7)までの証券および13)ならびに18)の証券または証書のうち2)から7)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14)の証券および15)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

### 3. 運用の指図範囲等(約款第17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の指図をすることができます。

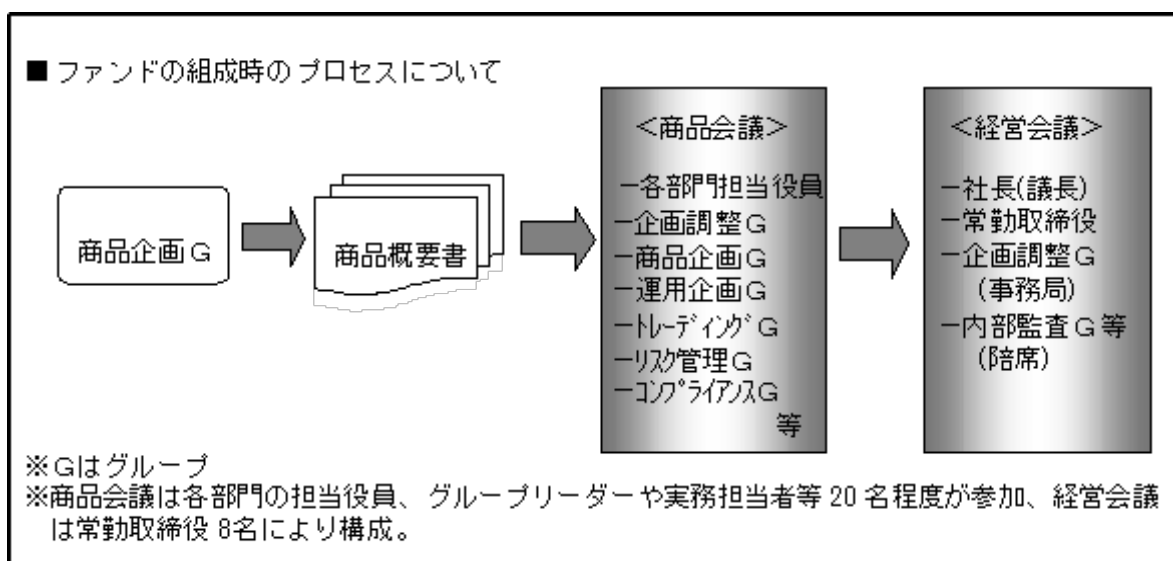
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。 )
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

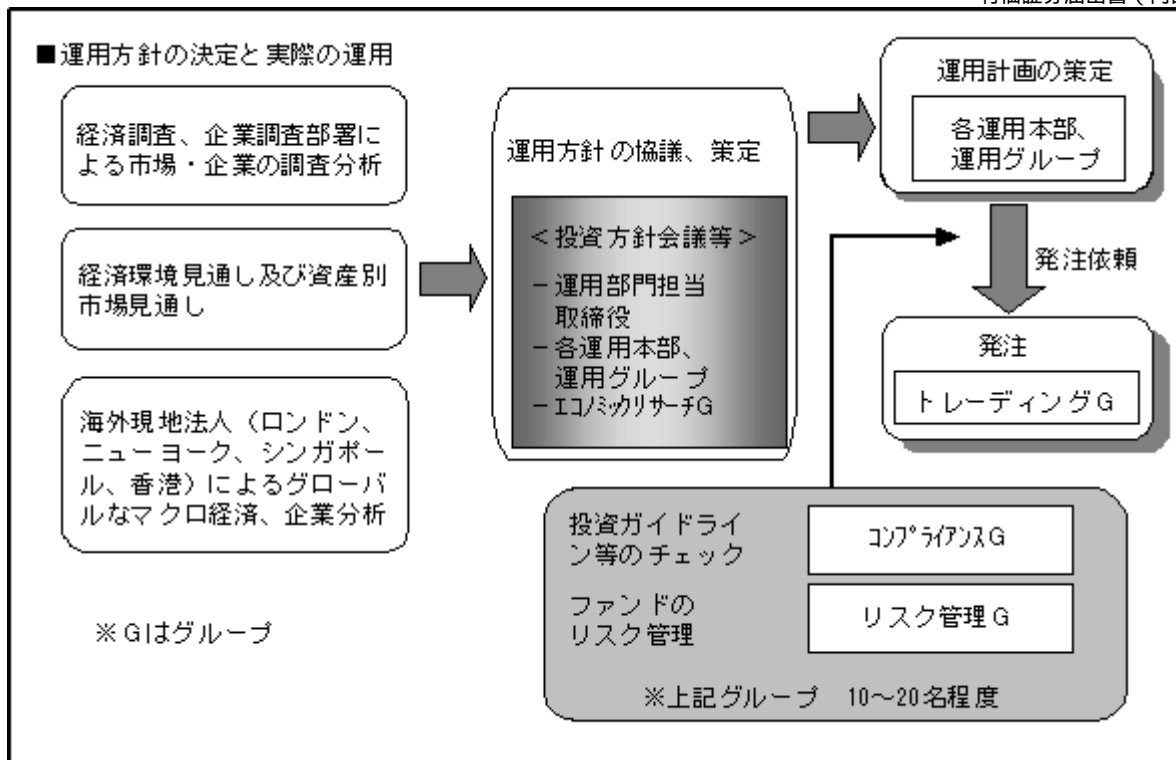
## （参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	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	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 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。 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。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、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。 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。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

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よって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。

上記体制は平成25年10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)【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時（原則として10月12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益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### 2) 分配対象額についての分配方針

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

##### 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. 信託財産から生ず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（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料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、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の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、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産に係る配当等収益の額に、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。

##### 収益分配金の支払い

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てします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

**(5) 【投資制限】**

- 1) 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）
- 2) 株式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）
- 3) 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）
- 4) 投資する株式等の範囲（約款第20条）
  - a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場（上場予定を含みます。）されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定の株式、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。
- 5) 信用取引の指図範囲（約款第21条）
  - a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - b. 上記a.の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
    2. 株式分割により取得する株券
    3. 有償増資により取得する株券
    4. 売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（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。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
    6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(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
- 6) 先物取引等の運用指図（約款第22条）
  - a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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。）。

- b. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- c. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の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。
- 7) スワップ取引の運用指図（約款第23条）
- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- d. 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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 8) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）
- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引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。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 9) 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1) 2) の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
- 1) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 上記a. 1) 2) 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。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。
- 10) 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26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。



## 11) 外国為替予約取引の指図および範囲（約款第27条）

- a. 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。
- b. 上記a.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係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、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係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。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. 上記b.においてマザーファンドの信託財産に係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係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係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係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。
- d. 上記b.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

## 12) 資金の借入れ（約款第33条）

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

## 13) 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。

## 14) 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。

#### (1) 株価変動リスク

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。当ファンドは、実質的に株式へ投資しますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

#### (2) 為替リスク

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として為替ヘッジを行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基準価額が下がる要因となります。

#### (3) 信用リスク

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

#### (4) 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、資金変動等が起こり、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。

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

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。

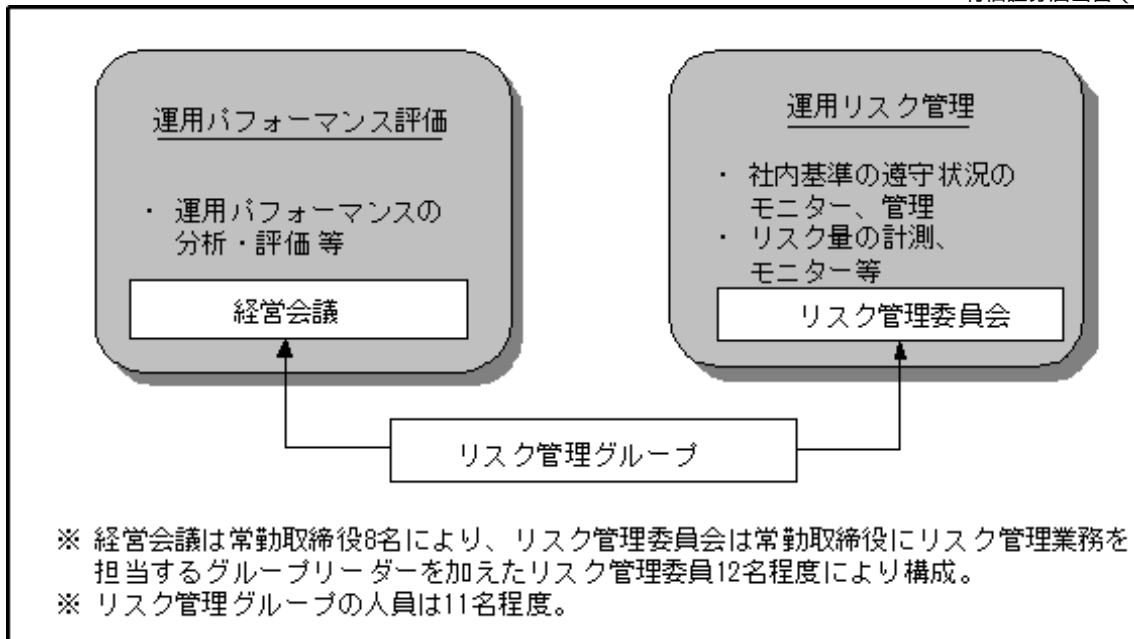
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができます。

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

#### 注意事項

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

#### <運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

上記体制は平成25年10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0.63%\*（税抜0.60%）

\*消費税率が8%になった場合は、年率0.648%となります。

信託報酬の配分（税抜）	
委託会社	年率0.55%
販売会社	年率0.02%
受託会社	年率0.03%

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (4)【その他の手数料等】

###### 1. 信託財産留保額

ありません。

## 2. その他の費用

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、信託財産から支払われます。

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、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（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当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

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1日現在のもので、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、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別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25年10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	2,408,329,301	100.00
内 日本	2,408,329,301	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	82,707	0.00
純資産総額	2,408,246,594	100.00

（参考）マザーファンドの投資状況

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	309,966,448,564	96.38
内 アメリカ	181,744,938,770	56.51
内 ユーロ	43,523,740,703	13.53
内 イギリス	31,445,364,937	9.78
内 カナダ	14,443,526,855	4.49
内 スイス	13,166,159,174	4.09
内 オーストラリア	11,077,660,416	3.44
内 スウェーデン	4,661,169,181	1.45
内 香港	4,120,106,156	1.28
内 シンガポール	2,115,034,024	0.66
内 デンマーク	1,650,329,096	0.51
内 ノルウェー	1,241,985,628	0.39
内 イスラエル	624,787,791	0.19
内 ニューージーランド	151,645,833	0.05
投資信託受益証券	1,004,966,660	0.31
内 オーストラリア	876,896,786	0.27
内 シンガポール	128,069,874	0.04
投資証券	5,552,976,536	1.73
内 アメリカ	4,422,552,402	1.38
内 ユーロ	467,040,436	0.15
内 イギリス	399,253,644	0.12
内 香港	140,100,423	0.04
内 カナダ	124,029,631	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,069,961,656	1.58
純資産総額	321,594,353,416	100.00

その他資産の投資状況

平成25年10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（売建）	527,522,000	0.16
内 日本	527,522,000	0.16



株価指数先物取引(買建)	4,255,237,410	1.32
内 アメリカ	2,558,191,413	0.80
内 ユーロ	877,986,167	0.27
内 イギリス	415,948,437	0.13
内 オーストラリア	228,272,665	0.07
内 カナダ	174,838,728	0.05

(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。

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成25年10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	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	1,135,468,789	2.0523 2,330,431,290	2.1210 2,408,329,301	- -	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成25年10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【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)マザーファンドの投資資産

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 投資有価証券の主要銘柄

平成25年10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	107,027	45,815.43 4,903,488,520	51,711.83 5,534,563,035	- -	1.72%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	507,034	8,722.92 4,422,819,086	8,748.67 4,435,874,716	- -	1.38%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	903,689	2,799.20 2,529,609,194	3,501.04 3,163,856,216	- -	0.98%
4	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	30,938	77,843.16 2,408,311,963	101,506.67 3,140,413,486	- -	0.98%
5	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	1,177,904	2,305.81 2,716,029,703	2,597.70 3,059,851,468	- -	0.95%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	320,109	7,489.19 2,397,357,449	9,140.74 2,926,034,068	- -	0.91%
7	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	367,856	6,892.24 2,535,353,720	7,171.59 2,638,114,250	- -	0.82%
8	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	220,803	11,404.05 2,518,049,392	11,850.75 2,616,681,814	- -	0.81%
9	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	311,755	7,565.08 2,358,453,602	8,030.53 2,503,559,501	- -	0.78%
10	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	573,525	3,481.58 1,996,773,537	4,245.78 2,435,061,548	- -	0.76%
11	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	2,117,677	1,142.74 2,419,961,563	1,079.72 2,286,508,692	- -	0.71%
12	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	748,257	2,665.68 1,994,614,168	3,046.91 2,279,874,953	- -	0.71%
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	431,483	4,855.91 2,095,244,427	5,181.62 2,235,783,531	- -	0.70%
14	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	80,063	22,526.13 1,803,510,005	27,427.24 2,195,907,516	- -	0.68%
15	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	612,873	3,476.50 2,130,655,855	3,571.97 2,189,165,563	- -	0.68%
16	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	119,719	19,656.29 2,353,232,238	17,746.57 2,124,602,392	- -	0.66%
17	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	262,263	6,925.34 1,816,262,336	7,768.31 2,037,341,727	- -	0.63%
18	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サービス	5,541,746	265.08 1,469,046,498	357.17 1,979,346,359	- -	0.62%

19	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	456,309	3,638.75 1,660,394,933	3,902.96 1,780,958,603	- -	0.55%
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融サービス	1,228,649	1,196.43 1,469,995,168	1,395.88 1,715,054,798	- -	0.53%
21	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融サービス	346,426	4,381.93 1,518,017,073	4,914.66 1,702,567,356	- -	0.53%
22	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,161,863	711.03 1,537,156,230	761.41 1,646,075,780	- -	0.51%
23	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	186,197	8,860.68 1,649,833,435	8,800.88 1,638,698,086	- -	0.51%
24	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	325,567	4,380.75 1,426,230,264	4,977.71 1,620,578,209	- -	0.50%
25	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	344,093	4,069.55 1,400,306,129	4,456.59 1,533,482,248	- -	0.48%
26	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	435,795	3,352.66 1,461,075,665	3,450.06 1,503,520,989	- -	0.47%
27	TOTAL SA ユーロ	株式 石油・ガス・消耗燃料	244,335	5,100.64 1,246,265,618	6,118.26 1,494,905,570	- -	0.46%
28	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・ カタログ販売	41,351	26,532.11 1,097,129,383	35,569.99 1,470,854,689	- -	0.46%
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	176,176	7,141.42 1,258,147,891	8,345.76 1,470,323,882	- -	0.46%
30	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	559,940	2,319.95 1,299,036,285	2,596.23 1,453,736,917	- -	0.45%

