

**【表紙】**

|   |                        |
|---|------------------------|
| <b>【提出書類】</b>                           | 有価証券届出書                |
| <b>【提出先】</b>                            | 関東財務局長                 |
| <b>【提出日】</b>                            | 平成26年4月14日             |
| <b>【発行者名】</b>                           | D I A Mアセットマネジメント株式会社  |
| <b>【代表者の役職氏名】</b>                       | 代表取締役社長 中島 敬雄          |
| <b>【本店の所在の場所】</b>                       | 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号      |
| <b>【事務連絡者氏名】</b>                        | 大楽 信雄                  |
| <b>【電話番号】</b>                           | 03-3287-3110           |
| <b>【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】</b> | マネックス資産設計ファンド エボリューション |
| <b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>        | 5,000億円を上限とします。        |
| <b>【縦覧に供する場所】</b>                       | 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】

マネックス資産設計ファンド エボリューション

なお、「マネックス資産設計ファンド Evolution」という名称を用いる場合があります。

（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（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金の再投資については、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当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、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

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

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：マ資産エボ）

**（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。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

**（７）【申込期間】**

継続申込期間：平成26年4月15日から平成27年4月13日まで

ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

**（９）【払込期日】**

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

**（１０）【払込取扱場所】**

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

**（１１）【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

## （ 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、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」に従って分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）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は、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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取得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、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。

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 世界の株式、債券、リートを実質的な投資対象とし、分散された基本ポートフォリオを構築します。

- 国内資産に偏らないグローバルな視点から資産配分比率を決定します。
- 基本ポートフォリオの資産配分比率の決定にあたっては、資産配分の専門家であるイボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。
- 各資産への投資はマザーファンドを通じて行います。
- 実質組入外資産について、原則として対円で為替ヘッジは行いません。



##### <投資対象とするマザーファンド>

|        |   |
|--------|---|
| 先進国株式  | 国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド<br>外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド  |
| 新興国株式  | エマージング株式バッシブ・マザーファンド                                  |
| 先進国債券  | 国内債券バッシブ・ファンド・マザーファンド<br>外国債券バッシブ・ファンド・マザーファンド        |
| 新興国債券  | エマージング債券バッシブ・マザーファンド                                  |
| 先進国リート | J-REITインデックスファンド・マザーファンド<br>グローバルリートバッシブ・ファンド・マザーファンド |

※リートとは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資家から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入などが投資家に分配される商品を行います。

##### ② 投資対象に新興国資産を加えることで、相対的に高いリターンを狙います。

- 高い経済成長が見込まれる新興国の資産を組み入れることで、先進国だけのポートフォリオよりも相対的に高いリターンが期待できます。

##### ③ 基本ポートフォリオの推定リスク水準は原則として日本株投資と同程度<sup>(※)</sup>としつつも、世界の複数資産へ高度な分散投資を行うことにより、効率の良い運用をめざします。

- 基本ポートフォリオのリスク水準を過去の日本株と同程度とし、期待リターンが最大となる資産配分比率を選択することで、分散効果を受けた効率的な運用をめざします。

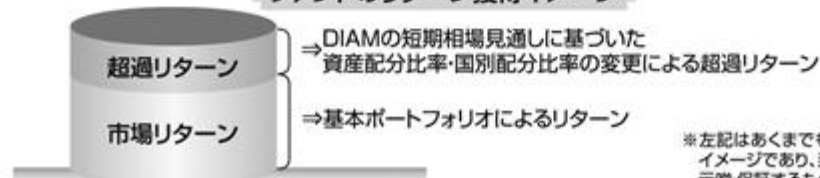
(※)過去30年間(1983年～2013年)の日経平均株価の標準偏差は概ね年率20%程度です。

日経平均株価(日経平均)は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、日経平均自体及び日経平均を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有します。本商品は、DIAMアセットマネジメント株式会社の責任のもとで組成・運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、本商品を保証するものではなく、本商品に関して一切の責任を負いません。

##### ④ 経験豊富な運用チームによるアクティブアセットアロケーション運用により、超過収益の獲得をめざします。

- DIAMが短期相場見通しに基づき機動的に配分比率の変更を行うことで、基本ポートフォリオのリターンに加えて超過リターンの獲得を狙います。
- 国別配分比率の変更にあたっては、先物取引を活用します。

##### ファンドのリターン獲得イメージ



※左記はあくまでもファンドのリターン獲得の構造イメージであり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

##### ⑤ 運用管理費用(信託報酬)は1.08%(税込)とし、購入時手数料はノーロードと低コストでご提供します。

※上記は過去の情報であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

※上記の内容は、DIAMアセットマネジメントが信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の完全性、正確性を保証するものではありません。

※上記の内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

## 投資プロセス ～ポートフォリオができるまで～

## ①イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言による基本ポートフォリオの決定 見直し頻度:原則として年1回

- 各資産のデータ分析をもとに、長期のリターン、リスク、相関の推計を行い、一定のリスク水準に対して期待リターンの最も高い資産配分比率を決定します。

- ※資産配分比率の決定にあたっては、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。
- ※基本ポートフォリオの国別配分比率は、各資産の代表的指数の国別配分比率を参考とします。なお、各資産の代表的指数は下記のとおりです。
- ※右記基本ポートフォリオはあくまでもイメージであり、実際のものとは異なります。

## 基本ポートフォリオ(例)



## 各5資産の定義

■先進国株式/MSCIワールド・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) ■先進国債券/シティグループ世界国債インデックス(円ベース、為替ヘッジなし) ■先進国リート/S&P 先進国 REITインデックス(円ベース、配当込み、為替ヘッジなし) ■新興国株式/MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) ■新興国債券/JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)

## ②DIAMによる資産配分比率・国別配分比率の変更 見直し頻度:短期の相場見通しに基づき随時

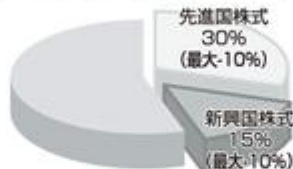
- 超過収益を獲得するために、相場環境の変化に対応し、基本ポートフォリオの資産配分比率・国別配分比率を機動的に変更します。
- オフバランス資産のポジションを考慮した実質組入比率は、原則として、純資産総額の範囲内で高位を維持します。

## 資産配分比率の変更(例)

## 株式に強気な見通しの場合



## 株式に弱気な見通しの場合



短期の相場見通しに基づき、資産配分比率を変更します。

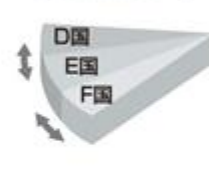
- ※資産配分比率の変更は、原則として基本ポートフォリオの比率から±10%の範囲で行います。ただし、当ファンドのリスクが一定水準を超えた場合には、先進国債券の比率を上記に関わらず、基本ポートフォリオの比率から+10%を超えて増加させることがあります。

## 国別配分比率の変更(例)

## 先進国株式



## 先進国債券



短期の相場見通しに基づき、先進国株式および先進国債券の国別配分比率を変更します。

- ※国別配分比率の変更は先進国株式、先進国債券を対象とします。
- ※国別配分比率の変更にあたっては先物取引を活用しますが、同一資産内の売り持ち、買い持ちのポジションは合計で0%を基本とします。

- ※上記の資産配分比率・国別比率は、あくまでもポートフォリオの決定までのプロセスを説明するためのものであり、実際のポートフォリオとは異なります。また、将来の運用成果を示唆・保証するものではありません。
- ※上記の内容は、DIAMアセットマネジメントが信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の完全性、正確性を保証するものではありません。
- ※上記の内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

## 分配方針

年1回の決算時(1月11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<br>追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(収益の源泉)    |
|----------------|--------|----------------------|
| 単位型投信          | 国内     | 株式<br>債券             |
| 追加型投信          | 海外     | 不動産投信                |
|                | 内外     | その他資産<br>( )<br>資産複合 |

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

## 単位型投信・追加型投信

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

## 投資対象地域

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

## 投資対象資産

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

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     |
|--|---------------------------------|--|------------------|-----------|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株  | 年1回<br><br>年2回<br><br>年4回       | グローバル<br>(日本を含む)<br><br>日本                       |                  |           |
| 債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>( )                      | 年6回<br>(隔月)<br><br>年12回<br>(毎月) | 北米<br><br>欧州<br><br>アジア<br><br>オセアニア             | ファミリー<br>ファンド    | あり<br>( ) |
| 不動産投信<br><br>その他資産<br>(投資信託証券<br>(資産複合(株式、<br>債券、不動産投信)<br>資産配分変更型)) | 日々<br><br>その他<br>( )            | 中南米<br><br>アフリカ<br><br>中近東<br>(中東)<br><br>エマージング | ファンド・オ<br>ブ・ファンズ | なし        |
| 資産複合<br>( )<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型                                    |                                 |  |                  |           |

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。



## 属性区分定義

### 投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型）」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

（注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。

### 決算頻度

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

### 投資対象地域

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

### 投資形態

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

### 為替ヘッジ

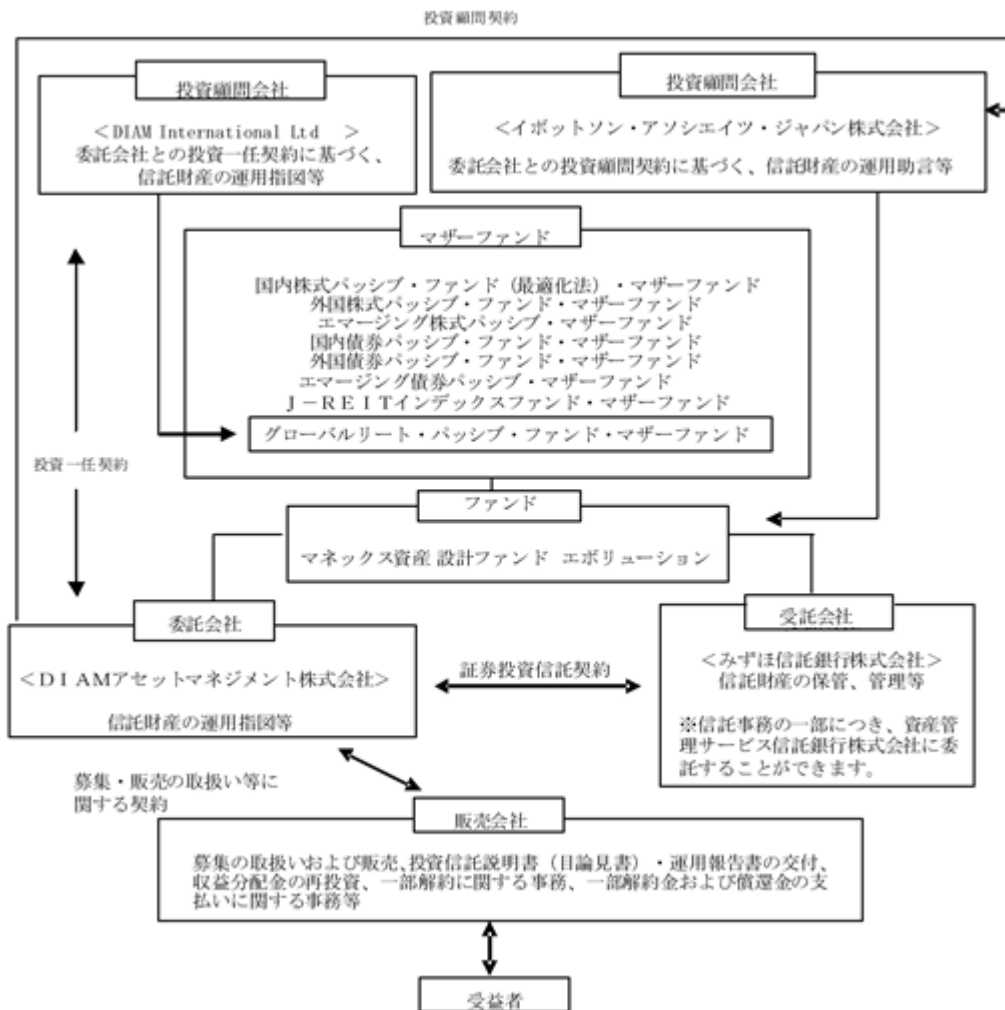
「なし」とは目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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22年5月28日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】



## ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

## ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

## ・「投資顧問契約」の概要

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

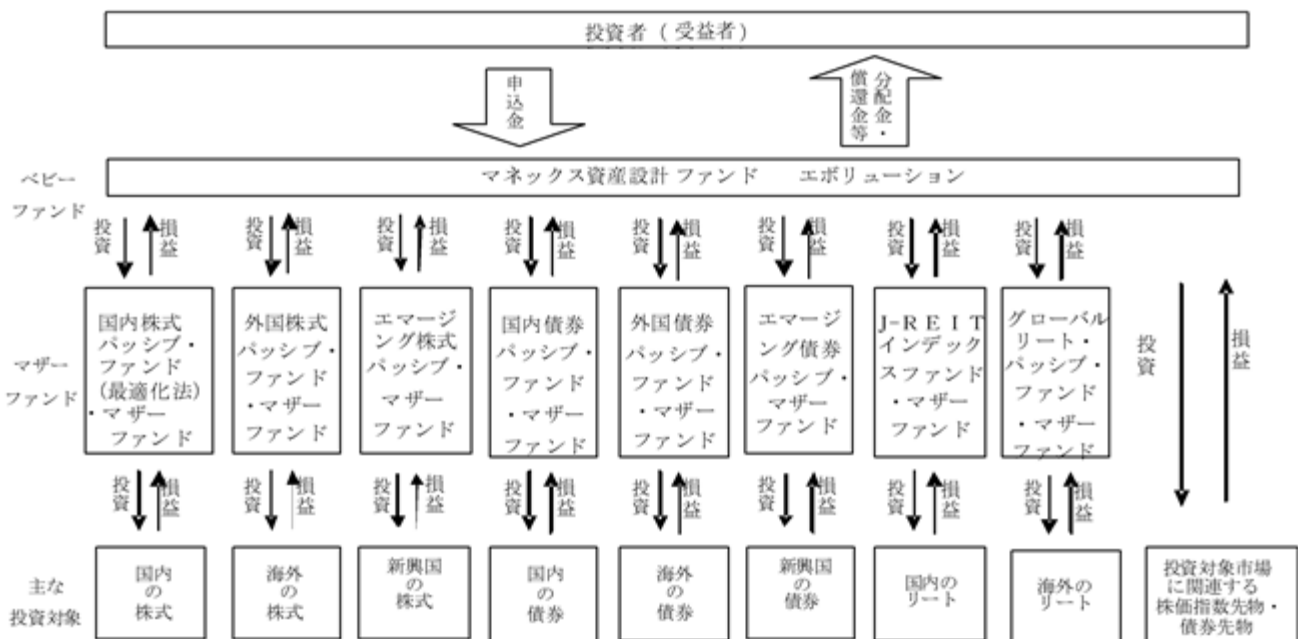
## ・「投資一任契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（DIAM International Ltd）との間においては、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託する契約を締結しております。当該契約の内容は、運用指図の権限委任、投資一任契約に基づく業務の内容、運用の責任等について規定したものであります。

### ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



## 委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

### 資本金の額

20億円（平成26年1月31日現在）

### 委託会社の沿革

昭和60年 7月 1日

会社設立

平成10年 3月31日

「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

平成10年12月 1日

証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月 1日

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

平成20年 1月 1日

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

## 大株主の状況

(平成26年1月31日現在)

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## &lt;基本方針&gt;

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。

## &lt;投資対象&gt;

主として、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、エマージング株式パッシブ・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、エマージング債券パッシブ・マザーファンド受益証券、J-REITインデックスファンド・マザーファンド受益証券およびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券（以下それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）、投資対象市場に関連する株価指数先物および債券先物を主要投資対象とします。

## &lt;投資態度&gt;

当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券、投資対象市場に関連する株価指数先物および債券先物に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざします。

原則として、各資産の長期のヒストリカルデータの分析により、一定のリスク水準において期待リターンが最大となる資産配分比率を基本ポートフォリオとします。

基本ポートフォリオの資産配分比率の決定にあたっては、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき決定し、原則として、年1回見直しを行います。

原則として、基本ポートフォリオの構築にあたっては、8つのパッシブマザーファンド受益証券への投資を通じて行います。

短期的なマクロ分析・市場分析等に基づいて、実際のポートフォリオの資産比率および国別比率を一定の範囲内で基本配分比率から乖離させることにより、超過収益の獲得をめざします。

なお、当該配分変更は、月次の定時リバランスに加えて、相場環境の変化に応じ機動的に実施します。

## ) 資産配分比率の変更

- ・ 先進国株式、新興国株式、先進国債券、新興国債券、先進国リートの5資産クラスに対して相対魅力度を判定し、オーバーウェイト/アンダーウェイトの調整を実施します。
- ・ 配分比率の変更は、原則としてマザーファンド受益証券の売買で調整します。
- ・ 基本配分比率との乖離幅は±10%とします。

- ・ 上記に関わらず、当ファンドのボラティリティが一定水準を超えた場合には、相場急変時と判断し、先進国債券への比率を増加させることがあります。この場合、基本配分比率との乖離幅は以下の通りとします。

先進国債券以外の資産クラス：±10%

先進国債券：制限は設けません

#### ）国別配分比率の変更

- ・ 先進国株式、先進国債券を対象に各構成国別の相対魅力度を判定し、オーバーウェイト/アンダーウェイトの調整を実施します。
- ・ 配分比率の変更は、原則として各国の株価指数先物および債券先物の買い持ち/売り持ちのポジションを構築することで調整します。
- ・ 同一資産クラス内における先物の買い持ち/売り持ちのポジションは合計で0%を基本とします。また、各構成国においてオンバランス資産以上のショートポジションは構築しません。

オフバランス資産のポジションを考慮した実質組入比率は、原則として、純資産総額の範囲内で高位を維持します。

原則として、外貨建資産の為替ヘッジは行いません。また、株価指数先物または債券先物のポジションを構築した場合において、想定元本部分にかかる為替リスクの調整は行いません。

ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

- b. 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16条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてD I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券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。なお、社債券のうちで、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、ならびに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総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
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. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関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。）
9. 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。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.から11.の証券または証書の性質を有するもの
13. 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。）
14. 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。）
15. 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。）
16. 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。）
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。）
20. 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。）
21. 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
22. 外国の者に対する権利で上記21.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、12.および17.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6.までの証券および12.ならびに17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

### 3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

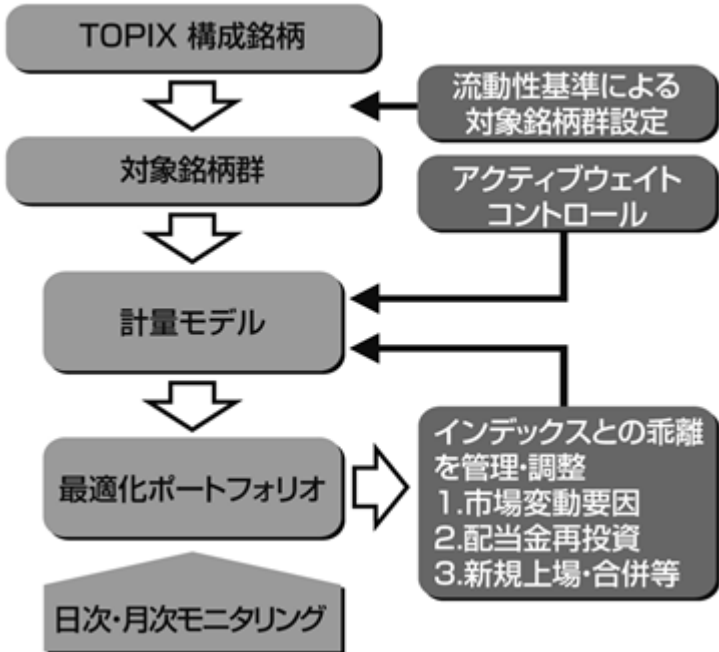
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

#### （参考）当ファンドが投資するマザーファンドの概要

|        |   |
|--------|---|
| ファンド名  | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド   |
| 基本方針   | この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。  |

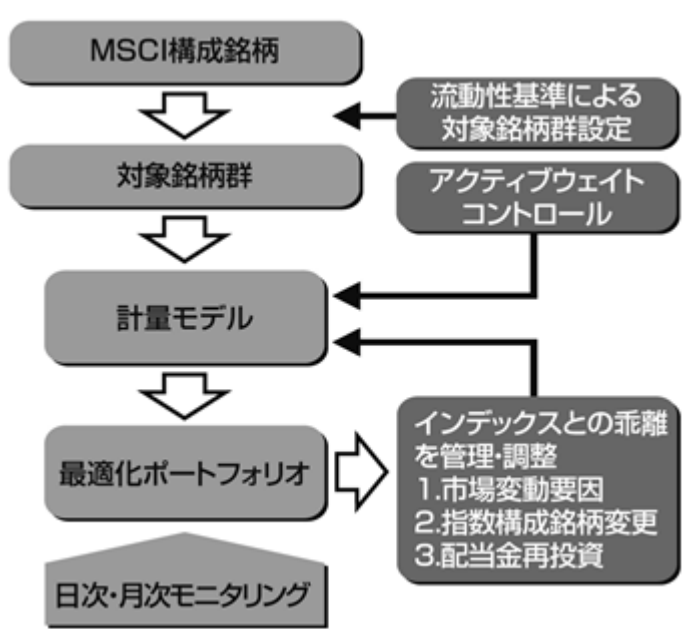
|      |   |
|------|---|
| 投資態度 | <ol style="list-style-type: none"><li>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li><li>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li><li>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li></ol> <p>TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>㈱東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p> |
|------|---|



|        |   |
|--------|---|
| 運用プロセス | <p>1.流動性基準による対象銘柄群設定<br/>マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br/>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理<br/>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。<br/>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>  |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>   |

|        |   |
|--------|---|
| ファンド名  | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド                   |
| 基本方針   | この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 海外の株式を主要投資対象とします。                       |

|      |   |
|------|---|
| 投資態度 | <p>1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <p>MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> |
|------|---|

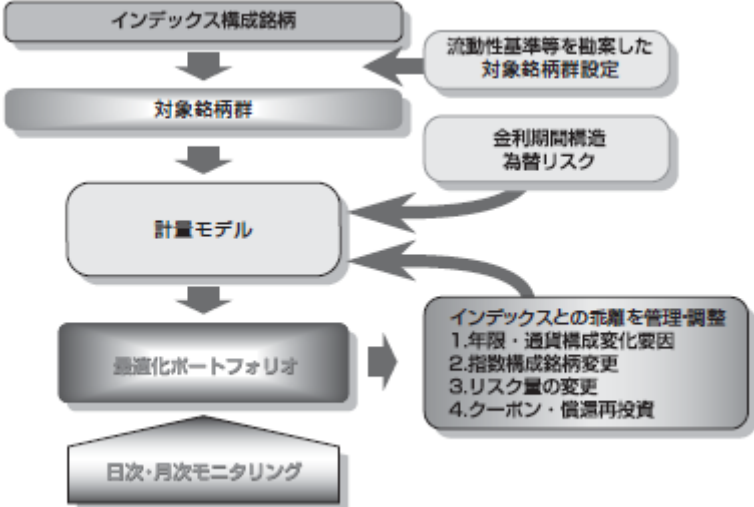
|        |  |
|--------|--|
| 運用プロセス | <p>1.流動性基準による対象銘柄群設定<br/>取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br/>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理<br/>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。<br/>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>  |
| 主な投資制限 | <p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>3.同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>  |

|        |  |
|--------|--|
| ファンド名  | エマージング株式パッシブ・マザーファンド   |
| 基本方針   | この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式 <sup>(*)</sup> に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。<br>(*)DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。  |
| 主な投資対象 | 海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。  |
| 投資態度   | <p>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> |
|        | <p>MSCIEマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p>                               |
| 主な投資制限 | <p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>   |

|        |  |
|--------|--|
| ファンド名  | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  |
| 基本方針   | この投資信託は、NOMURA - B P I総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。  |
| 主な投資対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。  |
| 投資態度   | <p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> |
|        | <p>NOMURA - B P I総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</p>                                      |

|        |   |
|--------|---|
| 運用プロセス | <p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定<br/>NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br/>債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因<br/>金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因、<br/>が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理<br/>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。<br/>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。<br/>・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更<br/>・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p> |
| 主な投資制限 | <p>1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3.同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>5.外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p>   |

|        |   |
|--------|---|
| ファンド名  | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド                   |
| 基本方針   | この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 海外の公社債を主要投資対象とします。                      |

|        |   |
|--------|---|
| 投資態度   | <p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <p>シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。</p> <p>シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。</p>  |
| 運用プロセス | <p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定<br/>シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br/>金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理<br/>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。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限・通貨構成変化要因</li> <li>・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更</li> <li>・クーポン・償還再投資</li> </ul>  |

|        |  |
|--------|--|
| 主な投資制限 | <p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> |
|--------|--|

|        |   |
|--------|---|
| ファンド名  | エマージング債券パッシブ・マザーファンド  |
| 基本方針   | この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。   |
| 主な投資対象 | 新興国の公社債を主要投資対象とします。   |
| 投資態度   | <p>1. 主として新興国の債券に投資し、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3. 組入債券は、当初組入時において、S &amp; PもしくはM o o d y ' s の外貨建て長期格付がB B - 格もしくはB a 3 格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> |
|        | J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス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。   |
| 主な投資制限 | <p>1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>  |

|        |   |
|--------|---|
| ファンド名  | J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド   |
| 基本方針   | この投資信託は、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。   |
| 主な投資対象 | 東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。 |

## 投資態度

1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

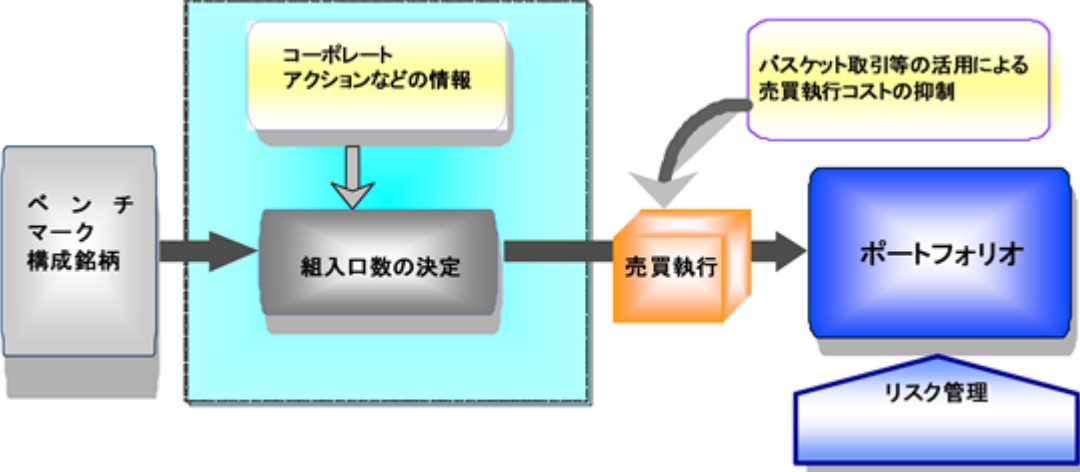
当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。



|                    |   |
|--------------------|---|
| <p>運用<br/>プロセス</p> | <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</li> <li>・ 新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・ 配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</li> </ul>   |
| <p>主な<br/>投資制限</p> | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>2. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</li> <li>3. 株式への投資は行いません。</li> <li>4. 外貨建資産への投資は行いません。</li> </ol> |

|               |   |
|---------------|---|
| <p>ファンド名</p>  | <p>グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>   |
| <p>基本方針</p>   | <p>この投資信託は、S &amp; P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> |
| <p>主な投資対象</p> | <p>日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。）を主要投資対象とします。</p>   |

## 投資態度

- 1.日本を除く世界各国の証券取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)<sup>(注)</sup>に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2.運用指図に関する権限は、DIAM International Ltdに委託します。
- 3.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4.外貨建資産については原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを実施する場合があります。

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

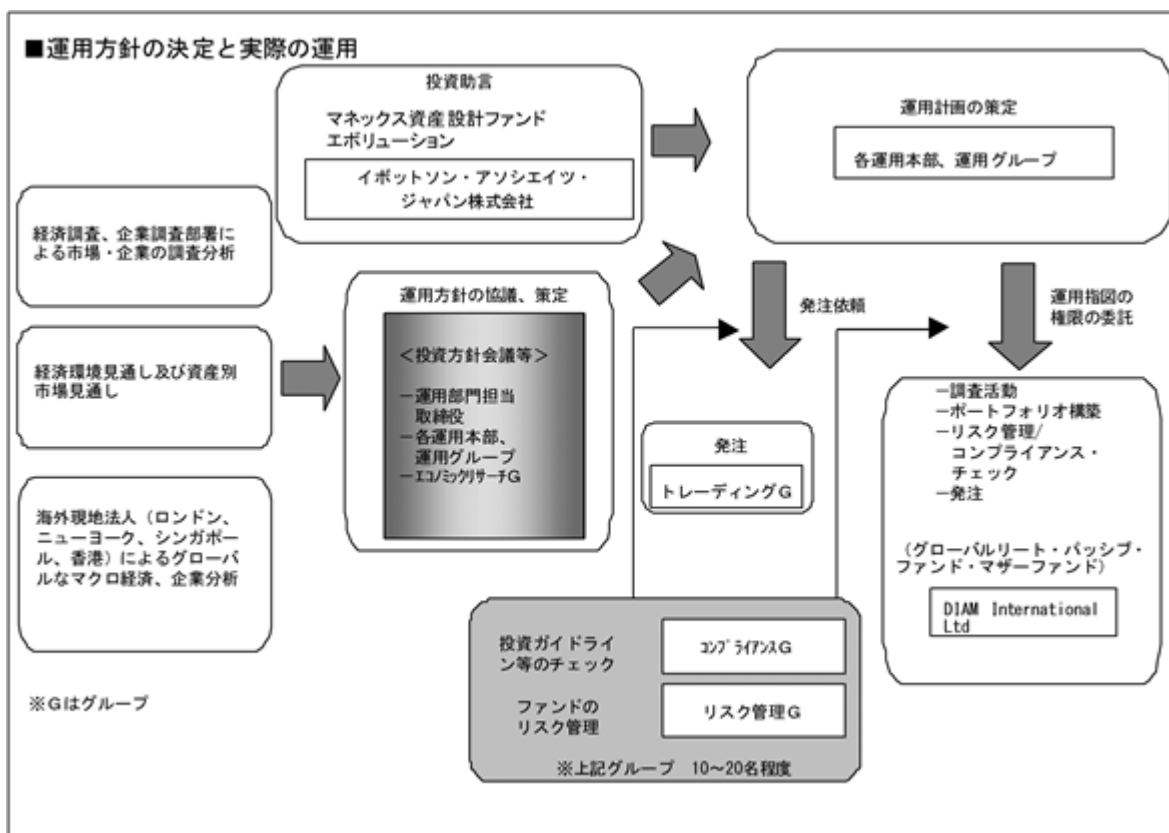
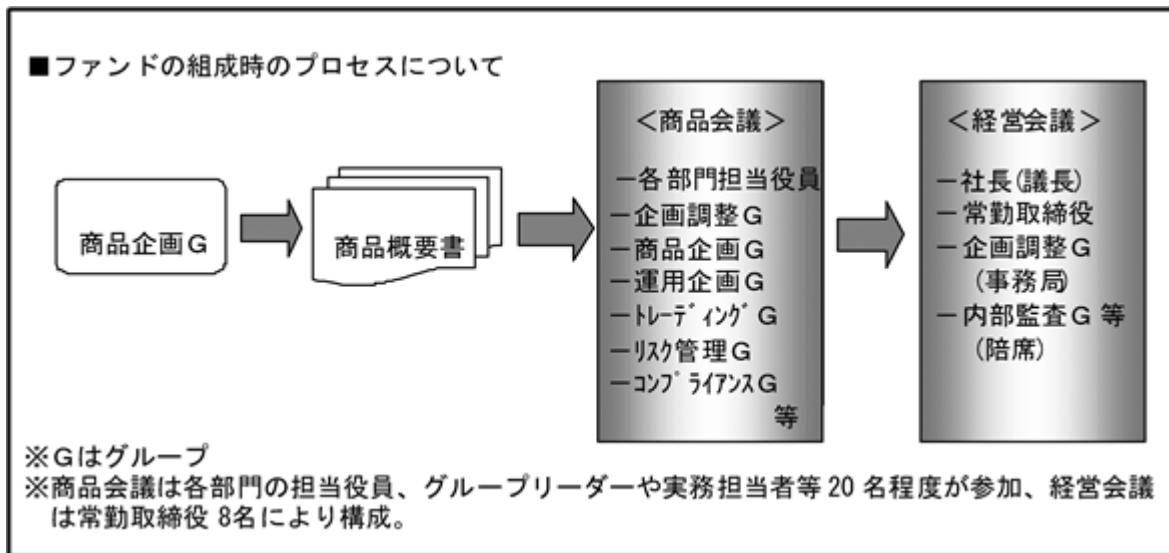
S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくはDIAMアセットマネジメント株式会社が得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害(利益の損失、トレーディング損失、損失時間、のれんを含む)について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダ

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>ウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&amp;Pダウ・ジョーンズ・インデックスとDIAMアセットマネジメント株式会社間での合意及び協定において、S&amp;Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。</p>  |
| 運用プロセス | <p>1.流動性基準によるユニバース設定<br/>取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、S &amp; P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資ユニバースを設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築<br/>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、最適化ツールを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.リバランス<br/>日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。<br/>リバランス要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの</li> <li>・大きなキャッシュフローに伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul> |
| 主な投資制限 | <p>1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>2.株式への投資は行いません。</p> <p>3.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>  |

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## ( 3 ) 【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

## &lt;ファンドの組成時のプロセスについて&gt;

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

#### <運用方針の決定と実際の運用>

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

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等に加え、投資助言先から得られた情報も参考にされます。個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループまたは、運用指図権限を委託した外部投資顧問会社で執行されます。なお、ファンドの運用等ガイドラインチェックについては、コンプライアンスグループにて行われます。ファンドのリスク管理や分析については、リスク管理グループにて行われます。

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

・DIAM International Ltdの運用体制

|        |   |
|--------|---|
| 運用体制   | <ul style="list-style-type: none"> <li>・DIAM International Ltdでは、資産クラス別運用体制ではなく、マルチプラットフォーム体制を採用しており、全ての運用担当者は3つまたは4つのプラットフォームに所属しております。</li> <li>・マクロ分析・市場分析・企業分析プラットフォームにおいては、株式や債券などの特定の資産クラスのみならず、幅広い資産クラスに関連する様々なレベルの分析が行われております。</li> </ul>   |
| 運用プロセス | <p>情報収集・分析</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・マルチプラットフォーム体制のもと、DIAM International Ltd内の他の運用担当者との情報交換や議論を通じ、投資対象国・地域のマクロ経済環境や対象資産に関する情報収集や分析を行います。</li> </ul> <p>運用方針・戦略の決定</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・月次の各種テーマ別運用方針会議におけるマクロ経済環境や金融市場環境などに関する議論を踏まえ、当該ファンドの運用目標・ガイドラインに沿った運用方針・戦略を策定します。</li> </ul> <p>ポートフォリオの構築</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・策定した運用方針・戦略に基づき、運用担当者がポートフォリオを構築します。運用対象となる銘柄の執行については基本的にはそれぞれの運用担当者が自ら行います。</li> <li>・運用担当者は使用するポートフォリオ・マネジメント・システムでポートフォリオのリスク量やその変化をリアルタイムで把握することができる体制となっています。</li> </ul> <p>運用モニタリング</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・運用ガイドラインチェックは運用部門からは独立したコンプライアンスチームによってシステムを用いて日次で行われています。</li> <li>・同じく運用部門から独立したリスク管理チームが各ファンドのパフォーマンス評価や各種リスクのモニタリングを行っており、週次で開催されるモニタリング会議で報告されています。</li> </ul> |

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

なお、マネックス資産設計ファンド エボリューションは、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の運用助言を受けます。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（1月11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益（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. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1) 信託財産に属する配当等収益（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、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、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、税引後自動的に全額無手数料で再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### （5）【投資制限】

マザーファンド受益証券への投資制限（約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限）

各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。

株式への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。



### 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（約款第16条第3項）

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

### マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合（約款第16条第5項）

委託会社は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。以下本項において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

### 投資する株式等の範囲（約款第19条）

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2) 1)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

### 同一銘柄の株式への実質投資割合（約款第20条第1項）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

### 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合（約款第20条第3項）

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

### 信用取引の指図範囲（約款第21条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引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ます。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.から6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.から6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売り出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権付社債券の新株予約権(前号に定めるものに限ります。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図（約款第22条）

- 1) 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。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
- 2) 委託会社は、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、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品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。
- 3) 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、わが国の金融商品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金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図（約款第23条）

- 1) 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。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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）

- 1) 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。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

### 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付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。
- 2) 上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第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。

### 外国為替予約の指図（約款第27条）

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を指図することができます。

### 資金の借入れ（約款第33条）

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

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

#### 資産配分リスク

当ファンドに組入れられている各資産（国内株式、外国株式、国内債券、外国債券、国内リートおよび外国リート）の資産配分比率によっては、収益率の悪い資産への配分が大きくなり、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。また、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### 株価変動リスク

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、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。また、新興国の株式に投資する場合、先進国の株式に比べ株価変動リスクが大きくなる傾向があります。

#### 金利リスク

金利リスクとは、金利の変動を受けて債券・リートの価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券・リートの価格は下落します。当ファンドは実質的に債券・リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。新興国の債券に投資する場合、先進国の債券に比べ金利リスクが大きくなる傾向があります。

#### リートの価格変動リスク

一般にリートが投資対象とする不動産の価値および当該不動産から得る収入は、国内外の景気、経済、社会情勢等の変化等により変動し、リートの価格および配当は影響を受けることになり、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

実質的に投資対象とするリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には基準価額が下がる要因となります。

リートは、実物資産である建物等を投資対象にしているため、火災、自然災害等に伴う損害を受けた場合は、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

リートが投資対象とする建物の用途規制等不動産等にかかる規制の強化や、新たな規制の導入、税制の変更などにより、規制対象となる不動産等の価値が低下する可能性があります、その結果当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### 為替リスク

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。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対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。新興国の通貨に投資する場合、先進国の通貨に比べ為替リスクが大きくなる傾向があります。

#### 信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。新興国債券、株式に投資する場合、先進国債券、株式に比べ信用リスクが大きくなる傾向があります。

#### 流動性リスク

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

#### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合、または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する場合があります。また、実質的に投資を行う新興国の通貨や有価証券等の発行者が属する国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化などが為替市場や株式、債券市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制などの種々な規制の導入や政策の変更等の要因も為替市場や株式、債券市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

#### 有価証券（指数）先物取引に伴うリスク

当ファンドは、有価証券（指数）先物取引を使用するため、有価証券（指数）先物取引の価格変動により基準価額が上下します。先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下

落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。また、有価証券（指数）先物取引の値動きと市場全体の値動きは一致しない場合があります。

#### < 分配金に関する留意点 >

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

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

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

#### < その他の留意点 >

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

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

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

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

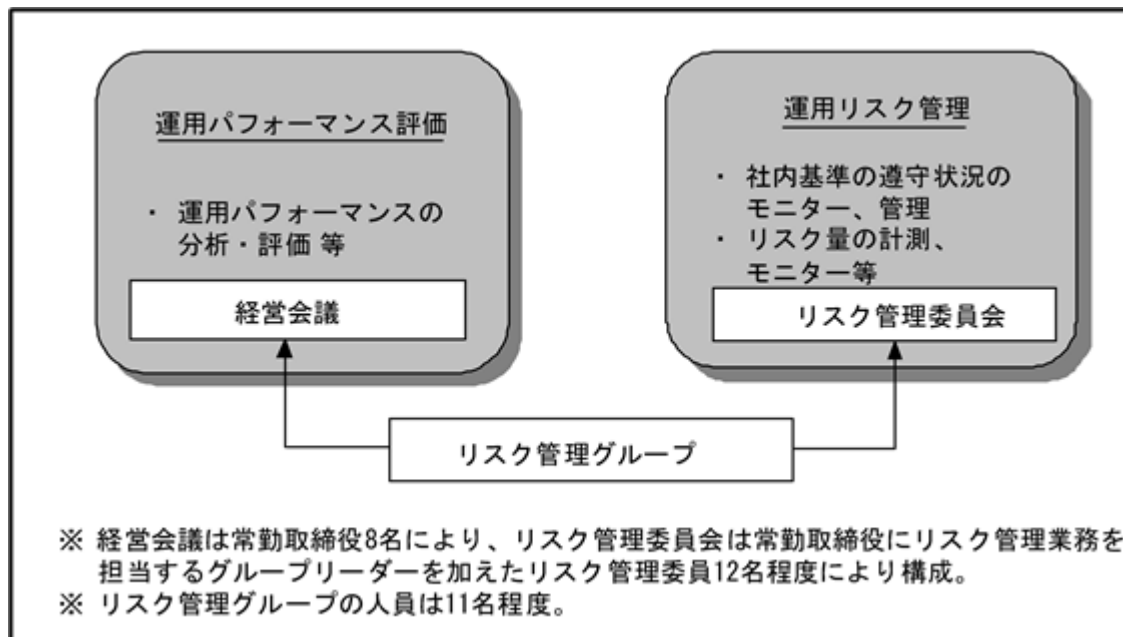
当ファンドは、受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利であると認める場合、またはやむを得ない事情が発生した場合、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

#### 注意事項

- ・当ファンドは、実質的に株式、債券、不動産投資信託証券など値動きのある有価証券および値動きのある有価証券（指数）先物（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

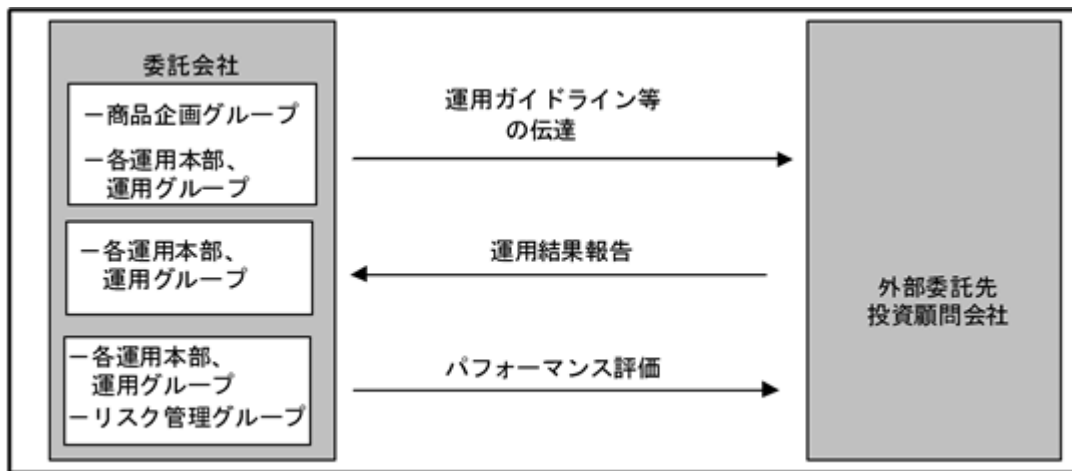
<運用評価・運用リスク管理体制>



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

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

## &lt; 外部委託先に関する管理体制 &gt;



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

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.08%（税抜1.00%）

信託報酬の配分は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。

| 信託報酬の配分（税抜）      |         |         |         |
|------------------|---------|---------|---------|
| 各販売会社の取扱純資産額     | 委託会社    | 販売会社    | 受託会社    |
| 100億円以下の部分       | 年率0.58% | 年率0.35% | 年率0.07% |
| 100億円超300億円以下の部分 | 年率0.55% | 年率0.38% | 年率0.07% |
| 300億円超の部分        | 年率0.52% | 年率0.41% | 年率0.07% |

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。



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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### （４）【その他の手数料等】

##### 1. 信託財産留保額

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

##### 2. その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、受益者の負担とし、計算期間を通じて毎日計算し、毎年7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用に係る消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

### 個人の受益者に対する課税

#### 収益分配時

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

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

#### 換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 損益通算について

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成26年1月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

<個別元本について>

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

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

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

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

#### <収益分配金の課税について>

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成26年1月31日現在

| 資産の種類                 | 時価合計（円）     | 投資比率（％） |
|-----------------------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 753,316,688 | 98.33   |
| 内 日本                  | 753,316,688 | 98.33   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 12,818,030  | 1.67    |
| 純資産総額                 | 766,134,718 | 100.00  |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

