

【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28年1月13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 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【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28年1月14日から平成29年1月12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」という場合があります。）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經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

（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、販売会社に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）

（ 1 1 ） 【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

（ 1 2 ） 【その他】

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。

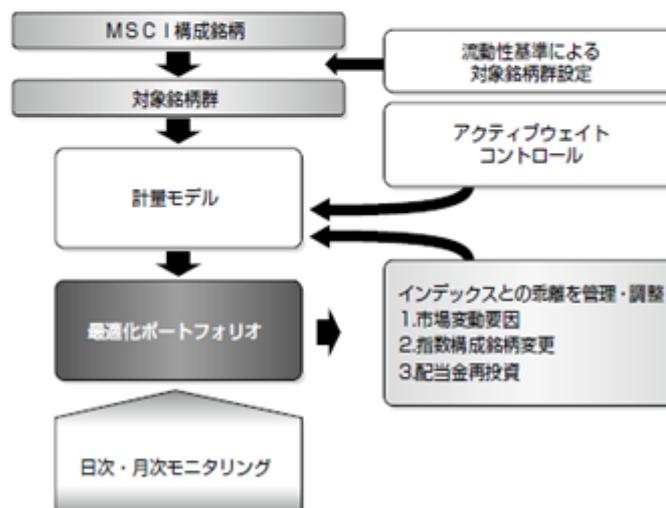
ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

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）^(注)」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	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

「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	グローバル (日本を除く)			
債券 一般 公債 社債 その他債券	年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回	日本 北米 欧州	ファミリー ファンド	あり ()	日経225 T O P I X
クレジット属性 ()	(毎月)	アジア			
不動産投信	日々	オセアニア		なし	
その他資産 (投資信託証券 (株式))	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オ ブ・ファンズ		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 ()		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		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

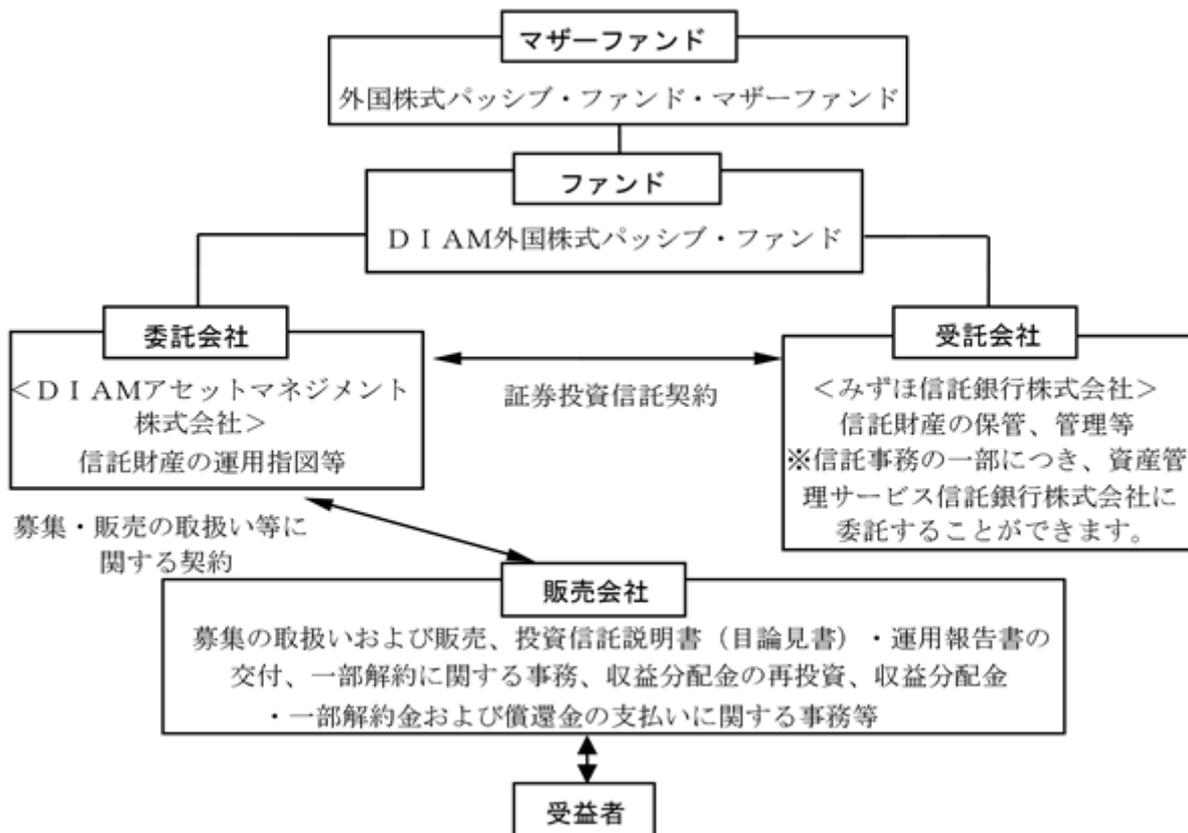
「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

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

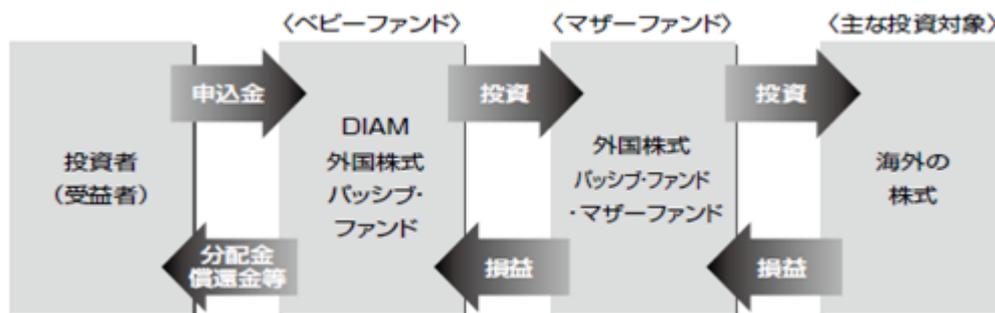
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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27年10月30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27年10月30日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、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。

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

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（約款第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す。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 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書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券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す。）
- 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せん。）
- 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せん。）
- 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。

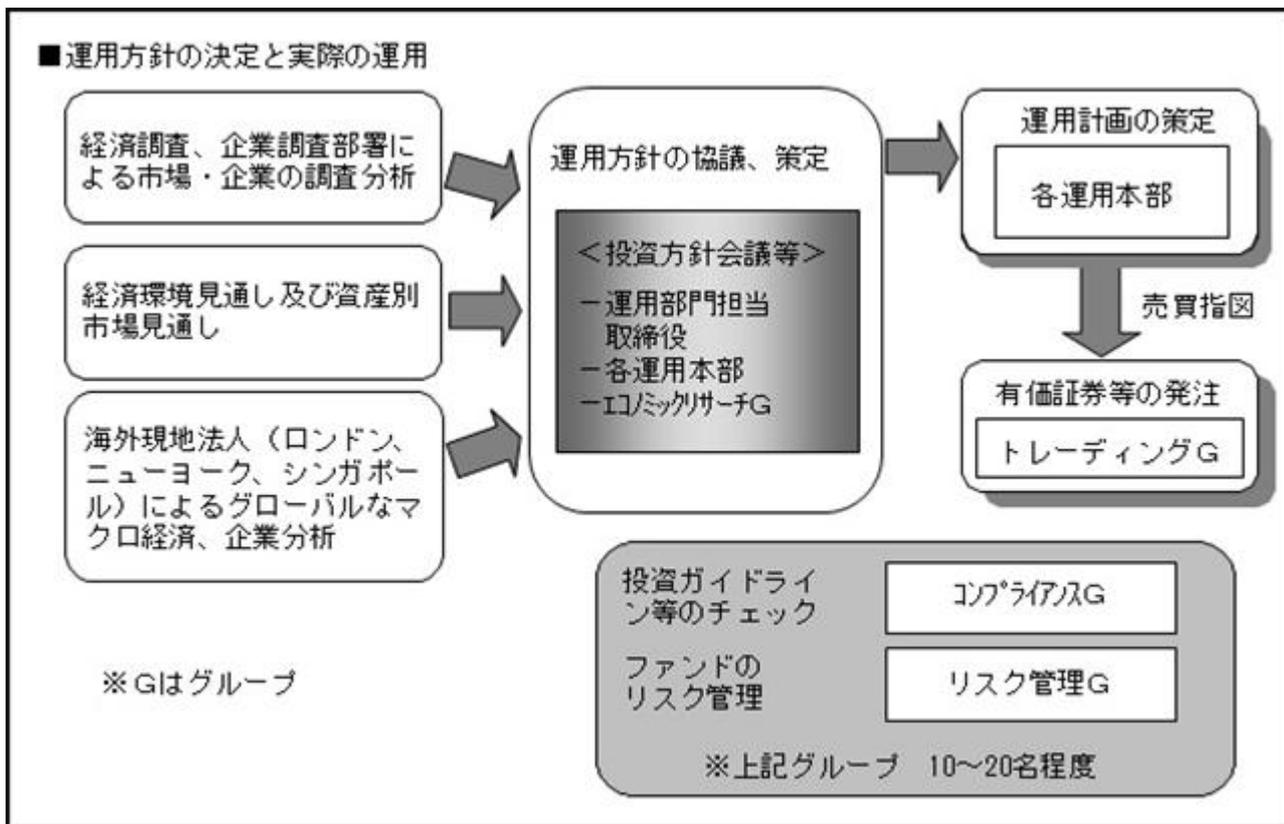
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

(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】



経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部の運用担当者、エコ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から得られた情報も参考にされます。

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

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

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成27年10月30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

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) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第24条の2)
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 10) 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。
- 11) 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。
- 12) 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。

13) 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。

14) 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委託会社に指図してはなりません。

3 【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き、為替変動等により影響を受けませんが、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があり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

< 分配金に関する留意点 >

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

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

< その他の留意点 >

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

当ファンドは、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10億口を下回ることとなった場合、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。

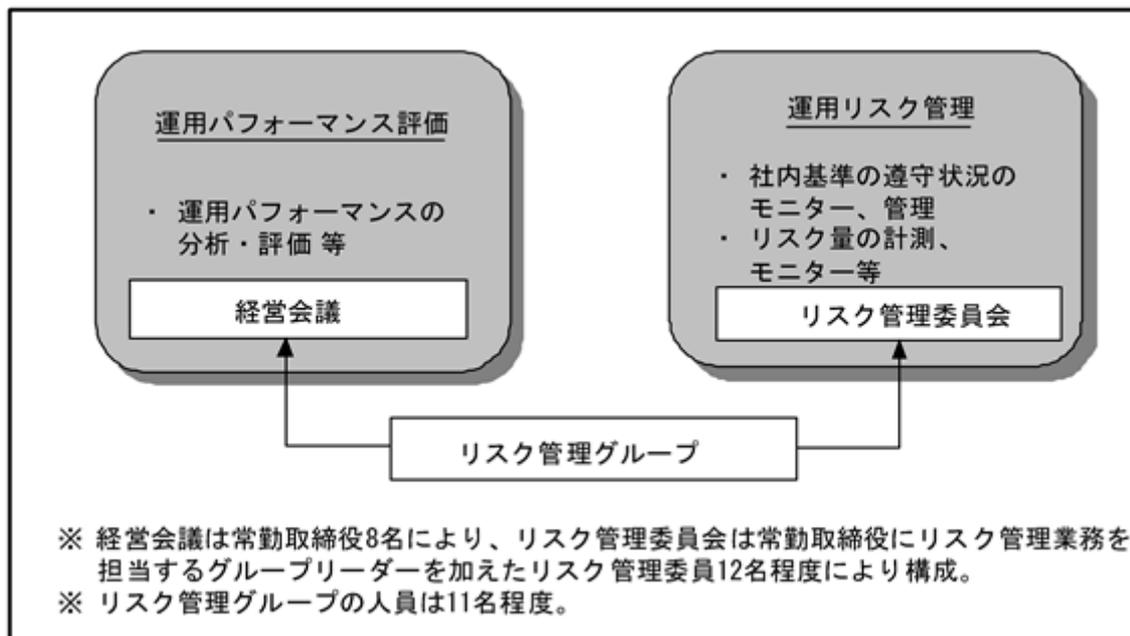
注意事項

- 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、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 >

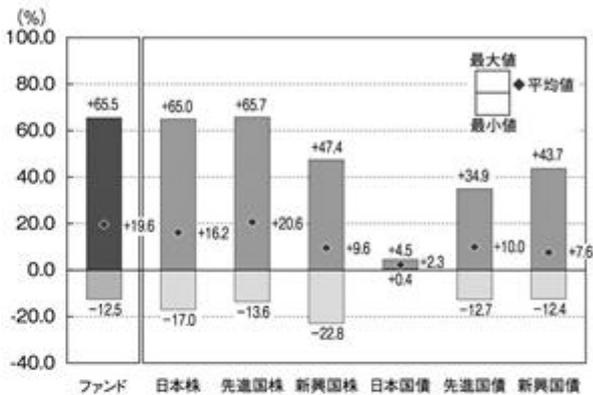


運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

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27年10月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

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

2010年11月～2015年10月

*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(兼東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティー・エルエルシーに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.648%（税抜0.60%）

信託報酬の配分（税抜）		主な役務
委託会社	年率0.55%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.02%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の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

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等がファンドから支払われます。

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。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期間の最初の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ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、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28年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「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27年10月30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	3,238,650,988	100.01
内 日本	3,238,650,988	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	172,169	0.01
純資産総額	3,238,478,819	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	276,290,022,597	94.04
内 アメリカ	167,819,159,023	57.12
内 イギリス	22,760,683,026	7.75
内 スイス	11,768,313,609	4.01
内 フランス	10,848,461,416	3.69
内 ドイツ	10,651,252,076	3.63
内 カナダ	10,178,161,043	3.46
内 オーストラリア	6,746,124,859	2.30
内 アイルランド	4,798,279,379	1.63
内 オランダ	4,701,566,105	1.60
内 スペイン	4,052,575,220	1.38
内 スウェーデン	3,341,712,299	1.14
内 イタリア	2,674,354,019	0.91
内 香港	2,666,966,074	0.91
内 デンマーク	2,028,482,415	0.69
内 シンガポール	1,695,584,007	0.58
内 ベルギー	1,571,554,083	0.53
内 ジャージー	1,515,697,170	0.52
内 バミューダ	1,092,593,367	0.37
内 フィンランド	1,031,994,075	0.35
内 オランダ領キュラソー	932,648,807	0.32
内 イスラエル	726,641,984	0.25
内 ケイマン諸島	705,614,472	0.24
内 ノルウェー	635,038,898	0.22
内 ルクセンブルグ	279,413,519	0.10
内 オーストリア	213,678,119	0.07
内 パナマ	212,310,768	0.07
内 ポルトガル	186,295,770	0.06
内 リベリア	157,872,042	0.05
内 ニュージーランド	155,488,622	0.05
内 イギリス領バージン諸島	77,508,179	0.03