（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25年10月31日現在

種類	投資比率
株式	96.38%
投資信託受益証券	0.31%
投資証券	1.73%
合計	98.42%

（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

平成25年10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	8.79%
商業銀行		7.94%
医薬品		6.70%
保険		4.25%
各種金融サービス		3.05%
メディア		2.89%

化学
各種電気通信サービス
食品
ソフトウェア
コンピュータ・周辺機器
飲料
食品・生活必需品小売り
金属・鉱業
資本市場
情報技術サービス
航空宇宙・防衛
コングロマリット
インターネットソフトウェア・サービス
ホテル・レストラン・レジャー
専門小売り
機械
バイオテクノロジー
家庭用品
電力
エネルギー設備・サービス
半導体・半導体製造装置
タバコ
ヘルスケア機器・用品
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
総合公益事業
繊維・アパレル・贅沢品
通信機器
自動車
電気設備
陸運・鉄道
無線通信サービス
インターネット販売・カタログ販売
不動産管理・開発
航空貨物・物流サービス
消費者金融
複合小売り
自動車部品
専門サービス
商業サービス・用品
建設・土木
ライフサイエンス・ツール/サービス
電子装置・機器・部品
パーソナル用品
建設資材
商社・流通業

2.79%
2.75%
2.58%
2.35%
2.31%
2.27%
2.26%
2.22%
2.16%
2.14%
2.08%
2.05%
1.78%
1.70%
1.70%
1.67%
1.59%
1.58%
1.56%
1.52%
1.46%
1.41%
1.39%
1.38%
1.32%
1.28%
1.23%
1.11%
0.91%
0.89%
0.88%
0.81%
0.59%
0.58%
0.57%
0.57%
0.55%
0.46%
0.44%
0.39%
0.35%
0.33%
0.30%
0.30%
0.28%

家庭用耐久財	0.27%
容器・包装	0.21%
建設関連製品	0.20%
ガス	0.19%
運送インフラ	0.16%
紙製品・林産品	0.12%
旅客航空輸送業	0.12%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12%
販売	0.09%
レジャー用品	0.09%
海運業	0.09%
水道	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.06%
事務用電子機器	0.04%
各種消費者サービス	0.03%
合計	96.38%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

平成25年10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・ドル売/円買2013年11月	売建	3,300,000	325,012,510	325,050,000	0.10%
		ユーロ売/円買2013年11月	売建	800,000	108,212,960	108,208,000	0.03%
		イギリス・ポンド売/円買2013年11月	売建	300,000	47,388,000	47,385,000	0.01%
		オーストラリア・ドル売/円買2013年11月	売建	300,000	28,072,950	28,071,000	0.01%
		カナダ・ドル売/円買2013年11月	売建	200,000	18,808,900	18,808,000	0.01%
株価指数先物取引	アメリカ	S & P 500 FUTURE Dec 13	買建	59	2,471,416,417	2,558,191,413	0.80%
	ユーロ	DJ EURO STOXX 50 Dec 13	買建	214	847,777,671	877,986,167	0.27%
	イギリス	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec 13	買建	39	403,316,366	415,948,437	0.13%
	オーストラリア	SPI 200 FUTURE S Dec 13	買建	18	222,382,256	228,272,665	0.07%
	カナダ	S & P / TSE 60 IX FUT Dec 13	買建	12	167,009,173	174,838,728	0.05%

（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場で評価しています。

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

**(3)【運用実績】****【純資産の推移】**

直近日（平成25年10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21年10月13日）	420	420	1.4011	1.4011
第2計算期間末 （平成22年10月12日）	785	785	1.3801	1.3801
第3計算期間末 （平成23年10月12日）	1,384	1,384	1.2569	1.2569
第4計算期間末 （平成24年10月12日）	1,435	1,435	1.5126	1.5126
第5計算期間末 （平成25年10月15日）	2,338	2,338	2.2824	2.2824
平成24年10月末日	1,641	-	1.5246	-
11月末日	1,709	-	1.5875	-
12月末日	1,852	-	1.6985	-
平成25年1月末日	2,131	-	1.8898	-
2月末日	1,761	-	1.9061	-
3月末日	1,912	-	1.9814	-
4月末日	1,937	-	2.1058	-
5月末日	2,094	-	2.2318	-
6月末日	2,019	-	2.0914	-
7月末日	2,136	-	2.1881	-
8月末日	2,134	-	2.1607	-
9月末日	2,309	-	2.2464	-
10月末日	2,408	-	2.3580	-

**【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

**【収益率の推移】**

	収益率(%)
第1計算期間	40.1
第2計算期間	1.5



第3計算期間	8.9
第4計算期間	20.3
第5計算期間	50.9

(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。

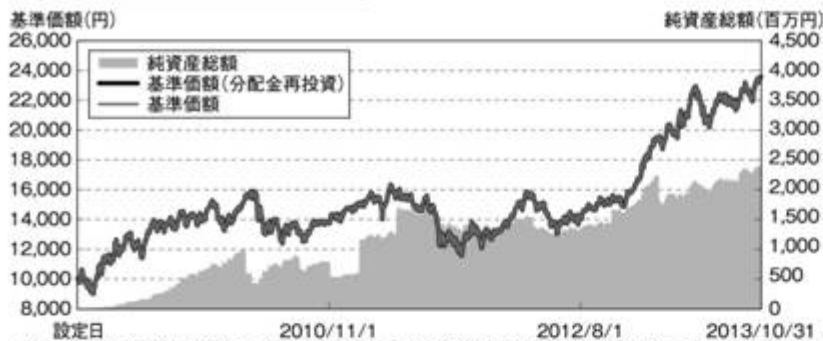
なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日: 2013年10月31日

## 基準価額・純資産の推移

《設定日(2009年1月30日)～2013年10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: 2009年1月30日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第1期(2009.10.13)	0円
第2期(2010.10.12)	0円
第3期(2011.10.12)	0円
第4期(2012.10.12)	0円
第5期(2013.10.15)	0円
設定来累計	0円

(注) 分配金は1万円当たりです。

## 主要な資産の状況

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

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

## ■外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド

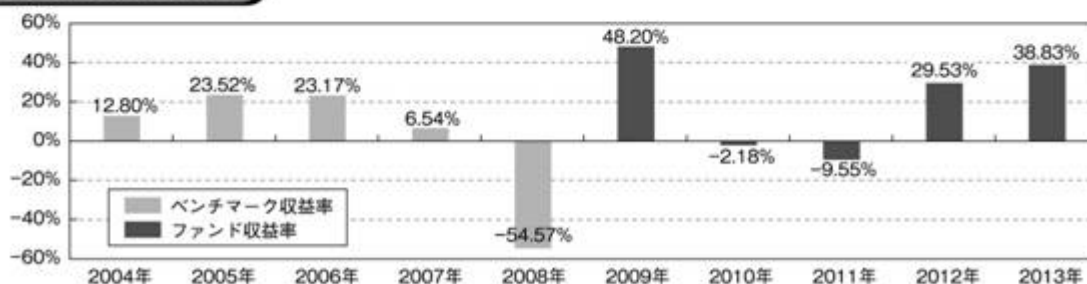
(注) 投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。内書きおよび地域は、通貨で区分けております。

ポートフォリオの状況

組入上位10銘柄

資産の種類	投資比率(%)	順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率	
株式	96.38	1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	1.72%	
内 アメリカ	56.51	2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.38%	
内 ユーロ	13.53	3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	0.98%	
内 イギリス	9.78	4	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	0.98%	
内 カナダ	4.49	5	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.95%	
内 スイス	4.09	6	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.91%	
内 その他	7.98	7	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.82%	
投資信託受益証券	0.31	8	CHEVRON CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	0.81%	
内 オーストラリア	0.27	9	PROCTER & GAMBLE CO	株式	アメリカ	家庭用品	0.78%	
内 シンガポール	0.04	10	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.76%	
投資証券	1.73	その他資産の投資状況					組入上位5業種(外国株式)	
内 アメリカ	1.38	資産の種類		投資比率(%)		順位	業種	投資比率
内 ユーロ	0.15	為替予約取引(売建)		△0.16		1	石油・ガス・消耗燃料	8.79%
内 イギリス	0.12	株価指数先物取引(買建)		1.32		2	商業銀行	7.94%
内 香港	0.04							
内 カナダ	0.04							
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.58							
純資産総額	100.00							

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。  
 ※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2009年は設定日から年末までの収益率、および2013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。  
 ※2008年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは「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)」です。

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

○当該ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○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。

**(4)【設定及び解約の実績】**

	設定口数	解約口数
第1計算期間	318,344,117	18,552,944
第2計算期間	853,875,247	584,626,892
第3計算期間	854,825,606	322,473,439
第4計算期間	104,491,214	257,037,399
第5計算期間	475,377,397	399,642,041

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい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）を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の受付は、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。

ただし、海外休業日には、お申込みの受付を行いません。

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額となります。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、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。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。

お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・お申込手数料

ありません。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を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）に払い込まれます。

## 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、委託会社に対し、解約の請求をすることができます。受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の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

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

なお、外貨建資産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において、委託会社にて計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

#### (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21年1月30日から原則として無期限です。

ただし、下記「(5)その他 イ．償還規定」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】

- 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12日までとします。
- 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ます。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## (5)【その他】

### イ.償還規定

- a. 委託会社は、受益権総口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合またはやむを得ない事情が発生した場合には、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、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 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。
- g. 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. 信託約款の変更等b.」の書面決議が否決された場合を除き、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。
- h. 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違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託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. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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。
- i. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、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、上記b.に規定する書面に付記します。

### ロ. 信託約款の変更等

- 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またはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a.からg.の規定にしたがい信託約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、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取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。
- j. 上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

## 八．関係法人との契約の更改

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

## 二．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。（URL <http://www.diam.co.jp/>）

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

## ホ．運用報告書

委託会社は、原則として毎年10月12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、当該信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。なお、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】

### (1) 収益分配金受領権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。



受益者が収益分配金支払開始日から5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。

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計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。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。

## (2) 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てします。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

## (3) 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、受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとしします。

## (4) 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5期計算期間（平成24年10月13日から平成25年10月15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】

D I A M外国株式パッシブ・ファンド

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成24年10月12日現在	第5期 平成25年10月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,411,563	7,248,006
親投資信託受益証券	1,435,117,511	2,338,295,752
未収入金	921,000	5,314,000
流動資産合計	1,440,450,074	2,350,857,758
<b>資産合計</b>		
	1,440,450,074	2,350,857,758
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	922,585	5,453,855
未払受託者報酬	212,932	341,283
未払委託者報酬	4,046,466	6,485,183
その他未払費用	50,496	80,977
流動負債合計	5,232,479	12,361,298
<b>負債合計</b>		
	5,232,479	12,361,298
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 948,845,510	<sup>1</sup> 1,024,580,866
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	486,372,085	1,313,915,594
（分配準備積立金）	59,691,612	664,440,391
元本等合計	1,435,217,595	2,338,496,460
<b>純資産合計</b>		
	1,435,217,595	2,338,496,460
<b>負債純資産合計</b>		
	1,440,450,074	2,350,857,758

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	平成23年10月13日 至 平成24年10月12日	自	平成24年10月13日 至 平成25年10月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		3,959		6,091
有価証券売買等損益		282,072,519		812,494,241
営業収益合計		282,076,478		812,500,332
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		437,072		631,687
委託者報酬		8,305,868		12,003,703
その他費用		103,650		149,858
営業費用合計		8,846,590		12,785,248
営業利益又は営業損失( )		273,229,888		799,715,084
経常利益又は経常損失( )		273,229,888		799,715,084
当期純利益又は当期純損失( )		273,229,888		799,715,084
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( )		48,987,357		161,662,493
期首剰余金又は期首欠損金( )		282,917,386		486,372,085
剰余金増加額又は欠損金減少額		45,839,423		408,224,121
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		45,839,423		408,224,121
剰余金減少額又は欠損金増加額		66,627,255		218,733,203
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		66,627,255		218,733,203
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		486,372,085		1,313,915,594

## (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10月12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25年10月15日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期 平成24年10月12日現在	第5期 平成25年10月15日現在
1. 1 期首元本額	1,101,391,695円	948,845,510円
期中追加設定元本額	104,491,214円	475,377,397円
期中一部解約元本額	257,037,399円	399,642,041円
2. 受益権の総数	948,845,510口	1,024,580,866口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期 自 平成23年10月13日 至 平成24年10月12日	第5期 自 平成24年10月13日 至 平成25年10月15日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(33,197,842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(426,680,473円)及び分配準備積立金(26,493,770円)より分配対象収益は486,372,085円(1万口当たり5,125.94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(48,140,405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(576,281,665円)、信託約款に規定される収益調整金(649,475,203円)及び分配準備積立金(40,018,321円)より分配対象収益は1,313,915,594円(1万口当たり12,823.93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。

## （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4期 自 平成23年10月13日 至 平成24年10月12日	第5期 自 平成24年10月13日 至 平成25年10月15日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 平成24年10月12日現在	第5期 平成25年10月15日現在
1． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2． 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期 平成24年10月12日現在	第5期 平成25年10月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	232,606,099	674,518,018
合計	232,606,099	674,518,018

（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4期 平成24年10月12日現在	第5期 平成25年10月15日現在
1口当たり純資産額	1.5126円	2.2824円
（1万口当たり純資産額）	(15,126円)	(22,824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25年10月15日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザー ファンド	1,139,298,262	2,338,295,752	
親投資信託受益証券 合計		1,139,298,262	2,338,295,752	
合計		1,139,298,262	2,338,295,752	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



（参考）

当ファンドは、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成24年10月12日現在	平成25年10月15日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,528,936,009	3,898,001,621
コール・ローン		80,696,311	91,169,010
株式		259,335,404,110	305,333,797,461
投資信託受益証券		944,984,604	1,034,341,199
投資証券		5,046,732,275	5,479,037,368
派生商品評価勘定		9,593,051	62,860,054
未収入金		4,279,135	17,692,020
未収配当金		379,301,016	379,719,672
差入委託証拠金		2,113,328,183	1,212,132,263
流動資産合計		272,443,254,694	317,508,750,668
資産合計		272,443,254,694	317,508,750,668
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		78,706,536	8,289,680
未払解約金		125,731,000	90,242,000
流動負債合計		204,437,536	98,531,680
負債合計		204,437,536	98,531,680
純資産の部			
元本等			
元本	1	201,439,925,559	154,653,983,066
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		70,798,891,599	162,756,235,922
元本等合計		272,238,817,158	317,410,218,988
純資産合計		272,238,817,158	317,410,218,988
負債純資産合計		272,443,254,694	317,508,750,668

## 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>株式</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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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、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</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. 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>
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>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24年10月12日現在	平成25年10月15日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	235,731,204,305円	201,439,925,559円
同期中追加設定元本額	37,872,489,491円	11,813,182,890円
同期中一部解約元本額	72,163,768,237円	58,599,125,383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	1,061,870,153円	1,139,298,262円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C 年金 >	34,380,690,072円	33,233,222,819円