（参考）

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

## その他資産の投資状況

平成26年1月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 資産の種類                 | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券                  | 356,477,373,400 | 79.58   |
| 内 日本                  | 356,477,373,400 | 79.58   |
| 地方債証券                 | 29,455,263,509  | 6.58    |
| 内 日本                  | 29,455,263,509  | 6.58    |
| 特殊債券                  | 30,536,881,322  | 6.82    |
| 内 日本                  | 30,536,881,322  | 6.82    |
| 社債券                   | 28,314,501,320  | 6.32    |
| 内 日本                  | 28,314,501,320  | 6.32    |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 3,176,603,303   | 0.71    |
| 純資産総額                 | 447,960,622,854 | 100.00  |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

#### J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 資産の種類                 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資証券                  | 28,099,868,120 | 99.06   |
| 内 日本                  | 28,099,868,120 | 99.06   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 267,376,951    | 0.94    |
| 純資産総額                 | 28,367,245,071 | 100.00  |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

## その他資産の投資状況

平成26年1月31日現在

| 資産の種類        | 時価合計（円）       | 投資比率（％） |
|--------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（買建）   | 5,283,955,000 | 1.72    |
| 内 日本         | 5,283,955,000 | 1.72    |
| 株価指数先物取引（買建） | 9,409,453,259 | 3.07    |
| 内 アメリカ       | 5,771,248,308 | 1.88    |
| 内 ユーロ        | 1,912,467,009 | 0.62    |
| 内 イギリス       | 935,607,036   | 0.31    |
| 内 カナダ        | 405,370,492   | 0.13    |
| 内 オーストラリア    | 384,760,414   | 0.13    |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

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

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

## その他資産の投資状況

平成26年1月31日現在

| 資産の種類      | 時価合計（円）     | 投資比率（％） |
|------------|-------------|---------|
| 為替予約取引（買建） | 214,424,190 | 0.06    |
| 内 日本       | 214,424,190 | 0.06    |
| 為替予約取引（売建） | 69,835,150  | 0.02    |
| 内 日本       | 69,835,150  | 0.02    |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

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

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 資産の種類                 | 時価合計（円）       | 投資比率（％） |
|-----------------------|---------------|---------|
| 投資信託受益証券              | 381,205,622   | 12.49   |
| 内 オーストラリア             | 276,371,480   | 9.06    |
| 内 シンガポール              | 104,834,142   | 3.44    |
| 投資証券                  | 2,631,723,995 | 86.26   |
| 内 アメリカ                | 2,048,564,172 | 67.14   |
| 内 ユーロ                 | 216,423,977   | 7.09    |
| 内 イギリス                | 214,365,904   | 7.03    |
| 内 カナダ                 | 80,312,182    | 2.63    |
| 内 香港                  | 61,437,041    | 2.01    |
| 内 ニュージーランド            | 10,620,719    | 0.35    |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 38,051,291    | 1.25    |
| 純資産総額                 | 3,050,980,908 | 100.00  |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 資産の種類                 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 株式                    | 34,724,119,959 | 94.40   |
| 内 香港                  | 6,952,695,862  | 18.90   |
| 内 韓国                  | 5,659,682,207  | 15.39   |
| 内 台湾                  | 4,241,934,921  | 11.53   |
| 内 ブラジル                | 3,575,237,110  | 9.72    |
| 内 アメリカ                | 3,414,128,713  | 9.28    |
| 内 南アフリカ               | 2,494,253,487  | 6.78    |
| 内 インド                 | 2,047,764,241  | 5.57    |
| 内 メキシコ                | 1,538,388,275  | 4.18    |
| 内 マレーシア               | 1,385,595,202  | 3.77    |
| 内 インドネシア              | 867,044,827    | 2.36    |
| 内 タイ                  | 784,290,365    | 2.13    |
| 内 ポーランド               | 603,419,445    | 1.64    |
| 内 トルコ                 | 476,652,890    | 1.30    |
| 内 フィリピン               | 330,404,742    | 0.90    |
| 内 ユーロ                 | 172,807,577    | 0.47    |
| 内 ハンガリー               | 92,069,241     | 0.25    |
| 内 チェコ                 | 87,750,854     | 0.24    |
| 投資信託受益証券              | 322,146,169    | 0.88    |
| 内 メキシコ                | 322,146,169    | 0.88    |
| 投資証券                  | 69,523,817     | 0.19    |
| 内 メキシコ                | 48,146,505     | 0.13    |
| 内 トルコ                 | 21,377,312     | 0.06    |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,668,234,747  | 4.54    |
| 純資産総額                 | 36,784,024,692 | 100.00  |

## その他資産の投資状況

平成26年1月31日現在

| 資産の種類        | 時価合計（円）       | 投資比率（％） |
|--------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（買建）   | 663,382,500   | 1.80    |
| 内 日本         | 663,382,500   | 1.80    |
| 株価指数先物取引（買建） | 1,653,026,030 | 4.49    |
| 内 アメリカ       | 1,653,026,030 | 4.49    |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

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

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



## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 資産の種類                 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 国債証券                  | 33,795,532,621 | 96.66   |
| 内 アメリカ                | 33,795,532,621 | 96.66   |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,168,726,927  | 3.34    |
| 純資産総額                 | 34,964,259,548 | 100.00  |

## その他資産の投資状況

平成26年1月31日現在

| 資産の種類      | 時価合計（円）    | 投資比率（％） |
|------------|------------|---------|
| 為替予約取引（買建） | 82,280,000 | 0.24    |
| 内 日本       | 82,280,000 | 0.24    |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価及び投資比率は、当該資産の通貨で区分けした地域別の内訳です。

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成26年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>地域                                 | 種類            | 数量          | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)   | 評価単価<br>評価金額<br>(円)   | 利率(%)<br>償還日 | 投資<br>比率 |
|----|---|---------------|-------------|-----------------------|-----------------------|--------------|----------|
| 1  | 外国株式パッシブ・ファン<br>ド・マザーファンド<br>日本           | 親投資信託<br>受益証券 | 172,650,870 | 2.2809<br>393,800,909 | 2.2265<br>384,407,162 | -<br>-       | 50.17%   |
| 2  | エマージング株式パッシ<br>ブ・マザーファンド<br>日本            | 親投資信託<br>受益証券 | 252,136,010 | 0.9020<br>227,447,149 | 0.8621<br>217,366,454 | -<br>-       | 28.37%   |
| 3  | エマージング債券パッシ<br>ブ・マザーファンド<br>日本            | 親投資信託<br>受益証券 | 34,588,140  | 1.4161<br>48,982,229  | 1.4026<br>48,513,325  | -<br>-       | 6.33%    |
| 4  | グローバルリート・パッシ<br>ブ・ファンド・マザーファ<br>ンド<br>日本  | 親投資信託<br>受益証券 | 39,146,404  | 1.2155<br>47,582,935  | 1.2170<br>47,641,173  | -<br>-       | 6.22%    |
| 5  | 国内株式パッシブ・ファン<br>ド（最適化法）・マザー<br>ファンド<br>日本 | 親投資信託<br>受益証券 | 20,684,103  | 1.7638<br>36,483,751  | 1.6991<br>35,144,359  | -<br>-       | 4.59%    |
| 6  | 外国債券パッシブ・ファン<br>ド・マザーファンド<br>日本           | 親投資信託<br>受益証券 | 8,202,426   | 1.6352<br>13,413,120  | 1.6307<br>13,375,696  | -<br>-       | 1.75%    |
| 7  | 国内債券パッシブ・ファン<br>ド・マザーファンド<br>日本           | 親投資信託<br>受益証券 | 3,576,164   | 1.1894<br>4,253,847   | 1.1921<br>4,263,145   | -<br>-       | 0.56%    |
| 8  | J-REITインデックス<br>ファンド・マザーファンド<br>日本        | 親投資信託<br>受益証券 | 1,939,677   | 1.3222<br>2,564,689   | 1.3432<br>2,605,374   | -<br>-       | 0.34%    |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

| 種類        | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 98.33% |
| 合計        | 98.33% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

| 種類 | 投資比率   |
|----|--------|
| 株式 | 97.90% |
| 合計 | 97.90% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成26年1月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>地域              | 種類   | 数量            | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)     | 評価単価<br>評価金額<br>(円)     | 利率(%)<br>償還日           | 投資<br>比率 |
|----|------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1  | 329回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 5,500,000,000 | 100.96<br>5,553,060,000 | 102.00<br>5,610,000,000 | 0.800000<br>2023/6/20  | 1.25%    |
| 2  | 97回 利付国庫債券(5年)<br>日本   | 国債証券 | 5,000,000,000 | 100.99<br>5,049,930,000 | 100.72<br>5,036,100,000 | 0.400000<br>2016/6/20  | 1.12%    |
| 3  | 328回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 5,000,000,000 | 98.42<br>4,921,365,000  | 100.34<br>5,017,350,000 | 0.600000<br>2023/3/20  | 1.12%    |
| 4  | 106回 利付国庫債券(5年)<br>日本  | 国債証券 | 5,000,000,000 | 100.29<br>5,014,680,000 | 100.21<br>5,010,800,000 | 0.200000<br>2017/9/20  | 1.12%    |
| 5  | 306回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,600,000,000 | 106.70<br>4,908,290,000 | 106.96<br>4,920,344,000 | 1.400000<br>2020/3/20  | 1.10%    |
| 6  | 330回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,700,000,000 | 101.67<br>4,778,539,000 | 101.86<br>4,787,702,000 | 0.800000<br>2023/9/20  | 1.07%    |
| 7  | 321回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,500,000,000 | 102.69<br>4,621,170,000 | 104.14<br>4,686,525,000 | 1.000000<br>2022/3/20  | 1.05%    |
| 8  | 103回 利付国庫債券(5年)<br>日本  | 国債証券 | 4,500,000,000 | 100.61<br>4,527,875,000 | 100.57<br>4,525,875,000 | 0.300000<br>2017/3/20  | 1.01%    |
| 9  | 105回 利付国庫債券(5年)<br>日本  | 国債証券 | 4,500,000,000 | 100.32<br>4,514,535,000 | 100.23<br>4,510,575,000 | 0.200000<br>2017/6/20  | 1.01%    |
| 10 | 293回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,200,000,000 | 108.42<br>4,553,894,000 | 107.07<br>4,497,108,000 | 1.800000<br>2018/6/20  | 1.00%    |
| 11 | 89回 利付国庫債券(5年)<br>日本   | 国債証券 | 4,300,000,000 | 100.82<br>4,335,561,000 | 100.43<br>4,318,834,000 | 0.400000<br>2015/6/20  | 0.96%    |
| 12 | 296回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 107.01<br>4,280,695,000 | 106.07<br>4,243,120,000 | 1.500000<br>2018/9/20  | 0.95%    |
| 13 | 297回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 106.45<br>4,258,300,000 | 105.84<br>4,233,720,000 | 1.400000<br>2018/12/20 | 0.95%    |
| 14 | 289回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 3,900,000,000 | 106.53<br>4,154,748,000 | 105.21<br>4,103,541,000 | 1.500000<br>2017/12/20 | 0.92%    |
| 15 | 325回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 100.49<br>4,019,680,000 | 102.35<br>4,094,120,000 | 0.800000<br>2022/9/20  | 0.91%    |
| 16 | 326回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 100.74<br>4,029,860,000 | 101.39<br>4,055,880,000 | 0.700000<br>2022/12/20 | 0.91%    |
| 17 | 313回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 3,800,000,000 | 105.84<br>4,021,992,000 | 106.48<br>4,046,582,000 | 1.300000<br>2021/3/20  | 0.90%    |
| 18 | 114回 利付国庫債券(5年)<br>日本  | 国債証券 | 4,000,000,000 | 100.54<br>4,021,750,000 | 100.52<br>4,021,080,000 | 0.300000<br>2018/9/20  | 0.90%    |
| 19 | 92回 利付国庫債券(5年)<br>日本   | 国債証券 | 4,000,000,000 | 100.65<br>4,026,320,000 | 100.35<br>4,014,240,000 | 0.300000<br>2015/9/20  | 0.90%    |
| 20 | 305回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 3,600,000,000 | 105.78<br>3,808,254,000 | 106.23<br>3,824,352,000 | 1.300000<br>2019/12/20 | 0.85%    |
| 21 | 315回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 104.92<br>3,672,480,000 | 105.76<br>3,701,810,000 | 1.200000<br>2021/6/20  | 0.83%    |
| 22 | 301回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 3,400,000,000 | 107.33<br>3,649,418,000 | 106.93<br>3,635,892,000 | 1.500000<br>2019/6/20  | 0.81%    |
| 23 | 282回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 3,400,000,000 | 105.79<br>3,596,962,000 | 104.18<br>3,542,392,000 | 1.700000<br>2016/9/20  | 0.79%    |

|    |                        |      |               |                         |                         |                        |       |
|----|------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|-------|
| 24 | 93回 利付国庫債券(5年)<br>日本   | 国債証券 | 3,500,000,000 | 101.28<br>3,545,080,000 | 100.78<br>3,527,475,000 | 0.500000<br>2015/12/20 | 0.79% |
| 25 | 113回 利付国庫債券(5年)<br>日本  | 国債証券 | 3,500,000,000 | 100.26<br>3,509,380,000 | 100.54<br>3,518,970,000 | 0.300000<br>2018/6/20  | 0.79% |
| 26 | 88回 利付国庫債券(5年)<br>日本   | 国債証券 | 3,500,000,000 | 100.94<br>3,533,110,000 | 100.47<br>3,516,450,000 | 0.500000<br>2015/3/20  | 0.78% |
| 27 | 107回 利付国庫債券(5年)<br>日本  | 国債証券 | 3,500,000,000 | 100.30<br>3,510,830,000 | 100.19<br>3,506,720,000 | 0.200000<br>2017/12/20 | 0.78% |
| 28 | 326回 利付国庫債券(2年)<br>日本  | 国債証券 | 3,500,000,000 | 100.04<br>3,501,580,000 | 100.02<br>3,500,770,000 | 0.100000<br>2015/3/15  | 0.78% |
| 29 | 285回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 3,300,000,000 | 106.48<br>3,513,939,000 | 104.94<br>3,463,152,000 | 1.700000<br>2017/3/20  | 0.77% |
| 30 | 310回 利付国庫債券(10年)<br>日本 | 国債証券 | 3,300,000,000 | 103.76<br>3,424,344,000 | 104.54<br>3,450,018,000 | 1.000000<br>2020/9/20  | 0.77% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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



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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

| 種類   | 投資比率   |
|------|--------|
| 投資証券 | 99.06% |
| 合計   | 99.06% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

|    |                                     |                                |           |                            |                            |        |       |
|----|-------------------------------------|--------------------------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------|-------|
| 19 | AT&T INC<br>アメリカ                    | 株式<br>各種電気通信<br>サービス           | 542,288   | 3,630.03<br>1,968,522,690  | 3,430.38<br>1,860,254,451  | -<br>- | 0.61% |
| 20 | MERCK & CO. INC.<br>アメリカ            | 株式<br>医薬品                      | 298,696   | 4,249.26<br>1,269,237,606  | 5,504.03<br>1,644,034,313  | -<br>- | 0.54% |
| 21 | COCA-COLA CO/THE<br>アメリカ            | 株式<br>飲料                       | 406,611   | 3,799.44<br>1,544,894,988  | 3,926.16<br>1,596,422,364  | -<br>- | 0.52% |
| 22 | BP PLC<br>イギリス                      | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料           | 1,922,200 | 763.76<br>1,468,105,465    | 810.90<br>1,558,713,363    | -<br>- | 0.51% |
| 23 | AMAZON.COM INC<br>アメリカ              | 株式<br>インターネット<br>販売・カタログ<br>販売 | 37,169    | 27,703.71<br>1,029,719,520 | 41,416.57<br>1,539,412,824 | -<br>- | 0.50% |
| 24 | CITIGROUP INC<br>アメリカ               | 株式<br>各種金融サービ<br>ス             | 308,990   | 4,575.43<br>1,413,764,235  | 4,968.13<br>1,535,104,960  | -<br>- | 0.50% |
| 25 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS<br>イギリス | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料           | 397,909   | 3,601.20<br>1,432,950,303  | 3,643.87<br>1,449,931,850  | -<br>- | 0.47% |
| 26 | VERIZON COMM INC<br>アメリカ            | 株式<br>各種電気通信<br>サービス           | 291,965   | 4,574.20<br>1,335,507,936  | 4,899.22<br>1,430,401,292  | -<br>- | 0.47% |
| 27 | ORACLE CORP<br>アメリカ                 | 株式<br>ソフトウェア                   | 353,534   | 3,576.26<br>1,264,331,869  | 3,846.96<br>1,360,032,570  | -<br>- | 0.44% |
| 28 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL<br>アメリカ | 株式<br>タバコ                      | 164,815   | 9,251.95<br>1,524,861,545  | 8,135.19<br>1,340,802,559  | -<br>- | 0.44% |
| 29 | GLAXOSMITHKLINE PLC<br>イギリス         | 株式<br>医薬品                      | 499,201   | 2,491.95<br>1,243,984,794  | 2,675.00<br>1,335,365,269  | -<br>- | 0.44% |
| 30 | PEPSICO INC<br>アメリカ                 | 株式<br>飲料                       | 157,377   | 7,456.78<br>1,173,526,007  | 8,339.88<br>1,312,506,679  | -<br>- | 0.43% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成26年1月31日現在

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

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>地域                       | 種類   | 数量            | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)     | 評価単価<br>評価金額<br>(円)     | 利率(%)<br>償還日           | 投資<br>比率 |
|----|---------------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1  | US T N/B 0.625 07/15/16<br>アメリカ | 国債証券 | 3,908,680,000 | 100.11<br>3,913,269,613 | 100.26<br>3,919,194,349 | 0.625000<br>2016/7/15  | 1.02%    |
| 2  | US T N/B 2.5 03/31/15<br>アメリカ   | 国債証券 | 3,085,800,000 | 104.64<br>3,229,104,552 | 102.71<br>3,169,425,180 | 2.500000<br>2015/3/31  | 0.83%    |
| 3  | US T N/B 1.25 08/31/15<br>アメリカ  | 国債証券 | 3,085,800,000 | 102.27<br>3,155,940,234 | 101.59<br>3,134,956,794 | 1.250000<br>2015/8/31  | 0.82%    |
| 4  | US T N/B 3.25 06/30/16<br>アメリカ  | 国債証券 | 2,571,500,000 | 109.20<br>2,808,155,145 | 106.62<br>2,741,939,020 | 3.250000<br>2016/6/30  | 0.71%    |
| 5  | US T N/B 2.25 01/31/15<br>アメリカ  | 国債証券 | 2,571,500,000 | 103.83<br>2,670,219,885 | 102.10<br>2,625,630,075 | 2.250000<br>2015/1/31  | 0.68%    |
| 6  | US T N/B 1.375 11/30/18<br>アメリカ | 国債証券 | 2,571,500,000 | 99.75<br>2,565,179,253  | 99.55<br>2,560,031,110  | 1.375000<br>2018/11/30 | 0.67%    |
| 7  | US T N/B 2.375 02/28/15<br>アメリカ | 国債証券 | 2,365,780,000 | 104.20<br>2,465,308,364 | 102.37<br>2,422,038,248 | 2.375000<br>2015/2/28  | 0.63%    |
| 8  | US T N/B 1.25 09/30/15<br>アメリカ  | 国債証券 | 2,365,780,000 | 102.31<br>2,420,571,464 | 101.63<br>2,404,484,160 | 1.250000<br>2015/9/30  | 0.63%    |
| 9  | FRANCE OAT 3.25 04/25/16<br>ユーロ | 国債証券 | 2,161,320,000 | 108.33<br>2,341,408,154 | 106.66<br>2,305,371,978 | 3.250000<br>2016/4/25  | 0.60%    |
| 10 | FRANCE OAT 3.0 10/25/15<br>ユーロ  | 国債証券 | 2,161,320,000 | 106.71<br>2,306,495,864 | 104.85<br>2,266,295,312 | 3.000000<br>2015/10/25 | 0.59%    |
| 11 | US T N/B 3.25 12/31/16<br>アメリカ  | 国債証券 | 2,057,200,000 | 110.00<br>2,262,920,000 | 107.38<br>2,209,144,792 | 3.250000<br>2016/12/31 | 0.58%    |

|    |                                  |      |               |                         |                         |                        |       |
|----|----------------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|-------|
| 12 | US T N/B 3.0 02/28/17<br>アメリカ    | 国債証券 | 2,057,200,000 | 109.31<br>2,248,766,464 | 106.75<br>2,196,122,716 | 3.000000<br>2017/2/28  | 0.57% |
| 13 | US T N/B 3.0 09/30/16<br>アメリカ    | 国債証券 | 2,057,200,000 | 108.71<br>2,236,546,696 | 106.35<br>2,188,017,348 | 3.000000<br>2016/9/30  | 0.57% |
| 14 | ITALY BTPS 3.75 08/01/15<br>ユーロ  | 国債証券 | 2,091,600,000 | 103.57<br>2,166,270,120 | 104.15<br>2,178,443,232 | 3.750000<br>2015/8/1   | 0.57% |
| 15 | US T N/B 1.75 05/31/16<br>アメリカ   | 国債証券 | 2,108,630,000 | 104.03<br>2,193,724,020 | 102.96<br>2,171,045,448 | 1.750000<br>2016/5/31  | 0.57% |
| 16 | DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17<br>ユーロ | 国債証券 | 1,952,160,000 | 112.51<br>2,196,481,190 | 110.34<br>2,154,110,952 | 3.750000<br>2017/1/4   | 0.56% |
| 17 | US T N/B 2.375 03/31/16<br>アメリカ  | 国債証券 | 2,057,200,000 | 105.94<br>2,179,418,252 | 104.23<br>2,144,384,136 | 2.375000<br>2016/3/31  | 0.56% |
| 18 | US T N/B 4.0 02/15/15<br>アメリカ    | 国債証券 | 2,057,200,000 | 107.34<br>2,208,342,484 | 103.99<br>2,139,405,712 | 4.000000<br>2015/2/15  | 0.56% |
| 19 | US T N/B 2.5 04/30/15<br>アメリカ    | 国債証券 | 2,057,200,000 | 104.79<br>2,155,781,024 | 102.90<br>2,116,899,944 | 2.500000<br>2015/4/30  | 0.55% |
| 20 | ITALY BTPS 3.75 08/01/16<br>ユーロ  | 国債証券 | 1,952,160,000 | 103.91<br>2,028,489,456 | 105.70<br>2,063,433,120 | 3.750000<br>2016/8/1   | 0.54% |
| 21 | US T N/B 0.375 06/15/15<br>アメリカ  | 国債証券 | 2,057,200,000 | 100.12<br>2,059,833,216 | 100.25<br>2,062,404,716 | 0.375000<br>2015/6/15  | 0.54% |
| 22 | US T N/B 3.625 02/15/20<br>アメリカ  | 国債証券 | 1,851,480,000 | 115.17<br>2,132,368,030 | 110.16<br>2,039,590,368 | 3.625000<br>2020/2/15  | 0.53% |
| 23 | US T N/B 0.625 05/31/17<br>アメリカ  | 国債証券 | 2,057,200,000 | 99.64<br>2,049,958,656  | 99.10<br>2,038,870,348  | 0.625000<br>2017/5/31  | 0.53% |
| 24 | ITALY BTPS 4.5 02/01/18<br>ユーロ   | 国債証券 | 1,854,552,000 | 105.86<br>1,963,405,278 | 108.98<br>2,021,276,224 | 4.500000<br>2018/2/1   | 0.53% |
| 25 | US T N/B 4.5 11/15/15<br>アメリカ    | 国債証券 | 1,851,480,000 | 111.15<br>2,057,957,049 | 107.52<br>1,990,840,899 | 4.500000<br>2015/11/15 | 0.52% |
| 26 | FRANCE OAT 3.75 04/25/17<br>ユーロ  | 国債証券 | 1,798,776,000 | 111.80<br>2,011,121,506 | 110.48<br>1,987,449,614 | 3.750000<br>2017/4/25  | 0.52% |
| 27 | US T N/B 3.125 04/30/17<br>アメリカ  | 国債証券 | 1,851,480,000 | 110.07<br>2,038,072,154 | 107.26<br>1,986,064,081 | 3.125000<br>2017/4/30  | 0.52% |
| 28 | DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15<br>ユーロ | 国債証券 | 1,882,440,000 | 106.66<br>2,007,942,274 | 103.38<br>1,946,198,242 | 3.750000<br>2015/1/4   | 0.51% |
| 29 | US T N/B 4.125 05/15/15<br>アメリカ  | 国債証券 | 1,851,480,000 | 108.45<br>2,008,059,663 | 105.06<br>1,945,275,976 | 4.125000<br>2015/5/15  | 0.51% |
| 30 | US T N/B 4.875 08/15/16<br>アメリカ  | 国債証券 | 1,748,620,000 | 115.03<br>2,011,455,072 | 110.92<br>1,939,726,679 | 4.875000<br>2016/8/15  | 0.50% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

| 種類   | 投資比率   |
|------|--------|
| 国債証券 | 97.42% |
| 合計   | 97.42% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

|    |                                   |              |         |                         |                         |        |       |
|----|-----------------------------------|--------------|---------|-------------------------|-------------------------|--------|-------|
| 22 | WESTFIELD RETAIL TRUST<br>オーストラリア | 投資信託<br>受益証券 | 114,200 | 278.68<br>31,825,817    | 275.03<br>31,408,780    | -<br>- | 1.03% |
| 23 | THE MACERICH COMPANY<br>アメリカ      | 投資証券         | 5,290   | 6,053.31<br>32,022,015  | 5,773.53<br>30,541,983  | -<br>- | 1.00% |
| 24 | STOCKLAND<br>オーストラリア              | 投資信託<br>受益証券 | 87,717  | 366.97<br>32,190,236    | 334.03<br>29,300,425    | -<br>- | 0.96% |
| 25 | ESSEX PROPERTY TRUST INC<br>アメリカ  | 投資証券         | 1,670   | 16,413.20<br>27,410,056 | 16,084.21<br>26,860,644 | -<br>- | 0.88% |
| 26 | GOODMAN GROUP<br>オーストラリア          | 投資信託<br>受益証券 | 60,752  | 454.75<br>27,627,439    | 422.98<br>25,697,379    | -<br>- | 0.84% |
| 27 | DIGITAL REALTY TRUST INC<br>アメリカ  | 投資証券         | 4,860   | 4,928.02<br>23,950,189  | 5,137.85<br>24,969,985  | -<br>- | 0.82% |
| 28 | HAMMERSON PLC<br>イギリス             | 投資証券         | 27,200  | 884.03<br>24,045,692    | 897.60<br>24,414,915    | -<br>- | 0.80% |
| 29 | UDR INC<br>アメリカ                   | 投資証券         | 9,169   | 2,493.32<br>22,861,309  | 2,509.78<br>23,012,209  | -<br>- | 0.75% |
| 30 | DUKE REALTY TRUST<br>アメリカ         | 投資証券         | 14,400  | 1,685.87<br>24,276,605  | 1,584.04<br>22,810,233  | -<br>- | 0.75% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。



## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>地域                        | 種類<br>業種                         | 数量        | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)         | 評価単価<br>評価金額<br>(円)         | 利率(%)<br>償還日 | 投資<br>比率 |
|----|----------------------------------|----------------------------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|--------------|----------|
| 1  | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD<br>韓国 | 株式<br>半導体・半導体<br>製造装置            | 10,629    | 142,323.99<br>1,512,761,695 | 122,112.00<br>1,297,928,448 | -<br>-       | 3.53%    |
| 2  | TAIWAN SEMICONDUCTOR<br>台湾       | 株式<br>半導体・半導体<br>製造装置            | 2,363,083 | 340.16<br>803,840,698       | 355.94<br>841,139,393       | -<br>-       | 2.29%    |
| 3  | TENCENT HOLDINGS LTD<br>香港       | 株式<br>インターネット<br>ソフトウェア・<br>サービス | 98,200    | 3,404.87<br>334,358,734     | 7,195.94<br>706,641,308     | -<br>-       | 1.92%    |
| 4  | CHINA MOBILE LIMITED<br>香港       | 株式<br>無線通信サー<br>ビス               | 579,000   | 1,067.85<br>618,288,964     | 980.42<br>567,664,338       | -<br>-       | 1.54%    |
| 5  | CHINA CONSTRUCTION BANK<br>香港    | 株式<br>商業銀行                       | 7,062,530 | 79.34<br>560,408,526        | 71.36<br>504,007,565        | -<br>-       | 1.37%    |
| 6  | AO GAZPROM ADR<br>アメリカ           | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料             | 568,232   | 776.24<br>441,086,865       | 863.50<br>490,673,843       | -<br>-       | 1.33%    |
| 7  | IND & COMM BK OF CHINA - H<br>香港 | 株式<br>商業銀行                       | 6,980,235 | 67.17<br>468,865,862        | 63.68<br>444,532,077        | -<br>-       | 1.21%    |
| 8  | NASPERS LTD<br>南アフリカ             | 株式<br>メディア                       | 37,891    | 5,422.69<br>205,471,442     | 10,247.21<br>388,277,322    | -<br>-       | 1.06%    |
| 9  | AMERICA MOVIL SAB DE CV<br>メキシコ  | 株式<br>無線通信サー<br>ビス               | 3,386,078 | 94.95<br>321,527,871        | 110.42<br>373,919,175       | -<br>-       | 1.02%    |
| 10 | HYUNDAI MOTOR CO<br>韓国           | 株式<br>自動車                        | 14,863    | 18,759.82<br>278,827,301    | 22,371.29<br>332,504,631    | -<br>-       | 0.90%    |
| 11 | BANK OF CHINA LTD<br>香港          | 株式<br>商業銀行                       | 7,275,200 | 45.23<br>329,074,643        | 43.55<br>316,904,801        | -<br>-       | 0.86%    |
| 12 | HON HAI PRECISION INDUSTRY<br>台湾 | 株式<br>電子装置・機<br>器・部品             | 1,083,769 | 238.64<br>258,640,461       | 287.81<br>311,920,639       | -<br>-       | 0.85%    |
| 13 | AMBEV SA<br>ブラジル                 | 株式<br>飲料                         | 448,550   | 683.86<br>306,746,724       | 677.33<br>303,817,089       | -<br>-       | 0.83%    |
| 14 | SBERBANK ADR<br>アメリカ             | 株式<br>商業銀行                       | 267,204   | 1,224.57<br>327,211,710     | 1,122.20<br>299,857,023     | -<br>-       | 0.82%    |
| 15 | MTN GROUP LTD<br>南アフリカ           | 株式<br>無線通信サー<br>ビス               | 162,066   | 1,499.56<br>243,028,194     | 1,839.37<br>298,100,715     | -<br>-       | 0.81%    |
| 16 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA<br>ブラジル | 株式<br>商業銀行                       | 235,680   | 1,305.18<br>307,606,889     | 1,259.91<br>296,936,437     | -<br>-       | 0.81%    |
| 17 | LUKOIL SPON ADR<br>アメリカ          | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料             | 49,540    | 6,149.35<br>304,639,273     | 5,868.16<br>290,708,795     | -<br>-       | 0.79%    |

|    |  |                                  |           |                          |                          |        |       |
|----|--|----------------------------------|-----------|--------------------------|--------------------------|--------|-------|
| 18 | CNOOC LTD<br>香港                            | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料             | 1,695,000 | 177.74<br>301,285,777    | 161.52<br>273,789,960    | -<br>- | 0.74% |
| 19 | SASOL LTD<br>南アフリカ                         | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料             | 53,966    | 3,451.93<br>186,286,998  | 4,943.66<br>266,790,019  | -<br>- | 0.73% |
| 20 | PETROLEO BRASILEIRO SA<br>ブラジル             | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料             | 400,512   | 728.18<br>291,647,635    | 627.39<br>251,279,626    | -<br>- | 0.68% |
| 21 | VALE SA-PREF A<br>ブラジル                     | 株式<br>金属・鉱業                      | 176,496   | 1,302.39<br>229,866,653  | 1,270.15<br>224,177,594  | -<br>- | 0.61% |
| 22 | BANCO BRADESCO SA PREF<br>ブラジル             | 株式<br>商業銀行                       | 195,749   | 1,363.02<br>266,810,767  | 1,097.72<br>214,879,471  | -<br>- | 0.58% |
| 23 | CHINA LIFE INSURANCE CO LTD<br>香港          | 株式<br>保険                         | 726,000   | 264.05<br>191,704,112    | 280.68<br>203,779,488    | -<br>- | 0.55% |
| 24 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL<br>COR<br>香港    | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料             | 2,473,200 | 83.49<br>206,492,689     | 81.82<br>202,365,138     | -<br>- | 0.55% |
| 25 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE<br>CORP<br>インド | 株式<br>貯蓄・抵当・不<br>動産金融            | 145,891   | 1,317.68<br>192,238,855  | 1,376.38<br>200,802,767  | -<br>- | 0.55% |
| 26 | PETRO CHINA CO LTD<br>香港                   | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料             | 1,978,000 | 122.17<br>241,659,371    | 99.43<br>196,677,287     | -<br>- | 0.53% |
| 27 | HYUNDAI MOBIS<br>韓国                        | 株式<br>自動車部品                      | 6,448     | 25,713.58<br>165,801,176 | 29,574.00<br>190,693,152 | -<br>- | 0.52% |
| 28 | SK HYNIX INC<br>韓国                         | 株式<br>半導体・半導体<br>製造装置            | 51,520    | 2,748.95<br>141,626,136  | 3,610.88<br>186,033,052  | -<br>- | 0.51% |
| 29 | ECOPETROL SA SP ADR<br>アメリカ                | 株式<br>石油・ガス・消<br>耗燃料             | 50,448    | 4,745.18<br>239,385,166  | 3,581.58<br>180,683,810  | -<br>- | 0.49% |
| 30 | NAVER CORP<br>韓国                           | 株式<br>インターネット<br>ソフトウェア・<br>サービス | 2,756     | 36,252.65<br>99,912,323  | 64,395.00<br>177,472,620 | -<br>- | 0.48% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

| 種類       | 投資比率   |
|----------|--------|
| 株式       | 94.40% |
| 投資信託受益証券 | 0.88%  |
| 投資証券     | 0.19%  |
| 合計       | 95.46% |

（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。

## 投資株式の業種別投資比率

平成26年1月31日現在

| 業種                      | 国内/外国 | 投資比率   |
|-------------------------|-------|--------|
| 商業銀行                    | 外国    | 16.89% |
| 石油・ガス・消耗燃料              |       | 10.23% |
| 半導体・半導体製造装置             |       | 8.20%  |
| 無線通信サービス                |       | 5.32%  |
| 金属・鉱業                   |       | 4.82%  |
| 保険                      |       | 3.19%  |
| 自動車                     |       | 2.82%  |
| 化学                      |       | 2.49%  |
| インターネットソフトウェア・サービス      |       | 2.40%  |
| 食品                      |       | 2.24%  |
| 食品・生活必需品小売り             |       | 2.08%  |
| 電子装置・機器・部品              |       | 1.97%  |
| 情報技術サービス                |       | 1.91%  |
| コングロマリット                |       | 1.76%  |
| メディア                    |       | 1.75%  |
| 各種電気通信サービス              |       | 1.67%  |
| 不動産管理・開発                |       | 1.61%  |
| 各種金融サービス                |       | 1.56%  |
| 飲料                      |       | 1.54%  |
| 電力                      |       | 1.41%  |
| コンピュータ・周辺機器             |       | 1.21%  |
| 建設資材                    |       | 1.11%  |
| 医薬品                     |       | 1.02%  |
| 建設・土木                   |       | 1.02%  |
| 機械                      |       | 0.98%  |
| 自動車部品                   |       | 0.88%  |
| 運送インフラ                  |       | 0.86%  |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |       | 0.82%  |
| 複合小売り                   |       | 0.75%  |
| タバコ                     |       | 0.72%  |
| 資本市場                    |       | 0.64%  |
| 専門小売り                   |       | 0.63%  |
| ガス                      |       | 0.62%  |
| 家庭用耐久財                  |       | 0.58%  |
| 貯蓄・抵当・不動産金融             |       | 0.57%  |
| ホテル・レストラン・レジャー          |       | 0.53%  |
| ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス |       | 0.53%  |
| パーソナル用品                 |       | 0.52%  |

|                   |        |
|-------------------|--------|
| 家庭用品              | 0.46%  |
| 商社・流通業            | 0.34%  |
| 旅客航空輸送業           | 0.32%  |
| 紙製品・林産品           | 0.32%  |
| エネルギー設備・サービス      | 0.29%  |
| 電気設備              | 0.27%  |
| 繊維・アパレル・贅沢品       | 0.25%  |
| 水道                | 0.23%  |
| 通信機器              | 0.19%  |
| 各種消費者サービス         | 0.19%  |
| 海運業               | 0.19%  |
| 消費者金融             | 0.17%  |
| 航空宇宙・防衛           | 0.16%  |
| ソフトウェア            | 0.15%  |
| 不動産投資信託           | 0.14%  |
| 商業サービス・用品         | 0.14%  |
| 陸運・鉄道             | 0.12%  |
| 容器・包装             | 0.11%  |
| 総合公益事業            | 0.09%  |
| レジャー用品            | 0.09%  |
| 販売                | 0.09%  |
| 建設関連製品            | 0.08%  |
| 航空貨物・物流サービス       | 0.07%  |
| ヘルスケア機器・用品        | 0.05%  |
| ライフサイエンス・ツール/サービス | 0.01%  |
| 合計                | 94.40% |

（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。

#### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 順位 | 銘柄名<br>地域                                      | 種類   | 数量            | 簿価単価<br>簿価金額<br>(円)     | 評価単価<br>評価金額<br>(円)     | 利率(%)<br>償還日           | 投資<br>比率 |
|----|--|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1  | RUSSIAN FEDERATION<br>03/31/30<br>アメリカ         | 国債証券 | 1,941,585,360 | 124.55<br>2,418,377,829 | 115.61<br>2,244,841,566 | 7.500000<br>2030/3/31  | 6.42%    |
| 2  | RUSSIAN FEDERATION 11.0<br>07/24/18<br>アメリカ    | 国債証券 | 473,156,000   | 144.07<br>681,699,507   | 134.24<br>635,188,272   | 11.000000<br>2018/7/24 | 1.82%    |
| 3  | RUSSIAN FEDERATION 12.75<br>06/24/28<br>アメリカ   | 国債証券 | 360,010,000   | 194.54<br>700,376,825   | 168.35<br>606,076,835   | 12.750000<br>2028/6/24 | 1.73%    |
| 4  | UNITED MEXICAN STATES<br>6.05 01/11/40<br>アメリカ | 国債証券 | 555,444,000   | 131.14<br>728,418,519   | 107.25<br>595,713,690   | 6.050000<br>2040/1/11  | 1.70%    |
| 5  | PERU 8.75 11/21/33<br>アメリカ                     | 国債証券 | 411,440,000   | 166.44<br>684,822,336   | 140.84<br>579,472,096   | 8.750000<br>2033/11/21 | 1.66%    |
| 6  | UNITED MEXICAN STATES<br>4.75 03/08/44<br>アメリカ | 国債証券 | 648,018,000   | 109.39<br>708,880,262   | 88.65<br>574,467,957    | 4.750000<br>2044/3/8   | 1.64%    |

|    |  |      |             |                       |                       |                        |       |
|----|--|------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|-------|
| 7  | RUSSIA FOREIGN BOND 5.0<br>04/29/20<br>アメリカ      | 国債証券 | 514,300,000 | 115.56<br>594,325,080 | 106.76<br>549,092,395 | 5.000000<br>2020/4/29  | 1.57% |
| 8  | PERU 7.35 07/21/25<br>アメリカ                       | 国債証券 | 390,868,000 | 141.62<br>553,556,519 | 124.77<br>487,725,090 | 7.350000<br>2025/7/21  | 1.39% |
| 9  | UNITED MEXICAN STATES<br>6.75 09/27/34<br>アメリカ   | 国債証券 | 401,154,000 | 137.09<br>549,959,504 | 116.40<br>466,983,371 | 6.750000<br>2034/9/27  | 1.34% |
| 10 | BRAZIL 7.125 01/20/37<br>アメリカ                    | 国債証券 | 411,440,000 | 143.51<br>590,493,545 | 112.00<br>460,812,800 | 7.125000<br>2037/1/20  | 1.32% |
| 11 | PANAMA 6.7 01/26/36<br>アメリカ                      | 国債証券 | 411,440,000 | 137.92<br>567,483,763 | 111.56<br>459,002,464 | 6.700000<br>2036/1/26  | 1.31% |
| 12 | COLOMBIA 7.375 03/18/19<br>アメリカ                  | 国債証券 | 370,296,000 | 129.27<br>478,684,725 | 119.50<br>442,503,720 | 7.375000<br>2019/3/18  | 1.27% |
| 13 | TURKEY 7.375 02/05/25<br>アメリカ                    | 国債証券 | 401,154,000 | 133.65<br>536,142,321 | 108.75<br>436,254,975 | 7.375000<br>2025/2/5   | 1.25% |
| 14 | TURKEY 7.25 03/15/15<br>アメリカ                     | 国債証券 | 411,440,000 | 110.36<br>454,081,641 | 105.37<br>433,559,014 | 7.250000<br>2015/3/15  | 1.24% |
| 15 | COLOMBIA 6.125 01/18/41<br>アメリカ                  | 国債証券 | 411,440,000 | 133.28<br>548,372,375 | 105.25<br>433,040,600 | 6.125000<br>2041/1/18  | 1.24% |
| 16 | BRAZIL 4.875 01/22/21<br>アメリカ                    | 国債証券 | 401,154,000 | 119.10<br>477,774,414 | 105.25<br>422,214,585 | 4.875000<br>2021/1/22  | 1.21% |
| 17 | PHILIPPINES 6.375<br>10/23/34<br>アメリカ            | 国債証券 | 339,438,000 | 133.41<br>452,866,865 | 119.50<br>405,628,410 | 6.375000<br>2034/10/23 | 1.16% |
| 18 | RUSSIAN FEDERATION 5.625<br>04/04/42<br>アメリカ     | 国債証券 | 411,440,000 | 117.35<br>482,828,954 | 97.59<br>401,524,296  | 5.625000<br>2042/4/4   | 1.15% |
| 19 | RUSSIA FOREIGN BOND 3.625<br>04/29/15<br>アメリカ    | 国債証券 | 380,582,000 | 104.90<br>399,254,690 | 103.26<br>393,008,002 | 3.625000<br>2015/4/29  | 1.12% |
| 20 | UNITED MEXICAN STATES<br>11.375 09/15/16<br>アメリカ | 国債証券 | 308,580,000 | 134.00<br>413,497,200 | 126.56<br>390,538,848 | 11.375000<br>2016/9/15 | 1.12% |
| 21 | UNITED MEXICAN STATES<br>5.95 03/19/19<br>アメリカ   | 国債証券 | 329,152,000 | 123.25<br>405,679,840 | 115.25<br>379,347,680 | 5.950000<br>2019/3/19  | 1.08% |
| 22 | BRAZIL 8.25 01/20/34<br>アメリカ                     | 国債証券 | 298,294,000 | 158.75<br>473,571,554 | 125.65<br>374,806,411 | 8.250000<br>2034/1/20  | 1.07% |
| 23 | HUNGARY 6.375 03/29/21<br>アメリカ                   | 国債証券 | 349,724,000 | 109.15<br>381,741,232 | 106.75<br>373,330,370 | 6.375000<br>2021/3/29  | 1.07% |
| 24 | PHILIPPINES 7.75 01/14/31<br>アメリカ                | 国債証券 | 277,722,000 | 146.82<br>407,775,612 | 132.62<br>368,328,802 | 7.750000<br>2031/1/14  | 1.05% |
| 25 | COLOMBIA 7.375 09/18/37<br>アメリカ                  | 国債証券 | 298,294,000 | 150.10<br>447,749,580 | 121.25<br>361,681,475 | 7.375000<br>2037/9/18  | 1.03% |
| 26 | PANAMA 5.2 01/30/20<br>アメリカ                      | 国債証券 | 329,152,000 | 113.84<br>374,729,266 | 109.00<br>358,775,680 | 5.200000<br>2020/1/30  | 1.03% |
| 27 | PHILIPPINES 9.5 02/02/30<br>アメリカ                 | 国債証券 | 236,578,000 | 169.12<br>400,112,542 | 150.62<br>356,345,612 | 9.500000<br>2030/2/2   | 1.02% |
| 28 | COLOMBIA 4.375 07/12/21<br>アメリカ                  | 国債証券 | 349,724,000 | 114.10<br>399,035,084 | 101.50<br>354,969,860 | 4.375000<br>2021/7/12  | 1.02% |

|    |                               |      |             |                       |                       |                      |       |
|----|-------------------------------|------|-------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-------|
| 29 | BRAZIL 5.625 01/07/41<br>アメリカ | 国債証券 | 370,296,000 | 121.22<br>448,906,755 | 94.75<br>350,855,460  | 5.625000<br>2041/1/7 | 1.00% |
| 30 | ROMANIA 6.75 02/07/22<br>アメリカ | 国債証券 | 308,580,000 | 120.19<br>370,900,302 | 113.37<br>349,852,575 | 6.750000<br>2022/2/7 | 1.00% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

| 種類   | 投資比率   |
|------|--------|
| 国債証券 | 96.66% |
| 合計   | 96.66% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