	内 マン島	40,665,006	0.01
	内 モーリシャス	23,333,146	0.01
投資信託受益証券		826,247,300	0.28
	内 オーストラリア	712,397,046	0.24
	内 シンガポール	113,850,254	0.04
投資証券		6,383,617,808	2.17
	内 アメリカ	5,336,253,471	1.82
	内 フランス	458,084,555	0.16
	内 イギリス	405,841,188	0.14
	内 香港	125,131,500	0.04
	内 カナダ	58,307,094	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,299,364,895	3.51
純資産総額		293,799,252,600	100.00

その他資産の投資状況

平成27年10月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	13,284,000	0.00
-	13,284,000	0.00
為替予約取引（売建）	572,219,700	0.19
-	572,219,700	0.19
株価指数先物取引（買建）	9,619,736,553	3.27
内 アメリカ	6,295,867,500	2.14
内 ドイツ	1,862,464,622	0.63
内 イギリス	802,657,128	0.27
内 カナダ	343,409,343	0.12
内 オーストラリア	315,337,960	0.11

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年10月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,117,469,805	2.8117 3,142,081,933	2.8982 3,238,650,988	- -	100.01%

(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27年10月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.01%
合計	100.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年10月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	446,784	15,318.96 6,844,270,055	14,572.07 6,510,570,850	- -	2.22%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	596,059	5,310.78 3,165,542,115	6,451.22 3,845,310,126	- -	1.31%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	324,356	11,230.85 3,642,796,750	9,941.60 3,224,619,880	- -	1.10%
4	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	782,105	3,047.24 2,383,265,085	3,547.20 2,774,287,548	- -	0.94%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	215,123	12,022.50 2,586,317,867	12,255.63 2,636,468,537	- -	0.90%
6	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	379,489	6,679.33 2,534,733,692	6,660.38 2,527,541,325	- -	0.86%
7	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・カタ ログ販売	30,655	46,833.08 1,435,668,120	75,749.89 2,322,113,031	- -	0.79%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	249,808	8,605.72 2,149,778,479	9,290.23 2,320,776,273	- -	0.79%
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	287,570	7,223.47 2,077,255,489	7,883.88 2,267,169,959	- -	0.77%
10	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	165,367	9,322.15 1,541,576,338	12,679.99 2,096,852,237	- -	0.71%
11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	23,953	66,539.71 1,593,825,892	86,675.62 2,076,141,317	- -	0.71%
12	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	22,300	67,305.71 1,500,917,522	90,052.36 2,008,167,739	- -	0.68%
13	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	477,167	4,178.30 1,993,748,276	4,203.69 2,005,863,577	- -	0.68%
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	210,515	10,325.77 2,173,729,734	9,311.71 1,960,256,314	- -	0.67%
15	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	176,167	11,559.62 2,036,423,783	11,038.27 1,944,579,263	- -	0.66%
16	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	477,245	4,122.68 1,967,530,380	4,056.19 1,935,798,782	- -	0.66%

17	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	54,428	29,842.59 1,624,272,619	32,796.99 1,785,074,680	- -	0.61%
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	316,495	5,942.70 1,880,837,292	5,609.75 1,775,460,991	- -	0.60%
19	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	124,718	12,597.61 1,571,149,695	13,908.33 1,734,619,849	- -	0.59%
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	813,199	2,005.15 1,630,590,403	2,066.18 1,680,216,323	- -	0.57%
21	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	321,074	5,064.33 1,626,025,307	5,173.31 1,661,015,656	- -	0.57%
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	145,584	13,497.44 1,965,011,690	10,867.70 1,582,163,382	- -	0.54%
23	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	234,417	6,193.87 1,451,949,281	6,487.49 1,520,778,880	- -	0.52%
24	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	90,855	17,861.26 1,622,785,478	16,670.90 1,514,634,710	- -	0.52%
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	367,624	4,134.31 1,519,872,532	4,114.22 1,512,488,586	- -	0.51%
26	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	100,465	13,573.13 1,363,625,040	14,946.86 1,501,636,993	- -	0.51%
27	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノ ロジー	113,693	12,326.65 1,401,454,311	13,203.48 1,501,144,274	- -	0.51%
28	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	218,894	7,076.59 1,549,024,616	6,633.78 1,452,095,296	- -	0.49%
29	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,514,022	1,102.49 1,669,205,232	950.67 1,439,350,312	- -	0.49%
30	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	151,357	8,179.95 1,238,094,165	9,491.85 1,436,659,302	- -	0.49%

（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27年10月30日現在

種類	投資比率
株式	94.04%
投資信託受益証券	0.28%
投資証券	2.17%
合計	96.49%

（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27年10月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	8.80%
医薬品		6.81%
石油・ガス・消耗燃料		6.18%
保険		4.23%
ソフトウェア		3.06%
メディア		3.04%
コンピュータ・周辺機器		2.72%
各種電気通信サービス		2.62%
バイオテクノロジー		2.57%
化学		2.55%
インターネットソフトウェア・サービス		2.53%
情報技術サービス		2.46%
飲料		2.33%
食品		2.24%
資本市場		2.08%
航空宇宙・防衛		2.07%
食品・生活必需品小売り		2.04%
コングロマリット		2.01%
専門小売り		1.97%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.81%
ホテル・レストラン・レジャー		1.76%
半導体・半導体製造装置		1.72%
電力		1.58%
ヘルスケア機器・用品		1.52%
タバコ		1.50%
家庭用品		1.44%
各種金融サービス		1.30%
繊維・アパレル・贅沢品		1.29%
インターネット販売・カタログ販売		1.27%
機械		1.21%
通信機器		1.16%
総合公益事業		1.15%
金属・鉱業		1.10%
自動車		1.04%
陸運・鉄道		0.82%
エネルギー設備・サービス		0.80%
電気設備		0.71%
パーソナル用品		0.69%
不動産管理・開発		0.61%
自動車部品		0.58%
航空貨物・物流サービス		0.58%
複合小売り		0.53%
消費者金融		0.50%
専門サービス		0.48%
無線通信サービス		0.45%
家庭用耐久財		0.42%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.41%

商業サービス・用品	0.38%
電子装置・機器・部品	0.35%
建設・土木	0.30%
建設資材	0.30%
商社・流通業	0.28%
建設関連製品	0.22%
容器・包装	0.22%
運送インフラ	0.22%
旅客航空輸送業	0.18%
ガス	0.15%
紙製品・林産品	0.14%
水道	0.09%
販売	0.08%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08%
レジャー用品	0.08%
海運業	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.04%
各種消費者サービス	0.03%
合計	94.04%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年10月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売2015年11月	買建	100,000	13,163,360	13,284,000	0.00%
		アメリカ・ドル売/円買2015年11月	売建	3,110,000	375,989,048	375,967,900	0.13%
		ユーロ売/円買2015年11月	売建	840,000	111,586,104	111,585,600	0.04%
		イギリス・ポンド売/円買2015年11月	売建	240,000	44,491,584	44,491,200	0.02%
		カナダ・ドル売/円買2015年11月	売建	250,000	22,986,450	22,985,000	0.01%
		オーストラリア・ドル売/円買2015年11月	売建	200,000	17,190,820	17,190,000	0.01%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S & P 500 FUTURE Dec 15	買建	100	6,080,450,902	6,295,867,500	2.14%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec 15	買建	412	1,786,146,714	1,862,464,622	0.63%
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec 15	買建	68	791,415,078	802,657,128	0.27%
	モントリオール取引所	S & P / TSE 60 IX FUT Dec 15	買建	23	336,746,646	343,409,343	0.12%
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec 15	買建	28	311,131,877	315,337,960	0.11%

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

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成27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
第6計算期間末 (平成26年10月14日)	2,215	2,215	2.6269	2.6269
第7計算期間末 (平成27年10月13日)	3,146	3,146	3.0867	3.0867
平成26年10月末日	2,369	-	2.8142	-
11月末日	2,668	-	3.1527	-
12月末日	2,748	-	3.1918	-
平成27年1月末日	2,669	-	3.0548	-
2月末日	2,849	-	3.2285	-
3月末日	2,897	-	3.2211	-
4月末日	2,920	-	3.2501	-
5月末日	3,109	-	3.3941	-
6月末日	3,053	-	3.2574	-
7月末日	3,216	-	3.3475	-
8月末日	2,993	-	3.0803	-
9月末日	2,832	-	2.8687	-
10月末日	3,238	-	3.1806	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	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
第6計算期間	15.1
第7計算期間	17.5

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	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
第6計算期間	217,412,057	398,702,037
第7計算期間	250,814,799	74,594,722

(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。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2015年10月30日

基準価額・純資産の推移

《設定日(2009年1月30日)~2015年10月30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3期(2011.10.12)	0円
第4期(2012.10.12)	0円
第5期(2013.10.15)	0円
第6期(2014.10.14)	0円
第7期(2015.10.13)	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	100.01%

■外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	94.04
内 アメリカ	57.12
内 イギリス	7.75
内 スイス	4.01
内 フランス	3.69
内 ドイツ	3.63
内 その他	17.84
投資信託受益証券	0.28
内 オーストラリア	0.24
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.17
内 アメリカ	1.82
内 フランス	0.16
内 イギリス	0.14
内 香港	0.04
内 カナダ	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.51
純資産総額	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.22%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.31%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.10%
4	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロメリット	0.94%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.90%
6	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.86%
7	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・カタログ販売	0.79%
8	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.79%
9	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.77%
10	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	0.71%

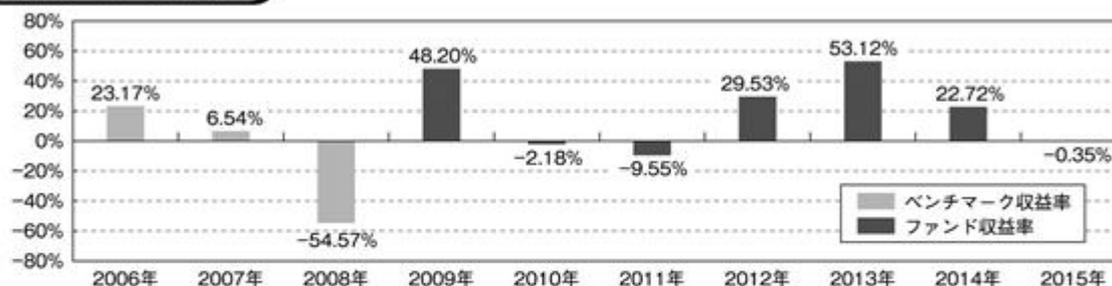
その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.00
為替予約取引(売建)	△0.19
株債指数先物取引(買建)	3.27

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	8.80%
2	医薬品	6.81%
3	石油・ガス・消耗燃料	6.18%
4	保険	4.23%
5	ソフトウェア	3.06%

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あります。
 ※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2015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。

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、ニューヨーク証券取引所、またはロンドン証券取引所の休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）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。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に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）

・ 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。

主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

なお、外貨建資産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められ、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】

a. 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。

b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。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10億口を下回る事となった場合、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發します。
- 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. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

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、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- 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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- 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. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。
- 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、毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(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）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、）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7期計算期間（平成26年10月15日から平成27年10月13日まで）の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

D I A M外国株式パッシブ・ファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,176,696	9,829,229
親投資信託受益証券	2,214,776,525	3,146,897,696
未収入金	246,000	664,000
流動資産合計	2,223,199,221	3,157,390,925
資産合計	2,223,199,221	3,157,390,925
負債の部		
流動負債		
未払解約金	590,042	434,279
未払受託者報酬	362,246	495,459
未払委託者報酬	6,883,578	9,414,344
その他未払費用	85,956	98,543
流動負債合計	7,921,822	10,442,625
負債合計	7,921,822	10,442,625
純資産の部		
元本等		
元本	1,843,290,886	1,101,510,963
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,371,986,513	2,127,437,337
（分配準備積立金）	653,928,995	942,211,480
元本等合計	2,215,277,399	3,146,948,300
純資産合計	2,215,277,399	3,146,948,300
負債純資産合計	2,223,199,221	3,157,390,925

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第6期		第7期	
	自	平成25年10月16日 平成26年10月14日	自	平成26年10月15日 平成27年10月13日
営業収益				
受取利息		7,100		3,378
有価証券売買等損益		372,675,773		394,751,171
営業収益合計		372,682,873		394,754,549
営業費用				
受託者報酬		765,030		929,147
委託者報酬		14,537,248		17,655,096
その他費用		181,536		201,462
営業費用合計		15,483,814		18,785,705
営業利益又は営業損失（ ）		357,199,059		375,968,844
経常利益又は経常損失（ ）		357,199,059		375,968,844
当期純利益又は当期純損失（ ）		357,199,059		375,968,844
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（ ）		132,179,406		35,258,521
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,313,915,594		1,371,986,513
剰余金増加額又は欠損金減少額		353,193,939		539,593,069
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		353,193,939		539,593,069
剰余金減少額又は欠損金増加額		520,142,673		124,852,568
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		520,142,673		124,852,568
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,371,986,513		2,127,437,337

(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、前計算期間末日を平成26年10月14日、当計算期間末日を平成27年10月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	平成26年10月14日現在	平成27年10月13日現在
1 . 1 期首元本額	1,024,580,866円	843,290,886円
期中追加設定元本額	217,412,057円	250,814,799円
期中一部解約元本額	398,702,037円	74,594,722円
2 . 受益権の総数	843,290,886口	1,019,510,963口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 平成25年10月16日 至 平成26年10月14日	自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13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（47,535,636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（177,484,017円）、信託約款に規定される収益調整金（718,057,518円）及び分配準備積立金（428,909,342円）より分配対象収益は1,371,986,513円（1万口当たり16,269.43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（60,462,942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（280,247,381円）、信託約款に規定される収益調整金（1,185,225,857円）及び分配準備積立金（601,501,157円）より分配対象収益は2,127,437,337円（1万口当たり20,867.23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6期	第7期
	自 平成25年10月16日 至 平成26年10月14日	自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13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	247,274,962	367,597,502
合計	247,274,962	367,597,502

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第6期 平成26年10月14日現在	第7期 平成27年10月13日現在
1口当たり純資産額	2.6269円	3.0867円
(1万口当たり純資産額)	(26,269円)	(30,867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27年10月13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	1,119,175,509	3,146,897,696	
親投資信託受益証券	合計	1,119,175,509	3,146,897,696	
合計		1,119,175,509	3,146,897,696	