D I A Mバランス・ファン ド< D C年金> 1 安定 型	197,634,364円	166,093,995円
D I A Mバランス・ファン ド< D C年金> 2 安 定・成長型	1,082,571,927円	936,552,009円
D I A Mバランス・ファン ド< D C年金> 3 成長 型	1,294,674,315円	1,185,023,858円
D I A M D C バラン ス30インデックスファン ド	195,944,813円	156,024,350円
D I A M D C バラン ス50インデックスファン ド	528,559,538円	451,895,736円
D I A M D C バラン ス70インデックスファン ド	374,423,524円	356,925,810円
マネックス資産設計ファン ド< 隔月分配型>	68,084,936円	80,863,075円
マネックス資産設計ファン ド< 育成型>	825,825,719円	1,034,737,023円
マネックス資産設計ファン ド エボリューション	155,200,393円	170,599,208円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国10)	37,247円	5,346,667円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国20)	55,871円	7,329,877円
D I A M D C 8資産 バランスファンド(新興 国30)	74,494円	13,063,657円
投資のソムリエ	- 円	908,501円
クルーズコントロール	- 円	1,348,999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)	554,368,358円	463,777,037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)	5,714,700,547円	4,277,967,049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	6,065,297,792円
D I A Mワールドバラン ス25V A(適格機関投 資家限定)	78,142,013円	55,195,486円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	7,998,870,265円	4,764,833,646円
D I A Mグローバル・バ ランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	1,363,833,768円	940,460,073円
D I A M国際分散バラン スファンド30V A(適 格機関投資家限定)	165,565,078円	118,213,196円

D I A M国際分散バ ランスファンド5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	941,692,175円	659,176,935円
D I A M国内重視バ ランスファンド3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	82,653,435円	56,459,354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)	154,233,663円	112,775,400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)	15,657,111,284円	12,636,746,851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)	7,808,375,478円	6,292,874,724円
D I A Mバランスファン ド2 5 V A ( 適格機関投 資家限定)	2,646,159,735円	1,990,189,895円
D I A Mバランスファン ド3 7 . 5 V A ( 適格機 関投資家限定)	2,248,664,227円	1,781,527,014円
D I A Mバランスファン ド5 0 V A ( 適格機関投 資家限定)	5,925,765,954円	4,848,550,390円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A ( 適格機関投資家限定)	4,674,094,087円	3,233,260,795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)	6,069,896,883円	4,434,131,908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)	4,018,058,020円	2,716,792,185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)	3,866,523,389円	2,463,151,543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)	17,251,005,700円	12,036,769,160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)	2,992,696,027円	2,386,723,846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)	123,819,718円	84,874,987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)	21,768,904,647円	16,033,589,626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)	2,059,073,778円	1,314,848,706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)	3,983,438,165円	2,844,294,394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)	13,305,797,412円	9,783,897,381円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限 定)	167,917円	302,758,001円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限 定)	261,317円	1,933,859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)	17,514,523,051円	12,984,158,404円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限 定)	78,260円	63,236円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限 定)	159,845円	135,263円
計	201,439,925,559円	154,653,983,066円
2. 受益権の総数	201,439,925,559口	154,653,983,066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23年10月13日 至 平成24年10月12日	自 平成24年10月13日 至 平成25年10月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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24年10月12日現在	平成25年10月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(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24年10月12日現在	平成25年10月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	10,350,405,931	28,291,898,509
投資信託受益証券	162,280,099	3,132,739
投資証券	319,609,751	129,809,895
合計	10,832,295,781	28,165,221,353

(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24年10月12日まで及び平成25年2月16日から平成25年10月15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24年10月12日 現在				平成25年10月15日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	84,006,497	-	84,438,800	432,303	58,435,700	-	58,486,000	50,300
アメリカ・ドル	7,811,800	-	7,851,000	39,200	39,376,900	-	39,428,000	51,100
イギリス・ポンド	12,495,300	-	12,598,000	102,700	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	56,120,050	-	56,413,000	292,950	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	19,058,800	-	19,058,000	800
シンガポール・ドル	5,654,704	-	5,654,000	704	-	-	-	-
香港・ドル	1,924,643	-	1,922,800	1,843	-	-	-	-
合計	84,006,497	-	84,438,800	432,303	58,435,700	-	58,486,000	50,300

(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。

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24年10月12日 現在				平成25年10月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	6,886,861,999	-	6,818,180,817	68,681,182	5,408,495,585	-	5,463,116,259	54,620,674
合計	6,886,861,999	-	6,818,180,817	68,681,182	5,408,495,585	-	5,463,116,259	54,620,674

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成24年10月12日現在	平成25年10月15日現在
1口当たり純資産額	1.3515円	2.0524円
(1万口当たり純資産額)	(13,515円)	(20,524円)

[次へ](#)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成25年10月15日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	42,566	310.700	13,225,256.200	
	ABBOTT LABORATORIES	182,708	34.000	6,212,072.000	
	AES CORP	75,129	13.810	1,037,531.490	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	121,668	186.970	22,748,265.960	
	ADOBE SYSTEMS INC	57,711	52.630	3,037,329.930	
	ACE LTD	40,865	94.500	3,861,742.500	
	AGCO CORP	11,661	62.580	729,745.380	
	AIRGAS INC	6,292	109.470	688,785.240	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22,987	109.170	2,509,490.790	
	ENERGEN CORP	8,985	80.570	723,921.450	
	ALLEGHANY CORP	1,956	405.070	792,316.920	
	ALLERGAN INC	35,741	90.230	3,224,910.430	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	107,996	58.360	6,302,646.560	
	RALPH LAUREN CORP	7,149	161.100	1,151,703.900	
	ALLSTATE CORP	56,333	52.820	2,975,509.060	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	86,619	85.980	7,447,501.620	
	ALTERA CORPORATION	38,100	37.310	1,421,511.000	
	ALCOA INC	123,518	8.450	1,043,727.100	
	AMGEN INC	87,750	111.580	9,791,145.000	
	HESS CORP	34,306	81.310	2,789,420.860	
	BEAM INC	14,795	68.330	1,010,942.350	
	AMERICAN EXPRESS CO	114,037	76.070	8,674,794.590	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	55,495	44.070	2,445,664.650	
	AFLAC INC	51,836	64.490	3,342,903.640	
	AMERICAN INTL GROUP	163,475	50.230	8,211,349.250	
	ANALOG DEVICES	37,380	47.270	1,766,952.600	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	57,893	95.750	5,543,254.750	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,914	107.010	2,345,017.140	
	NABORS INDUSTRIES LTD	36,022	17.290	622,820.380	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	56,765	35.640	2,023,104.600	
	TIME WARNER	110,477	68.040	7,516,855.080	
	VALERO ENERGY CORP	67,007	36.570	2,450,445.990	
APACHE CORP	44,015	88.620	3,900,609.300		
ANSYS INC	9,305	85.910	799,392.550		

APPLE INC	108,803	496.040	53,970,640.120	
APPLIED MATERIALS INC	128,032	18.100	2,317,379.200	
ALBEMARLE CORP	10,917	63.990	698,578.830	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	78,603	36.970	2,905,952.910	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	13,584	55.540	754,455.360	
AMEREN CORP	25,297	35.530	898,802.410	
ARROW ELECTRONICS INC	11,621	49.160	571,288.360	
ASHLAND INC	9,468	88.390	836,876.520	
AUTOLIV INC	10,829	90.610	981,215.690	
AUTODESK INC	27,402	40.990	1,123,207.980	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	55,082	72.860	4,013,274.520	
AUTOZONE INC	4,116	426.040	1,753,580.640	
AVERY DENNISON CORP	8,865	43.150	382,524.750	
AVNET INC	15,099	42.490	641,556.510	
AVON PRODUCTS INC	52,897	20.950	1,108,192.150	
BAKER HUGHES INC	48,267	50.420	2,433,622.140	
BALL CORP	17,019	45.570	775,555.830	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	126,211	116.000	14,640,476.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	140,173	31.180	4,370,594.140	
CR BARD INC	9,099	120.290	1,094,518.710	
BAXTER INTERNATIONAL INC	61,008	66.480	4,055,811.840	
BED BATH & BEYOND INC	20,557	77.270	1,588,439.390	
BECTON DICKINSON & CO	21,201	102.760	2,178,614.760	
AMETEK INC	25,338	45.610	1,155,666.180	
VERIZON COMM INC	334,764	46.810	15,670,302.840	
WR BERKLEY CORP	11,053	43.820	484,342.460	
BEST BUY CO INC	33,006	39.610	1,307,367.660	
YUM! BRANDS INC	53,600	66.940	3,587,984.000	
FIRSTENERGY CORP	51,798	37.930	1,964,698.140	
SLM CORP	58,143	25.210	1,465,785.030	
H&R BLOCK INC	33,589	27.730	931,422.970	
ENSCO PLC-CL A	27,725	55.120	1,528,202.000	
BOEING CO	83,987	119.460	10,033,087.020	
ROBERT HALF INTL INC	14,807	39.630	586,801.410	
BORGWARNER INC	13,686	103.000	1,409,658.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	166,092	12.210	2,027,983.320	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	21,232	59.460	1,262,454.720	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	192,709	47.670	9,186,438.030	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	6,595	189.080	1,246,982.600	

ONEOK INC	24,605	55.050	1,354,505.250	
SEMPRA ENERGY	25,660	87.050	2,233,703.000	
FEDEX CORP	33,914	115.370	3,912,658.180	
VERISIGN INC	20,783	51.690	1,074,273.270	
AMPHENOL CORP	19,291	77.100	1,487,336.100	
BROWN-FORMAN CORP	14,456	70.400	1,017,702.400	
QUANTA SERVICES INC	25,480	28.370	722,867.600	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	18,492	27.610	510,564.120	
SIRIUS XM RADIO INC	345,664	3.935	1,360,187.840	
CSX CORP	122,939	26.020	3,198,872.780	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	20,538	16.410	337,028.580	
CABOT OIL & GAS CORP	51,824	36.780	1,906,086.720	
CAMPBELL SOUP CO	22,764	40.820	929,226.480	
SEAGATE TECHNOLOGY	40,239	47.330	1,904,511.870	
WHITING PETROLEUM CORP	13,133	64.870	851,937.710	
CONSTELLATION BRANDS INC	19,719	63.180	1,245,846.420	
CARDINAL HEALTH INC	37,293	54.880	2,046,639.840	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	45,706	32.100	1,467,162.600	
CATERPILLAR INC	75,230	86.240	6,487,835.200	
CELGENE CORP	48,968	154.340	7,557,721.120	
CORE LABORATORIES N.V.	6,020	175.430	1,056,088.600	
CITRIX SYSTEMS INC	19,857	58.540	1,162,428.780	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	58,295	26.450	1,541,902.750	
CENTURYLINK INC	63,731	32.680	2,082,729.080	
CERNER CORP	37,038	55.950	2,072,276.100	
JPMORGAN CHASE & CO	437,231	52.710	23,046,446.010	
CHUBB CORP	31,655	90.380	2,860,978.900	
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,505	61.400	1,074,807.000	
CIGNA CORP	34,621	79.250	2,743,714.250	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16,516	48.990	809,118.840	
CINTAS CORP	8,876	51.880	460,486.880	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	134,501	4.380	589,114.380	
CISCO SYSTEMS INC	613,641	23.340	14,322,380.940	
CLOROX COMPANY	15,155	84.480	1,280,294.400	
EQUINIX INC	5,159	166.120	857,013.080	
COCA-COLA CO/THE	462,336	37.910	17,527,157.760	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	30,102	41.040	1,235,386.080	
COLGATE-PALMOLIVE CO	105,654	61.530	6,500,890.620	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	30,686	42.040	1,290,039.440	

COMCAST CORP-SPECIAL CL A	62,487	45.060	2,815,664.220	
COMERICA INC	18,671	40.790	761,590.090	
NRG ENERGY, INC.	33,814	27.940	944,763.160	
COMCAST CORP-CL A	245,387	46.460	11,400,680.020	
CA INC	39,190	29.770	1,166,686.300	
COMPUTER SCIENCES CORP	19,843	52.140	1,034,614.020	
CONAGRA FOODS INC	45,240	30.760	1,391,582.400	
CONSOLIDATED EDISON INC	36,790	55.960	2,058,768.400	
CMS ENERGY CORP	35,850	26.940	965,799.000	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	30,745	63.770	1,960,608.650	
MOLSON COORS BREWING CO	17,190	51.820	890,785.800	
CORNING INC	174,193	14.410	2,510,121.130	
DIRECTV	59,742	61.175	3,654,716.850	
CREE INC	13,242	73.190	969,181.980	
SEALED AIR CORP	20,323	27.320	555,224.360	
BROADCOM CORP-CL A	55,671	26.680	1,485,302.280	
CUMMINS INC	20,085	134.070	2,692,795.950	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	11,144	94.980	1,058,457.120	
DR HORTON INC	34,671	18.250	632,745.750	
DANAHER CORP	67,314	69.550	4,681,688.700	
MOODY ' S CORP	25,138	71.620	1,800,383.560	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	33,650	88.220	2,968,603.000	
TARGET CORP	72,637	63.650	4,623,345.050	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,668	63.880	425,951.840	
DEERE & CO	43,812	83.100	3,640,777.200	
DELL INC	183,328	13.845	2,538,176.160	
MORGAN STANLEY	176,590	28.180	4,976,306.200	
REPUBLIC SERVICES INC	29,354	33.190	974,259.260	
THE WALT DISNEY CO	200,754	66.830	13,416,389.820	
DOLLAR TREE INC	24,068	58.860	1,416,642.480	
DOVER CORP	18,750	90.780	1,702,125.000	
DOW CHEMICAL	138,081	40.820	5,636,466.420	
OMNICOM GROUP	27,703	63.950	1,771,606.850	
DTE ENERGY CO	21,998	66.490	1,462,647.020	
XL GROUP PLC	34,834	31.450	1,095,529.300	
DUKE ENERGY CORP	84,260	68.580	5,778,550.800	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	35,585	71.930	2,559,629.050	
FLOWSERVE CORP	17,139	63.410	1,086,783.990	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,429	50.960	888,181.840	
EBAY INC	133,900	54.770	7,333,703.000	