#### 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 種類           | 地域 | 資産の名称             | 買建/<br>売建 | 数量  | 簿価金額<br>(円)   | 評価金額<br>(円)   | 投資<br>比率 |
|--------------|----|-------------------|-----------|-----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | 日本 | TOPIX<br>先物 2603月 | 買建        | 555 | 6,978,902,561 | 6,743,250,000 | 2.13%    |

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

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

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 種類           | 地域          | 資産の名称   | 買建/<br>売建 | 数量         | 簿価金額<br>(円)   | 評価金額<br>(円)   | 投資<br>比率 |
|--------------|-------------|---|-----------|------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引       | 日本          | アメリカ・ドル買/円<br>売2014年02月                             | 買建        | 31,200,000 | 3,189,275,540 | 3,208,920,000 | 1.05%    |
|              |             | ユーロ買/円売201<br>4年02月                                 | 買建        | 7,700,000  | 1,074,489,920 | 1,073,611,000 | 0.35%    |
|              |             | イギリス・ポンド買/<br>円売2014年02月                            | 買建        | 3,100,000  | 524,697,900   | 525,976,000   | 0.17%    |
|              |             | オーストラリア・ドル<br>買/円売2014年0<br>2月                      | 買建        | 2,700,000  | 241,397,550   | 244,998,000   | 0.08%    |
|              |             | カナダ・ドル買/円売<br>2014年02月                              | 買建        | 2,500,000  | 228,400,500   | 230,450,000   | 0.08%    |
| 株価指数先物<br>取引 | アメリカ        | S & P 500 F U<br>T U R E M a r 1 4                  | 買建        | 126        | 5,808,131,332 | 5,771,248,308 | 1.88%    |
|              | ユーロ         | D J E U R O S T<br>O X X 5 0 M a r<br>1 4           | 買建        | 454        | 1,921,162,488 | 1,912,467,009 | 0.62%    |
|              | イギリス        | F T S E 1 0 0 I<br>N D E X F U T U R<br>E M a r 1 4 | 買建        | 85         | 945,224,498   | 935,607,036   | 0.31%    |
|              | カナダ         | S & P / T S E 6<br>0 I X F U T M<br>a r 1 4         | 買建        | 28         | 402,215,751   | 405,370,492   | 0.13%    |
|              | オースト<br>ラリア | S P I 2 0 0 F U<br>T U R E S M a r 1<br>4           | 買建        | 33         | 392,353,325   | 384,760,414   | 0.13%    |

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

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

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 種類     | 地域 | 資産の名称                   | 買建/<br>売建 | 数量      | 簿価金額<br>(円) | 評価金額<br>(円) | 投資<br>比率 |
|--------|----|-------------------------|-----------|---------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | ユーロ買/円売201<br>4年02月     | 買建        | 843,000 | 117,639,301 | 117,539,490 | 0.03%    |
|        |    | アメリカ・ドル買/円<br>売2014年02月 | 買建        | 942,000 | 96,271,646  | 96,884,700  | 0.03%    |
|        |    | アメリカ・ドル売/円<br>買2014年02月 | 売建        | 679,000 | 69,841,736  | 69,835,150  | 0.02%    |

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 種類           | 地域   | 資産の名称                          | 買建/<br>売建 | 数量        | 簿価金額<br>(円)   | 評価金額<br>(円)   | 投資<br>比率 |
|--------------|------|--------------------------------|-----------|-----------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引       | 日本   | アメリカ・ドル買/円<br>売2014年02月        | 買建        | 6,450,000 | 659,184,840   | 663,382,500   | 1.80%    |
| 株価指数先物<br>取引 | アメリカ | MINI MSCI<br>EMG MKT Ma<br>r14 | 買建        | 348       | 1,717,514,107 | 1,653,026,030 | 4.49%    |

(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。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

| 種類     | 地域 | 資産の名称                   | 買建/<br>売建 | 数量      | 簿価金額<br>(円) | 評価金額<br>(円) | 投資<br>比率 |
|--------|----|-------------------------|-----------|---------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | アメリカ・ドル買/円<br>売2014年02月 | 買建        | 800,000 | 81,759,360  | 82,280,000  | 0.24%    |

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。



## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（平成26年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(百万円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(百万円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(平成23年1月11日) | 251                     | 251                     | 1.0795                     | 1.0795                     |
| 第2計算期間末<br>(平成24年1月11日) | 413                     | 413                     | 0.9400                     | 0.9400                     |
| 第3計算期間末<br>(平成25年1月11日) | 552                     | 552                     | 1.2495                     | 1.2495                     |
| 第4計算期間末<br>(平成26年1月14日) | 760                     | 760                     | 1.5426                     | 1.5426                     |
| 平成25年1月末日               | 587                     | -                       | 1.2859                     | -                          |
| 2月末日                    | 624                     | -                       | 1.2936                     | -                          |
| 3月末日                    | 656                     | -                       | 1.3276                     | -                          |
| 4月末日                    | 698                     | -                       | 1.4057                     | -                          |
| 5月末日                    | 744                     | -                       | 1.4498                     | -                          |
| 6月末日                    | 682                     | -                       | 1.3401                     | -                          |
| 7月末日                    | 703                     | -                       | 1.3834                     | -                          |
| 8月末日                    | 700                     | -                       | 1.3538                     | -                          |
| 9月末日                    | 735                     | -                       | 1.4231                     | -                          |
| 10月末日                   | 758                     | -                       | 1.4863                     | -                          |
| 11月末日                   | 763                     | -                       | 1.5351                     | -                          |
| 12月末日                   | 702                     | -                       | 1.5861                     | -                          |
| 平成26年1月末日               | 766                     | -                       | 1.5003                     | -                          |

## 【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       |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 8.0    |
| 第2計算期間 | 12.9   |
| 第3計算期間 | 32.9   |
| 第4計算期間 | 23.5   |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定口数        | 解約口数        |
|--------|-------------|-------------|
| 第1計算期間 | 269,849,173 | 36,948,684  |
| 第2計算期間 | 306,401,840 | 98,947,769  |
| 第3計算期間 | 166,526,568 | 164,650,415 |
| 第4計算期間 | 401,888,372 | 351,206,799 |

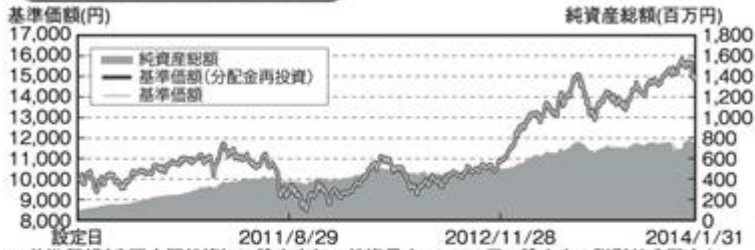
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(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。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2014年1月31日

## 基準価額・純資産の推移 (設定日(2010年5月28日)~2014年1月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2010年5月28日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄一覧

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名                         | 投資比率   |
|----|-----------------------------|--------|
| 1  | 外国株式バッシブ・ファンドマザーファンド        | 50.17% |
| 2  | エマージング株式バッシブ・マザーファンド        | 28.37% |
| 3  | エマージング債券バッシブ・マザーファンド        | 6.33%  |
| 4  | グローバルリート・バッシブ・ファンドマザーファンド   | 6.22%  |
| 5  | 国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 4.59%  |
| 6  | 外国債券バッシブ・ファンドマザーファンド        | 1.75%  |
| 7  | 国内債券バッシブ・ファンドマザーファンド        | 0.56%  |
| 8  | J-REITインデックスファンドマザーファンド     | 0.34%  |

## ■国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

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

## その他資産の投資状況

| 資産の種類        | 投資比率(%) |
|--------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 2.13    |

## ■外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

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

## ■エマージング株式バッシブ・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

| 資産の種類                | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 株式                   | 94.40   |
| 内 香港                 | 18.90   |
| 内 韓国                 | 15.39   |
| 内 台湾                 | 11.53   |
| 内 ブラジル               | 9.72    |
| 内 アメリカ               | 9.28    |
| 内 その他                | 29.58   |
| 投資信託受益証券             | 0.88    |
| 内 メキシコ               | 0.88    |
| 投資証券                 | 0.19    |
| 内 メキシコ               | 0.13    |
| 内 トルコ                | 0.06    |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 4.54    |
| 純資産総額                | 100.00  |

## 分配の推移(税引前)

|       |              |    |
|-------|--------------|----|
| 第1期   | (2011.01.11) | 0円 |
| 第2期   | (2012.01.11) | 0円 |
| 第3期   | (2013.01.11) | 0円 |
| 第4期   | (2014.01.14) | 0円 |
| 設定来累計 |              | 0円 |

(注)分配金は1万口当たりです。

## 組入上位5銘柄

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

## 組入上位5業種(国内株式)

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

## その他資産の投資状況

| 資産の種類        | 投資比率(%) |
|--------------|---------|
| 為替予約取引(買建)   | 1.72    |
| 株価指数先物取引(買建) | 3.07    |

## 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名                        | 種類 | 地域 | 業種          | 投資比率  |
|----|----------------------------|----|----|-------------|-------|
| 1  | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 株式 | 韓国 | 半導体・半導体製造業  | 3.53% |
| 2  | TAIWAN SEMICONDUCTOR       | 株式 | 台湾 | 半導体・半導体製造業  | 2.29% |
| 3  | TENCENT HOLDINGS LTD       | 株式 | 香港 | インターネットサービス | 1.92% |
| 4  | CHINA MOBILE LIMITED       | 株式 | 香港 | 無線通信サービス    | 1.54% |
| 5  | CHINA CONSTRUCTION BANK    | 株式 | 香港 | 銀行業         | 1.37% |

## 組入上位5業種(外国株式)

| 順位 | 業種         | 投資比率   |
|----|------------|--------|
| 1  | 商業銀行       | 16.89% |
| 2  | 石油ガス・石油燃料  | 10.23% |
| 3  | 半導体・半導体製造業 | 8.20%  |
| 4  | 無線通信サービス   | 5.32%  |
| 5  | 金属・鉱業      | 4.82%  |

## その他資産の投資状況

| 資産の種類        | 投資比率(%) |
|--------------|---------|
| 為替予約取引(買建)   | 1.80    |
| 株価指数先物取引(買建) | 4.49    |

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2014年1月31日

## 主要な資産の状況

### ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

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

#### 組入上位5銘柄

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

### ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

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

#### 組入上位5銘柄

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

#### その他資産の投資状況

| 資産の種類      | 投資比率(%) |
|------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 0.06    |
| 為替予約取引(売建) | △0.02   |

### ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

| 資産の種類                | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 国債証券                 | 96.66   |
| 内 アメリカ               | 96.66   |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 3.34    |
| 純資産総額                | 100.00  |

#### 組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名                                 | 種類   | 地域   | 利率(%)     | 償還日        | 投資比率  |
|----|-------------------------------------|------|------|-----------|------------|-------|
| 1  | RUSSIAN FEDERATION 03/31/30         | 国債証券 | アメリカ | 7.500000  | 2030/3/31  | 6.42% |
| 2  | RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18    | 国債証券 | アメリカ | 11.000000 | 2018/7/24  | 1.82% |
| 3  | RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28   | 国債証券 | アメリカ | 12.750000 | 2028/6/24  | 1.73% |
| 4  | UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 | 国債証券 | アメリカ | 6.050000  | 2040/1/11  | 1.70% |
| 5  | PERU 8.75 11/21/33                  | 国債証券 | アメリカ | 8.750000  | 2033/11/21 | 1.66% |

#### その他資産の投資状況

| 資産の種類      | 投資比率(%) |
|------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 0.24    |

### ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

#### ポートフォリオの状況

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

#### 組入上位5銘柄

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

### ■グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

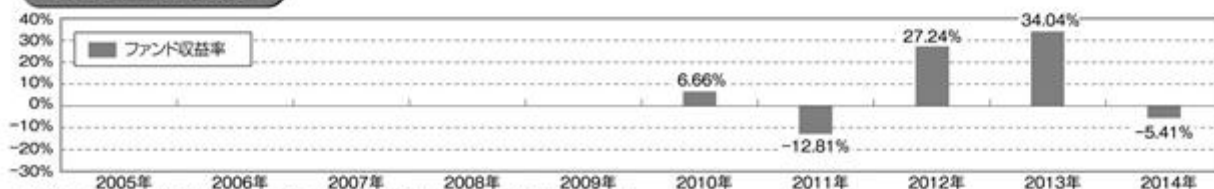
#### ポートフォリオの状況

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

#### 組入上位5銘柄

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

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2010年は設定日から年末までの収益率、および2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）することができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

### < 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

- ・お申込手数料  
ありません。

- ・お申込単位  
各販売会社が定める単位とします。  
お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。  
収益分配金の再投資については、1口単位となります。  
当初元本は1口当たり1円です。

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約のお申込みの受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の請求の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

海外休業日には、解約の請求の受付を行いません。

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

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

#### ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

#### ・解約単位

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

原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

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

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

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日に計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

#### （2）【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。



**（３）【信託期間】**

信託期間は平成22年5月28日から平成32年1月14日までです。

下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

**（４）【計算期間】**

- a. 計算期間は原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

**（５）【その他】****イ. 償還規定**

- a. 委託会社は、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等b.」の書面決議が否決された場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。



- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、上記b.に規定する書面に付記します。

#### ロ．信託約款の変更

- 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ます。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a. からg.の規定にしたがい信託約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請

求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

j.上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

#### 八．関係法人との契約の更改

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

当ファンドの投資顧問契約について、委託会社とイボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社（投資顧問会社）との間の当該契約は、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。

グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資一任契約について、委託会社とDIAM International Ltd（投資顧問会社）との間の当該契約は、当事者間の別段の意思表示がない限り、マザーファンドの信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

#### 二．公告

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

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

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

#### ホ．運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日（原則として1月11日。休業日の場合は翌営業日。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

（URL <http://www.diam.co.jp/>）

#### 4【受益者の権利等】

##### 収益分配金受領権

当ファンドの収益分配金は、自動的に再投資されます。収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益者にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### 償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

#### 一部解約請求権

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

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

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

#### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

（1）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（平成25年1月12日から平成26年1月14日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## マネックス資産設計ファンド エボリューション

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第3期<br>平成25年1月11日現在 | 第4期<br>平成26年1月14日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 14,651,128          | 21,611,464          |
| 親投資信託受益証券       | 543,093,543         | 743,011,691         |
| 未収入金            | 4,000,000           | -                   |
| 流動資産合計          | 561,744,671         | 764,623,155         |
| 資産合計            | 561,744,671         | 764,623,155         |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 6,619,296           | 324,997             |
| 未払受託者報酬         | 179,129             | 274,498             |
| 未払委託者報酬         | 2,380,358           | 3,647,313           |
| その他未払費用         | 18,140              | 27,848              |
| 流動負債合計          | 9,196,923           | 4,274,656           |
| 負債合計            | 9,196,923           | 4,274,656           |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1,442,230,713       | 1,492,912,286       |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 110,317,035         | 267,436,213         |
| (分配準備積立金)       | 95,562,352          | 130,690,137         |
| 元本等合計           | 552,547,748         | 760,348,499         |
| 純資産合計           | 552,547,748         | 760,348,499         |
| 負債純資産合計         | 561,744,671         | 764,623,155         |

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

|   | 第3期 |                            | 第4期 |                            |
|---|-----|----------------------------|-----|----------------------------|
|   | 自   | 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日 | 自   | 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
| 営業収益                                      |     |                            |     |                            |
| 受取利息                                      |     | 6,974                      |     | 9,910                      |
| 有価証券売買等損益                                 |     | 143,437,406                |     | 146,798,148                |
| 営業収益合計                                    |     | 143,444,380                |     | 146,808,058                |
| 営業費用                                      |     |                            |     |                            |
| 受託者報酬                                     |     | 349,962                    |     | 517,073                    |
| 委託者報酬                                     |     | 2,465,512                  |     | 2,687,581                  |
| その他費用                                     |     | 35,448                     |     | 52,457                     |
| 営業費用合計                                    |     | 5,035,922                  |     | 7,440,111                  |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             |     | 138,408,458                |     | 139,367,947                |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             |     | 138,408,458                |     | 139,367,947                |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           |     | 138,408,458                |     | 139,367,947                |
| 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（ ） |     | 16,340,517                 |     | 54,706,588                 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           |     | 26,441,559                 |     | 110,317,035                |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |     | 14,690,653                 |     | 176,647,624                |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |     | 7,169,098                  |     | -                          |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |     | 7,521,555                  |     | 176,647,624                |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |     | -                          |     | 104,189,805                |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |     | -                          |     | 104,189,805                |
| 分配金                                       |     | 1 -                        |     | 1 -                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           |     | 110,317,035                |     | 267,436,213                |

## ( 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<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。             |
| 2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日の取扱い<br><br>当ファンドは、原則として毎年1月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成26年1月14日としております。 |

## ( 貸借対照表に関する注記 )

| 項目          | 第3期<br>平成25年1月11日現在 | 第4期<br>平成26年1月14日現在 |
|-------------|---------------------|---------------------|
| 1 . 1 期首元本額 | 440,354,560円        | 442,230,713円        |
| 期中追加設定元本額   | 166,526,568円        | 401,888,372円        |
| 期中一部解約元本額   | 164,650,415円        | 351,206,799円        |
| 2 . 受益権の総数  | 442,230,713口        | 492,912,286口        |

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

| 項目   | 第3期<br>自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日   | 第4期<br>自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日  |
|--|---|--|
| 1 . 1 分配金の計算過程   | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,692,519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(70,113,063円)、信託約款に規定される収益調整金(23,620,316円)及び分配準備積立金(12,756,770円)より分配対象収益は119,182,668円(1万口当たり2,695.03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(16,949,152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(67,712,207円)、信託約款に規定される収益調整金(136,746,076円)及び分配準備積立金(46,028,778円)より分配対象収益は267,436,213円(1万口当たり5,425.63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。 |
| 2 . 2 当ファンドの主要投資対象であるグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に関わる権限を委託する為に要する費用 | 73,584円   | 96,217円  |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 第3期  | 第4期                          |
|--------------------------|--|------------------------------|
|                          | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日   | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。  | 同左                           |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 同左                           |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。   | 同左                           |



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 第3期<br>平成25年1月11日現在   | 第4期<br>平成26年1月14日現在 |
|----------------------------|---|---------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  | 同左                  |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>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3期<br>平成25年1月11日現在       | 第4期<br>平成26年1月14日現在       |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
|           | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 126,931,080               | 99,857,089                |
| 合計        | 126,931,080               | 99,857,089                |

## (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3期<br>平成25年1月11日現在 | 第4期<br>平成26年1月14日現在 |
|--------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.2495円             | 1.5426円             |
| (1万口当たり純資産額) | (12,495円)           | (15,426円)           |

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## ( 1 ) 株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

| 種 類          | 銘 柄                           | 券面総額<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 備考 |
|--------------|-------------------------------|-------------|-------------|----|
| 親投資信託受益証券    | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド   | 19,179,120  | 33,883,751  |    |
|              | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド         | 5,003,057   | 5,951,136   |    |
|              | J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 1,678,558   | 2,214,689   |    |
|              | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド         | 163,376,187 | 372,693,757 |    |
|              | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド         | 10,923,133  | 17,856,045  |    |
|              | グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド    | 37,731,897  | 45,832,935  |    |
|              | エマージング株式パッシブ・マザーファンド          | 241,045,504 | 217,447,149 |    |
|              | エマージング債券パッシブ・マザーファンド          | 33,290,175  | 47,132,229  |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                               | 512,227,631 | 743,011,691 |    |
| 合計           |                               | 512,227,631 | 743,011,691 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

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

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                        |  |
|------------------------|--|
| 1 . 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。                         |
| 3 . 収益及び費用の計上基準        | 受取配当金<br>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  |

## （貸借対照表に関する注記）

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

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

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

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

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日  | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1． 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。   | 同左                           |
| 2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。<br>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。 | 同左                           |
| 3． 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。  | 同左                           |



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   | 同左           |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「(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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。           | 同左           |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左           |

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類 | 平成25年1月11日現在      | 平成26年1月14日現在      |
|----|-------------------|-------------------|
|    | 当期の損益に含まれた評価差額(円) | 当期の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 41,537,448,229    | 74,092,922,661    |
| 合計 | 41,537,448,229    | 74,092,922,661    |

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

| 種類   | 平成25年1月11日 現在 |           |               |             | 平成26年1月14日 現在 |           |               |             |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|      | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|      |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 市場取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 先物取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 買 建  | 3,243,625,000 | -         | 3,448,915,000 | 205,290,000 | 5,812,732,000 | -         | 5,795,760,000 | 16,972,000  |
| 合計   | 3,243,625,000 | -         | 3,448,915,000 | 205,290,000 | 5,812,732,000 | -         | 5,795,760,000 | 16,972,000  |

## （注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

- 2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成26年1月14日現在

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

| 銘柄     | 株式数     |
|--------|---------|
| トヨタ自動車 | 500,000 |

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

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

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                    |  |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 |
|--------------------|--|

## （貸借対照表に関する注記）

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



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

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

|   |                  |                  |
|---|------------------|------------------|
| D I A Mバランス70V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 163,175円         | 124,094,157円     |
| D I A M世界アセットバ<br>ランスファンド4VA<br>(適格機関投資家限定) | 35,827,613,691円  | 38,015,228,752円  |
| D I A M世界バランス2<br>5VA(適格機関投資家<br>限定)        | 912,114,674円     | 933,930,861円     |
| D I A M国内バランス3<br>0VA(適格機関投資家<br>限定)        | 201,397,299円     | 199,033,079円     |
| D I A Mバランス20V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 2,054,001,727円   | 1,748,356,268円   |
| D I A Mバランス40V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 339,154円         | 26,145,578円      |
| D I A Mバランス60V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 247,769円         | 304,583円         |
| 計   | 368,547,050,465円 | 384,301,757,056円 |
| 2. 受益権の総数                                   | 368,547,050,465口 | 384,301,757,056口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日  | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。   | 同左                           |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 同左                           |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                | 同左                           |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 平成25年1月11日現在  | 平成26年1月14日現在 |
|----------------------------|---|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は<br>ありません。  | 同左           |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 同左           |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 同左           |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類    | 平成25年1月11日現在              | 平成26年1月14日現在              |
|-------|---------------------------|---------------------------|
|       | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) |
| 国債証券  | 1,367,061,600             | 4,779,705,100             |
| 地方債証券 | 12,073,749                | 147,909,892               |
| 特殊債証券 | 10,446,711                | 181,654,816               |
| 社債証券  | 46,541,540                | 90,495,920                |
| 合計    | 1,391,082,680             | 4,359,644,472             |

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

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

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                    |   |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> |
| 2. 収益及び費用の計上基準     | <p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>  |

## （貸借対照表に関する注記）

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

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日  | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。   | 同左                           |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 同左                           |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。                                | 同左                           |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 平成25年1月11日現在  | 平成26年1月14日現在 |
|----------------------------|---|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は<br>ありません。  | 同左           |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 同左           |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 同左           |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成25年1月11日現在      | 平成26年1月14日現在      |
|------|-------------------|-------------------|
|      | 当期の損益に含まれた評価差額(円) | 当期の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | 1,845,180,295     | 1,095,382,568     |
| 合計   | 1,845,180,295     | 1,095,382,568     |

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。



(1口当たり情報に関する注記)

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

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

|                   |        |                |  |
|-------------------|--------|----------------|--|
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 389    | 427,900,000    |  |
| 日本賃貸住宅投資法人        | 3,459  | 220,338,300    |  |
| 福岡リート投資法人         | 324    | 268,596,000    |  |
| 平和不動産リート投資法人      | 2,057  | 159,828,900    |  |
| 野村不動産オフィスファンド投資法人 | 874    | 402,914,000    |  |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 3,904  | 415,385,600    |  |
| 野村不動産レジデンシャル投資法人  | 377    | 202,826,000    |  |
| 投資証券 合計           | 70,686 | 17,369,800,780 |  |
| 合計                | 70,686 | 17,369,800,780 |  |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

（単位：円）

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

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>         | <p>株式<br/>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<br/>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<br/>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> |
| <p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>      | <p>先物取引<br/>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<br/>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>   |
| <p>3. 収益及び費用の計上基準</p>             | <p>受取配当金<br/>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>  |
| <p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> | <p>外貨建取引等の処理基準<br/>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>   |

## （貸借対照表に関する注記）

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

|   |                 |                 |
|---|-----------------|-----------------|
| D I A M 8資産バラン<br>スファンドN<DC年金<br>>                      | - 円             | 452,734円        |
| D I A M外国株式イン<br>デックスファンドV A<br>(適格機関投資家専用)             | 542,138,384円    | 446,333,455円    |
| D I A M外国株式パッシ<br>ブ私募ファンド(適格機<br>関投資家向け)                | 5,707,368,590円  | 4,223,297,292円  |
| D I A M為替リスクコン<br>トロール型グローバル株<br>式私募ファンド(適格機<br>関投資家限定) | 12,254,128,984円 | - 円             |
| D I A Mワールドバラン<br>ス25VA(適格機関投<br>資家限定)                  | 72,514,634円     | 48,987,699円     |
| D I A Mグローバル・バ<br>ランスファンド25VA<br>(適格機関投資家限定)            | 7,675,157,100円  | 3,797,958,766円  |
| D I A Mグローバル・バ<br>ランスファンド50VA<br>(適格機関投資家限定)            | 1,345,528,917円  | 757,583,234円    |
| D I A M国際分散バラン<br>スファンド30VA(適<br>格機関投資家限定)              | 158,826,564円    | 97,541,633円     |
| D I A M国際分散バラン<br>スファンド50VA(適<br>格機関投資家限定)              | 906,017,627円    | 487,450,822円    |
| D I A M国内重視バラン<br>スファンド30VA(適<br>格機関投資家限定)              | 77,853,986円     | 41,788,110円     |
| D I A M国内重視バラン<br>スファンド50VA(適<br>格機関投資家限定)              | 147,335,281円    | 92,550,138円     |
| D I A M世界バラン<br>スファンド40VA(適<br>格機関投資家限定)                | 15,008,817,486円 | 11,265,455,225円 |
| D I A M世界バラン<br>スファンド50VA(適<br>格機関投資家限定)                | 7,461,861,312円  | 5,618,861,756円  |
| D I A Mバランスマ<br>ンダ25VA(適格機<br>関投資家限定)                   | 2,484,248,662円  | 1,777,730,776円  |
| D I A Mバランスマ<br>ンダ37.5VA(適格機<br>関投資家限定)                 | 2,146,629,341円  | 1,590,948,161円  |
| D I A Mバランスマ<br>ンダ50VA(適格機<br>関投資家限定)                   | 5,689,028,414円  | 4,393,683,480円  |
| D I A Mグローバル・ア<br>セット・バランスマ<br>ンダVA<br>(適格機関投資家限定)      | 4,219,738,741円  | 2,616,588,063円  |

|   |                 |                 |
|---|-----------------|-----------------|
| D I A Mグローバル・ア<br>セット・バランスV A 2<br>(適格機関投資家限定)            | 5,538,044,320円  | 3,936,646,960円  |
| D I A M アクサ グ<br>ローバル バランスファ<br>ンド3 0 V A (適格機関<br>投資家限定) | 3,739,745,900円  | 2,375,066,041円  |
| D I A M世界アセットバ<br>ランスファンドV A (適<br>格機関投資家向け)              | 3,576,182,757円  | 2,049,442,154円  |
| D I A Mグローバル 私<br>募ファンド(適格機関投<br>資家向け)                    | 51,515,013円     | 29,321,084円     |
| D I A M世界バランス<br>ファンド5 5 V A (適格<br>機関投資家限定)              | 15,300,439,503円 | 10,441,316,927円 |
| D I A Mアイエヌジー世<br>界バランスファンド3 5<br>V A (適格機関投資家限<br>定)     | 2,846,622,975円  | 2,275,077,315円  |
| D I A Mグローバル分散<br>ファンドV A (適格機関<br>投資家限定)                 | 115,996,456円    | 73,011,333円     |
| D I A M世界アセットバ<br>ランスファンド2 V A<br>(適格機関投資家限定)             | 20,371,140,933円 | 14,039,586,099円 |
| D I A M世界アセットバ<br>ランスファンド4 0 V A<br>(適格機関投資家限定)           | 1,909,202,112円  | 1,099,526,644円  |
| D I A M世界アセットバ<br>ランスファンド2 5 V A<br>(適格機関投資家限定)           | 3,674,405,812円  | 2,473,239,583円  |
| D I A M世界アセットバ<br>ランスファンド3 V A<br>(適格機関投資家限定)             | 12,575,501,262円 | 8,666,421,148円  |
| D I A Mバランス3 0 V<br>A (適格機関投資家限<br>定)                     | - 円             | 155,731円        |
| D I A Mバランス5 0 V<br>A (適格機関投資家限<br>定)                     | 159,888円        | 347,414,773円    |
| D I A Mバランス7 0 V<br>A (適格機関投資家限<br>定)                     | 250,516円        | 238,514,023円    |
| D I A M世界アセットバ<br>ランスファンド4 V A<br>(適格機関投資家限定)             | 16,414,596,880円 | 11,517,045,938円 |
| D I A Mバランス2 0 V<br>A (適格機関投資家限<br>定)                     | - 円             | 268,844,682円    |
| D I A Mバランス4 0 V<br>A (適格機関投資家限<br>定)                     | 73,576円         | 11,460,038円     |

|    |                                    |                  |                  |
|----|------------------------------------|------------------|------------------|
|    | D I A Mバランス60V<br>A(適格機関投資家限<br>定) | 151,084円         | 283,672円         |
| 計  |                                    | 192,607,329,918円 | 135,913,743,805円 |
| 2. | 受益権の総数                             | 192,607,329,918口 | 135,913,743,805口 |



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日  | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。   | 同左                           |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                           |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。  | 同左                           |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は<br>ありません。   | 同左           |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「(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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。           | 同左           |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左           |

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類       | 平成25年1月11日現在              | 平成26年1月14日現在              |
|----------|---------------------------|---------------------------|
|          | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額(円) |
| 株式       | 23,967,239,175            | 42,184,166,839            |
| 投資信託受益証券 | 226,723,888               | 28,406,461                |
| 投資証券     | 570,431,456               | 226,080,969               |
| 合計       | 24,764,394,519            | 41,929,679,409            |

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

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

## （注）時価の算定方法

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

## 株式関連

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

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成26年1月14日現在

| 通貨      | 銘柄                              | 株式数     | 評価額     |                | 備考 |
|---------|---------------------------------|---------|---------|----------------|----|
|         |                                 |         | 単価      | 金額             |    |
| アメリカ・ドル | AMAZON.COM INC                  | 37,169  | 390.980 | 14,532,335.620 |    |
|         | ABBOTT LABORATORIES             | 157,441 | 39.110  | 6,157,517.510  |    |
|         | AES CORP                        | 75,129  | 14.260  | 1,071,339.540  |    |
|         | INTL BUSINESS MACHINES<br>CORP  | 106,042 | 184.160 | 19,528,694.720 |    |
|         | ADOBE SYSTEMS INC               | 47,588  | 58.600  | 2,788,656.800  |    |
|         | ACE LTD                         | 35,827  | 96.920  | 3,472,352.840  |    |
|         | AGCO CORP                       | 11,661  | 56.480  | 658,613.280    |    |
|         | AIRGAS INC                      | 6,292   | 110.000 | 692,120.000    |    |
|         | AIR PRODUCTS & CHEMICALS<br>INC | 20,869  | 108.580 | 2,265,956.020  |    |
|         | ENERGEN CORP                    | 8,985   | 65.640  | 589,775.400    |    |
|         | ALLEGHANY CORP                  | 1,956   | 391.020 | 764,835.120    |    |
|         | ALLERGAN INC                    | 30,222  | 114.420 | 3,458,001.240  |    |
|         | DU PONT (E.I.) DE NEMOURS       | 93,314  | 62.660  | 5,847,055.240  |    |

|                                 |         |         |                |  |
|---------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| RALPH LAUREN CORP               | 5,290   | 167.500 | 886,075.000    |  |
| ALLSTATE CORP                   | 48,737  | 53.460  | 2,605,480.020  |  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL<br>INC  | 77,010  | 88.870  | 6,843,878.700  |  |
| ALTERA CORPORATION              | 28,796  | 31.380  | 903,618.480    |  |
| ALCOA INC                       | 102,779 | 10.100  | 1,038,067.900  |  |
| AMGEN INC                       | 76,489  | 116.400 | 8,903,319.600  |  |
| HESS CORP                       | 30,613  | 78.870  | 2,414,447.310  |  |
| BEAM INC                        | 14,795  | 83.420  | 1,234,198.900  |  |
| AMERICAN EXPRESS CO             | 98,830  | 86.990  | 8,597,221.700  |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER         | 48,454  | 46.670  | 2,261,348.180  |  |
| AFLAC INC                       | 47,249  | 64.100  | 3,028,660.900  |  |
| AMERICAN INTL GROUP             | 144,852 | 51.460  | 7,454,083.920  |  |
| ANALOG DEVICES                  | 32,150  | 48.850  | 1,570,527.500  |  |
| ANADARKO PETROLEUM CORP         | 51,454  | 78.370  | 4,032,449.980  |  |
| ALEXION PHARMACEUTICALS<br>INC  | 19,920  | 130.590 | 2,601,352.800  |  |
| NABORS INDUSTRIES LTD           | 36,022  | 16.530  | 595,443.660    |  |
| TYCO INTERNATIONAL LTD          | 50,231  | 40.340  | 2,026,318.540  |  |
| TIME WARNER                     | 95,165  | 65.470  | 6,230,452.550  |  |
| VALERO ENERGY CORP              | 56,486  | 51.490  | 2,908,464.140  |  |
| APACHE CORP                     | 40,751  | 84.290  | 3,434,901.790  |  |
| ANSYS INC                       | 9,305   | 83.400  | 776,037.000    |  |
| APPLE INC                       | 92,754  | 535.730 | 49,691,100.420 |  |
| APPLIED MATERIALS INC           | 128,032 | 17.320  | 2,217,514.240  |  |
| ALBEMARLE CORP                  | 7,690   | 65.750  | 505,617.500    |  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO       | 65,752  | 41.530  | 2,730,680.560  |  |
| PINNACLE WEST CAPITAL<br>CORP   | 13,584  | 52.970  | 719,544.480    |  |
| AMEREN CORP                     | 25,297  | 36.230  | 916,510.310    |  |
| ARROW ELECTRONICS INC           | 11,621  | 52.210  | 606,732.410    |  |
| ASHLAND INC                     | 6,333   | 98.330  | 622,723.890    |  |
| AUTOLIV INC                     | 10,829  | 90.200  | 976,775.800    |  |
| AUTODESK INC                    | 20,701  | 51.570  | 1,067,550.570  |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING       | 48,043  | 79.050  | 3,797,799.150  |  |
| AUTOZONE INC                    | 3,337   | 486.380 | 1,623,050.060  |  |
| AVERY DENNISON CORP             | 8,865   | 50.360  | 446,441.400    |  |
| AVNET INC                       | 15,099  | 42.120  | 635,969.880    |  |
| AVON PRODUCTS INC               | 41,317  | 16.490  | 681,317.330    |  |
| BAKER HUGHES INC                | 44,146  | 52.550  | 2,319,872.300  |  |
| BALL CORP                       | 12,188  | 50.780  | 618,906.640    |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL<br>B  | 112,890 | 114.010 | 12,870,588.900 |  |
| BANK OF NEW YORK MELLON<br>CORP | 115,464 | 33.500  | 3,868,044.000  |  |
| CR BARD INC                     | 6,949   | 133.690 | 929,011.810    |  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC        | 55,596  | 70.100  | 3,897,279.600  |  |
| BED BATH & BEYOND INC           | 20,557  | 68.300  | 1,404,043.100  |  |
| BECTON DICKINSON & CO           | 19,000  | 111.060 | 2,110,140.000  |  |

|                                     |         |         |                |  |
|-------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| AMETEK INC                          | 25,338  | 51.660  | 1,308,961.080  |  |
| BE AEROSPACE INC                    | 10,265  | 82.920  | 851,173.800    |  |
| VERIZON COMM INC                    | 291,965 | 47.030  | 13,731,113.950 |  |
| WR BERKLEY CORP                     | 11,053  | 41.510  | 458,810.030    |  |
| BEST BUY CO INC                     | 26,686  | 36.860  | 983,645.960    |  |
| YUM! BRANDS INC                     | 46,751  | 73.410  | 3,431,990.910  |  |
| FIRSTENERGY CORP                    | 45,992  | 31.960  | 1,469,904.320  |  |
| SLM CORP                            | 49,666  | 26.950  | 1,338,498.700  |  |
| H&R BLOCK INC                       | 26,590  | 29.410  | 782,011.900    |  |
| ENSCO PLC-CL A                      | 22,819  | 55.290  | 1,261,662.510  |  |
| BOEING CO                           | 72,809  | 140.700 | 10,244,226.300 |  |
| ROBERT HALF INTL INC                | 14,807  | 40.370  | 597,758.590    |  |
| BORGWARNER INC                      | 20,836  | 55.570  | 1,157,856.520  |  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP              | 131,498 | 12.920  | 1,698,954.160  |  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE<br>INC      | 17,632  | 57.450  | 1,012,958.400  |  |
| METTLER TOLEDO<br>INTERNATIONAL INC | 2,922   | 247.270 | 722,522.940    |  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO             | 167,571 | 55.420  | 9,286,784.820  |  |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP<br>INC    | 5,422   | 208.920 | 1,132,764.240  |  |
| ONEOK INC                           | 20,139  | 63.310  | 1,275,000.090  |  |
| SEMPRA ENERGY                       | 22,909  | 90.860  | 2,081,511.740  |  |
| FEDEX CORP                          | 31,403  | 140.490 | 4,411,807.470  |  |
| VERISIGN INC                        | 16,877  | 60.330  | 1,018,189.410  |  |
| AMPHENOL CORP                       | 15,769  | 89.190  | 1,406,437.110  |  |
| BROWN-FORMAN CORP                   | 14,456  | 78.220  | 1,130,748.320  |  |
| QUANTA SERVICES INC                 | 25,480  | 31.150  | 793,702.000    |  |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS<br>INC       | 18,492  | 33.130  | 612,639.960    |  |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC              | 345,664 | 3.670   | 1,268,586.880  |  |
| CSX CORP                            | 105,721 | 28.430  | 3,005,648.030  |  |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY<br>GRP-A     | 20,538  | 16.710  | 343,189.980    |  |
| CABOT OIL & GAS CORP                | 46,124  | 36.440  | 1,680,758.560  |  |
| CAMPBELL SOUP CO                    | 22,764  | 42.250  | 961,779.000    |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY                  | 32,204  | 58.540  | 1,885,222.160  |  |
| WHITING PETROLEUM CORP              | 13,133  | 58.710  | 771,038.430    |  |
| CONSTELLATION BRANDS INC            | 16,362  | 80.060  | 1,309,941.720  |  |
| CARDINAL HEALTH INC                 | 33,720  | 67.950  | 2,291,274.000  |  |
| CARNIVAL CORP COMMON<br>PAIRED      | 37,957  | 41.420  | 1,572,178.940  |  |
| CATERPILLAR INC                     | 65,969  | 89.890  | 5,929,953.410  |  |
| CELGENE CORP                        | 42,543  | 164.900 | 7,015,340.700  |  |
| CORE LABORATORIES N.V.              | 4,891   | 187.210 | 915,644.110    |  |
| CITRIX SYSTEMS INC                  | 19,857  | 58.790  | 1,167,393.030  |  |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP              | 58,295  | 25.150  | 1,466,119.250  |  |
| CENTURYLINK INC                     | 63,731  | 30.870  | 1,967,375.970  |  |
| CERNER CORP                         | 33,863  | 53.830  | 1,822,845.290  |  |

|                                   |         |         |                |  |
|-----------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| JPMORGAN CHASE & CO               | 383,778 | 57.700  | 22,143,990.600 |  |
| CHUBB CORP                        | 26,934  | 90.110  | 2,427,022.740  |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC            | 12,581  | 65.260  | 821,036.060    |  |
| CIGNA CORP                        | 29,425  | 88.780  | 2,612,351.500  |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP         | 16,516  | 50.510  | 834,223.160    |  |
| CINTAS CORP                       | 8,876   | 58.480  | 519,068.480    |  |
| FRONTIER COMMUNICATIONS<br>CORP   | 134,501 | 4.700   | 632,154.700    |  |
| CISCO SYSTEMS INC                 | 543,117 | 22.190  | 12,051,766.230 |  |
| CHICAGO BRIDGE & IRON CO<br>NV    | 9,607   | 80.450  | 772,883.150    |  |
| CLOROX COMPANY                    | 15,155  | 89.100  | 1,350,310.500  |  |
| EQUINIX INC                       | 5,159   | 174.920 | 902,412.280    |  |
| COCA-COLA CO/THE                  | 406,611 | 39.530  | 16,073,332.830 |  |
| COCA-COLA ENTERPRISES<br>INC      | 24,325  | 43.910  | 1,068,110.750  |  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO              | 94,230  | 64.690  | 6,095,738.700  |  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL<br>A    | 21,321  | 48.750  | 1,039,398.750  |  |
| COMCAST CORP-SPECIAL CL A         | 48,067  | 50.240  | 2,414,886.080  |  |
| COMERICA INC                      | 18,671  | 47.220  | 881,644.620    |  |
| NRG ENERGY, INC.                  | 33,814  | 27.460  | 928,532.440    |  |
| COMCAST CORP-CL A                 | 217,413 | 52.160  | 11,340,262.080 |  |
| CA INC                            | 30,767  | 33.440  | 1,028,848.480  |  |
| COMPUTER SCIENCES CORP            | 16,463  | 54.750  | 901,349.250    |  |
| CONAGRA FOODS INC                 | 45,240  | 33.570  | 1,518,706.800  |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC           | 28,579  | 53.920  | 1,540,979.680  |  |
| CMS ENERGY CORP                   | 20,017  | 26.730  | 535,054.410    |  |
| CAMERON INTERNATIONAL<br>CORP     | 26,380  | 57.650  | 1,520,807.000  |  |
| MOLSON COORS BREWING CO           | 17,190  | 55.940  | 961,608.600    |  |
| CORNING INC                       | 155,504 | 18.020  | 2,802,182.080  |  |
| DIRECTV                           | 54,604  | 70.710  | 3,861,048.840  |  |
| CREE INC                          | 13,242  | 61.060  | 808,556.520    |  |
| SEALED AIR CORP                   | 20,323  | 33.270  | 676,146.210    |  |
| BROADCOM CORP-CL A                | 55,671  | 28.720  | 1,598,871.120  |  |
| CUMMINS INC                       | 18,380  | 136.150 | 2,502,437.000  |  |
| L-3 COMMUNICATIONS<br>HOLDINGS    | 8,350   | 105.660 | 882,261.000    |  |
| DR HORTON INC                     | 34,671  | 21.550  | 747,160.050    |  |
| DANAHER CORP                      | 59,746  | 76.150  | 4,549,657.900  |  |
| MOODY'S CORP                      | 19,691  | 75.080  | 1,478,400.280  |  |
| COGNIZANT TECHNOLOGY<br>SOLUTIONS | 30,639  | 98.210  | 3,009,056.190  |  |
| TARGET CORP                       | 63,175  | 61.500  | 3,885,262.500  |  |
| DIAMOND OFFSHORE DRILLING         | 6,668   | 54.570  | 363,872.760    |  |
| DEERE & CO                        | 37,524  | 89.510  | 3,358,773.240  |  |
| MORGAN STANLEY                    | 147,597 | 30.870  | 4,556,319.390  |  |
| REPUBLIC SERVICES INC             | 29,354  | 32.040  | 940,502.160    |  |