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26年10月14日現在	平成27年10月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,186,847,439	8,814,164,373
コール・ローン		107,556,977	56,656,644
株式		277,234,968,911	270,386,591,397
投資信託受益証券		826,950,076	807,368,710
投資証券		5,744,036,346	6,260,359,022
派生商品評価勘定		22,170	407,897,463
未収入金		46,263,879	2,043,961
未収配当金		358,496,337	316,123,934
差入委託証拠金		920,675,078	2,080,064,646
流動資産合計		288,425,817,213	289,131,270,150
資産合計		288,425,817,213	289,131,270,150
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		246,674,226	423,664
未払解約金		82,003,000	80,724,000
流動負債合計		328,677,226	81,147,664
負債合計		328,677,226	81,147,664
純資産の部			
元本等			
元本	1	121,180,095,614	102,800,378,688
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		166,917,044,373	186,249,743,798
元本等合計		288,097,139,987	289,050,122,486
純資産合計		288,097,139,987	289,050,122,486
負債純資産合計		288,425,817,213	289,131,270,150

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</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26年10月14日現在	平成27年10月13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	154,653,983,066円	121,180,095,614円
同期中追加設定元本額	9,966,107,976円	16,767,057,945円
同期中一部解約元本額	43,439,995,428円	35,146,774,871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	931,596,082円	1,119,175,509円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	34,450,432,094円	33,993,104,111円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	151,176,304円	148,265,440円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	851,828,397円	818,639,464円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,082,205,157円	1,044,869,296円
D I A M D C バランス3 0インデックスファンド	149,497,367円	142,164,161円
D I A M D C バランス5 0インデックスファンド	420,434,888円	408,169,305円
D I A M D C バランス7 0インデックスファンド	342,976,095円	331,856,954円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	63,008,746円	44,564,223円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	833,028,811円	855,892,942円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	198,999,656円	242,749,015円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国1 0)	10,685,545円	18,376,910円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国2 0)	21,368,040円	35,655,942円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国3 0)	50,469,236円	79,250,573円
投資のソムリエ	84,046,922円	338,753,785円
クルーズコントロール	226,774,251円	55,856,701円
投資のソムリエ< D C年金>	1,881,571円	5,573,276円
D I A M 8 資産バランスファンドN< D C年金>	14,829,071円	48,256,073円
D I A M D C バランス・F(成長型)	38,365円	11,405,832円
クルーズコントロール< D C年金>	8,728円	17,772円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	- 円	2,432,944円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	- 円	5,730,205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)	388,950,027円	278,372,403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)	3,748,124,706円	3,406,456,936円
D I A Mアクティブアロケーショ ン私募ファンド(適格機関投資家 限定)	- 円	124,104,729円
D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	43,492,317円	39,486,856円
D I A Mグローバル・バランス ファンド2 5 V A (適格機関投資 家限定)	2,175,554,275円	724,016,406円
D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投資 家限定)	531,942,158円	393,841,463円
D I A M国際分散バランスファン ド3 0 V A (適格機関投資家限 定)	64,415,204円	35,887,852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)	368,534,639円	220,681,027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)	28,733,789円	18,321,569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)	64,248,960円	35,678,126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)	9,655,162,803円	5,136,920,981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)	4,750,451,188円	2,921,275,554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)	1,565,175,959円	1,225,421,906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)	1,378,864,193円	1,143,720,278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)	3,871,651,793円	3,389,655,512円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスV A (適格機関投資家限 定)	1,775,298,702円	1,330,757,724円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスV A 2 (適格機関投資家 限定)	2,945,091,514円	2,129,038,401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)	1,978,280,551円	1,635,609,518円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家向 け)	1,555,219,943円	1,134,201,469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)	28,088,225円	11,130,233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)	8,141,472,458円	4,994,233,495円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	2,053,497,397円	1,750,857,571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)	56,105,071円	843,239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)	12,408,365,555円	11,275,001,774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)	846,895,340円	661,196,750円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投資 家限定)	2,154,886,947円	1,955,551,826円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資家 限定)	7,757,350,806円	7,178,571,130円
D I A Mバランス3 0 V A (適格 機関投資家限定)	145,585円	142,381円
D I A Mバランス5 0 V A (適格 機関投資家限定)	113,778,470円	52,307,284円
D I A Mバランス7 0 V A (適格 機関投資家限定)	146,565,638円	18,504,997円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資家 限定)	10,418,899,977円	9,666,803,838円
D I A Mバランス2 0 V A (適格 機関投資家限定)	80,636,950円	60,448,279円
D I A Mバランス4 0 V A (適格 機関投資家限定)	198,655,574円	100,292,840円
D I A Mバランス6 0 V A (適格 機関投資家限定)	273,574円	283,908円
計	121,180,095,614円	102,800,378,688円
2 . 受益権の総数	121,180,095,614口	102,800,378,688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25年10月16日 至 平成26年10月14日	自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13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26年10月14日現在	平成27年10月13日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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26年10月14日現在	平成27年10月13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	1,297,666,404	12,479,024,127
投資信託受益証券	62,663,740	73,146,640
投資証券	348,414,090	303,801,843
合計	886,588,574	12,855,972,610

（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26年2月18日から平成26年10月14日まで及び平成27年2月17日から平成27年10月13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26年10月14日 現在				平成27年10月13日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	396,113,920	-	396,092,000	21,920	46,399,180	-	46,762,600	363,420
アメリカ・ドル	246,280,320	-	246,261,000	19,320	-	-	-	-
イギリス・ポンド	34,398,800	-	34,398,000	800	3,684,900	-	3,672,000	12,900
オーストラリア・ドル	18,717,000	-	18,716,000	1,000	42,714,280	-	43,090,600	376,320
カナダ・ドル	28,648,050	-	28,647,000	1,050	-	-	-	-
ユーロ	68,069,750	-	68,070,000	250	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	680,956,654	-	680,913,900	42,754
アメリカ・ドル	-	-	-	-	437,814,580	-	437,781,000	33,580
イギリス・ポンド	-	-	-	-	58,753,984	-	58,752,000	1,984
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	21,985,250	-	21,982,500	2,750
カナダ・ドル	-	-	-	-	27,602,460	-	27,600,000	2,460
ユーロ	-	-	-	-	134,800,380	-	134,798,400	1,980
合計	396,113,920	-	396,092,000	21,920	727,355,834	-	727,676,500	406,174

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成26年10月14日 現在				平成27年10月13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	4,021,397,314	-	3,774,723,338	246,673,976	11,761,249,479	-	12,169,129,452	407,879,973
合計	4,021,397,314	-	3,774,723,338	246,673,976	11,761,249,479	-	12,169,129,452	407,879,973

(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26年10月14日現在	平成27年10月13日現在
1口当たり純資産額	2.3774円	2.8118円
(1万口当たり純資産額)	(23,774円)	(28,118円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年10月13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	30,991	550.190	17,050,938.290	
	ABBOTT LABORATORIES	116,754	41.570	4,853,463.780	
	AES CORP	45,320	10.710	485,377.200	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,106	151.140	11,049,240.840	
	ADOBE SYSTEMS INC	39,348	83.920	3,302,084.160	
	ACE LTD	25,433	107.020	2,721,839.660	
	AGCO CORP	6,536	46.310	302,682.160	
	AIRGAS INC	6,292	92.760	583,645.920	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,942	138.810	2,212,909.020	
	ENERGEN CORP	7,454	58.530	436,282.620	
	ALLEGHANY CORP	1,188	483.490	574,386.120	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	70,262	55.660	3,910,782.920	
	RALPH LAUREN CORP	5,290	120.580	637,868.200	
	ALLSTATE CORP	32,138	60.910	1,957,525.580	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,345	101.500	5,922,017.500	
	ALTERA CORPORATION	23,108	52.490	1,212,938.920	
	ALCOA INC	102,779	10.080	1,036,012.320	
	AMGEN INC	59,579	153.030	9,117,374.370	
	HESS CORP	20,456	60.130	1,230,019.280	
	AMERICAN EXPRESS CO	70,563	77.310	5,455,225.530	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	38,075	57.560	2,191,597.000	
	AFLAC INC	33,588	60.830	2,043,158.040	
	AMERICAN INTL GROUP	105,329	58.680	6,180,705.720	
	JARDEN CORP	14,140	50.990	720,998.600	
	ANALOG DEVICES	25,145	56.580	1,422,704.100	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	37,962	71.090	2,698,718.580	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,340	159.860	2,771,972.400	
	NABORS INDUSTRIES LTD	19,674	11.150	219,365.100	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	31,929	36.080	1,151,998.320	
	TIME WARNER	64,279	73.180	4,703,937.220	
	JONES LANG LASALLE INC	2,687	149.140	400,739.180	
	VALERO ENERGY CORP	39,834	64.500	2,569,293.000	
	APACHE CORP	29,768	44.950	1,338,071.600	
ANSYS INC	7,266	91.870	667,527.420		
APPLE INC	450,800	111.600	50,309,280.000		
APPLIED MATERIALS INC	94,015	15.600	1,466,634.000		
ALBEMARLE CORP	7,690	50.510	388,421.900		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	50,255	45.440	2,283,587.200	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	64.620	604,843.200	
AMEREN CORP	19,716	43.720	861,983.520	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	58.140	451,573.380	
ASHLAND INC	5,128	106.270	544,952.560	
AUTOLIV INC	7,264	113.290	822,938.560	
AUTODESK INC	18,164	51.550	936,354.200	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	36,504	85.680	3,127,662.720	
AUTOZONE INC	2,607	744.060	1,939,764.420	
AVERY DENNISON CORP	8,865	59.490	527,378.850	
AVNET INC	10,288	45.270	465,737.760	
BAKER HUGHES INC	34,030	55.680	1,894,790.400	
BALL CORP	10,625	66.780	709,537.500	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	91,427	133.400	12,196,361.800	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	87,268	40.460	3,530,863.280	
CR BARD INC	5,892	189.130	1,114,353.960	
BAXTER INTERNATIONAL INC	41,887	33.470	1,401,957.890	
BED BATH & BEYOND INC	14,763	58.910	869,688.330	
BECTON DICKINSON & CO	16,883	138.460	2,337,620.180	
AMETEK INC	19,168	55.780	1,069,191.040	
BE AEROSPACE INC	7,540	46.740	352,419.600	
VERIZON COMM INC	318,869	44.300	14,125,896.700	
WR BERKLEY CORP	9,107	55.830	508,443.810	
BEST BUY CO INC	23,778	37.160	883,590.480	
YUM! BRANDS INC	33,692	70.840	2,386,741.280	
FIRSTENERGY CORP	33,061	32.400	1,071,176.400	
H&R BLOCK INC	22,530	35.270	794,633.100	
ENSCO PLC-CL A	16,993	16.090	273,417.370	
BOEING CO	51,615	140.680	7,261,198.200	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	53.270	577,766.420	
BORGWARNER INC	17,824	44.840	799,228.160	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,849	16.940	1,826,962.060	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,592	72.000	834,624.000	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	295.520	651,030.560	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	130,648	62.710	8,192,936.080	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,276	175.130	748,855.880	
ONEOK INC	16,401	38.800	636,358.800	
UNITED RENTALS INC	7,795	69.520	541,908.400	
SEMPRA ENERGY	18,407	100.330	1,846,774.310	
FEDEX CORP	21,204	154.420	3,274,321.680	
VERISIGN INC	9,291	75.300	699,612.300	

AMPHENOL CORP	23,947	52.030	1,245,962.410	
BROWN-FORMAN CORP	9,803	106.470	1,043,725.410	
QUANTA SERVICES INC	16,615	26.280	436,642.200	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	23,243	45.210	1,050,816.030	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	209,556	3.920	821,459.520	
CSX CORP	77,207	28.370	2,190,362.590	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,517	33.050	512,836.850	
CABOT OIL & GAS CORP	33,871	22.930	776,662.030	
CAMPBELL SOUP CO	15,612	50.890	794,494.680	
SEAGATE TECHNOLOGY	26,728	49.020	1,310,206.560	
WHITING PETROLEUM CORP	15,410	20.160	310,665.600	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,276	137.070	1,819,741.320	
CARDINAL HEALTH INC	25,805	80.080	2,066,464.400	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	32,472	50.360	1,635,289.920	
CATERPILLAR INC	44,532	70.500	3,139,506.000	
CELGENE CORP	61,971	117.600	7,287,789.600	
CORE LABORATORIES N.V.	3,159	117.000	369,603.000	
CITRIX SYSTEMS INC	12,490	75.720	945,742.800	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,606	8.240	367,553.440	
CENTURYLINK INC	44,154	25.860	1,141,822.440	
CERNER CORP	24,936	65.200	1,625,827.200	
JPMORGAN CHASE & CO	290,639	61.720	17,938,239.080	
CHUBB CORP	18,142	125.470	2,276,276.740	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,603	88.300	936,244.900	
CIGNA CORP	20,009	137.610	2,753,438.490	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,832	56.680	670,637.760	
CINTAS CORP	7,454	91.040	678,612.160	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	79,229	5.110	404,860.190	
CISCO SYSTEMS INC	393,089	27.960	10,990,768.440	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	7,706	43.130	332,359.780	
CLOROX COMPANY	9,288	120.750	1,121,526.000	
COCA-COLA CO/THE	323,827	42.000	13,600,734.000	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	18,074	50.910	920,147.340	
COLGATE-PALMOLIVE CO	66,462	66.250	4,403,107.500	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	18,147	76.410	1,386,612.270	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	33,278	60.960	2,028,626.880	
COMERICA INC	13,912	42.600	592,651.200	
NRG ENERGY, INC.	23,703	14.910	353,411.730	
COMCAST CORP-CL A	164,377	60.270	9,907,001.790	
CA INC	26,267	28.920	759,641.640	

COMPUTER SCIENCES CORP	11,025	65.010	716,735.250	
CONAGRA FOODS INC	34,469	42.040	1,449,076.760	
CONSOLIDATED EDISON INC	24,429	65.770	1,606,695.330	
CMS ENERGY CORP	20,017	35.890	718,410.130	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,553	65.810	957,732.930	
COOPER COS INC	3,794	139.190	528,086.860	
MOLSON COORS BREWING CO	12,219	78.750	962,246.250	
CORNING INC	97,214	17.260	1,677,913.640	
SEALED AIR CORP	14,883	49.420	735,517.860	
BROADCOM CORP-CL A	42,632	50.930	2,171,247.760	
CUMMINS INC	14,022	111.980	1,570,183.560	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	113.580	751,786.020	
DR HORTON INC	26,166	30.930	809,314.380	
DANAHER CORP	47,028	89.480	4,208,065.440	
MOODY'S CORP	14,341	99.040	1,420,332.640	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,638	66.190	3,153,159.220	
TARGET CORP	47,898	79.210	3,794,000.580	
DEERE & CO	24,921	78.430	1,954,554.030	
MORGAN STANLEY	113,390	32.800	3,719,192.000	
REPUBLIC SERVICES INC	18,651	43.610	813,370.110	
THE WALT DISNEY CO	126,325	106.350	13,434,663.750	
DOLLAR TREE INC	17,831	63.050	1,124,244.550	
DOVER CORP	13,192	60.880	803,128.960	
DOW CHEMICAL	89,076	46.600	4,150,941.600	
OMNICOM GROUP	19,378	71.100	1,377,775.800	
DTE ENERGY CO	14,055	81.600	1,146,888.000	
XL GROUP PLC	23,051	37.140	856,114.140	
DUKE ENERGY CORP	55,649	72.820	4,052,360.180	
FLOWSERVE CORP	12,469	45.410	566,217.290	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	66.250	625,135.000	
EBAY INC	85,724	24.560	2,105,381.440	
EMC CORP/MASS	152,581	28.350	4,325,671.350	
BANK OF AMERICA CORP	822,335	15.520	12,762,639.200	
CITIGROUP INC	237,976	51.280	12,203,409.280	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,592	71.010	823,147.920	
E*TRADE FINANCIAL CORP	19,301	26.310	507,809.310	
EATON CORP PLC	36,792	54.140	1,991,918.880	
EATON VANCE CORP	9,128	34.950	319,023.600	
DISH NETWORK CORP	16,800	62.400	1,048,320.000	
ECOLAB INC	21,285	120.570	2,566,332.450	
ELECTRONIC ARTS INC	23,902	68.110	1,627,965.220	
SALESFORCE.COM INC	48,702	75.880	3,695,507.760	
EMERSON ELECTRIC CO	52,695	46.950	2,474,030.250	
WEATHERFORD INTL PLC	58,791	10.090	593,201.190	
ENTERGY CORP	13,984	68.280	954,827.520	
EOG RESOURCES INC	43,598	86.030	3,750,735.940	