EMC CORP/MASS	239,154	25.390	6,072,120.060	
BANK OF AMERICA CORP	1,244,783	14.350	17,862,636.050	
CITIGROUP INC	350,411	49.600	17,380,385.600	
EASTMAN CHEMICAL CO	19,571	78.310	1,532,605.010	
EATON CORP PLC	56,239	68.950	3,877,679.050	
EATON VANCE CORP	12,917	38.700	499,887.900	
DISH NETWORK CORP	28,168	47.650	1,342,205.200	
ECOLAB INC	30,394	100.710	3,060,979.740	
ELECTRONIC ARTS INC	35,610	24.590	875,649.900	
SALESFORCE.COM INC	65,152	51.170	3,333,827.840	
EMERSON ELECTRIC CO	80,965	65.600	5,311,304.000	
WEATHERFORD INTL LTD	91,917	15.970	1,467,914.490	
ENTERGY CORP	21,729	64.860	1,409,342.940	
EOG RESOURCES INC	30,776	181.060	5,572,302.560	
EQUIFAX INC	14,577	61.150	891,383.550	
EQT CORP	17,893	89.750	1,605,896.750	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	27,824	71.650	1,993,589.600	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	20,066	43.580	874,476.280	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	95,132	63.070	5,999,975.240	
EXXON MOBIL CORP	515,388	87.600	45,147,988.800	
FMC CORP	16,287	72.180	1,175,595.660	
NEXTERA ENERGY INC	50,017	81.060	4,054,378.020	
FAMILY DOLLAR STORES	13,430	69.630	935,130.900	
ASSURANT INC	8,352	57.890	483,497.280	
FASTENAL CO	34,680	48.100	1,668,108.000	
FIFTH THIRD BANCORP	105,628	18.310	1,934,048.680	
M&T BANK CORP	13,571	114.880	1,559,036.480	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	13,945	73.940	1,031,093.300	
FISERV INC	16,418	102.370	1,680,710.660	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	33.170	478,377.740	
MACY ' S INC	40,826	42.580	1,738,371.080	
FORD MOTOR CO	426,609	17.180	7,329,142.620	
FOREST LABORATORIES INC	24,901	43.400	1,080,703.400	
FOSSIL GROUP INC	6,562	120.250	789,080.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	50,418	51.450	2,594,006.100	
FREEPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	123,221	33.870	4,173,495.270	
FLEXTRONICS INTL LTD	74,709	9.050	676,116.450	
GAP INC/THE	34,421	36.920	1,270,823.320	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	15,658	44.730	700,382.340	
GENERAL DYNAMICS CORP	33,279	87.810	2,922,228.990	
GENERAL MILLS INC	72,462	48.340	3,502,813.080	

GENUINE PARTS CO	18,750	79.910	1,498,312.500	
GILEAD SCIENCES INC	178,830	63.870	11,421,872.100	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	23,633	67.500	1,595,227.500	
MCKESSON CORP	26,247	138.690	3,640,196.430	
NVIDIA CORP	71,382	15.490	1,105,707.180	
GENERAL ELECTRIC CO	1,194,370	24.380	29,118,740.600	
WW GRAINGER INC	7,144	258.610	1,847,509.840	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	15,422	68.950	1,063,346.900	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	20,710	75.030	1,553,871.300	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	35,897	18.200	653,325.400	
HALLIBURTON CO	94,567	51.350	4,856,015.450	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,686	55.130	919,899.180	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	51,621	159.460	8,231,484.660	
HARLEY-DAVIDSON INC	25,751	65.690	1,691,583.190	
HARRIS CORP	14,775	59.730	882,510.750	
CONSOL ENERGY INC	28,063	38.420	1,078,180.460	
HASBRO INC	11,176	46.520	519,907.520	
HENRY SCHEIN INC	10,751	108.110	1,162,290.610	
DENBURY RESOURCES INC	47,155	18.470	870,952.850	
HELMERICH & PAYNE INC	13,583	75.110	1,020,219.130	
HERSHEY FOODS CORP	16,263	93.520	1,520,915.760	
HEWLETT-PACKARD CO	232,782	22.900	5,330,707.800	
F5 NETWORKS INC	9,598	90.210	865,835.580	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	41.540	536,655.260	
REYNOLDS AMERICAN INC	36,837	50.980	1,877,950.260	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	14,788	79.910	1,181,709.080	
JUNIPER NETWORKS INC	62,508	20.610	1,288,289.880	
HOLLYFRONTIER CORP	23,585	42.490	1,002,126.650	
HOLOGIC INC	34,080	22.190	756,235.200	
UNUM GROUP	30,372	31.280	950,036.160	
HOME DEPOT INC	167,672	76.350	12,801,757.200	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,878	68.080	944,814.240	
HORMEL FOODS CORP	14,878	42.970	639,307.660	
HUDSON CITY BANCORP INC	61,279	9.400	576,022.600	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,422	24.410	1,059,931.020	
HUMANA INC	20,043	95.670	1,917,513.810	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,635	73.180	705,089.300	
RED HAT INC	23,998	42.840	1,028,074.320	
BIOGEN IDEC INC	27,579	238.840	6,586,968.360	
ILLINOIS TOOL WORKS	47,293	77.250	3,653,384.250	

INTUIT INC	33,577	67.430	2,264,097.110	
INGERSOLL-RAND PLC	36,286	65.680	2,383,264.480	
INTEL CORP	579,851	23.450	13,597,505.950	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,998	81.320	813,037.360	
INTL GAME TECH	36,187	18.430	666,926.410	
INTERNATIONAL PAPER CO	50,098	45.340	2,271,443.320	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	55,606	16.930	941,409.580	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,497	58.350	845,899.950	
JOHNSON & JOHNSON	325,046	89.800	29,189,130.800	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,681	33.180	1,714,775.580	
JOHNSON CONTROLS INC	81,485	42.280	3,445,185.800	
KLA-TENCOR CORP	16,662	62.870	1,047,539.940	
DEVON ENERGY CORP	42,827	60.940	2,609,877.380	
KELLOGG CO	31,667	60.290	1,909,203.430	
KEYCORP	112,373	11.930	1,340,609.890	
KIMBERLY-CLARK CORP	43,931	96.960	4,259,549.760	
BLACKROCK INC/NEW YORK	15,296	282.270	4,317,601.920	
KOHL'S CORP	23,092	51.490	1,189,007.080	
KROGER CO	55,601	41.620	2,314,113.620	
LSI CORP	55,560	7.740	430,034.400	
LAM RESEARCH CORP	20,116	53.300	1,072,182.800	
AKAMAI TECHNOLOGIES	21,419	51.890	1,111,431.910	
LEGG MASON INC	13,165	35.040	461,301.600	
LEGGETT & PLATT INC	19,896	29.670	590,314.320	
LENNAR CORP	18,341	34.310	629,279.710	
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,049	28.560	1,029,559.440	
ELI LILLY & CO	116,140	49.030	5,694,344.200	
L BRANDS INC	30,268	57.490	1,740,107.320	
LINCOLN NATIONAL CORP	28,925	43.940	1,270,964.500	
LINEAR TECH CORP	29,629	40.010	1,185,456.290	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	83,168	90.360	7,515,060.480	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	41,714	51.360	2,142,431.040	
LOCKHEED MARTIN CORP	31,957	127.500	4,074,517.500	
LOEWS CORP	41,060	48.560	1,993,873.600	
RANGE RESOURCES CORP	19,980	79.330	1,585,013.400	
LOWE'S COS INC	128,590	48.880	6,285,479.200	
DOMINION RESOURCES INC/VA	69,278	62.610	4,337,495.580	
IRON MOUNTAIN INC	20,204	25.480	514,797.920	
SCANA CORP	17,601	45.790	805,949.790	
MDU RESOURCES GROUP INC	21,313	28.460	606,567.980	



MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,258	20.590	849,502.220	
MCCORMICK & CO INC	14,416	66.440	957,799.040	
MCDONALD'S CORPORATION	117,510	94.720	11,130,547.200	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	33,018	67.890	2,241,592.020	
EVEREST RE GROUP LTD	5,049	148.530	749,927.970	
MANPOWERGROUP INC	7,953	76.680	609,836.040	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	12,156	74.910	910,605.960	
MARSH & MCLENNAN COS	66,593	43.680	2,908,782.240	
ENERGIZER HOLDINGS INC	7,466	93.680	699,414.880	
MASCO CORP	46,833	20.280	949,773.240	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	98.110	500,557.220	
MATTEL INC	37,311	41.940	1,564,823.340	
METLIFE INC	107,497	48.670	5,231,878.990	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	34,242	30.080	1,029,999.360	
MEDTRONIC INC	114,453	55.190	6,316,661.070	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,156	17.830	965,601.480	
CVS CAREMARK CORP	144,566	59.690	8,629,144.540	
MERCK & CO. INC.	348,767	46.750	16,304,857.250	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,600	100.630	1,066,678.000	
MICROSOFT CORP	918,201	34.450	31,632,024.450	
MICRON TECH INC	123,712	17.070	2,111,763.840	
RACKSPACE HOSTING INC	13,630	49.520	674,957.600	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,985	40.390	766,804.150	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	50,668	11.420	578,628.560	
3M CO	75,182	121.400	9,127,094.800	
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,039	128.980	907,890.220	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	29,468	61.030	1,798,432.040	
KANSAS CITY SOUTHERN	13,384	112.730	1,508,778.320	
MURPHY OIL CORPORATION	22,178	61.380	1,361,285.640	
MYLAN LABORATORIES	42,232	39.480	1,667,319.360	
ILLUMINA INC	15,876	81.200	1,289,131.200	
XCEL ENERGY INC	60,378	28.040	1,692,999.120	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	45,346	80.080	3,631,307.680	
NETAPP INC	38,904	41.730	1,623,463.920	
SEARS HOLDINGS CORP	4,862	54.750	266,194.500	
NEWELL RUBBERMAID INC	29,362	27.800	816,263.600	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	104.940	385,864.380	
NEWMONT MINING CORP	59,837	25.740	1,540,204.380	

NIKE INC-CL B	84,625	74.060	6,267,327.500	
NOBLE CORP	30,714	37.860	1,162,832.040	
NOBLE ENERGY INC	39,596	67.400	2,668,770.400	
NORDSTROM INC	19,877	56.930	1,131,597.610	
NORFOLK SOUTHERN CORP	38,275	79.060	3,026,021.500	
NORTHEAST UTILITIES	34,447	41.730	1,437,473.310	
NISOURCE INC	33,928	30.820	1,045,660.960	
COACH INC	34,483	54.120	1,866,219.960	
NORTHERN TRUST CORP	26,469	55.250	1,462,412.250	
NORTHROP GRUMMAN CORP	26,680	98.810	2,636,250.800	
WELLS FARGO & CO	581,238	41.750	24,266,686.500	
NUCOR CORP	35,421	49.280	1,745,546.880	
MONSANTO CO	60,921	106.710	6,500,879.910	
CHENIERE ENERGY INC	23,885	36.610	874,429.850	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	69,223	72.100	4,990,978.300	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	93,791	95.710	8,976,736.610	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	13,732	82.700	1,135,636.400	
OGE ENERGY CORP	22,050	35.810	789,610.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,078	129.110	1,559,390.580	
OMNICARE INC	12,226	56.490	690,646.740	
ORACLE CORP	434,004	33.280	14,443,653.120	
OWENS-ILLINOIS INC	19,173	30.000	575,190.000	
PACCAR INC	39,230	56.580	2,219,633.400	
PALL CORP	13,652	77.420	1,056,937.840	
EXELON CORP	101,760	30.020	3,054,835.200	
PARKER HANNIFIN CORP	18,417	107.960	1,988,299.320	
PARTNERRE LTD	3,890	93.700	364,493.000	
PATTERSON COS INC	12,490	40.460	505,345.400	
PAYCHEX INC	40,014	40.900	1,636,572.600	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,943	45.810	638,728.830	
JC PENNEY CO INC HOLDING CO	20,021	7.870	157,565.270	
PPL CORPORATION	71,724	30.160	2,163,195.840	
PEPSICO INC	178,456	81.090	14,470,997.040	
PENTAIR LTD	26,019	65.990	1,716,993.810	
PERRIGO CO	10,959	130.950	1,435,081.050	
PFIZER INC	758,949	29.350	22,275,153.150	
CONOCOPHILLIPS	135,418	71.960	9,744,679.280	
PVH CORP	10,064	119.040	1,198,018.560	
PETSMART INC	12,432	72.780	904,800.960	
PG&E CORP	53,163	40.970	2,178,088.110	

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,788	195.010	2,883,807.880	
ALTRIA GROUP INC	236,133	35.740	8,439,393.420	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	60,797	72.980	4,436,965.060	
POLARIS INDUSTRIES INC	6,387	131.270	838,421.490	
GARMIN LTD	13,579	47.660	647,175.140	
AETNA INC	43,081	65.510	2,822,236.310	
FLUOR CORP (NEW)	19,968	73.740	1,472,440.320	
PPG INDUSTRIES INC	16,667	166.130	2,768,888.710	
PRAXAIR INC	32,891	122.250	4,020,924.750	
PRECISION CASTPARTS CORP	17,625	241.510	4,256,613.750	
COSTCO WHOLESALE CORP	50,865	116.260	5,913,564.900	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,682	74.480	2,061,755.360	
QUEST DIAGNOSTICS	19,752	58.630	1,158,059.760	
PROCTER & GAMBLE CO	316,846	78.740	24,948,454.040	
PROGRESSIVE CORP	63,937	26.760	1,710,954.120	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	62,905	33.740	2,122,414.700	
PULTE GROUP INC	40,688	15.990	650,601.120	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	47,010	15.660	736,176.600	
QUALCOMM INC	200,071	67.750	13,554,810.250	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	16,533	42.410	701,164.530	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,570	91.990	512,384.300	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,914	295.630	2,635,245.820	
RESMED INC	16,867	56.030	945,058.010	
US BANCORP	218,267	37.180	8,115,167.060	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,613	56.100	819,789.300	
ROSS STORES INC	24,171	72.980	1,763,999.580	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,374	105.470	883,205.780	
ROPER INDUSTRIES INC	12,181	130.880	1,594,249.280	
ROWAN COMPANIES PLC-A	13,327	37.040	493,632.080	
PEABODY ENERGY CORP	33,467	17.930	600,063.310	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,791	108.770	1,608,817.070	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,326	37.170	606,837.420	
RAYTHEON COMPANY	37,567	76.380	2,869,367.460	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	14,329	74.730	1,070,806.170	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,012	225.640	1,356,547.680	
FMC TECHNOLOGIES INC	28,849	58.100	1,676,126.900	
ACCENTURE PLC-CL A	77,007	72.660	5,595,328.620	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	200,619	30.680	6,154,990.920	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	23,210	44.170	1,025,185.700	
SANDISK CORP	28,831	63.030	1,817,217.930	
SAFEWAY INC	23,620	33.380	788,435.600	
ROCKWELL COLLINS INC	13,494	68.920	930,006.480	
ST JUDE MEDICAL INC	30,560	56.030	1,712,276.800	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	42,378	85.200	3,610,605.600	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	35,841	46.280	1,658,721.480	
PRICELINE.COM INC	6,148	1,017.630	6,256,389.240	
SCHLUMBERGER LTD	154,576	91.170	14,092,693.920	
SCHWAB (CHARLES) CORP	130,332	22.010	2,868,607.320	
JOY GLOBAL INC	12,702	52.030	660,885.060	
ZIMMER HOLDINGS INC	17,978	87.650	1,575,771.700	
SPX CORP	5,525	85.580	472,829.500	
BUNGE LTD	17,339	78.590	1,362,672.010	
SEI INVESTMENTS CO	15,882	31.900	506,635.800	
WELLPOINT INC	33,503	88.670	2,970,711.010	
AMERISOURCEBERGEN CORP	28,187	63.110	1,778,881.570	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	36,833	44.120	1,625,071.960	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,067	180.090	1,812,966.030	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,617	25.810	428,884.770	
SIGMA-ALDRICH	14,239	83.470	1,188,529.330	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	55,592	80.260	4,461,813.920	
ADVANCE AUTO PARTS	9,721	83.610	812,772.810	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	42,666	36.230	1,545,789.180	
EDISON INTERNATIONAL	34,152	47.430	1,619,829.360	
SOUTHERN CO	99,679	41.350	4,121,726.650	
BB&T CORP	82,994	33.820	2,806,857.080	
SOUTHWEST AIRLINES	17,528	15.310	268,353.680	
AT&T INC	624,202	33.920	21,172,931.840	
CHEVRON CORP	224,079	118.580	26,571,287.820	
MEADWESTVACO CORP	16,496	38.040	627,507.840	
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,491	91.580	1,601,825.780	
STAPLES INC	85,931	15.140	1,300,995.340	
STATE STREET CORP	55,303	67.270	3,720,232.810	
STARBUCKS CORP	81,949	78.100	6,400,216.900	
STRYKER CORP	33,395	70.810	2,364,699.950	
NETFLIX INC	6,260	324.360	2,030,493.600	
STERICYCLE INC	10,607	117.100	1,242,079.700	