|                                   |           |         |                |  |
|-----------------------------------|-----------|---------|----------------|--|
| THE WALT DISNEY CO                | 172,342   | 73.270  | 12,627,498.340 |  |
| DOLLAR TREE INC                   | 24,068    | 55.130  | 1,326,868.840  |  |
| DOVER CORP                        | 18,750    | 93.150  | 1,746,562.500  |  |
| DOW CHEMICAL                      | 121,961   | 41.890  | 5,108,946.290  |  |
| OMNICOM GROUP                     | 27,703    | 71.510  | 1,981,041.530  |  |
| DTE ENERGY CO                     | 19,035    | 66.050  | 1,257,261.750  |  |
| XL GROUP PLC                      | 26,332    | 29.860  | 786,273.520    |  |
| DUKE ENERGY CORP                  | 71,547    | 67.770  | 4,848,740.190  |  |
| CROWN CASTLE<br>INTERNATIONAL COR | 32,561    | 71.600  | 2,331,367.600  |  |
| FLOWSERVE CORP                    | 12,469    | 75.400  | 940,162.600    |  |
| DARDEN RESTAURANTS INC            | 13,828    | 50.830  | 702,877.240    |  |
| EBAY INC                          | 119,842   | 52.540  | 6,296,498.680  |  |
| EMC CORP/MASS                     | 210,363   | 25.140  | 5,288,525.820  |  |
| BANK OF AMERICA CORP              | 1,093,077 | 16.430  | 17,959,255.110 |  |
| CITIGROUP INC                     | 308,990   | 53.720  | 16,598,942.800 |  |
| EASTMAN CHEMICAL CO               | 16,731    | 78.170  | 1,307,862.270  |  |
| EATON CORP PLC                    | 48,113    | 74.070  | 3,563,729.910  |  |
| EATON VANCE CORP                  | 12,917    | 40.430  | 522,234.310    |  |
| DISH NETWORK CORP                 | 23,833    | 55.950  | 1,333,456.350  |  |
| ECOLAB INC                        | 27,290    | 103.100 | 2,813,599.000  |  |
| ELECTRONIC ARTS INC               | 35,610    | 22.380  | 796,951.800    |  |
| SALESFORCE.COM INC                | 59,007    | 56.210  | 3,316,783.470  |  |
| EMERSON ELECTRIC CO               | 72,168    | 68.050  | 4,911,032.400  |  |
| WEATHERFORD INTL LTD              | 73,546    | 14.290  | 1,050,972.340  |  |
| ENERGY CORP                       | 16,359    | 60.620  | 991,682.580    |  |
| EOG RESOURCES INC                 | 27,383    | 163.460 | 4,476,025.180  |  |
| EQUIFAX INC                       | 11,487    | 67.450  | 774,798.150    |  |
| EQT CORP                          | 14,624    | 84.350  | 1,233,534.400  |  |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE          | 23,912    | 73.840  | 1,765,662.080  |  |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL          | 20,066    | 44.220  | 887,318.520    |  |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING<br>CO     | 82,264    | 72.620  | 5,974,011.680  |  |
| EXXON MOBIL CORP                  | 449,640   | 98.550  | 44,312,022.000 |  |
| FMC CORP                          | 12,155    | 72.850  | 885,491.750    |  |
| NEXTERA ENERGY INC                | 42,705    | 86.680  | 3,701,669.400  |  |
| FAMILY DOLLAR STORES              | 10,460    | 65.000  | 679,900.000    |  |
| ASSURANT INC                      | 8,352     | 66.630  | 556,493.760    |  |
| FASTENAL CO                       | 30,809    | 47.430  | 1,461,270.870  |  |
| FIFTH THIRD BANCORP               | 87,505    | 21.250  | 1,859,481.250  |  |
| M&T BANK CORP                     | 11,528    | 114.350 | 1,318,226.800  |  |
| TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS<br>CORP   | 11,007    | 72.220  | 794,925.540    |  |
| FISERV INC                        | 26,258    | 57.390  | 1,506,946.620  |  |
| FLIR SYSTEMS INC                  | 14,422    | 32.460  | 468,138.120    |  |
| MACY'S INC                        | 40,826    | 55.260  | 2,256,044.760  |  |
| FORD MOTOR CO                     | 371,524   | 16.110  | 5,985,251.640  |  |
| FOREST LABORATORIES INC           | 24,901    | 67.730  | 1,686,544.730  |  |
| FOSSIL GROUP INC                  | 5,086     | 114.580 | 582,753.880    |  |



|                                  |           |         |                |  |
|----------------------------------|-----------|---------|----------------|--|
| FRANKLIN RESOURCES INC           | 39,798    | 56.780  | 2,259,730.440  |  |
| FREEMPORT-MCMORAN<br>COPPER&GOLD | 105,847   | 35.630  | 3,771,328.610  |  |
| FLEXTRONICS INTL LTD             | 74,709    | 7.620   | 569,282.580    |  |
| GAP INC/THE                      | 34,421    | 38.250  | 1,316,603.250  |  |
| DENTSPLY INTERNATIONAL<br>INC    | 15,658    | 48.310  | 756,437.980    |  |
| GENERAL DYNAMICS CORP            | 29,851    | 95.010  | 2,836,143.510  |  |
| GENERAL MILLS INC                | 65,106    | 48.810  | 3,177,823.860  |  |
| GENUINE PARTS CO                 | 14,679    | 81.630  | 1,198,246.770  |  |
| GILEAD SCIENCES INC              | 155,525   | 73.140  | 11,375,098.500 |  |
| STARWOOD HOTELS&RESORTS          | 17,970    | 77.240  | 1,388,002.800  |  |
| MCKESSON CORP                    | 23,752    | 167.140 | 3,969,909.280  |  |
| NVIDIA CORP                      | 51,123    | 15.360  | 785,249.280    |  |
| GENERAL ELECTRIC CO              | 1,039,570 | 26.730  | 27,787,706.100 |  |
| WW GRAINGER INC                  | 5,965     | 261.660 | 1,560,801.900  |  |
| GREEN MOUNTAIN COFFEE<br>ROASTE  | 12,666    | 79.410  | 1,005,807.060  |  |
| LIFE TECHNOLOGIES CORP           | 16,876    | 75.850  | 1,280,044.600  |  |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC        | 22,236    | 14.820  | 329,537.520    |  |
| HALLIBURTON CO                   | 88,400    | 49.580  | 4,382,872.000  |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP            | 16,686    | 69.720  | 1,163,347.920  |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC          | 43,162    | 175.880 | 7,591,332.560  |  |
| HARLEY-DAVIDSON INC              | 21,132    | 67.190  | 1,419,859.080  |  |
| HARRIS CORP                      | 10,776    | 67.950  | 732,229.200    |  |
| CONSOL ENERGY INC                | 22,051    | 36.410  | 802,876.910    |  |
| HASBRO INC                       | 11,176    | 52.250  | 583,946.000    |  |
| HENRY SCHEIN INC                 | 7,142     | 114.310 | 816,402.020    |  |
| DENBURY RESOURCES INC            | 28,517    | 16.070  | 458,268.190    |  |
| HELMERICH & PAYNE INC            | 9,929     | 83.700  | 831,057.300    |  |
| HERSHEY FOODS CORP               | 16,263    | 97.850  | 1,591,334.550  |  |
| HEWLETT-PACKARD CO               | 197,600   | 28.120  | 5,556,512.000  |  |
| F5 NETWORKS INC                  | 7,198     | 92.010  | 662,287.980    |  |
| CROWN HOLDINGS INC NPR           | 12,919    | 43.130  | 557,196.470    |  |
| REYNOLDS AMERICAN INC            | 32,398    | 48.110  | 1,558,667.780  |  |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-<br>CL A | 14,788    | 89.120  | 1,317,906.560  |  |
| JUNIPER NETWORKS INC             | 48,236    | 25.320  | 1,221,335.520  |  |
| HOLLYFRONTIER CORP               | 19,247    | 48.730  | 937,906.310    |  |
| HOLOGIC INC                      | 24,876    | 21.800  | 542,296.800    |  |
| UNUM GROUP                       | 30,372    | 33.960  | 1,031,433.120  |  |
| HOME DEPOT INC                   | 147,644   | 80.970  | 11,954,734.680 |  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL<br>INC   | 13,878    | 68.640  | 952,585.920    |  |
| HORMEL FOODS CORP                | 14,878    | 45.110  | 671,146.580    |  |
| HUDSON CITY BANCORP INC          | 61,279    | 9.250   | 566,830.750    |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC           | 43,422    | 23.040  | 1,000,442.880  |  |
| HUMANA INC                       | 15,524    | 96.030  | 1,490,769.720  |  |

|                                |         |         |                |  |
|--------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 9,635   | 77.800  | 749,603.000    |  |
| RED HAT INC                    | 20,247  | 57.560  | 1,165,417.320  |  |
| BIOGEN IDEC INC                | 24,030  | 283.670 | 6,816,590.100  |  |
| ILLINOIS TOOL WORKS            | 42,995  | 81.110  | 3,487,324.450  |  |
| INTUIT INC                     | 27,600  | 75.010  | 2,070,276.000  |  |
| INGERSOLL-RAND PLC             | 28,100  | 61.730  | 1,734,613.000  |  |
| INTEL CORP                     | 506,921 | 25.500  | 12,926,485.500 |  |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES      | 9,998   | 84.790  | 847,730.420    |  |
| INTL GAME TECH                 | 20,749  | 16.950  | 351,695.550    |  |
| INTERNATIONAL PAPER CO         | 43,061  | 48.130  | 2,072,525.930  |  |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC   | 36,872  | 17.410  | 641,941.520    |  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC   | 14,497  | 64.340  | 932,736.980    |  |
| JOHNSON & JOHNSON              | 287,687 | 94.500  | 27,186,421.500 |  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP    | 41,564  | 34.770  | 1,445,180.280  |  |
| JOHNSON CONTROLS INC           | 69,702  | 51.190  | 3,568,045.380  |  |
| KLA-TENCOR CORP                | 16,662  | 62.310  | 1,038,209.220  |  |
| DEVON ENERGY CORP              | 38,601  | 59.180  | 2,284,407.180  |  |
| KELLOGG CO                     | 28,361  | 60.430  | 1,713,855.230  |  |
| KEYCORP                        | 86,740  | 13.470  | 1,168,387.800  |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP            | 38,888  | 104.730 | 4,072,740.240  |  |
| BLACKROCK INC/NEW YORK         | 14,098  | 306.470 | 4,320,614.060  |  |
| KOHL'S CORP                    | 23,092  | 53.460  | 1,234,498.320  |  |
| KROGER CO                      | 48,049  | 38.610  | 1,855,171.890  |  |
| LSI CORP                       | 55,560  | 10.970  | 609,493.200    |  |
| LAM RESEARCH CORP              | 14,133  | 54.580  | 771,379.140    |  |
| AKAMAI TECHNOLOGIES            | 17,064  | 46.300  | 790,063.200    |  |
| LEGG MASON INC                 | 13,165  | 43.260  | 569,517.900    |  |
| LEGGETT & PLATT INC            | 8,522   | 29.790  | 253,870.380    |  |
| LENNAR CORP                    | 18,341  | 38.180  | 700,259.380    |  |
| LEUCADIA NATIONAL CORP         | 36,049  | 27.370  | 986,661.130    |  |
| ELI LILLY & CO                 | 102,969 | 52.070  | 5,361,595.830  |  |
| L BRANDS INC                   | 26,970  | 56.610  | 1,526,771.700  |  |
| LINCOLN NATIONAL CORP          | 28,925  | 51.060  | 1,476,910.500  |  |
| LINEAR TECH CORP               | 23,086  | 44.490  | 1,027,096.140  |  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B     | 73,308  | 100.230 | 7,347,660.840  |  |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC       | 34,061  | 58.930  | 2,007,214.730  |  |
| LOCKHEED MARTIN CORP           | 27,544  | 150.920 | 4,156,940.480  |  |
| LOEWS CORP                     | 33,738  | 46.330  | 1,563,081.540  |  |
| RANGE RESOURCES CORP           | 17,434  | 79.670  | 1,388,966.780  |  |
| LOWE'S COS INC                 | 106,220 | 48.660  | 5,168,665.200  |  |
| DOMINION RESOURCES INC/VA      | 60,588  | 67.170  | 4,069,695.960  |  |
| IRON MOUNTAIN INC              | 12,968  | 27.690  | 359,083.920    |  |
| SCANA CORP                     | 9,574   | 46.400  | 444,233.600    |  |
| MDU RESOURCES GROUP INC        | 21,313  | 30.470  | 649,407.110    |  |

|                                  |         |         |                |  |
|----------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| MGM RESORTS INTERNATIONAL        | 41,258  | 25.250  | 1,041,764.500  |  |
| MCCORMICK & CO INC               | 14,416  | 69.230  | 998,019.680    |  |
| MCDONALD'S CORPORATION           | 102,385 | 94.830  | 9,709,169.550  |  |
| MCGRAW-HILL FINANCIAL INC        | 26,382  | 76.630  | 2,021,652.660  |  |
| EVEREST RE GROUP LTD             | 5,049   | 147.010 | 742,253.490    |  |
| MANPOWERGROUP INC                | 7,953   | 84.260  | 670,119.780    |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP<br>NPR | 12,156  | 68.740  | 835,603.440    |  |
| MARSH & MCLENNAN COS             | 56,000  | 47.390  | 2,653,840.000  |  |
| ENERGIZER HOLDINGS INC           | 7,466   | 104.990 | 783,855.340    |  |
| MASCO CORP                       | 37,719  | 22.700  | 856,221.300    |  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS<br>INC | 5,102   | 105.250 | 536,985.500    |  |
| MATTEL INC                       | 37,311  | 44.660  | 1,666,309.260  |  |
| METLIFE INC                      | 93,799  | 52.970  | 4,968,533.030  |  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS        | 34,242  | 27.960  | 957,406.320    |  |
| MEDTRONIC INC                    | 103,783 | 59.250  | 6,149,142.750  |  |
| ACTIVISION BLIZZARD INC          | 54,156  | 17.870  | 967,767.720    |  |
| CVS CAREMARK CORP                | 127,599 | 68.550  | 8,746,911.450  |  |
| MERCK & CO. INC.                 | 298,696 | 53.120  | 15,866,731.520 |  |
| LABORATORY CRP OF AMER<br>HLDGS  | 10,600  | 90.700  | 961,420.000    |  |
| MICROSOFT CORP                   | 807,386 | 34.990  | 28,250,436.140 |  |
| MICRON TECH INC                  | 103,537 | 23.330  | 2,415,518.210  |  |
| RACKSPACE HOSTING INC            | 13,630  | 35.830  | 488,362.900    |  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC         | 18,985  | 45.150  | 857,172.750    |  |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP<br>LTD  | 50,668  | 15.230  | 771,673.640    |  |
| 3M CO                            | 66,174  | 134.680 | 8,912,314.320  |  |
| MOHAWK INDUSTRIES INC            | 7,039   | 146.690 | 1,032,550.910  |  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC           | 24,610  | 65.490  | 1,611,708.900  |  |
| KANSAS CITY SOUTHERN             | 10,506  | 116.010 | 1,218,801.060  |  |
| MURPHY OIL CORPORATION           | 17,184  | 62.340  | 1,071,250.560  |  |
| MYLAN LABORATORIES               | 37,298  | 45.240  | 1,687,361.520  |  |
| ILLUMINA INC                     | 13,717  | 113.930 | 1,562,777.810  |  |
| XCEL ENERGY INC                  | 48,810  | 28.040  | 1,368,632.400  |  |
| NATIONAL OILWELL VARCO<br>INC    | 45,346  | 76.740  | 3,479,852.040  |  |
| NETAPP INC                       | 33,354  | 39.700  | 1,324,153.800  |  |
| SEARS HOLDINGS CORP              | 4,862   | 35.460  | 172,406.520    |  |
| NEWELL RUBBERMAID INC            | 29,362  | 31.680  | 930,188.160    |  |
| DUN & BRADSTREET CORP            | 3,677   | 119.380 | 438,960.260    |  |
| NEWMONT MINING CORP              | 49,529  | 23.880  | 1,182,752.520  |  |
| NIKE INC-CL B                    | 72,273  | 75.180  | 5,433,484.140  |  |
| NOBLE ENERGY INC                 | 35,626  | 63.170  | 2,250,494.420  |  |
| NORDSTROM INC                    | 13,411  | 59.490  | 797,820.390    |  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP            | 32,257  | 90.190  | 2,909,258.830  |  |
| NORTHEAST UTILITIES              | 34,447  | 42.330  | 1,458,141.510  |  |
| NISOURCE INC                     | 33,928  | 33.240  | 1,127,766.720  |  |

|                                  |         |         |                |  |
|----------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| COACH INC                        | 30,955  | 54.300  | 1,680,856.500  |  |
| TOWERS WATSON & COMPANY          | 6,639   | 127.070 | 843,617.730    |  |
| NORTHERN TRUST CORP              | 22,009  | 60.430  | 1,330,003.870  |  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP            | 21,819  | 115.630 | 2,522,930.970  |  |
| WELLS FARGO & CO                 | 515,521 | 45.560  | 23,487,136.760 |  |
| NUCOR CORP                       | 35,421  | 51.540  | 1,825,598.340  |  |
| MONSANTO CO                      | 54,120  | 111.400 | 6,028,968.000  |  |
| CHENIERE ENERGY INC              | 23,885  | 45.060  | 1,076,258.100  |  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL<br>CORP    | 61,482  | 76.370  | 4,695,380.340  |  |
| OCWEN FINANCIAL CORP             | 12,196  | 55.200  | 673,219.200    |  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP        | 82,883  | 91.540  | 7,587,109.820  |  |
| OCEANEERING INTERNATIONAL<br>INC | 9,081   | 74.030  | 672,266.430    |  |
| OGE ENERGY CORP                  | 22,050  | 33.580  | 740,439.000    |  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC          | 12,078  | 130.220 | 1,572,797.160  |  |
| OMNICARE INC                     | 12,226  | 62.210  | 760,579.460    |  |
| ORACLE CORP                      | 353,534 | 37.750  | 13,345,908.500 |  |
| OWENS-ILLINOIS INC               | 19,173  | 33.870  | 649,389.510    |  |
| PACCAR INC                       | 34,453  | 58.400  | 2,012,055.200  |  |
| PALL CORP                        | 10,048  | 83.190  | 835,893.120    |  |
| EXELON CORP                      | 85,567  | 26.980  | 2,308,597.660  |  |
| PARKER HANNIFIN CORP             | 16,001  | 125.620 | 2,010,045.620  |  |
| PARTNERRE LTD                    | 3,890   | 99.900  | 388,611.000    |  |
| PATTERSON COS INC                | 4,032   | 40.510  | 163,336.320    |  |
| PAYCHEX INC                      | 32,595  | 43.580  | 1,420,490.100  |  |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD        | 13,943  | 45.770  | 638,171.110    |  |
| PPL CORPORATION                  | 64,994  | 30.140  | 1,958,919.160  |  |
| PEPSICO INC                      | 157,377 | 82.370  | 12,963,143.490 |  |
| PENTAIR LTD                      | 19,696  | 75.080  | 1,478,775.680  |  |
| PFIZER INC                       | 676,001 | 30.540  | 20,645,070.540 |  |
| CONOCOPHILLIPS                   | 118,436 | 67.740  | 8,022,854.640  |  |
| PVH CORP                         | 7,894   | 129.550 | 1,022,667.700  |  |
| PETSMART INC                     | 8,567   | 66.780  | 572,104.260    |  |
| PG&E CORP                        | 44,930  | 40.290  | 1,810,229.700  |  |
| PHARMACYCLICS INC                | 5,559   | 130.530 | 725,616.270    |  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES<br>CO  | 14,788  | 164.780 | 2,436,766.640  |  |
| ALTRIA GROUP INC                 | 208,659 | 37.090  | 7,739,162.310  |  |
| PNC FINANCIAL SERVICES<br>GROUP  | 56,300  | 77.370  | 4,355,931.000  |  |
| POLARIS INDUSTRIES INC           | 6,387   | 138.970 | 887,601.390    |  |
| GARMIN LTD                       | 13,579  | 45.410  | 616,622.390    |  |
| AETNA INC                        | 38,540  | 71.040  | 2,737,881.600  |  |
| FLUOR CORP (NEW)                 | 17,508  | 78.040  | 1,366,324.320  |  |
| PPG INDUSTRIES INC               | 14,182  | 187.760 | 2,662,812.320  |  |
| PRAXAIR INC                      | 30,530  | 130.800 | 3,993,324.000  |  |
| PRECISION CASTPARTS CORP         | 15,193  | 269.000 | 4,086,917.000  |  |
| COSTCO WHOLESALE CORP            | 45,160  | 114.770 | 5,183,013.200  |  |

|                                   |         |           |                |  |
|-----------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| T ROWE PRICE GROUP INC            | 27,682  | 82.350    | 2,279,612.700  |  |
| QUEST DIAGNOSTICS                 | 14,594  | 53.750    | 784,427.500    |  |
| PROCTER & GAMBLE CO               | 279,844 | 80.010    | 22,390,318.440 |  |
| PROGRESSIVE CORP                  | 63,937  | 25.700    | 1,643,180.900  |  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE<br>GP   | 49,488  | 31.570    | 1,562,336.160  |  |
| PULTE GROUP INC                   | 40,688  | 19.400    | 789,347.200    |  |
| NEW YORK COMMUNITY<br>BANCORP INC | 47,010  | 16.940    | 796,349.400    |  |
| QUALCOMM INC                      | 174,034 | 73.220    | 12,742,769.480 |  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL<br>INC    | 10,374  | 52.580    | 545,464.920    |  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS<br>LTD     | 5,570   | 90.200    | 502,414.000    |  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS         | 7,865   | 268.680   | 2,113,168.200  |  |
| RESMED INC                        | 16,867  | 46.830    | 789,881.610    |  |
| US BANCORP                        | 187,987 | 40.780    | 7,666,109.860  |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD            | 14,613  | 55.140    | 805,760.820    |  |
| ROSS STORES INC                   | 21,400  | 73.290    | 1,568,406.000  |  |
| ROCK-TENN COMPANY -CL A           | 8,374   | 99.660    | 834,552.840    |  |
| ROPER INDUSTRIES INC              | 9,399   | 137.980   | 1,296,874.020  |  |
| ROWAN COMPANIES PLC-A             | 13,327  | 32.830    | 437,525.410    |  |
| PEABODY ENERGY CORP               | 33,467  | 17.360    | 580,987.120    |  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC           | 14,791  | 115.070   | 1,702,000.370  |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES<br>LTD    | 16,326  | 48.760    | 796,055.760    |  |
| RAYTHEON COMPANY                  | 33,183  | 89.930    | 2,984,147.190  |  |
| KINDER MORGAN MANAGEMENT<br>LLC   | 11,615  | 75.100    | 872,286.500    |  |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS<br>CORP     | 4,580   | 251.010   | 1,149,625.800  |  |
| FMC TECHNOLOGIES INC              | 22,653  | 51.050    | 1,156,435.650  |  |
| ACCENTURE PLC-CL A                | 65,120  | 81.060    | 5,278,627.200  |  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL<br>INC     | 170,829 | 35.200    | 6,013,180.800  |  |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC         | 18,347  | 44.070    | 808,552.290    |  |
| SANDISK CORP                      | 24,773  | 71.180    | 1,763,342.140  |  |
| SAFEWAY INC                       | 23,620  | 31.670    | 748,045.400    |  |
| ROCKWELL COLLINS INC              | 13,494  | 75.140    | 1,013,939.160  |  |
| ST JUDE MEDICAL INC               | 30,560  | 66.380    | 2,028,572.800  |  |
| THE TRAVELERS COMPANIES<br>INC    | 39,444  | 86.340    | 3,405,594.960  |  |
| FIDELITY NATIONAL<br>INFORMATION  | 29,320  | 52.040    | 1,525,812.800  |  |
| PRICELINE.COM INC                 | 5,196   | 1,139.720 | 5,921,985.120  |  |
| SCHLUMBERGER LTD                  | 134,571 | 87.460    | 11,769,579.660 |  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP             | 117,670 | 24.830    | 2,921,746.100  |  |
| JOY GLOBAL INC                    | 12,702  | 54.890    | 697,212.780    |  |
| ZIMMER HOLDINGS INC               | 17,978  | 95.650    | 1,719,595.700  |  |

|                                   |         |         |                |  |
|-----------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| SPX CORP                          | 3,361   | 99.480  | 334,352.280    |  |
| BUNGE LTD                         | 13,535  | 81.060  | 1,097,147.100  |  |
| SEI INVESTMENTS CO                | 15,882  | 33.740  | 535,858.680    |  |
| WELLPOINT INC                     | 31,319  | 90.840  | 2,845,017.960  |  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP            | 22,772  | 70.610  | 1,607,930.920  |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP         | 32,264  | 47.720  | 1,539,638.080  |  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE           | 8,538   | 191.190 | 1,632,380.220  |  |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES<br>INC   | 16,617  | 24.820  | 412,433.940    |  |
| SIGMA-ALDRICH                     | 11,301  | 91.470  | 1,033,702.470  |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC          | 46,269  | 88.530  | 4,096,194.570  |  |
| ADVANCE AUTO PARTS                | 7,875   | 114.290 | 900,033.750    |  |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO            | 34,348  | 38.070  | 1,307,628.360  |  |
| EDISON INTERNATIONAL              | 34,152  | 45.480  | 1,553,232.960  |  |
| SOUTHERN CO                       | 87,757  | 41.270  | 3,621,731.390  |  |
| BB&T CORP                         | 73,195  | 38.540  | 2,820,935.300  |  |
| SOUTHWEST AIRLINES                | 17,528  | 20.720  | 363,180.160    |  |
| AT&T INC                          | 542,288 | 33.300  | 18,058,190.400 |  |
| CHEVRON CORP                      | 197,149 | 119.250 | 23,510,018.250 |  |
| MEADWESTVACO CORP                 | 16,496  | 35.020  | 577,689.920    |  |
| STANLEY BLACK & DECKER<br>INC     | 14,726  | 80.150  | 1,180,288.900  |  |
| STAPLES INC                       | 72,899  | 14.500  | 1,057,035.500  |  |
| STATE STREET CORP                 | 47,154  | 72.930  | 3,438,941.220  |  |
| STARBUCKS CORP                    | 78,597  | 75.120  | 5,904,206.640  |  |
| STRYKER CORP                      | 29,747  | 77.430  | 2,303,310.210  |  |
| NETFLIX INC                       | 5,640   | 336.810 | 1,899,608.400  |  |
| STERICYCLE INC                    | 7,859   | 115.020 | 903,942.180    |  |
| SUNTRUST BANKS INC                | 54,576  | 38.150  | 2,082,074.400  |  |
| SYMANTEC CORP                     | 76,489  | 22.200  | 1,698,055.800  |  |
| SYNOPSIS INC                      | 14,312  | 40.640  | 581,639.680    |  |
| SYSCO CORP                        | 59,058  | 36.280  | 2,142,624.240  |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC            | 4,432   | 393.350 | 1,743,327.200  |  |
| TESORO CORP                       | 15,352  | 54.810  | 841,443.120    |  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC             | 110,530 | 42.240  | 4,668,787.200  |  |
| TEXTRON INC                       | 25,116  | 34.750  | 872,781.000    |  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC<br>INC   | 37,264  | 112.990 | 4,210,459.360  |  |
| TIFFANY & CO                      | 12,040  | 87.440  | 1,052,777.600  |  |
| TOLL BROTHERS INC                 | 17,142  | 36.070  | 618,311.940    |  |
| TORCHMARK CORP                    | 9,110   | 77.170  | 703,018.700    |  |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC         | 13,637  | 32.030  | 436,793.110    |  |
| DAVITA HEALTHCARE<br>PARTNERS INC | 17,040  | 64.470  | 1,098,568.800  |  |
| TRACTOR SUPPLY CO                 | 15,159  | 73.400  | 1,112,670.600  |  |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD            | 23,388  | 33.670  | 787,473.960    |  |
| TYSON FOODS INC                   | 28,867  | 33.900  | 978,591.300    |  |
| MARATHON OIL CORP                 | 70,393  | 34.110  | 2,401,105.230  |  |
| UNION PACIFIC CORP                | 47,799  | 168.050 | 8,032,621.950  |  |

|                                  |         |           |                |  |
|----------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| UNITED TECHNOLOGIES CORP         | 88,532  | 112.800   | 9,986,409.600  |  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC           | 105,909 | 73.940    | 7,830,911.460  |  |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES<br>INC | 9,035   | 83.990    | 758,849.650    |  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS<br>INC    | 10,927  | 79.500    | 868,696.500    |  |
| VF CORP                          | 37,944  | 60.230    | 2,285,367.120  |  |
| CBS CORP                         | 57,668  | 60.940    | 3,514,287.920  |  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS<br>INC    | 23,298  | 77.040    | 1,794,877.920  |  |
| VULCAN MATERIALS CO              | 15,610  | 58.660    | 915,682.600    |  |
| URBAN OUTFITTERS INC             | 13,462  | 36.890    | 496,613.180    |  |
| WALGREEN CO                      | 91,195  | 60.200    | 5,489,939.000  |  |
| WAL-MART STORES INC              | 167,855 | 77.490    | 13,007,083.950 |  |
| WASTE MANAGEMENT INC             | 46,499  | 43.030    | 2,000,851.970  |  |
| WATERS CORP                      | 8,002   | 100.510   | 804,281.020    |  |
| ACTAVIS PLC                      | 18,272  | 181.290   | 3,312,530.880  |  |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW            | 10,083  | 97.390    | 981,983.370    |  |
| WESTERN DIGITAL CORP             | 23,595  | 84.610    | 1,996,372.950  |  |
| WHIRLPOOL CORP                   | 7,676   | 153.500   | 1,178,266.000  |  |
| WYNN RESORTS LTD                 | 7,511   | 203.470   | 1,528,263.170  |  |
| WHOLE FOODS MARKET INC           | 34,963  | 52.500    | 1,835,557.500  |  |
| NASDAQ OMX GROUP                 | 10,282  | 39.150    | 402,540.300    |  |
| CME GROUP INC                    | 33,607  | 74.020    | 2,487,590.140  |  |
| WILLIAMS COS INC                 | 69,554  | 39.040    | 2,715,388.160  |  |
| DICK'S SPORTING GOODS INC        | 8,716   | 54.260    | 472,930.160    |  |
| LKQ CORP                         | 28,289  | 32.260    | 912,603.140    |  |
| PEPCO HOLDINGS INC               | 18,195  | 18.790    | 341,884.050    |  |
| ALLIANT ENERGY CORP              | 10,609  | 51.350    | 544,772.150    |  |
| WISCONSIN ENERGY CORP            | 20,446  | 40.990    | 838,081.540    |  |
| INTEGRYS ENERGY GROUP INC        | 7,824   | 53.610    | 419,444.640    |  |
| TD AMERITRADE HOLDING<br>CORP    | 24,850  | 30.570    | 759,664.500    |  |
| CARMAX INC                       | 24,979  | 45.220    | 1,129,550.380  |  |
| XEROX CORP                       | 127,501 | 12.210    | 1,556,787.210  |  |
| XILINX INC                       | 24,251  | 45.180    | 1,095,660.180  |  |
| YAHOO! INC                       | 99,997  | 39.990    | 3,998,880.030  |  |
| CIMAREX ENERGY CO                | 9,368   | 92.730    | 868,694.640    |  |
| TJX COMPANIES INC                | 71,898  | 62.910    | 4,523,103.180  |  |
| HOSPIRA INC                      | 15,624  | 41.690    | 651,364.560    |  |
| CBRE GROUP INC                   | 28,979  | 26.200    | 759,249.800    |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC               | 24,021  | 89.760    | 2,156,124.960  |  |
| REGIONS FINANCIAL CORP           | 138,567 | 10.310    | 1,428,625.770  |  |
| GOOGLE INC                       | 27,917  | 1,122.980 | 31,350,232.660 |  |
| T-MOBILE US INC                  | 19,051  | 32.490    | 618,966.990    |  |
| LAS VEGAS SANDS CORP             | 42,336  | 79.170    | 3,351,741.120  |  |
| MOSAIC CO/THE                    | 29,078  | 46.150    | 1,341,949.700  |  |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX<br>NEWS | 46,732  | 31.930    | 1,492,152.760  |  |

|   |         |         |               |  |
|---|---------|---------|---------------|--|
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX<br>INC         | 150,198 | 32.350  | 4,858,905.300 |  |
| HERBALIFE LTD                           | 7,528   | 79.840  | 601,035.520   |  |
| CELANESE CORP                           | 14,767  | 53.860  | 795,350.620   |  |
| WINDSTREAM HOLDINGS INC                 | 73,694  | 7.910   | 582,919.540   |  |
| IHS INC-CLASS A                         | 5,758   | 119.700 | 689,232.600   |  |
| DISCOVERY COMMNUCATIONS-A               | 13,414  | 81.440  | 1,092,436.160 |  |
| EXPEDIA INC                             | 10,399  | 67.870  | 705,780.130   |  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS<br>INC           | 6,285   | 244.640 | 1,537,562.400 |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC                | 19,034  | 113.180 | 2,154,268.120 |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES<br>C          | 15,627  | 84.920  | 1,327,044.840 |  |
| FIDELITY NATIONAL<br>FINANCIAL          | 21,690  | 30.860  | 669,353.400   |  |
| GAMESTOP CORP. - CL. A                  | 14,066  | 45.320  | 637,471.120   |  |
| INTERCONTINENTALEXCHANGE<br>GROUP       | 11,889  | 220.510 | 2,621,643.390 |  |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A                | 7,718   | 84.930  | 655,489.740   |  |
| VIACOM INC-CLASS B                      | 44,238  | 84.420  | 3,734,571.960 |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL<br>INC           | 3,447   | 529.800 | 1,826,220.600 |  |
| UNITED CONTINENTAL<br>HOLIDINGS INC     | 10,239  | 44.600  | 456,659.400   |  |
| TRANSDIGM GROUP INC                     | 4,774   | 167.420 | 799,263.080   |  |
| MASTERCARD INC                          | 10,780  | 810.000 | 8,731,800.000 |  |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP                | 46,990  | 27.750  | 1,303,972.500 |  |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP                  | 12,025  | 71.480  | 859,547.000   |  |
| WESTERN UNION CO                        | 61,119  | 16.380  | 1,001,129.220 |  |
| LEIDOS HOLDINGS INC                     | 8,629   | 46.510  | 401,334.790   |  |
| KBR INC                                 | 15,988  | 31.920  | 510,336.960   |  |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC               | 45,731  | 27.150  | 1,241,596.650 |  |
| SPECTRA ENERGY CORP                     | 67,253  | 34.560  | 2,324,263.680 |  |
| TIME WARNER CABLE INC                   | 28,718  | 132.400 | 3,802,263.200 |  |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL<br>INC        | 35,585  | 15.410  | 548,364.850   |  |
| DELTA AIR LINES INC                     | 22,701  | 30.920  | 701,914.920   |  |
| CONTINENTAL RESOURCES<br>INC/OK         | 3,877   | 104.680 | 405,844.360   |  |
| DISCOVER FINANCIAL                      | 51,410  | 53.660  | 2,758,660.600 |  |
| COVIDIEN PLC                            | 47,677  | 68.770  | 3,278,747.290 |  |
| TE CONNECTIVITY LTD                     | 40,997  | 55.550  | 2,277,383.350 |  |
| CONCHO RESOURCES<br>INC/MIDLAND TX      | 10,077  | 95.630  | 963,663.510   |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC                 | 12,339  | 49.700  | 613,248.300   |  |
| VMWARE INC                              | 10,086  | 93.010  | 938,098.860   |  |
| TERADATA CORP                           | 19,646  | 44.030  | 865,013.380   |  |
| ULTA SALON COSMETICS &<br>FRAGRANCE INC | 7,107   | 88.890  | 631,741.230   |  |



|   |         |         |                |  |
|---|---------|---------|----------------|--|
| INVESCO LTD                             | 43,479  | 35.050  | 1,523,938.950  |  |
| NETSUITE INC                            | 3,281   | 103.000 | 337,943.000    |  |
| CALPINE CORP NPR                        | 42,931  | 19.140  | 821,699.340    |  |
| PHILIP MORRIS<br>INTERNATIONAL          | 164,815 | 82.450  | 13,588,996.750 |  |
| VISA INC                                | 52,252  | 218.900 | 11,437,962.800 |  |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP<br>INC          | 22,285  | 47.430  | 1,056,977.550  |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO<br>INC          | 16,289  | 41.590  | 677,459.510    |  |
| LORILLARD INC                           | 38,414  | 49.270  | 1,892,657.780  |  |
| SCRIPPS NETWORKS<br>INTERACTIVE         | 7,259   | 76.310  | 553,934.290    |  |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-<br>C          | 9,733   | 75.210  | 732,018.930    |  |
| MARATHON PETROLEUM CORP                 | 33,263  | 88.160  | 2,932,466.080  |  |
| CAREFUSION CORP                         | 20,958  | 40.750  | 854,038.500    |  |
| KINDER MORGAN<br>INC/DELAWARE           | 67,126  | 35.460  | 2,380,287.960  |  |
| XYLEM INC                               | 22,549  | 35.020  | 789,665.980    |  |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES<br>NV         | 42,755  | 79.820  | 3,412,704.100  |  |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD                  | 26,085  | 52.640  | 1,373,114.400  |  |
| LINKEDIN CORP                           | 10,629  | 213.540 | 2,269,716.660  |  |
| HCA HOLDINGS INC                        | 28,526  | 50.960  | 1,453,684.960  |  |
| NIELSEN HOLDINGS NV                     | 26,310  | 43.680  | 1,149,220.800  |  |
| VERISK ANALYTICS INC                    | 16,556  | 62.450  | 1,033,922.200  |  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC               | 7,162   | 113.500 | 812,887.000    |  |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO               | 20,925  | 82.900  | 1,734,682.500  |  |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN<br>FRANCISCO CA | 7,892   | 51.570  | 406,990.440    |  |
| COBALT INTERNATIONAL<br>ENERGY INC      | 32,899  | 15.900  | 523,094.100    |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS<br>INC           | 7,245   | 134.220 | 972,423.900    |  |
| CIT GROUP INC                           | 20,577  | 50.200  | 1,032,965.400  |  |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS<br>TRUST        | 713,000 | 0.675   | 481,275.000    |  |
| DOLLAR GENERAL CORP                     | 30,790  | 60.690  | 1,868,645.100  |  |
| AON PLC                                 | 29,492  | 80.920  | 2,386,492.640  |  |
| REALOGY HOLDINGS CORP                   | 11,464  | 48.000  | 550,272.000    |  |
| QEP RESOURCES INC                       | 18,552  | 29.330  | 544,130.160    |  |
| TESLA MOTORS INC                        | 9,661   | 139.340 | 1,346,163.740  |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES<br>HOLDING NV      | 15,393  | 37.980  | 584,626.140    |  |
| GENERAL MOTORS CO                       | 101,523 | 39.580  | 4,018,280.340  |  |
| VANTIV INC                              | 12,141  | 31.590  | 383,534.190    |  |
| TRIPADVISOR INC                         | 12,944  | 84.450  | 1,093,120.800  |  |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD               | 19,210  | 76.670  | 1,472,830.700  |  |

|          |                                 |            |         |  |  |
|----------|---------------------------------|------------|---------|--|--|
|          | DELPHI AUTOMOTIVE PLC           | 29,892     | 60.200  | 1,799,498.400                          |  |
|          | PHILLIPS 66                     | 58,928     | 75.810  | 4,467,331.680                          |  |
|          | LIBERTY MEDIA CORP              | 9,165      | 135.200 | 1,239,108.000                          |  |
|          | FACEBOOK INC                    | 175,797    | 55.910  | 9,828,810.270                          |  |
|          | ADT CORP                        | 23,368     | 39.010  | 911,585.680                            |  |
|          | SERVICENOW INC                  | 12,789     | 57.090  | 730,124.010                            |  |
|          | WORKDAY INC                     | 6,561      | 87.880  | 576,580.680                            |  |
|          | KRAFT FOODS GROUP INC           | 59,385     | 53.490  | 3,176,503.650                          |  |
|          | ABBVIE INC                      | 161,206    | 49.830  | 8,032,894.980                          |  |
|          | ZOETIS INC                      | 51,278     | 31.780  | 1,629,614.840                          |  |
|          | NEWS CORP/NEW-CL A              | 43,948     | 17.150  | 753,708.200                            |  |
|          | SPRINT CORP                     | 97,357     | 9.090   | 884,975.130                            |  |
|          | NOBLE CORP PLC                  | 24,088     | 35.170  | 847,174.960                            |  |
|          | PERRIGO CO PLC                  | 14,130     | 160.880 | 2,273,234.400                          |  |
|          | アメリカ・ドル 小計                      | 31,599,855 |         | 1,707,967,174.270<br>(176,467,168,446) |  |
| イギリス・ポンド | ABERDEEN ASSET MGMT             | 92,697     | 4.599   | 426,313.500                            |  |
|          | AMEC PLC                        | 28,599     | 11.050  | 316,018.950                            |  |
|          | ANTOFAGASTA PLC                 | 44,020     | 7.840   | 345,116.800                            |  |
|          | SEVERN TRENT PLC                | 28,908     | 16.550  | 478,427.400                            |  |
|          | BHP BILLITON PLC                | 214,510    | 17.970  | 3,854,744.700                          |  |
|          | BARCLAYS PLC                    | 1,567,569  | 2.917   | 4,572,598.770                          |  |
|          | BT GROUP PLC                    | 800,927    | 3.847   | 3,081,166.160                          |  |
|          | BRITISH SKY BROADCASTING<br>PLC | 104,248    | 8.395   | 875,161.960                            |  |
|          | AGGREKO PLC                     | 27,635     | 17.140  | 473,663.900                            |  |
|          | TULLOW OIL PLC                  | 97,933     | 8.780   | 859,851.740                            |  |
|          | BUNZL PLC                       | 34,501     | 14.170  | 488,879.170                            |  |
|          | EASYJET PLC                     | 13,628     | 16.910  | 230,449.480                            |  |
|          | CAPITA PLC                      | 64,410     | 10.370  | 667,931.700                            |  |
|          | AVIVA PLC                       | 295,997    | 4.762   | 1,409,537.710                          |  |
|          | CRODA INTERNATIONAL             | 12,849     | 23.520  | 302,208.480                            |  |
|          | DIAGEO PLC                      | 258,978    | 19.960  | 5,169,200.880                          |  |
|          | SCHRODERS PLC                   | 12,609     | 25.900  | 326,573.100                            |  |
|          | NATIONAL GRID PLC               | 375,807    | 7.770   | 2,920,020.390                          |  |
|          | GKN PLC                         | 182,053    | 3.897   | 709,460.540                            |  |
|          | KINGFISHER PLC                  | 234,699    | 3.850   | 903,591.150                            |  |
|          | BAE SYSTEMS PLC                 | 323,539    | 4.297   | 1,390,247.080                          |  |
|          | BRITISH AMERICAN TOBACCO<br>PLC | 193,252    | 30.425  | 5,879,692.100                          |  |
|          | COBHAM PLC                      | 88,449     | 2.889   | 255,529.160                            |  |
|          | NEXT PLC                        | 15,179     | 61.950  | 940,339.050                            |  |
|          | REXAM PLC                       | 94,964     | 5.035   | 478,143.740                            |  |
|          | IMPERIAL TOBACCO GROUP<br>PLC   | 100,666    | 22.240  | 2,238,811.840                          |  |
|          | IMI PLC                         | 37,027     | 15.640  | 579,102.280                            |  |
|          | JOHNSON MATTHEY PLC             | 21,473     | 33.760  | 724,928.480                            |  |
|          | SABMILLER PLC                   | 96,580     | 30.205  | 2,917,198.900                          |  |
|          | ANGLO AMERICAN PLC              | 140,108    | 12.730  | 1,783,574.840                          |  |