EQUIFAX INC	8,986	105.780	950,539.080	
EQT CORP	12,314	74.380	915,915.320	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,656	84.530	1,576,991.680	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	50.300	718,233.700	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	56,147	83.510	4,688,835.970	
EXXON MOBIL CORP	327,485	79.300	25,969,560.500	
FMC CORP	9,724	37.530	364,941.720	
NEXTERA ENERGY INC	34,182	101.450	3,467,763.900	
ASSURANT INC	6,227	80.420	500,775.340	
FASTENAL CO	21,892	38.810	849,628.520	
FIFTH THIRD BANCORP	64,871	18.990	1,231,900.290	
M&T BANK CORP	9,572	120.170	1,150,267.240	
FISERV INC	19,533	92.440	1,805,630.520	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	28.540	411,603.880	
MACY'S INC	27,089	50.360	1,364,202.040	
FORD MOTOR CO	283,953	14.980	4,253,615.940	
FRANKLIN RESOURCES INC	30,571	38.030	1,162,615.130	
FREEMPORT-MCMORAN INC	85,535	12.940	1,106,822.900	
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	11.190	496,421.970	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,532	42.690	534,991.080	
TEGNA INC	14,570	25.530	371,972.100	
GAP INC/THE	16,693	27.000	450,711.000	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,729	56.650	607,797.850	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,674	143.690	3,114,337.060	
GENERAL MILLS INC	45,431	57.170	2,597,290.270	
GENUINE PARTS CO	12,396	85.210	1,056,263.160	
GILEAD SCIENCES INC	115,132	99.510	11,456,785.320	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	13,585	70.330	955,433.050	
GARTNER INC	5,772	86.280	498,008.160	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,413	31.780	585,165.140	
MCKESSON CORP	18,096	190.610	3,449,278.560	
NVIDIA CORP	43,024	26.350	1,133,682.400	
GENERAL ELECTRIC CO	789,495	28.090	22,176,914.550	
WW GRAINGER INC	4,603	225.090	1,036,089.270	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	9,838	55.030	541,385.140	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	17.650	392,465.400	
HALLIBURTON CO	65,636	38.870	2,551,271.320	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,539	137.460	1,586,150.940	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,160	180.230	5,435,736.800	
HARLEY-DAVIDSON INC	17,507	54.660	956,932.620	
HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE	5,014	106.510	534,041.140	
HARRIS CORP	7,832	77.000	603,064.000	
CONSOL ENERGY INC	22,051	11.520	254,027.520	

HASBRO INC	8,909	74.440	663,185.960	
HENRY SCHEIN INC	7,142	143.180	1,022,591.560	
HELMERICH & PAYNE INC	9,929	58.500	580,846.500	
HERSHEY FOODS CORP	12,284	97.070	1,192,407.880	
HEWLETT-PACKARD CO	140,666	29.300	4,121,513.800	
F5 NETWORKS INC	5,809	119.400	693,594.600	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	50.860	657,060.340	
REYNOLDS AMERICAN INC	66,092	46.950	3,103,019.400	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	109.080	1,131,050.520	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	123.090	424,291.230	
JUNIPER NETWORKS INC	30,722	29.730	913,365.060	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	50.260	698,010.880	
HOLOGIC INC	18,649	37.620	701,575.380	
UNUM GROUP	19,821	33.110	656,273.310	
HOME DEPOT INC	101,704	121.900	12,397,717.600	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,610	102.910	1,297,695.100	
HORMEL FOODS CORP	11,661	66.400	774,290.400	
HUDSON CITY BANCORP INC	43,137	10.050	433,526.850	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	18.540	592,390.080	
HUMANA INC	11,754	181.510	2,133,468.540	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,637	75.720	502,553.640	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,060	10.860	652,251.600	
RED HAT INC	14,283	75.980	1,085,222.340	
BIOGEN INC	18,152	264.670	4,804,289.840	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,400	87.610	2,312,904.000	
INTUIT INC	20,568	93.210	1,917,143.280	
ISIS PHARMACEUTICALS INC	9,222	42.200	389,168.400	
INGERSOLL-RAND PLC	21,063	54.580	1,149,618.540	
INTEL CORP	371,543	32.210	11,967,400.030	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,632	110.100	620,083.200	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,541	41.950	1,323,144.950	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,872	20.960	772,837.120	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,297	40.910	380,340.270	
INCYTE CORP	12,683	106.010	1,344,524.830	
JOHNSON & JOHNSON	217,104	95.990	20,839,812.960	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	32,860	46.860	1,539,819.600	
JOHNSON CONTROLS INC	50,971	44.070	2,246,291.970	
KLA-TENCOR CORP	12,621	52.820	666,641.220	
DEVON ENERGY CORP	32,345	43.990	1,422,856.550	
KELLOGG CO	20,813	69.830	1,453,371.790	
KEYCORP	66,833	13.150	878,853.950	

KIMBERLY-CLARK CORP	29,054	115.430	3,353,703.220	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,714	315.660	3,066,321.240	
KOHL'S CORP	15,787	46.500	734,095.500	
KROGER CO	72,724	38.200	2,778,056.800	
LAM RESEARCH CORP	12,091	66.480	803,809.680	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,007	68.520	411,599.640	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	72.820	1,046,204.940	
LEGG MASON INC	9,375	43.740	410,062.500	
LEGGETT & PLATT INC	8,522	44.300	377,524.600	
LENNAR CORP	12,932	51.190	661,989.080	
LEUCADIA NATIONAL CORP	30,186	20.650	623,340.900	
ELI LILLY & CO	77,351	79.440	6,144,763.440	
L BRANDS INC	19,395	96.830	1,878,017.850	
LINCOLN NATIONAL CORP	21,084	49.450	1,042,603.800	
LINEAR TECH CORP	18,324	41.240	755,681.760	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,011	104.410	5,743,698.510	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26,779	35.990	963,776.210	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,634	214.330	4,422,485.220	
LOEWS CORP	24,433	36.330	887,650.890	
RANGE RESOURCES CORP	12,431	34.480	428,620.880	
LOWE'S COS INC	75,167	73.810	5,548,076.270	
DOMINION RESOURCES INC/VA	46,529	72.000	3,350,088.000	
SCANA CORP	9,574	56.410	540,069.340	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,355	19.070	159,329.850	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,729	21.080	711,007.320	
MCCORMICK & CO INC	9,163	83.350	763,736.050	
MCDONALD'S CORPORATION	74,354	103.240	7,676,306.960	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	21,226	90.230	1,915,221.980	
EVEREST RE GROUP LTD	2,661	178.280	474,403.080	
MANPOWERGROUP INC	5,703	87.190	497,244.570	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	8,263	149.530	1,235,566.390	
MARSH & MCLENNAN COS	41,835	53.920	2,255,743.200	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,542	84.660	469,185.720	
MASCO CORP	30,441	27.110	825,255.510	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,501	162.020	729,252.020	
MATTEL INC	25,152	22.490	565,668.480	
METLIFE INC	74,474	48.340	3,600,073.160	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,891	34.860	763,120.260	
MEDTRONIC PLC	111,023	73.010	8,105,789.230	
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,499	32.580	1,319,457.420	

CVS HEALTH CORP	88,345	103.070	9,105,719.150	
MERCK & CO. INC.	219,478	50.710	11,129,729.380	
SUNEDISON INC	20,428	8.980	183,443.440	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,810	112.600	879,406.000	
MICROSOFT CORP	603,178	47.000	28,349,366.000	
MICRON TECH INC	83,952	18.030	1,513,654.560	
RACKSPACE HOSTING INC	10,000	26.730	267,300.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,799	46.280	731,177.720	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,888	9.250	285,714.000	
3M CO	49,809	150.060	7,474,338.540	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,675	197.800	924,715.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,138	69.430	912,171.340	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,699	97.980	852,328.020	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	29.460	366,570.780	
ENDO INTERNATIONAL PLC	15,883	64.000	1,016,512.000	
MYLAN NV	32,656	42.900	1,400,942.400	
ILLUMINA INC	11,266	146.600	1,651,595.600	
XCEL ENERGY INC	41,914	35.840	1,502,197.760	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	32,114	39.250	1,260,474.500	
NETAPP INC	24,525	33.370	818,399.250	
NEWELL RUBBERMAID INC	21,322	42.550	907,251.100	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	113.360	416,824.720	
NEWMONT MINING CORP	37,881	18.450	698,904.450	
NIKE INC-CL B	53,002	126.430	6,701,042.860	
NOBLE ENERGY INC	34,695	35.480	1,230,978.600	
NORDSTROM INC	11,509	68.830	792,164.470	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,184	80.980	1,958,420.320	
EVERSOURCE ENERGY	26,416	51.180	1,351,970.880	
COACH INC	21,436	30.830	660,871.880	
TOWERS WATSON & COMPANY	4,459	122.530	546,361.270	
NORTHERN TRUST CORP	17,989	68.800	1,237,643.200	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,528	177.190	2,574,216.320	
WELLS FARGO & CO	383,002	52.180	19,985,044.360	
NUCOR CORP	24,612	41.280	1,015,983.360	
MONSANTO CO	37,900	89.540	3,393,566.000	
CHENIERE ENERGY INC	17,814	50.770	904,416.780	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,198	74.250	3,207,451.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,326	73.040	4,333,171.040	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	46.380	421,176.780	
OGE ENERGY CORP	16,028	28.390	455,034.920	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,893	257.070	2,029,053.510	
ORACLE CORP	270,562	38.040	10,292,178.480	
PACCAR INC	27,939	54.860	1,532,733.540	

EXELON CORP	67,643	31.030	2,098,962.290	
PARKER HANNIFIN CORP	11,757	106.330	1,250,121.810	
PARTNERRE LTD	3,890	139.210	541,526.900	
PATTERSON COS INC	4,032	46.740	188,455.680	
PAYCHEX INC	25,896	50.310	1,302,827.760	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	53.690	457,385.110	
PPL CORPORATION	52,418	33.420	1,751,809.560	
PEPSICO INC	115,435	99.140	11,444,225.900	
PENTAIR PLC	14,306	56.880	813,725.280	
PFIZER INC	482,211	33.220	16,019,049.420	
CONOCOPHILLIPS	95,275	55.270	5,265,849.250	
PVH CORP	6,479	100.460	650,880.340	
PG&E CORP	36,973	53.000	1,959,569.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,237	134.000	1,639,758.000	
ALTRIA GROUP INC	152,084	57.460	8,738,746.640	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,969	89.710	3,675,328.990	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,980	122.090	608,008.200	
GARMIN LTD	9,959	36.950	367,985.050	
AETNA INC	27,229	110.630	3,012,344.270	
FLUOR CORP (NEW)	11,793	47.090	555,332.370	
PPG INDUSTRIES INC	21,222	97.340	2,065,749.480	
PRAXAIR INC	22,231	108.530	2,412,730.430	
PRECISION CASTPARTS CORP	11,186	230.590	2,579,379.740	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,337	153.630	5,275,193.310	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,526	70.240	1,441,746.240	
QUEST DIAGNOSTICS	11,056	63.360	700,508.160	
PROCTER & GAMBLE CO	212,337	74.330	15,783,009.210	
PROGRESSIVE CORP	45,883	32.270	1,480,644.410	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,399	42.700	1,682,337.300	
PULTE GROUP INC	25,477	20.100	512,087.700	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	37,710	18.640	702,914.400	
QUALCOMM INC	127,053	57.790	7,342,392.870	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	51.360	532,808.640	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	108.200	382,487.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,984	526.830	3,152,550.720	
AUTONATION INC	3,445	60.740	209,249.300	
RESMED INC	11,376	54.550	620,560.800	
US BANCORP	137,412	41.630	5,720,461.560	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,051	76.140	841,423.140	
RITE AID CORP	73,930	6.260	462,801.800	
ROSS STORES INC	32,109	50.530	1,622,467.770	

ROPER TECHNOLOGIES INC	8,066	174.230	1,405,339.180	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,943	105.520	1,154,705.360	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,330	92.900	1,238,357.000	
RAYTHEON COMPANY	23,936	112.310	2,688,252.160	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,580	279.000	1,277,820.000	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	33.660	630,754.740	
ACCENTURE PLC-CL A	48,758	105.050	5,122,027.900	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	127,104	45.050	5,726,035.200	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	13,685	42.200	577,507.000	
SANDISK CORP	16,366	62.850	1,028,603.100	
ROCKWELL COLLINS INC	9,506	86.400	821,318.400	
ST JUDE MEDICAL INC	21,273	65.390	1,391,041.470	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	24,709	103.720	2,562,817.480	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,950	70.820	1,625,319.000	
PRICELINE GROUP INC	4,008	1,347.190	5,399,537.520	
SCHLUMBERGER LTD	98,643	74.940	7,392,306.420	
SCHWAB (CHARLES) CORP	90,877	28.390	2,579,998.030	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,008	96.510	1,351,912.080	
BUNGE LTD	10,172	77.130	784,566.360	
SEI INVESTMENTS CO	10,402	49.510	515,003.020	
ANTHEM INC	20,699	143.860	2,977,758.140	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,490	93.720	1,545,442.800	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	49.420	1,154,006.420	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,362	243.770	1,550,864.740	
CENTENE CORP	7,708	57.280	441,514.240	
SIGMA-ALDRICH	9,766	139.650	1,363,821.900	
ACUITY BRANDS INC	2,888	197.850	571,390.800	
SNAP-ON INC	4,354	163.600	712,314.400	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,139	77.940	2,738,733.660	
ADVANCE AUTO PARTS	6,001	191.280	1,147,871.280	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28,328	12.030	340,785.840	
EDISON INTERNATIONAL	26,497	63.590	1,684,944.230	
SOUTHERN CO	71,178	45.610	3,246,428.580	
BB&T CORP	60,610	36.710	2,224,993.100	
SOUTHWEST AIRLINES	13,746	41.220	566,610.120	
AT&T INC	480,417	33.300	15,997,886.100	
CHEVRON CORP	147,417	88.740	13,081,784.580	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,011	101.510	1,219,236.610	
STAPLES INC	50,301	12.190	613,169.190	
STATE STREET CORP	31,868	69.110	2,202,397.480	