SUNTRUST BANKS INC	64,306	33.430	2,149,749.580	
SYMANTEC CORP	83,895	25.180	2,112,476.100	
SYNOPSIS INC	14,312	37.960	543,283.520	
SYSCO CORP	73,723	32.110	2,367,245.530	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,904	401.680	1,969,838.720	
TESORO CORP	15,352	45.570	699,590.640	
TEXAS INSTRUMENTS INC	126,516	40.550	5,130,223.800	
TEXTRON INC	35,448	27.290	967,375.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	40,929	92.660	3,792,481.140	
TIFFANY & CO	15,300	76.460	1,169,838.000	
TOLL BROTHERS INC	17,142	31.100	533,116.200	
TORCHMARK CORP	9,110	73.290	667,671.900	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	30.150	411,155.550	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	21,994	57.550	1,265,754.700	
TRACTOR SUPPLY CO	17,814	65.710	1,170,557.940	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	31,924	29.870	953,569.880	
TYSON FOODS INC	28,867	29.350	847,246.450	
MARATHON OIL CORP	85,390	34.830	2,974,133.700	
UNION PACIFIC CORP	53,432	157.260	8,402,716.320	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	99,843	106.900	10,673,216.700	
UNITEDHEALTH GROUP INC	116,762	74.720	8,724,456.640	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,927	77.940	851,650.380	
VF CORP	9,486	197.580	1,874,243.880	
CBS CORP	63,397	57.050	3,616,798.850	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,119	73.710	1,925,231.490	
VULCAN MATERIALS CO	15,610	52.930	826,237.300	
URBAN OUTFITTERS INC	13,462	36.070	485,574.340	
WALGREEN CO	103,529	56.700	5,870,094.300	
WAL-MART STORES INC	190,881	74.680	14,254,993.080	
WASTE MANAGEMENT INC	52,872	41.720	2,205,819.840	
WATERS CORP	10,272	104.180	1,070,136.960	
ACTAVIS PLC	20,061	141.650	2,841,640.650	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	13,299	106.730	1,419,402.270	
WESTERN DIGITAL CORP	26,378	68.870	1,816,652.860	
WHIRLPOOL CORP	9,109	131.290	1,195,920.610	
WYNN RESORTS LTD	9,243	167.150	1,544,967.450	
WHOLE FOODS MARKET INC	39,177	61.890	2,424,664.530	
NASDAQ OMX GROUP	10,282	33.530	344,755.460	
CME GROUP INC	38,949	75.350	2,934,807.150	
WILLIAMS COS INC	78,697	35.770	2,814,991.690	

DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	51.870	452,098.920	
LKQ CORP	37,131	32.220	1,196,360.820	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	18.550	337,517.250	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	50.470	535,436.230	
WISCONSIN ENERGY CORP	28,552	41.050	1,172,059.600	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,824	56.520	442,212.480	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	26.990	670,701.500	
CARMAX INC	24,979	48.410	1,209,233.390	
XEROX CORP	146,264	10.660	1,559,174.240	
XILINX INC	32,314	47.450	1,533,299.300	
YAHOO! INC	117,324	34.000	3,989,016.000	
CIMAREX ENERGY CO	11,195	101.010	1,130,806.950	
TJX COMPANIES INC	80,643	56.190	4,531,330.170	
HOSPIRA INC	21,954	41.200	904,504.800	
CBRE GROUP INC	38,714	22.670	877,646.380	
LIBERTY GLOBAL PLC	24,021	76.960	1,848,656.160	
REGIONS FINANCIAL CORP	169,883	9.720	1,651,262.760	
GOOGLE INC	31,361	875.940	27,470,354.340	
T-MOBILE US INC	19,051	26.480	504,470.480	
LAS VEGAS SANDS CORP	49,833	68.890	3,432,995.370	
MOAIC CO/THE	35,034	45.410	1,590,893.940	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	46,732	33.580	1,569,260.560	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	175,792	33.690	5,922,432.480	
HERBALIFE LTD	11,353	64.710	734,652.630	
CELANESE CORP	19,554	53.230	1,040,859.420	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	73,694	8.520	627,872.880	
IHS INC-CLASS A	7,888	113.570	895,840.160	
DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	17,131	80.160	1,373,220.960	
EXPEDIA INC	14,711	48.510	713,630.610	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,231	206.080	1,490,164.480	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	21,642	94.540	2,046,034.680	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	15,627	73.060	1,141,708.620	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	21,690	26.320	570,880.800	
GAMESTOP CORP. - CL. A	14,066	51.780	728,337.480	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,847	195.660	1,731,004.020	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,718	79.260	611,728.680	
VIACOM INC-CLASS B	48,577	82.840	4,024,118.680	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,870	442.020	1,710,617.400	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	10,239	29.920	306,350.880	
NYSE EURONEXT	31,411	44.490	1,397,475.390	
TRANSDIGM GROUP INC	6,075	140.500	853,537.500	
MASTERCARD INC	12,012	689.100	8,277,469.200	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	54,765	25.740	1,409,651.100	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	17,165	61.930	1,063,028.450	
WESTERN UNION CO	72,733	18.680	1,358,652.440	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,629	46.270	399,263.830	
KBR INC	15,988	33.410	534,159.080	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	45,731	23.410	1,070,562.710	
SPECTRA ENERGY CORP	81,160	34.600	2,808,136.000	
TIME WARNER CABLE INC	34,878	114.680	3,999,809.040	
PEOPLE ' S UNITED FINANCIAL INC	35,585	14.850	528,437.250	
DELTA AIR LINES INC	22,701	24.110	547,321.110	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,159	112.960	695,720.640	
DISCOVER FINANCIAL	60,224	52.830	3,181,633.920	
COVIDIEN PLC	51,451	61.760	3,177,613.760	
TE CONNECTIVITY LTD	45,120	52.200	2,355,264.000	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	12,141	110.410	1,340,487.810	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,339	75.640	933,321.960	
VMWARE INC	10,086	80.280	809,704.080	
TERADATA CORP	19,646	52.580	1,032,986.680	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	7,107	118.220	840,189.540	
INVESCO LTD	54,025	34.650	1,871,966.250	
CALPINE CORP NPR	42,931	19.620	842,306.220	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	188,430	86.690	16,334,996.700	
VISA INC	59,486	193.440	11,506,971.840	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	26,275	44.170	1,160,566.750	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,996	41.010	902,055.960	
LORILLARD INC	47,014	47.050	2,212,008.700	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	11,070	78.320	867,002.400	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,733	73.530	715,667.490	
MARATHON PETROLEUM CORP	40,014	67.190	2,688,540.660	
CAREFUSION CORP	26,093	38.390	1,001,710.270	

KINDER MORGAN INC/DELAWARE	75,358	35.260	2,657,123.080	
XYLEM INC	22,549	28.170	635,205.330	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	49,733	75.710	3,765,285.430	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	26,085	44.230	1,153,739.550	
LINKEDIN CORP	10,629	228.500	2,428,726.500	
HCA HOLDINGS INC	28,526	46.330	1,321,609.580	
NIELSEN HOLDINGS NV	26,310	37.160	977,679.600	
VERISK ANALYTICS INC	19,955	67.260	1,342,173.300	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	23,363	75.420	1,762,037.460	

[次へ](#)



	FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	7,892	47.680	376,290.560	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	32,899	23.790	782,667.210	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	7,245	137.190	993,941.550	
	CIT GROUP INC	24,840	50.120	1,244,980.800	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	713,000	0.785	559,705.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	38,091	57.050	2,173,091.550	
	AON PLC	35,899	73.690	2,645,397.310	
	REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	43.830	502,467.120	
	QEP RESOURCES INC	25,069	29.710	744,799.990	
	TESLA MOTORS INC	9,661	179.720	1,736,274.920	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	39.500	608,023.500	
	GENERAL MOTORS CO	89,662	35.330	3,167,758.460	
	TRIPADVISOR INC	12,944	75.010	970,929.440	
	MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	22,308	74.030	1,651,461.240	
	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	35,528	57.380	2,038,596.640	
	PHILLIPS 66	71,137	60.480	4,302,365.760	
	LIBERTY MEDIA CORP	11,365	149.660	1,700,885.900	
	FACEBOOK INC	193,636	49.510	9,586,918.360	
	ADT CORP	23,368	40.010	934,953.680	
	KRAFT FOODS GROUP INC	69,953	52.360	3,662,739.080	
	ABBVIE INC	182,126	46.330	8,437,897.580	
	ZOETIS INC	51,278	32.290	1,655,766.620	
	NEWS CORP/NEW-CL A	43,948	16.560	727,778.880	
	SPRINT CORP	97,357	6.030	587,062.710	
アメリカ・ドル	小計	35,904,385		1,824,100,014.280 (179,819,779,408)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	92,697	3.969	367,914.390	
	AMEC PLC	28,599	10.850	310,299.150	
	ANTOFAGASTA PLC	44,020	8.670	381,653.400	
	SEVERN TRENT PLC	28,908	18.080	522,656.640	
	BHP BILLITON PLC	241,429	18.165	4,385,557.780	
	BARCLAYS PLC	1,776,031	2.768	4,916,053.800	
	BT GROUP PLC	898,740	3.535	3,177,045.900	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	125,523	8.770	1,100,836.710	
	AGGREKO PLC	27,635	14.650	404,852.750	
	TULLOW OIL PLC	110,342	10.000	1,103,420.000	
	BUNZL PLC	34,501	13.290	458,518.290	
	EASYJET PLC	13,628	12.630	172,121.640	

CAPITA PLC	82,174	10.070	827,492.180	
AVIVA PLC	348,949	4.255	1,484,777.990	
CRODA INTERNATIONAL	18,042	25.100	452,854.200	
DIAGEO PLC	293,712	19.535	5,737,663.920	
SCHRODERS PLC	12,609	26.500	334,138.500	
NATIONAL GRID PLC	421,773	7.505	3,165,406.360	
GKN PLC	182,053	3.606	656,483.110	
KINGFISHER PLC	286,010	3.738	1,069,105.380	
BAE SYSTEMS PLC	394,089	4.438	1,748,966.980	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	220,066	32.320	7,112,533.120	
COBHAM PLC	147,144	2.860	420,831.840	
NEXT PLC	17,675	50.250	888,168.750	
REXAM PLC	94,964	4.780	453,927.920	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	116,230	22.110	2,569,845.300	
IMI PLC	37,027	14.930	552,813.110	
JOHNSON MATTHEY PLC	21,473	29.870	641,398.510	
SABMILLER PLC	111,241	29.700	3,303,857.700	
ANGLO AMERICAN PLC	155,970	15.235	2,376,202.950	
COMPASS GROUP PLC	205,337	8.620	1,770,004.940	
HSBC HOLDINGS PLC	2,148,277	6.898	14,818,814.740	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	714,594	1.986	1,419,183.680	
ARM HOLDINGS PLC	161,360	9.865	1,591,816.400	
CENTRICA PLC	604,992	3.587	2,170,106.300	
UNILEVER PLC	144,796	23.830	3,450,488.680	
MEGGITT PLC	95,590	5.410	517,141.900	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	274,675	2.794	767,441.950	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82,325	6.995	575,863.370	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	411,297	1.193	490,677.320	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	46,419	19.630	911,204.970	
PEARSON PLC	99,504	13.060	1,299,522.240	
PERSIMMON PLC	29,923	11.950	357,579.850	
PRUDENTIAL PLC	296,626	11.830	3,509,085.580	
RIO TINTO PLC	145,727	30.840	4,494,220.680	
VODAFONE GROUP PLC	5,630,493	2.215	12,471,541.990	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	73,583	43.440	3,196,445.520	
REED ELSEVIER PLC	127,990	8.405	1,075,755.950	
OLD MUTUAL PLC	601,615	1.910	1,149,084.650	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	218,608	11.250	2,459,340.000	

ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	270,153	3.717	1,004,158.700	
TRAVIS PERKINS PLC	32,096	17.630	565,852.480	
SSE PLC	110,312	14.420	1,590,699.040	
SERCO GROUP PLC	72,250	5.375	388,343.750	
BP PLC	2,191,105	4.434	9,715,359.570	
SHIRE PLC	63,164	24.560	1,551,307.840	
SAGE GROUP PLC(THE)	136,991	3.237	443,439.860	
INVENSYS PLC	92,740	5.010	464,627.400	
SMITHS GROUP PLC	46,973	13.960	655,743.080	
STANDARD CHARTERED PLC	274,735	14.695	4,037,230.820	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,334,483	0.756	4,032,869.140	
TATE & LYLE PLC	60,088	7.580	455,467.040	
BG GROUP PLC	390,434	12.055	4,706,681.870	
TESCO PLC	960,967	3.615	3,473,895.700	
3I GROUP PLC	119,685	3.563	426,437.650	
SMITH & NEPHEW PLC	93,652	7.860	736,104.720	
GLAXOSMITHKLINE PLC	578,876	15.685	9,079,670.060	
WEIR GROUP	26,057	23.460	611,297.220	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	17,421	15.880	276,645.480	
BABCOCK INT'L GROUP	43,025	11.850	509,846.250	
WPP PLC	154,991	12.420	1,924,988.220	
WOLSELEY PLC	28,868	32.110	926,951.480	
ASTRAZENECA PLC	143,598	31.865	4,575,750.270	
WHITBREAD PLC	22,710	32.260	732,624.600	
CARNIVAL PLC	22,689	20.550	466,258.950	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	195,589	4.756	930,221.280	
INTERTEK GROUP PLC	19,178	32.660	626,353.480	
WILLIAM HILL PLC	104,797	4.199	440,042.600	
BURBERRY GROUP PLC	53,390	15.850	846,231.500	
INVESTEC PLC	50,655	4.229	214,219.990	
INTERCONTINENTAL HOTELS	31,773	18.080	574,455.840	
VEDANTA RESOURCES PLC	14,891	10.290	153,228.390	
ICAP PLC	52,823	3.616	191,007.960	
ITV PLC	446,892	1.849	826,303.300	
SAINSBURY (J) PLC	147,222	3.900	574,165.800	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	10,689	43.370	463,581.930	
G4S PLC	171,953	2.419	415,954.300	
ADMIRAL GROUP PLC	22,361	12.290	274,816.690	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	435,795	20.220	8,811,774.900	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	300,720	21.245	6,388,796.400	