|                                 |           |        |                |  |
|---------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| COMPASS GROUP PLC               | 184,252   | 9.585  | 1,766,055.420  |  |
| HSBC HOLDINGS PLC               | 1,903,533 | 6.770  | 12,886,918.410 |  |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC       | 574,217   | 2.281  | 1,309,788.970  |  |
| ARM HOLDINGS PLC                | 141,802   | 9.780  | 1,386,823.560  |  |
| CENTRICA PLC                    | 543,390   | 3.262  | 1,772,538.180  |  |
| UNILEVER PLC                    | 128,821   | 24.020 | 3,094,280.420  |  |
| MEGGITT PLC                     | 71,707    | 5.350  | 383,632.450    |  |
| MORRISON <WM.><br>SUPERMARKETS  | 202,760   | 2.513  | 509,535.880    |  |
| UNITED UTILITIES GROUP<br>PLC   | 82,325    | 6.595  | 542,933.370    |  |
| RSA INSURANCE GROUP PLC<br>GRP  | 411,297   | 0.987  | 405,950.130    |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS<br>PLC | 38,784    | 26.600 | 1,031,654.400  |  |
| PEARSON PLC                     | 89,377    | 13.180 | 1,177,988.860  |  |
| PERSIMMON PLC                   | 29,923    | 13.460 | 402,763.580    |  |
| PRUDENTIAL PLC                  | 257,589   | 13.700 | 3,528,969.300  |  |
| RIO TINTO PLC                   | 129,113   | 31.770 | 4,101,920.010  |  |
| VODAFONE GROUP PLC              | 4,941,395 | 2.337  | 11,548,040.110 |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP<br>PLC  | 65,566    | 46.490 | 3,048,163.340  |  |
| REED ELSEVIER PLC               | 127,990   | 9.070  | 1,160,869.300  |  |
| OLD MUTUAL PLC                  | 538,950   | 1.955  | 1,053,647.250  |  |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC        | 194,037   | 12.450 | 2,415,760.650  |  |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND<br>GROUP | 234,054   | 3.680  | 861,318.720    |  |
| TRAVIS PERKINS PLC              | 19,895    | 18.800 | 374,026.000    |  |
| SSE PLC                         | 99,390    | 13.440 | 1,335,801.600  |  |
| SERCO GROUP PLC                 | 50,772    | 5.145  | 261,221.940    |  |
| BP PLC                          | 1,922,200 | 4.958  | 9,530,267.600  |  |
| SHIRE PLC                       | 57,161    | 29.110 | 1,663,956.710  |  |
| SAGE GROUP PLC(THE)             | 98,062    | 4.017  | 393,915.050    |  |
| INVENSYS PLC                    | 71,055    | 5.090  | 361,669.950    |  |
| SMITHS GROUP PLC                | 36,935    | 15.050 | 555,871.750    |  |
| STANDARD CHARTERED PLC          | 245,267   | 12.920 | 3,168,849.640  |  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 5,053,661 | 0.840  | 4,245,075.240  |  |
| TATE & LYLE PLC                 | 36,876    | 7.755  | 285,973.380    |  |
| BG GROUP PLC                    | 350,815   | 13.150 | 4,613,217.250  |  |
| TESCO PLC                       | 818,585   | 3.265  | 2,672,680.020  |  |
| 3I GROUP PLC                    | 119,685   | 3.940  | 471,558.900    |  |
| SMITH & NEPHEW PLC              | 93,652    | 8.745  | 818,986.740    |  |
| GLAXOSMITHKLINE PLC             | 499,201   | 15.910 | 7,942,287.910  |  |
| WEIR GROUP                      | 18,336    | 21.030 | 385,606.080    |  |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC       | 17,421    | 18.000 | 313,578.000    |  |
| BABCOCK INT'L GROUP             | 43,025    | 13.920 | 598,908.000    |  |
| WPP PLC                         | 130,749   | 13.590 | 1,776,878.910  |  |
| WOLSELEY PLC                    | 27,936    | 34.660 | 968,261.760    |  |
| ASTRAZENECA PLC                 | 130,210   | 36.635 | 4,770,243.350  |  |

|                                    |  |         |                                     |                |  |
|------------------------------------|--|---------|-------------------------------------|----------------|--|
| WHITBREAD PLC                      | 19,002   | 38.910  | 739,367.820                         |                |  |
| CARNIVAL PLC                       | 17,669   | 25.990  | 459,217.310                         |                |  |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC          | 158,973  | 4.744   | 754,167.910                         |                |  |
| INTERTEK GROUP PLC                 | 19,178   | 30.690  | 588,572.820                         |                |  |
| WILLIAM HILL PLC                   | 104,797  | 3.807   | 398,962.170                         |                |  |
| BURBERRY GROUP PLC                 | 41,539   | 14.610  | 606,884.790                         |                |  |
| INVESTEC PLC                       | 50,655   | 4.390   | 222,375.450                         |                |  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS            | 25,287   | 19.930  | 503,969.910                         |                |  |
| ICAP PLC                           | 52,823   | 4.519   | 238,707.130                         |                |  |
| ITV PLC                            | 345,353  | 2.028   | 700,375.880                         |                |  |
| SAINSBURY (J) PLC                  | 147,222  | 3.512   | 517,043.660                         |                |  |
| RANDGOLD RESOURCES LTD<br>NPR      | 10,689   | 38.350  | 409,923.150                         |                |  |
| G4S PLC                            | 171,953  | 2.510   | 431,602.030                         |                |  |
| ADMIRAL GROUP PLC                  | 22,361   | 13.350  | 298,519.350                         |                |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A<br>SHS     | 397,909  | 21.900  | 8,714,207.100                       |                |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B<br>SHS     | 248,943  | 23.030  | 5,733,157.290                       |                |  |
| INMARSAT PLC                       | 46,334   | 7.500   | 347,505.000                         |                |  |
| PETROFAC LTD                       | 29,942   | 12.580  | 376,670.360                         |                |  |
| STANDARD LIFE PLC                  | 223,263  | 3.770   | 841,701.510                         |                |  |
| EXPERIAN PLC                       | 98,499   | 11.310  | 1,114,023.690                       |                |  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC            | 25,927   | 14.850  | 385,015.950                         |                |  |
| TUI TRAVEL PLC                     | 52,043   | 4.213   | 219,257.150                         |                |  |
| MELROSE PLC                        | 106,965  | 3.047   | 325,922.350                         |                |  |
| FRESNILLO PLC NPR                  | 23,779   | 7.035   | 167,285.260                         |                |  |
| RESOLUTION LTD                     | 122,660  | 3.587   | 439,981.420                         |                |  |
| GLENCORE XSTRATA PLC               | 1,079,568                                      | 3.189   | 3,442,742.350                       |                |  |
| DIRECT LINE INSURANCE<br>GROUP PLC | 107,350  | 2.491   | 267,408.850                         |                |  |
| COCA-COLA HBC AG                   | 25,293   | 17.980  | 454,768.140                         |                |  |
| イギリス・ポンド 小計                        | 30,211,561                                     |         | 177,196,207.840<br>(30,020,581,532) |                |  |
| イスラエル・<br>シュケル                     | BANK HAPOLIM BM                                | 133,450 | 19.230                              | 2,566,243.500  |  |
|                                    | BANK LEUMI LE-ISRAEL BM                        | 181,502 | 14.010                              | 2,542,843.020  |  |
|                                    | BEZEQ ISRAELI<br>TELECOMMUNICATION CORP<br>LTD | 188,230 | 5.890                               | 1,108,674.700  |  |
|                                    | ISRAEL CHEMICALS LTD                           | 66,569  | 28.800                              | 1,917,187.200  |  |
|                                    | TEVA PHARMACEUTICAL<br>INDUSTRIES LTD          | 89,826  | 146.200                             | 13,132,561.200 |  |
| イスラエル・シュケル 小計                      | 659,577  |         | 21,267,509.620<br>(630,156,310)     |                |  |
| オーストラリア・<br>ドル                     | RAMSAY HEALTH CARE LTD                         | 12,795  | 43.950                              | 562,340.250    |  |
|                                    | AUST AND NZ BANKING GROUP<br>LT                | 283,459 | 31.330                              | 8,880,770.470  |  |
|                                    | AMCOR LTD                                      | 123,722 | 10.360                              | 1,281,759.920  |  |

|                                |         |        |                |  |
|--------------------------------|---------|--------|----------------|--|
| WESTPAC BANKING CORPORATION    | 321,420 | 32.010 | 10,288,654.200 |  |
| BANK OF QUEENSLAND LTD         | 30,216  | 12.300 | 371,656.800    |  |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD     | 149,206 | 5.140  | 766,918.840    |  |
| TELSTRA CORP LTD               | 448,020 | 5.250  | 2,352,105.000  |  |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD  | 31,874  | 11.890 | 378,981.860    |  |
| AMP LTD                        | 324,183 | 4.450  | 1,442,614.350  |  |
| ASX LTD                        | 22,288  | 36.500 | 813,512.000    |  |
| BHP BILLITON LTD               | 328,942 | 36.560 | 12,026,119.520 |  |
| CALTEX AUSTRALIA LTD           | 14,149  | 19.340 | 273,641.660    |  |
| ALS LTD                        | 34,895  | 8.880  | 309,867.600    |  |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD     | 101,749 | 3.310  | 336,789.190    |  |
| COMPUTERSHARE LT               | 50,472  | 11.350 | 572,857.200    |  |
| CSL LIMITED                    | 50,259  | 67.800 | 3,407,560.200  |  |
| TRANSURBAN GROUP               | 160,451 | 6.820  | 1,094,275.820  |  |
| COCA-COLA AMATIL LTD           | 60,500  | 12.170 | 736,285.000    |  |
| COCHLEAR LTD                   | 5,226   | 59.880 | 312,932.880    |  |
| ORIGIN ENERGY LTD              | 107,742 | 13.810 | 1,487,917.020  |  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 163,026 | 77.000 | 12,553,002.000 |  |
| BORAL LIMITED                  | 84,744  | 4.790  | 405,923.760    |  |
| RIO TINTO LIMITED              | 42,941  | 63.510 | 2,727,182.910  |  |
| APA GROUP                      | 86,227  | 6.070  | 523,397.890    |  |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT   | 223,859 | 5.790  | 1,296,143.610  |  |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 4,423   | 46.000 | 203,458.000    |  |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC    | 35,790  | 12.940 | 463,122.600    |  |
| ORICA LTD                      | 34,301  | 23.900 | 819,793.900    |  |
| LEIGHTON HLDGS LTD             | 21,757  | 16.200 | 352,463.400    |  |
| SYDNEY AIRPORT                 | 115,539 | 3.730  | 430,960.470    |  |
| MACQUARIE GROUP LTD            | 30,846  | 53.980 | 1,665,067.080  |  |
| WORLEYPARSONS LTD              | 23,411  | 16.840 | 394,241.240    |  |
| SUNCORP GROUP LTD              | 140,404 | 13.150 | 1,846,312.600  |  |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    | 236,120 | 34.240 | 8,084,748.800  |  |
| NEWCREST MINING LTD            | 92,633  | 8.870  | 821,654.710    |  |
| INCITEC PIVOT LTD              | 165,148 | 2.850  | 470,671.800    |  |
| TOLL HOLDINGS LTD              | 72,011  | 5.730  | 412,623.030    |  |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED         | 127,737 | 1.120  | 143,065.440    |  |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED    | 121,525 | 11.890 | 1,444,932.250  |  |
| SANTOS LTD                     | 104,285 | 14.260 | 1,487,104.100  |  |
| SONIC HEALTHCARE               | 45,868  | 17.050 | 782,049.400    |  |
| TABCORP HOLDINGS LTD           | 30,088  | 3.560  | 107,113.280    |  |

|        |                                |           |         |                                    |  |
|--------|--------------------------------|-----------|---------|------------------------------------|--|
|        | WESFARMERS LTD                 | 103,161   | 43.620  | 4,499,882.820                      |  |
|        | ALUMINA LIMITED                | 388,179   | 1.155   | 448,346.740                        |  |
|        | ILUKA RESOURCES LIM            | 55,637    | 8.280   | 460,674.360                        |  |
|        | WOODSIDE PETROLEUM LTD         | 64,556    | 37.570  | 2,425,368.920                      |  |
|        | WOOLWORTHS LTD                 | 124,027   | 34.210  | 4,242,963.670                      |  |
|        | METCASH LTD                    | 79,084    | 3.100   | 245,160.400                        |  |
|        | SEEK LTD                       | 29,830    | 13.190  | 393,457.700                        |  |
|        | TATTS GROUP LTD                | 141,350   | 3.050   | 431,117.500                        |  |
|        | SP AUSNET                      | 234,780   | 1.250   | 293,475.000                        |  |
|        | AGL ENERGY LTD                 | 57,550    | 15.050  | 866,127.500                        |  |
|        | BRAMBLES LTD                   | 152,289   | 9.070   | 1,381,261.230                      |  |
|        | ASCIANO LTD                    | 108,957   | 5.640   | 614,517.480                        |  |
|        | CROWN RESORTS LTD              | 46,332    | 17.210  | 797,373.720                        |  |
|        | ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD   | 109,246   | 2.550   | 278,577.300                        |  |
|        | AURIZON HOLDINGS LTD           | 210,167   | 4.860   | 1,021,411.620                      |  |
|        | TREASURY WINE ESTATES LTD      | 56,402    | 4.860   | 274,113.720                        |  |
|        | オーストラリア・ドル 小計                  | 6,625,798 |         | 103,806,421.730<br>(9,691,367,533) |  |
| カナダ・ドル | AGNICO EAGLE MINES LTD         | 17,334    | 31.030  | 537,874.020                        |  |
|        | ALIMENTATION COUCHE TARD INC   | 15,943    | 77.420  | 1,234,307.060                      |  |
|        | BARRICK GOLD CORP              | 120,690   | 19.730  | 2,381,213.700                      |  |
|        | ATCO LTD                       | 7,193     | 47.250  | 339,869.250                        |  |
|        | TALISMAN ENERGY INC            | 100,146   | 12.170  | 1,218,776.820                      |  |
|        | BANK OF MONTREAL               | 65,347    | 71.700  | 4,685,379.900                      |  |
|        | BANK OF NOVA SCOTIA            | 124,468   | 64.270  | 7,999,558.360                      |  |
|        | NATIONAL BANK OF CANADA        | 17,129    | 88.100  | 1,509,064.900                      |  |
|        | BCE INC                        | 26,643    | 46.410  | 1,236,501.630                      |  |
|        | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT    | 55,291    | 40.590  | 2,244,261.690                      |  |
|        | VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN | 32,566    | 141.820 | 4,618,510.120                      |  |
|        | BOMBARDIER INC 'B'             | 155,097   | 4.490   | 696,385.530                        |  |
|        | SAPUTO INC                     | 15,632    | 50.190  | 784,570.080                        |  |
|        | BLACKBERRY LTD                 | 56,591    | 9.110   | 515,544.010                        |  |
|        | CGI GROUP INC                  | 22,652    | 34.360  | 778,322.720                        |  |
|        | CAE INC                        | 31,436    | 14.010  | 440,418.360                        |  |
|        | CAMECO CORP                    | 45,703    | 21.780  | 995,411.340                        |  |
|        | ROGERS COMM-CL B               | 35,628    | 47.040  | 1,675,941.120                      |  |
|        | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE    | 40,469    | 88.650  | 3,587,576.850                      |  |
|        | CANADIAN NATURAL RESOURCES     | 111,566   | 35.850  | 3,999,641.100                      |  |
|        | CANADIAN TIRE CORP-CL A        | 6,877     | 99.170  | 681,992.090                        |  |
|        | CANADIAN UTILITIES LTD         | 15,036    | 36.760  | 552,723.360                        |  |
|        | CANADIAN NATL RAILWAY CO       | 83,758    | 58.830  | 4,927,483.140                      |  |
|        | AGRIUM INC                     | 16,162    | 99.260  | 1,604,240.120                      |  |
|        | YAMANA GOLD INC                | 67,520    | 10.130  | 683,977.600                        |  |

|  |         |         |                |  |
|--|---------|---------|----------------|--|
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                                    | 11,491  | 59.020  | 678,198.820    |  |
| OPEN TEXT CORP   | 7,329   | 96.500  | 707,248.500    |  |
| ELDORADO GOLD CORP                                       | 78,309  | 6.820   | 534,067.380    |  |
| EMPIRE CO LTD  | 5,031   | 72.420  | 364,345.020    |  |
| KINROSS GOLD CORP  | 125,461 | 4.970   | 623,541.170    |  |
| FINNING INTERNATIONAL INC                                | 17,160  | 26.220  | 449,935.200    |  |
| FORTIS INC   | 20,884  | 30.300  | 632,785.200    |  |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD                               | 60,600  | 18.660  | 1,130,796.000  |  |
| TELUS CORP   | 26,152  | 36.810  | 962,655.120    |  |
| GREAT WEST LIFECO INC                                    | 32,106  | 31.690  | 1,017,439.140  |  |
| IMPERIAL OIL LTD   | 32,537  | 45.360  | 1,475,878.320  |  |
| ENBRIDGE INC   | 80,635  | 46.710  | 3,766,460.850  |  |
| IGM FINANCIAL INC  | 6,816   | 55.150  | 375,902.400    |  |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD                             | 49,079  | 3.610   | 177,175.190    |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP                                  | 190,370 | 21.590  | 4,110,088.300  |  |
| LOBLAW CO LTD  | 12,181  | 44.000  | 535,964.000    |  |
| PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP                             | 35,435  | 17.780  | 630,034.300    |  |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC | 9,630   | 45.690  | 439,994.700    |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC                                  | 23,217  | 90.750  | 2,106,942.750  |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                                   | 61,535  | 37.740  | 2,322,330.900  |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD                              | 1,025   | 417.500 | 427,937.500    |  |
| METRO INC  | 10,154  | 66.000  | 670,164.000    |  |
| HUSKY ENERGY INC   | 35,673  | 33.280  | 1,187,197.440  |  |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP                               | 37,273  | 39.630  | 1,477,128.990  |  |
| METHANEX CORP  | 9,418   | 63.090  | 594,181.620    |  |
| ONEX CORP  | 10,676  | 58.200  | 621,343.200    |  |
| GOLDCORP INC   | 75,826  | 25.040  | 1,898,683.040  |  |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN                              | 88,758  | 36.420  | 3,232,566.360  |  |
| POWER CORP OF CANADA                                     | 39,841  | 30.660  | 1,221,525.060  |  |
| POWER FINANCIAL CORP                                     | 23,521  | 34.670  | 815,473.070    |  |
| ROYAL BANK OF CANADA                                     | 146,553 | 71.210  | 10,436,039.130 |  |
| SNC-LAVALIN GROUP INC                                    | 16,326  | 49.430  | 806,994.180    |  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD                             | 17,692  | 163.440 | 2,891,580.480  |  |
| SHAW COMM INC-B  | 39,522  | 25.310  | 1,000,301.820  |  |
| SHOPPERS DRUG MART CORP                                  | 22,208  | 59.080  | 1,312,048.640  |  |
| NEW GOLD INC   | 51,627  | 5.950   | 307,180.650    |  |
| SUNCOR ENERGY INC  | 150,001 | 37.270  | 5,590,537.270  |  |
| ENCANA CORP  | 71,646  | 18.770  | 1,344,795.420  |  |
| TECK RESOURCES LTD-CL B                                  | 60,753  | 26.060  | 1,583,223.180  |  |
| THOMSON REUTERS CORP                                     | 41,062  | 40.700  | 1,671,223.400  |  |

|                                    |           |        |                                     |  |
|------------------------------------|-----------|--------|-------------------------------------|--|
| TORONTO DOMINION BANK<br>(THE) C\$ | 93,830    | 97.800 | 9,176,574.000                       |  |
| TRANSCANADA CORP                   | 73,427    | 48.200 | 3,539,181.400                       |  |
| TRANSALTA CORP                     | 34,014    | 13.960 | 474,835.440                         |  |
| WESTON (GEORGE) LTD                | 4,743     | 78.540 | 372,515.220                         |  |
| INTACT FINANCIAL CORP              | 12,288    | 69.490 | 853,893.120                         |  |
| SILVER WHEATON CORP                | 41,308    | 23.580 | 974,042.640                         |  |
| CATAMARAN CORP                     | 20,272    | 54.540 | 1,105,634.880                       |  |
| FRANCO-NEVADA CORP NPR             | 16,024    | 46.940 | 752,166.560                         |  |
| CI FINANCIAL CORP                  | 16,122    | 35.250 | 568,300.500                         |  |
| TOURMALINE OIL CORP                | 15,779    | 45.500 | 717,944.500                         |  |
| KEYERA CORP                        | 8,738     | 65.770 | 574,698.260                         |  |
| ALTAGAS LTD                        | 12,358    | 40.670 | 502,599.860                         |  |
| PEMBINA PIPELINE CORP              | 28,565    | 37.250 | 1,064,046.250                       |  |
| TIM HORTONS INC                    | 14,007    | 59.980 | 840,139.860                         |  |
| DOLLARAMA INC                      | 6,908     | 82.490 | 569,840.920                         |  |
| BAYTEX ENERGY CORP                 | 11,962    | 39.990 | 478,360.380                         |  |
| MEG ENERGY CORP                    | 17,794    | 30.960 | 550,902.240                         |  |
| ATHABASCA OIL CORP                 | 42,987    | 6.790  | 291,881.730                         |  |
| CENOVUS ENERGY INC W/I             | 72,925    | 29.760 | 2,170,248.000                       |  |
| ENERPLUS CORP                      | 20,814    | 18.940 | 394,217.160                         |  |
| VERMILION ENERGY INC               | 8,291     | 60.800 | 504,092.800                         |  |
| PENN WEST PETROLEUM LTD            | 52,457    | 9.040  | 474,211.280                         |  |
| ARC RESOURCES LTD                  | 30,599    | 28.150 | 861,361.850                         |  |
| CANADIAN OIL SANDS LTD             | 53,022    | 20.000 | 1,060,440.000                       |  |
| PEYTO EXPLORATION & DEV<br>CORP    | 11,168    | 33.200 | 370,777.600                         |  |
| PENGROWTH ENERGY CORP              | 36,505    | 6.550  | 239,107.750                         |  |
| カナダ・ドル 小計                          | 3,879,297 |        | 141,543,466.780<br>(13,431,059,562) |  |
| シンガポール・<br>ドル                      |           |        |                                     |  |
| SINGAPORE TECH ENG                 | 125,000   | 3.870  | 483,750.000                         |  |
| SEMBCORP INDUSTRIES                | 139,000   | 5.310  | 738,090.000                         |  |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS<br>LTD    | 169,000   | 4.030  | 681,070.000                         |  |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD          | 821,640   | 0.530  | 435,469.200                         |  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD             | 174,000   | 17.250 | 3,001,500.000                       |  |
| CITY DEVELOPMENTS LTD              | 37,000    | 9.510  | 351,870.000                         |  |
| SEMBCORP MARINE                    | 108,000   | 4.280  | 462,240.000                         |  |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE<br>LTD    | 13,000    | 36.630 | 476,190.000                         |  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD             | 87,000    | 7.060  | 614,220.000                         |  |
| CAPITALAND LTD                     | 276,000   | 2.950  | 814,200.000                         |  |
| GENTING SINGAPORE PLC              | 584,400   | 1.495  | 873,678.000                         |  |
| KEPPEL CORP LTD                    | 137,500   | 10.980 | 1,509,750.000                       |  |
| COMFORTDELGRO CORP LTD             | 90,000    | 2.030  | 182,700.000                         |  |
| NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE          | 411,763   | 1.040  | 428,233.520                         |  |
| OVERSEA-CHINESE BANKING<br>CORP    | 280,200   | 9.730  | 2,726,346.000                       |  |



|           |                                      |           |            |                                   |  |
|-----------|--------------------------------------|-----------|------------|-----------------------------------|--|
|           | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS         | 819,867   | 3.550      | 2,910,527.850                     |  |
|           | SINGAPORE AIRLINES LTD               | 65,400    | 10.070     | 658,578.000                       |  |
|           | KEPPEL LAND LTD                      | 95,000    | 3.150      | 299,250.000                       |  |
|           | UNITED OVERSEAS BANK LTD             | 125,000   | 20.990     | 2,623,750.000                     |  |
|           | STARHUB LTD                          | 65,000    | 4.250      | 276,250.000                       |  |
|           | WILMAR INTERNATIONAL LTD             | 200,000   | 3.310      | 662,000.000                       |  |
|           | YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 231,000   | 1.240      | 286,440.000                       |  |
|           | CAPITAMALLS ASIA LTD                 | 120,000   | 1.930      | 231,600.000                       |  |
|           | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD       | 285,000   | 2.920      | 832,200.000                       |  |
| シンガポール・ドル | 小計                                   | 5,459,770 |            | 22,559,902.570<br>(1,841,339,248) |  |
| スイス・フラン   | CREDIT SUISSE GROUP AG               | 157,904   | 29.770     | 4,700,802.080                     |  |
|           | SYNGENTA AG                          | 9,713     | 351.900    | 3,418,004.700                     |  |
|           | NESTLE SA-REGISTERED                 | 328,388   | 66.350     | 21,788,543.800                    |  |
|           | CIE FINANC RICHEMONT                 | 52,226    | 88.150     | 4,603,721.900                     |  |
|           | ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN        | 71,471    | 256.600    | 18,339,458.600                    |  |
|           | SCHINDLER HOLDING-PART CERT          | 4,842     | 130.900    | 633,817.800                       |  |
|           | SIKA INHABER                         | 188       | 3,145.000  | 591,260.000                       |  |
|           | SGS SA-REG                           | 576       | 2,069.000  | 1,191,744.000                     |  |
|           | SULZER AG-REG                        | 3,187     | 138.900    | 442,674.300                       |  |
|           | NOVARTIS AG-REG SHS                  | 234,010   | 73.150     | 17,117,831.500                    |  |
|           | BALOISE HOLDING AG -R                | 5,702     | 113.700    | 648,317.400                       |  |
|           | BARRY CALLEBAUT AG                   | 69        | 1,108.000  | 76,452.000                        |  |
|           | SWISSCOM AG-REG                      | 2,309     | 478.200    | 1,104,163.800                     |  |
|           | ABB LTD                              | 220,149   | 23.700     | 5,217,531.300                     |  |
|           | ADECCO SA-REG                        | 11,879    | 71.850     | 853,506.150                       |  |
|           | GEBERIT AG                           | 4,109     | 275.200    | 1,130,796.800                     |  |
|           | LONZA GROUP AG-REG                   | 5,846     | 92.700     | 541,924.200                       |  |
|           | LINDT & SPRUENGLI PART               | 91        | 4,036.000  | 367,276.000                       |  |
|           | LINDT & SPRUENGLI NAMEN              | 13        | 49,045.000 | 637,585.000                       |  |
|           | UBS AG-REGISTERED                    | 372,228   | 18.760     | 6,982,997.280                     |  |
|           | GIVAUDAN-REG                         | 909       | 1,249.000  | 1,135,341.000                     |  |
|           | ZURICH INSURANCE GROUP AG            | 15,295    | 265.300    | 4,057,763.500                     |  |
|           | HOLCIM LTD-REG                       | 22,704    | 68.750     | 1,560,900.000                     |  |
|           | ACTELION                             | 12,017    | 83.250     | 1,000,415.250                     |  |
|           | SONOVA HOLDING AG                    | 4,519     | 122.700    | 554,481.300                       |  |
|           | KUEHNE & NAGEL INTL AG               | 6,445     | 125.000    | 805,625.000                       |  |
|           | THE SWATCH GROUP AG-B                | 2,715     | 565.500    | 1,535,332.500                     |  |
|           | THE SWATCH GROUP AG-REG              | 5,552     | 97.850     | 543,263.200                       |  |
|           | SCHINDLER NAMEN                      | 1,824     | 132.400    | 241,497.600                       |  |
|           | SWISS LIFE HOLDING AG                | 3,553     | 196.700    | 698,875.100                       |  |
|           | EMS-CHEMIE HOLDING                   | 1,280     | 315.750    | 404,160.000                       |  |
|           | SWISS PRIME SITE AG                  | 5,477     | 70.700     | 387,223.900                       |  |
|           | PARTNERS GROUP HOLDING AG            | 2,010     | 239.000    | 480,390.000                       |  |

|                                       |                                 |           |                |                                     |  |
|---------------------------------------|---------------------------------|-----------|----------------|-------------------------------------|--|
|                                       | ARYZTA AG                       | 8,596     | 71.800         | 617,192.800                         |  |
|                                       | JULIUS BAER GROUP LTD           | 23,855    | 43.400         | 1,035,307.000                       |  |
|                                       | SWISS RE LTD                    | 36,822    | 80.000         | 2,945,760.000                       |  |
|                                       | TRANSOCEAN LTD                  | 39,921    | 43.480         | 1,735,765.080                       |  |
| スイス・フラン 小計                            |                                 | 1,678,394 |                | 110,127,701.840<br>(12,648,166,557) |  |
| スウェーデン・<br>クローナ                       | ATLAS COPCO AB-A SHS            | 66,188    | 177.900        | 11,774,845.200                      |  |
|                                       | ATLAS COPCO AB-B SHS            | 42,459    | 164.300        | 6,976,013.700                       |  |
|                                       | ELEKTA AB                       | 32,078    | 99.450         | 3,190,157.100                       |  |
|                                       | ERICSSON LM-B SHS               | 319,794   | 78.150         | 24,991,901.100                      |  |
|                                       | GETINGE AB-B SHS                | 22,760    | 217.100        | 4,941,196.000                       |  |
|                                       | SKF AB-B SHS                    | 43,481    | 171.600        | 7,461,339.600                       |  |
|                                       | SANDVIK AB                      | 108,906   | 88.500         | 9,638,181.000                       |  |
|                                       | SKANDINAVISKA ENSKILDA<br>BAN-A | 162,348   | 85.550         | 13,888,871.400                      |  |
|                                       | SKANSKA AB-B SHS                | 39,626    | 130.200        | 5,159,305.200                       |  |
|                                       | SWEDBANK AB                     | 88,783    | 182.300        | 16,185,140.900                      |  |
|                                       | SVENSKA CELLULOSA AB-B<br>SHS   | 63,427    | 197.000        | 12,495,119.000                      |  |
|                                       | SVENSKA HANDELSBANKEN-A<br>SHS  | 48,233    | 321.400        | 15,502,086.200                      |  |
|                                       | VOLVO AB-B SHS                  | 144,477   | 88.100         | 12,728,423.700                      |  |
|                                       | SCANIA AB                       | 35,390    | 125.400        | 4,437,906.000                       |  |
|                                       | SWEDISH MATCH AB                | 24,727    | 194.200        | 4,801,983.400                       |  |
|                                       | TELE2 AB-B SHS                  | 24,305    | 75.550         | 1,836,242.750                       |  |
|                                       | NORDEA AB                       | 312,909   | 88.200         | 27,598,573.800                      |  |
|                                       | INDUSTRIVARDEN C                | 18,353    | 126.200        | 2,316,148.600                       |  |
|                                       | ELECTROLUX AB-SER B             | 28,642    | 163.600        | 4,685,831.200                       |  |
|                                       | SECURITAS AB-B SHS              | 27,261    | 69.800         | 1,902,817.800                       |  |
|                                       | INVESTOR AB-B SHS               | 44,529    | 220.200        | 9,805,285.800                       |  |
|                                       | HENNES&MAURITZ AB-B SHS         | 94,656    | 286.200        | 27,090,547.200                      |  |
|                                       | ASSA ABLOY AB-B                 | 32,006    | 337.600        | 10,805,225.600                      |  |
| TELIASONERA AB                        | 243,599                         | 52.600    | 12,813,307.400 |                                     |  |
| LUNDIN PETROLEUM AB                   | 28,131                          | 121.000   | 3,403,851.000  |                                     |  |
| BOLIDEN AB                            | 17,761                          | 98.450    | 1,748,570.450  |                                     |  |
| ALFA LAVAL AB                         | 31,389                          | 160.100   | 5,025,378.900  |                                     |  |
| KINNEVIK INVESTMENT B                 | 23,218                          | 303.500   | 7,046,663.000  |                                     |  |
| MILLICOM INTERNATIONAL<br>CELLULAR SA | 7,723                           | 656.000   | 5,066,288.000  |                                     |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS                    | 54,633                          | 39.940    | 2,182,042.020  |                                     |  |
| HEXAGON AB                            | 21,871                          | 213.400   | 4,667,271.400  |                                     |  |
| スウェーデン・クローナ 小計                        |                                 | 2,253,663 |                | 282,166,514.420<br>(4,483,625,914)  |  |
| デンマーク・<br>クローネ                        | CARLSBERG AS-B                  | 10,483    | 581.000        | 6,090,623.000                       |  |
|                                       | A P MOLLER A/S                  | 124       | 65,250.000     | 8,091,000.000                       |  |
|                                       | AP MOLLER MAERSK A              | 62        | 62,450.000     | 3,871,900.000                       |  |
|                                       | DANSKE BANK A/S                 | 74,115    | 129.900        | 9,627,538.500                       |  |

|                |                             |           |         |                                   |  |
|----------------|-----------------------------|-----------|---------|-----------------------------------|--|
|                | NOVOZYMES-B SHS             | 24,240    | 235.100 | 5,698,824.000                     |  |
|                | NOVO NORDISK A/S-B          | 206,880   | 211.300 | 43,713,744.000                    |  |
|                | TDC A/S                     | 84,208    | 50.000  | 4,210,400.000                     |  |
|                | COLOPLAST-B                 | 12,458    | 371.200 | 4,624,409.600                     |  |
|                | DSV A/S                     | 15,918    | 182.300 | 2,901,851.400                     |  |
|                | WILLIAM DEMANT              | 2,595     | 510.500 | 1,324,747.500                     |  |
| デンマーク・クローネ 小計  |                             | 431,083   |         | 90,155,038.000<br>(1,705,733,318) |  |
| ニュージーランド・ドル    | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD   | 118,545   | 3.600   | 426,762.000                       |  |
|                | RYMAN HEALTHCARE LTD        | 41,674    | 8.120   | 338,392.880                       |  |
|                | FLETCHER BUILDING LTD       | 73,992    | 9.000   | 665,928.000                       |  |
|                | TELECOM CORP OF NEW ZEALAND | 209,231   | 2.330   | 487,508.230                       |  |
| ニュージーランド・ドル 小計 |                             | 443,442   |         | 1,918,591.110<br>(166,034,875)    |  |
| ノルウェー・クローネ     | DNB ASA                     | 98,819    | 111.000 | 10,968,909.000                    |  |
|                | NORSK HYDRO ASA             | 107,062   | 27.700  | 2,965,617.400                     |  |
|                | TELENOR ASA                 | 65,096    | 145.000 | 9,438,920.000                     |  |
|                | SUBSEA 7 SA                 | 22,609    | 120.000 | 2,713,080.000                     |  |
|                | ORKLA ASA                   | 86,098    | 46.260  | 3,982,893.480                     |  |
|                | STATOIL ASA                 | 117,819   | 152.000 | 17,908,488.000                    |  |
|                | YARA INTERNATIONAL ASA      | 21,131    | 262.000 | 5,536,322.000                     |  |
|                | AKER SOLUTIONS ASA          | 18,936    | 106.400 | 2,014,790.400                     |  |
|                | SEADRILL LTD                | 38,772    | 245.800 | 9,530,157.600                     |  |
|                | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA   | 21,678    | 115.800 | 2,510,312.400                     |  |
| ノルウェー・クローネ 小計  |                             | 598,020   |         | 67,569,490.280<br>(1,140,572,996) |  |
| ユーロ            | CRH PLC                     | 73,961    | 19.775  | 1,462,578.770                     |  |
|                | KERRY GROUP PLC-A           | 14,215    | 50.510  | 717,999.650                       |  |
|                | BANK OF IRELAND             | 2,422,842 | 0.314   | 760,772.380                       |  |
|                | UMICORE                     | 13,643    | 32.565  | 444,284.290                       |  |
|                | AIR LIQUIDE                 | 32,433    | 98.570  | 3,196,920.810                     |  |
|                | AIRBUS GROUP NV             | 62,297    | 55.780  | 3,474,926.660                     |  |
|                | AXA                         | 177,702   | 20.150  | 3,580,695.300                     |  |
|                | VEOLIA ENVIRONNEMENT        | 38,954    | 12.285  | 478,549.890                       |  |
|                | ADIDAS AG                   | 20,732    | 89.040  | 1,845,977.280                     |  |
|                | ASSICURAZIONI GENERALI      | 112,448   | 17.080  | 1,920,611.840                     |  |
|                | BANCO ESPIRITO SANTO-REG    | 157,125   | 1.234   | 193,892.250                       |  |
|                | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA | 40,778    | 16.720  | 681,808.160                       |  |
|                | DANONE                      | 57,035    | 51.320  | 2,927,036.200                     |  |
|                | SAFRAN SA                   | 28,086    | 51.530  | 1,447,271.580                     |  |
|                | INTESA SANPAOLO             | 1,125,068 | 1.932   | 2,173,631.370                     |  |
|                | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 34,402    | 84.150  | 2,894,928.300                     |  |
|                | ACCOR SA                    | 17,313    | 34.575  | 598,596.970                       |  |
|                | BOSKALIS WESTMINSTER CT     | 9,683     | 37.905  | 367,034.110                       |  |

|                                  |         |         |               |  |
|----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| BOUYGUES                         | 22,659  | 28.970  | 656,431.230   |  |
| BNP PARIBAS                      | 99,978  | 57.950  | 5,793,725.100 |  |
| REED ELSEVIER NV                 | 68,686  | 15.435  | 1,060,168.410 |  |
| THALES SA                        | 8,128   | 47.195  | 383,600.960   |  |
| CAP GEMINI SA                    | 15,406  | 51.550  | 794,179.300   |  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON        | 6,567   | 83.920  | 551,102.640   |  |
| CHRISTIAN DIOR                   | 5,133   | 131.250 | 673,706.250   |  |
| CGG                              | 16,618  | 12.665  | 210,466.970   |  |
| ALCATEL-LUCENT                   | 298,978 | 3.271   | 977,957.030   |  |
| UNICREDIT SPA                    | 437,673 | 6.005   | 2,628,226.360 |  |
| NATIXIS                          | 102,266 | 4.734   | 484,127.240   |  |
| KONINKLIJKE DSM NV               | 15,919  | 56.910  | 905,950.290   |  |
| DELHAIZE GROUP                   | 12,505  | 45.155  | 564,663.270   |  |
| COMMERZBANK AG                   | 96,311  | 13.685  | 1,318,016.030 |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA           | 13,555  | 114.400 | 1,550,692.000 |  |
| UNITED INTERNET                  | 9,260   | 32.005  | 296,366.300   |  |
| FUCHS PETROLUB SE PREF           | 4,411   | 73.610  | 324,693.710   |  |
| PUBLICIS GROUPE                  | 17,067  | 65.130  | 1,111,573.710 |  |
| MAN SE                           | 3,396   | 89.550  | 304,111.800   |  |
| IBERDROLA SA                     | 492,622 | 4.636   | 2,283,795.590 |  |
| ENI SPA                          | 253,048 | 17.330  | 4,385,321.840 |  |
| IMERYS SA                        | 4,401   | 63.000  | 277,263.000   |  |
| JERONIMO MARTINS                 | 33,291  | 14.000  | 466,074.000   |  |
| KBC GROUPE                       | 24,972  | 45.200  | 1,128,734.400 |  |
| LAFARGE SA                       | 19,853  | 56.120  | 1,114,150.360 |  |
| HANNOVER RUECK SE                | 5,730   | 60.220  | 345,060.600   |  |
| WARTSILA OYJ                     | 21,069  | 38.940  | 820,426.860   |  |
| L'OREAL                          | 25,480  | 122.850 | 3,130,218.000 |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUI V<br>SA  | 25,343  | 126.350 | 3,202,088.050 |  |
| LAGARDERE S.C.A.                 | 13,927  | 27.070  | 377,003.890   |  |
| GEA GROUP AG                     | 20,171  | 34.650  | 698,925.150   |  |
| MEDIOBANCA SPA                   | 55,752  | 6.900   | 384,688.800   |  |
| MICHELIN(CGDE) -B                | 20,134  | 78.770  | 1,585,955.180 |  |
| CONTINENTAL AG                   | 10,728  | 159.950 | 1,715,943.600 |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG             | 90,507  | 25.990  | 2,352,276.930 |  |
| NOKIAN RENKAAT OYJ               | 9,399   | 34.030  | 319,847.970   |  |
| AXEL SPRINGER SE                 | 6,021   | 49.320  | 296,955.720   |  |
| OMV AG                           | 15,010  | 35.670  | 535,406.700   |  |
| PORTUGAL TELECOM SGPS SA-<br>REG | 67,989  | 3.529   | 239,933.180   |  |
| PERNOD-RICARD                    | 20,773  | 81.510  | 1,693,207.230 |  |
| PIRELLI & C                      | 30,073  | 11.660  | 350,651.180   |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-<br>PFD   | 14,295  | 77.990  | 1,114,867.050 |  |
| RENAULT SA                       | 21,020  | 64.770  | 1,361,465.400 |  |
| REPSOL SA                        | 86,855  | 18.910  | 1,642,428.050 |  |
| REMY COINTREAU                   | 3,877   | 59.050  | 228,936.850   |  |
| MERCK KGAA                       | 6,349   | 130.000 | 825,370.000   |  |

|                                   |         |         |               |  |
|-----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV           | 82,955  | 76.090  | 6,312,045.950 |  |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN         | 44,154  | 41.130  | 1,816,054.020 |  |
| SAIPEM                            | 35,323  | 16.380  | 578,590.740   |  |
| RWE AG                            | 50,913  | 25.525  | 1,299,554.320 |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV<br>VVPR   | 39,408  | 0.001   | 39.400        |  |
| LUXOTTICA GROUP SPA               | 19,633  | 38.220  | 750,373.260   |  |
| SOCIETE GENERALE-A                | 73,735  | 44.945  | 3,314,019.570 |  |
| VINCI S.A.                        | 47,191  | 48.200  | 2,274,606.200 |  |
| SODEXO                            | 9,625   | 75.260  | 724,377.500   |  |
| SOLVAY SA                         | 5,471   | 108.200 | 591,962.200   |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SA             | 55,445  | 63.250  | 3,506,896.250 |  |
| VIVENDI SA                        | 123,403 | 19.020  | 2,347,125.060 |  |
| SAP AG                            | 95,146  | 61.210  | 5,823,886.660 |  |
| TECHNIP-COFLEXIP S.A.             | 9,593   | 69.160  | 663,451.880   |  |
| TELEFONICA S.A                    | 419,237 | 12.260  | 5,139,845.620 |  |
| TOTAL SA                          | 217,116 | 43.055  | 9,347,929.380 |  |
| VALLOUREC                         | 11,847  | 40.345  | 477,967.210   |  |
| VALEO                             | 8,400   | 85.000  | 714,000.000   |  |
| E.ON SE                           | 185,310 | 13.130  | 2,433,120.300 |  |
| VOEST-ALPINE AG                   | 9,875   | 35.610  | 351,648.750   |  |
| ZODIAC AEROSPACE                  | 3,509   | 129.800 | 455,468.200   |  |
| HENKEL AG & CO KGAA               | 14,673  | 74.160  | 1,088,149.680 |  |
| METRO AG                          | 11,655  | 35.850  | 417,831.750   |  |
| SIEMENS AG-REG                    | 80,638  | 98.520  | 7,944,455.760 |  |
| UPM-KYMMENE OYJ                   | 46,308  | 12.880  | 596,447.040   |  |
| ING GROEP NV-CVA                  | 388,916 | 10.595  | 4,120,565.020 |  |
| BAYER AG                          | 84,009  | 98.220  | 8,251,363.980 |  |
| STORA ENSO OYJ-R SHS              | 67,549  | 7.585   | 512,359.160   |  |
| HENKEL AG & CO KGAA<br>VORZUG     | 16,679  | 81.450  | 1,358,504.550 |  |
| DAIMLER AG                        | 97,645  | 62.870  | 6,138,941.150 |  |
| BASF SE                           | 94,899  | 77.490  | 7,353,723.510 |  |
| CELESIO AG                        | 8,447   | 24.165  | 204,121.750   |  |
| BEIERSDORF AG                     | 10,562  | 73.530  | 776,623.860   |  |
| HOCHTIEF AG                       | 1,935   | 63.930  | 123,704.550   |  |
| HEIDELBERGCEMENT AG               | 13,234  | 57.800  | 764,925.200   |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG<br>& CO | 21,622  | 51.600  | 1,115,695.200 |  |
| ORANGE                            | 192,070 | 9.526   | 1,829,658.820 |  |
| SAMPO OYJ-A SHS                   | 46,036  | 35.450  | 1,631,976.200 |  |
| RANDSTAD HOLDINGS                 | 13,985  | 48.550  | 678,971.750   |  |
| ALLIANZ SE                        | 46,088  | 128.500 | 5,922,308.000 |  |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA           | 203,441 | 2.852   | 580,213.730   |  |
| KONINKLIJKE AHOLD NV              | 101,654 | 13.120  | 1,333,700.480 |  |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG          | 19,236  | 34.150  | 656,909.400   |  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG            | 27,299  | 17.600  | 480,462.400   |  |
| ERSTE GROUP BANK AG               | 30,671  | 29.000  | 889,459.000   |  |

