

【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30年1月12日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	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一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【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。)。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下、「委託会社」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.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694(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。

(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30年1月13日から平成30年7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.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694(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.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694(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。

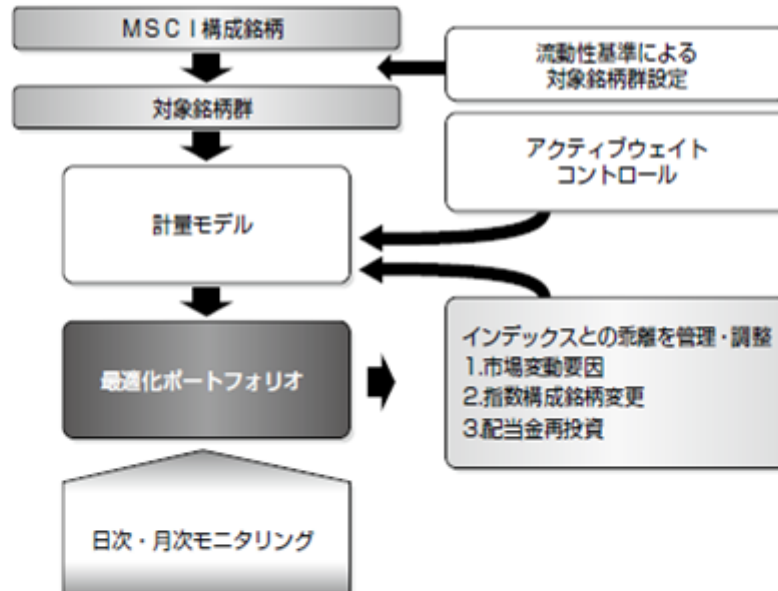
ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

ファンドの特色

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

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
海外	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。
株式	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。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

その他資産 （投資信託証券 （株式））	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。
年1回	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。
グローバル （日本を除く）	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。
ファミリーファンド	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	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。
その他	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。

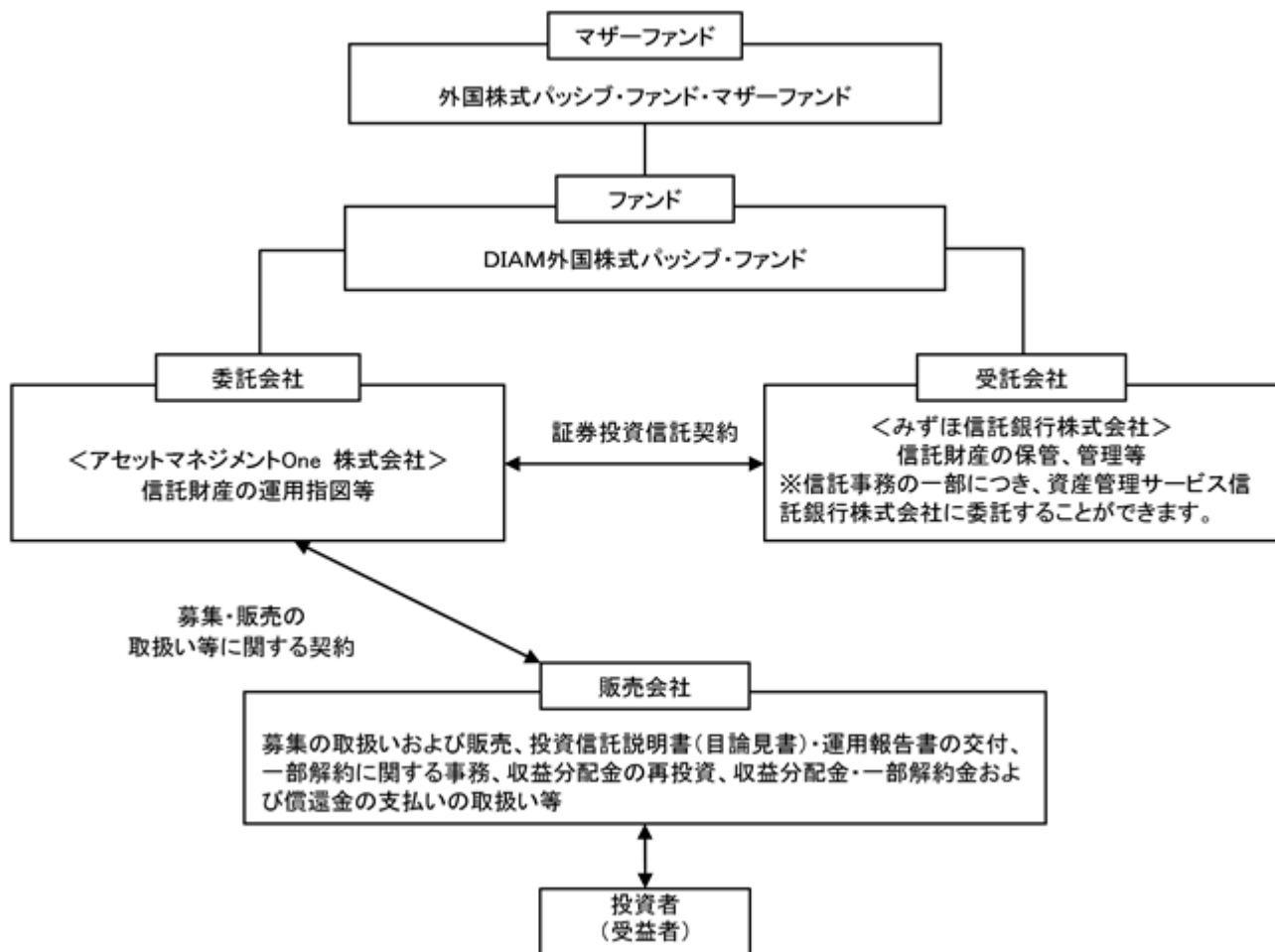
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

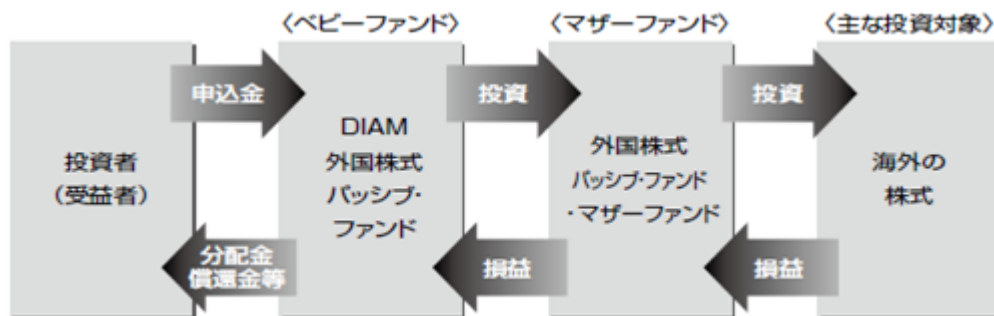
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（平成29年10月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日 会社設立

平成10年3月31日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

平成10年12月1日 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

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

平成28年10月1日 DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（平成29年10月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
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	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

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せん。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne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

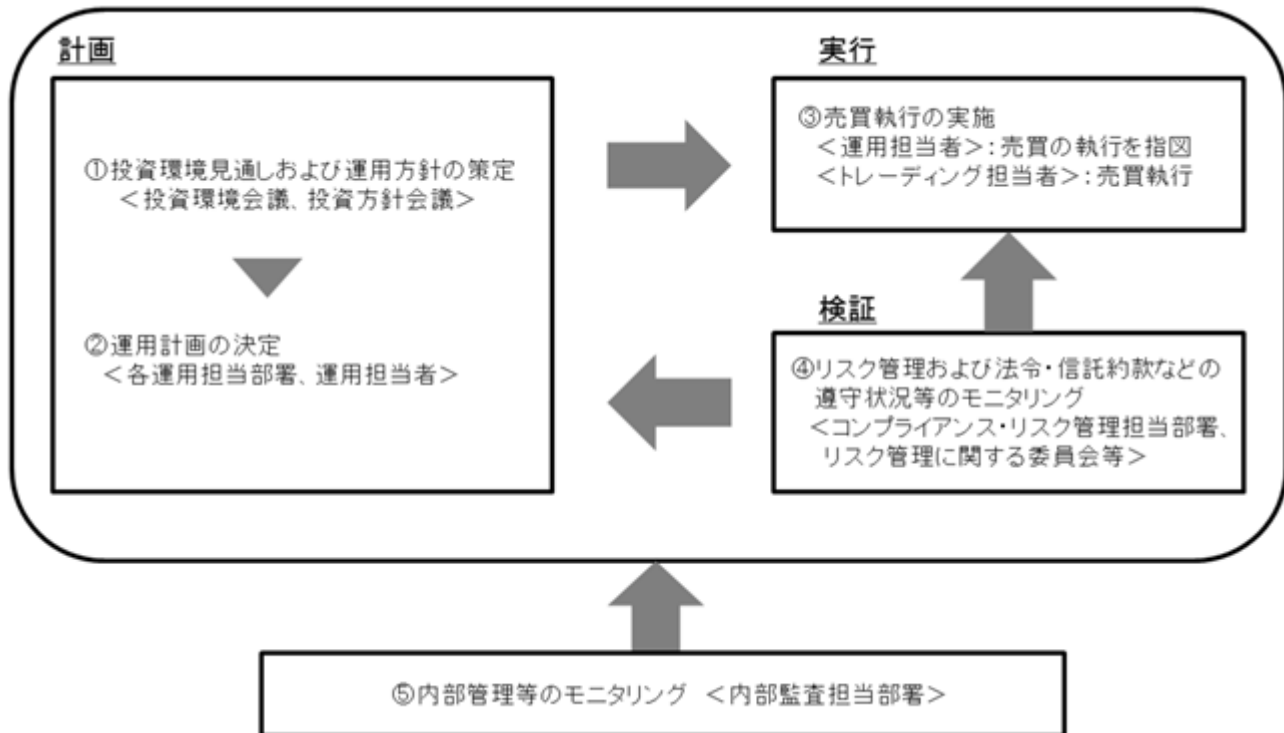
（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	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。 デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

運用計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

定期的で開催されるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b．ファンドの関係法人に関する管理

当ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

c．運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制は平成29年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（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ません。)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」2.運用方法(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」2.運用方法(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」2.運用方法(3)投資制限)
- 4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)
- 5) 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、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。
- 6) 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せん。)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
- 7) 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。
- 8) 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。
- 9) 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。
- 10) 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。
- 11) 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。
- 12) 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。
- 13) 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、

14) 資金の借入れ(約款第33条)

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

15) 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律 第9条)

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドは、値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元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。

(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。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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。

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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となります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、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。

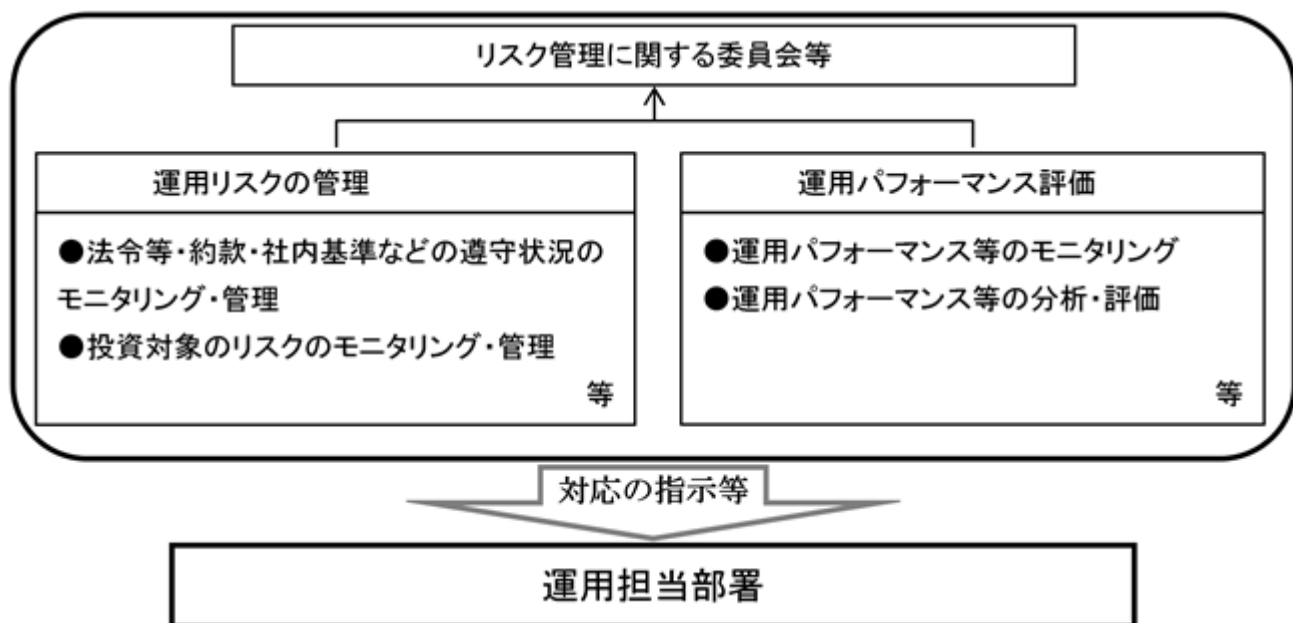
八．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

二．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。

<リスク管理体制>

委託会社における当ファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下の通りです。

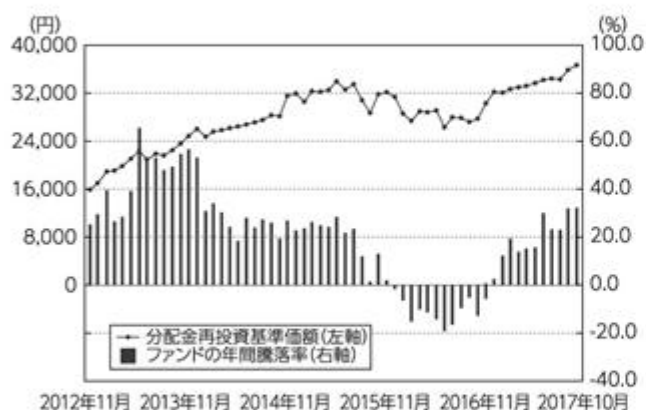
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



上記体制は平成29年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

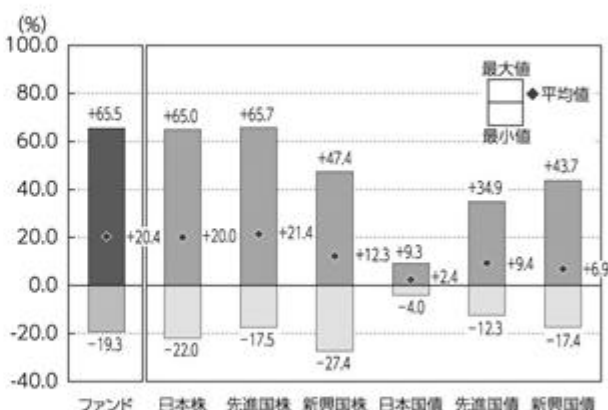
＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