	INMARSAT PLC	63,120	7.100	448,152.000	
	PETROFAC LTD	29,942	13.600	407,211.200	
	STANDARD LIFE PLC	275,631	3.564	982,348.880	
	EXPERIAN PLC	123,000	11.780	1,448,940.000	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	10.090	261,603.430	
	TUI TRAVEL PLC	52,043	3.697	192,402.970	
	MELROSE PLC	160,488	3.000	481,464.000	
	FRESNILLO PLC NPR	23,779	9.370	222,809.230	
	RESOLUTION LTD	174,815	3.360	587,378.400	
	GLENCORE XSTRATA PLC	1,250,553	3.312	4,141,831.530	
	COCA-COLA HBC AG	25,293	17.290	437,315.970	
イギリス・ポンド 小計		34,048,367		194,287,582.140 (30,555,608,043)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	133,450	18.560	2,476,832.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	181,502	13.190	2,394,011.380	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	313,742	6.551	2,055,323.840	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	66,569	31.000	2,063,639.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	104,972	143.600	15,073,979.200	
	ISRAEL CORP LTD/THE	126	1,860.000	234,360.000	
イスラエル・シュケル 小計		800,361		24,298,145.420 (678,161,238)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	35.580	455,246.100	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	320,687	31.140	9,986,193.180	
	AMCOR LTD	144,717	10.350	1,497,820.950	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	363,326	32.950	11,971,591.700	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	190,644	4.970	947,500.680	
	TELSTRA CORP LTD	500,182	4.930	2,465,897.260	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,181	10.330	580,349.730	
	AMP LTD	324,183	4.530	1,468,548.990	
	ASX LTD	22,288	34.680	772,947.840	
	BHP BILLITON LTD	373,674	35.060	13,101,010.440	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	14,149	18.290	258,785.210	
	ALS LTD	34,895	9.880	344,762.600	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	3.140	319,491.860	
	COMPUTERSHARE LT	50,472	9.970	503,205.840	
	CSL LIMITED	55,433	65.350	3,622,546.550	
TRANSURBAN GROUP	160,451	7.000	1,123,157.000		

COCA-COLA AMATIL LTD	77,149	12.400	956,647.600	
COCHLEAR LTD	5,226	59.910	313,089.660	
ORIGIN ENERGY LTD	132,784	14.170	1,881,549.280	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	188,728	72.520	13,686,554.560	
BORAL LIMITED	84,744	4.720	399,991.680	
RIO TINTO LIMITED	46,842	61.650	2,887,809.300	
APA GROUP	122,365	5.960	729,295.400	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,859	5.830	1,305,097.970	
FLIGHT CENTRE LTD	4,423	49.380	218,407.740	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	10.500	375,795.000	
ORICA LTD	34,301	20.250	694,595.250	
LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	17.420	379,006.940	
SYDNEY AIRPORT	66,175	4.020	266,023.500	
MACQUARIE GROUP LTD	32,683	47.740	1,560,286.420	
WORLEYPARSONS LTD	23,411	22.000	515,042.000	
SUNCORP GROUP LTD	158,665	12.780	2,027,738.700	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	272,953	34.760	9,487,846.280	
NEWCREST MINING LTD	92,633	10.100	935,593.300	
INCITEC PIVOT LTD	165,148	2.640	435,990.720	
TOLL HOLDINGS LTD	72,011	5.700	410,462.700	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	127,737	1.445	184,579.960	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,314	14.290	2,047,957.060	
SANTOS LTD	120,305	14.530	1,748,031.650	
SONIC HEALTHCARE	45,868	15.640	717,375.520	
TABCORP HOLDINGS LTD	129,182	3.250	419,841.500	
WESFARMERS LTD	120,134	41.600	4,997,574.400	
ALUMINA LIMITED	388,179	1.000	388,179.000	
ILUKA RESOURCES LIM I	55,637	10.810	601,435.970	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	72,757	38.040	2,767,676.280	
WOOLWORTHS LTD	148,206	33.690	4,993,060.140	
METCASH LTD	79,084	3.230	255,441.320	
SEEK LTD	29,830	11.750	350,502.500	
TATTS GROUP LTD	141,350	3.100	438,185.000	
SP AUSNET	234,780	1.220	286,431.600	
AGL ENERGY LTD	57,550	15.720	904,686.000	
BRAMBLES LTD	188,833	9.140	1,725,933.620	
WHITEHAVEN COAL LTD	66,260	1.785	118,274.100	
ASCIANO LTD	108,957	5.860	638,488.020	
CROWN LTD	46,332	15.850	734,362.200	

	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	109,246	2.720	297,149.120	
	AURIZON HOLDINGS LTD	210,167	4.670	981,479.890	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	4.790	270,165.580	
オーストラリア・ドル 小計		7,267,583		114,752,690.360 (10,776,425,151)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	24,022	25.360	609,197.920	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	15,943	68.330	1,089,385.190	
	BARRICK GOLD CORP	118,208	17.810	2,105,284.480	
	ATCO LTD	2,966	46.540	138,037.640	
	TALISMAN ENERGY INC	125,274	12.710	1,592,232.540	
	BANK OF MONTREAL	73,939	69.830	5,163,160.370	
	BANK OF NOVA SCOTIA	138,192	59.900	8,277,700.800	
	NATIONAL BANK OF CANADA	17,129	85.820	1,470,010.780	
	BCE INC	32,838	44.670	1,466,873.460	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	63,495	39.810	2,527,735.950	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	35,515	113.410	4,027,756.150	
	BOMBARDIER INC ' B '	155,097	4.970	770,832.090	
	SAPUTO INC	15,632	51.350	802,703.200	
	BLACKBERRY LTD	56,591	8.350	472,534.850	
	CGI GROUP INC	22,652	37.530	850,129.560	
	CAE INC	31,436	11.280	354,598.080	
	CAMECO CORP	45,703	18.090	826,767.270	
	ROGERS COMM-CL B	46,012	45.600	2,098,147.200	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	45,092	82.760	3,731,813.920	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	122,521	33.300	4,079,949.300	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	9,334	93.510	872,822.340	
	CANADIAN UTILITIES LTD	15,036	36.170	543,852.120	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	49,716	109.490	5,443,404.840	
	AGRIUM INC	18,409	86.120	1,585,383.080	
	YAMANA GOLD INC	100,733	9.510	957,970.830	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,491	48.040	552,027.640	
	OPEN TEXT CORP	7,329	78.000	571,662.000	
	ELDORADO GOLD CORP	78,309	6.000	469,854.000	
	KINROSS GOLD CORP	125,461	4.810	603,467.410	
	FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	23.350	400,686.000	
FORTIS INC	20,884	31.710	662,231.640		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,423	18.610	1,310,572.030		
TELUS CORP	26,152	34.640	905,905.280		

GREAT WEST LIFECO INC	39,777	30.270	1,204,049.790	
IMPERIAL OIL LTD	36,639	45.120	1,653,151.680	
ENBRIDGE INC	88,371	42.960	3,796,418.160	
IGM FINANCIAL INC	14,041	48.740	684,358.340	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	49,079	4.260	209,076.540	
MANULIFE FINANCIAL CORP	209,272	17.700	3,704,114.400	
LOBLAW CO LTD	17,526	46.320	811,804.320	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	35,435	22.700	804,374.500	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	44.750	430,942.500	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,894	88.030	2,279,448.820	
SUN LIFE FINANCIAL INC	72,863	33.770	2,460,583.510	
METRO INC	13,859	65.860	912,753.740	
HUSKY ENERGY INC	35,673	29.500	1,052,353.500	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,756	38.950	1,704,296.200	
ONEX CORP	10,676	54.050	577,037.800	
GOLDCORP INC	91,035	24.480	2,228,536.800	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	104,742	32.460	3,399,925.320	
POWER CORP OF CANADA	39,841	29.040	1,156,982.640	
POWER FINANCIAL CORP	32,185	32.430	1,043,759.550	
ROYAL BANK OF CANADA	169,491	68.030	11,530,472.730	
SNC-LAVALIN GROUP INC	20,986	44.270	929,050.220	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,454	134.080	2,876,552.320	
SHAW COMM INC-B	39,522	24.960	986,469.120	
SHOPPERS DRUG MART CORP	22,208	60.010	1,332,702.080	
NEW GOLD INC	51,627	5.720	295,306.440	
SUNCOR ENERGY INC	174,406	36.800	6,418,140.800	
ENCANA CORP	87,507	18.300	1,601,378.100	
TECK RESOURCES LTD-CL B	60,753	27.160	1,650,051.480	
THOMSON REUTERS CORP	41,062	35.940	1,475,768.280	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	106,409	92.510	9,843,896.590	
TRANSCANADA CORP	81,270	45.330	3,683,969.100	
TRANSALTA CORP	34,014	13.670	464,971.380	
WESTON (GEORGE) LTD	7,627	83.030	633,269.810	
INTACT FINANCIAL CORP	16,454	62.630	1,030,514.020	
SILVER WHEATON CORP	41,308	22.900	945,953.200	
CATAMARAN CORP	25,679	49.650	1,274,962.350	
BELL ALIANT INC	14,926	26.190	390,911.940	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,024	42.410	679,577.840	

	CI FINANCIAL CORP	16,122	31.920	514,614.240	
	TOURMALINE OIL CORP	15,779	39.700	626,426.300	
	KEYERA CORP	8,738	57.940	506,279.720	
	ALTAGAS LTD	12,358	35.720	441,427.760	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,549	33.410	1,287,922.090	
	TIM HORTONS INC	18,155	60.490	1,098,195.950	
	DOLLARAMA INC	6,908	85.430	590,150.440	
	BAYTEX ENERGY CORP	11,962	42.130	503,959.060	
	MEG ENERGY CORP	17,794	34.610	615,850.340	
	ATHABASCA OIL CORP	42,987	7.380	317,244.060	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	91,611	31.010	2,840,857.110	
	ENERPLUS CORP	20,814	17.140	356,751.960	
	VERMILION ENERGY INC	12,420	57.890	718,993.800	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	52,457	11.690	613,222.330	
	ARC RESOURCES LTD	38,621	26.800	1,035,042.800	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	53,022	20.330	1,077,937.260	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	31.650	353,467.200	
	BONAVISTA ENERGY CORP	16,429	12.610	207,169.690	
	PENGROWTH ENERGY CORP	76,902	6.610	508,322.220	
	カナダ・ドル 小計	4,304,511		149,706,410.200 (14,267,020,892)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.170	521,250.000	
	SEBFCORP INDUSTRIES	139,000	5.260	731,140.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	169,000	4.130	697,970.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.525	431,361.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	210,000	16.460	3,456,600.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	63,000	10.360	652,680.000	
	SEBFCORP MARINE	108,000	4.530	489,240.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	36.600	475,800.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	7.240	629,880.000	
	CAPITALAND LTD	332,000	3.130	1,039,160.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	765,400	1.450	1,109,830.000	
	KEPPEL CORP LTD	174,500	10.850	1,893,325.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	332,000	1.895	629,140.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	0.970	399,410.110	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	280,200	10.240	2,869,248.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	914,867	3.710	3,394,156.570	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	10.210	667,734.000	



	KEPPEL LAND LTD	95,000	3.580	340,100.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	146,000	20.600	3,007,600.000	
	UOL GROUP LIMITED	9,000	6.280	56,520.000	
	STARHUB LTD	65,000	4.350	282,750.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	88,800	1.445	128,316.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.250	650,000.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.145	264,495.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	120,000	1.970	236,400.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	381,000	2.940	1,120,140.000	
	シンガポール・ドル 小計	6,347,570		26,174,245.680 (2,075,879,425)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	172,163	28.620	4,927,305.060	
	SYNGENTA AG	10,522	361.000	3,798,442.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	374,051	61.650	23,060,244.150	
	CIE FINANC RICHEMONT	60,354	91.650	5,531,444.100	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	81,331	239.900	19,511,306.900	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,813	132.900	905,447.700	
	SIKA INHABER	262	2,623.000	687,226.000	
	SGS SA-REG	576	2,062.000	1,187,712.000	
	SULZER AG-REG	3,187	137.200	437,256.400	
	NOVARTIS AG-REG SHS	266,892	68.000	18,148,656.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,702	103.800	591,867.600	
	BARRY CALLEBAUT AG	390	907.000	353,730.000	
	SWISSCOM AG-REG	2,920	441.200	1,288,304.000	
	ABB LTD	253,934	21.140	5,368,164.760	
	ADECCO SA-REG	15,348	65.250	1,001,457.000	
	GEBERIT AG	4,974	238.200	1,184,806.800	
	LONZA GROUP AG-REG	5,846	73.300	428,511.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	3,789.000	344,799.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	43,910.000	570,830.000	
	UBS AG-REGISTERED	419,521	18.630	7,815,676.230	
	GIVAUDAN-REG	909	1,215.000	1,104,435.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,823	235.500	3,961,816.500	
	HOLCIM LTD-REG	27,289	65.700	1,792,887.300	
	ACTELION	12,017	63.550	763,680.350	
	SONOVA HOLDING AG	6,168	111.400	687,115.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,445	117.700	758,576.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,717	578.000	2,148,426.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	100.700	559,086.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,824	130.500	238,032.000	

	SWISS LIFE HOLDING AG	3,553	173.700	617,156.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,280	327.000	418,560.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,711	70.000	609,770.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	221.200	444,612.000	
	ARYZTA AG	8,596	63.050	541,977.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,855	43.140	1,029,104.700	
	SWISS RE LTD	40,573	76.150	3,089,633.950	
	TRANSOCEAN LTD	44,184	40.740	1,800,056.160	
スイス・フラン	小計	1,898,396		117,708,113.460 (12,731,309,552)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	77,654	191.200	14,847,444.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,459	172.400	7,319,931.600	
	ELEKTA AB	46,758	101.500	4,745,937.000	
	ERICSSON LM-B SHS	351,413	82.950	29,149,708.350	
	GETINGE AB-B SHS	22,760	200.300	4,558,828.000	
	SKF AB-B SHS	43,481	180.500	7,848,320.500	
	SANDVIK AB	108,906	92.150	10,035,687.900	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	184,986	73.100	13,522,476.600	
	SKANSKA AB-B SHS	39,626	122.700	4,862,110.200	
	SWEDBANK AB	107,424	157.400	16,908,537.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	73,365	159.400	11,694,381.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,673	279.400	16,952,036.200	
	VOLVO AB-B SHS	166,786	93.700	15,627,848.200	
	SCANIA AB	35,390	137.300	4,859,047.000	
	SWEDISH MATCH AB	24,727	224.300	5,546,266.100	
	TELE2 AB-B SHS	44,358	82.500	3,659,535.000	
	NORDEA AB	312,020	77.650	24,228,353.000	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	116.800	2,143,630.400	
	ELECTROLUX AB-SER B	28,642	164.500	4,711,609.000	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	72.900	1,987,326.900	
	INVESTOR AB-B SHS	55,047	200.600	11,042,428.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	109,009	271.100	29,552,339.900	
	ASSA ABLOY AB-B	39,701	298.000	11,830,898.000	
	TELIASONERA AB	280,470	49.000	13,743,030.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	28,131	138.500	3,896,143.500	
	BOLIDEN AB	17,761	90.400	1,605,594.400	
	ALFA LAVAL AB	41,066	152.800	6,274,884.800	
	KINNEVIK INVESTMENT B	23,218	225.300	5,231,015.400	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,723	554.000	4,278,542.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	54,633	40.690	2,223,016.770	