STARBUCKS CORP	117,519	60.540	7,114,600.260	
STRYKER CORP	26,601	98.510	2,620,464.510	
NETFLIX INC	30,599	113.450	3,471,456.550	
STERICYCLE INC	6,853	149.620	1,025,345.860	
SUNTRUST BANKS INC	42,848	39.560	1,695,066.880	
SYMANTEC CORP	55,527	20.880	1,159,403.760	
SYNOPSIS INC	11,163	48.100	536,940.300	
SYSCO CORP	47,889	41.240	1,974,942.360	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,954	460.840	1,361,321.360	
TESORO CORP	10,250	103.630	1,062,207.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	81,566	51.340	4,187,598.440	
TEXTRON INC	21,846	41.210	900,273.660	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,197	125.900	3,927,702.300	
TIFFANY & CO	10,305	80.540	829,964.700	
TOLL BROTHERS INC	12,654	37.090	469,336.860	
TORCHMARK CORP	10,414	58.050	604,532.700	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	48.970	667,803.890	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	73.640	1,026,983.440	
TRACTOR SUPPLY CO	11,181	85.740	958,658.940	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,388	17.290	404,378.520	
TYSON FOODS INC	25,091	47.050	1,180,531.550	
MARATHON OIL CORP	52,743	18.960	1,000,007.280	
UNION PACIFIC CORP	68,867	95.260	6,560,270.420	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	66,367	95.430	6,333,402.810	
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,657	122.510	9,023,719.070	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,441	129.270	961,898.070	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	76.820	637,298.720	
VF CORP	28,415	71.560	2,033,377.400	
CBS CORP	36,310	42.620	1,547,532.200	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,746	113.250	2,122,984.500	
VULCAN MATERIALS CO	10,233	94.200	963,948.600	
URBAN OUTFITTERS INC	8,777	30.740	269,804.980	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,479	86.210	5,817,364.590	
WAL-MART STORES INC	126,006	66.930	8,433,581.580	
WASTE MANAGEMENT INC	34,984	53.410	1,868,495.440	
WATERS CORP	6,779	120.590	817,479.610	
ALLERGAN PLC	30,766	273.400	8,411,424.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,059	118.420	954,346.780	
WESTERN DIGITAL CORP	18,200	85.010	1,547,182.000	
WABTEC CORP	7,250	94.040	681,790.000	
WHIRLPOOL CORP	6,288	158.870	998,974.560	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,061	79.590	1,198,704.990	

WYNN RESORTS LTD	6,279	71.200	447,064.800	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	33.650	977,700.750	
NASDAQ INC	9,132	54.130	494,315.160	
CME GROUP INC	24,875	89.560	2,227,805.000	
WILLIAMS COS INC	54,874	42.540	2,334,339.960	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	50.210	437,630.360	
LKQ CORP	22,850	28.460	650,311.000	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	26.430	480,893.850	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	59.370	629,856.330	
WEC ENERGY GROUP INC	24,880	52.770	1,312,917.600	
FOOT LOCKER INC	11,034	70.770	780,876.180	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,310	32.080	683,624.800	
CARMAX INC	17,598	57.340	1,009,069.320	
XEROX CORP	88,088	10.460	921,400.480	
XILINX INC	20,017	44.690	894,559.730	
YAHOO! INC	69,471	32.860	2,282,817.060	
CIMAREX ENERGY CO	6,901	121.540	838,747.540	
TJX COMPANIES INC	54,044	73.580	3,976,557.520	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,740	82.390	472,918.600	
CBRE GROUP INC	20,788	33.340	693,071.920	
LIBERTY GLOBAL PLC	17,106	44.330	758,308.980	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,419	9.080	975,364.520	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,276	58.790	75,016.040	
T-MOBILE US INC	19,411	40.530	786,727.830	
LAS VEGAS SANDS CORP	31,104	46.130	1,434,827.520	
MEDIVATION INC	12,474	41.300	515,176.200	
MOSAIC CO/THE	25,355	33.080	838,743.400	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	36,077	28.840	1,040,460.680	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	96,941	28.670	2,779,298.470	
CELANESE CORP	11,777	64.230	756,436.710	
IHS INC-CLASS A	5,758	120.950	696,430.100	
DISCOVERY COMMNUCATIONS- A	13,414	28.840	386,859.760	
EXPEDIA INC	8,139	127.020	1,033,815.780	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,830	50.380	999,035.400	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,183	109.830	1,557,718.890	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	51,510	42.610	2,194,841.100	
GAMESTOP CORP. - CL. A	8,633	43.940	379,334.020	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,848	233.400	2,065,123.200	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	13,591	103.350	1,404,629.850	
VIACOM INC-CLASS B	27,414	46.500	1,274,751.000	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,433	747.820	1,819,446.060	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,961	57.800	402,345.800	
TRANSDIGM GROUP INC	4,061	221.720	900,404.920	
MASTERCARD INC	78,551	96.640	7,591,168.640	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	35,147	27.900	980,601.300	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,179	78.870	802,817.730	
HANESBRANDS INC	32,964	29.670	978,041.880	
WESTERN UNION CO	41,207	19.140	788,701.980	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	35,460	19.240	682,250.400	
SPECTRA ENERGY CORP	52,852	29.350	1,551,206.200	
TIME WARNER CABLE INC	21,719	186.670	4,054,285.730	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,191	15.910	305,328.810	
DELTA AIR LINES INC	17,405	48.500	844,142.500	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,164	34.110	176,144.040	
DISCOVER FINANCIAL	34,753	55.540	1,930,181.620	
TE CONNECTIVITY LTD	31,379	61.950	1,943,929.050	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	115.080	1,159,661.160	
WABCO HOLDING INC	4,395	113.500	498,832.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	51.910	398,668.800	
VMWARE INC	6,605	72.270	477,343.350	
TERADATA CORP	12,117	28.580	346,303.860	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	166.070	814,905.490	
INVESCO LTD	34,162	32.630	1,114,706.060	
NETSUITE INC	3,281	89.280	292,927.680	
CALPINE CORP NPR	26,738	16.090	430,214.420	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	121,221	84.660	10,262,569.860	
VISA INC	153,153	74.990	11,484,943.470	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,483	84.030	1,301,036.490	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,289	57.450	935,803.050	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	7,259	55.140	400,261.260	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	144.760	882,312.200	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,028	27.210	572,171.880	
MARATHON PETROLEUM CORP	42,732	49.770	2,126,771.640	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,122	50.840	514,602.480	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	144,557	32.290	4,667,745.530	

XYLEM INC	11,028	34.640	382,009.920	
ALKERMES PLC	11,218	59.070	662,647.260	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	31,960	92.680	2,962,052.800	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	20,406	117.680	2,401,378.080	
LINKEDIN CORP	8,789	192.160	1,688,894.240	
SPLUNK INC	9,277	57.250	531,108.250	
FREESCALE SEMICONDUCTOR LIMITED	7,437	37.270	277,176.990	
ZILLOW GROUP INC	4,067	34.540	140,474.180	
HCA HOLDINGS INC	26,050	77.790	2,026,429.500	
VERISK ANALYTICS INC	13,285	81.460	1,082,196.100	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,874	133.390	650,142.860	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,223	146.720	913,038.560	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	15,779	71.300	1,125,042.700	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,944	64.670	707,748.480	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	30,557	7.720	235,900.040	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,012	185.920	1,117,751.040	
CIT GROUP INC	13,340	41.890	558,812.600	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	330,000	0.580	191,400.000	
LEAR CORP	6,259	116.410	728,610.190	
DOLLAR GENERAL CORP	23,512	68.520	1,611,042.240	
AON PLC	21,841	91.280	1,993,646.480	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	39.340	450,993.760	
TESLA MOTORS INC	7,149	215.580	1,541,181.420	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	46.350	713,465.550	
GENERAL MOTORS CO	109,374	33.020	3,611,529.480	
VANTIV INC	12,141	47.400	575,483.400	
TRIPADVISOR INC	9,263	67.480	625,067.240	
ALLY FINANCIAL INC	29,357	20.500	601,818.500	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,570	41.920	694,614.400	
VOYA FINANCIAL INC	16,634	39.890	663,530.260	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	22,647	81.780	1,852,071.660	
PHILLIPS 66	42,882	83.870	3,596,513.340	
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	2,200	78.230	172,106.000	
LIBERTY MEDIA CORP	5,006	38.500	192,731.000	
FACEBOOK INC	167,292	94.260	15,768,943.920	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	7,204	70.090	504,928.360	
ADT CORP	15,211	33.680	512,306.480	
SERVICENOW INC	10,829	74.280	804,378.120	

WHITEWAVE FOODS CO	12,239	43.460	531,906.940		
PALO ALTO NETWORKS INC	5,614	167.810	942,085.340		
TABLEAU SOFTWARE INC	3,880	84.460	327,704.800		
WORKDAY INC	7,948	77.510	616,049.480		
ABBVIE INC	133,171	55.770	7,426,946.670		
ZOETIS INC	37,899	42.710	1,618,666.290		
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,645	59.790	756,044.550		
NEWS CORP/NEW-CL A	33,106	13.910	460,504.460		
MALLINCKRODT PLC	9,419	65.890	620,617.910		
SPRINT CORP	84,196	4.500	378,882.000		
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS INC	12,129	36.030	437,007.870		
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,283	43.840	626,166.720		
FIREEYE INC	8,532	31.000	264,492.000		
ANTERO RESOURCES CORP	1,568	23.650	37,083.200		
TWITTER INC	37,478	28.750	1,077,492.500		
PERRIGO CO PLC	11,364	161.530	1,835,626.920		
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	36,830	25.220	928,852.600		
ARAMARK	17,585	30.950	544,255.750		
NAVIENT CORP	28,699	11.880	340,944.120		
FNF GROUP	21,690	36.410	789,732.900		
LIBERTY MEDIA CORP-C	18,330	37.460	686,641.800		
SYNCHRONY FINANCIAL	13,543	32.340	437,980.620		
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	33,236	23.560	783,040.160		
CDK GLOBAL INC	9,646	50.030	482,589.380		
QORVO INC	12,235	46.430	568,071.050		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,174	26.950	193,339.300		
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,310	46.990	1,236,306.900		
WESTROCK CO	19,981	56.330	1,125,529.730		
KRAFT HEINZ CO	46,578	73.720	3,433,730.160		
ALPHABET INC-CL A	22,566	676.430	15,264,319.380		
PAYPAL HOLDINGS INC	85,724	32.630	2,797,174.120		
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	32.000	260,288.000		
ALPHABET INC-CL C	24,125	646.670	15,600,913.750		
COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	25,231	21.080	531,869.480		
BAXALTA INC	44,320	31.190	1,382,340.800		
アメリカ・ドル 小計	25,112,732		1,428,493,930.010 (171,347,846,904)		
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	71,341	3.445	245,769.740	
	AMEC FOSTER WHEELER PLC	28,599	8.110	231,937.890	
	ANTOFAGASTA PLC	25,905	5.765	149,342.320	
	ASHTREAD GROUP	38,160	10.110	385,797.600	
	SEVERN TRENT PLC	19,770	22.210	439,091.700	

BHP BILLITON PLC	164,052	11.775	1,931,712.300	
BARCLAYS PLC	1,318,008	2.565	3,380,690.520	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	68,386	6.260	428,096.360	
BT GROUP PLC	657,931	4.353	2,863,973.640	
SKY PLC	82,222	10.720	881,419.840	
AGGREKO PLC	18,550	10.560	195,888.000	
TULLOW OIL PLC	92,627	2.421	224,249.960	
BUNZL PLC	26,929	18.370	494,685.730	
EASYJET PLC	13,628	17.050	232,357.400	
CAPITA PLC	50,523	12.550	634,063.650	
AVIVA PLC	319,061	4.711	1,503,096.370	
CRODA INTERNATIONAL	9,774	27.630	270,055.620	
DIAGEO PLC	197,214	18.275	3,604,085.850	
SCHRODERS PLC	10,331	28.370	293,090.470	
NATIONAL GRID PLC	288,774	9.089	2,624,666.880	
GKN PLC	134,097	2.917	391,160.940	
KINGFISHER PLC	189,315	3.538	669,796.470	
BAE SYSTEMS PLC	245,770	4.629	1,137,669.330	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	144,037	37.635	5,420,832.490	
COBHAM PLC	88,449	2.958	261,632.140	
NEXT PLC	10,966	76.450	838,350.700	
REXAM PLC	54,770	5.345	292,745.650	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	75,241	34.410	2,589,042.810	
IMI PLC	22,272	10.560	235,192.320	
JOHNSON MATTHEY PLC	18,203	25.940	472,185.820	
SABMILLER PLC	75,242	36.215	2,724,889.030	
ANGLO AMERICAN PLC	109,290	6.917	755,958.930	
COMPASS GROUP PLC	136,931	10.750	1,472,008.250	
HSBC HOLDINGS PLC	1,531,187	5.316	8,139,790.090	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	462,703	2.511	1,161,847.230	
ARM HOLDINGS PLC	109,575	9.570	1,048,632.750	
CENTRICA PLC	386,570	2.389	923,515.730	
UNILEVER PLC	99,674	28.170	2,807,816.580	
MEGGITT PLC	71,707	4.781	342,831.160	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	128,338	1.790	229,725.020	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	53,266	9.615	512,152.590	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	73,187	4.073	298,090.650	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	27,749	33.790	937,638.710	
PEARSON PLC	65,464	12.060	789,495.840	
PERSIMMON PLC	23,150	19.360	448,184.000	
PRUDENTIAL PLC	198,517	15.150	3,007,532.550	
RIO TINTO PLC	99,709	25.370	2,529,617.330	