- *ファンド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。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2012年11月～2017年10月

- *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 (配当込み, 円ベース)
 - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み, 円ベース)
 - 日本国債…NOMURA-BPI国債
 - 先進国債…シティ世界国債インデックス (除く日本, 円ベース)
 - 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (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、円換算しております。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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.に帰属します。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。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同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.に帰属します。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国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス(除く日本)」は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数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・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社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。

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0.54%（税抜0.50%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.45%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
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、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立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。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）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かかる消費税等に相当する金額を含みます。）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

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。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）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISA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。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

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29年10月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）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29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	5,802,217,279	99.99
内 日本	5,802,217,279	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	518,766	0.01
純資産総額	5,802,736,045	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29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	284,246,252,070	94.46
内 アメリカ	174,102,384,641	57.86
内 イギリス	20,012,731,998	6.65
内 ドイツ	11,666,122,369	3.88
内 フランス	11,617,151,995	3.86
内 カナダ	11,549,087,419	3.84
内 スイス	10,412,833,138	3.46
内 オーストラリア	7,414,224,491	2.46
内 オランダ	5,969,048,537	1.98
内 アイルランド	4,302,044,871	1.43
内 スペイン	4,016,844,025	1.33
内 スウェーデン	3,413,058,665	1.13
内 香港	2,803,297,396	0.93
内 イタリア	2,383,164,426	0.79
内 シンガポール	2,346,393,649	0.78
内 デンマーク	2,240,733,832	0.74
内 ジャージー	1,641,623,579	0.55
内 ベルギー	1,385,533,979	0.46
内 バミューダ	1,375,611,849	0.46
内 フィンランド	1,172,266,145	0.39
内 ノルウェー	800,365,793	0.27
内 ケイマン諸島	747,278,010	0.25
内 オランダ領キュラソー	728,341,616	0.24
内 イスラエル	532,729,668	0.18
内 ルクセンブルグ	399,837,949	0.13
内 オーストリア	322,032,396	0.11
内 ポルトガル	194,391,970	0.06
内 パナマ	186,143,030	0.06
内 リベリア	169,697,346	0.06
内 ニュージーランド	150,145,294	0.05
内 イギリス領バージン諸島	65,841,285	0.02

	内 パプアニューギニア	60,136,072	0.02
	内 マン島	42,419,084	0.01
	内 モーリシャス	22,735,553	0.01
投資信託受益証券		794,304,821	0.26
	内 オーストラリア	684,550,357	0.23
	内 シンガポール	109,754,464	0.04
投資証券		6,507,355,956	2.16
	内 アメリカ	5,641,330,252	1.87
	内 フランス	393,761,647	0.13
	内 イギリス	268,491,728	0.09
	内 香港	156,102,933	0.05
	内 カナダ	47,669,396	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,369,380,413	3.11
純資産総額		300,917,293,260	100.00

その他資産の投資状況

平成29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	22,630,000	0.01
-	22,630,000	0.01
為替予約取引（売建）	93,973,000	0.03
-	93,973,000	0.03
株価指数先物取引（買建）	9,283,366,432	3.09
内 アメリカ	6,044,961,936	2.01
内 ドイツ	1,838,639,649	0.61
内 イギリス	701,585,057	0.23
内 カナダ	416,027,040	0.14
内 オーストラリア	282,152,750	0.09

（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29年10月31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	1,714,603,215	3.3556 5,753,591,055	3.3840 5,802,217,279	- -	99.99%

(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29年10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

(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29年10月31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	377,548	15,354.14 5,796,927,325	18,866.03 7,122,833,857	- -	2.37%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	530,683	7,339.95 3,895,190,944	9,492.99 5,037,769,685	- -	1.67%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	29,421	95,299.55 2,803,808,079	125,703.78 3,698,331,087	- -	1.23%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	171,270	15,325.17 2,624,742,878	20,354.08 3,486,044,857	- -	1.16%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	195,199	13,220.29 2,580,588,789	15,842.39 3,092,420,637	- -	1.03%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	257,176	10,143.18 2,608,583,772	11,475.55 2,951,237,486	- -	0.98%
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	306,862	9,339.79 2,866,028,688	9,453.38 2,900,885,057	- -	0.96%
8	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	22,724	93,307.02 2,120,308,919	115,096.16 2,615,445,312	- -	0.87%
9	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	21,455	95,558.68 2,050,211,545	116,908.99 2,508,282,397	- -	0.83%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	719,642	2,723.48 1,959,932,423	3,123.21 2,247,597,408	- -	0.75%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	343,529	6,540.20 2,246,750,106	6,319.98 2,171,098,470	- -	0.72%
12	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	225,201	8,336.28 1,877,340,515	9,412.70 2,119,750,353	- -	0.70%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	90,365	18,949.58 1,712,379,186	21,257.10 1,920,898,383	- -	0.64%
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	185,301	9,956.15 1,844,885,805	9,762.31 1,808,966,398	- -	0.60%
15	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	137,000	12,715.22 1,741,985,771	12,944.37 1,773,379,018	- -	0.59%

16	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	343,790	4,067.54 1,398,381,401	5,020.90 1,726,138,373	- -	0.57%
17	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	432,021	3,709.90 1,602,756,691	3,977.57 1,718,395,497	- -	0.57%
18	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	446,294	4,599.11 2,052,556,931	3,795.38 1,693,858,178	- -	0.56%
19	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	198,735	6,796.18 1,350,640,436	8,348.94 1,659,227,544	- -	0.55%
20	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	133,087	9,865.88 1,313,021,457	12,452.12 1,657,216,146	- -	0.55%
21	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	69,757	18,612.97 1,298,385,110	23,694.57 1,652,862,286	- -	0.55%
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,509	16,029.85 1,386,726,728	18,706.47 1,618,278,843	- -	0.54%
23	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	295,798	5,462.65 1,615,842,571	5,412.44 1,600,989,755	- -	0.53%
24	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,445,842	1,046.16 1,512,593,426	1,101.29 1,592,304,493	- -	0.53%
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	295,882	4,598.29 1,360,552,067	5,189.51 1,535,484,846	- -	0.51%
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	160,610	8,560.02 1,374,825,879	9,276.28 1,489,864,615	- -	0.50%
27	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	628,464	3,406.75 2,141,025,760	2,309.59 1,451,497,689	- -	0.48%
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	342,375	4,314.93 1,477,325,561	4,130.33 1,414,125,157	- -	0.47%
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	360,416	3,653.39 1,316,743,441	3,851.96 1,388,310,322	- -	0.46%
30	DOWDUPONT INC アメリカ	株式 化学	168,213	6,958.57 1,170,523,612	8,111.30 1,364,427,587	- -	0.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年10月31日現在

種類	投資比率
株式	94.46%
投資信託受益証券	0.26%
投資証券	2.16%
合計	96.89%

（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29年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	9.53%
石油・ガス・消耗燃料		5.98%
医薬品		5.29%
保険		4.10%
ソフトウェア		4.00%
インターネットソフトウェア・サービス		3.17%
情報技術サービス		2.92%
資本市場		2.90%
半導体・半導体製造装置		2.88%
コンピュータ・周辺機器		2.70%
化学		2.63%
メディア		2.19%
バイオテクノロジー		2.15%
ヘルスケア機器・用品		2.11%
各種電気通信サービス		2.09%
航空宇宙・防衛		2.04%
飲料		1.99%
電力		1.89%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.87%
食品		1.86%
インターネット販売・通信販売		1.81%
コングロマリット		1.76%
ホテル・レストラン・レジャー		1.75%
機械		1.68%
食品・生活必需品小売り		1.57%
専門小売り		1.50%
金属・鉱業		1.50%
タバコ		1.32%
家庭用品		1.26%
繊維・アパレル・贅沢品		1.20%
総合公益事業		1.08%
自動車		1.05%
各種金融サービス		0.97%
陸運・鉄道		0.90%
通信機器		0.81%
電気設備		0.78%
パーソナル用品		0.72%
専門サービス		0.59%

航空貨物・物流サービス	0.59%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.57%
不動産管理・開発	0.55%
エネルギー設備・サービス	0.52%
消費者金融	0.51%
家庭用耐久財	0.49%
自動車部品	0.47%
電子装置・機器・部品	0.43%
建設関連製品	0.42%
商業サービス・用品	0.37%
複合小売り	0.36%
無線通信サービス	0.34%
建設資材	0.34%
建設・土木	0.33%
商社・流通業	0.31%
容器・包装	0.29%
運送インフラ	0.27%
旅客航空輸送業	0.15%
ガス	0.13%
紙製品・林産品	0.10%
海運業	0.08%
水道	0.08%
販売	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
レジャー用品	0.06%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01%
合計	94.46%

(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29年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2017年11月	買建	200,000	22,630,400	22,630,000	0.01%
		アメリカ・ドル売/円 買2017年11月	売建	680,000	77,364,280	76,942,000	0.03%
		ユーロ売/円買201 7年11月	売建	80,000	10,555,480	10,540,800	0.00%
		イギリス・ポンド売/ 円買2017年11月	売建	20,000	2,988,696	2,988,400	0.00%
		カナダ・ドル売/円買 2017年11月	売建	20,000	1,773,260	1,763,000	0.00%
		オーストラリア・ドル 売/円買2017年1 1月	売建	20,000	1,746,640	1,738,800	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Dec 17	買建	416	5,890,983,709	6,044,961,936	2.01%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Dec 17	買建	382	1,770,378,746	1,838,639,649	0.61%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Dec 17	買建	63	692,144,817	701,585,057	0.23%
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT D ec 17	買建	25	397,598,073	416,027,040	0.14%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Dec 1 7	買建	22	271,631,800	282,152,750	0.09%

(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29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
第8計算期間末 (平成28年10月12日)	4,929	4,929	2.7556	2.7556
第9計算期間末 (平成29年10月12日)	5,037	5,037	3.6369	3.6369
平成28年10月末日	4,948	-	2.7726	-
11月末日	5,430	-	3.0281	-
12月末日	5,732	-	3.2178	-
平成29年1月末日	5,676	-	3.2057	-
2月末日	5,875	-	3.2665	-
3月末日	6,094	-	3.2965	-
4月末日	4,971	-	3.3179	-
5月末日	5,137	-	3.3667	-
6月末日	5,314	-	3.4177	-
7月末日	4,450	-	3.4420	-
8月末日	4,545	-	3.4270	-
9月末日	4,874	-	3.5846	-
10月末日	5,802	-	3.6655	-

【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
第8計算期間	0.0000
第9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
第8計算期間	10.7
第9計算期間	32.0

(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
第8計算期間	991,108,656	221,609,326
第9計算期間	451,944,648	855,793,807

(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 >>

基準価額・純資産の推移

(2009年1月30日～2017年10月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2009年1月30日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

データの基準日:2017年10月31日

分配の推移(税引前)

第5期(2013.10.15)	0円
第6期(2014.10.14)	0円
第7期(2015.10.13)	0円
第8期(2016.10.12)	0円
第9期(2017.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※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	比率
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	99.99%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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、国/地域を表します。

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	94.46
内 アメリカ	57.86
内 イギリス	6.65
内 ドイツ	3.88
内 フランス	3.86
内 カナダ	3.84
内 その他	18.37
投資信託受益証券	0.26
内 オーストラリア	0.23
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.16
内 アメリカ	1.87
内 フランス	0.13
内 イギリス	0.09
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.11
合計(純資産総額)	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.37%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.67%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.23%
4	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	1.16%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.03%
6	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	0.98%
7	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	0.96%
8	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	0.87%
9	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	0.83%
10	BANK OF AMERICA CORP	株式	アメリカ	銀行	0.75%

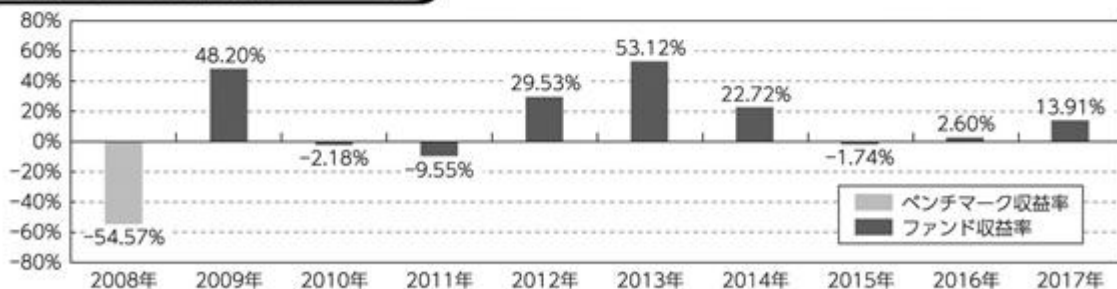
その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.09

株式組入上位5業種

順位	業種	比率
1	銀行	9.53%
2	石油・ガス・消耗燃料	5.98%
3	医薬品	5.29%
4	保険	4.10%
5	ソフトウェア	4.00%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2009年は設定日から年末までの収益率、および2017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年は、ベンチマークの収益率を表示しています。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、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

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

○委託会社の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.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（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.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（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。

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

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

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.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694(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10億口を下回るようになった場合、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「イ.償還規定 c.」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. 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であっても、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。

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.am-one.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.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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)償還金請求権

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、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）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。

(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9期計算期間(平成28年10月13日から平成29年10月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

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8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,727,405	16,418,461
親投資信託受益証券	4,929,571,847	5,037,300,319
未収入金	5,100,000	2,138,000
流動資産合計	4,950,399,252	5,055,856,780
資産合計	4,950,399,252	5,055,856,780
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,377,246	1,959,956
未払受託者報酬	752,758	802,148
未払委託者報酬	14,303,176	15,241,619
その他未払費用	100,287	106,869
流動負債合計	20,533,467	18,110,592
負債合計	20,533,467	18,110,592
純資産の部		
元本等		
元本	1,789,010,293	1,385,161,134
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,140,855,492	3,652,585,054
(分配準備積立金)	862,017,169	1,289,869,639
元本等合計	4,929,865,785	5,037,746,188
純資産合計	4,929,865,785	5,037,746,188
負債純資産合計	4,950,399,252	5,055,856,780

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	平成27年10月14日 平成28年10月12日	自	平成28年10月13日 平成29年10月12日
営業収益				
受取利息		1,122		7
有価証券売買等損益		346,593,849		1,476,163,472
営業収益合計		346,592,727		1,476,163,479
営業費用				
支払利息		3,680		28,724
受託者報酬		1,287,599		1,707,648
委託者報酬		24,465,883		32,446,559
その他費用		183,781		227,520
営業費用合計		25,940,943		34,410,451
営業利益又は営業損失（ ）		372,533,670		1,441,753,028
経常利益又は経常損失（ ）		372,533,670		1,441,753,028
当期純利益又は当期純損失（ ）		372,533,670		1,441,753,028
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（ ）		54,643,681		427,852,501
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,127,437,337		3,140,855,492
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,777,318,474		1,052,819,222
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,777,318,474		1,052,819,222
剰余金減少額又は欠損金増加額		446,010,330		1,554,990,187
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		446,010,330		1,554,990,187
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,140,855,492		3,652,585,054