	RATOS AB	24,941	56.800	1,416,648.800	
	HEXAGON AB	29,365	184.600	5,420,779.000	
スウェーデン・クローナ 小計		2,528,107		301,724,336.120 (4,595,261,639)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,479	562.500	7,019,437.500	
	A P MOLLER A/S	147	52,900.000	7,776,300.000	
	AP MOLLER MAERSK A	62	49,600.000	3,075,200.000	
	DANSKE BANK A/S	84,736	121.500	10,295,424.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,277	201.700	5,905,170.900	
	NOVO NORDISK A/S-B	45,753	928.000	42,458,784.000	
	TDC A/S	84,208	48.990	4,125,349.920	
	COLOPLAST-B	15,865	318.900	5,059,348.500	
	DSV A/S	15,918	156.600	2,492,758.800	
	WILLIAM DEMANT	4,646	531.000	2,467,026.000	
デンマーク・クローネ 小計		293,091		90,674,799.620 (1,623,985,661)	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	111,882	9.420	1,053,928.440	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	341,753	2.295	784,323.130	
ニュージーランド・ドル 小計		453,635		1,838,251.570 (151,839,580)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	115,484	94.400	10,901,689.600	
	NORSK HYDRO ASA	130,459	25.470	3,322,790.730	
	TELENOR ASA	76,941	143.000	11,002,563.000	
	SUBSEA 7 SA	22,609	125.600	2,839,690.400	
	ORKLA ASA	86,098	44.200	3,805,531.600	
	STATOIL ASA	128,107	135.100	17,307,255.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	21,131	241.200	5,096,797.200	
	AKER SOLUTIONS ASA	18,936	80.300	1,520,560.800	
	SEADRILL LTD	45,817	272.900	12,503,459.300	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	21,678	95.100	2,061,577.800		
ノルウェー・クローネ 小計		667,260		70,361,916.130 (1,159,564,378)	
ユーロ	CRH PLC	92,675	18.180	1,684,831.500	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	43.195	614,016.920	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.231	559,676.500	
	UMICORE	13,643	34.915	476,345.340	
	AIR LIQUIDE	35,346	100.350	3,546,971.100	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	66,671	48.920	3,261,545.320	
	AXA	205,152	18.325	3,759,410.400	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,954	13.715	534,254.110	

ADIDAS AG	25,113	81.580	2,048,718.540	
ASSICURAZIONI GENERALI	126,408	16.500	2,085,732.000	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	309,702	1.038	321,470.670	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	38,837	15.415	598,672.350	
DANONE	68,158	53.480	3,645,089.840	
SAFRAN SA	31,493	45.950	1,447,103.350	
INTESA SANPAOLO	1,298,802	1.769	2,297,580.730	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	37,582	80.630	3,030,236.660	
ACCOR SA	17,313	32.890	569,424.570	
BOSKALIS WESTMINSTER CT	9,683	33.950	328,737.850	
BOUYGUES	22,659	28.110	636,944.490	
BNP PARIBAS	114,949	53.700	6,172,761.300	
REED ELSEVIER NV	85,681	14.635	1,253,941.430	
THALES SA	12,532	44.045	551,971.940	
CAP GEMINI SA	18,774	44.275	831,218.850	
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	79.690	523,324.230	
CHRISTIAN DIOR	6,765	146.000	987,690.000	
CGG	16,618	15.600	259,240.800	
UNICREDIT SPA	515,797	5.440	2,805,935.680	
NATIXIS	102,266	3.886	397,405.670	
KONINKLIJKE DSM NV	19,426	54.560	1,059,882.560	
DELHAIZE GROUP	12,505	43.805	547,781.520	
ELAN CORPORATION PLC	58,647	11.805	692,327.830	
COMMERZBANK AG	110,140	9.204	1,013,728.560	
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,176	91.180	1,383,747.680	
UNITED INTERNET	9,260	28.130	260,483.800	
FUCHS PETROLUB SE PREF	4,411	59.110	260,734.210	
PUBLICIS GROUPE	19,919	58.010	1,155,501.190	
MAN SE	5,152	88.090	453,839.680	
IBERDROLA SA	557,058	4.474	2,492,277.490	
ENI SPA	290,775	17.480	5,082,747.000	
JERONIMO MARTINS	33,291	14.290	475,728.390	
KESKO OYJ-B	8,791	21.710	190,852.610	
KBC GROUPE	24,972	38.535	962,296.020	
LAFARGE SA	19,853	49.660	985,899.980	
HANNOVER RUECK SE	5,730	54.380	311,597.400	
WARTSILA OYJ	21,069	31.770	669,362.130	
L'OREAL	29,216	123.250	3,600,872.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIV SA	28,603	144.800	4,141,714.400	
LAGARDERE S.C.A.	13,927	25.130	349,985.510	
GEA GROUP AG	20,171	30.930	623,889.030	

MEDIOBANCA SPA	81,452	6.210	505,816.920	
MICHELIN(CGDE)-B	21,992	78.190	1,719,554.480	
CONTINENTAL AG	13,371	133.400	1,783,691.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	100,548	23.670	2,379,971.160	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,126	34.430	520,788.180	
AXEL SPRINGER AG	6,021	43.355	261,040.450	
OMV AG	19,954	35.045	699,287.930	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	67,989	3.651	248,227.830	
PERNOD-RICARD	23,685	88.600	2,098,491.000	
PIRELLI & C	30,073	10.230	307,646.790	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	14,295	64.690	924,743.550	
RENAULT SA	23,230	65.510	1,521,797.300	
REPSOL SA	103,785	18.640	1,934,552.400	
REMY COINTREAU	3,877	75.080	291,085.160	
MERCK KGAA	7,924	115.200	912,844.800	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	93,739	72.240	6,771,705.360	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	48,205	37.440	1,804,795.200	
SAIPEM	35,323	15.420	544,680.660	
RWE AG	64,201	27.125	1,741,452.120	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	19,633	38.480	755,477.840	
SOCIETE GENERALE-A	79,252	40.685	3,224,367.620	
VINCI S.A.	50,724	45.340	2,299,826.160	
SODEXO	9,625	69.890	672,691.250	
SOLVAY SA	6,923	110.950	768,106.850	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	60,642	62.220	3,773,145.240	
VIVENDI SA	143,667	18.200	2,614,739.400	
SAP AG	104,954	53.820	5,648,624.280	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	12,461	86.750	1,080,991.750	
TELEFONICA S.A	468,433	12.485	5,848,386.000	
TOTAL SA	248,653	43.630	10,848,730.390	
VALLOUREC	11,847	43.100	510,605.700	
E.ON SE	210,787	13.900	2,929,939.300	
VOEST-ALPINE AG	15,072	34.450	519,230.400	
ZODIAC AEROSPACE	3,509	118.450	415,641.050	
HENKEL AG & CO KGAA	17,444	62.590	1,091,819.960	
METRO AG	11,655	30.980	361,071.900	
SIEMENS AG-REG	92,359	91.240	8,426,835.160	
UPM-KYMMENE OYJ	66,925	10.550	706,058.750	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	27,987	9.060	253,562.220	

ING GROEP NV-CVA	412,719	8.935	3,687,644.260	
BAYER AG	96,849	86.970	8,422,957.530	
STORA ENSO OYJ-R SHS	67,549	6.485	438,055.260	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,464	73.150	1,423,791.600	
DAIMLER AG	111,486	58.200	6,488,485.200	
BASF SE	107,176	71.450	7,657,725.200	
CELESIO AG	16,256	20.000	325,120.000	
BEIERSDORF AG	12,865	68.550	881,895.750	
HOCHTIEF AG	4,785	64.500	308,632.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	17,319	58.070	1,005,714.330	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	25,367	47.520	1,205,439.840	
ORANGE	218,731	10.135	2,216,838.680	
SAMPO OYJ-A SHS	51,825	33.180	1,719,553.500	
RANDSTAD HOLDINGS	13,985	40.550	567,091.750	
ALLIANZ SE	53,020	120.000	6,362,400.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	203,441	2.510	510,636.910	
KONINKLIJKE AHOLD NV	113,607	13.055	1,483,139.380	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	13,630	33.610	458,104.300	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	14.020	382,731.980	
ERSTE GROUP BANK AG	30,671	24.220	742,851.620	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	19,853	144.250	2,863,795.250	
ARCELOR MITTAL (NL)	102,748	11.285	1,159,511.180	
SOCIETE BIC SA	3,322	85.450	283,864.900	
DASSAULT SYSTEMES SA	7,659	86.240	660,512.160	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,046	24.390	488,921.940	
HEINEKEN NV	28,277	50.400	1,425,160.800	
AKZO NOBEL	28,476	48.050	1,368,271.800	
ASML HOLDING NV	41,667	71.320	2,971,690.440	
AEGON NV	221,649	5.759	1,276,476.590	
VOLKSWAGEN AG	3,623	168.950	612,105.850	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,186	175.450	3,015,283.700	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	640,177	8.940	5,723,182.380	
KERING	8,562	166.400	1,424,716.800	
CNP ASSURANCES	22,463	13.320	299,207.160	
ACCIONA S.A.	2,548	42.900	109,309.200	
FORTUM OYJ	52,604	16.830	885,325.320	
AGEAS	30,098	31.105	936,198.290	
UCB SA	13,239	44.795	593,041.000	
THYSSENKRUPP AG	44,483	18.520	823,825.160	
UNILEVER NV-CVA	190,151	27.610	5,250,069.110	

CARREFOUR SA	69,876	26.700	1,865,689.200	
GAS NATURAL SDG SA	36,738	16.695	613,340.910	
ATOS	6,025	58.260	351,016.500	
NOKIA OYJ	460,657	4.920	2,266,432.440	
POHJOLA BANK PLC	9,831	12.530	123,182.430	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	116,292	24.060	2,797,985.520	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,008	19.170	651,933.360	
SANOFI	140,101	73.200	10,255,393.200	
IMMOFINANZ AG	131,110	3.162	414,569.820	
STMICROELECTRONICS NV	80,884	6.730	544,349.320	
ELISA OYJ	13,898	18.120	251,831.760	
BANCO SANTANDER SA	1,297,338	6.597	8,558,538.780	
METSO OYJ	10,879	28.690	312,118.510	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	15,682	45.615	715,334.430	
QIAGEN N.V.	27,019	15.300	413,390.700	
LINDE AG	21,263	143.000	3,040,609.000	
FIAT SPA	119,079	6.405	762,700.990	
DEUTSCHE BANK AG-REG	115,984	35.700	4,140,628.800	
BMW VORZUG	6,146	61.330	376,934.180	
K & S	18,738	18.960	355,272.480	
SUEDZUCKER AG	11,866	22.130	262,594.580	
ENEL SPA	762,928	3.210	2,448,998.880	
COLRUYT NV	7,116	40.515	288,304.740	
VOPAK (KON.)	8,976	42.320	379,864.320	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	318,534	11.465	3,651,992.310	
BANCO POPULAR ESPANOL	144,093	4.105	591,501.760	
FINMECCANICA SPA	55,583	5.570	309,597.310	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	127,495	7.365	939,000.670	
KONINKLIJKE KPN NV	366,685	2.360	865,376.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	23,933	57.540	1,377,104.820	
BANCO SABADELL	421,242	1.915	806,678.430	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,358	63.740	596,478.920	
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.001	0.510	
OPAP SA	29,941	9.100	272,463.100	
FRAPORT AG	6,165	54.690	337,163.850	
HEINEKEN HOLDING NV-A	12,515	46.180	577,942.700	
INDITEX	24,890	114.000	2,837,460.000	
ANDRITZ AG	9,129	42.680	389,625.720	
MAPFRE SA	135,413	2.758	373,469.050	
ESSILOR INTL	24,973	79.480	1,984,854.040	
SNAM SPA	225,511	3.774	851,078.510	
CREDIT AGRICOLE SA	131,294	8.941	1,173,899.650	

ENAGAS	15,332	18.585	284,945.220	
WENDEL	4,087	99.790	407,841.730	
TENARIS SA	58,832	16.860	991,907.520	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	4.710	353,033.340	
TELECOM ITALIA SPA	1,035,863	0.691	715,781.330	
TELECOM ITALIA-RNC	792,074	0.536	424,551.660	
ATLANTIA SPA	38,919	15.600	607,136.400	
ILIAD SA	2,821	168.000	473,928.000	
BELGACOM SA	13,498	21.365	288,384.770	
SES FDR	39,141	21.200	829,789.200	
TERNA SPA	179,290	3.400	609,586.000	
GRIFOLS SA	17,550	29.020	509,301.000	
FERROVIAL SA	45,760	13.515	618,446.400	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	11,028	47.930	528,572.040	
EXOR SPA	9,585	30.060	288,125.100	
NESTE OIL OYJ	10,692	15.560	166,367.520	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	24.100	219,285.900	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.000	0.000	
FUGRO CERT	10,228	43.490	444,815.720	
KONE OYJ	18,998	65.750	1,249,118.500	
GDF SUEZ	150,719	19.355	2,917,166.240	
ALSTOM	28,395	25.335	719,387.320	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	36.200	181,905.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	21.820	380,759.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	31,118	25.050	779,505.900	
ARKEMA SA	7,958	83.870	667,437.460	
LEGRAND SA	27,260	41.445	1,129,790.700	
ADP	4,749	78.480	372,701.520	
ORION OYJ	8,051	18.600	149,748.600	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	12.550	426,925.900	
SCOR SE	14,425	24.425	352,330.620	
REXEL SA	20,799	18.805	391,125.190	
PRYSMIAN SPA	27,099	18.670	505,938.330	
CAIXABANK	152,053	3.757	571,263.120	
BUREAU VERITAS SA	30,760	21.705	667,645.800	
GROUPE EUROTUNNEL SA	76,011	6.848	520,523.320	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	12.455	282,392.210	
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	47,618	25.835	1,230,211.030	
TNT EXPRESS NV W/I	34,234	6.611	226,320.970	