|                                 |           |         |               |  |
|---------------------------------|-----------|---------|---------------|--|
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG      | 18,428    | 152.600 | 2,812,112.800 |  |
| ARCELOR MITTAL (NL)             | 102,748   | 12.700  | 1,304,899.600 |  |
| SOCIETE BIC SA                  | 3,322     | 84.930  | 282,137.460   |  |
| DASSAULT SYSTEMES SA            | 5,838     | 86.310  | 503,877.780   |  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV     | 20,046    | 26.855  | 538,335.330   |  |
| HEINEKEN NV                     | 21,379    | 47.120  | 1,007,378.480 |  |
| AKZO NOBEL                      | 24,058    | 56.030  | 1,347,969.740 |  |
| ASML HOLDING NV                 | 37,808    | 66.440  | 2,511,963.520 |  |
| AEGON NV                        | 167,051   | 6.807   | 1,137,116.150 |  |
| VOLKSWAGEN AG                   | 3,623     | 196.800 | 713,006.400   |  |
| VOLKSWAGEN AG PFD               | 14,120    | 202.600 | 2,860,712.000 |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA    | 592,047   | 9.492   | 5,619,710.120 |  |
| KERING                          | 7,231     | 145.350 | 1,051,025.850 |  |
| CNP ASSURANCES                  | 22,463    | 15.350  | 344,807.050   |  |
| FORTUM OYJ                      | 43,978    | 16.500  | 725,637.000   |  |
| AGEAS                           | 19,877    | 32.780  | 651,568.060   |  |
| UCB SA                          | 10,367    | 52.090  | 540,017.030   |  |
| THYSSENKRUPP AG                 | 44,483    | 18.210  | 810,035.430   |  |
| UNILEVER NV-CVA                 | 166,176   | 28.475  | 4,731,861.600 |  |
| CARREFOUR SA                    | 61,756    | 28.500  | 1,760,046.000 |  |
| GAS NATURAL SDG SA              | 36,738    | 18.240  | 670,101.120   |  |
| ATOS                            | 6,025     | 66.480  | 400,542.000   |  |
| NOKIA OYJ                       | 391,422   | 5.960   | 2,332,875.120 |  |
| POHJOLA BANK PLC                | 9,831     | 15.000  | 147,465.000   |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV          | 100,900   | 27.670  | 2,791,903.000 |  |
| WOLTERS KLUWER-CVA              | 34,008    | 21.260  | 723,010.080   |  |
| SANOFI                          | 121,234   | 73.200  | 8,874,328.800 |  |
| IMMOFINANZ AG                   | 131,110   | 3.474   | 455,476.140   |  |
| STMICROELECTRONICS NV           | 80,884    | 5.763   | 466,134.490   |  |
| ELISA OYJ                       | 13,898    | 19.500  | 271,011.000   |  |
| BANCO SANTANDER SA              | 1,164,908 | 6.809   | 7,931,858.570 |  |
| METSO OYJ                       | 10,879    | 24.400  | 265,447.600   |  |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 11,690    | 52.680  | 615,829.200   |  |
| QIAGEN N.V.                     | 27,019    | 17.825  | 481,613.670   |  |
| LINDE AG                        | 19,271    | 147.400 | 2,840,545.400 |  |
| FIAT SPA                        | 92,315    | 6.790   | 626,818.850   |  |
| DEUTSCHE BANK AG-REG            | 102,711   | 38.565  | 3,961,049.710 |  |
| BMW VORZUG                      | 6,146     | 62.850  | 386,276.100   |  |
| K & S                           | 18,738    | 23.220  | 435,096.360   |  |
| SUEDZUCKER AG                   | 11,866    | 21.590  | 256,186.940   |  |
| ENEL SPA                        | 672,106   | 3.304   | 2,220,638.220 |  |
| COLRUYT NV                      | 7,116     | 40.715  | 289,727.940   |  |
| VOPAK (KON.)                    | 8,976     | 41.300  | 370,708.800   |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG         | 297,815   | 12.205  | 3,634,832.070 |  |
| BANCO POPULAR ESPANOL           | 144,093   | 5.559   | 801,012.980   |  |

|                                   |           |         |               |  |
|-----------------------------------|-----------|---------|---------------|--|
| FINMECCANICA SPA                  | 55,583    | 5.765   | 320,435.990   |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 103,908   | 7.667   | 796,662.630   |  |
| KONINKLIJKE KPN NV                | 366,685   | 2.638   | 967,315.030   |  |
| UNIPOLSAI SPA                     | 91,992    | 2.288   | 210,477.690   |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 20,044    | 61.790  | 1,238,518.760 |  |
| BANCO SABADELL                    | 344,219   | 2.132   | 733,874.900   |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT<br>SA    | 9,358     | 67.450  | 631,197.100   |  |
| GROUPE BRUX LAMBERT-STR<br>VPR    | 516       | 0.001   | 0.510         |  |
| FRAPORT AG                        | 3,149     | 55.100  | 173,509.900   |  |
| HEINEKEN HOLDING NV-A             | 8,014     | 44.420  | 355,981.880   |  |
| INDITEX                           | 22,630    | 117.900 | 2,668,077.000 |  |
| JC DECAUX INTERNATIONAL           | 8,589     | 31.135  | 267,418.510   |  |
| ANDRITZ AG                        | 9,129     | 43.400  | 396,198.600   |  |
| MAPFRE SA                         | 80,219    | 3.416   | 274,028.100   |  |
| ESSILOR INTL                      | 19,980    | 81.400  | 1,626,372.000 |  |
| SNAM SPA                          | 225,511   | 4.042   | 911,515.460   |  |
| CREDIT AGRICOLE SA                | 111,051   | 10.200  | 1,132,720.200 |  |
| ENAGAS                            | 15,332    | 19.710  | 302,193.720   |  |
| WENDEL                            | 4,087     | 106.000 | 433,222.000   |  |
| TENARIS SA                        | 46,257    | 15.810  | 731,323.170   |  |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE<br>SCPA | 74,954    | 5.530   | 414,495.620   |  |
| TELECOM ITALIA SPA                | 1,035,863 | 0.806   | 834,905.570   |  |
| TELECOM ITALIA-RNC                | 792,074   | 0.630   | 499,006.620   |  |
| ATLANTIA SPA                      | 38,919    | 17.180  | 668,628.420   |  |
| ILIAD SA                          | 2,821     | 162.100 | 457,284.100   |  |
| BELGACOM SA                       | 13,498    | 21.280  | 287,237.440   |  |
| SES FDR                           | 28,786    | 23.470  | 675,607.420   |  |
| TERNA SPA                         | 179,290   | 3.636   | 651,898.440   |  |
| GRIFOLS SA                        | 17,550    | 37.935  | 665,759.250   |  |
| FERROVIAL SA                      | 45,760    | 14.515  | 664,206.400   |  |
| LANXESS MANUFACTURES<br>POLYMERS  | 6,856     | 47.390  | 324,905.840   |  |
| SKY DEUTSCHLAND AG                | 45,911    | 7.502   | 344,424.320   |  |
| EXOR SPA                          | 9,585     | 29.600  | 283,716.000   |  |
| NESTE OIL OYJ                     | 10,692    | 14.620  | 156,317.040   |  |
| RAIFFEISEN BANK<br>INTERNATIONAL  | 9,099     | 26.600  | 242,033.400   |  |
| IRISH BANK RESOLUTION<br>CORP     | 91,316    | 0.000   | 0.000         |  |
| FUGRO CERT                        | 7,283     | 42.605  | 310,292.210   |  |
| KONE OYJ                          | 31,230    | 32.230  | 1,006,542.900 |  |
| GDF SUEZ                          | 136,591   | 16.770  | 2,290,631.070 |  |
| ALSTOM                            | 22,916    | 26.195  | 600,284.620   |  |
| TELENET GROUP HOLDING NV          | 5,025     | 43.295  | 217,557.370   |  |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS           | 17,450    | 22.035  | 384,510.750   |  |
| ELECTRICITE DE FRANCE             | 23,911    | 24.980  | 597,296.780   |  |

|  |            |         |                                     |  |
|--|------------|---------|-------------------------------------|--|
| DEUTSCHE WOHNEN AG                                   | 32,216     | 14.410  | 464,232.560                         |  |
| ARKEMA SA  | 5,658      | 80.540  | 455,695.320                         |  |
| LEGRAND SA   | 27,260     | 38.550  | 1,050,873.000                       |  |
| ADP  | 2,540      | 82.810  | 210,337.400                         |  |
| ORION OYJ  | 8,051      | 20.530  | 165,287.030                         |  |
| RTL GROUP SA   | 3,848      | 96.930  | 372,986.640                         |  |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B<br>SHRS                       | 34,018     | 11.955  | 406,685.190                         |  |
| SCOR SE  | 14,425     | 25.640  | 369,857.000                         |  |
| REXEL SA   | 20,799     | 19.965  | 415,252.030                         |  |
| PRYSMIAN SPA   | 14,445     | 18.620  | 268,965.900                         |  |
| CAIXABANK  | 156,629    | 4.313   | 675,540.870                         |  |
| BUREAU VERITAS SA                                    | 24,211     | 21.045  | 509,520.490                         |  |
| GROUPE EUROTUNNEL SA                                 | 46,533     | 8.400   | 390,877.200                         |  |
| SUEZ ENVIRONNEMENT SA                                | 22,673     | 13.320  | 302,004.360                         |  |
| GDF SUEZ-STRIP VVPR                                  | 3,318      | 0.001   | 3.310                               |  |
| AMADEUS IT HOLDING SA                                | 42,576     | 30.560  | 1,301,122.560                       |  |
| TNT EXPRESS NV W/I                                   | 34,234     | 6.849   | 234,468.660                         |  |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING<br>AG                      | 2,019      | 96.010  | 193,844.190                         |  |
| ENEL GREEN POWER SPA                                 | 224,723    | 1.885   | 423,602.850                         |  |
| BRENNTAG AG  | 5,161      | 128.450 | 662,930.450                         |  |
| INTERNATIONAL<br>CONSOLIDATED AIRLINES<br>GROUP SA   | 119,317    | 5.166   | 616,391.620                         |  |
| DISTRIBUIDORA<br>INTERNACIONAL DE<br>ALIMENTACION SA | 58,607     | 6.575   | 385,341.020                         |  |
| DELTA LLOYD NV                                       | 19,898     | 18.940  | 376,868.120                         |  |
| EDENRED  | 18,682     | 23.700  | 442,763.400                         |  |
| ZIGGO NV   | 16,833     | 33.800  | 568,955.400                         |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND<br>HOLDING AG                 | 31,777     | 6.145   | 195,269.660                         |  |
| HUGO BOSS AG -ORD                                    | 4,016      | 97.740  | 392,523.840                         |  |
| OSRAM LICHT AG                                       | 9,503      | 44.000  | 418,132.000                         |  |
| GEMALTO  | 8,626      | 80.200  | 691,805.200                         |  |
| OCI NV   | 10,713     | 33.400  | 357,814.200                         |  |
| CNH INDUSTRIAL NV                                    | 109,614    | 8.420   | 922,949.880                         |  |
| REPSOL SA - RTS                                      | 95,127     | 0.506   | 48,134.260                          |  |
| IBERDROLA SA - RTS                                   | 492,622    | 0.129   | 63,548.230                          |  |
| ユーロ 小計   | 21,101,265 |         | 300,936,179.530<br>(42,495,197,912) |  |
| 香港・ドル  |            |         |                                     |  |
| ASM PACIFIC TECH                                     | 36,200     | 70.000  | 2,534,000.000                       |  |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD                             | 218,000    | 23.950  | 5,221,100.000                       |  |
| BANK OF EAST ASIA                                    | 111,660    | 31.600  | 3,528,456.000                       |  |
| CLP HOLDINGS LTD                                     | 204,000    | 60.200  | 12,280,800.000                      |  |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS                               | 114,000    | 17.080  | 1,947,120.000                       |  |
| LI & FUNG LTD  | 532,400    | 10.600  | 5,643,440.000                       |  |
| CHEUNG KONG HOLDINGS LTD                             | 136,000    | 120.100 | 16,333,600.000                      |  |



|                                   |             |         |                                      |  |
|-----------------------------------|-------------|---------|--------------------------------------|--|
| CHEUNG KONG<br>INFRASTRUCTURE     | 49,000      | 47.200  | 2,312,800.000                        |  |
| HONG KONG EXCHANGES<br>&CLEAR     | 108,200     | 126.900 | 13,730,580.000                       |  |
| MTR CORP                          | 165,500     | 28.550  | 4,725,025.000                        |  |
| FIRST PACIFIC CO                  | 223,500     | 8.300   | 1,855,050.000                        |  |
| HANG SENG BANK LTD                | 85,500      | 122.500 | 10,473,750.000                       |  |
| HENDERSON LAND<br>DEVELOPMENT     | 111,700     | 44.500  | 4,970,650.000                        |  |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD         | 130,500     | 59.150  | 7,719,075.000                        |  |
| (THE) WHARF HOLDINGS LTD          | 163,750     | 59.600  | 9,759,500.000                        |  |
| HONG KONG & CHINA GAS             | 564,740     | 17.160  | 9,690,938.400                        |  |
| HUTCHISON WHAMPOA LTD             | 222,000     | 106.400 | 23,620,800.000                       |  |
| HYSAN DEVELOPMENT CO              | 88,000      | 33.300  | 2,930,400.000                        |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT<br>GROUP LTD | 208,000     | 77.050  | 16,026,400.000                       |  |
| KERRY PROPERTIES LTD              | 88,000      | 26.150  | 2,301,200.000                        |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS<br>LTD     | 451,500     | 24.300  | 10,971,450.000                       |  |
| YUE YUEN INDUSTRIAL<br>HOLDINGS   | 86,000      | 24.500  | 2,107,000.000                        |  |
| NEW WORLD DEVELOPMENT             | 430,700     | 9.920   | 4,272,544.000                        |  |
| SHANGRI-LA ASIA LTD               | 230,000     | 14.960  | 3,440,800.000                        |  |
| SINO LAND CO                      | 257,400     | 10.700  | 2,754,180.000                        |  |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES           | 164,000     | 96.900  | 15,891,600.000                       |  |
| SWIRE PACIFIC LTD A               | 73,500      | 88.150  | 6,479,025.000                        |  |
| WHEELLOCK & CO LTD                | 107,000     | 36.100  | 3,862,700.000                        |  |
| SJM HOLDINGS LTD                  | 196,000     | 25.350  | 4,968,600.000                        |  |
| WYNN MACAU LTD                    | 169,600     | 36.700  | 6,224,320.000                        |  |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD            | 89,600      | 33.850  | 3,032,960.000                        |  |
| AIA GROUP LTD                     | 1,241,200   | 37.200  | 46,172,640.000                       |  |
| SANDS CHINA LTD                   | 240,000     | 63.500  | 15,240,000.000                       |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD              | 163,200     | 20.400  | 3,329,280.000                        |  |
| 香港・ドル 小計                          | 7,460,350   |         | 286,351,783.400<br>(3,814,205,755)   |  |
| 合計                                | 112,402,075 |         | 298,535,209,958<br>(298,535,209,958) |  |

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

| 種 類      | 通 貨        | 銘 柄                                | 券面総額        | 評価額         | 備考 |
|----------|------------|------------------------------------|-------------|-------------|----|
| 投資信託受益証券 | オーストラリア・ドル | CFS RETAIL PROPERTY TRUST<br>GROUP | 235,579.000 | 467,624.310 |    |
|          |            | DEXUS PROPERTY GROUP               | 553,747.000 | 575,896.880 |    |
|          |            | FEDERATION CENTRES                 | 146,114.000 | 346,290.180 |    |
|          |            | GOODMAN GROUP                      | 155,160.000 | 740,113.200 |    |
|          |            | GPT GROUP                          | 198,416.000 | 714,297.600 |    |
|          |            | LEND LEASE GROUP                   | 46,860.000  | 520,614.600 |    |
|          |            | MIRVAC GROUP                       | 399,690.000 | 689,465.250 |    |
|          |            | STOCKLAND                          | 210,736.000 | 796,582.080 |    |

|             |                      |                                 |                     |                                |                                   |  |
|-------------|----------------------|---------------------------------|---------------------|--------------------------------|-----------------------------------|--|
|             |                      | WESTFIELD GROUP                 | 201,312.000         | 2,039,290.560                  |                                   |  |
|             |                      | WESTFIELD RETAIL TRUST          | 326,593.000         | 996,108.650                    |                                   |  |
|             | オーストラリア・ドル           | 小計                              | 2,474,207.000       | 7,886,283.310<br>(736,263,410) |                                   |  |
|             | シンガポール・ドル            | ASCENDAS REAL ESTATE INVT       | 295,906.000         | 642,116.020                    |                                   |  |
|             |                      | CAPITACOMMERCIAL TRUST          | 211,000.000         | 308,060.000                    |                                   |  |
|             |                      | CAPITAMALL TRUST                | 294,800.000         | 549,802.000                    |                                   |  |
|             | シンガポール・ドル            | 小計                              | 801,706.000         | 1,499,978.020<br>(122,428,206) |                                   |  |
| 投資信託受益証券 合計 |                      |                                 | 3,275,913           | 858,691,616<br>(858,691,616)   |                                   |  |
| 投資証券        | アメリカ・ドル              | AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP    | 45,817.000          | 936,957.650                    |                                   |  |
|             |                      | AMERICAN TOWER CORP             | 40,012.000          | 3,286,585.680                  |                                   |  |
|             |                      | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT       | 88,038.000          | 914,714.820                    |                                   |  |
|             |                      | AVALONBAY COMMUNITIES INC       | 11,610.000          | 1,402,836.300                  |                                   |  |
|             |                      | BOSTON PROPERTIES INC           | 16,442.000          | 1,703,391.200                  |                                   |  |
|             |                      | CAMDEN PROPERTY TRUST           | 6,285.000           | 369,872.250                    |                                   |  |
|             |                      | COLE REAL ESTATE INVESTMENT INC | 50,958.000          | 725,641.920                    |                                   |  |
|             |                      | DIGITAL REALTY TRUST INC        | 15,517.000          | 779,108.570                    |                                   |  |
|             |                      | DUKE REALTY TRUST               | 38,117.000          | 568,705.640                    |                                   |  |
|             |                      | EQUITY RESIDENTIAL              | 37,715.000          | 2,007,192.300                  |                                   |  |
|             |                      | FEDERAL REALTY INVS TRUST       | 7,764.000           | 809,552.280                    |                                   |  |
|             |                      | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC   | 46,720.000          | 951,686.400                    |                                   |  |
|             |                      | HCP INC                         | 44,698.000          | 1,703,440.780                  |                                   |  |
|             |                      | HEALTH CARE REIT INC            | 30,578.000          | 1,710,839.100                  |                                   |  |
|             |                      | HOST HOTELS & RESORTS INC       | 80,629.000          | 1,538,401.320                  |                                   |  |
|             |                      | KIMCO REALTY                    | 32,980.000          | 667,515.200                    |                                   |  |
|             |                      | LIBERTY PROPERTY TRUST          | 16,250.000          | 557,700.000                    |                                   |  |
|             |                      | PLUM CREEK TIMBER CO            | 13,352.000          | 586,419.840                    |                                   |  |
|             |                      | PROLOGIS INC                    | 53,944.000          | 1,982,442.000                  |                                   |  |
|             |                      | PUBLIC STORAGE                  | 14,278.000          | 2,198,240.880                  |                                   |  |
|             |                      | RAYONIER INC                    | 10,834.000          | 449,936.020                    |                                   |  |
|             |                      | REALTY INCOME CORP              | 16,761.000          | 641,778.690                    |                                   |  |
|             |                      | REGENCY CENTERS CORP            | 10,144.000          | 476,260.800                    |                                   |  |
|             |                      | SIMON PROPERTY GROUP INC        | 31,510.000          | 4,889,406.700                  |                                   |  |
|             |                      | SL GREEN                        | 10,737.000          | 989,414.550                    |                                   |  |
|             |                      | THE MACERICH COMPANY            | 15,776.000          | 922,264.960                    |                                   |  |
|             |                      | UDR INC                         | 28,307.000          | 661,251.520                    |                                   |  |
|             |                      | VENTAS INC                      | 31,176.000          | 1,867,442.400                  |                                   |  |
|             | VORNADO REALTY TRUST | 16,326.000                      | 1,484,686.440       |                                |                                   |  |
|             | WEYERHAEUSER CO      | 60,041.000                      | 1,836,053.780       |                                |                                   |  |
|             |                      | アメリカ・ドル                         | 小計                  | 923,316.000                    | 39,619,739.990<br>(4,093,511,536) |  |
|             |                      | イギリス・ポンド                        | BRITISH LAND CO PLC | 82,388.000                     | 531,814.540                       |  |
|             |                      |                                 | HAMMERSON PLC       | 68,046.000                     | 344,993.220                       |  |
|             | INTU PROPERTIES PLC  |                                 | 89,110.000          | 279,359.850                    |                                   |  |

|             |                                 |             |                                  |  |
|-------------|---------------------------------|-------------|----------------------------------|--|
|             | LAND SECURITIES GROUP PLC       | 85,101.000  | 847,180.450                      |  |
|             | SEGRO PLC                       | 87,111.000  | 298,529.390                      |  |
| イギリス・ポンド 小計 |                                 | 411,756.000 | 2,301,877.450<br>(389,984,078)   |  |
| カナダ・ドル      | BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES    | 24,845.000  | 502,117.450                      |  |
|             | H & R REAL ESTATE INVESTMENT    | 9,731.000   | 209,119.190                      |  |
|             | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 15,764.000  | 399,932.680                      |  |
| カナダ・ドル 小計   |                                 | 50,340.000  | 1,111,169.320<br>(105,438,857)   |  |
| ユーロ         | CORIO NV                        | 7,710.000   | 252,309.750                      |  |
|             | GECINA SA                       | 2,977.000   | 286,566.020                      |  |
|             | ICADE                           | 3,001.000   | 198,066.000                      |  |
|             | KLEPIERRE                       | 13,172.000  | 443,896.400                      |  |
|             | UNIBAIL-RODAMCO SE              | 9,344.000   | 1,748,262.400                    |  |
| ユーロ 小計      |                                 | 36,204.000  | 2,929,100.570<br>(413,618,291)   |  |
| 香港・ドル       | LINK REIT/THE                   | 240,500.000 | 8,489,650.000                    |  |
| 香港・ドル 小計    |                                 | 240,500.000 | 8,489,650.000<br>(113,082,138)   |  |
| 投資証券 合計     |                                 | 1,662,116   | 5,115,634,900<br>(5,115,634,900) |  |
| 合計          |                                 |             | 5,974,326,516<br>(5,974,326,516) |  |

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

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

| 通貨          | 銘柄数               | 組入株式<br>時価比率 | 組入<br>投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|-------------|-------------------|--------------|----------------------------|--------------------|-------------------------|
| アメリカ・ドル     | 株式 581銘柄          | 56.92%       | -%                         | -%                 | 59.30%                  |
|             | 投資証券 30銘柄         | -%           | -%                         | 1.32%              |                         |
| イギリス・ポンド    | 株式 101銘柄          | 9.68%        | -%                         | -%                 | 9.99%                   |
|             | 投資証券 5銘柄          | -%           | -%                         | 0.13%              |                         |
| イスラエル・シケル   | 株式 5銘柄            | 0.20%        | -%                         | -%                 | 0.21%                   |
| オーストラリア・ドル  | 株式 58銘柄           | 3.13%        | -%                         | -%                 | 3.42%                   |
|             | 投資信託<br>受益証券 10銘柄 | -%           | 0.24%                      | -%                 |                         |
| カナダ・ドル      | 株式 91銘柄           | 4.33%        | -%                         | -%                 | 4.45%                   |
|             | 投資証券 3銘柄          | -%           | -%                         | 0.03%              |                         |
| シンガポール・ドル   | 株式 24銘柄           | 0.59%        | -%                         | -%                 | 0.64%                   |
|             | 投資信託<br>受益証券 3銘柄  | -%           | 0.04%                      | -%                 |                         |
| スイス・フラン     | 株式 37銘柄           | 4.08%        | -%                         | -%                 | 4.15%                   |
| スウェーデン・クローナ | 株式 31銘柄           | 1.45%        | -%                         | -%                 | 1.47%                   |
| デンマーク・クローネ  | 株式 10銘柄           | 0.55%        | -%                         | -%                 | 0.56%                   |
| ニュージーランド・ドル | 株式 4銘柄            | 0.05%        | -%                         | -%                 | 0.05%                   |
| ノルウェー・クローネ  | 株式 10銘柄           | 0.37%        | -%                         | -%                 | 0.37%                   |
| ユーロ         | 株式 230銘柄          | 13.71%       | -%                         | -%                 | 14.09%                  |
|             | 投資証券 5銘柄          | -%           | -%                         | 0.13%              |                         |
| 香港・ドル       | 株式 34銘柄           | 1.23%        | -%                         | -%                 | 1.29%                   |
|             | 投資証券 1銘柄          | -%           | -%                         | 0.04%              |                         |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

| 科 目      | 注記<br>番号 | 平成25年1月11日現在    | 平成26年1月14日現在    |
|----------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部     |          |                 |                 |
| 流動資産     |          |                 |                 |
| 預金       |          | 2,694,113,013   | 6,230,132,062   |
| コール・ローン  |          | 215,455,666     | 237,609,652     |
| 国債証券     |          | 391,575,850,371 | 379,095,794,508 |
| 派生商品評価勘定 |          | 2,611           | 155,013         |

|             |   |                 |                 |
|-------------|---|-----------------|-----------------|
| 未収利息        |   | 4,422,869,430   | 4,376,904,703   |
| 前払費用        |   | 78,430,631      | 138,879,680     |
| 流動資産合計      |   | 398,986,721,722 | 390,079,475,618 |
| 資産合計        |   | 398,986,721,722 | 390,079,475,618 |
| 負債の部        |   |                 |                 |
| 流動負債        |   |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    |   | 1,627,128       | -               |
| 未払解約金       |   | 104,449,000     | 93,908,000      |
| 流動負債合計      |   | 106,076,128     | 93,908,000      |
| 負債合計        |   | 106,076,128     | 93,908,000      |
| 純資産の部       |   |                 |                 |
| 元本等         |   |                 |                 |
| 元本          | 1 | 286,407,723,256 | 238,565,930,026 |
| 剰余金         |   |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) |   | 112,472,922,338 | 151,419,637,592 |
| 元本等合計       |   | 398,880,645,594 | 389,985,567,618 |
| 純資産合計       |   | 398,880,645,594 | 389,985,567,618 |
| 負債純資産合計     |   | 398,986,721,722 | 390,079,475,618 |

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法      | <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>  |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>               |

## (貸借対照表に関する注記)

| 項目  | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在   |
|---|--|--|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額<br>同期中追加設定元本額<br>同期中一部解約元本額   | 320,315,770,753円<br><br>20,040,695,235円<br>53,948,742,732円   | 286,407,723,256円<br><br>16,750,273,193円<br>64,592,066,423円   |
| 元本の内訳<br>ファンド名 <ul style="list-style-type: none"> <li>D I A M外国債券パッシブ・ファンド</li> <li>D I A M外国債券インデックスファンド&lt;DC年金&gt;</li> <li>D I A Mバランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 1 安定型</li> <li>D I A Mバランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 2 安定・成長型</li> <li>D I A Mバランス・ファンド&lt;DC年金&gt; 3 成長型</li> <li>D I A M DC バランス30インデックスファンド</li> <li>D I A M DC バランス50インデックスファンド</li> </ul> | 1,850,163,418円<br>4,311,702,246円<br>343,786,882円<br>1,211,058,264円<br>1,225,792,520円<br>323,665,802円<br>655,695,333円 | 3,039,043,112円<br>4,192,829,760円<br>331,588,356円<br>1,211,540,212円<br>1,297,002,520円<br>305,504,835円<br>657,173,695円 |

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

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



|   |                  |                  |
|---|------------------|------------------|
| D I A Mバランス50V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 223,959円         | 305,404,315円     |
| D I A Mバランス70V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 140,474円         | 91,450,251円      |
| D I A M世界アセットバ<br>ランスファンド4VA<br>(適格機関投資家限定) | 24,532,037,030円  | 21,701,242,973円  |
| D I A M世界バランス2<br>5VA(適格機関投資家<br>限定)        | 237,498,841円     | 202,670,862円     |
| D I A Mバランス20V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 527,215,625円     | 376,321,065円     |
| D I A Mバランス40V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 207,824円         | 13,410,530円      |
| D I A Mバランス60V<br>A(適格機関投資家限<br>定)          | 127,183円         | 132,666円         |
| 計   | 286,407,723,256円 | 238,565,930,026円 |
| 2. 受益権の総数                                   | 286,407,723,256口 | 238,565,930,026口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日   | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
|--------------------------|--|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。  | 同左                           |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                           |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。   | 同左                           |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   | 同左           |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「(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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。           | 同左           |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左           |

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成25年1月11日現在      | 平成26年1月14日現在      |
|------|-------------------|-------------------|
|      | 当期の損益に含まれた評価差額(円) | 当期の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 6,527,210,258     | 6,031,225,829     |
| 合計   | 6,527,210,258     | 6,031,225,829     |

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

| 種類                                | 平成25年1月11日 現在 |           |            |             | 平成26年1月14日 現在 |           |             |             |
|-----------------------------------|---------------|-----------|------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
|                                   | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)  | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|                                   |               |           |            |             |               |           |             |             |
| 市場取引以外の取引<br>為替予約取引<br>売 建<br>ユーロ | 89,283,643    | -         | 90,908,160 | 1,624,517   | 152,792,213   | -         | 152,637,200 | 155,013     |
| 合計                                | 89,283,643    | -         | 90,908,160 | 1,624,517   | 152,792,213   | -         | 152,637,200 | 155,013     |

## （注）時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

該当事項はありません。

## （2）株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

| 種類   | 通貨      | 銘柄                      | 券面総額           | 評価額            | 備考 |
|------|---------|-------------------------|----------------|----------------|----|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | US T N/B 0.25 12/15/15  | 11,000,000.000 | 10,980,640.000 |    |
|      |         | US T N/B 0.375 01/15/16 | 15,000,000.000 | 15,002,250.000 |    |
|      |         | US T N/B 0.375 06/15/15 | 20,000,000.000 | 20,046,000.000 |    |

|                         |                |                |  |
|-------------------------|----------------|----------------|--|
| US T N/B 0.5 07/31/17   | 15,000,000.000 | 14,732,700.000 |  |
| US T N/B 0.625 05/31/17 | 20,000,000.000 | 19,797,600.000 |  |
| US T N/B 0.625 07/15/16 | 38,000,000.000 | 38,081,320.000 |  |
| US T N/B 0.75 02/28/18  | 11,500,000.000 | 11,256,430.000 |  |
| US T N/B 0.75 12/31/17  | 19,000,000.000 | 18,663,700.000 |  |
| US T N/B 1.0 05/31/18   | 15,000,000.000 | 14,756,250.000 |  |
| US T N/B 1.0 08/31/16   | 10,000,000.000 | 10,105,800.000 |  |
| US T N/B 1.0 08/31/19   | 7,000,000.000  | 6,681,150.000  |  |
| US T N/B 1.0 09/30/16   | 6,000,000.000  | 6,059,280.000  |  |
| US T N/B 1.0 10/31/16   | 8,000,000.000  | 8,073,120.000  |  |
| US T N/B 1.0 11/30/19   | 9,000,000.000  | 8,536,590.000  |  |
| US T N/B 1.125 05/31/19 | 8,000,000.000  | 7,741,200.000  |  |
| US T N/B 1.25 08/31/15  | 30,000,000.000 | 30,482,700.000 |  |
| US T N/B 1.25 09/30/15  | 23,000,000.000 | 23,378,120.000 |  |
| US T N/B 1.25 10/31/19  | 13,000,000.000 | 12,550,070.000 |  |
| US T N/B 1.375 02/28/19 | 10,000,000.000 | 9,870,300.000  |  |
| US T N/B 1.375 05/31/20 | 15,500,000.000 | 14,846,055.000 |  |
| US T N/B 1.375 09/30/18 | 17,500,000.000 | 17,391,850.000 |  |
| US T N/B 1.375 11/30/15 | 17,000,000.000 | 17,329,970.000 |  |
| US T N/B 1.375 11/30/18 | 25,000,000.000 | 24,795,750.000 |  |
| US T N/B 1.625 08/15/22 | 3,000,000.000  | 2,765,850.000  |  |
| US T N/B 1.625 11/15/22 | 10,500,000.000 | 9,623,880.000  |  |
| US T N/B 1.75 05/15/22  | 8,000,000.000  | 7,500,000.000  |  |
| US T N/B 1.75 05/15/23  | 19,000,000.000 | 17,404,190.000 |  |
| US T N/B 1.75 05/31/16  | 20,500,000.000 | 21,106,185.000 |  |
| US T N/B 1.75 07/31/15  | 15,000,000.000 | 15,348,600.000 |  |
| US T N/B 1.75 10/31/20  | 6,000,000.000  | 5,826,060.000  |  |
| US T N/B 1.875 06/30/15 | 15,000,000.000 | 15,359,700.000 |  |
| US T N/B 1.875 06/30/20 | 16,000,000.000 | 15,783,040.000 |  |
| US T N/B 1.875 08/31/17 | 8,000,000.000  | 8,234,960.000  |  |
| US T N/B 1.875 09/30/17 | 18,000,000.000 | 18,517,500.000 |  |
| US T N/B 2.0 02/15/22   | 12,000,000.000 | 11,542,440.000 |  |
| US T N/B 2.0 02/15/23   | 16,000,000.000 | 15,068,640.000 |  |
| US T N/B 2.0 04/30/16   | 18,000,000.000 | 18,630,000.000 |  |
| US T N/B 2.0 09/30/20   | 16,000,000.000 | 15,817,440.000 |  |
| US T N/B 2.0 11/15/21   | 3,000,000.000  | 2,900,850.000  |  |
| US T N/B 2.125 08/15/21 | 11,000,000.000 | 10,799,690.000 |  |
| US T N/B 2.125 08/31/20 | 3,000,000.000  | 2,994,120.000  |  |
| US T N/B 2.25 01/31/15  | 25,000,000.000 | 25,546,750.000 |  |
| US T N/B 2.25 11/30/17  | 17,000,000.000 | 17,701,250.000 |  |
| US T N/B 2.375 02/28/15 | 23,000,000.000 | 23,566,720.000 |  |
| US T N/B 2.375 03/31/16 | 20,000,000.000 | 20,857,000.000 |  |
| US T N/B 2.375 06/30/18 | 6,000,000.000  | 6,252,600.000  |  |
| US T N/B 2.5 03/31/15   | 30,000,000.000 | 30,835,500.000 |  |
| US T N/B 2.5 04/30/15   | 20,000,000.000 | 20,595,200.000 |  |
| US T N/B 2.5 06/30/17   | 8,000,000.000  | 8,418,720.000  |  |
| US T N/B 2.5 08/15/23   | 16,000,000.000 | 15,608,640.000 |  |
| US T N/B 2.625 08/15/20 | 16,500,000.000 | 17,019,420.000 |  |
| US T N/B 2.625 11/15/20 | 6,000,000.000  | 6,166,860.000  |  |

|                         |                |                |  |
|-------------------------|----------------|----------------|--|
| US T N/B 2.625 12/31/14 | 25,000,000.000 | 25,594,500.000 |  |
| US T N/B 2.75 02/15/19  | 11,000,000.000 | 11,605,000.000 |  |
| US T N/B 2.75 08/15/42  | 6,000,000.000  | 4,917,600.000  |  |
| US T N/B 2.75 11/15/42  | 6,900,000.000  | 5,642,337.000  |  |
| US T N/B 2.75 11/30/16  | 14,000,000.000 | 14,816,480.000 |  |
| US T N/B 2.875 03/31/18 | 10,000,000.000 | 10,647,600.000 |  |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 13,500,000.000 | 11,308,275.000 |  |
| US T N/B 3.0 02/28/17   | 20,000,000.000 | 21,346,800.000 |  |
| US T N/B 3.0 05/15/42   | 7,000,000.000  | 6,069,210.000  |  |
| US T N/B 3.0 09/30/16   | 20,000,000.000 | 21,276,400.000 |  |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 7,900,000.000  | 7,038,979.000  |  |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 11,500,000.000 | 10,173,820.000 |  |
| US T N/B 3.125 04/30/17 | 18,000,000.000 | 19,306,260.000 |  |
| US T N/B 3.125 05/15/19 | 13,000,000.000 | 13,950,040.000 |  |
| US T N/B 3.125 05/15/21 | 16,000,000.000 | 16,878,720.000 |  |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 5,000,000.000  | 4,460,900.000  |  |
| US T N/B 3.25 03/31/17  | 12,000,000.000 | 12,916,800.000 |  |
| US T N/B 3.25 06/30/16  | 25,000,000.000 | 26,674,750.000 |  |
| US T N/B 3.25 12/31/16  | 20,000,000.000 | 21,486,600.000 |  |
| US T N/B 3.375 11/15/19 | 4,000,000.000  | 4,340,280.000  |  |
| US T N/B 3.5 02/15/18   | 14,000,000.000 | 15,258,880.000 |  |
| US T N/B 3.5 02/15/39   | 5,000,000.000  | 4,851,550.000  |  |
| US T N/B 3.5 05/15/20   | 14,000,000.000 | 15,248,940.000 |  |
| US T N/B 3.625 02/15/20 | 18,000,000.000 | 19,763,280.000 |  |
| US T N/B 3.625 02/15/21 | 10,500,000.000 | 11,458,125.000 |  |
| US T N/B 3.625 08/15/19 | 9,000,000.000  | 9,886,230.000  |  |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 10,000,000.000 | 9,742,900.000  |  |
| US T N/B 3.75 08/15/41  | 5,000,000.000  | 5,026,150.000  |  |
| US T N/B 3.75 11/15/18  | 10,000,000.000 | 11,039,800.000 |  |
| US T N/B 3.75 11/15/43  | 2,800,000.000  | 2,792,328.000  |  |
| US T N/B 3.875 05/15/18 | 8,000,000.000  | 8,863,120.000  |  |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 5,200,000.000  | 5,361,668.000  |  |
| US T N/B 4.0 02/15/15   | 20,000,000.000 | 20,832,000.000 |  |
| US T N/B 4.0 08/15/18   | 12,000,000.000 | 13,375,200.000 |  |
| US T N/B 4.125 05/15/15 | 18,000,000.000 | 18,939,240.000 |  |
| US T N/B 4.25 05/15/39  | 3,000,000.000  | 3,292,950.000  |  |
| US T N/B 4.25 08/15/15  | 15,000,000.000 | 15,949,800.000 |  |
| US T N/B 4.25 11/15/17  | 9,000,000.000  | 10,053,900.000 |  |
| US T N/B 4.25 11/15/40  | 4,700,000.000  | 5,153,832.000  |  |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 2,500,000.000  | 2,796,075.000  |  |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 4,600,000.000  | 5,146,250.000  |  |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 3,000,000.000  | 3,352,590.000  |  |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 3,100,000.000  | 3,468,342.000  |  |
| US T N/B 4.5 02/15/16   | 16,000,000.000 | 17,369,280.000 |  |
| US T N/B 4.5 02/15/36   | 4,400,000.000  | 5,022,864.000  |  |
| US T N/B 4.5 05/15/38   | 1,500,000.000  | 1,709,880.000  |  |
| US T N/B 4.5 08/15/39   | 3,200,000.000  | 3,650,496.000  |  |
| US T N/B 4.5 11/15/15   | 18,000,000.000 | 19,373,040.000 |  |
| US T N/B 4.625 02/15/17 | 14,000,000.000 | 15,632,960.000 |  |

|            |                              |  |  |  |
|------------|------------------------------|--|--|--|
|            | US T N/B 4.625 02/15/40      | 6,000,000.000                          | 6,975,180.000                          |  |
|            | US T N/B 4.75 02/15/41       | 5,500,000.000                          | 6,515,740.000                          |  |
|            | US T N/B 4.75 08/15/17       | 15,000,000.000                         | 16,987,500.000                         |  |
|            | US T N/B 4.875 08/15/16      | 17,000,000.000                         | 18,882,580.000                         |  |
|            | US T N/B 5.0 05/15/37        | 1,700,000.000                          | 2,076,244.000                          |  |
|            | US T N/B 5.25 02/15/29       | 2,500,000.000                          | 3,069,725.000                          |  |
|            | US T N/B 5.25 11/15/28       | 3,000,000.000                          | 3,682,500.000                          |  |
|            | US T N/B 5.375 02/15/31      | 4,000,000.000                          | 5,012,480.000                          |  |
|            | US T N/B 5.5 08/15/28        | 1,000,000.000                          | 1,257,180.000                          |  |
|            | US T N/B 6.0 02/15/26        | 4,000,000.000                          | 5,191,840.000                          |  |
|            | US T N/B 6.125 11/15/27      | 2,800,000.000                          | 3,711,736.000                          |  |
|            | US T N/B 6.25 05/15/30       | 3,000,000.000                          | 4,090,290.000                          |  |
|            | US T N/B 6.25 08/15/23       | 5,000,000.000                          | 6,508,000.000                          |  |
|            | US T N/B 7.25 05/15/16       | 10,000,000.000                         | 11,572,200.000                         |  |
|            | US T N/B 7.5 11/15/16        | 4,000,000.000                          | 4,765,920.000                          |  |
|            | US T N/B 8.0 11/15/21        | 6,000,000.000                          | 8,422,020.000                          |  |
|            | US T N/B 8.125 08/15/19      | 4,000,000.000                          | 5,365,920.000                          |  |
|            | US T N/B 8.75 05/15/17       | 7,000,000.000                          | 8,804,670.000                          |  |
|            | US T N/B 8.875 02/15/19      | 4,000,000.000                          | 5,433,880.000                          |  |
| アメリカ・ドル 小計 |                              | 1,403,800,000.000<br>(145,040,616,000) | 1,452,139,276.000<br>(150,035,029,996) |  |
| イギリス・ボンド   | UK TREASURY 1.0<br>09/07/17  | 7,100,000.000                          | 7,017,640.000                          |  |
|            | UK TREASURY 1.25<br>07/22/18 | 4,100,000.000                          | 4,023,330.000                          |  |
|            | UK TREASURY 1.75<br>01/22/17 | 3,800,000.000                          | 3,879,800.000                          |  |
|            | UK TREASURY 1.75<br>09/07/22 | 6,700,000.000                          | 6,225,640.000                          |  |
|            | UK TREASURY 2.0<br>01/22/16  | 7,000,000.000                          | 7,189,700.000                          |  |
|            | UK TREASURY 2.25<br>09/07/23 | 3,050,000.000                          | 2,901,953.000                          |  |
|            | UK TREASURY 2.75<br>01/22/15 | 3,700,000.000                          | 3,787,690.000                          |  |
|            | UK TREASURY 3.25<br>01/22/44 | 1,600,000.000                          | 1,508,960.000                          |  |
|            | UK TREASURY 3.5<br>07/22/68  | 600,000.000                            | 599,640.000                            |  |
|            | UK TREASURY 3.75<br>07/22/52 | 4,000,000.000                          | 4,197,600.000                          |  |
|            | UK TREASURY 3.75<br>09/07/19 | 5,000,000.000                          | 5,462,500.000                          |  |
|            | UK TREASURY 3.75<br>09/07/20 | 5,700,000.000                          | 6,227,820.000                          |  |
|            | UK TREASURY 3.75<br>09/07/21 | 5,000,000.000                          | 5,449,950.000                          |  |
|            | UK TREASURY 4.0<br>01/22/60  | 4,700,000.000                          | 5,261,180.000                          |  |