(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。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12日現在
1. 1 期首元本額	1,019,510,963円	1,789,010,293円
期中追加設定元本額	991,108,656円	451,944,648円
期中一部解約元本額	221,609,326円	855,793,807円
2. 受益権の総数	1,789,010,293口	1,385,161,134口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期 自 平成27年10月14日 至 平成28年10月12日	第9期 自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12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(69,773,552円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,278,838,323円)及び分配準備積立金(792,243,617円)より分配対象収益は3,140,855,492円(1万口当たり17,556.39円)ですが、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(98,602,017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(689,763,896円)、信託約款に規定される収益調整金(2,362,715,415円)及び分配準備積立金(501,503,726円)より分配対象収益は3,652,585,054円(1万口当たり26,369.39円)ですが、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8期	第9期
	自 平成27年10月14日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12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8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12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	295,345,367	1,061,361,272
合計	295,345,367	1,061,361,272

（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8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7556円 (27,556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29年10月12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	1,500,759,815	5,037,300,319	
親投資信託受益証券	合計	1,500,759,815	5,037,300,319	
合計		1,500,759,815	5,037,300,319	

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28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,972,546,971	5,651,561,043
コール・ローン		98,225,753	268,115,912
株式		240,970,135,633	282,008,310,018
投資信託受益証券		819,369,297	798,785,653
投資証券		5,741,105,528	6,543,093,181
派生商品評価勘定		36,397,654	201,465,333
未収入金		2,921,921	8,520,388
未収配当金		280,921,804	293,191,790
差入委託証拠金		1,171,790,039	1,597,210,020
流動資産合計		254,093,414,600	297,370,253,338
資産合計		254,093,414,600	297,370,253,338
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		34,581,305	543,550
未払解約金		377,050,000	472,640,000
流動負債合計		411,631,305	473,183,550
負債合計		411,631,305	473,183,550
純資産の部			
元本等			
元本	1	100,403,068,668	88,453,274,390
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		153,278,714,627	208,443,795,398
元本等合計		253,681,783,295	296,897,069,788
純資産合計		253,681,783,295	296,897,069,788
負債純資産合計		254,093,414,600	297,370,253,338

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<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>
3. 収益及び費用の計上基準	<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>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12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	102,800,378,688円	100,403,068,668円
同期中追加設定元本額	21,913,175,658円	17,826,557,176円
同期中一部解約元本額	24,310,485,678円	29,776,351,454円
元本の内訳 ファンド名		

D I A M外国株式パッシブ・ファン ド	1,951,069,361円	1,500,759,815円
M I T O ラップ型ファンド(安 定型)	6,302,436円	2,952,003円
M I T O ラップ型ファンド(中 立型)	15,885,054円	7,416,677円
M I T O ラップ型ファンド(積 極型)	34,557,068円	19,987,131円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	15,053,332円	7,484,878円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	13,976,337円	7,682,961円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	16,854,378円	13,499,602円
たわらノーロード 先進国株式	1,925,384,634円	4,471,783,454円
たわらノーロード 先進国株式< ラップ向け>	426,031円	425,029円
たわらノーロード 先進国株式< 為替ヘッジあり>	12,210,923円	334,440,710円
たわらノーロード バランス(8 資産均等型)	- 円	4,162,856円
D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	35,775,985,290円	36,248,641,542円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>1安定型	184,975,989円	163,816,147円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>2安定・成長型	953,771,814円	857,026,223円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>3成長型	1,154,273,058円	1,040,064,596円
D I A M DC バランス30イ ンデックスファンド	154,219,442円	135,530,066円
D I A M DC バランス50イ ンデックスファンド	424,912,023円	389,058,681円
D I A M DC バランス70イ ンデックスファンド	351,218,100円	330,441,705円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	44,877,625円	35,350,510円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	962,087,439円	831,794,009円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	228,191,393円	200,977,464円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	27,448,009円	30,287,665円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	55,450,918円	70,337,364円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	106,709,231円	132,555,525円
投資のソムリエ	543,340,779円	3,198,792,059円
クルーズコントロール	531,098,739円	529,164,076円
投資のソムリエ<DC年金>	14,886,372円	175,260,706円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	87,691,558円	112,222,016円

D I A M D C バランス・F (成長型)	40,468,070円	61,949,596円
クルーズコントロール< D C 年金 >	169,726円	176,323円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	4,309,803円	2,336,372円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	10,831,563円	7,273,627円
投資のソムリエ< D C 年金>リス ク抑制型	4,359,505円	31,606,974円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	439,073円	1,646,742円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	- 円	402,698,402円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	- 円	376,390,776円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	- 円	1,182,935,075円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	- 円	455,321円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(D C)	- 円	455,344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)	- 円	120,612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)	199,567,957円	110,699,871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)	3,233,690,106円	2,964,558,782円
D I A M 先進国株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	147,200,968円	- 円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	392,381円	161,291,968円
D I A M ワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	- 円	171,807,118円
D I A M グローバル・バランス ファンド25V A(適格機関投資 家限定)	36,367,478円	25,138,484円
D I A M グローバル・バランス ファンド50V A(適格機関投資 家限定)	201,127,434円	119,155,473円
D I A M 国際分散バランスファン ド30V A(適格機関投資家限 定)	351,435,122円	255,180,569円
D I A M 国際分散バランスファン ド50V A(適格機関投資家限 定)	25,425,328円	15,220,426円
D I A M 国内重視バランスファン ド30V A(適格機関投資家限 定)	162,351,419円	111,060,683円
D I A M 国内重視バランスファン ド50V A(適格機関投資家限 定)	13,816,919円	8,214,224円

D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	23,041,123円	13,833,399円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	2,048,221,117円	30,862,374円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	1,083,778,037円	76,913,785円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	919,211,282円	624,620,278円
D I A Mバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	1,021,084,457円	774,320,364円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	3,089,092,005円	2,391,175,141円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA(適格機関投資家限 定)	1,300,978,067円	882,809,453円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA2(適格機関投資家 限定)	1,728,448,000円	358,382,128円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格 機関投資家限定)	1,470,108,607円	1,034,110,504円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	999,380,756円	678,263,358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)	13,494,600円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド5 5VA(適格機関投資家限定)	4,787,679,095円	614,773,286円
D I A M世界バランスファンド3 5VA(適格機関投資家限定)	1,708,239,056円	650,989,428円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	11,069,827,660円	8,547,165,090円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投資 家限定)	610,228,493円	460,597,770円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	1,905,576,749円	1,462,455,020円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資家 限定)	7,010,880,357円	5,509,914,891円
D I A Mバランス30VA(適格 機関投資家限定)	30,570,864円	13,592,785円
D I A Mバランス50VA(適格 機関投資家限定)	10,518,093円	15,185,783円
D I A Mバランス70VA(適格 機関投資家限定)	3,463,728円	12,516,619円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資家 限定)	9,440,136,846円	7,365,755,184円

	D I A Mバランス20VA(適格 機関投資家限定)	103,812,926円	69,571,913円
	D I A Mバランス40VA(適格 機関投資家限定)	188,138円	159,561円
	D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	298,427円	263,069円
	計	100,403,068,668円	88,453,274,390円
2.	受益権の総数	100,403,068,668口	88,453,274,390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27年10月14日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	30,288,208,875	21,429,512,211
投資信託受益証券	49,142,697	6,618,087
投資証券	510,076,515	262,194,403
合計	30,847,428,087	21,685,088,527

(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28年2月16日から平成28年10月12日まで及び平成29年2月16日から平成29年10月12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28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	426,548,102	-	424,879,200	1,668,902	260,218,350	-	260,759,900	541,550
アメリカ・ドル	261,702,840	-	261,147,600	555,240	162,850,310	-	163,035,800	185,490
イギリス・ポンド	43,453,250	-	43,210,600	242,650	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	27,557,260	-	27,422,500	134,760	21,917,700	-	21,934,900	17,200
カナダ・ドル	16,514,808	-	16,430,400	84,408	11,682,000	-	11,742,800	60,800
ユーロ	77,319,944	-	76,668,100	651,844	63,768,340	-	64,046,400	278,060
合計	426,548,102	-	424,879,200	1,668,902	260,218,350	-	260,759,900	541,550

(注)時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

 - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買建	5,952,255,095	-	5,952,402,542	147,447	7,207,430,951	-	7,408,894,284	201,463,333
合計	5,952,255,095	-	5,952,402,542	147,447	7,207,430,951	-	7,408,894,284	201,463,333

(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28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	2.5266円	3.3565円
(1万口当たり純資産額)	(25,266円)	(33,565円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年10月12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	29,421	995.000	29,273,895.000	
	ABBOTT LABORATORIES	124,816	54.440	6,794,983.040	
	AES CORP	45,579	11.270	513,675.330	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	64,220	147.620	9,480,156.400	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	13.880	826,262.520	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,138	153.650	5,398,953.700	
	CHUBB LTD	33,654	147.370	4,959,589.980	
	AGCO CORP	5,610	74.720	419,179.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,019	152.930	2,296,855.670	
	ALLEGHANY CORP	1,054	545.480	574,935.920	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	85.200	400,695.600	
	ALLSTATE CORP	25,754	93.090	2,397,439.860	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,300	142.720	7,464,256.000	
	AMGEN INC	53,947	184.150	9,934,340.050	
	HESS CORP	20,421	44.330	905,262.930	
	AMERICAN EXPRESS CO	54,985	91.960	5,056,420.600	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	72.760	2,536,340.840	
	AFLAC INC	28,218	83.880	2,366,925.840	
	AMERICAN INTL GROUP	65,596	61.840	4,056,456.640	
	AMERCO	551	363.250	200,150.750	
	ANALOG DEVICES	27,391	88.570	2,426,020.870	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	48.390	1,984,135.170	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	141.230	2,261,798.450	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	70,717	41.350	2,924,147.950	
	TIME WARNER	56,495	103.380	5,840,453.100	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	131.240	369,834.320	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	77.920	2,501,621.600	
	APACHE CORP	28,309	41.960	1,187,845.640	
	ANSYS INC	5,619	127.140	714,399.660	
	APPLE INC	377,548	156.550	59,105,139.400	
APPLIED MATERIALS INC	78,309	53.230	4,168,388.070		
ALBEMARLE CORP	7,904	137.420	1,086,167.680		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	41,382	43.290	1,791,426.780		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	86.400	676,598.400		
AMEREN CORP	17,312	59.780	1,034,911.360		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	82.870	476,999.720	
AUTOLIV INC	6,197	127.030	787,204.910	
AUTODESK INC	14,259	118.570	1,690,689.630	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,355	113.090	3,772,116.950	
AUTOZONE INC	2,015	588.560	1,185,948.400	
AVERY DENNISON CORP	6,262	101.210	633,777.020	
AVNET INC	10,288	40.690	418,618.720	
BALL CORP	24,324	42.300	1,028,905.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	90,365	187.460	16,939,822.900	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	54.880	4,047,345.120	
CR BARD INC	5,309	321.580	1,707,268.220	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	62.010	2,162,660.760	
BED BATH & BEYOND INC	10,744	21.990	236,260.560	
BECTON DICKINSON & CO	17,020	197.510	3,361,620.200	
AMETEK INC	16,775	66.970	1,123,421.750	
VERIZON COMM INC	295,798	48.860	14,452,690.280	
WR BERKLEY CORP	8,134	67.290	547,336.860	
BEST BUY CO INC	21,033	55.470	1,166,700.510	
YUM! BRANDS INC	23,738	76.640	1,819,280.320	
FIRSTENERGY CORP	30,796	31.830	980,236.680	
H&R BLOCK INC	16,114	25.610	412,679.540	
BOEING CO	41,419	261.440	10,828,583.360	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	48.740	397,620.920	
BORGWARNER INC	14,648	52.010	761,842.480	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	102,476	29.270	2,999,472.520	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	76.700	758,869.800	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	659.700	1,212,528.600	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	120,268	65.110	7,830,649.480	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	194.560	736,993.280	
INGREDION INC	5,305	122.070	647,581.350	
ONEOK INC	28,473	56.380	1,605,307.740	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,657	104.860	698,053.020	
UNITED RENTALS INC	6,332	142.160	900,157.120	
SEMPRA ENERGY	16,912	114.940	1,943,865.280	
FEDEX CORP	18,719	222.680	4,168,346.920	
VERISIGN INC	6,321	108.290	684,501.090	
AMPHENOL CORP	21,490	86.780	1,864,902.200	
BROWN-FORMAN CORP	13,612	55.300	752,743.600	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,337	55.390	1,237,246.430	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.720	726,966.240	
CSX CORP	66,444	53.080	3,526,847.520	

CABOT OIL & GAS CORP	32,261	25.510	822,978.110	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	45.740	642,647.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	33.500	778,506.500	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	207.740	2,542,737.600	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	65.820	1,456,267.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	67.200	1,674,355.200	
CATERPILLAR INC	42,278	128.600	5,436,950.800	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	117.710	1,157,324.720	
CELGENE CORP	57,086	139.560	7,966,922.160	
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	96.570	348,810.840	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	80.570	877,890.720	
CENTURYLINK INC	39,384	20.270	798,313.680	
CERNER CORP	20,809	71.520	1,488,259.680	
JPMORGAN CHASE & CO	257,176	96.840	24,904,923.840	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	47.400	892,162.800	
CIGNA CORP	19,211	186.950	3,591,496.450	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	76.940	844,955.080	
CINTAS CORP	6,282	150.670	946,508.940	
CISCO SYSTEMS INC	360,416	33.590	12,106,373.440	
CLOROX COMPANY	9,331	130.540	1,218,068.740	
COCA-COLA CO/THE	295,882	46.100	13,640,160.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,819	74.730	4,470,273.870	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	23,366	114.130	2,666,761.580	
COMERICA INC	12,068	76.570	924,046.760	
COMCAST CORP-CL A	342,375	37.420	12,811,672.500	
CA INC	22,732	33.630	764,477.160	
CONAGRA BRANDS INC	31,942	33.790	1,079,320.180	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	82.840	1,801,770.000	
CMS ENERGY CORP	22,372	47.350	1,059,314.200	
COOPER COS INC	3,794	237.520	901,150.880	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	84.140	1,165,759.700	
CORNING INC	65,641	29.890	1,962,009.490	
WR GRACE & CO	6,303	72.940	459,740.820	
SEALED AIR CORP	13,870	44.010	610,418.700	
CUMMINS INC	11,239	172.330	1,936,816.870	
DR HORTON INC	24,498	41.480	1,016,177.040	
DANAHER CORP	44,524	86.960	3,871,807.040	
MOODY'S CORP	13,204	142.550	1,882,230.200	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,287	73.600	3,185,923.200	
TARGET CORP	37,486	59.150	2,217,296.900	
DEERE & CO	19,364	127.770	2,474,138.280	
MORGAN STANLEY	103,282	49.180	5,079,408.760	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	63.320	1,100,185.000	
COSTAR GROUP INC	2,278	289.200	658,797.600	