	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,019	91.000	183,729.000	
	ENEL GREEN POWER SPA	224,723	1.702	382,478.540	
	BRENNTAG AG	5,161	120.450	621,642.450	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	125,533	4.040	507,153.320	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	6.600	386,806.200	
	DELTA LLOYD NV	19,898	15.070	299,862.860	
	EDENRED	27,224	23.800	647,931.200	
	BANKIA SA	463,650	1.013	469,677.450	
	ZIGGO NV	16,833	29.485	496,321.000	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	31,777	5.750	182,717.750	
	HUGO BOSS AG -ORD	4,016	95.010	381,560.160	
	OSRAM LICHT AG	9,503	34.200	325,002.600	
	GEMALTO	8,626	82.880	714,922.880	
	OCI NV	10,713	26.700	286,037.100	
	CNH INDUSTRIAL NV	109,614	9.300	1,019,410.200	
	BANCO BILBAO VIZCAYA - RTS	640,174	0.109	69,778.960	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS RTS	38,820	0.745	28,920.900	
	CAIXABANK S.A - RTS	152,035	0.058	8,818.030	
	ユーロ 小計	23,418,344		319,750,315.350 (42,718,642,130)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	36,200	77.800	2,816,360.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	25.950	5,657,100.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	33.450	3,735,027.000	
	CLP HOLDINGS LTD	236,000	62.500	14,750,000.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	211,000	15.460	3,262,060.000	
	LI & FUNG LTD	754,400	10.940	8,253,136.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	171,000	123.900	21,186,900.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	54.000	2,646,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	132,600	127.700	16,933,020.000	
	MTR CORP	165,500	30.350	5,022,925.000	
	FIRST PACIFIC CO	223,500	8.500	1,899,750.000	
	HANG SENG BANK LTD	100,200	127.700	12,795,540.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	111,700	47.000	5,249,900.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	172,000	68.100	11,713,200.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	189,750	69.150	13,121,212.500	

HONG KONG & CHINA GAS	713,740	18.320	13,075,716.800	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	254,000	97.750	24,828,500.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	88,000	35.800	3,150,400.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	261,000	57.250	14,942,250.000	
KERRY PROPERTIES LTD	88,000	33.350	2,934,800.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	451,500	25.150	11,355,225.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	86,000	21.400	1,840,400.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	430,700	11.220	4,832,454.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	12.200	2,806,000.000	
SINO LAND CO	429,400	11.340	4,869,396.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190,000	103.900	19,741,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	73,500	91.250	6,706,875.000	
WHEELOCK & CO LTD	107,000	40.000	4,280,000.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	77,500	35.400	2,743,500.000	
SJM HOLDINGS LTD	126,000	22.550	2,841,300.000	
WYNN MACAU LTD	223,600	28.400	6,350,240.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	89,600	27.350	2,450,560.000	
AIA GROUP LTD	1,364,200	38.000	51,839,600.000	
HKT TRUST / HKT LTD	104,000	7.150	743,600.000	
SANDS CHINA LTD	271,600	51.400	13,960,240.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	21.850	3,565,920.000	
香港・ドル 小計	8,705,050		328,900,107.300 (4,180,320,364)	
合計	126,636,660		305,333,797,461 (305,333,797,461)	

[次へ](#)

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

平成25年10月15日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	235,579.000	471,158.000		
		DEXUS PROPERTY GROUP	553,747.000	586,971.820		
		FEDERATION CENTRES	234,445.000	546,256.850		
		GOODMAN GROUP	214,527.000	1,059,763.380		
		GPT GROUP	198,416.000	722,234.240		
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	492,967.200		
		MIRVAC GROUP	519,514.000	896,161.650		
		STOCKLAND	284,414.000	1,109,214.600		
		WESTFIELD GROUP	255,799.000	2,826,578.950		
		WESTFIELD RETAIL TRUST	326,593.000	989,576.790		
	オーストラリア・ドル 小計			2,869,894.000	9,700,883.480 (911,009,967)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.000	677,624.740		
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	299,620.000		
		CAPITAMALL TRUST	294,800.000	577,808.000		
シンガポール・ドル 小計			801,706.000	1,555,052.740 (123,331,232)		
投資信託受益証券 合計			3,671,600	1,034,341,199 (1,034,341,199)		
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	45,817.000	1,016,679.230		
		AMERICAN TOWER CORP	44,723.000	3,338,124.720		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	118,204.000	1,372,348.440		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,101.000	1,813,529.610		
		BOSTON PROPERTIES INC	18,404.000	1,973,276.880		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	407,519.400		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,517.000	847,538.540		
		DUKE REALTY TRUST	38,117.000	612,540.190		
		EQUITY RESIDENTIAL	37,715.000	2,022,655.450		
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,764.000	810,949.800		
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	57,341.000	1,151,407.280		
		HCP INC	52,697.000	2,184,290.650		
		HEALTH CARE REIT INC	30,578.000	1,938,033.640		
		HOST HOTELS & RESORTS INC	92,071.000	1,650,833.030		
		KIMCO REALTY	53,036.000	1,088,298.720		
LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.000	591,500.000				

	PLUM CREEK TIMBER CO	21,734.000	1,037,581.160	
	PROLOGIS INC	60,701.000	2,365,517.970	
	PUBLIC STORAGE	16,392.000	2,746,807.440	
	RAYONIER INC	16,734.000	960,029.580	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	683,681.190	
	REGENCY CENTERS CORP	10,144.000	504,359.680	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	34,494.000	5,323,114.080	
	SL GREEN	10,737.000	987,911.370	
	THE MACERICH COMPANY	15,776.000	892,763.840	
	UDR INC	28,307.000	680,500.280	
	VENTAS INC	31,176.000	1,983,417.120	
	VORNADO REALTY TRUST	20,461.000	1,780,925.440	
	WEYERHAEUSER CO	60,041.000	1,759,201.300	
アメリカ・ドル 小計		992,078.000	44,525,336.030	(4,389,307,625)
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	113,808.000	678,864.720	
	HAMMERSON PLC	68,046.000	344,312.760	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	291,657.030	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	85,101.000	810,587.020	
	SEGRO PLC	87,111.000	279,190.750	
イギリス・ポンド 小計		443,176.000	2,404,612.280	(378,173,373)
カナダ・ドル	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	35,844.000	698,241.120	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	204,351.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	382,907.560	
カナダ・ドル 小計		61,339.000	1,285,499.680	(122,508,120)
ユーロ	CORIO NV	7,710.000	245,486.400	
	FONCIERE DES REGIONS	1,321.000	82,866.330	
	GECINA SA	2,977.000	291,746.000	
	ICADE	5,370.000	366,556.200	
	KLEPIERRE	13,172.000	418,869.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	10,538.000	1,976,401.900	
ユーロ 小計		41,088.000	3,381,926.430	(451,825,371)
香港・ドル	LINK REIT/THE	283,000.000	10,796,450.000	
香港・ドル 小計		283,000.000	10,796,450.000	(137,222,879)
投資証券 合計		1,820,681	5,479,037,368	(5,479,037,368)
合計			6,513,378,567	(6,513,378,567)

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 572銘柄	56.65%	-%	-%	59.07%
	投資証券 29銘柄	-%	-%	1.38%	
イギリス・ポンド	株式 101銘柄	9.63%	-%	-%	9.92%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.12%	
イスラエル・シケル	株式 6銘柄	0.21%	-%	-%	0.22%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	3.40%	-%	-%	3.75%
	投資信託受益証券 10銘柄	-%	0.29%	-%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	4.49%	-%	-%	4.61%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.04%	
シンガポール・ドル	株式 26銘柄	0.65%	-%	-%	0.71%
	投資信託受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	4.01%	-%	-%	4.08%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	1.45%	-%	-%	1.47%
デンマーク・クローネ	株式 10銘柄	0.51%	-%	-%	0.52%
ニュージーランド・ドル	株式 2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 229銘柄	13.46%	-%	-%	13.84%
	投資証券 6銘柄	-%	-%	0.14%	
香港・ドル	株式 36銘柄	1.32%	-%	-%	1.38%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.04%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成25年10月31日現在

資産総額	2,409,912,514円
負債総額	1,665,920円
純資産総額（ - ）	2,408,246,594円
発行済数量	1,021,298,176口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3580円

（参考）マザーファンドの現況

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年10月31日現在

資産総額	322,110,107,079円
負債総額	515,753,663円
純資産総額（ - ）	321,594,353,416円
発行済数量	151,622,687,099口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1210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、当該譲渡にかか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かか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、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

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

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

###### (2) 会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

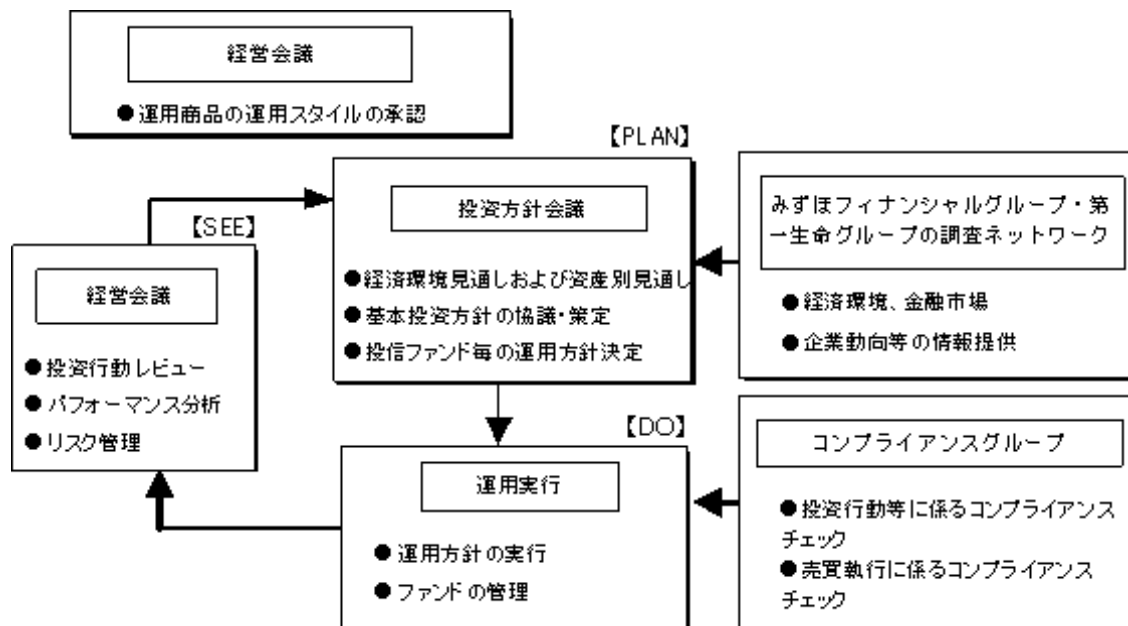
###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成25年10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25年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は301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	10	22,769,908,547
追加型株式投資信託	281	4,908,126,657,681
単位型公社債投資信託	9	88,033,330,410
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	134,715,659
合計	301	5,019,064,612,297

### 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	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

## (2)【損益計算書】

(単位：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)	
	営業収益			
委託者報酬	23,208,602		23,374,427	
運用受託報酬	4,966,992		5,374,163	
投資助言報酬	943,057		885,923	
その他営業収益	697,063		715,164	
営業収益計		29,815,715		30,349,678
営業費用				
支払手数料	10,154,958		10,846,568	
広告宣伝費	164,286		177,553	
公告費	-		3,769	
調査費	4,590,302		4,546,312	
調査費	2,888,013		3,001,788	
委託調査費	1,702,289		1,544,523	
委託計算費	335,754		341,978	
営業雑経費	496,565		456,677	
通信費	26,941		25,513	
印刷費	399,066		374,775	
協会費	25,014		25,492	
諸会費	41		42	
支払販売手数料	45,500		30,854	
営業費用計		15,741,867		16,372,860
一般管理費				
給料	4,630,102		4,870,759	
役員報酬	245,224		242,014	
給料・手当	3,824,122		4,035,751	
賞与	560,755		592,994	
交際費	35,987		36,212	
寄付金	3,156		2,693	
旅費交通費	213,642		187,653	
租税公課	84,346		95,064	
不動産賃借料	656,463		675,811	
退職給付費用	164,627		173,065	
固定資産減価償却費	475,556		524,750	
福利厚生費	24,887		26,642	
修繕費	6,721		6,018	
賞与引当金繰入	574,646		724,974	
役員退職慰労引当金繰入	30,048		47,820	
役員退職金	27,503		7,200	
機器リース料	1,510		35	
事務委託費	323,740		224,066	
消耗品費	58,739		60,044	
器具備品費	2,889		2,065	
諸経費	114,695		159,247	
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 （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）	
	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 (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)
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

[次へ](#)



## 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 その他有価証券」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貸契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、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す。

## 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	1,548,354	未払 手数料	122,786
								預金の引出 (純額)	91,135	現金・ 預金	433,779
								受取利息	104	未収 収益	-
	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	450,766	未払 手数料	83,446
								預金の預入 (純額)	392,267	現金・ 預金	11,440,025
								受取利息	3,654	未収 収益	-
	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	237,031	未払 費用	127,757
								業務委託料 の支払	15,140	未払 費用	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)	1,000,000	金銭の 信託	6,548,577	
							信託報酬の 支払	5,087			

## 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。

[次へ](#)

## (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		4,022,411
関係会社株式		409,446
繰延税金資産		2,119,074
差入保証金		675,426
その他		731,197
	固定資産計	87,266
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

[次へ](#)

## 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	<p>(1)子会社株式及び関連会社株式 : 移動平均法による原価法</p> <p>(2)その他有価証券</p> <p>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</p>									
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法									
3. デリバティブ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	<p>(1)有形固定資産: 定率法</p> <p>なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <table data-bbox="603 1193 954 1305"> <tr> <td>建物</td> <td>...</td> <td>6~18年</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td>...</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>3~20年</td> </tr> </table> <p>(2)無形固定資産: 定額法</p> <p>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。</p>	建物	...	6~18年	車両運搬具	...	6年	器具備品	...	3~20年
建物	...	6~18年								
車両運搬具	...	6年								
器具備品	...	3~20年								

5．引当金の計上基準	<p>(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3)退職給付引当金：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。</p> <p>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、それぞれ発生の日次会計期間から費用処理</p> <p>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</p> <p>(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。</p>
6．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>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。</p>
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	<p>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。</p>



## 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 その他有価証券	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 その他有価証券」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) 通常の見積り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
水戸証券株式会社	12,272	「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

### 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) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、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）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

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【その他】

- (1) 目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2) 目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3) 請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。  
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4) ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。  
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。  
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。  
（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：パ外国株）



## 独立監査人の監査報告書

平成25年11月27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D I A M外国株式パッシブ・ファンドの平成24年10月13日から平成25年10月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M外国株式パッシブ・ファンドの平成25年10月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

---

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

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

## 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) 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。

[委託会社の監査報告書（中間）へ](#)

## 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な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）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。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)