VODAFONE GROUP PLC	2,044,567	2.108	4,309,947.230	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	49,830	60.890	3,034,148.700	
RELX PLC	91,200	11.320	1,032,384.000	
OLD MUTUAL PLC	389,986	2.108	822,090.480	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	145,152	7.260	1,053,803.520	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	263,787	3.283	866,012.720	
ST JAMES'S PLACE PLC	41,514	8.735	362,624.790	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	19.690	391,732.550	
SSE PLC	76,640	15.460	1,184,854.400	
BP PLC	1,439,054	3.848	5,537,479.790	
SHIRE PLC	45,793	43.830	2,007,107.190	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.240	446,820.040	
SMITHS GROUP PLC	27,324	10.510	287,175.240	
STANDARD CHARTERED PLC	191,743	7.627	1,462,423.860	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,412,471	0.759	3,349,065.480	
TATE & LYLE PLC	20,845	5.800	120,901.000	
BG GROUP PLC	264,412	10.805	2,856,971.660	
TAYLOR WIMPLEY PLC	262,412	1.907	500,419.680	
TESCO PLC	631,592	2.018	1,274,552.650	
3I GROUP PLC	88,649	4.754	421,437.340	
SMITH & NEPHEW PLC	71,822	11.230	806,561.060	
GLAXOSMITHKLINE PLC	376,735	13.060	4,920,159.100	
WEIR GROUP	18,336	13.480	247,169.280	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	25,036	24.150	604,619.400	
BABCOCK INT'L GROUP	24,605	9.825	241,744.120	
WPP PLC	101,945	14.080	1,435,385.600	
WOLSELEY PLC	20,425	37.240	760,627.000	
ASTRAZENECA PLC	97,819	41.765	4,085,410.530	
WHITBREAD PLC	13,806	46.820	646,396.920	
CARNIVAL PLC	14,275	33.340	475,928.500	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	131,038	4.937	646,934.600	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	25.650	344,889.900	
WILLIAM HILL PLC	60,095	3.446	207,087.370	
BURBERRY GROUP PLC	36,044	14.750	531,649.000	
INVESTEC PLC	50,655	5.450	276,069.750	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,882	23.770	425,055.140	
ICAP PLC	52,823	4.687	247,581.400	
ITV PLC	301,405	2.450	738,442.250	
SAINSBURY (J) PLC	89,174	2.712	241,839.880	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	44.080	382,305.840	
G4S PLC	124,374	2.566	319,143.680	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	15.430	245,228.990	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	301,572	17.915	5,402,662.380	

	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	195,064	18.140	3,538,460.960	
	INMARSAT PLC	34,127	9.160	312,603.320	
	PETROFAC LTD	21,025	9.180	193,009.500	
	TUI AG-DI	19,394	12.200	236,606.800	
	STANDARD LIFE PLC	153,643	4.222	648,680.740	
	EXPERIAN PLC	77,722	11.040	858,050.880	
	MONDI PLC	31,215	14.610	456,051.150	
	SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC	21,006	6.870	144,311.220	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	12.730	271,021.700	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	84,043	2.701	227,000.140	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	7.395	115,650.400	
	GLENCORE PLC	857,397	1.211	1,038,307.760	
	DIXONS CARPHONE PLC	72,841	4.332	315,547.210	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	98,404	3.766	370,589.460	
	COCA-COLA HBC AG	18,432	14.990	276,295.680	
	ROYAL MAIL PLC	64,647	4.722	305,263.130	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	39,861	3.813	151,989.990	
イギリス・ポンド	小計	22,522,929		126,466,691.000 (23,220,549,134)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,152	20.470	2,091,051.440	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	15.110	1,877,719.700	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	7.460	1,404,195.800	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	38,983	20.500	799,151.500	
	NICE SYSTEMS LTD	3,882	219.500	852,099.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	68,127	224.800	15,314,949.600	
イスラエル・シュケル	小計	525,644		22,339,167.040 (698,992,536)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	59.060	755,672.700	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	214,207	28.350	6,072,768.450	
	AMCOR LTD	84,976	13.060	1,109,786.560	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	241,524	30.620	7,395,464.880	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	12.720	428,689.440	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	2.400	358,094.400	
	TELSTRA CORP LTD	328,099	5.580	1,830,792.420	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	10.360	330,214.640	
	AMP LTD	240,810	5.750	1,384,657.500	
	ASX LTD	18,724	39.010	730,423.240	

BHP BILLITON LTD	246,429	25.360	6,249,439.440	
CALTEX AUSTRALIA LTD	21,516	32.990	709,812.840	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,430	3.930	151,029.900	
COMPUTERSHARE LT	34,030	10.590	360,377.700	
CSL LIMITED	36,821	88.920	3,274,123.320	
TRANSURBAN GROUP	159,479	9.810	1,564,488.990	
COCA-COLA AMATIL LTD	60,500	9.010	545,105.000	
COCHLEAR LTD	5,226	84.440	441,283.440	
ORIGIN ENERGY LTD	84,610	6.270	530,504.700	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	132,786	74.650	9,912,474.900	
BORAL LIMITED	43,430	5.380	233,653.400	
RIO TINTO LIMITED	34,809	54.810	1,907,881.290	
APA GROUP	87,434	8.920	779,911.280	
ARISTOCRAT LEISU	40,226	8.990	361,631.740	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	174,456	5.090	887,981.040	
TPG TELECOM LTD	12,142	10.870	131,983.540	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	17.350	620,956.500	
ORICA LTD	34,301	16.910	580,029.910	
CIMIC GROUP LTD	7,290	26.430	192,674.700	
SYDNEY AIRPORT	85,130	5.930	504,820.900	
MACQUARIE GROUP LTD	23,603	80.770	1,906,414.310	
SUNCORP GROUP LTD	103,375	12.880	1,331,470.000	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	204,471	31.400	6,420,389.400	
NEWCREST MINING LTD	74,849	14.710	1,101,028.790	
INCITEC PIVOT LTD	165,148	3.960	653,986.080	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	43,622	3.580	156,166.760	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	106,137	12.990	1,378,719.630	
SANTOS LTD	84,284	5.930	499,804.120	
SONIC HEALTHCARE	33,734	18.050	608,898.700	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.750	336,186.000	
WESFARMERS LTD	87,657	40.200	3,523,811.400	
ALUMINA LIMITED	184,613	1.265	233,535.440	
ILUKA RESOURCES LIM I	45,912	7.390	339,289.680	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	32.020	1,854,694.460	
WOOLWORTHS LTD	98,290	26.600	2,614,514.000	
SEEK LTD	29,830	12.790	381,525.700	
TATTS GROUP LTD	141,350	3.820	539,957.000	
AGL ENERGY LTD	48,662	16.120	784,431.440	
BRAMBLES LTD	123,431	10.050	1,240,481.550	
ASCIANO LTD	74,924	8.510	637,603.240	
CROWN RESORTS LTD	32,861	11.470	376,915.670	
AURIZON HOLDINGS LTD	142,831	5.130	732,723.030	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	6.540	368,869.080	
	HEALTHSCOPE LTD	33,982	2.540	86,314.280	
	MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.460	577,728.540	
	SOUTH32 LTD(AUD)	432,027	1.520	656,681.040	
	ORIGIN ENERGY LTD-RTS	48,348	2.240	108,299.520	
オーストラリア・ドル 小計		5,514,643		79,787,167.620 (7,017,281,392)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	13,502	37.160	501,734.320	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	33,941	59.870	2,032,047.670	
	BARRICK GOLD CORP	89,708	9.840	882,726.720	
	ATCO LTD	7,193	39.930	287,216.490	
	BANK OF MONTREAL	49,807	75.510	3,760,926.570	
	BANK OF NOVA SCOTIA	93,034	60.280	5,608,089.520	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,392	42.010	1,066,717.920	
	BCE INC	9,856	55.530	547,303.680	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	66,058	43.380	2,865,596.040	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,546	227.560	5,813,247.760	
	BOMBARDIER INC 'B'	97,503	1.650	160,879.950	
	SAPUTO INC	20,680	31.200	645,216.000	
	BLACKBERRY LTD	38,780	9.590	371,900.200	
	CGI GROUP INC	17,094	48.040	821,195.760	
	CAE INC	31,436	14.680	461,480.480	
	CAMECO CORP	29,078	18.330	532,999.740	
	ROGERS COMM-CL B	29,459	47.830	1,409,023.970	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,504	99.360	3,030,877.440	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	86,449	32.040	2,769,825.960	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,911	113.600	671,489.600	
	CANADIAN UTILITIES LTD	8,537	37.180	317,405.660	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,192	80.430	5,082,532.560	
	AGRIUM INC	11,307	123.910	1,401,050.370	
	YAMANA GOLD INC	67,520	3.220	217,414.400	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,758	39.130	734,000.540	
	OPEN TEXT CORP	12,014	60.770	730,090.780	
	ELDORADO GOLD CORP	46,790	5.100	238,629.000	
	EMPIRE CO LTD	15,093	27.350	412,793.550	
	KINROSS GOLD CORP	125,461	2.880	361,327.680	
	FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	21.940	376,490.400	
	FORTIS INC	20,884	38.830	810,925.720	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,435	8.630	409,364.050	
TELUS CORP	18,945	42.560	806,299.200		
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	33.560	833,529.720		

IMPERIAL OIL LTD	22,883	45.640	1,044,380.120	
ENBRIDGE INC	65,808	55.220	3,633,917.760	
IGM FINANCIAL INC	8,010	37.570	300,935.700	
JEAN COUTU GROUP INC	3,791	20.080	76,123.280	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	74,943	3.900	292,277.700	
MANULIFE FINANCIAL CORP	155,082	21.580	3,346,669.560	
LOBLAW CO LTD	17,936	66.270	1,188,618.720	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	42.460	408,889.800	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,039	65.470	2,097,593.330	
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,112	44.340	2,177,626.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,614	615.610	993,594.540	
METRO INC	22,860	36.060	824,331.600	
HUSKY ENERGY INC	26,989	23.160	625,065.240	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,920	20.130	743,199.600	
METHANEX CORP	7,381	54.790	404,404.990	
ONEX CORP	6,646	75.440	501,374.240	
GOLDCORP INC	67,652	18.750	1,268,475.000	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	65,526	28.120	1,842,591.120	
POWER CORP OF CANADA	32,563	29.190	950,513.970	
POWER FINANCIAL CORP	23,521	32.420	762,550.820	
ROYAL BANK OF CANADA	113,212	73.900	8,366,366.800	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,939	43.540	519,824.060	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,278	203.690	2,500,905.820	
SHAW COMM INC-B	29,011	26.270	762,118.970	
SUNCOR ENERGY INC	113,283	36.670	4,154,087.610	
ENCANA CORP	59,596	11.320	674,626.720	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,683	9.630	420,667.290	
THOMSON REUTERS CORP	29,905	53.590	1,602,608.950	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	141,801	53.050	7,522,543.050	
TRANSCANADA CORP	54,748	45.050	2,466,397.400	
TRANSALTA CORP	34,014	7.060	240,138.840	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,200	48.570	203,994.000	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	106.470	504,987.210	
INTACT FINANCIAL CORP	10,718	92.510	991,522.180	
SILVER WHEATON CORP	28,408	18.680	530,661.440	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	532.250	795,181.500	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	11,057	63.280	699,686.960	
CI FINANCIAL CORP	16,122	31.700	511,067.400	
VERESEN INC	17,460	12.610	220,170.600	

	TOURMALINE OIL CORP	15,779	34.790	548,951.410	
	KEYERA CORP	13,728	41.420	568,613.760	
	ALTAGAS LTD	12,358	34.900	431,294.200	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,194	36.020	835,447.880	
	DOLLARAMA INC	9,286	88.380	820,696.680	
	MEG ENERGY CORP	14,673	12.580	184,586.340	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	61,276	21.900	1,341,944.400	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	49.060	406,756.460	
	ARC RESOURCES LTD	20,372	21.780	443,702.160	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	47,227	9.830	464,241.410	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	31.610	353,020.480	
	INTER PIPELINE LTD	29,717	26.490	787,203.330	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,330	28.010	261,333.300	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,471	47.010	774,301.710	
カナダ・ドル	小計	3,060,312		112,365,132.910 (10,338,715,880)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.230	403,750.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	92,000	3.930	361,560.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	3.990	493,563.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	40	0.380	15.200	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	136,700	17.770	2,429,159.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	8.240	304,880.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,244	32.270	330,573.880	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	7.570	658,590.000	
	CAPITALAND LTD	184,415	3.130	577,218.950	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	0.810	473,364.000	
	KEPPEL CORP LTD	106,500	7.450	793,425.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	202,000	3.080	622,160.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	0.515	212,057.940	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	239,253	9.410	2,251,370.730	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	626,022	3.910	2,447,746.020	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.980	521,550.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,000	20.070	1,886,580.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	2.930	586,000.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.250	288,750.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	2.320	661,200.000	
シンガポール・ドル	小計	3,823,537		16,303,513.720 (1,395,417,738)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	118,733	24.170	2,869,776.610	

SYNGENTA AG	7,218	313.900	2,265,730.200		
NESTLE SA-REGISTERED	252,581	74.850	18,905,687.850		
CIE FINANC RICHEMONT	40,740	83.700	3,409,938.000		
ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	55,102	254.500	14,023,459.000		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,548	148.100	525,458.800		
SIKA INHABER	188	3,118.000	586,184.000		
SGS SA-REG	458	1,809.000	828,522.000		
SULZER AG-REG	1,118	100.200	112,023.600		
NOVARTIS AG-REG SHS	178,538	88.850	15,863,101.300		
BALOISE HOLDING AG -R	3,687	114.200	421,055.400		
BARRY CALLEBAUT AG	92	1,152.000	105,984.000		
SWISSCOM AG-REG	1,850	492.600	911,310.000		
ABB LTD	167,033	18.060	3,016,615.980		
ADECCO SA-REG	12,185	73.000	889,505.000		
GEBERIT AG	3,062	317.600	972,491.200		
LONZA GROUP AG-REG	3,997	132.400	529,202.800		
LINDT & SPRUENGLI PART	65	5,810.000	377,650.000		
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	70,850.000	637,650.000		
GIVAUDAN-REG	758	1,695.000	1,284,810.000		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,606	258.300	2,997,829.800		
LAFARGEHOLCIM LTD	18,690	54.600	1,020,474.000		
ACTELION	8,330	118.200	984,606.000		
SONOVA HOLDING AG	4,519	128.500	580,691.500		
KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	132.800	591,358.400		
THE SWATCH GROUP AG-B	2,193	402.500	882,682.500		
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	78.650	436,664.800		
SCHINDLER NAMEN	1,663	150.500	250,281.500		
SWISS LIFE HOLDING AG	2,785	230.900	643,056.500		
EMS-CHEMIE HOLDING	808	394.250	318,554.000		
SWISS PRIME SITE AG	5,990	74.850	448,351.500		
DUFREY GROUP	3,162	123.900	391,771.800		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,475	329.750	486,381.250		
ARYZTA AG	8,596	46.380	398,682.480		
JULIUS BAER GROUP LTD	17,617	46.700	822,713.900		
SWISS RE LTD	26,944	86.550	2,332,003.200		
TRANSOCEAN LTD	26,823	15.400	413,074.200		
UBS GROUP AG	286,204	19.030	5,446,462.120		
スイス・フラン 小計	1,288,372		87,981,795.190 (10,943,175,686)		
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,991	216.700	10,616,349.700	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,729	202.300	6,823,376.700	
	ERICSSON LM-B SHS	235,937	86.500	20,408,550.500	
	GETINGE AB-B SHS	14,684	197.000	2,892,748.000	
	SKF AB-B SHS	32,306	163.500	5,282,031.000	