THE WALT DISNEY CO	112,920	98.550	11,128,266.000	
DOLLAR TREE INC	17,493	91.230	1,595,886.390	
DOVER CORP	10,736	93.820	1,007,251.520	
OMNICOM GROUP	16,993	74.350	1,263,429.550	
DTE ENERGY CO	13,122	109.700	1,439,483.400	
DUKE ENERGY CORP	51,971	86.390	4,489,774.690	
FLOWSERVE CORP	8,406	43.720	367,510.320	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	79.340	748,652.240	
EBAY INC	73,800	38.310	2,827,278.000	
BANK OF AMERICA CORP	719,642	25.830	18,588,352.860	
CITIGROUP INC	198,735	74.940	14,893,200.900	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	88.150	898,512.950	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	44.240	829,057.600	
EATON CORP PLC	32,234	78.530	2,531,336.020	
EATON VANCE CORP	9,184	50.340	462,322.560	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	41.390	864,099.030	
DISH NETWORK CORP	16,150	51.650	834,147.500	
ECOLAB INC	19,009	132.550	2,519,642.950	
ELECTRONIC ARTS INC	23,241	116.050	2,697,118.050	
SALESFORCE.COM INC	48,240	96.010	4,631,522.400	
EMERSON ELECTRIC CO	45,625	63.430	2,893,993.750	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	86.200	708,650.200	
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	4.020	283,168.800	
ENERGY CORP	13,984	80.350	1,123,614.400	
EOG RESOURCES INC	43,463	96.930	4,212,868.590	
EQUIFAX INC	8,495	110.500	938,697.500	
EQT CORP	14,119	63.100	890,908.900	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	109.730	1,770,383.820	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,641	60.260	882,266.660	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	42,945	57.710	2,478,355.950	
EXXON MOBIL CORP	306,862	82.600	25,346,801.200	
FMC CORP	8,970	92.430	829,097.100	
NEXTERA ENERGY INC	34,843	149.870	5,221,920.410	
ASSURANT INC	4,089	95.320	389,763.480	
FASTENAL CO	21,654	44.510	963,819.540	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	28.260	1,474,408.980	
M&T BANK CORP	9,799	163.150	1,598,706.850	
FISERV INC	15,880	126.740	2,012,631.200	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	42.580	494,907.340	
MACY'S INC	24,512	20.470	501,760.640	
FORD MOTOR CO	261,895	12.380	3,242,260.100	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	44.930	1,002,568.020	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	14.430	1,396,997.160	
FLEX LTD	35,913	17.310	621,654.030	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	61.720	751,502.720	
GAP INC/THE	18,295	28.420	519,943.900	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	57.320	1,001,781.640	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,563	212.830	3,950,763.290	

GENERAL MILLS INC	43,704	50.870	2,223,222.480	
GENUINE PARTS CO	11,094	95.500	1,059,477.000	
GILEAD SCIENCES INC	94,012	82.570	7,762,570.840	
GARTNER INC	7,153	123.990	886,900.470	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	32.990	597,020.030	
MCKESSON CORP	15,054	149.940	2,257,196.760	
NVIDIA CORP	44,016	190.940	8,404,415.040	
GENERAL ELECTRIC CO	628,464	23.070	14,498,664.480	
WW GRAINGER INC	3,832	172.500	661,020.000	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	15.800	351,328.800	
HALLIBURTON CO	61,528	45.510	2,800,139.280	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	55.700	1,644,375.400	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,381	242.400	6,152,354.400	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	46.270	596,929.270	
HARRIS CORP	8,954	136.000	1,217,744.000	
HASBRO INC	7,736	96.610	747,374.960	
HENRY SCHEIN INC	11,426	80.670	921,735.420	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	52.280	377,095.640	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	109.520	1,109,656.640	
HP INC	122,725	20.410	2,504,817.250	
F5 NETWORKS INC	4,874	115.990	565,335.260	
CROWN HOLDINGS INC NPR	7,781	60.900	473,862.900	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	120.150	414,157.050	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	26.860	745,096.400	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	36.520	507,189.760	
HOLOGIC INC	22,344	36.660	819,131.040	
UNUM GROUP	16,000	52.230	835,680.000	
HOME DEPOT INC	86,509	165.250	14,295,612.250	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	94.930	1,223,362.910	
HORMEL FOODS CORP	19,345	31.720	613,623.400	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	29.310	936,513.120	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	180.290	421,337.730	
HUMANA INC	10,468	240.380	2,516,297.840	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	105.680	626,365.360	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	13.850	1,040,979.850	
RED HAT INC	13,799	119.370	1,647,186.630	
BIOGEN INC	15,267	333.190	5,086,811.730	
IDEX CORP	6,466	123.230	796,805.180	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,032	151.440	3,336,526.080	
INTUIT INC	17,739	143.660	2,548,384.740	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	158.080	988,790.400	
INGERSOLL-RAND PLC	19,826	91.430	1,812,691.180	
INTEL CORP	343,790	39.300	13,510,947.000	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	147.730	824,037.940	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	57.390	1,628,441.250	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	20.550	599,176.350	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	58.010	460,077.310	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,173	104.880	437,664.240	
INCYTE CORP	12,360	111.620	1,379,623.200	
JOHNSON & JOHNSON	195,199	136.650	26,673,943.350	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	55.870	1,426,361.100	
KLA-TENCOR CORP	11,724	104.590	1,226,213.160	
DEVON ENERGY CORP	34,184	36.080	1,233,358.720	
WESTAR ENERGY INC	9,911	52.090	516,263.990	
KELLOGG CO	18,922	61.250	1,158,972.500	
EAST WEST BANCORP INC	12,297	59.860	736,098.420	
KEYCORP	85,287	18.440	1,572,692.280	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,358	117.840	2,988,186.720	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,616	473.930	4,083,380.880	
KOHL'S CORP	11,357	43.220	490,849.540	
KROGER CO	66,588	20.780	1,383,698.640	
LAM RESEARCH CORP	11,522	186.180	2,145,165.960	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	116.700	718,521.900	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	50.520	637,663.440	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	48.340	463,483.920	
LENNAR CORP	14,850	56.580	840,213.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	25.270	542,344.740	
ELI LILLY & CO	73,736	86.060	6,345,720.160	
L BRANDS INC	16,262	41.850	680,564.700	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,740	75.280	1,335,467.200	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	50,474	118.920	6,002,368.080	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	66.620	1,616,600.920	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,908	318.590	6,023,899.720	
LOEWS CORP	21,346	48.700	1,039,550.200	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	19.930	272,981.210	
LOWE'S COS INC	61,289	81.210	4,977,279.690	
DOMINION ENERGY INC	45,131	78.010	3,520,669.310	
SCANA CORP	10,902	49.580	540,521.160	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	30.900	994,918.200	
MCCORMICK & CO INC	7,476	98.290	734,816.040	
MCDONALD'S CORPORATION	58,807	163.150	9,594,362.050	
S&P GLOBAL INC	18,409	159.000	2,927,031.000	
EVEREST RE GROUP LTD	3,382	222.510	752,528.820	
MANPOWERGROUP INC	4,257	120.710	513,862.470	

MARKEL CORPORATION	989	1,093.890	1,081,857.210	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	110.470	1,742,774.720	
MARSH & MCLENNAN COS	38,962	83.580	3,256,443.960	
MASCO CORP	23,043	38.960	897,755.280	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	203.730	893,763.510	
MATTEL INC	24,003	15.660	375,886.980	
METLIFE INC	64,937	52.850	3,431,920.450	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	49.160	1,000,012.720	
MEDTRONIC PLC	100,576	78.240	7,869,066.240	
ACTIVISION BLIZZARD INC	53,568	61.360	3,286,932.480	
CVS HEALTH CORP	73,660	73.900	5,443,474.000	
MERCK & CO. INC.	197,759	63.780	12,613,069.020	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	149.280	1,071,233.280	
MICROSOFT CORP	530,683	76.420	40,554,794.860	
MICRON TECH INC	76,146	41.610	3,168,435.060	
MIDDLEBY CORP	4,100	123.550	506,555.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,331	91.930	1,409,378.830	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	18.510	489,830.130	
3M CO	43,383	216.510	9,392,853.330	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,963	257.060	1,275,788.780	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,170	89.260	1,175,554.200	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	104.890	760,137.830	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	25.750	320,407.250	
MYLAN NV	31,344	38.290	1,200,161.760	
ILLUMINA INC	10,453	206.690	2,160,530.570	
XCEL ENERGY INC	37,554	48.280	1,813,107.120	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	34.980	942,291.240	
NETAPP INC	20,641	43.510	898,089.910	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	30.230	415,360.200	
NEWELL BRANDS INC	36,206	43.170	1,563,013.020	
NEWMONT MINING CORP	38,093	38.080	1,450,581.440	
NVR INC	299	2,923.150	874,021.850	
NIKE INC-CL B	94,901	51.030	4,842,798.030	
NOBLE ENERGY INC	31,005	27.790	861,628.950	
NORDSTROM INC	9,487	42.920	407,182.040	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,896	131.490	2,879,105.040	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	61.300	1,415,110.500	
NISOURCE INC	22,198	26.420	586,471.160	
COACH INC	19,175	38.870	745,332.250	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	93.730	1,508,115.700	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,954	295.190	3,528,701.260	
WELLS FARGO & CO	343,529	55.660	19,120,824.140	
NUCOR CORP	23,780	57.340	1,363,545.200	

MONSANTO CO	32,637	119.800	3,909,912.600	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	46.500	740,605.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,430	86.750	3,160,302.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,121	64.390	3,484,851.190	
OGE ENERGY CORP	16,028	36.470	584,541.160	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	208.420	1,328,677.500	
ORACLE CORP	222,369	48.280	10,735,975.320	
PACCAR INC	24,457	72.860	1,781,937.020	
EXELON CORP	69,910	38.460	2,688,738.600	
PARKER HANNIFIN CORP	10,277	177.560	1,824,784.120	
PATTERSON COS INC	7,169	36.950	264,894.550	
PAYCHEX INC	23,141	63.480	1,468,990.680	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	55.460	361,931.960	
MEDNAX INC	5,672	43.290	245,540.880	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	192.460	1,011,377.300	
PPL CORPORATION	49,957	37.920	1,894,369.440	
PEPSICO INC	105,321	111.510	11,744,344.710	
PENTAIR PLC	11,775	69.950	823,661.250	
PFIZER INC	432,021	36.450	15,747,165.450	
CONOCOPHILLIPS	88,450	49.600	4,387,120.000	
PVH CORP	5,387	126.210	679,893.270	
PG&E CORP	37,651	69.150	2,603,566.650	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	149.010	1,811,663.580	
ALTRIA GROUP INC	140,935	64.870	9,142,453.450	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,538	136.490	4,714,091.620	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	105.000	526,050.000	
GARMIN LTD	7,795	54.380	423,892.100	
AETNA INC	23,744	156.300	3,711,187.200	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	42.610	418,472.810	
PPG INDUSTRIES INC	17,674	112.410	1,986,734.340	
PRAXAIR INC	20,519	141.180	2,896,872.420	
COSTCO WHOLESALE CORP	31,578	157.870	4,985,218.860	
T ROWE PRICE GROUP INC	16,303	92.850	1,513,733.550	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	91.450	949,068.100	
PROCTER & GAMBLE CO	185,301	91.460	16,947,629.460	
PROGRESSIVE CORP	41,336	49.250	2,035,798.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	48.390	1,795,994.850	
PULTE GROUP INC	21,209	26.970	572,006.730	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	12.840	390,181.920	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	99.070	1,066,884.830	
QUALCOMM INC	109,455	54.120	5,923,704.600	

RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	86.390	880,054.930	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	137.730	486,875.550	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	452.970	2,563,357.230	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	142.040	659,349.680	
AUTONATION INC	5,772	45.210	260,952.120	
RESMED INC	9,394	76.550	719,110.700	
US BANCORP	122,040	54.260	6,621,890.400	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	61.470	449,775.990	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	98.590	855,169.660	
ROSS STORES INC	28,189	64.550	1,819,599.950	
ROLLINS INC	5,357	47.480	254,350.360	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,821	249.910	1,954,546.110	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	183.750	1,629,311.250	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	125.010	1,536,747.930	
RAYTHEON COMPANY	21,099	187.220	3,950,154.780	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	224.800	865,030.400	
ACCENTURE PLC-CL A	44,729	136.910	6,123,847.390	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	109,427	41.710	4,564,200.170	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	155.960	1,380,090.040	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	134.600	1,626,775.600	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	125.610	2,481,425.550	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,718	94.640	2,150,031.520	
PRICELINE GROUP INC	3,542	1,920.200	6,801,348.400	
SCHLUMBERGER LTD	100,396	67.740	6,800,825.040	
SCHWAB (CHARLES) CORP	88,912	45.310	4,028,602.720	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	118.640	1,681,722.000	
BUNGE LTD	10,334	67.740	700,025.160	
SEI INVESTMENTS CO	11,107	63.550	705,849.850	
ANTHEM INC	19,573	189.890	3,716,716.970	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	80.320	984,482.240	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	67.300	1,443,046.600	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	383.040	2,282,152.320	
CENTENE CORP	12,713	96.050	1,221,083.650	
SVB FINANCIAL GROUP	3,468	188.070	652,226.760	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	60.650	580,117.250	
ACUITY BRANDS INC	3,087	165.060	509,540.220	
SNAP-ON INC	3,932	150.940	593,496.080	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,203	110.010	3,322,632.030	

ADVANCE AUTO PARTS	5,273	89.400	471,406.200	
EDISON INTERNATIONAL	24,139	78.420	1,892,980.380	
SOUTHERN CO	70,353	50.480	3,551,419.440	
BB&T CORP	60,674	47.350	2,872,913.900	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	58.550	664,659.600	
AT&T INC	446,294	38.190	17,043,967.860	
CHEVRON CORP	137,000	119.330	16,348,210.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,528	156.490	1,647,526.720	
STATE STREET CORP	27,099	99.290	2,690,659.710	
STARBUCKS CORP	103,854	55.640	5,778,436.560	
STEEL DYNAMICS INC	15,309	35.980	550,817.820	
STRYKER CORP	24,985	146.410	3,658,053.850	
NETFLIX INC	31,957	194.950	6,230,017.150	
STERICYCLE INC	6,853	70.710	484,575.630	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	60.170	2,091,268.520	
SYMANTEC CORP	46,581	31.610	1,472,425.410	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	40.090	392,601.370	
SYNOPSIS INC	10,656	82.860	882,956.160	
SYSCO CORP	35,926	53.780	1,932,100.280	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,788	360.290	2,805,938.520	
TELEFLEX INC	3,203	239.890	768,367.670	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	15.760	1,006,323.280	
ANDEAVOR	11,500	106.420	1,223,830.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	70,900	92.870	6,584,483.000	
TEXTRON INC	19,076	53.920	1,028,577.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,065	193.460	5,429,454.900	
TIFFANY & CO	8,733	93.270	814,526.910	
TOLL BROTHERS INC	9,526	43.180	411,332.680	
TORCHMARK CORP	7,699	81.100	624,388.900	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	67.570	762,122.030	
DAVITA INC	12,618	54.560	688,438.080	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	59.430	551,272.680	
TRIMBLE INC	20,073	40.590	814,763.070	
TYSON FOODS INC	21,621	70.040	1,514,334.840	
UGI CORP	12,068	47.040	567,678.720	
MARATHON OIL CORP	66,702	13.680	912,483.360	
UNION PACIFIC CORP	58,542	113.050	6,618,173.100	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	54,787	117.750	6,451,169.250	
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,757	195.260	13,620,751.820	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	107.750	684,320.250	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	100.910	691,031.680	