|                              |                                     |                                     |               |
|------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------|
| UK TREASURY 4.0<br>03/07/22  | 3,900,000.000                       | 4,320,810.000                       |               |
| UK TREASURY 4.0<br>09/07/16  | 6,600,000.000                       | 7,147,800.000                       |               |
| UK TREASURY 4.25<br>03/07/36 | 5,000,000.000                       | 5,598,500.000                       |               |
| UK TREASURY 4.25<br>06/07/32 | 5,200,000.000                       | 5,817,760.000                       |               |
| UK TREASURY 4.25<br>09/07/39 | 3,000,000.000                       | 3,374,700.000                       |               |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/27 | 3,300,000.000                       | 3,688,410.000                       |               |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/40 | 4,300,000.000                       | 4,845,240.000                       |               |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/46 | 5,000,000.000                       | 5,709,000.000                       |               |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/49 | 4,000,000.000                       | 4,611,600.000                       |               |
| UK TREASURY 4.25<br>12/07/55 | 4,200,000.000                       | 4,913,160.000                       |               |
| UK TREASURY 4.5<br>03/07/19  | 5,500,000.000                       | 6,210,050.000                       |               |
| UK TREASURY 4.5<br>09/07/34  | 4,500,000.000                       | 5,204,250.000                       |               |
| UK TREASURY 4.5<br>12/07/42  | 4,800,000.000                       | 5,662,080.000                       |               |
| UK TREASURY 4.75<br>03/07/20 | 4,800,000.000                       | 5,524,320.000                       |               |
| UK TREASURY 4.75<br>09/07/15 | 6,000,000.000                       | 6,418,800.000                       |               |
| UK TREASURY 4.75<br>12/07/30 | 4,600,000.000                       | 5,439,960.000                       |               |
| UK TREASURY 4.75<br>12/07/38 | 4,500,000.000                       | 5,445,900.000                       |               |
| UK TREASURY 5.0<br>03/07/18  | 5,500,000.000                       | 6,274,950.000                       |               |
| UK TREASURY 5.0<br>03/07/25  | 4,450,000.000                       | 5,307,960.000                       |               |
| UK TREASURY 6.0<br>12/07/28  | 3,000,000.000                       | 3,985,800.000                       |               |
| UK TREASURY 8.0<br>06/07/21  | 3,500,000.000                       | 4,827,550.000                       |               |
| UK TREASURY 8.0<br>12/07/15  | 2,000,000.000                       | 2,284,200.000                       |               |
| UK TREASURY 8.75<br>08/25/17 | 2,500,000.000                       | 3,157,750.000                       |               |
| イギリス・ボンド 小計                  | 162,200,000.000<br>(27,479,924,000) | 179,503,953.000<br>(30,411,559,717) |               |
| オーストラリア・ドル                   | AUSTRALIAN 4.5<br>04/15/20          | 5,100,000.000                       | 5,327,103.000 |



|        |                             |                                   |                                   |  |
|--------|-----------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|
|        | AUSTRALIAN 5.25<br>03/15/19 | 4,100,000.000                     | 4,438,824.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 5.75<br>05/15/21 | 4,800,000.000                     | 5,371,872.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 2.75<br>04/21/24 | 3,100,000.000                     | 2,721,552.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 3.25<br>04/21/25 | 2,300,000.000                     | 2,084,720.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 3.25<br>04/21/29 | 1,800,000.000                     | 1,531,098.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 4.25<br>07/21/17 | 1,100,000.000                     | 1,141,602.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 4.5 04/21/33     | 450,000.000                       | 433,845.000                       |  |
|        | AUSTRALIAN 4.75<br>04/21/27 | 3,000,000.000                     | 3,087,240.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 4.75<br>06/15/16 | 4,950,000.000                     | 5,173,393.500                     |  |
|        | AUSTRALIAN 4.75<br>10/21/15 | 1,800,000.000                     | 1,864,620.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 5.5 01/21/18     | 5,100,000.000                     | 5,531,001.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 5.5 04/21/23     | 5,100,000.000                     | 5,635,857.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 5.75<br>07/15/22 | 4,500,000.000                     | 5,047,920.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 6.0 02/15/17     | 7,500,000.000                     | 8,164,050.000                     |  |
|        | AUSTRALIAN 6.25<br>04/15/15 | 4,100,000.000                     | 4,287,698.000                     |  |
|        | オーストラリア・ドル 小計               | 58,800,000.000<br>(5,489,568,000) | 61,842,395.500<br>(5,773,606,044) |  |
| カナダ・ドル | CANADA 8.0 06/01/27         | 1,000,000.000                     | 1,584,090.000                     |  |
|        | CANADA 1.0 11/01/15         | 4,100,000.000                     | 4,099,508.000                     |  |
|        | CANADA 1.25 03/01/18        | 1,700,000.000                     | 1,677,985.000                     |  |
|        | CANADA 1.25 09/01/18        | 2,050,000.000                     | 2,007,360.000                     |  |
|        | CANADA 1.5 03/01/17         | 2,000,000.000                     | 2,016,180.000                     |  |
|        | CANADA 1.5 06/01/23         | 3,900,000.000                     | 3,563,625.000                     |  |
|        | CANADA 1.5 08/01/15         | 2,000,000.000                     | 2,016,040.000                     |  |
|        | CANADA 1.5 09/01/17         | 3,000,000.000                     | 3,008,760.000                     |  |
|        | CANADA 2.5 06/01/24         | 2,200,000.000                     | 2,170,190.000                     |  |
|        | CANADA 2.75 06/01/22        | 3,400,000.000                     | 3,489,046.000                     |  |
|        | CANADA 2.75 09/01/16        | 4,000,000.000                     | 4,165,440.000                     |  |
|        | CANADA 3.0 12/01/15         | 6,000,000.000                     | 6,220,260.000                     |  |
|        | CANADA 3.25 06/01/21        | 3,050,000.000                     | 3,275,791.500                     |  |
|        | CANADA 3.5 06/01/20         | 3,000,000.000                     | 3,268,440.000                     |  |
|        | CANADA 3.5 12/01/45         | 3,500,000.000                     | 3,784,025.000                     |  |
|        | CANADA 3.75 06/01/19        | 5,500,000.000                     | 6,037,130.000                     |  |
|        | CANADA 4.0 06/01/16         | 8,500,000.000                     | 9,087,265.000                     |  |
|        | CANADA 4.0 06/01/17         | 3,500,000.000                     | 3,814,790.000                     |  |
|        | CANADA 4.0 06/01/41         | 3,900,000.000                     | 4,554,420.000                     |  |
|        | CANADA 4.25 06/01/18        | 3,500,000.000                     | 3,893,190.000                     |  |
|        | CANADA 4.5 06/01/15         | 8,000,000.000                     | 8,385,920.000                     |  |

|                      |                             |                                    |                                    |  |
|----------------------|-----------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--|
|                      | CANADA 5.0 06/01/37         | 3,400,000.000                      | 4,506,020.000                      |  |
|                      | CANADA 5.75 06/01/29        | 2,900,000.000                      | 3,934,256.000                      |  |
|                      | CANADA 5.75 06/01/33        | 3,200,000.000                      | 4,489,728.000                      |  |
| カナダ・ドル 小計            |                             | 87,300,000.000<br>(8,283,897,000)  | 95,049,459.500<br>(9,019,243,212)  |  |
| シンガポール・ドル            | SINGAPORE 2.75 04/01/42     | 700,000.000                        | 666,211.000                        |  |
|                      | SINGAPORE 2.75 07/01/23     | 300,000.000                        | 308,928.000                        |  |
|                      | SINGAPORE 2.875<br>07/01/15 | 2,400,000.000                      | 2,488,680.000                      |  |
|                      | SINGAPORE 2.875<br>09/01/30 | 800,000.000                        | 788,544.000                        |  |
|                      | SINGAPORE 3.0 09/01/24      | 300,000.000                        | 310,041.000                        |  |
|                      | SINGAPORE 3.125<br>09/01/22 | 2,100,000.000                      | 2,224,341.000                      |  |
|                      | SINGAPORE 3.25 09/01/20     | 1,700,000.000                      | 1,830,951.000                      |  |
|                      | SINGAPORE 3.375<br>09/01/33 | 300,000.000                        | 316,122.000                        |  |
|                      | SINGAPORE 3.5 03/01/27      | 1,400,000.000                      | 1,495,354.000                      |  |
|                      | SINGAPORE 3.75 09/01/16     | 2,100,000.000                      | 2,282,595.000                      |  |
|                      | SINGAPORE 4.0 09/01/18      | 3,000,000.000                      | 3,373,170.000                      |  |
| シンガポール・ドル 小計         |                             | 15,100,000.000<br>(1,232,462,000)  | 16,084,937.000<br>(1,312,852,558)  |  |
| スウェーデン・クローナ          | SWEDEN 1.5 11/13/23         | 21,000,000.000                     | 19,402,950.000                     |  |
|                      | SWEDEN 3.0 07/12/16         | 13,000,000.000                     | 13,631,150.000                     |  |
|                      | SWEDEN 3.5 03/30/39         | 10,600,000.000                     | 11,338,926.000                     |  |
|                      | SWEDEN 3.5 06/01/22         | 16,000,000.000                     | 17,576,320.000                     |  |
|                      | SWEDEN 3.75 08/12/17        | 12,000,000.000                     | 13,018,320.000                     |  |
|                      | SWEDEN 4.25 03/12/19        | 20,500,000.000                     | 23,088,945.000                     |  |
|                      | SWEDEN 4.5 08/12/15         | 18,000,000.000                     | 19,042,020.000                     |  |
| SWEDEN 5.0 12/01/20  | 12,100,000.000              | 14,420,780.000                     |                                    |  |
| スウェーデン・クローナ 小計       |                             | 123,200,000.000<br>(1,957,648,000) | 131,519,411.000<br>(2,089,843,441) |  |
| デンマーク・クローネ           | DENMARK 1.5 11/15/23        | 7,500,000.000                      | 7,245,000.000                      |  |
|                      | DENMARK 2.5 11/15/16        | 2,000,000.000                      | 2,125,500.000                      |  |
|                      | DENMARK 3.0 11/15/21        | 25,500,000.000                     | 28,154,550.000                     |  |
|                      | DENMARK 4.0 11/15/15        | 24,000,000.000                     | 25,715,040.000                     |  |
|                      | DENMARK 4.0 11/15/17        | 14,100,000.000                     | 15,958,380.000                     |  |
|                      | DENMARK 4.0 11/15/19        | 23,600,000.000                     | 27,465,680.000                     |  |
|                      | DENMARK 4.5 11/15/39        | 30,200,000.000                     | 40,468,000.000                     |  |
| DENMARK 7.0 11/10/24 | 8,000,000.000               | 11,986,400.000                     |                                    |  |
| デンマーク・クローネ 小計        |                             | 134,900,000.000<br>(2,552,308,000) | 159,118,550.000<br>(3,010,522,966) |  |
| ノルウェー・クローネ           | NORWAY 2.0 05/24/23         | 9,300,000.000                      | 8,619,984.000                      |  |
|                      | NORWAY 3.75 05/25/21        | 14,000,000.000                     | 15,005,200.000                     |  |
|                      | NORWAY 4.25 05/19/17        | 14,600,000.000                     | 15,766,540.000                     |  |
|                      | NORWAY 4.5 05/22/19         | 13,500,000.000                     | 15,008,625.000                     |  |
|                      | NORWAY 5.0 05/15/15         | 18,300,000.000                     | 19,173,825.000                     |  |
| ノルウェー・クローネ 小計        |                             | 69,700,000.000<br>(1,176,536,000)  | 73,574,174.000<br>(1,241,932,057)  |  |

|                 |                                |                                    |                                    |  |
|-----------------|--------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--|
| ポーランド・ズロチ       | POLAND 3.75 04/25/18           | 2,800,000.000                      | 2,830,380.000                      |  |
|                 | POLAND 4.0 10/25/23            | 3,400,000.000                      | 3,302,930.000                      |  |
|                 | POLAND 4.75 10/25/16           | 10,300,000.000                     | 10,754,230.000                     |  |
|                 | POLAND 5.0 04/25/16            | 7,000,000.000                      | 7,310,450.000                      |  |
|                 | POLAND 5.25 10/25/17           | 12,000,000.000                     | 12,814,680.000                     |  |
|                 | POLAND 5.25 10/25/20           | 9,000,000.000                      | 9,642,600.000                      |  |
|                 | POLAND 5.5 04/25/15            | 7,000,000.000                      | 7,243,600.000                      |  |
|                 | POLAND 5.5 10/25/19            | 9,000,000.000                      | 9,779,400.000                      |  |
|                 | POLAND 5.75 04/25/29           | 3,000,000.000                      | 3,337,140.000                      |  |
|                 | POLAND 5.75 09/23/22           | 7,400,000.000                      | 8,162,274.000                      |  |
|                 | POLAND 5.75 10/25/21           | 5,500,000.000                      | 6,048,240.000                      |  |
|                 | POLAND 6.25 10/24/15           | 11,400,000.000                     | 12,086,280.000                     |  |
| ポーランド・ズロチ 小計    |                                | 87,800,000.000<br>(2,979,932,000)  | 93,312,204.000<br>(3,167,016,204)  |  |
| マレーシア・リングgit    | MALAYSIA 3.418 08/15/22        | 5,000,000.000                      | 4,753,950.000                      |  |
|                 | MALAYSIA 3.502 05/31/27        | 5,700,000.000                      | 5,135,472.000                      |  |
|                 | MALAYSIA 3.814 02/15/17        | 7,000,000.000                      | 7,067,970.000                      |  |
|                 | MALAYSIA 3.835 08/12/15        | 10,000,000.000                     | 10,120,200.000                     |  |
|                 | MALAYSIA 4.127 04/15/32        | 2,000,000.000                      | 1,875,220.000                      |  |
|                 | MALAYSIA 4.16 07/15/21         | 4,000,000.000                      | 4,039,280.000                      |  |
|                 | MALAYSIA 4.24 02/07/18         | 10,000,000.000                     | 10,195,000.000                     |  |
|                 | MALAYSIA 4.262 09/15/16        | 7,000,000.000                      | 7,183,610.000                      |  |
|                 | MALAYSIA 4.378 11/29/19        | 9,000,000.000                      | 9,276,930.000                      |  |
|                 | MALAYSIA 5.248 09/15/28        | 2,000,000.000                      | 2,139,160.000                      |  |
| マレーシア・リングgit 小計 |                                | 61,700,000.000<br>(1,949,720,000)  | 61,786,792.000<br>(1,952,462,627)  |  |
| メキシコ・ペソ         | MEXICAN BONDS 10.0<br>11/20/36 | 20,000,000.000                     | 25,633,400.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 10.0<br>12/05/24 | 55,000,000.000                     | 70,481,400.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 6.25<br>06/16/16 | 19,500,000.000                     | 20,511,270.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 6.5<br>06/10/21  | 22,000,000.000                     | 22,652,080.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 7.25<br>12/15/16 | 50,000,000.000                     | 53,866,000.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 7.75<br>11/13/42 | 20,000,000.000                     | 20,559,400.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 7.75<br>12/14/17 | 70,000,000.000                     | 76,797,700.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 8.0<br>06/11/20  | 58,000,000.000                     | 65,026,120.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 8.0<br>12/17/15  | 30,000,000.000                     | 32,262,000.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 8.5<br>05/31/29  | 52,000,000.000                     | 59,394,920.000                     |  |
|                 | MEXICAN BONDS 8.5<br>11/18/38  | 29,000,000.000                     | 32,385,460.000                     |  |
| メキシコ・ペソ 小計      |                                | 425,500,000.000<br>(3,361,450,000) | 479,569,750.000<br>(3,788,601,025) |  |

|                              |                             |               |               |  |
|------------------------------|-----------------------------|---------------|---------------|--|
| ユーロ                          | AUSTRIA 1.75 10/20/23       | 1,500,000.000 | 1,441,500.000 |  |
|                              | AUSTRIA 1.95 06/18/19       | 500,000.000   | 519,950.000   |  |
|                              | AUSTRIA 3.15 06/20/44       | 800,000.000   | 830,280.000   |  |
|                              | AUSTRIA 3.2 02/20/17        | 1,700,000.000 | 1,841,950.000 |  |
|                              | AUSTRIA 3.4 11/22/22        | 2,300,000.000 | 2,557,554.000 |  |
|                              | AUSTRIA 3.5 07/15/15        | 2,400,000.000 | 2,517,600.000 |  |
|                              | AUSTRIA 3.5 09/15/21        | 3,500,000.000 | 3,919,300.000 |  |
|                              | AUSTRIA 3.65 04/20/22       | 2,100,000.000 | 2,373,000.000 |  |
|                              | AUSTRIA 3.8 01/26/62        | 1,000,000.000 | 1,204,710.000 |  |
|                              | AUSTRIA 3.9 07/15/20        | 3,500,000.000 | 4,011,000.000 |  |
|                              | AUSTRIA 4.0 09/15/16        | 4,000,000.000 | 4,382,000.000 |  |
|                              | AUSTRIA 4.15 03/15/37       | 3,300,000.000 | 3,958,350.000 |  |
|                              | AUSTRIA 4.3 09/15/17        | 3,000,000.000 | 3,388,500.000 |  |
|                              | AUSTRIA 4.35 03/15/19       | 3,700,000.000 | 4,294,035.000 |  |
|                              | AUSTRIA 4.65 01/15/18       | 2,750,000.000 | 3,163,875.000 |  |
|                              | AUSTRIA 4.85 03/15/26       | 2,500,000.000 | 3,127,625.000 |  |
|                              | AUSTRIA 6.25 07/15/27       | 1,600,000.000 | 2,270,480.000 |  |
|                              | BELGIUM 2.25 06/22/23       | 2,500,000.000 | 2,454,575.000 |  |
|                              | BELGIUM 2.75 03/28/16       | 3,000,000.000 | 3,159,720.000 |  |
|                              | BELGIUM 3.0 09/28/19        | 3,000,000.000 | 3,244,470.000 |  |
|                              | BELGIUM 3.25 09/28/16       | 4,000,000.000 | 4,292,400.000 |  |
|                              | BELGIUM 3.5 03/28/15        | 1,600,000.000 | 1,663,888.000 |  |
|                              | BELGIUM 3.5 06/28/17        | 2,000,000.000 | 2,187,560.000 |  |
|                              | BELGIUM 3.75 06/22/45       | 1,000,000.000 | 1,040,610.000 |  |
|                              | BELGIUM 3.75 09/28/15       | 4,000,000.000 | 4,240,880.000 |  |
|                              | BELGIUM 3.75 09/28/20       | 5,100,000.000 | 5,748,210.000 |  |
|                              | BELGIUM 4.0 03/28/17        | 3,700,000.000 | 4,092,533.000 |  |
|                              | BELGIUM 4.0 03/28/18        | 3,000,000.000 | 3,369,600.000 |  |
|                              | BELGIUM 4.0 03/28/19        | 2,650,000.000 | 3,008,412.500 |  |
|                              | BELGIUM 4.0 03/28/22        | 4,500,000.000 | 5,125,365.000 |  |
|                              | BELGIUM 4.0 03/28/32        | 2,000,000.000 | 2,209,960.000 |  |
|                              | BELGIUM 4.25 03/28/41       | 3,100,000.000 | 3,551,670.000 |  |
|                              | BELGIUM 4.25 09/28/21       | 3,900,000.000 | 4,523,415.000 |  |
|                              | BELGIUM 4.25 09/28/22       | 3,100,000.000 | 3,579,539.000 |  |
|                              | BELGIUM 4.5 03/28/26        | 2,000,000.000 | 2,343,200.000 |  |
|                              | BELGIUM 5.0 03/28/35        | 4,600,000.000 | 5,776,910.000 |  |
|                              | BELGIUM 5.5 03/28/28        | 4,200,000.000 | 5,413,086.000 |  |
|                              | BELGIUM 5.5 09/28/17        | 3,000,000.000 | 3,504,600.000 |  |
|                              | BUNDESOBL 0.5 02/23/18      | 5,700,000.000 | 5,669,847.000 |  |
|                              | BUNDESOBL 2.75 04/08/16     | 8,500,000.000 | 8,983,225.000 |  |
|                              | DEUTSCHLAND 1.5<br>02/15/23 | 4,500,000.000 | 4,411,305.000 |  |
|                              | DEUTSCHLAND 1.5<br>05/15/23 | 4,500,000.000 | 4,391,595.000 |  |
| DEUTSCHLAND 1.5<br>09/04/22  | 4,000,000.000               | 3,951,360.000 |               |  |
| DEUTSCHLAND 1.75<br>07/04/22 | 6,300,000.000               | 6,373,773.000 |               |  |

|                              |                |                |  |
|------------------------------|----------------|----------------|--|
| DEUTSCHLAND 2.0<br>01/04/22  | 5,500,000.000  | 5,710,650.000  |  |
| DEUTSCHLAND 2.0<br>08/15/23  | 4,600,000.000  | 4,672,220.000  |  |
| DEUTSCHLAND 2.25<br>09/04/20 | 5,000,000.000  | 5,337,400.000  |  |
| DEUTSCHLAND 2.25<br>09/04/21 | 4,500,000.000  | 4,772,250.000  |  |
| DEUTSCHLAND 2.5<br>01/04/21  | 4,200,000.000  | 4,542,510.000  |  |
| DEUTSCHLAND 2.5<br>07/04/44  | 4,000,000.000  | 3,831,600.000  |  |
| DEUTSCHLAND 3.0<br>07/04/20  | 5,500,000.000  | 6,131,950.000  |  |
| DEUTSCHLAND 3.25<br>01/04/20 | 5,000,000.000  | 5,635,250.000  |  |
| DEUTSCHLAND 3.25<br>07/04/15 | 11,600,000.000 | 12,130,352.000 |  |
| DEUTSCHLAND 3.25<br>07/04/21 | 5,500,000.000  | 6,233,700.000  |  |
| DEUTSCHLAND 3.25<br>07/04/42 | 3,600,000.000  | 3,989,880.000  |  |
| DEUTSCHLAND 3.5<br>01/04/16  | 13,000,000.000 | 13,853,190.000 |  |
| DEUTSCHLAND 3.5<br>07/04/19  | 6,500,000.000  | 7,388,550.000  |  |
| DEUTSCHLAND 3.75<br>01/04/15 | 13,500,000.000 | 13,978,845.000 |  |
| DEUTSCHLAND 3.75<br>01/04/17 | 14,000,000.000 | 15,422,820.000 |  |
| DEUTSCHLAND 3.75<br>01/04/19 | 6,000,000.000  | 6,857,100.000  |  |
| DEUTSCHLAND 4.0<br>01/04/18  | 11,000,000.000 | 12,488,630.000 |  |
| DEUTSCHLAND 4.0<br>01/04/37  | 5,800,000.000  | 7,087,310.000  |  |
| DEUTSCHLAND 4.0<br>07/04/16  | 9,000,000.000  | 9,834,300.000  |  |
| DEUTSCHLAND 4.25<br>07/04/17 | 7,000,000.000  | 7,920,360.000  |  |
| DEUTSCHLAND 4.25<br>07/04/18 | 6,000,000.000  | 6,942,600.000  |  |
| DEUTSCHLAND 4.25<br>07/04/39 | 3,400,000.000  | 4,363,220.000  |  |
| DEUTSCHLAND 4.75<br>07/04/28 | 2,500,000.000  | 3,226,750.000  |  |
| DEUTSCHLAND 4.75<br>07/04/34 | 5,000,000.000  | 6,663,000.000  |  |
| DEUTSCHLAND 4.75<br>07/04/40 | 4,200,000.000  | 5,815,740.000  |  |

|                               |                |                |  |
|-------------------------------|----------------|----------------|--|
| DEUTSCHLAND 5.5<br>01/04/31   | 4,100,000.000  | 5,769,930.000  |  |
| DEUTSCHLAND 5.625<br>01/04/28 | 3,900,000.000  | 5,430,750.000  |  |
| DEUTSCHLAND 6.25<br>01/04/24  | 2,600,000.000  | 3,643,640.000  |  |
| DEUTSCHLAND 6.25<br>01/04/30  | 2,500,000.000  | 3,743,250.000  |  |
| DEUTSCHLAND 6.5<br>07/04/27   | 3,200,000.000  | 4,779,520.000  |  |
| FINLAND 1.5 04/15/23          | 1,200,000.000  | 1,144,680.000  |  |
| FINLAND 1.625 09/15/22        | 1,300,000.000  | 1,268,345.000  |  |
| FINLAND 1.75 04/15/16         | 2,500,000.000  | 2,582,000.000  |  |
| FINLAND 2.625 07/04/42        | 700,000.000    | 672,070.000    |  |
| FINLAND 2.75 07/04/28         | 800,000.000    | 815,880.000    |  |
| FINLAND 3.375 04/15/20        | 1,550,000.000  | 1,731,970.000  |  |
| FINLAND 3.5 04/15/21          | 1,500,000.000  | 1,689,450.000  |  |
| FINLAND 3.875 09/15/17        | 2,400,000.000  | 2,674,800.000  |  |
| FINLAND 4.0 07/04/25          | 1,700,000.000  | 1,982,880.000  |  |
| FINLAND 4.25 07/04/15         | 700,000.000    | 741,601.000    |  |
| FINLAND 4.375 07/04/19        | 1,400,000.000  | 1,635,200.000  |  |
| FR TREASURY 1.0<br>07/25/17   | 3,000,000.000  | 3,030,390.000  |  |
| FR TREASURY 2.5<br>07/25/16   | 6,700,000.000  | 7,057,043.000  |  |
| FRANCE BTAN 8.5<br>04/25/23   | 3,000,000.000  | 4,587,660.000  |  |
| FRANCE OAT 3.5<br>04/25/15    | 12,000,000.000 | 12,501,840.000 |  |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/18       | 6,000,000.000  | 6,005,220.000  |  |
| FRANCE OAT 1.75<br>05/25/23   | 2,700,000.000  | 2,580,579.000  |  |
| FRANCE OAT 2.25<br>05/25/24   | 500,000.000    | 489,295.000    |  |
| FRANCE OAT 2.25<br>10/25/22   | 4,700,000.000  | 4,739,339.000  |  |
| FRANCE OAT 2.5 10/25/20       | 9,500,000.000  | 10,024,400.000 |  |
| FRANCE OAT 2.75<br>10/25/27   | 4,500,000.000  | 4,426,875.000  |  |
| FRANCE OAT 3.0 04/25/22       | 10,000,000.000 | 10,750,000.000 |  |
| FRANCE OAT 3.0 10/25/15       | 15,500,000.000 | 16,261,050.000 |  |
| FRANCE OAT 3.25<br>04/25/16   | 15,500,000.000 | 16,524,550.000 |  |
| FRANCE OAT 3.25<br>10/25/21   | 7,700,000.000  | 8,457,526.000  |  |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/20       | 9,000,000.000  | 10,070,010.000 |  |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26       | 8,000,000.000  | 8,610,400.000  |  |
| FRANCE OAT 3.75<br>04/25/17   | 12,900,000.000 | 14,209,221.000 |  |

|                             |                |                |  |
|-----------------------------|----------------|----------------|--|
| FRANCE OAT 3.75<br>04/25/21 | 8,500,000.000  | 9,653,450.000  |  |
| FRANCE OAT 3.75<br>10/25/19 | 6,500,000.000  | 7,356,440.000  |  |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/18     | 9,000,000.000  | 10,158,660.000 |  |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55     | 4,750,000.000  | 5,248,275.000  |  |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60     | 2,900,000.000  | 3,223,495.000  |  |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38     | 6,300,000.000  | 7,031,430.000  |  |
| FRANCE OAT 4.25<br>04/25/19 | 9,500,000.000  | 10,962,430.000 |  |
| FRANCE OAT 4.25<br>10/25/17 | 8,000,000.000  | 9,038,000.000  |  |
| FRANCE OAT 4.25<br>10/25/18 | 8,000,000.000  | 9,177,600.000  |  |
| FRANCE OAT 4.25<br>10/25/23 | 10,800,000.000 | 12,585,780.000 |  |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41     | 5,800,000.000  | 6,980,880.000  |  |
| FRANCE OAT 4.75<br>04/25/35 | 5,100,000.000  | 6,298,959.000  |  |
| FRANCE OAT 5.0 10/25/16     | 9,000,000.000  | 10,132,200.000 |  |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29     | 6,900,000.000  | 9,035,274.000  |  |
| FRANCE OAT 5.75<br>10/25/32 | 6,100,000.000  | 8,391,465.000  |  |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25     | 5,000,000.000  | 6,698,700.000  |  |
| FRANCE OAT 8.5 10/25/19     | 3,000,000.000  | 4,184,400.000  |  |
| IRISH 4.4 06/18/19          | 1,700,000.000  | 1,892,865.000  |  |
| IRISH 4.5 04/18/20          | 3,000,000.000  | 3,337,380.000  |  |
| IRISH 4.5 10/18/18          | 3,000,000.000  | 3,359,700.000  |  |
| IRISH 4.6 04/18/16          | 3,000,000.000  | 3,253,350.000  |  |
| IRISH 5.0 10/18/20          | 2,000,000.000  | 2,282,400.000  |  |
| IRISH 5.4 03/13/25          | 3,700,000.000  | 4,258,071.000  |  |
| IRISH 5.5 10/18/17          | 1,500,000.000  | 1,716,000.000  |  |
| IRISH 5.9 10/18/19          | 1,500,000.000  | 1,787,925.000  |  |
| ITALY BTPS 3.0 04/15/15     | 13,000,000.000 | 13,350,220.000 |  |
| ITALY BTPS 3.75<br>03/01/21 | 7,000,000.000  | 7,270,200.000  |  |
| ITALY BTPS 3.75<br>04/15/16 | 10,000,000.000 | 10,552,000.000 |  |
| ITALY BTPS 3.75<br>08/01/15 | 15,000,000.000 | 15,633,450.000 |  |
| ITALY BTPS 3.75<br>08/01/16 | 14,000,000.000 | 14,823,200.000 |  |
| ITALY BTPS 3.75<br>08/01/21 | 7,500,000.000  | 7,767,000.000  |  |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/17     | 11,900,000.000 | 12,721,100.000 |  |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37     | 6,500,000.000  | 6,077,500.000  |  |
| ITALY BTPS 4.0 09/01/20     | 5,400,000.000  | 5,740,740.000  |  |
| ITALY BTPS 4.25<br>02/01/15 | 3,900,000.000  | 4,040,556.000  |  |

|                              |                |                |  |
|------------------------------|----------------|----------------|--|
| ITALY BTPS 4.25<br>02/01/19  | 2,900,000.000  | 3,145,340.000  |  |
| ITALY BTPS 4.25<br>03/01/20  | 8,000,000.000  | 8,617,600.000  |  |
| ITALY BTPS 4.25<br>09/01/19  | 7,300,000.000  | 7,903,710.000  |  |
| ITALY BTPS 4.5 02/01/18      | 13,300,000.000 | 14,510,300.000 |  |
| ITALY BTPS 4.5 02/01/20      | 4,500,000.000  | 4,908,150.000  |  |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/19      | 7,500,000.000  | 8,223,000.000  |  |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/24      | 2,000,000.000  | 2,106,220.000  |  |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26      | 3,900,000.000  | 4,087,980.000  |  |
| ITALY BTPS 4.5 05/01/23      | 3,500,000.000  | 3,709,195.000  |  |
| ITALY BTPS 4.5 08/01/18      | 7,000,000.000  | 7,670,600.000  |  |
| ITALY BTPS 4.75<br>08/01/23  | 7,000,000.000  | 7,579,600.000  |  |
| ITALY BTPS 4.75<br>09/01/21  | 7,000,000.000  | 7,693,000.000  |  |
| ITALY BTPS 4.75<br>09/01/28  | 3,000,000.000  | 3,163,560.000  |  |
| ITALY BTPS 4.75<br>09/01/44  | 2,200,000.000  | 2,225,608.000  |  |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/22      | 4,500,000.000  | 4,983,300.000  |  |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/25      | 6,100,000.000  | 6,644,486.000  |  |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34      | 5,500,000.000  | 5,828,350.000  |  |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39      | 4,650,000.000  | 4,896,915.000  |  |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40      | 5,250,000.000  | 5,509,875.000  |  |
| ITALY BTPS 5.25<br>08/01/17  | 11,200,000.000 | 12,468,960.000 |  |
| ITALY BTPS 5.25<br>11/01/29  | 7,500,000.000  | 8,240,250.000  |  |
| ITALY BTPS 5.5 09/01/22      | 6,000,000.000  | 6,838,500.000  |  |
| ITALY BTPS 5.5 11/01/22      | 4,400,000.000  | 5,013,844.000  |  |
| ITALY BTPS 5.75<br>02/01/33  | 4,300,000.000  | 4,980,260.000  |  |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31      | 7,200,000.000  | 8,535,600.000  |  |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27      | 7,500,000.000  | 9,249,750.000  |  |
| ITALY BTPS 7.25<br>11/01/26  | 3,500,000.000  | 4,554,550.000  |  |
| ITALY BTPS 9.0 11/01/23      | 4,000,000.000  | 5,700,800.000  |  |
| NETHERLANDS 0.75<br>04/15/15 | 1,000,000.000  | 1,007,250.000  |  |
| NETHERLANDS 1.75<br>07/15/23 | 1,500,000.000  | 1,450,305.000  |  |
| NETHERLANDS 2.25<br>07/15/22 | 4,500,000.000  | 4,611,645.000  |  |
| NETHERLANDS 2.5<br>01/15/17  | 3,500,000.000  | 3,708,600.000  |  |
| NETHERLANDS 2.5<br>01/15/33  | 2,700,000.000  | 2,588,463.000  |  |



|                              |               |               |  |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| NETHERLANDS 2.75<br>01/15/15 | 3,800,000.000 | 3,898,914.000 |  |
| NETHERLANDS 3.25<br>07/15/15 | 6,000,000.000 | 6,272,400.000 |  |
| NETHERLANDS 3.25<br>07/15/21 | 5,000,000.000 | 5,529,500.000 |  |
| NETHERLANDS 3.5<br>07/15/20  | 4,000,000.000 | 4,496,800.000 |  |
| NETHERLANDS 3.75<br>01/15/42 | 3,600,000.000 | 4,226,652.000 |  |
| NETHERLANDS 4.0<br>01/15/37  | 3,100,000.000 | 3,697,370.000 |  |
| NETHERLANDS 4.0<br>07/15/16  | 4,000,000.000 | 4,359,600.000 |  |
| NETHERLANDS 4.0<br>07/15/18  | 7,700,000.000 | 8,726,410.000 |  |
| NETHERLANDS 4.0<br>07/15/19  | 5,000,000.000 | 5,729,250.000 |  |
| NETHERLANDS 4.5<br>07/15/17  | 5,000,000.000 | 5,661,000.000 |  |
| NETHERLANDS 5.5<br>01/15/28  | 2,900,000.000 | 3,899,630.000 |  |
| NETHERLANDS 7.5<br>01/15/23  | 4,000,000.000 | 5,806,400.000 |  |
| SPAIN 2.75 03/31/15          | 2,000,000.000 | 2,047,500.000 |  |
| SPAIN 3.0 04/30/15           | 6,000,000.000 | 6,166,800.000 |  |
| SPAIN 3.15 01/31/16          | 7,000,000.000 | 7,279,300.000 |  |
| SPAIN 3.25 04/30/16          | 7,000,000.000 | 7,310,800.000 |  |
| SPAIN 3.75 10/31/18          | 2,700,000.000 | 2,874,393.000 |  |
| SPAIN 3.8 01/31/17           | 6,000,000.000 | 6,399,000.000 |  |
| SPAIN 4.0 04/30/20           | 6,000,000.000 | 6,384,300.000 |  |
| SPAIN 4.0 07/30/15           | 7,000,000.000 | 7,332,850.000 |  |
| SPAIN 4.1 07/30/18           | 5,500,000.000 | 5,955,125.000 |  |
| SPAIN 4.2 01/31/37           | 4,200,000.000 | 3,950,478.000 |  |
| SPAIN 4.25 10/31/16          | 5,000,000.000 | 5,378,800.000 |  |
| SPAIN 4.3 10/31/19           | 5,500,000.000 | 5,985,925.000 |  |
| SPAIN 4.4 01/31/15           | 4,800,000.000 | 4,977,168.000 |  |
| SPAIN 4.5 01/31/18           | 3,000,000.000 | 3,283,500.000 |  |
| SPAIN 4.6 07/30/19           | 5,500,000.000 | 6,076,400.000 |  |
| SPAIN 4.65 07/30/25          | 4,000,000.000 | 4,233,600.000 |  |
| SPAIN 4.7 07/30/41           | 2,900,000.000 | 2,902,320.000 |  |
| SPAIN 4.8 01/31/24           | 4,700,000.000 | 5,068,480.000 |  |
| SPAIN 4.85 10/31/20          | 5,000,000.000 | 5,544,750.000 |  |
| SPAIN 4.9 07/30/40           | 3,300,000.000 | 3,407,910.000 |  |
| SPAIN 5.15 10/31/44          | 1,000,000.000 | 1,058,700.000 |  |
| SPAIN 5.4 01/31/23           | 4,500,000.000 | 5,066,910.000 |  |
| SPAIN 5.5 04/30/21           | 6,500,000.000 | 7,441,850.000 |  |
| SPAIN 5.5 07/30/17           | 5,500,000.000 | 6,201,470.000 |  |
| SPAIN 5.75 07/30/32          | 4,000,000.000 | 4,676,400.000 |  |

|              |                               |  |  |  |
|--------------|-------------------------------|--|--|--|
|              | SPAIN 5.85 01/31/22           | 4,800,000.000                          | 5,584,656.000                          |  |
|              | SPAIN 5.9 07/30/26            | 2,500,000.000                          | 2,939,000.000                          |  |
|              | SPAIN 6.0 01/31/29            | 5,300,000.000                          | 6,287,761.000                          |  |
| ユーロ 小計       |                               | 1,056,700,000.000<br>(149,216,607,000) | 1,172,071,691.500<br>(165,508,243,557) |  |
| 南アフリカ・ランド    | SOUTH AFRICA 10.5<br>12/21/26 | 36,000,000.000                         | 42,648,840.000                         |  |
|              | SOUTH AFRICA 6.25<br>03/31/36 | 30,000,000.000                         | 22,230,000.000                         |  |
|              | SOUTH AFRICA 6.5<br>02/28/41  | 13,000,000.000                         | 9,654,450.000                          |  |
|              | SOUTH AFRICA 6.75<br>03/31/21 | 45,000,000.000                         | 42,829,200.000                         |  |
|              | SOUTH AFRICA 7.75<br>02/28/23 | 14,000,000.000                         | 13,884,640.000                         |  |
|              | SOUTH AFRICA 8.0<br>12/21/18  | 45,500,000.000                         | 47,002,865.000                         |  |
|              | SOUTH AFRICA 8.75<br>02/28/48 | 9,000,000.000                          | 8,648,550.000                          |  |
| 南アフリカ・ランド 小計 |                               | 192,500,000.000<br>(1,838,375,000)     | 186,898,545.000<br>(1,784,881,105)     |  |
| 国債証券 合計      |                               | 352,559,043,000<br>(352,559,043,000)   | 379,095,794,508<br>(379,095,794,508)   |  |
| 合計           |                               | 352,559,043,000<br>(352,559,043,000)   | 379,095,794,508<br>(379,095,794,508)   |  |

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

## 3. 外貨建有価証券の内訳

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

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

（単位：円）

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

|         |  |               |               |
|---------|--|---------------|---------------|
| 元本等合計   |  | 2,921,718,294 | 3,034,549,422 |
| 純資産合計   |  | 2,921,718,294 | 3,034,549,422 |
| 負債純資産合計 |  | 2,922,418,294 | 3,034,802,422 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                             |   |
|-----------------------------|---|
| 1 . 有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> |
| 2 . 収益及び費用の計上基準             | <p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>  |
| 3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>   |

## （貸借対照表に関する注記）

| 項目  |                                      | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在   |
|-----|--------------------------------------|----------------|----------------|
| 1 . | 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 3,472,218,155円 | 2,807,145,592円 |
|     | 同期中追加設定元本額                           | 198,987,156円   | 456,429,619円   |
|     | 同期中一部解約元本額                           | 864,059,719円   | 765,324,014円   |
|     | 元本の内訳                                |                |                |
|     | ファンド名                                |                |                |
|     | マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>                 | 38,177,163円    | 45,374,620円    |
|     | マネックス資産設計ファンド<育成型>                   | 470,694,534円   | 565,155,884円   |
|     | マネックス資産設計ファンド エボリューション               | 41,933,299円    | 37,731,897円    |
|     | D I A Mパッシブ資産分散ファンド                  | 2,111,558,594円 | 1,771,208,187円 |
|     | D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）       | 144,782,002円   | 78,780,609円    |
|     | 計                                    | 2,807,145,592円 | 2,498,251,197円 |
| 2 . | 受益権の総数                               | 2,807,145,592口 | 2,498,251,197口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日   | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
|--------------------------|--|------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。  | 同左                           |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                           |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。   | 同左                           |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 平成25年1月11日現在  | 平成26年1月14日現在 |
|----------------------------|---|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  | 同左           |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | 同左           |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。   | 同左           |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類       | 平成25年1月11日現在      | 平成26年1月14日現在      |
|----------|-------------------|-------------------|
|          | 当期の損益に含まれた評価差額(円) | 当期の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資信託受益証券 | 9,044,830         | 17,604,396        |
| 投資証券     | 93,659,538        | 72,884,461        |
| 合計       | 102,704,368       | 90,488,857        |

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。



(1口当たり情報に関する注記)