	SANDVIK AB	77,917	80.600	6,280,110.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	125,807	93.900	11,813,277.300	
	SKANSKA AB-B SHS	25,753	176.500	4,545,404.500	
	SWEDBANK AB	70,859	196.200	13,902,535.800	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	43,424	223.400	9,700,921.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	118,909	124.500	14,804,170.500	
	VOLVO AB-B SHS	118,487	86.200	10,213,579.400	
	SWEDISH MATCH AB	16,323	252.800	4,126,454.400	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	78.800	1,915,234.000	
	NORDEA AB	239,599	97.650	23,396,842.350	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	156.200	2,866,738.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,296	241.600	4,178,713.600	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	107.900	2,941,461.900	
	INVESTOR AB-B SHS	35,865	306.800	11,003,382.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	73,108	314.300	22,977,844.400	
	ASSA ABLOY AB-B	79,488	154.000	12,241,152.000	
	TELIASONERA AB	194,938	44.530	8,680,589.140	
	LUNDIN PETROLEUM AB	17,555	125.300	2,199,641.500	
	BOLIDEN AB	17,761	155.900	2,768,939.900	
	ALFA LAVAL AB	24,553	145.800	3,579,827.400	
	KINNEVIK INVESTMENT B	18,310	255.800	4,683,698.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,145	534.500	2,750,002.500	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	292.100	1,729,232.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	31,087	56.900	1,768,850.300	
	HEXAGON AB	21,871	274.200	5,997,028.200	
スウェーデン・クローナ 小計		1,815,541		237,088,687.390 (3,475,720,157)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,563	533.000	4,031,079.000	
	A P MOLLER A/S	550	11,140.000	6,127,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	291	10,850.000	3,157,350.000	
	DANSKE BANK A/S	56,971	198.600	11,314,440.600	
	NOVOZYMES-B SHS	19,620	277.700	5,448,474.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	153,480	363.400	55,774,632.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,857	370.700	6,619,589.900	
	TDC A/S	70,447	35.580	2,506,504.260	
	COLOPLAST-B	8,513	466.300	3,969,611.900	
	DSV A/S	15,918	274.500	4,369,491.000	
	WILLIAM DEMANT	2,595	579.000	1,502,505.000	
	TRYG A/S	2,750	124.000	341,000.000	
	PANDORA A/S	9,254	808.500	7,481,859.000	
ISS A/S	11,128	222.900	2,480,431.200		
デンマーク・クローネ 小計		376,937		115,123,967.860 (2,101,012,414)	

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	4.785	468,891.720	
	CONTACT ENERGY L	64,605	4.930	318,502.650	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	7.260	537,181.920	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	209,231	3.065	641,293.010	
ニュージーランド・ドル 小計		445,820		1,965,869.300 (157,544,767)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	79,374	118.700	9,421,693.800	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	32.430	3,472,020.660	
	TELENOR ASA	60,554	164.300	9,949,022.200	
	SUBSEA 7 SA	22,609	71.550	1,617,673.950	
	ORKLA ASA	59,907	64.500	3,864,001.500	
	STATOIL ASA	88,513	138.700	12,276,753.100	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,544	350.200	4,743,108.800	
	SEADRILL LTD	38,772	60.100	2,330,197.200	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,642	114.500	1,562,009.000		
ノルウェー・クローネ 小計		483,977		49,236,480.210 (729,684,636)	
ユーロ	CRH PLC	62,226	23.850	1,484,090.100	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	66.400	943,876.000	
	BANK OF IRELAND	2,198,637	0.345	758,529.760	
	UMICORE	6,363	37.780	240,394.140	
	AIR LIQUIDE	26,893	110.150	2,962,263.950	
	AIRBUS GROUP SE	46,497	56.200	2,613,131.400	
	AXA	154,051	22.790	3,510,822.290	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,227	19.605	710,230.330	
	ADIDAS AG	16,367	75.800	1,240,618.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	96,101	16.540	1,589,510.540	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	29,905	15.120	452,163.600	
	DANONE	45,362	58.590	2,657,759.580	
	SAFRAN SA	21,780	67.400	1,467,972.000	
	INTESA SANPAOLO	999,500	3.174	3,172,413.000	
	INTESA SANPAOLO-RNC	59,714	2.878	171,856.890	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,267	89.250	2,344,329.750	
	ACCOR SA	15,303	43.830	670,730.490	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	5,933	40.940	242,897.020	
	BOUYGUES	15,864	33.175	526,288.200	
	BNP PARIBAS	82,913	53.970	4,474,814.610	
	RELX NV	80,368	14.380	1,155,691.840	
	THALES SA	8,128	60.110	488,574.080	
	CAP GEMINI SA	12,883	74.810	963,777.230	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,109	55.560	228,296.040	
CHRISTIAN DIOR SE	4,128	178.650	737,467.200		
INGENICO GROUP	4,239	106.600	451,877.400		

ALCATEL-LUCENT	221,150	3.292	728,025.800	
UNICREDIT SPA	376,340	5.850	2,201,589.000	
NATIXIS	70,166	5.547	389,210.800	
KONINKLIJKE DSM NV	13,718	45.575	625,197.850	
DELHAIZE GROUP	8,529	81.090	691,616.610	
COMMERZBANK AG	80,064	9.997	800,399.800	
FRESENIUS SE & CO KGAA	29,762	57.630	1,715,184.060	
UNITED INTERNET	9,768	45.135	440,878.680	
FUCHS PETROLUB SE PREF	4,422	40.995	181,279.890	
PUBLICIS GROUPE	14,367	63.760	916,039.920	
MAN SE	3,396	93.180	316,439.280	
IBERDROLA SA	441,615	6.173	2,726,089.390	
ENI SPA	194,215	15.430	2,996,737.450	
JERONIMO MARTINS	19,517	12.240	238,888.080	
KBC GROUPE	20,590	54.390	1,119,890.100	
HANNOVER RUECK SE	4,399	91.250	401,408.750	
WARTSILA OYJ	11,298	38.000	429,324.000	
L'OREAL	19,789	165.150	3,268,153.350	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,741	166.500	3,619,876.500	
LAGARDERE S.C.A.	7,114	25.120	178,703.680	
GEA GROUP AG	16,205	36.775	595,938.870	
BOLLORE	52,042	4.598	239,289.110	
MEDIOBANCA SPA	42,404	8.845	375,063.380	
MICHELIN(CGDE)-B	14,584	86.460	1,260,932.640	
CONTINENTAL AG	8,644	204.300	1,765,969.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	75,581	26.070	1,970,396.670	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	30.000	281,970.000	
AXEL SPRINGER SE	3,067	48.555	148,918.180	
OMV AG	15,010	24.975	374,874.750	
PERNOD-RICARD	16,699	97.770	1,632,661.230	
PEUGEOT SA	33,969	14.860	504,779.340	
PIRELLI & C	14,123	14.920	210,715.160	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,007	42.255	507,355.780	
RENAULT SA	15,554	76.950	1,196,880.300	
REPSOL SA	87,161	12.365	1,077,745.760	
REMY COINTREAU	905	61.600	55,748.000	
MERCK KGAA	9,627	77.370	744,840.990	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	62,763	98.350	6,172,741.050	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,783	39.175	1,401,799.020	
SAIPEM	28,190	8.685	244,830.150	
RWE AG	41,149	13.395	551,190.850	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	13,658	61.500	839,967.000	
SOCIETE GENERALE-A	56,558	41.500	2,347,157.000	
VINCI S.A.	36,827	56.360	2,075,569.720	

SODEXO	7,368	77.180	568,662.240	
SOLVAY SA	5,034	100.100	503,903.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,801	52.670	2,306,998.670	
VIVENDI SA	90,768	21.660	1,966,034.880	
SAP SE	76,018	60.510	4,599,849.180	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	9,593	47.550	456,147.150	
TELEFONICA S.A	344,981	11.580	3,994,879.980	
TOTAL SA	169,324	45.150	7,644,978.600	
VALEO	6,764	131.350	888,451.400	
E.ON SE	151,854	9.562	1,452,027.940	
VOEST-ALPINE AG	9,875	32.920	325,085.000	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	22.855	349,270.110	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	79.690	686,449.660	
METRO AG	11,655	26.970	314,335.350	
SIEMENS AG-REG	61,754	86.030	5,312,696.620	
UPM-KYMMENE OYJ	46,308	15.370	711,753.960	
ING GROEP NV-CVA	299,748	12.530	3,755,842.440	
BAYER AG	64,356	111.150	7,153,169.400	
STORA ENSO OYJ-R SHS	44,611	8.265	368,709.910	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,878	93.940	1,303,699.320	
DAIMLER AG	74,804	73.480	5,496,597.920	
BASF SE	71,445	72.670	5,191,908.150	
BEIERSDORF AG	7,979	81.590	651,006.610	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,833	64.690	765,476.770	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,963	73.150	1,240,843.450	
ORANGE	155,234	13.945	2,164,738.130	
SAMPO OYJ-A SHS	32,912	43.990	1,447,798.880	
RANDSTAD HOLDINGS	8,678	50.360	437,024.080	
ALLIANZ SE	36,052	146.550	5,283,420.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.378	645,515.530	
KONINKLIJKE AHOLD NV	71,470	18.020	1,287,889.400	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,917	44.525	753,229.420	
HERMES INTL	1,835	345.150	633,350.250	
ENDESA S.A.	20,780	19.385	402,820.300	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17,286	13.540	234,052.440	
ERSTE GROUP BANK AG	21,896	26.170	573,018.320	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,359	169.100	2,259,006.900	
ARCELOR MITTAL (NL)	76,767	5.763	442,408.220	
SOCIETE BIC SA	2,165	135.800	294,007.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,074	66.820	739,964.680	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,852	29.035	402,192.820	
HEINEKEN NV	19,005	73.640	1,399,528.200	
AKZO NOBEL	20,652	59.990	1,238,913.480	
ASML HOLDING NV	27,333	79.290	2,167,233.570	
AEGON NV	144,321	5.539	799,394.010	

BANKINTER S.A.	52,241	6.938	362,448.050	
VOLKSWAGEN AG	2,794	132.450	370,065.300	
VOLKSWAGEN AG PFD	12,808	108.550	1,390,308.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	491,341	8.055	3,957,751.750	
KERING	6,033	162.800	982,172.400	
FORTUM OYJ	34,316	14.380	493,464.080	
AGEAS	14,964	38.510	576,263.640	
UCB SA	10,367	67.910	704,022.970	
THYSSENKRUPP AG	29,522	17.975	530,657.950	
UNILEVER NV-CVA	128,212	37.840	4,851,542.080	
CARREFOUR SA	44,554	28.240	1,258,204.960	
GAS NATURAL SDG SA	27,025	19.280	521,042.000	
ATOS SE	6,025	69.570	419,159.250	
NOKIA OYJ	283,740	6.140	1,742,163.600	
TUI AG	19,196	16.480	316,350.080	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	72,718	22.415	1,629,973.970	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	28.370	699,916.270	
SANOFI	92,060	87.180	8,025,790.800	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	6.381	376,542.810	
ELISA OYJ	13,898	30.930	429,865.140	
BANCO SANTANDER SA	1,113,459	5.283	5,882,403.890	
METSO OYJ	10,879	22.280	242,384.120	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	8,282	77.300	640,198.600	
QIAGEN N.V.	19,737	22.880	451,582.560	
LINDE AG	14,642	152.000	2,225,584.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	108,003	25.740	2,779,997.220	
BMW VORZUG	4,116	70.450	289,972.200	
K & S	13,745	24.520	337,027.400	
ENEL SPA	550,062	4.012	2,206,848.740	
COLRUYT NV	4,673	43.940	205,331.620	
VOPAK (KON.)	5,364	36.490	195,732.360	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,385,733	0.057	192,986.780	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	249,904	15.085	3,769,801.840	
BANCO POPULAR ESPANOL	157,769	3.862	609,303.870	
FINMECCANICA SPA	34,431	11.710	403,187.010	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	91,103	10.615	967,058.340	
KONINKLIJKE KPN NV	257,686	3.213	827,945.110	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.162	198,886.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,867	76.610	1,215,570.870	
EURAZEO	2,001	61.320	122,701.320	
BANCO SABADELL	350,263	1.990	697,023.370	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,333	71.140	379,389.620	
FRAPORT AG	3,149	56.950	179,335.550	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	64.610	517,784.540	
INDITEX	84,555	31.200	2,638,116.000	

BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	195,575	1.657	324,067.770	
JC DECAUX SA	5,728	34.440	197,272.320	
ANDRITZ AG	4,704	41.555	195,474.720	
MAPFRE SA	80,219	2.584	207,285.890	
ESSILOR INTL	16,675	107.150	1,786,726.250	
SNAM SPA	158,640	4.502	714,197.280	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	11.245	962,403.320	
ENAGAS	16,043	26.370	423,053.910	
WENDEL	1,994	108.150	215,651.100	
TENARIS SA	33,458	12.290	411,198.820	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	6.800	509,687.200	
TELECOM ITALIA SPA	873,707	1.067	932,245.360	
TELECOM ITALIA-RNC	432,141	0.887	383,309.060	
ATLANTIA SPA	33,870	24.310	823,379.700	
ILIAD SA	2,102	176.500	371,003.000	
PROXIMUS	13,498	29.695	400,823.110	
SES FDR	24,850	28.805	715,804.250	
TERNA SPA	110,846	4.340	481,071.640	
GRIFOLS SA	13,410	38.070	510,518.700	
FERROVIAL SA	34,406	21.785	749,534.710	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	46.250	317,090.000	
EXOR SPA	9,585	41.860	401,228.100	
NESTE OYJ	10,692	20.900	223,462.800	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	8,947	13.695	122,529.160	
KONE OYJ	25,273	37.350	943,946.550	
ENGIE	113,645	15.245	1,732,518.020	
ALSTOM	17,252	28.275	487,800.300	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	49.715	249,817.870	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,979	29.545	383,464.550	
ELECTRICITE DE FRANCE	16,174	17.750	287,088.500	
DEUTSCHE WOHNEN AG	22,321	24.530	547,534.130	
ARKEMA SA	5,658	63.590	359,792.220	
LEGRAND SA	20,657	47.290	976,869.530	
ADP	2,313	109.500	253,273.500	
ORION OYJ	8,051	32.370	260,610.870	
RTL GROUP SA	2,768	75.570	209,177.760	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	9.888	336,369.980	
SYMRISE AG	9,463	56.390	533,618.570	
SCOR SE	14,425	31.185	449,843.620	
REXEL SA	20,799	12.250	254,787.750	
PRYSMIAN SPA	14,445	18.600	268,677.000	
BANCO POPOLARE SC	29,282	13.550	396,771.100	
CAIXABANK	202,918	3.878	786,916.000	
BUREAU VERITAS SA	23,255	20.290	471,843.950	