VF CORP	24,309	64.350	1,564,284.150	
CBS CORP	26,212	57.100	1,496,705.200	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	154.020	2,732,622.840	
VULCAN MATERIALS CO	9,977	117.280	1,170,102.560	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	66,410	68.920	4,576,977.200	
WAL-MART STORES INC	112,246	85.730	9,622,849.580	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	77.080	2,483,209.280	
WATERS CORP	5,963	185.670	1,107,150.210	
ALLERGAN PLC	24,888	206.610	5,142,109.680	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	104.270	912,883.850	
VAIL RESORTS INC	2,598	216.350	562,077.300	
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	85.620	1,756,579.920	
WABTEC CORP	5,497	75.130	412,989.610	
WHIRLPOOL CORP	5,553	176.910	982,381.230	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	105.470	1,426,903.630	
WYNN RESORTS LTD	6,279	143.270	899,592.330	
NASDAQ INC	9,132	75.630	690,653.160	
CME GROUP INC	25,327	137.190	3,474,611.130	
WILLIAMS COS INC	61,081	30.160	1,842,202.960	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	25.300	189,471.700	
LKQ CORP	22,948	36.960	848,158.080	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	42.660	698,898.780	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	64.730	1,496,363.410	
FOOT LOCKER INC	9,476	32.930	312,044.680	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	48.120	896,523.720	
CARMAX INC	13,513	76.060	1,027,798.780	
XEROX CORP	17,455	32.740	571,476.700	
XILINX INC	18,777	72.760	1,366,214.520	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	115.500	808,846.500	
TJX COMPANIES INC	46,499	72.550	3,373,502.450	
ZIONS BANCORP	16,584	47.280	784,091.520	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	7.430	703,621.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	65.550	1,029,135.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	43.450	742,995.000	
SIGNATURE BANK	4,171	125.680	524,211.280	
CBRE GROUP INC	20,976	39.230	822,888.480	
LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	32.460	521,729.580	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	15.040	1,270,669.440	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	209.240	681,285.440	
T-MOBILE US INC	21,188	61.180	1,296,281.840	
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	63.320	1,797,464.840	
MOSAIC CO/THE	26,525	21.100	559,677.500	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	37,764	25.480	962,226.720	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	26.110	1,967,127.400	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	72.110	394,658.030	
CELANESE CORP	10,766	106.560	1,147,224.960	
DEXCOM INC	6,161	47.200	290,799.200	
DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	10,423	20.000	208,460.000	
EXPEDIA INC	8,709	147.170	1,281,703.530	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	34.910	644,962.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	151.830	1,606,057.740	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	31.490	1,316,848.820	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	70.090	2,949,737.650	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	16.520	242,777.920	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	25.210	620,468.520	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	311.490	562,862.430	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	67.400	417,273.400	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	264.560	1,008,502.720	
MASTERCARD INC	69,733	146.850	10,240,291.050	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	22.360	660,313.160	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	108.970	810,300.920	
HANESBRANDS INC	27,619	23.660	653,465.540	
WESTERN UNION CO	35,222	19.740	695,282.280	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	62.140	579,269.080	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	52.000	602,472.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	24.370	441,072.630	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	82.000	683,060.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	30,910	18.280	565,034.800	
DELTA AIR LINES INC	14,611	53.070	775,405.770	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	37.640	239,164.560	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	64.840	1,762,156.680	
TE CONNECTIVITY LTD	24,311	86.750	2,108,979.250	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	135.670	1,431,589.840	
WABCO HOLDING INC	3,176	149.840	475,891.840	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	62.690	418,957.270	
VMWARE INC	5,491	112.030	615,156.730	
MERCADOLIBRE INC	2,861	274.490	785,315.890	

ULTA BEAUTY INC	4,332	207.890	900,579.480	
INVESCO LTD	29,824	36.290	1,082,312.960	
MSCI INC	6,462	121.880	787,588.560	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	112,359	114.260	12,838,139.340	
VISA INC	133,087	108.440	14,431,954.280	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	88.800	1,116,393.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	84.440	1,012,604.480	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	84.750	558,078.750	
SIGNET JEWELERS LTD	4,205	64.090	269,498.450	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,085	18.930	304,489.050	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	56.220	2,061,756.060	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	66.060	767,881.440	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	103.940	189,794.440	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	150,279	19.050	2,862,814.950	
XYLEM INC	14,682	64.310	944,199.420	
ALKERMES PLC	12,053	51.560	621,452.680	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	26,044	97.260	2,533,039.440	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	233.930	813,842.470	
SPLUNK INC	10,674	63.480	677,585.520	
HCA HEALTHCARE INC	21,493	75.530	1,623,366.290	
VERISK ANALYTICS INC	12,511	83.360	1,042,916.960	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	142.570	568,426.590	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	161.570	1,057,314.080	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	103.410	1,103,177.880	
CIT GROUP INC	9,287	49.440	459,149.280	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	115.460	2,615,399.920	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	47.780	785,742.100	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.430	174,408.000	
LEAR CORP	5,132	173.410	889,940.120	
CBOE HOLDINGS INC	8,174	109.100	891,783.400	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	40.700	432,763.100	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	82.540	1,597,561.700	
FORTINET INC	11,399	38.680	440,913.320	
AON PLC	19,411	147.770	2,868,363.470	
TESLA INC	9,357	354.600	3,317,992.200	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	48.490	552,398.080	
GENERAL MOTORS CO	100,830	45.470	4,584,740.100	
VANTIV INC	12,141	70.800	859,582.800	
TRIPADVISOR INC	9,263	40.330	373,576.790	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	24.350	764,809.150	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	47.000	560,381.000	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	40.550	548,438.750	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,069	99.250	1,892,598.250	
PHILLIPS 66	30,976	93.680	2,901,831.680	
FACEBOOK INC	171,270	172.740	29,585,179.800	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	10,051	97.760	982,585.760	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	101.520	716,122.080	
SERVICENOW INC	13,054	120.680	1,575,356.720	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	149.000	1,050,152.000	
TESARO INC	2,646	117.910	311,989.860	
WORKDAY INC	10,290	108.510	1,116,567.900	
ABBVIE INC	116,610	92.380	10,772,431.800	
ZOETIS INC	37,529	64.280	2,412,364.120	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	58.800	718,771.200	
COTY INC	38,871	16.850	654,976.350	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.480	407,945.240	
MALLINCKRODT PLC	7,835	35.690	279,631.150	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	34.950	450,540.450	
CDW CORP	12,723	69.040	878,395.920	
SPRINT CORP	63,882	7.190	459,311.580	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	52.830	538,813.170	
ARCONIC INC	27,513	27.350	752,480.550	
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	41.840	363,673.280	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	44.090	220,714.540	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	43.800	585,518.400	
XL GROUP LTD	20,259	39.350	797,191.650	
BROADCOM LTD	29,284	250.400	7,332,713.600	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	79.360	1,196,272.640	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	15.150	233,461.500	
BLACK KNIGHT INC	5,445	44.550	242,574.750	
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	34.390	976,813.560	
TECHNIPFMC LTD	32,556	27.270	887,802.120	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	60.670	381,674.970	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC ADR	16,697	31.790	530,797.630	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	20.210	266,024.230	
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	57.420	400,791.600	
TWITTER INC	43,692	17.730	774,659.160	

PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	21.850	171,238.450	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	32.340	417,832.800	
ALLEGION PLC	7,994	88.150	704,671.100	
PERRIGO CO PLC	8,553	87.310	746,762.430	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	70.220	1,038,975.120	
ARAMARK	17,307	41.970	726,374.790	
SABRE CORP	17,624	18.190	320,580.560	
NAVIENT CORP	22,636	11.790	266,878.440	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	26.960	470,559.840	
ARISTA NETWORKS INC	3,158	192.950	609,336.100	
IHS MARKIT LTD	27,511	43.970	1,209,658.670	
FNF GROUP	17,760	34.200	607,392.000	
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	31.420	1,806,178.700	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	37.450	1,304,945.250	
CDK GLOBAL INC	8,309	64.850	538,838.650	
QORVO INC	8,784	72.940	640,704.960	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	34.650	394,628.850	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	96.860	757,251.480	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	28.570	420,264.700	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	39.720	1,066,084.800	
DOWDUPONT INC	168,213	71.620	12,047,415.060	
WESTROCK CO	17,744	58.570	1,039,266.080	
KRAFT HEINZ CO	43,818	78.190	3,426,129.420	
FORTIVE CORP	21,682	72.350	1,568,692.700	
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	69.860	1,318,886.940	
ALPHABET INC-CL A	21,455	1,005.650	21,576,220.750	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	14.940	1,816,554.600	
PAYPAL HOLDINGS INC	84,248	67.780	5,710,329.440	
FIRST DATA CORP	22,035	17.830	392,884.050	
DXC TECHNOLOGY CO	21,001	87.650	1,840,737.650	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	41.410	336,828.940	
ALPHABET INC-CL C	22,724	989.250	22,479,717.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	187.660	1,105,692.720	
ATHENE HOLDING LTD	8,984	54.750	491,874.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,503	365.120	5,660,455.360	
アメリカ・ドル 小計	22,688,783		1,617,975,597.890 (181,941,355,983)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	10.010	259,309.050	
ASHTAD GROUP	35,233	18.530	652,867.490	
SEVERN TRENT PLC	14,897	21.500	320,285.500	
BHP BILLITON PLC	153,323	13.665	2,095,158.790	
BARCLAYS PLC	1,277,859	1.904	2,433,043.530	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	6.695	433,045.990	

BT GROUP PLC	631,894	2.760	1,744,027.440	
SKY PLC	72,210	9.135	659,638.350	
BUNZL PLC	22,241	23.090	513,544.690	
EASYJET PLC	13,628	12.890	175,664.920	
CAPITA PLC	54,894	5.445	298,897.830	
AVIVA PLC	277,861	4.935	1,371,244.030	
CRODA INTERNATIONAL	8,407	38.800	326,191.600	
DIAGEO PLC	179,703	25.585	4,597,701.250	
SCHRODERS PLC	11,554	34.350	396,879.900	
DCC PLC	5,936	73.050	433,624.800	
NATIONAL GRID PLC	252,695	9.430	2,382,913.850	
GKN PLC	134,180	3.518	472,045.240	
KINGFISHER PLC	165,680	3.056	506,318.080	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	6.150	1,384,832.400	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	8.005	95,955.930	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,726	49.165	8,246,248.790	
COBHAM PLC	142,739	1.472	210,111.800	
NEXT PLC	9,731	50.500	491,415.500	
IMPERIAL BRANDS PLC	71,010	31.540	2,239,655.400	
IMI PLC	21,218	12.450	264,164.100	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	33.790	423,287.330	
ANGLO AMERICAN PLC	93,573	14.420	1,349,322.660	
COMPASS GROUP PLC	115,111	16.100	1,853,287.100	
HSBC HOLDINGS PLC	1,445,842	7.584	10,965,265.720	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.634	1,115,891.460	
CENTRICA PLC	392,766	1.756	689,697.090	
UNILEVER PLC	93,834	44.160	4,143,709.440	
MEGGITT PLC	62,181	5.190	322,719.390	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.336	363,673.150	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	8.600	478,151.400	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.150	497,313.600	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	33.040	836,176.320	
PEARSON PLC	65,009	6.165	400,780.480	
PERSIMMON PLC	23,150	27.780	643,107.000	
PRUDENTIAL PLC	182,973	18.240	3,337,427.520	
RIO TINTO PLC	91,556	35.690	3,267,633.640	
VODAFONE GROUP PLC	1,906,594	2.150	4,099,177.100	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,231	70.380	3,324,117.780	
RELX PLC	80,689	16.830	1,357,995.870	
OLD MUTUAL PLC	339,296	1.963	666,038.040	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	9.110	1,065,560.260	

ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.754	769,583.260	
ST JAMES' S PLACE PLC	40,884	11.300	461,989.200	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	14.500	295,176.500	
SSE PLC	73,043	13.740	1,003,610.820	
BP PLC	1,412,206	4.886	6,900,038.510	
SHIRE PLC	65,457	38.365	2,511,257.800	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	7.205	614,377.550	
SMITHS GROUP PLC	31,720	16.100	510,692.000	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	7.650	1,817,127.450	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,323,741	0.665	3,540,287.760	
TATE & LYLE PLC	39,915	6.545	261,243.670	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	2.001	506,297.020	
TESCO PLC	562,988	1.872	1,053,913.530	
3I GROUP PLC	66,784	9.450	631,108.800	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	14.010	926,831.550	
GLAXOSMITHKLINE PLC	360,458	15.170	5,468,147.860	
WEIR GROUP	18,336	20.020	367,086.720	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	39.210	858,228.480	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	8.220	175,102.440	
WPP PLC	90,628	13.720	1,243,416.160	
FERGUSON PLC	18,238	51.850	945,640.300	
ASTRAZENECA PLC	90,878	51.480	4,678,399.440	
WHITBREAD PLC	12,159	40.280	489,764.520	
CARNIVAL PLC	13,153	50.400	662,911.200	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.499	420,894.710	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	7.335	359,326.980	
INTERTEK GROUP PLC	13,339	51.550	687,625.450	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	18.470	552,123.710	
INVESTEC PLC	50,655	5.520	279,615.600	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	40.990	506,718.380	
ITV PLC	247,210	1.737	429,403.770	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.395	262,036.950	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	74.300	519,951.400	
G4S PLC	122,250	2.788	340,833.000	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	18.820	299,106.260	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	38.350	411,342.100	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	326,760	23.050	7,531,818.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	266,594	23.375	6,231,634.750	
INMARSAT PLC	34,127	6.275	214,146.920	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,457	11.620	133,130.340	
TUI AG-DI	30,153	13.190	397,718.070	

	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	4.326	796,775.650	
	EXPERIAN PLC	72,946	15.510	1,131,392.460	
	MONDI PLC	24,061	19.260	463,414.860	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	14.960	318,498.400	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	14.440	225,827.160	
	GLENCORE PLC	900,291	3.650	3,286,062.150	
	DIXONS CARPHONE PLC	84,639	1.936	163,861.100	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.701	417,080.490	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	6.835	209,260.360	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	26.110	350,030.660	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.794	330,809.600	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	3.855	212,256.300	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.636	231,971.530	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	15,645	24.100	377,044.500	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.658	279,280.980	
	WORLDPAY GROUP PLC	160,354	4.131	662,422.370	
イギリス・ボンド 小計		22,461,041		139,930,766.100 (20,839,888,995)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	24.850	1,948,935.800	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	19.070	2,369,828.900	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.940	929,856.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	524.600	923,296.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	271.800	706,680.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	15.360	758,952.960	
	NICE LTD	4,035	286.300	1,155,220.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	62.900	656,927.600	
イスラエル・シュケル 小計		459,178		9,449,697.960 (304,280,274)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	63.550	706,358.250	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	215,285	29.900	6,437,021.500	
	AMCOR LTD	80,741	15.500	1,251,485.500	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	239,994	32.640	7,833,404.160	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	12.940	395,562.860	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.960	566,060.000	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.480	949,758.120	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.520	449,441.280	
	AMP LTD	200,498	5.050	1,012,514.900	

ASX LTD	10,290	53.430	549,794.700	
BHP BILLITON LTD	232,053	26.630	6,179,571.390	
CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	32.560	682,001.760	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	60,838	3.910	237,876.580	
COMPUTERSHARE LT	38,040	14.470	550,438.800	
CSL LIMITED	32,212	136.700	4,403,380.400	
REA GROUP LTD	4,119	68.470	282,027.930	
TRANSURBAN GROUP	149,591	12.060	1,804,067.460	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	7.930	385,405.930	
COCHLEAR LTD	3,992	164.860	658,121.120	
ORIGIN ENERGY LTD	121,721	7.020	854,481.420	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	125,646	76.350	9,593,072.100	
BORAL LIMITED	86,101	6.710	577,737.710	
RIO TINTO LIMITED	26,822	68.770	1,844,548.940	
APA GROUP	73,253	8.220	602,139.660	
ARISTOCRAT LEISU	44,406	22.610	1,004,019.660	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.470	1,109,417.370	
TPG TELECOM LTD	28,719	4.950	142,159.050	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	6,557	45.420	297,818.940	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	17.680	632,767.200	
ORICA LTD	25,308	19.960	505,147.680	
CIMIC GROUP LTD	8,709	46.230	402,617.070	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	11.490	424,452.090	
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.180	611,233.400	
MACQUARIE GROUP LTD	24,521	92.950	2,279,226.950	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.370	1,245,829.970	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	31.770	6,127,861.140	
NEWCREST MINING LTD	51,533	22.090	1,138,363.970	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.110	666,313.650	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.660	499,319.160	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	43,789	6.240	273,243.360	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	10.250	977,747.500	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.340	564,024.380	
SANTOS LTD	133,862	4.070	544,818.340	
SONIC HEALTHCARE	26,192	21.290	557,627.680	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.300	304,336.800	
WESFARMERS LTD	81,021	41.450	3,358,320.450	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.230	411,686.990	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,249	29.060	1,750,835.940	
WOOLWORTHS LTD	97,477	24.880	2,425,227.760	
SEEK LTD	25,899	17.240	446,498.760	

	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	46.790	214,344.990	
	TATTS GROUP LTD	109,937	3.990	438,648.630	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.695	279,786.870	
	AGL ENERGY LTD	46,315	22.920	1,061,539.800	
	BRAMBLES LTD	115,255	9.190	1,059,193.450	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.670	383,487.870	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.880	679,217.920	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	14.100	716,124.900	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	1.775	264,558.420	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.990	529,756.240	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.260	1,196,605.820	
オーストラリア・ドル 小計		5,496,017		84,330,452.640 (7,400,840,523)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	57.620	930,044.420	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	58.940	1,811,108.320	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	20.890	1,747,406.720	
	ATCO LTD	7,193	46.710	335,985.030	
	BANK OF MONTREAL	45,451	97.240	4,419,655.240	
	BANK OF NOVA SCOTIA	86,583	80.830	6,998,503.890	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	61.450	1,459,806.200	
	BCE INC	11,568	58.890	681,239.520	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	65,043	52.990	3,446,628.570	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	17.800	459,578.200	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.350	356,295.250	
	SAPUTO INC	14,101	43.280	610,291.280	
	BLACKBERRY LTD	39,652	14.200	563,058.400	
	CGI GROUP INC	15,228	65.800	1,002,002.400	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	63.940	725,079.600	
	CAE INC	23,000	21.500	494,500.000	
	CAMECO CORP	32,627	11.380	371,295.260	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	66.120	1,716,938.040	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29,471	112.270	3,308,709.170	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	41.500	3,295,930.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	156.770	762,215.740	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	39.150	357,008.850	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,387	100.960	5,490,911.520	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.010	228,454.170	
	AGRIUM INC	9,382	132.690	1,244,897.580	
	YAMANA GOLD INC	67,520	3.280	221,465.600	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	38.750	539,787.500		
OPEN TEXT CORP	19,756	41.890	827,578.840		
EMPIRE CO LTD	15,093	22.190	334,913.670		

KINROSS GOLD CORP	99,741	5.460	544,585.860	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	29.050	287,362.600	
FORTIS INC	29,002	45.460	1,318,430.920	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	15.430	853,217.280	
TELUS CORP	18,945	45.000	852,525.000	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	36.270	698,124.960	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	39.460	850,047.320	
ENBRIDGE INC	119,607	51.980	6,217,171.860	
IGM FINANCIAL INC	8,426	43.220	364,171.720	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	4.080	359,019.600	
MANULIFE FINANCIAL CORP	148,181	25.910	3,839,369.710	
LINAMAR CORP	3,827	78.400	300,036.800	
LOBLAW CO LTD	15,354	68.900	1,057,890.600	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	56.900	371,215.600	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	68.270	1,729,893.530	
SUN LIFE FINANCIAL INC	47,058	49.710	2,339,253.180	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,245	645.000	1,448,025.000	
METRO INC	19,965	41.990	838,330.350	
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.740	452,509.260	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	9.610	384,323.120	
METHANEX CORP	7,381	62.630	462,272.030	
ONEX CORP	6,646	97.640	648,915.440	
GOLDCORP INC	70,077	16.630	1,165,380.510	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,076	23.770	1,451,776.520	
POWER CORP OF CANADA	25,052	32.300	809,179.600	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	35.350	618,059.400	
ROYAL BANK OF CANADA	106,285	98.830	10,504,146.550	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	56.960	748,112.640	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	208.440	2,210,923.080	
SHAW COMM INC-B	27,548	28.630	788,699.240	
SUNCOR ENERGY INC	120,732	42.990	5,190,268.680	
ENCANA CORP	69,257	14.350	993,837.950	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	28.380	1,164,034.080	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	57.710	1,181,265.990	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	133,609	71.110	9,500,935.990	
TRANSCANADA CORP	62,895	62.460	3,928,421.700	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	75.720	431,301.120	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	109.950	341,394.750	

INTACT FINANCIAL CORP	10,785	102.980	1,110,639.300	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	25.050	850,272.150	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	719.640	1,075,142.160	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,627	99.400	1,453,923.800	
CI FINANCIAL CORP	20,695	28.070	580,908.650	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	22.700	358,183.300	
KEYERA CORP	13,728	38.570	529,488.960	
ALTAGAS LTD	12,538	28.200	353,571.600	
PEMBINA PIPELINE CORP	41,429	43.110	1,786,004.190	
DOLLARAMA INC	7,504	136.520	1,024,446.080	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	12.170	980,232.650	
VERMILION ENERGY INC	8,291	42.580	353,030.780	
ARC RESOURCES LTD	22,997	16.000	367,952.000	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	18.610	269,714.730	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	9.620	294,670.220	
INTER PIPELINE LTD	24,083	25.960	625,194.680	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	32.020	479,051.220	
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	19.790	341,001.490	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	81.860	1,256,796.580	
SHOPIFY INC	5,021	118.400	594,486.400	
HYDRO ONE LTD	26,559	22.620	600,764.580	
カナダ・ドル 小計	3,065,501		127,271,194.040 (11,497,679,669)	
シンガポール・ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.350	418,750.000	
SEMBICORP INDUSTRIES	81,400	3.120	253,968.000	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.690	332,753.000	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.380	263,013.200	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	135,700	21.350	2,897,195.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	11.920	345,680.000	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	40.140	238,592.160	
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.630	195,849.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.620	525,018.000	
CAPITALAND LTD	192,415	3.670	706,163.050	
GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.180	491,352.000	
KEPPEL CORP LTD	119,300	6.730	802,889.000	
COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.040	362,916.000	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	11.340	2,556,637.020	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.680	2,178,272.960	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.180	483,550.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	24.070	2,274,615.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.640	349,920.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.340	307,280.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.455	274,704.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	3.300	567,930.000	
シンガポール・ドル	小計	3,662,874		16,827,047.390 (1,397,822,827)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	182,508	15.390	2,808,798.120	
	NESTLE SA-REGISTERED	225,201	83.600	18,826,803.600	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	89.350	3,345,085.300	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	50,677	245.900	12,461,474.300	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	218.700	620,014.500	
	SIKA INHABER	151	7,165.000	1,081,915.000	
	SGS SA-REG	405	2,313.000	936,765.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	160,610	83.800	13,459,118.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	154.900	639,272.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,493.000	214,992.000	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	501.500	900,192.500	
	ABB LTD	140,915	24.450	3,445,371.750	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	75.850	936,064.850	
	GEBERIT AG	2,801	465.600	1,304,145.600	
	LONZA GROUP AG-REG	5,901	265.300	1,565,535.300	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,640.000	423,000.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	68,330.000	614,970.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,148.000	1,486,416.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,250	294.600	3,314,250.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	56.700	1,852,729.200	
	SONOVA HOLDING AG	3,168	172.900	547,747.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	176.000	648,912.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	600	645.000	387,000.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	399.000	780,045.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	76.450	351,058.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	213.600	355,216.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	342.300	761,617.500	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	117.200	357,460.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	636.500	351,984.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.750	519,632.500	
	DUFREY GROUP	2,390	155.900	372,601.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	663.500	843,972.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	57.100	869,461.700	

	SWISS RE LTD	23,838	90.600	2,159,722.800	
	UBS GROUP AG	268,881	16.690	4,487,623.890	
スイス・フラン 小計		1,211,642		84,030,968.610 (9,707,257,494)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	346.200	16,748,117.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	315.000	9,184,455.000	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	46.540	10,320,151.920	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	156.000	2,051,868.000	
	LUNDBERGS B	3,691	645.000	2,380,695.000	
	SKF AB-B SHS	24,866	174.000	4,326,684.000	
	SANDVIK AB	76,781	141.200	10,841,477.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	117,729	105.200	12,385,090.800	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	185.300	3,924,468.700	
	SWEDBANK AB	66,507	216.900	14,425,368.300	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	125.000	13,548,500.000	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	153.500	17,448,652.000	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	294.200	3,377,710.200	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	93.250	2,515,512.000	
	NORDEA AB	218,620	110.300	24,113,786.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	211.000	2,406,033.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	277.300	5,321,664.300	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	135.000	3,253,230.000	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	413.800	13,825,885.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	219.300	14,572,046.400	
	ASSA ABLOY AB-B	68,613	177.600	12,185,668.800	
	TELIA CO AB	184,927	39.200	7,249,138.400	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	177.300	2,976,867.000	
	BOLIDEN AB	21,855	289.400	6,324,837.000	
ALFA LAVAL AB	17,411	201.100	3,501,352.100		
KINNEVIK AB-B	18,310	268.900	4,923,559.000		
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	530.500	2,828,626.000		
ICA GRUPPEN AB	5,920	310.700	1,839,344.000		
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	82.100	2,766,113.200		
HEXAGON AB	20,529	403.300	8,279,345.700		
ESSITY AB-B	48,083	231.300	11,121,597.900		
スウェーデン・クローナ 小計		1,698,339		250,967,844.920 (3,511,040,150)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	715.000	5,240,950.000	
	A P MOLLER A/S	481	11,910.000	5,728,710.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	11,500.000	3,139,500.000	
	DANSKE BANK A/S	57,098	250.600	14,308,758.800	
	GENMAB A/S	4,633	1,420.000	6,578,860.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	331.800	5,276,947.200	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,315	308.800	41,476,472.000	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	575.000	9,089,600.000	
	TDC A/S	68,939	37.650	2,595,553.350	
	COLOPLAST-B	8,286	543.500	4,503,441.000	
	DSV A/S	13,040	469.200	6,118,368.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	177.500	1,160,317.500	
	H LUNDBECK A/S	4,840	392.000	1,897,280.000	
	TRYG A/S	11,107	145.100	1,611,625.700	
	PANDORA A/S	8,251	629.000	5,189,879.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	544.000	4,193,152.000	
	ISS A/S	11,125	257.700	2,866,912.500	
	DONG ENERGY A/S	11,600	388.000	4,500,800.000	
デンマーク・クローネ 小計		387,275		125,477,127.050 (2,248,550,116)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.240	611,470.080	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	7.750	583,427.750	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.615	759,732.010	
ニュージーランド・ドル 小計		383,434		1,954,629.840 (155,901,275)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	24,816	160.300	3,978,004.800	
	DNB ASA	70,426	159.300	11,218,861.800	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	60.000	5,512,740.000	
	TELENOR ASA	53,178	165.000	8,774,370.000	
	SCHIBSTED ASA	9,131	206.000	1,880,986.000	
	ORKLA ASA	61,421	83.450	5,125,582.450	
	STATOIL ASA	81,414	159.700	13,001,815.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,279	360.000	4,060,440.000	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	143.400	2,392,342.200		
ノルウェー・クローネ 小計		420,227		55,945,143.050 (794,980,482)	
ユーロ	CRH PLC	58,956	30.820	1,817,023.920	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	85.510	534,095.460	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	81.600	944,601.600	
	UMICORE	7,660	72.410	554,660.600	
	AIR LIQUIDE	31,649	104.000	3,291,496.000	
	AIRBUS SE	42,646	77.990	3,325,961.540	
	AXA	139,550	25.825	3,603,878.750	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	19.860	687,592.920	
	ADIDAS AG	13,503	194.000	2,619,582.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	15.540	1,336,362.300	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	38,521	17.380	669,494.980	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,335.000	209,595.000	
	DANONE	43,686	69.100	3,018,702.600	
	SAFRAN SA	22,050	85.620	1,887,921.000	
INTESA SANPAOLO	934,915	2.886	2,698,164.690		

INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	2.714	138,897.090	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,705	88.390	2,006,894.950	
ACCOR SA	15,604	43.400	677,213.600	
BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	30.490	230,595.870	
BOUYGUES	13,996	39.855	557,810.580	
BNP PARIBAS	80,451	67.370	5,419,983.870	
RELX NV	70,826	18.330	1,298,240.580	
THALES SA	8,128	95.690	777,768.320	
CAPGEMINI SA	11,481	99.500	1,142,359.500	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	50.490	215,289.360	
INGENICO GROUP	4,334	78.890	341,909.260	
UNICREDIT SPA	142,664	17.300	2,468,087.200	
NATIXIS	70,166	6.795	476,777.970	
KONINKLIJKE DSM NV	14,525	70.240	1,020,236.000	
COMMERZBANK AG	72,573	11.700	849,104.100	
EIFFAGE	4,777	87.440	417,700.880	
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	69.550	2,097,349.800	
UNITED INTERNET	9,882	54.170	535,307.940	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	49.930	276,911.780	
PUBLICIS GROUPE	15,068	60.200	907,093.600	
MAN SE	3,396	95.160	323,163.360	
IBERDROLA SA	407,950	6.739	2,749,175.050	
ENI SPA	177,297	13.920	2,467,974.240	
IMERYS SA	2,256	75.940	171,320.640	
JERONIMO MARTINS	19,517	16.315	318,419.850	
KBC GROUPE	18,378	71.820	1,319,907.960	
HANNOVER RUECK SE	3,642	105.600	384,595.200	
WARTSILA OYJ	11,645	59.200	689,384.000	
L'OREAL	18,067	185.500	3,351,428.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,452	239.400	4,896,208.800	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	28.280	271,488.000	
GEA GROUP AG	14,635	39.995	585,326.820	
BOLLORE	71,347	4.110	293,236.170	
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.160	388,420.640	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	122.650	1,486,272.700	
CONTINENTAL AG	7,776	215.750	1,677,672.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	38.060	2,662,068.640	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.765	184,147.890	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	38.140	358,477.860	
AXEL SPRINGER SE	3,067	56.490	173,254.830	
OMV AG	9,766	48.600	474,627.600	
PERNOD-RICARD	16,249	121.750	1,978,315.750	
PEUGEOT SA	42,232	20.365	860,054.680	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,066	55.140	665,319.240	

RENAULT SA	12,442	85.040	1,058,067.680	
REPSOL SA	94,490	15.400	1,455,146.000	
REMY COINTREAU	1,860	109.100	202,926.000	
MERCK KGAA	9,551	95.360	910,783.360	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	49.440	1,765,304.640	
SAIPEM	46,575	3.514	163,664.550	
RWE AG	39,183	20.485	802,663.750	
SEB SA	1,405	163.300	229,436.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	47.170	547,266.340	
SOCIETE GENERALE-A	56,596	48.590	2,749,999.640	
VINCI S.A.	35,362	80.370	2,842,043.940	
SODEXO	6,286	103.050	647,772.300	
SOLVAY SA	5,036	124.900	628,996.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,723	74.010	3,087,919.230	
VIVENDI SA	77,297	21.270	1,644,107.190	
SAP SE	71,560	94.820	6,785,319.200	
TELEFONICA S.A	322,715	9.220	2,975,432.300	
TOTAL SA	168,622	45.850	7,731,318.700	
VALEO	17,731	63.360	1,123,436.160	
E.ON SE	164,012	9.862	1,617,486.340	
VOEST-ALPINE AG	9,875	43.770	432,228.750	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	24.355	372,193.110	
HENKEL AG & CO KGAA	7,525	106.350	800,283.750	
SIEMENS AG-REG	55,852	119.650	6,682,691.800	
UPM-KYMMENE OYJ	36,917	23.810	878,993.770	
ING GROEP NV-CVA	289,132	15.745	4,552,383.340	
BAYER AG	60,432	117.150	7,079,608.800	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	12.420	525,403.260	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,173	118.550	1,561,659.150	
DAIMLER AG	68,086	68.090	4,635,975.740	
BASF SE	65,128	89.240	5,812,022.720	
BEIERSDORF AG	6,780	91.970	623,556.600	
HOCHTIEF AG	1,707	139.900	238,809.300	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	85.960	946,333.640	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	81.480	1,226,111.040	
ORANGE	141,819	13.920	1,974,120.480	
SAMPO OYJ-A SHS	33,860	45.800	1,550,788.000	
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	53.610	417,836.340	
ALLIANZ SE	32,540	194.350	6,324,149.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.093	591,053.740	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	91,426	15.940	1,457,330.440	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	29.740	523,483.480	
HERMES INTL	2,285	431.950	987,005.750	
ENDESA S.A.	21,037	19.430	408,748.910	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	24.560	485,010.880	

ERSTE GROUP BANK AG	23,324	37.290	869,751.960	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,346	184.250	2,090,500.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	51,058	22.345	1,140,891.010	
SOCIETE BIC SA	2,478	92.150	228,347.700	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	88.130	789,732.930	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,049	31.070	467,572.430	
HEINEKEN NV	17,373	85.850	1,491,472.050	
AKZO NOBEL	18,209	78.660	1,432,319.940	
ASML HOLDING NV	27,421	144.650	3,966,447.650	
AEGON NV	120,404	4.824	580,828.890	
BANKINTER S.A.	57,960	7.941	460,260.360	
VOLKSWAGEN AG	2,794	148.550	415,048.700	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	142.300	1,868,968.200	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	490,925	7.365	3,615,662.620	
KERING	5,479	357.550	1,959,016.450	
CNP ASSURANCES	13,987	19.870	277,921.690	
FORTUM OYJ	29,739	17.560	522,216.840	
AGEAS	12,993	40.335	524,072.650	
UCB SA	8,747	60.750	531,380.250	
THYSSENKRUPP AG	29,903	23.605	705,860.310	
UNILEVER NV-CVA	120,672	50.390	6,080,662.080	
CARREFOUR SA	39,144	17.135	670,732.440	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	18.695	542,341.950	
ATOS SE	7,050	133.050	938,002.500	
NOKIA OYJ	417,248	4.986	2,080,398.520	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	70,960	34.680	2,460,892.800	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	39.985	822,011.630	
SANOFI	81,462	84.420	6,877,022.040	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	16.840	772,383.440	
ELISA OYJ	9,517	36.130	343,849.210	
BANCO SANTANDER SA	1,155,988	5.646	6,526,708.240	
METSO OYJ	8,585	30.860	264,933.100	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.255	631,549.980	
QIAGEN N.V.	13,642	29.690	405,030.980	
LINDE AG	13,375	175.200	2,343,300.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	14.320	2,137,174.080	
BMW VORZUG	4,116	76.600	315,285.600	
K & S	14,982	20.850	312,374.700	
ENEL SPA	600,898	5.195	3,121,665.110	
COLRUYT NV	4,673	44.670	208,742.910	
VOPAK (KON.)	5,364	37.125	199,138.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	232,897	15.655	3,646,002.530	
LEONARDO SPA	26,269	15.310	402,178.390	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	21.715	1,775,722.410	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.984	683,237.520	

EUROFINS SCIENTIFIC	794	540.600	429,236.400	
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.985	182,604.120	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	94.500	1,308,258.000	
EURAZEO	2,427	78.570	190,689.390	
BANCO SABADELL	367,753	1.684	619,296.050	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	90.440	525,818.160	
FRAPORT AG	3,149	81.510	256,674.990	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	81.080	649,775.120	
INDITEX	79,821	31.400	2,506,379.400	
JC DECAUX SA	6,058	32.400	196,279.200	
ANDRITZ AG	6,265	48.460	303,601.900	
MAPFRE SA	84,474	2.730	230,614.020	
ESSILOR INTL	14,632	103.450	1,513,680.400	
SNAM SPA	158,419	4.202	665,676.630	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	15.050	1,288,054.250	
ENAGAS	18,095	24.270	439,165.650	
WENDEL	2,220	138.900	308,358.000	
TENARIS SA	38,237	11.520	440,490.240	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.771	610,757.670	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.620	308,509.520	
ATLANTIA SPA	34,969	27.480	960,948.120	
ILIAD SA	2,102	222.700	468,115.400	
PROXIMUS	8,922	28.890	257,756.580	
SES FDR	24,585	16.780	412,536.300	
TERNA SPA	117,108	4.978	582,963.620	
GRIFOLS SA	18,800	24.220	455,336.000	
FERROVIAL SA	36,193	18.615	673,732.690	
LANXESS AG	6,856	66.250	454,210.000	
NESTE OYJ	10,692	39.460	421,906.320	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	28.140	271,297.740	
RECORDATI SPA	6,859	39.830	273,193.970	
KONE OYJ	23,717	45.570	1,080,783.690	
ENGIE	129,539	14.435	1,869,895.460	
ALSTOM	12,046	35.850	431,849.100	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	58.680	213,243.120	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	23.195	290,911.690	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	10.905	379,014.180	
IPSEN SA	2,487	114.300	284,264.100	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	35.690	953,422.660	
ARKEMA SA	3,796	103.800	394,024.800	
LEGRAND SA	19,920	61.640	1,227,868.800	
ADP	2,313	138.650	320,697.450	
ORION OYJ	8,051	38.730	311,815.230	
RTL GROUP SA	3,446	64.820	223,369.720	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	15.105	572,796.700	
SYMRISE AG	7,926	63.910	506,550.660	

SCOR SE	13,875	35.340	490,342.500	
REXEL SA	23,245	14.225	330,660.120	
PRYSMIAN SPA	14,925	28.490	425,213.250	
CAIXABANK	262,372	4.060	1,065,230.320	
BUREAU VERITAS SA	21,480	22.265	478,252.200	
GROUPE EUROTUNNEL SE	37,646	10.540	396,788.840	
SUEZ SA	25,406	15.540	394,809.240	
AMADEUS IT GROUP SA	30,169	56.770	1,712,694.130	
BRENNTAG AG	9,600	47.600	456,960.000	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.957	311,304.870	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	48,305	4.450	214,957.250	
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	30.385	351,706.370	
EDENRED	13,195	23.950	316,020.250	
BANKIA SA	63,197	4.047	255,758.250	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.672	287,519.550	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	75.700	395,002.600	
OSRAM LICHT AG	7,017	63.800	447,684.600	
GEMALTO	6,103	34.020	207,624.060	
KION GROUP AG	6,125	80.080	490,490.000	
VONOVIA SE	35,308	36.450	1,286,976.600	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.890	504,947.430	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	35.200	566,368.000	
FERRARI NV	8,338	98.400	820,459.200	
METRO AG	10,774	16.905	182,134.470	
INNOGY SE	9,769	38.710	378,157.990	
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	10.160	799,033.200	
NN GROUP NV	21,965	35.700	784,150.500	
ZALANDO SE	6,674	44.550	297,326.700	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	82,323	15.130	1,245,546.990	
AENA SME SA	5,256	151.150	794,444.400	
ABN AMRO GROUP NV	29,129	25.945	755,751.900	
EXOR NV	9,441	55.850	527,279.850	
ALTICE NV-A	43,403	17.190	746,097.570	
COVESTRO AG	8,603	70.950	610,382.850	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	54,880	104.750	5,748,680.000	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.200	248,093.000	
SCHAEFFLER AG	12,644	13.710	173,349.240	
ユーロ 小計	14,135,769		289,106,033.330 (38,575,418,027)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	113.100	1,877,460.000

HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.920	3,102,880.000	
BANK OF EAST ASIA	76,260	34.850	2,657,661.000	
CLP HOLDINGS LTD	119,500	79.600	9,512,200.000	
PCCW LTD	331,000	4.250	1,406,750.000	
LI & FUNG LTD	532,400	4.030	2,145,572.000	
I-CABLE COMMUNICATIONS LTD	26,552	0.244	6,478.680	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	68.200	3,341,800.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	79,040	216.600	17,120,064.000	
MTR CORP	118,500	45.000	5,332,500.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	28.500	1,795,500.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	190.400	10,662,400.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	52.550	4,406,002.200	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	67.950	6,557,175.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	70.750	6,774,312.500	
HONG KONG & CHINA GAS	610,046	14.780	9,016,479.880	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	37.650	1,882,500.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	53.200	8,724,800.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	33.150	1,093,950.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	289,000	38.550	11,140,950.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	30.300	1,530,150.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.920	5,259,890.720	
SINO LAND CO	255,400	13.920	3,555,168.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	129.500	13,338,500.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	76.550	2,296,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	42.950	4,874,825.000	
WHEELOCK & CO LTD	56,000	56.650	3,172,400.000	
SJM HOLDINGS LTD	299,000	6.890	2,060,110.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	19.620	2,440,728.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	17.540	1,136,592.000	
AIA GROUP LTD	889,227	59.750	53,131,313.250	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	9.550	2,693,100.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	37.950	6,421,140.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	27.100	2,823,820.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.120	1,637,600.000	
WH GROUP LTD	530,500	8.200	4,350,100.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	100.700	20,072,732.400	
CK ASSET HOLDINGS LTD	198,832	64.300	12,784,897.600	
香港・ドル 小計	7,195,149		252,137,002.230	

			(3,633,294,203)	
合計	83,265,229		282,008,310,018 (282,008,310,018)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12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	63,819.000	596,069.460		
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,014,302.460		
		GPT GROUP	144,955.000	718,976.800		
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	689,347.350		
		MIRVAC GROUP	295,783.000	695,090.050		
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,507,893.840		
		STOCKLAND	193,279.000	834,965.280		
		VICINITY CENTRES	270,443.000	719,378.380		
		WESTFIELD CORP	140,035.000	1,075,468.800		
	オーストラリア・ドル	小計		1,650,984.000	7,851,492.420 (689,046,975)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT		200,806.000	538,160.080	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST-RTS		44,753.000	11,859.540	
		CAPITALAND MALL TRUST		199,000.000	407,950.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		192,100.000	363,069.000	
	シンガポール・ドル	小計		636,659.000	1,321,038.620 (109,738,678)	
投資信託受益証券	合計		2,287,643	798,785,653 (798,785,653)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	553,431.500		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	894,813.040		
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	4,233,485.490		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	934,987.680		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,463.000	1,883,130.740		
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,432,631.040		
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	413,130.000		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	586,956.150		
		COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	488,242.620		
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28,166.000	2,878,846.860		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,823,533.160		
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	707,917.100		
		EQUINIX INC	5,753.000	2,640,454.410		
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,799,342.900		
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,168,549.200		
EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	655,920.370				

	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,144.000	529,686.080	
	GGP INC	43,463.000	942,277.840	
	HCP INC	34,130.000	903,079.800	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	954,914.490	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	750,179.100	
	KIMCO REALTY	32,980.000	640,471.600	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	488,908.530	
	MID AMERICA	8,123.000	883,782.400	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	444,745.920	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,513,307.000	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,393,896.680	
	REALTY INCOME CORP	21,640.000	1,226,338.800	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	721,799.540	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,569.000	1,448,268.150	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,664.000	3,741,373.120	
	SL GREEN	8,203.000	860,494.700	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	521,279.620	
	UDR INC	17,458.000	674,053.380	
	VENTAS INC	25,041.000	1,578,835.050	
	VEREIT INC	72,429.000	605,506.440	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	969,064.960	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,801,497.040	
	WEYERHAEUSER CO	51,939.000	1,786,182.210	
アメリカ・ドル 小計		897,250.000	50,475,314.710 (5,675,949,139)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	434,819.550	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	312,716.360	
	INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	172,808.850	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	61,201.000	607,725.930	
	SEGRO PLC	61,113.000	334,593.670	
イギリス・ポンド 小計		327,513.000	1,862,664.360 (277,406,604)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	232,479.240	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	238,972.500	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,582.000	77,924.760	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	549,376.500 (49,630,673)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	200,865.390	
	GECINA SA	3,670.000	495,266.500	
	ICADE	2,234.000	166,410.660	
	KLEPIERRE	17,042.000	562,386.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,497,274.350	