	GRUPE EUROTUNNEL SE	37,707	12.185	459,459.790	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	16.645	377,392.080	
	ENGIE	3,318	0.001	3.310	
	AMADEUS IT HOLDING SA	37,149	38.260	1,421,320.740	
	TNT EXPRESS NV W/I	26,687	6.752	180,190.620	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,549	118.000	182,782.000	
	ENEL GREEN POWER SPA	71,844	1.755	126,086.220	
	BRENNTAG AG	13,579	49.315	669,648.380	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	67,082	7.681	515,256.840	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	6.094	357,151.050	
	DELTA LLOYD NV	19,898	8.214	163,442.170	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,928	30.785	305,633.480	
	EDENRED	18,682	16.720	312,363.040	
	BANKIA SA	431,169	1.206	519,989.810	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	63,554	5.399	343,128.040	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,197	106.500	553,480.500	
	OSRAM LICHT AG	7,598	47.730	362,652.540	
	GEMALTO	5,952	60.220	358,429.440	
	VONOVIA SE	36,285	28.835	1,046,277.970	
	CNH INDUSTRIAL NV	84,201	6.480	545,622.480	
	NUMERICABLE-SFR	9,058	42.115	381,477.670	
	NN GROUP NV	12,746	27.400	349,240.400	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	70,110	13.930	976,632.300	
	AENA SA	5,256	101.100	531,381.600	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-RTS	491,341	0.088	43,238.000	
	ALTICE NV-A	18,226	19.650	358,140.900	
	LAFARGEHOLCIM LTD	14,105	50.030	705,673.150	
ユーロ	小計	21,463,506		260,966,660.510 (35,533,220,494)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	17,100	55.250	944,775.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	18.840	4,107,120.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	28.550	3,187,893.000	
	CLP HOLDINGS LTD	155,000	66.950	10,377,250.000	
	PCCW LTD	260,000	4.160	1,081,600.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	14.900	1,281,400.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	6.290	3,348,796.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	69.000	3,381,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	87,240	199.500	17,404,380.000	
	MTR CORP	133,500	33.950	4,532,325.000	

HANG SENG BANK LTD	57,100	141.400	8,073,940.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	107,657	48.400	5,210,598.800	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	116,000	74.200	8,607,200.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	119,750	45.800	5,484,550.000	
HONG KONG & CHINA GAS	586,535	14.840	8,704,179.400	
HYSAN DEVELOPMENT CO	39,000	33.550	1,308,450.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	24.800	4,687,200.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	311,500	25.550	7,958,825.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	54,000	27.600	1,490,400.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	429,266	8.120	3,485,639.920	
SINO LAND CO	255,400	12.440	3,177,176.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	139,000	101.900	14,164,100.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	42,500	90.800	3,859,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	28.550	2,583,775.000	
WHEELOCK & CO LTD	76,000	35.350	2,686,600.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	6.500	1,274,000.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	10.880	1,845,248.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	10.680	448,560.000	
AIA GROUP LTD	938,027	45.000	42,211,215.000	
HKT TRUST / HKT LTD	178,000	9.150	1,628,700.000	
SANDS CHINA LTD	179,600	27.400	4,921,040.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	22.650	2,360,130.000	
WH GROUP LTD	246,500	4.350	1,072,275.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	210,332	104.800	22,042,793.600	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	221,832	56.250	12,478,050.000	
香港・ドル 小計	6,749,199		221,410,184.720 (3,427,429,659)	
合計	93,183,149		270,386,591,397 (270,386,591,397)	

(2) 株式以外の有価証券

平成27年10月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	633,968.090	
		FEDERATION CENTRES	252,110.000	690,781.400	
		GOODMAN GROUP	155,160.000	898,376.400	
		GPT GROUP	131,618.000	598,861.900	
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	591,373.200	
		MIRVAC GROUP	235,066.000	405,488.850	
		SCENTRE GROUP	412,770.000	1,626,313.800	
		STOCKLAND	210,736.000	807,118.880	
	WESTFIELD CORP	166,693.000	1,650,260.700		
	オーストラリア・ドル	小計	1,698,942.000	7,902,543.220 (695,028,676)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	127,906.000	306,974.400	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	211,000.000	295,400.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	398,000.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	312,162.500	
	シンガポール・ドル	小計	730,006.000	1,312,536.900 (112,340,034)	
	投資信託受益証券	合計	2,428,948	807,368,710 (807,368,710)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,741.000	500,405.040	
		AMERICAN TOWER CORP	33,354.000	3,161,959.200	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	798,538.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,455.000	1,883,886.450	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,785.000	1,567,057.450	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13,569.000	337,596.720	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	486,144.750	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	9,335.000	179,792.100	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,026.000	2,121,119.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,854.000	759,237.300	
		DUKE REALTY TRUST	28,754.000	602,396.300	
		EQUINIX INC	4,580.000	1,248,324.800	
		EQUITY RESIDENTIAL	26,804.000	2,094,196.520	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,825.000	1,112,017.750	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,578.000	669,684.460	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	815,509.050	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,720.000	1,272,652.800			

	HCP INC	36,231.000	1,420,617.510	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	1,026,276.900	
	IRON MOUNTAIN INC	13,906.000	441,932.680	
	KIMCO REALTY	32,980.000	852,862.800	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	10,299.000	349,754.040	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	549,968.880	
	PROLOGIS INC	40,935.000	1,715,585.850	
	PUBLIC STORAGE	11,398.000	2,499,239.460	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	807,209.760	
	REGENCY CENTERS CORP	6,286.000	412,047.300	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24,273.000	4,773,042.720	
	SL GREEN	8,526.000	977,079.600	
	THE MACERICH COMPANY	10,631.000	858,028.010	
	UDR INC	21,797.000	780,986.510	
	VENTAS INC	24,040.000	1,383,502.000	
	VEREIT INC	65,404.000	536,312.800	
	VORNADO REALTY TRUST	13,114.000	1,262,091.360	
	WELLTOWER INC	25,792.000	1,780,937.600	
	WEYERHAEUSER CO	42,629.000	1,225,583.750	
アメリカ・ドル 小計		828,434.000	43,263,577.620 (5,189,466,135)	
イギリス・ボンド	BRITISH LAND CO PLC	82,388.000	693,706.960	
	HAMMERSON PLC	68,046.000	418,142.670	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	301,191.800	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	809,356.800	
	SEGRO PLC	42,345.000	180,643.770	
イギリス・ボンド 小計		345,120.000	2,403,042.000 (441,222,542)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	227,212.720	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	407,026.480	
カナダ・ドル 小計		26,512.000	634,239.200 (58,356,348)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	209,304.000	
	GECINA SA	2,710.000	301,894.000	
	ICADE	3,001.000	192,124.020	
	KLEPIERRE	15,834.000	649,194.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,900.000	1,847,020.000	
ユーロ 小計		32,037.000	3,199,536.020 (435,648,825)	
香港・ドル	LINK REIT	196,500.000	8,763,900.000	
香港・ドル 小計		196,500.000	8,763,900.000 (135,665,172)	
投資証券 合計		1,428,603	6,260,359,022 (6,260,359,022)	
合計			7,067,727,732 (7,067,727,732)	

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 602銘柄	59.28%	-%	-%	63.63%
	投資証券 36銘柄	-%	-%	1.80%	
イギリス・ポンド	株式 107銘柄	8.03%	-%	-%	8.53%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.15%	
イスラエル・シェケル	株式 6銘柄	0.24%	-%	-%	0.25%
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄	2.43%	-%	-%	2.78%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.24%	-%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.58%	-%	-%	3.75%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.48%	-%	-%	0.54%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.79%	-%	-%	3.94%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	1.20%	-%	-%	1.25%
デンマーク・クローネ	株式 14銘柄	0.73%	-%	-%	0.76%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.05%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.25%	-%	-%	0.26%
ユーロ	株式 232銘柄	12.29%	-%	-%	12.96%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.15%	
香港・ドル	株式 35銘柄	1.19%	-%	-%	1.28%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(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27年10月30日現在

資産総額	3,240,723,627円
負債総額	2,244,808円
純資産総額（ - ）	3,238,478,819円
発行済数量	1,018,192,003口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1806円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年10月30日現在

資産総額	294,254,928,907円
負債総額	455,676,307円
純資産総額（ - ）	293,799,252,600円
発行済数量	101,372,777,286口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8982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。

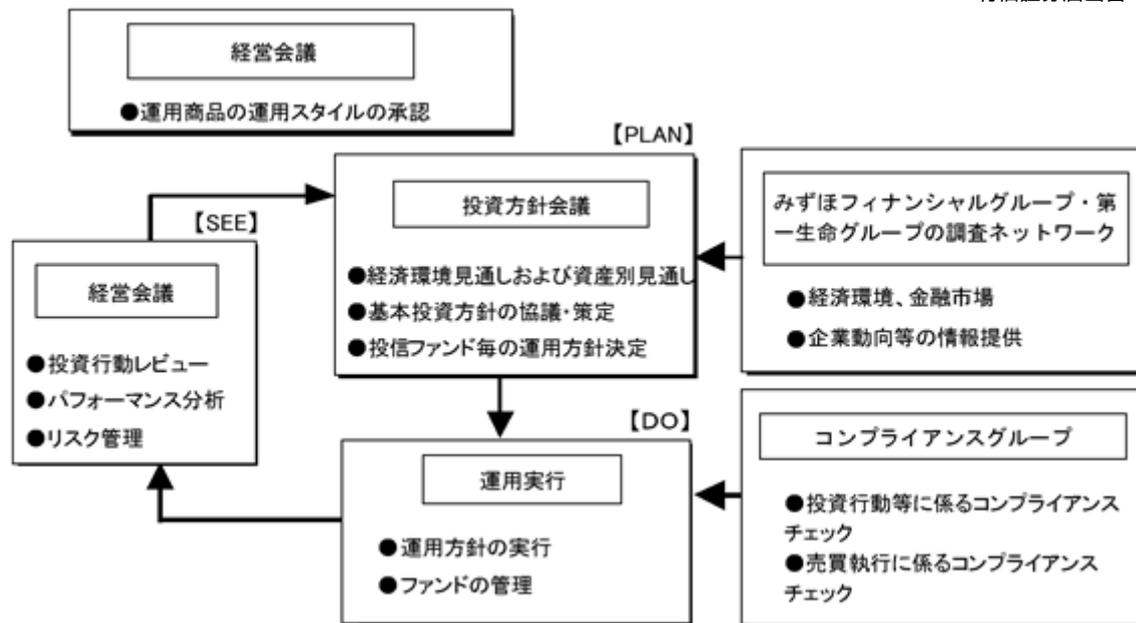
投資運用の意思決定機構

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27年10月30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27年10月30日現在、委託会社の運用する投資信託は394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)
単体型株式投資信託	5	23,257,375,581
追加型株式投資信託	353	5,925,127,729,592
単体型公社債投資信託	36	273,634,451,164
追加型公社債投資信託	0	0
合計	394	6,222,019,556,337

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第29期 (平成26年3月31日現在)	第30期 (平成27年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	11,487,360	12,051,921
金銭の信託	10,952,459	14,169,657
前払費用	64,554	57,309
未収委託者報酬	3,854,410	4,622,292
未収運用受託報酬	1,415,502	1,737,052
未収投資助言報酬	2 255,218	2 312,206
未収収益	275,082	260,845
繰延税金資産	401,327	411,797
その他	23,246	46,782
流動資産計	28,729,163	33,669,865
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 122,181	1 138,967
車両運搬具	1 1,615	1 941
器具備品	1 140,023	1 243,908
建設仮勘定	29,509	49,116
無形固定資産		
商標権	1 195	1 101
ソフトウェア	1 1,188,444	1 1,702,633
ソフトウェア仮勘定	642,834	202,399
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 231	1 188
投資その他の資産		
投資有価証券	4,178,284	4,343,365
関係会社株式	617,159	613,137
関係会社株式	2,119,074	2,316,596
繰延税金資産	622,698	582,861
差入保証金	731,197	733,907
その他	88,154	96,862
固定資産計	6,310,469	6,688,771
資産合計	35,039,633	40,358,637

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

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

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

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

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

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 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。

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

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

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		10,613,571
金銭の信託		14,000,363
前払費用		141,040
未収委託者報酬		4,528,913
未収運用受託報酬		2,131,544
未収投資助言報酬		268,863
未収収益		240,459
繰延税金資産		392,452
その他		37,555
	流動資産計	32,354,763
固定資産		
有形固定資産		447,795
建物	1	200,557
車両運搬具	1	745
器具備品	1	246,491
無形固定資産		1,838,514
商標権	1	54
ソフトウェア	1	1,688,242
ソフトウェア仮勘定		142,901
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	167
投資その他の資産		4,353,734
投資有価証券		574,051
関係会社株式		2,316,596
繰延税金資産		600,727
差入保証金		771,427
その他		90,932
	固定資産計	6,640,044
	資産合計	38,994,807

（単位：千円）

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

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日至平成27年9月30日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

項目	第31期中間会計期間 (自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産：定率法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第31期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)																		
1. 固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">建物</td> <td style="width: 10%; text-align: center;">...</td> <td style="width: 40%; text-align: right;">596,463千円</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">4,178千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">499,246千円</td> </tr> <tr> <td>商標権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">883千円</td> </tr> <tr> <td>ソフトウェア</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">2,309,177千円</td> </tr> <tr> <td>電信電話専用施設利用権</td> <td style="text-align: center;">...</td> <td style="text-align: right;">1,429千円</td> </tr> </table>	建物	...	596,463千円	車両運搬具	...	4,178千円	器具備品	...	499,246千円	商標権	...	883千円	ソフトウェア	...	2,309,177千円	電信電話専用施設利用権	...	1,429千円
建物	...	596,463千円																	
車両運搬具	...	4,178千円																	
器具備品	...	499,246千円																	
商標権	...	883千円																	
ソフトウェア	...	2,309,177千円																	
電信電話専用施設利用権	...	1,429千円																	

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第31期中間会計期間末（平成27年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

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

（有価証券関係）

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

（金銭の信託関係）

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

（セグメント情報等）

第31期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

第31期中間会計期間
（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

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

1．増資引受の理由

子会社の財務基盤強化のため。

2．子会社の概要

商号 : DIAM International Ltd

主な事業内容 : 資産運用業

増資前の資本金 : 4,000千ポンド

当社出資比率 : 100%

3．増資の概要

金額 : 5,000千ポンド

増資後の資本金 : 9,000千ポンド

払込日 : 平成27年10月5日

増資後の当社出資比率 : 100%

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3) (4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

平成27年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
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。

(注) 資本金の額は平成27年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集販売の取扱い
- (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27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年11月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M外国株式パッシブ・ファンドの平成26年10月15日から平成27年10月13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27年10月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。