	ユーロ 小計		32,510.000	2,922,202.900 (389,909,533)	
	香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	10,423,125.000	
	香港・ドル 小計		163,500.000	10,423,125.000 (150,197,232)	
投資証券	合計		1,443,778	6,543,093,181 (6,543,093,181)	
合計				7,341,878,834 (7,341,878,834)	

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 604銘柄	61.28%	-%	-%	64.84%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	1.91%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	7.02%	-%	-%	7.30%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.09%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.49%	-%	-%	2.80%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.23%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.87%	-%	-%	3.99%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.47%	-%	-%	0.52%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 35銘柄	3.27%	-%	-%	3.35%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.18%	-%	-%	1.21%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.76%	-%	-%	0.78%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0.05%	-%	-%	0.05%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.27%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式 232銘柄	12.99%	-%	-%	13.47%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 38銘柄	1.22%	-%	-%	1.31%
	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29年10月31日現在

資産総額	5,810,931,834円
負債総額	8,195,789円
純資産総額(-)	5,802,736,045円
発行済数量	1,583,066,774口
1口当たり純資産額(/)	3.6655円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年10月31日現在

資産総額	301,198,831,295円
負債総額	281,538,035円
純資産総額(-)	300,917,293,260円
発行済数量	88,924,408,009口
1口当たり純資産額(/)	3.3840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) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 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かか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得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。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 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（平成29年10月31日現在）

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成29年10月31日現在）

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。

取締役は株主総会で選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役（監査等委員である取締役を除く。）の補欠として選任された取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、現任取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、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）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

平成29年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,223,417,202,703
追加型株式投資信託	852	12,174,841,867,596
単位型公社債投資信託	56	293,054,001,411
単位型株式投資信託	131	894,157,810,122
合計	1,077	14,585,470,881,832

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne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32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29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33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	-	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	1 29,219	1 1,243,812
車両運搬具	1 549	1 -
器具備品	1 184,683	1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	-	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	-	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	-	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	-
時効後支払損引当金	-	216,466
本社移転費用引当金	-	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
(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	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	-	17,124,479
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	24,580,000
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	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	-		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		-	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

（単位：千円）

	第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）		第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		-		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		-		2
雑収入	1	6,693	1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		-		31,945
投資信託償還損		-		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
時効成立後支払分配金・償還金		-		39
時効後支払損引当金繰入額		-		209,210
営業外費用計		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	2	-	2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		-
貸倒引当金戻入益		-		8,883
訴訟損失引当金戻入益		-		21,677
その他特別利益		-		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	3	624	3	23,600
固定資産売却損	4	2,653	4	10,323
投資有価証券評価損		-		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		-		30,000
本社移転費用	5	-	5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	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	-	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の 積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の 積立	-	-			-
当期純利益	5,126,556	5,126,556			5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)			98,949	98,949	98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	98,949	98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	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	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の積立	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

重要な会計方針

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. 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。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 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。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 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、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分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、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、そ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年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、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年または10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しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</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> <p>(5) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(6) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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

この結果、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42,532千円増加しております。

追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
雑収入	4,715	8,183

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	-	16,052

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	543
器具備品	2,653	9,779

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	-	942,315
旧本社不動産賃借料	-	418,583
賃貸借契約解約損	-	150,723

(株主資本等変動計算書関係)

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
 平成28年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28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28年3月31日	平成28年6月30日

第32期（自平成28年4月1日 至平成29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	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

（注）普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

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28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成29年6月21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29年6月21日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種 類株式					

(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

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定してあります。

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っている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。当該デリバティブ取引は、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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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（為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されてあります。

有価証券及び投資有価証券は、主に其他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されてあります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(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

預金の預入先については、余資運用規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としています。

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

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り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31期（平成28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	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	32,747,840	32,747,840	-
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	-
負債計	1,744,274	1,744,274	-

第32期（平成29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	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

(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) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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) 未払手数料

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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	77,696	337,468
関係会社株式	3,229,196	3,306,296

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、「(5) 有価証券及び投資有価証券 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。

(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31期(平成28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) 現金・預金	12,951,736	-	-	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	-	-	-

第32期(平成29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) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円)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。

2. その他有価証券

第31期(平成28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	365,683	146,101	219,581
投資信託	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額77,696千円)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32期(平成29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	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)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「其他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却した其他有価証券

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	5,927	3,377	-

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	717,905	2	79,146

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

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(其他有価証券)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

(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確定給付企業年金制度(積立型制度であります)及び退職一時金制度(非積立型制度であります)を採用しております。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。

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度(複数事業主制度を含む)

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	51,531	144,062
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による増加	-	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	-	-
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の発生額	-	1,894
事業主からの拠出額	-	37,402
退職給付の支払額	-	28,876
合併による増加	-	1,336,984
年金資産の期末残高	-	1,363,437

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	1,275,346
年金資産	-	1,363,437
	-	88,090
非積立型制度の退職給付債務	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	79,449	430,203
未認識過去勤務費用	9,704	4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
前払年金費用	-	325,140
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
株式	-	31.5%
債券	-	29.0%
共同運用資産	-	24.1%
生命保険一般勘定	-	10.5%
現金及び預金	-	4.6%
合計	-	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02% ~ 1.09%
長期期待運用収益率	-	2.50%
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 8.73%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	-
退職給付費用	-	22,562
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	-	36,177
合併による増加	-	287,313
退職給付引当金の期末残高	-	300,927

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	789,261
年金資産	-	1,150,443
	-	361,181
非積立型制度の退職給付債務	-	60,254
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927
退職給付引当金	-	60,254
前払年金費用	-	361,181
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 - 千円 当事業年度22,562千円

4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

(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31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額(一括償却資産)	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額(税法上)	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	-
時効後支払損引当金	-	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	-	12,344
本社移転費用引当金	-	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	-
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
繰延税金負債		
前払年金費用	-	210,151
その他有価証券評価差額金	-	114,171
繰延税金負債合計	-	324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

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。

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM （存続会社）	MHAM （消滅会社）
合併比率（*）	1	0.0154

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成28年10月1日から平成29年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	- 千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん金額74,319,216千円及び顧客関連資産の金額50,434,199千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,483,082千円
経常利益	4,483,082千円
税引前当期純利益	4,483,082千円
当期純利益	3,693,863千円
1株当たり当期純利益	115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	795,405	未収投資助言報酬	207,235

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

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せん。

(2) 子会社及び関連会社等

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	9,000千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 増資の引受	800,617	未払費用	308,974
	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	912,600	-	-
									473,948	未払費用	157,130

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 当社預り資産の運用の顧問料は、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31期(自平成27年4月1日 至平成28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	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	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 金融技術の 開発業務委 託	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払費 用 未払金	292,861 7,581
	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 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

第32期(自平成28年4月1日 至平成29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				
親会社 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	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	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 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信 託銀行株 式会社	東京都 中央区	2,473 億円	信託銀 行業	-	-	投資一任契 約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

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) 当社預り資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注3) 業務委託料は、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4) 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。
- (注5) 運用受託報酬は、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6) 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せん。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	-	7,449,532
固定資産合計	-	124,292
流動負債合計	-	1,665,547
固定負債合計	-	114,110
純資産合計	-	5,794,167
営業収益	-	1,093,658
税引前当期純利益	-	5,546,153
当期純利益	-	3,891,816

(1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株主及び普通株主と同等の 株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の 株式に係る当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(-)	(7,734株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		38,311,736
金銭の信託		12,187,115
有価証券		10,007
未収委託者報酬		10,291,857
未収運用受託報酬		4,862,664
未収投資助言報酬		324,278
未収収益		55,950
前払費用		764,943
繰延税金資産		727,622
その他		498,289
	流動資産計	68,034,465
固定資産		
有形固定資産		1,782,018
建物	1	1,200,157
器具備品	1	573,952
建設仮勘定		7,907
無形固定資産		1,557,565
ソフトウェア		1,050,789
ソフトウェア仮勘定		502,759
電話加入権		3,934
電信電話専用施設利用権		81
投資その他の資産		7,742,187
投資有価証券		1,939,084
関係会社株式		3,229,196
長期差入保証金		1,566,055
繰延税金資産		906,695
その他		101,155
	固定資産計	11,081,771
	資産合計	79,116,236

(単位:千円)

	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	970,622
未払金	4,511,170
未払収益分配金	1,016
未払償還金	57,332
未払手数料	4,075,374
その他未払金	377,447
未払費用	7,061,067
未払法人税等	3,136,528
未払消費税等	1,025,584
前受収益	66,578
賞与引当金	1,376,046
役員賞与引当金	24,993
本社移転費用引当金	347,010
流動負債計	18,519,601
固定負債	
退職給付引当金	1,423,210
時効後支払損引当金	199,012
固定負債計	1,622,222
負債合計	20,141,823
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	36,673,439
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	36,550,146
別途積立金	24,580,000
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	11,470,146
株主資本計	58,226,396
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	748,016
評価・換算差額等計	748,016
純資産合計	58,974,413
負債・純資産合計	79,116,236

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日至平成29年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,132,996	
運用受託報酬	9,310,831	
投資助言報酬	593,439	
その他営業収益	57,716	
	営業収益計	52,094,984
営業費用		
支払手数料	18,688,374	
広告宣伝費	177,047	
公告費	860	
調査費	11,809,998	
調査費	5,371,951	
委託調査費	6,438,046	
委託計算費	550,197	
営業雑経費	555,637	
通信費	24,831	
印刷費	438,120	
協会費	27,130	
諸会費	29	
支払販売手数料	65,526	
	営業費用計	31,782,116
一般管理費		
給料	5,014,947	
役員報酬	93,260	
給料・手当	4,921,687	
交際費	22,147	
寄付金	4,057	
旅費交通費	181,947	
租税公課	331,327	
不動産賃借料	773,059	
退職給付費用	260,989	
固定資産減価償却費	1 720,970	
福利厚生費	22,315	
修繕費	1,799	
賞与引当金繰入額	1,376,046	
役員賞与引当金繰入額	24,993	
機器リース料	104	
事務委託費	1,549,368	
事務用消耗品費	75,575	
器具備品費	3,469	
諸経費	90,183	
	一般管理費計	10,453,305
営業利益		9,859,563

（単位：千円）

	第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日至平成29年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	593	
受取配当金	46,072	
時効成立分配金・償還金	85	
投資信託解約益	217,088	
投資信託償還益	93,060	
時効後支払損引当金戻入額	17,443	
雑収入	3,498	
	営業外収益計	377,842
営業外費用		
為替差損	8,306	
投資信託解約損	1,365	
投資信託償還損	17,053	
金銭の信託運用損	31,660	
	営業外費用計	58,386
経常利益		10,179,019
特別利益		
投資有価証券売却益	132,762	
関係会社株式売却益	1,492,680	
本社移転費用引当金戻入額	122,238	
その他特別利益	0	
	特別利益計	1,747,681
特別損失		
固定資産除却損	18,065	
固定資産売却損	134	
退職給付制度終了損	690,899	
その他特別損失	50	
	特別損失計	709,149
税引前中間純利益		11,217,551
法人税、住民税及び事業税		3,407,636
法人税等調整額		163,880
法人税等合計		3,243,755
中間純利益		7,973,795

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	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	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当中間期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
中間純利益									7,973,795
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	-	-	-	-	-	-	-	-	4,773,795
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	11,470,146

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
中間純利益	7,973,795	7,973,795			7,973,795
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額(純 額)			230,151	230,151	230,151
当中間期変動額 合計	4,773,795	4,773,795	230,151	230,151	5,003,947
当中間期末残高	36,673,439	58,226,396	748,016	748,016	58,974,413

重要な会計方針

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：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. 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。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="571 696 922 768"> <tr> <td>建物</td> <td>...</td> <td>6～18年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>2～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>	建物	...	6～18年	器具備品	...	2～20年
建物	...	6～18年					
器具備品	...	2～20年					
4. 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。						

5．引当金の計上基準	<p>(1) 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、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分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、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、そ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年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、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年または10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しております。</p> <p>なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

<p>第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)</p>
<p>当社は、当中間会計期間においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の減価償却費が286,788千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ同額減少しております。</p>

追加情報

<p>第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)</p>
--

当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」(企業会計基準適用指針第1号 平成28年12月16日)及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第2号 平成19年2月7日)を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。

本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 ... 97,109千円 器具備品 ... 774,035千円

(中間損益計算書関係)

項目	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産 ...
	無形固定資産 ...	578,697千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日 至平成29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	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

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29年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種類株式				

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（平成29年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成29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	38,311,736	38,311,736	-
(2) 金銭の信託	12,187,115	12,187,115	-
(3) 未収委託者報酬	10,291,857	10,291,857	-
(4) 未収運用受託報酬	4,862,664	4,862,664	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,641,123	1,641,123	-
資産計	67,294,496	67,294,496	-
(1) 未払手数料	4,075,374	4,075,374	-
負債計	4,075,374	4,075,374	-

（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）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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）未払手数料

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	307,968
関係会社株式	3,229,196

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、「(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

（有価証券関係）

第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)			
1. 子会社株式 関係会社株式（中間貸借対照表計上額3,229,196千円）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。			
2. 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	1,189,247	146,101	1,043,145
投資信託	423,152	385,910	37,242
小計	1,612,400	532,011	1,080,388
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	28,723	30,967	2,244
小計	28,723	30,967	2,244
合計	1,641,123	562,979	1,078,144
（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額307,968千円）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。			

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成29年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

（注）顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	118,742,638千円
資産合計	118,742,638千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,822,169千円
負債合計	13,822,169千円
純資産	104,920,468千円

（注）固定資産及び資産合計には、のれん

72,413,595千円及び顧客関連資産の金額47,817,519千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,506,064千円
経常利益	4,506,064千円
税引前中間純利益	4,506,064千円
中間純利益	3,709,808千円
1株当たり中間純利益	92,745円22銭

（注）営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,616,680千円が含まれております。

（資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（セグメント情報等）

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）

1．セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

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%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

（1株当たり情報）

第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,474,360円32銭
1株当たり中間純利益金額	199,344円89銭

（注）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。

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33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)
中間純利益金額	7,973,795千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,973,795千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

(注) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭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、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

平成29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29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】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

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。

独立監査人の監査報告書

平成29年6月7日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32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、アセットマネジメントOne株式会社の平成29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) XBR 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29年11月29日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 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28年10月13日から平成29年10月12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29年10月12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

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月24日

アセットマネジメントOne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	湯原	尚	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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の平成29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29年4月1日から平成29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）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。