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

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

|   |            |             |  |
|---|------------|-------------|--|
| ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUIT           | 2,603.000  | 167,685.260 |  |
| AMERICAN CAMPUS<br>COMMUNITIES            | 4,409.000  | 149,112.380 |  |
| AMERICAN REALTY CAPITAL<br>PROPERTIES INC | 7,200.000  | 93,744.000  |  |
| APARTMENT INVT & MGMT<br>CO-A             | 6,615.000  | 173,908.350 |  |
| ASHFORD HOSPITALITY<br>PRIME INC          | 643.000    | 11,561.140  |  |
| ASHFORD HOSPITALITY<br>TRUST              | 3,219.000  | 26,653.320  |  |
| AVALONBAY COMMUNITIES<br>INC              | 4,678.000  | 565,242.740 |  |
| BIOMED REALTY TRUST INC                   | 8,300.000  | 152,471.000 |  |
| BOSTON PROPERTIES INC                     | 5,838.000  | 604,816.800 |  |
| BRANDYWINE REALTY TRUST                   | 6,100.000  | 84,424.000  |  |
| BRE PROPERTIES -CL A                      | 3,300.000  | 188,793.000 |  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST                     | 3,070.000  | 180,669.500 |  |
| CBL & ASSOCIATES                          | 7,630.000  | 136,348.100 |  |
| CEDAR REALTY TRUST INC                    | 3,200.000  | 20,544.000  |  |
| COMMONWEALTH REIT                         | 4,525.000  | 102,672.250 |  |
| CORPORATE OFFICE<br>PROPERTIES            | 3,800.000  | 92,910.000  |  |
| CORRECTIONS CORP OF<br>AMERICA            | 4,734.000  | 158,446.980 |  |
| COUSINS PROPERTIES INC                    | 9,409.000  | 98,229.960  |  |
| CUBESMART                                 | 6,100.000  | 96,685.000  |  |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC                  | 18,300.000 | 126,819.000 |  |
| DDR CORP                                  | 11,082.000 | 171,881.820 |  |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY<br>CO             | 8,372.000  | 96,194.280  |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC                  | 4,860.000  | 244,020.600 |  |
| DOUGLAS EMMETT INC                        | 5,445.000  | 131,333.400 |  |
| DUKE REALTY TRUST                         | 14,400.000 | 214,848.000 |  |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY<br>INC           | 3,500.000  | 85,295.000  |  |
| EAST GROUP                                | 1,800.000  | 102,456.000 |  |
| EDUCATION REALTY TRUST<br>INC             | 7,800.000  | 70,434.000  |  |
| EPR PROPERTIES                            | 2,200.000  | 107,910.000 |  |
| EQUITY LIFESTYLE<br>PROPERTIES            | 3,710.000  | 136,231.200 |  |
| EQUITY RESIDENTIAL                        | 13,070.000 | 695,585.400 |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC                  | 1,670.000  | 252,787.900 |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC                   | 4,800.000  | 207,840.000 |  |
| FEDERAL REALTY INVS<br>TRUST              | 2,874.000  | 299,671.980 |  |
| FELCOR LODGING TR INC                     | 3,200.000  | 26,624.000  |  |
| FIRST INDUSTRIAL RT                       | 4,600.000  | 76,360.000  |  |

|                                  |            |             |  |
|----------------------------------|------------|-------------|--|
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C     | 5,700.000  | 68,514.000  |  |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC    | 20,797.000 | 423,634.890 |  |
| GEO GROUP INC                    | 2,800.000  | 91,280.000  |  |
| GETTY REALTY CORP                | 1,700.000  | 31,586.000  |  |
| GLIMCHER REALTY TRUST            | 6,400.000  | 58,432.000  |  |
| HCP INC                          | 17,452.000 | 665,095.720 |  |
| HEALTH CARE REIT INC             | 11,051.000 | 618,303.450 |  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC      | 4,600.000  | 100,280.000 |  |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST         | 10,400.000 | 58,032.000  |  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC         | 4,600.000  | 165,140.000 |  |
| HOME PROPERTIES INC              | 2,400.000  | 132,480.000 |  |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST     | 5,800.000  | 153,584.000 |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC        | 27,913.000 | 532,580.040 |  |
| INLAND REAL ESTATE CORP          | 4,900.000  | 51,744.000  |  |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST      | 8,000.000  | 67,840.000  |  |
| KILROY REALTY CORP               | 3,275.000  | 166,042.500 |  |
| KIMCO REALTY                     | 15,322.000 | 310,117.280 |  |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES         | 3,900.000  | 118,404.000 |  |
| LEXINGTON REALTY TRUST           | 9,421.000  | 94,775.260  |  |
| LIBERTY PROPERTY TRUST           | 5,228.000  | 179,424.960 |  |
| LTC PROPERTIES INC               | 1,601.000  | 56,995.600  |  |
| MACK CALI                        | 2,800.000  | 56,868.000  |  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST         | 6,000.000  | 74,880.000  |  |
| MID AMERICA                      | 2,760.000  | 169,491.600 |  |
| NATIONAL HEALTH INVS INC         | 1,500.000  | 87,210.000  |  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC   | 5,000.000  | 156,550.000 |  |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC        | 5,400.000  | 165,672.000 |  |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST          | 3,500.000  | 107,205.000 |  |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 7,400.000  | 121,878.000 |  |
| POST PROPERTIES, INC             | 2,330.000  | 108,042.100 |  |
| PROLOGIS INC                     | 19,194.000 | 705,379.500 |  |
| PS BUSINESS PARKS                | 1,400.000  | 106,890.000 |  |
| PUBLIC STORAGE                   | 5,539.000  | 852,784.440 |  |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES      | 3,600.000  | 55,872.000  |  |
| REALTY INCOME CORP               | 8,030.000  | 307,468.700 |  |
| REGENCY CENTERS CORP             | 3,747.000  | 175,921.650 |  |
| RLJ LODGING TRUST                | 6,900.000  | 172,017.000 |  |
| ROUSE PROPERTIES INC             | 1,411.000  | 28,375.210  |  |

|              |                              |             |                                   |  |
|--------------|------------------------------|-------------|-----------------------------------|--|
|              | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 2,000.000   | 85,480.000                        |  |
|              | SAUL CENTERS INC             | 870.000     | 41,307.600                        |  |
|              | SENIOR HOUSING PPTYS TRUST   | 8,100.000   | 177,309.000                       |  |
|              | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 11,864.000  | 1,840,936.880                     |  |
|              | SL GREEN                     | 3,905.000   | 359,845.750                       |  |
|              | SOVRAN SELF STORAGE INC      | 1,546.000   | 101,572.200                       |  |
|              | STRATEGIC HOTELS & RESORTS   | 8,000.000   | 74,800.000                        |  |
|              | SUN COMMUNITIES INC          | 2,300.000   | 97,451.000                        |  |
|              | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 6,400.000   | 83,904.000                        |  |
|              | TANGER FACTORY OUTLET        | 4,700.000   | 155,523.000                       |  |
|              | TAUBMAN CENTERS INC          | 2,700.000   | 177,579.000                       |  |
|              | THE MACERICH COMPANY         | 5,290.000   | 309,253.400                       |  |
|              | UDR INC                      | 9,169.000   | 214,187.840                       |  |
|              | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 900.000     | 37,260.000                        |  |
|              | URSTADT BIDDLE PROPERTIES    | 2,600.000   | 47,970.000                        |  |
|              | VENTAS INC                   | 11,295.000  | 676,570.500                       |  |
|              | VORNADO REALTY TRUST         | 6,599.000   | 600,113.060                       |  |
|              | WASHINGTON REIT              | 4,000.000   | 91,560.000                        |  |
|              | WEINGARTEN REALTY INVST      | 4,731.000   | 132,231.450                       |  |
|              | WP CAREY INC                 | 2,600.000   | 160,134.000                       |  |
| アメリカ・ドル 小計   |                              | 570,681.000 | 19,323,362.140<br>(1,996,489,776) |  |
| イギリス・bond    | BIG YELLOW GROUP PLC         | 10,000.000  | 49,190.000                        |  |
|              | BRITISH LAND CO PLC          | 36,191.000  | 233,612.900                       |  |
|              | DERWENT LONDON PLC           | 3,860.000   | 99,588.000                        |  |
|              | GREAT PORTLAND ESTATES PLC   | 17,800.000  | 109,203.000                       |  |
|              | HAMMERSON PLC                | 27,200.000  | 137,904.000                       |  |
|              | INTU PROPERTIES PLC          | 17,804.000  | 55,815.540                        |  |
|              | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 27,178.000  | 270,556.990                       |  |
|              | LONDONMETRIC PROPERTY PLC    | 36,000.000  | 49,536.000                        |  |
|              | SEGRO PLC                    | 33,790.000  | 115,798.330                       |  |
|              | SHAFTESBURY PLC              | 12,700.000  | 81,407.000                        |  |
|              | WORKSPACE GROUP PLC          | 7,067.000   | 39,327.850                        |  |
| イギリス・bond 小計 |                              | 229,590.000 | 1,241,939.610<br>(210,409,408)    |  |
| カナダ・ドル       | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 1,440.000   | 86,169.600                        |  |
|              | CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR | 3,400.000   | 86,870.000                        |  |
|              | CANADIAN APT PPTYS REIT      | 2,681.000   | 57,561.070                        |  |

|                |                                     |             |                                  |  |
|----------------|-------------------------------------|-------------|----------------------------------|--|
|                | CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST      | 2,700.000   | 116,208.000                      |  |
|                | CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCE      | 4,700.000   | 47,846.000                       |  |
|                | COMINAR REAL ESTATE INVT TR         | 3,500.000   | 64,610.000                       |  |
|                | H & R REAL ESTATE INVESTMENT        | 7,981.000   | 171,511.690                      |  |
|                | INNVEST REAL ESTATE INVT TR         | 12,300.000  | 58,056.000                       |  |
|                | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST     | 7,500.000   | 190,275.000                      |  |
| カナダ・ドル 小計      |                                     | 46,202.000  | 879,107.360<br>(83,418,497)      |  |
| ニュージーランド・ドル    | GOODMAN PROPERTY TRUST              | 73,600.000  | 72,496.000                       |  |
|                | KIWI INCOME PROPERTY TRUST          | 50,000.000  | 55,000.000                       |  |
| ニュージーランド・ドル 小計 |                                     | 123,600.000 | 127,496.000<br>(11,033,504)      |  |
| ユーロ            | BEFIMMO                             | 1,104.000   | 55,939.680                       |  |
|                | COFINIMMO SA                        | 730.000     | 63,729.000                       |  |
|                | CORIO NV                            | 4,080.000   | 133,518.000                      |  |
|                | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV        | 1,300.000   | 39,260.000                       |  |
|                | FONCIERE DES REGIONS                | 1,600.000   | 98,736.000                       |  |
|                | GECINA SA                           | 1,116.000   | 107,426.160                      |  |
|                | ICADE                               | 956.000     | 63,096.000                       |  |
|                | KLEPIERRE                           | 4,268.000   | 143,831.600                      |  |
|                | MERCIALYS                           | 2,220.000   | 33,488.700                       |  |
|                | NIEUWE STEEN INVS                   | 991.000     | 4,578.420                        |  |
|                | UNIBAIL-RODAMCO SE                  | 3,740.000   | 699,754.000                      |  |
|                | VASTNED RETAIL                      | 1,480.000   | 52,170.000                       |  |
|                | WAREHOUSES DE PAUW                  | 904.000     | 48,499.600                       |  |
| WERELDHAVE NV  | 1,040.000                           | 59,779.200  |                                  |  |
| ユーロ 小計         |                                     | 25,529.000  | 1,603,806.360<br>(226,473,496)   |  |
| 香港・ドル          | FORTUNE REAL ESTATE (HK)            | 78,000.000  | 478,140.000                      |  |
|                | LINK REIT/THE                       | 94,100.000  | 3,321,730.000                    |  |
|                | REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 203,000.000 | 440,510.000                      |  |
|                | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 121,000.000 | 454,960.000                      |  |
| 香港・ドル 小計       |                                     | 496,100.000 | 4,695,340.000<br>(62,541,928)    |  |
| 投資証券 合計        |                                     | 1,491,702   | 2,590,366,609<br>(2,590,366,609) |  |
| 合計             |                                     |             | 2,985,875,762<br>(2,985,875,762) |  |

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

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

| 通貨          | 銘柄数           | 組入<br>投資信託受益証券<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 有価証券の<br>合計金額<br>に対する比率 |
|-------------|---------------|------------------------|--------------------|-------------------------|
| アメリカ・ドル     | 投資証券 96銘柄     | -%                     | 65.79%             | 66.86%                  |
| イギリス・ポンド    | 投資証券 11銘柄     | -%                     | 6.93%              | 7.05%                   |
| オーストラリア・ドル  | 投資信託受益証券 14銘柄 | 9.53%                  | -%                 | 9.68%                   |
| カナダ・ドル      | 投資証券 9銘柄      | -%                     | 2.75%              | 2.79%                   |
| シンガポール・ドル   | 投資信託受益証券 9銘柄  | 3.51%                  | -%                 | 3.57%                   |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 2銘柄      | -%                     | 0.36%              | 0.37%                   |
| ユーロ         | 投資証券 14銘柄     | -%                     | 7.46%              | 7.58%                   |
| 香港・ドル       | 投資証券 4銘柄      | -%                     | 2.06%              | 2.09%                   |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

| 科 目         | 注記<br>番号 | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在   |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部        |          |                |                |
| 流動資産        |          |                |                |
| 預金          |          | 1,365,343,588  | 898,020,599    |
| コール・ローン     |          | 44,222,614     | 36,843,254     |
| 株式          |          | 36,734,491,312 | 36,394,271,057 |
| 投資信託受益証券    |          | 302,202,050    | 330,187,525    |
| 投資証券        |          | 11,259,718     | 73,394,633     |
| 派生商品評価勘定    |          | 42,251,470     | 11,310         |
| 未収入金        |          | 2,507,041      | -              |
| 未収配当金       |          | 39,768,123     | 20,722,573     |
| 差入委託証拠金     |          | 337,545,580    | 259,191,756    |
| 流動資産合計      |          | 38,879,591,496 | 38,012,642,707 |
| 資産合計        |          | 38,879,591,496 | 38,012,642,707 |
| 負債の部        |          |                |                |
| 流動負債        |          |                |                |
| 派生商品評価勘定    |          | 493,833        | 28,813,882     |
| 未払金         |          | 18,137         | 3,752          |
| 未払解約金       |          | 14,800,000     | 8,519,000      |
| 流動負債合計      |          | 15,311,970     | 37,336,634     |
| 負債合計        |          | 15,311,970     | 37,336,634     |
| 純資産の部       |          |                |                |
| 元本等         |          |                |                |
| 元本          | 1        | 46,090,797,565 | 42,097,535,766 |
| 剰余金         |          |                |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 2        | 7,226,518,039  | 4,122,229,693  |
| 元本等合計       |          | 38,864,279,526 | 37,975,306,073 |
| 純資産合計       |          | 38,864,279,526 | 37,975,306,073 |
| 負債純資産合計     |          | 38,879,591,496 | 38,012,642,707 |

## 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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>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<br/>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>   |

## （貸借対照表に関する注記）

| 項目                                      | 平成25年1月11日現在    | 平成26年1月14日現在    |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 52,868,790,729円 | 46,090,797,565円 |
| 同期中追加設定元本額                              | 7,470,968,134円  | 7,749,079,562円  |
| 同期中一部解約元本額                              | 14,248,961,298円 | 11,742,341,361円 |
| 元本の内訳                                   |                 |                 |



| ファンド名                               |   |   |
|-------------------------------------|---|---|
| D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>        | 177,467,718円                                      | 213,583,763円                                      |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション              | 205,971,270円                                      | 241,045,504円                                      |
| D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）       | 34,126円   | 7,051,114円  |
| D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）       | 70,837円   | 13,044,378円                                       |
| D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国30）       | 108,947円  | 33,166,784円                                       |
| 投資のソムリエ                             | 3,188,354円  | 58,142,043円                                       |
| クルーズコントロール                          | 6,108,126円  | 80,753,967円                                       |
| 投資のソムリエ<DC年金>                       | - 円   | 660,890円  |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>          | - 円   | 550,917円  |
| エマージング株式パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）       | 8,883,398,642円                                    | 7,930,699,430円                                    |
| 新興国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）          | 3,193,053,982円                                    | 3,090,291,212円                                    |
| エマージング株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）         | 2,238,317,504円                                    | 2,166,543,481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） | 19,406,269,848円                                   | 17,474,957,918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） | 11,976,808,211円                                   | 10,787,044,365円                                   |
| 計                                   | 46,090,797,565円                                   | 42,097,535,766円                                   |
| 2 . 受益権の総数                          | 46,090,797,565口                                   | 42,097,535,766口                                   |
| 3 . 2 元本の欠損                         | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,226,518,039円であります。 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,122,229,693円であります。 |

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日  | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1． 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。   | 同左                           |
| 2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。<br>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左                           |
| 3． 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。  | 同左                           |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   | 同左           |
| 2. 時価の算定方法                 | (1)有価証券<br>「(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。<br>(2)デリバティブ取引<br>「(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。<br>(3)上記以外の金融商品<br>上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。           | 同左           |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左           |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類       | 平成25年1月11日現在              | 平成26年1月14日現在              |
|----------|---------------------------|---------------------------|
|          | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |
| 株式       | 2,523,885,670             | 1,205,838,994             |
| 投資信託受益証券 | 74,330,994                | 14,444,172                |
| 投資証券     | 2,423,449                 | 5,032,148                 |
| 合計       | 2,600,640,113             | 1,186,362,674             |

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成24年4月19日から平成25年1月11日まで及び平成25年4月19日から平成26年1月14日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

| 種類        | 平成25年1月11日 現在 |           |     |      | 平成26年1月14日 現在 |           |            |        |
|-----------|---------------|-----------|-----|------|---------------|-----------|------------|--------|
|           | 契約額等          | うち<br>1年超 | 時価  | 評価損益 | 契約額等          | うち<br>1年超 | 時価         | 評価損益   |
|           | （円）           |           | （円） | （円）  | （円）           |           | （円）        | （円）    |
| 市場取引以外の取引 |               |           |     |      |               |           |            |        |
| 為替予約取引    |               |           |     |      |               |           |            |        |
| 売 建       | -             | -         | -   | -    | 10,268,310    | -         | 10,257,000 | 11,310 |
| メキシコ・ペソ   | -             | -         | -   | -    | 10,268,310    | -         | 10,257,000 | 11,310 |
| 合計        | -             | -         | -   | -    | 10,268,310    | -         | 10,257,000 | 11,310 |

## （注）時価の算定方法

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

## 株式関連

| 種類   | 平成25年1月11日 現在 |           |               |             | 平成26年1月14日 現在 |           |               |             |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|      | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|      |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 市場取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 先物取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 買 建  | 1,752,411,953 | -         | 1,794,169,590 | 41,757,637  | 1,167,675,113 | -         | 1,138,861,231 | 28,813,882  |
| 合計   | 1,752,411,953 | -         | 1,794,169,590 | 41,757,637  | 1,167,675,113 | -         | 1,138,861,231 | 28,813,882  |

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

|              | 平成25年1月11日現在 | 平成26年1月14日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.8432円      | 0.9021円      |
| (1万口当たり純資産額) | (8,432円)     | (9,021円)     |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成26年1月14日現在

| 通貨      | 銘柄                                  | 株式数    | 評価額     |               | 備考 |
|---------|-------------------------------------|--------|---------|---------------|----|
|         |                                     |        | 単価      | 金額            |    |
| アメリカ・ドル | BANCOLOMBIA SA SPONS<br>ADR         | 32,513 | 47.960  | 1,559,323.480 |    |
|         | LATAM AIRLINES GROUP<br>SP ADR      | 41,450 | 15.540  | 644,133.000   |    |
|         | BANCO SANTANDER<br>CHILE ADR        | 26,392 | 22.260  | 587,485.920   |    |
|         | CIA DE MINAS<br>BUENAVENTURA SA ADR | 22,773 | 11.970  | 272,592.810   |    |
|         | CIA CERVECERIAS<br>UNIDAS ADR       | 16,368 | 22.570  | 369,425.760   |    |
|         | SURGUTNEFTEGAZ SP<br>ADR PREF       | 73,600 | 7.570   | 557,152.000   |    |
|         | CREDICORP LTD                       | 6,949  | 130.930 | 909,832.570   |    |
|         | EMBOTELLADORA ANDINA<br>SA ADR      | 11,900 | 26.000  | 309,400.000   |    |

|  |         |         |               |  |
|--|---------|---------|---------------|--|
| EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHILE SP ADR | 15,816  | 42.660  | 674,710.560   |  |
| ENERSIS SA SPONS ADR                             | 53,208  | 15.100  | 803,440.800   |  |
| CORPBANCA SA ADR                                 | 22,265  | 20.920  | 465,783.800   |  |
| INFOSYS LTD ADR                                  | 17,222  | 59.410  | 1,023,159.020 |  |
| MOBILE TELESYSTEMS OJSC ADR                      | 52,325  | 20.040  | 1,048,593.000 |  |
| WIPRO LTD ADR                                    | 23,281  | 12.860  | 299,393.660   |  |
| DR REDDYS LABORATORIES LTD ADR                   | 634     | 43.100  | 27,325.400    |  |
| QUIMICA Y MINERA DE CHIL-SP ADR                  | 16,146  | 25.790  | 416,405.340   |  |
| HDFC BANK LTD ADR                                | 4,830   | 34.090  | 164,654.700   |  |
| SOUTHERN COPPER CORP                             | 14,980  | 27.820  | 416,743.600   |  |
| BANCO DE CHILE-ADR                               | 5,578   | 80.730  | 450,311.940   |  |
| VINA CONCHA Y TORO SA SP ADR                     | 9,100   | 36.220  | 329,602.000   |  |
| LUKOIL SPON ADR                                  | 49,540  | 60.000  | 2,972,400.000 |  |
| GAIL INDIA LTD GDR                               | 2,630   | 33.500  | 88,105.000    |  |
| GLOBAL TELECOM HOLDING GDR                       | 56,215  | 3.350   | 188,320.250   |  |
| RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD GDR                  | 1,342   | 19.000  | 25,498.000    |  |
| OAQ GAZPROM ADR                                  | 568,232 | 8.320   | 4,727,690.240 |  |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR             | 84,283  | 4.484   | 377,924.970   |  |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL CO                     | 84,200  | 1.610   | 135,562.000   |  |
| SURGUTNEFTEGAZ ADR                               | 72,932  | 8.360   | 609,711.520   |  |
| SISTEMA JSFC GDR                                 | 14,202  | 32.000  | 454,464.000   |  |
| NOVATEK OAO GDR                                  | 9,029   | 131.400 | 1,186,410.600 |  |
| TELECOM EGYPT -GDR REG S                         | 13,015  | 9.510   | 123,772.650   |  |
| MMC NORILSK NICKEL ADR                           | 57,374  | 16.600  | 952,408.400   |  |
| ROSTELECOM SPON ADR                              | 17,771  | 20.140  | 357,907.940   |  |
| LARSEN & TOUBRO LTD GDR                          | 3,461   | 16.040  | 55,514.440    |  |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD GDR                      | 12,251  | 14.380  | 176,169.380   |  |
| RANBAXY LABORATORIES LTD GDR                     | 4,433   | 7.375   | 32,693.370    |  |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD GDR                      | 19,260  | 28.360  | 546,213.600   |  |
| ROSNEFT OIL CO GDR                               | 121,035 | 7.130   | 862,979.550   |  |
| URALKALI -SPON GDR                               | 26,381  | 25.500  | 672,715.500   |  |

|   |                                 |           |                |                                   |  |
|---|---------------------------------|-----------|----------------|-----------------------------------|--|
|   | SEVERSTAL GDR                   | 21,786    | 9.275          | 202,065.150                       |  |
|   | TATNEFT GDR                     | 23,880    | 36.050         | 860,874.000                       |  |
|   | VTB BANK OJSC GDR               | 241,425   | 2.881          | 695,545.420                       |  |
|   | MAGNIT OJSC GDR                 | 26,398    | 57.700         | 1,523,164.600                     |  |
|   | ECOPETROL SA SP ADR             | 50,448    | 35.310         | 1,781,318.880                     |  |
|   | FEDERAL<br>HYDROGENERATING ADR  | 135,146   | 1.700          | 229,748.200                       |  |
|   | SBERBANK ADR                    | 267,204   | 12.050         | 3,219,808.200                     |  |
|   | CENCOSUD SA ADR                 | 56,420    | 9.630          | 543,324.600                       |  |
|   | MEGAFON OAO GDR                 | 9,723     | 30.900         | 300,440.700                       |  |
| アメリカ・ドル 小計                                    |                                 | 2,517,346 |                | 35,232,220.520<br>(3,640,193,025) |  |
| インド・ルピー                                       | RELIANCE INDUSTRIES<br>LTD      | 91,051    | 880.400        | 80,161,300.400                    |  |
|   | BHARAT PETROLEUM<br>CORP LTD    | 16,876    | 331.500        | 5,594,394.000                     |  |
|   | ASIAN PAINTS LTD                | 27,790    | 494.050        | 13,729,649.500                    |  |
|   | BANK OF BARODA                  | 3,799     | 617.600        | 2,346,262.400                     |  |
|   | RELIANCE<br>INFRASTRUCTURE LTD  | 3,292     | 402.500        | 1,325,030.000                     |  |
|   | HDFC BANK LTD                   | 134,154   | 672.850        | 90,265,518.900                    |  |
|   | MAHINDRA & MAHINDRA<br>LTD      | 20,857    | 888.250        | 18,526,230.250                    |  |
|   | ICICI BANK LTD                  | 15,840    | 1,054.900      | 16,709,616.000                    |  |
|   | ADITYA BIRLA NUVO<br>LTD        | 4,900     | 1,148.450      | 5,627,405.000                     |  |
|   | STATE BANK OF INDIA<br>LTD      | 9,859     | 1,641.250      | 16,181,083.750                    |  |
|   | LIC HOUSING FINANCE<br>LTD      | 29,705    | 204.600        | 6,077,643.000                     |  |
|   | RELIANCE CAPITAL LTD            | 8,069     | 344.200        | 2,777,349.800                     |  |
|   | TATA STEEL LTD                  | 34,054    | 385.950        | 13,143,141.300                    |  |
|   | TATA MOTORS LTD                 | 76,718    | 376.150        | 28,857,475.700                    |  |
|   | JSW STEEL LTD                   | 9,507     | 1,019.300      | 9,690,485.100                     |  |
|   | TATA POWER CO LTD               | 116,490   | 78.850         | 9,185,236.500                     |  |
|   | NESTLE INDIA LTD                | 587       | 5,426.900      | 3,185,590.300                     |  |
|   | BHARAT HEAVY<br>ELECTRICALS LTD | 65,796    | 163.850        | 10,780,674.600                    |  |
|   | GAIL INDIA LTD                  | 15,664    | 344.750        | 5,400,164.000                     |  |
|   | KOTAK MAHINDRA BANK<br>LTD      | 32,029    | 716.900        | 22,961,590.100                    |  |
| SESA STERLITE LTD                             | 110,959                         | 195.900   | 21,736,868.100 |                                   |  |
| OIL & NATURAL GAS<br>CORP LTD                 | 80,421                          | 292.900   | 23,555,310.900 |                                   |  |
| GLAXOSMITHKLINE<br>CONSUMER HEALTHCARE<br>LTD | 1,065                           | 4,313.750 | 4,594,143.750  |                                   |  |
| LUPIN LTD                                     | 1,485                           | 919.950   | 1,366,125.750  |                                   |  |
| ACC LTD                                       | 6,455                           | 1,037.150 | 6,694,803.250  |                                   |  |

|                                      |         |           |                 |  |
|--------------------------------------|---------|-----------|-----------------|--|
| HOUSING DEVELOPMENT<br>FINANCE CORP  | 145,891 | 818.650   | 119,433,667.150 |  |
| ZEE ENTERTAINMENT<br>ENTERPRISES LTD | 28,113  | 295.950   | 8,320,042.350   |  |
| INFOSYS LTD                          | 26,400  | 3,665.000 | 96,756,000.000  |  |
| WIPRO LTD                            | 28,934  | 561.450   | 16,244,994.300  |  |
| HINDUSTAN UNILEVER<br>LTD            | 59,246  | 545.700   | 32,330,542.200  |  |
| APOLLO HOSPITALS<br>ENTERPRISE LTD   | 8,687   | 899.100   | 7,810,481.700   |  |
| HCL TECHNOLOGIES LTD                 | 21,929  | 1,343.350 | 29,458,322.150  |  |
| DABUR INDIA LTD                      | 14,377  | 169.950   | 2,443,371.150   |  |
| HERO MOTOCORP LTD                    | 5,264   | 2,037.000 | 10,722,768.000  |  |
| DR REDDYS<br>LABORATORIES LTD        | 8,411   | 2,626.550 | 22,091,912.050  |  |
| BHARTI AIRTEL LTD                    | 50,224  | 331.000   | 16,624,144.000  |  |
| UNITED SPIRITS LTD                   | 7,850   | 2,759.600 | 21,662,860.000  |  |
| SUN PHARMACEUTICAL<br>INDUSTRIES LTD | 56,175  | 602.350   | 33,837,011.250  |  |
| DIVI'S LABORATORIES<br>LTD           | 2,562   | 1,261.650 | 3,232,347.300   |  |
| JINDAL STEEL & POWER<br>LTD          | 43,566  | 260.200   | 11,335,873.200  |  |
| SHRIRAM TRANSPORT<br>FINANCE CO LTD  | 13,445  | 608.750   | 8,184,643.750   |  |
| CIPLA LTD/INDIA                      | 36,885  | 402.250   | 14,836,991.250  |  |
| LARSEN & TOUBRO LTD                  | 24,901  | 980.550   | 24,416,675.550  |  |
| JAIPRAKASH<br>ASSOCIATES LTD         | 87,706  | 47.650    | 4,179,190.900   |  |
| ULTRATECH CEMENT LTD                 | 5,608   | 1,669.550 | 9,362,836.400   |  |
| TATA CONSULTANCY<br>SERVICES LTD     | 48,041  | 2,368.750 | 113,797,118.750 |  |
| ADANI ENTERPRISES<br>LTD             | 16,748  | 235.300   | 3,940,804.400   |  |
| NTPC LTD                             | 109,910 | 132.750   | 14,590,552.500  |  |
| PIRAMAL ENTERPRISES<br>LTD           | 6,088   | 549.950   | 3,348,095.600   |  |
| YES BANK LTD                         | 9,775   | 338.750   | 3,311,281.250   |  |
| AMBUJA CEMENTS LTD                   | 77,639  | 170.100   | 13,206,393.900  |  |
| RANBAXY LABORATORIES<br>LTD          | 8,562   | 438.800   | 3,757,005.600   |  |
| HINDALCO INDUSTRIES<br>LTD           | 112,300 | 110.000   | 12,353,000.000  |  |
| ITC LTD                              | 211,620 | 325.450   | 68,871,729.000  |  |
| RELIANCE<br>COMMUNICATIONS LTD       | 55,596  | 123.150   | 6,846,647.400   |  |
| SIEMENS INDIA LTD                    | 5,734   | 593.850   | 3,405,135.900   |  |
| UNITED BREWERIES LTD                 | 5,209   | 778.150   | 4,053,383.350   |  |
| GODREJ CONSUMER<br>PRODUCTS LTD      | 12,583  | 803.050   | 10,104,778.150  |  |



|            |  |           |            |                                      |  |
|------------|--|-----------|------------|--------------------------------------|--|
|            | TECH MAHINDRA LTD                          | 9,089     | 1,884.500  | 17,128,220.500                       |  |
|            | CAIRN INDIA LTD                            | 34,782    | 324.000    | 11,269,368.000                       |  |
|            | IDEA CELLULAR LTD                          | 57,695    | 161.900    | 9,340,820.500                        |  |
|            | POWER FINANCE CORP LTD                     | 25,765    | 153.050    | 3,943,333.250                        |  |
|            | DLF LTD                                    | 45,392    | 161.050    | 7,310,381.600                        |  |
|            | POWER GRID CORP OF INDIA LTD               | 127,192   | 98.000     | 12,464,816.000                       |  |
|            | ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE      | 34,730    | 143.750    | 4,992,437.500                        |  |
|            | RELIANCE POWER LTD                         | 63,381    | 67.250     | 4,262,372.250                        |  |
|            | RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD             | 34,322    | 203.700    | 6,991,391.400                        |  |
|            | BAJAJ AUTO LTD                             | 8,032     | 1,895.800  | 15,227,065.600                       |  |
|            | OIL INDIA LTD                              | 12,465    | 482.250    | 6,011,246.250                        |  |
|            | COAL INDIA LTD                             | 43,852    | 290.250    | 12,728,043.000                       |  |
|            | MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD | 20,882    | 280.500    | 5,857,401.000                        |  |
|            | インド・ルピー 小計                                 | 2,790,980 |            | 1,292,870,589.650<br>(2,184,951,297) |  |
| インドネシア・ルピア | ASTRA AGRO LESTARI TBK PT                  | 35,000    | 21,175.000 | 741,125,000.000                      |  |
|            | UNITED TRACTORS TBK PT                     | 185,201   | 19,000.000 | 3,518,819,000.000                    |  |
|            | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT              | 372,000   | 6,725.000  | 2,501,700,000.000                    |  |
|            | UNILEVER INDONESIA TBK PT                  | 152,500   | 27,025.000 | 4,121,312,500.000                    |  |
|            | PT ASTRA INTERNATIONAL TBK                 | 1,893,000 | 7,000.000  | 13,251,000,000.000                   |  |
|            | TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK       | 4,366,500 | 2,220.000  | 9,693,630,000.000                    |  |
|            | CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT          | 687,000   | 3,805.000  | 2,614,035,000.000                    |  |
|            | GUDANG GARAM TBK PT                        | 49,500    | 42,600.000 | 2,108,700,000.000                    |  |
|            | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT         | 141,000   | 21,950.000 | 3,094,950,000.000                    |  |
|            | TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT         | 93,500    | 9,150.000  | 855,525,000.000                      |  |
|            | BANK DANAMON INDONESIA TBK PT              | 290,416   | 4,000.000  | 1,161,664,000.000                    |  |
|            | BANK MANDIRI                               | 848,000   | 8,800.000  | 7,462,400,000.000                    |  |
|            | MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK              | 143,000   | 11,200.000 | 1,601,600,000.000                    |  |
|            | BANK RAKYAT INDONESIA                      | 1,044,500 | 8,375.000  | 8,747,687,500.000                    |  |

|        |  |            |            |                                      |  |
|--------|--|------------|------------|--------------------------------------|--|
|        | PERUSAHAAN GAS<br>NEGARA PT                | 1,019,500  | 4,420.000  | 4,506,190,000.000                    |  |
|        | BANK NEGARA<br>INDONESIA PERSERO<br>TBK PT | 732,500    | 4,225.000  | 3,094,812,500.000                    |  |
|        | KALBE FARMA TBK PT                         | 2,111,000  | 1,430.000  | 3,018,730,000.000                    |  |
|        | SEMEN INDONESIA<br>PERSERO TBK PT          | 340,500    | 15,525.000 | 5,286,262,500.000                    |  |
|        | BANK CENTRAL ASIA<br>TBK PT                | 1,198,000  | 9,800.000  | 11,740,400,000.000                   |  |
|        | XL AXIATA TBK PT                           | 188,000    | 5,225.000  | 982,300,000.000                      |  |
|        | LIPPO KARAWACI TBK<br>PT                   | 2,169,500  | 940.000    | 2,039,330,000.000                    |  |
|        | GLOBAL MEDIACOM TBK<br>PT                  | 674,500    | 1,860.000  | 1,254,570,000.000                    |  |
|        | MEDIA NUSANTARA<br>CITRA TBK PT            | 468,500    | 2,505.000  | 1,173,592,500.000                    |  |
|        | JASA MARGA PERSERO<br>TBK PT               | 187,500    | 4,950.000  | 928,125,000.000                      |  |
|        | INDO TAMBANGRAYA<br>MEGAH PT               | 44,000     | 25,650.000 | 1,128,600,000.000                    |  |
|        | BUMI SERPONG DAMAI<br>PT                   | 808,500    | 1,525.000  | 1,232,962,500.000                    |  |
|        | ADARO ENERGY PT                            | 1,090,500  | 955.000    | 1,041,427,500.000                    |  |
|        | INDOFOOD CBP SUKSES<br>MAKMUR TBK PT       | 123,000    | 10,150.000 | 1,248,450,000.000                    |  |
|        | TOWER BERSAMA<br>INFRASTRUCTURE TBK<br>PT  | 151,500    | 5,850.000  | 886,275,000.000                      |  |
|        | PT SURYA CITRA MEDIA<br>TBK                | 393,500    | 2,630.000  | 1,034,905,000.000                    |  |
|        | インドネシア・ルピア 小計                              | 22,001,617 |            | 102,071,080,500.000<br>(877,811,292) |  |
| タイ・パーツ | BANGKOK BANK PCL                           | 76,400     | 182.000    | 13,904,800.000                       |  |
|        | BEC WORLD PLC                              | 86,200     | 48.500     | 4,180,700.000                        |  |
|        | KRUNG THAI BANK PCL<br>NVDR                | 342,500    | 16.500     | 5,651,250.000                        |  |
|        | SIAM COMMERCIAL BANK<br>PCL NVDR           | 178,700    | 147.000    | 26,268,900.000                       |  |
|        | TRUE CORP PCL NVDR                         | 462,600    | 7.150      | 3,307,590.000                        |  |
|        | KASIKORNBANK PCL<br>NVDR                   | 71,200     | 164.000    | 11,676,800.000                       |  |
|        | TMB BANK PCL -NVDR                         | 904,300    | 2.020      | 1,826,686.000                        |  |
|        | IRPC PCL NVDR                              | 1,080,200  | 3.220      | 3,478,244.000                        |  |
|        | BANPU PCL PUBLIC CO<br>LTD NVDR            | 115,000    | 27.250     | 3,133,750.000                        |  |
|        | BANGKOK BANK PCL<br>NVDR                   | 49,900     | 181.500    | 9,056,850.000                        |  |
|        | CHAROEN POKPHAND<br>FOODS PCL              | 203,000    | 30.000     | 6,090,000.000                        |  |

|         |   |           |           |                                  |  |
|---------|---|-----------|-----------|----------------------------------|--|
|         | ADVANCED INFO SERVICE PCL                 | 99,700    | 209.000   | 20,837,300.000                   |  |
|         | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR              | 263,900   | 8.400     | 2,216,760.000                    |  |
|         | PTT PCL                                   | 79,300    | 292.000   | 23,155,600.000                   |  |
|         | SIAM CEMENT PCL                           | 7,800     | 397.000   | 3,096,600.000                    |  |
|         | SIAM CEMENT PCL NVDR                      | 7,600     | 397.000   | 3,017,200.000                    |  |
|         | AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR             | 38,900    | 153.000   | 5,951,700.000                    |  |
|         | SIAM CEMENT PCL FOREIGN                   | 31,300    | 404.000   | 12,645,200.000                   |  |
|         | KASIKORNBANK PCL - FOREIGN                | 115,100   | 166.000   | 19,106,600.000                   |  |
|         | CENTRAL PATTANA PCL NVDR                  | 154,000   | 40.250    | 6,198,500.000                    |  |
|         | BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR       | 35,800    | 121.500   | 4,349,700.000                    |  |
|         | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR              | 177,700   | 22.000    | 3,909,400.000                    |  |
|         | THAI OIL PCL NVDR                         | 87,000    | 54.500    | 4,741,500.000                    |  |
|         | GLOW ENERGY PCL NVDR                      | 41,600    | 68.000    | 2,828,800.000                    |  |
|         | CP ALL PCL NVDR                           | 443,000   | 40.750    | 18,052,250.000                   |  |
|         | BTS GROUP HOLDINGS PCL                    | 515,300   | 8.350     | 4,302,755.000                    |  |
|         | PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR     | 130,145   | 165.000   | 21,473,925.000                   |  |
|         | INDORAMA VENTURES PCL NVDR                | 21,422    | 21.400    | 458,430.800                      |  |
|         | INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN             | 128,333   | 21.400    | 2,746,326.200                    |  |
|         | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR              | 141,008   | 75.750    | 10,681,356.000                   |  |
|         | タイ・パーツ 小計                                 | 6,088,908 |           | 258,345,473.000<br>(808,621,330) |  |
| チェコ・コルナ | KOMERCNI BANKA AS                         | 1,669     | 4,470.000 | 7,460,430.000                    |  |
|         | TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS              | 10,953    | 294.600   | 3,226,753.800                    |  |
|         | CEZ                                       | 13,572    | 517.900   | 7,028,938.800                    |  |
|         | チェコ・コルナ 小計                                | 26,194    |           | 17,716,122.600<br>(91,415,193)   |  |
| トルコ・リラ  | AKBANK TAS                                | 170,308   | 6.690     | 1,139,360.520                    |  |
|         | ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS | 21,760    | 20.850    | 453,696.000                      |  |
|         | ARCELIK                                   | 27,213    | 12.900    | 351,047.700                      |  |
|         | ENKA INSAAT VE SANAYI AS                  | 39,011    | 6.620     | 258,252.820                      |  |

|                 |   |           |            |                                  |  |
|-----------------|---|-----------|------------|----------------------------------|--|
|                 | EREGLI DEMIR VE<br>CELİK FABRIKALARI<br>TAS | 166,902   | 2.770      | 462,318.540                      |  |
|                 | FORD OTOMOTIV SANAYI<br>AS                  | 5,584     | 22.300     | 124,523.200                      |  |
|                 | KOC HOLDING AS                              | 68,796    | 8.760      | 602,652.960                      |  |
|                 | TURK SISE VE CAM<br>FABRIKALARI AS          | 26,304    | 2.730      | 71,809.920                       |  |
|                 | TOFAS TURK OTOMOBİL<br>FABRIKASI AS         | 12,826    | 12.400     | 159,042.400                      |  |
|                 | TURK HAVA YOLLARI                           | 44,435    | 7.170      | 318,598.950                      |  |
|                 | TURKCELL İLETİSİM<br>HİZMET AS              | 72,222    | 11.480     | 829,108.560                      |  |
|                 | TURKIYE GARANTI<br>BANKASI AS               | 221,127   | 6.770      | 1,497,029.790                    |  |
|                 | TURKIYE İS BANKASI                          | 154,675   | 4.700      | 726,972.500                      |  |
|                 | TUPRAS TURKIYE<br>PETROL RAFİNE             | 13,304    | 42.100     | 560,098.400                      |  |
|                 | ULKER BİSKUVİ SANAYİ<br>AS                  | 11,216    | 14.650     | 164,314.400                      |  |
|                 | YAPI VE KREDİ<br>BANKASI AS                 | 76,848    | 3.740      | 287,411.520                      |  |
|                 | HACI OMER SABANCI<br>HOLDING AS             | 80,353    | 8.560      | 687,821.680                      |  |
|                 | COCA-COLA İCECEK AS                         | 5,353     | 49.000     | 262,297.000                      |  |
|                 | BİM BİRLEŞİK<br>MAGAZALAR AS                | 19,743    | 40.500     | 799,591.500                      |  |
|                 | TURKIYE VAKIFLAR<br>BANKASI TAO             | 57,549    | 3.950      | 227,318.550                      |  |
|                 | TAV HAVALİMANLARI<br>HOLDING AS             | 16,685    | 16.750     | 279,473.750                      |  |
|                 | TURKIYE HALK BANKASI<br>AS                  | 57,669    | 13.050     | 752,580.450                      |  |
|                 | TURK<br>TELEKOMÜNİKASYON AS                 | 52,652    | 5.900      | 310,646.800                      |  |
|                 | KOZA ALTIN<br>İŞLETMELERİ AS                | 4,261     | 22.800     | 97,150.800                       |  |
| トルコ・リラ 小計       |   | 1,426,796 |            | 11,423,118.710<br>(541,455,827)  |  |
| ハンガリー・<br>フォロント | RICHTER GEDEON NYRT                         | 15,067    | 4,759.000  | 71,703,853.000                   |  |
|                 | MOL HUNGARIAN OIL<br>AND GAS NYRT           | 3,754     | 14,390.000 | 54,020,060.000                   |  |
|                 | OTP BANK NYRT                               | 19,837    | 4,460.000  | 88,473,020.000                   |  |
| ハンガリー・フォロント 小計  |   | 38,658    |            | 214,196,933.000<br>(101,208,050) |  |
| フィリピン・ペソ        | AYALA LAND INC                              | 476,600   | 26.100     | 12,439,260.000                   |  |
|                 | ABOITIZ EQUITY<br>VENTURES INC              | 163,780   | 52.350     | 8,573,883.000                    |  |

|          |   |           |           |                                  |  |
|----------|---|-----------|-----------|----------------------------------|--|
|          | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND             | 76,309    | 84.000    | 6,409,956.000                    |  |
|          | AYALA CORP                                | 17,403    | 525.000   | 9,136,575.000                    |  |
|          | ALLIANCE GLOBAL GROUP INC                 | 212,800   | 25.500    | 5,426,400.000                    |  |
|          | DMCI HOLDINGS INC                         | 70,370    | 57.350    | 4,035,719.500                    |  |
|          | GLOBE TELECOM INC                         | 3,520     | 1,670.000 | 5,878,400.000                    |  |
|          | INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC | 72,710    | 98.950    | 7,194,654.500                    |  |
|          | JG SUMMIT HOLDINGS INC                    | 162,900   | 38.600    | 6,287,940.000                    |  |
|          | JOLLIBEE FOODS CORP                       | 48,790    | 167.500   | 8,172,325.000                    |  |
|          | METROPOLITAN BANK & TRUST                 | 18,851    | 73.750    | 1,390,261.250                    |  |
|          | BDO UNIBANK INC                           | 124,238   | 71.800    | 8,920,288.400                    |  |
|          | PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO     | 4,575     | 2,710.000 | 12,398,250.000                   |  |
|          | SM PRIME HOLDINGS INC                     | 672,475   | 14.680    | 9,871,933.000                    |  |
|          | UNIVERSAL ROBINA CORP                     | 87,930    | 119.500   | 10,507,635.000                   |  |
|          | SM INVESTMENTS CORP                       | 12,462    | 710.000   | 8,848,020.000                    |  |
|          | ENERGY DEVELOPMENT CORP                   | 949,200   | 5.480     | 5,201,616.000                    |  |
|          | METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP            | 1,289,200 | 4.230     | 5,453,316.000                    |  |
|          | ABOITIZ POWER CORP                        | 221,200   | 35.450    | 7,841,540.000                    |  |
| フィリピン・ペソ | 小計  | 4,685,313 |           | 143,987,972.650<br>(332,612,217) |  |
| ブラジル・リアル | BRF SA                                    | 61,192    | 44.440    | 2,719,372.480                    |  |
|          | CYRELA BRAZIL REALTY SA                   | 26,730    | 14.470    | 386,783.100                      |  |
|          | VALE SA                                   | 127,727   | 32.040    | 4,092,373.080                    |  |
|          | CIA PARANAENSE DE ENERGIA                 | 8,018     | 30.340    | 243,266.120                      |  |
|          | VALE SA-PREF A                            | 176,496   | 29.800    | 5,259,580.800                    |  |
|          | RAIA DROGASIL SA                          | 21,900    | 14.300    | 313,170.000                      |  |
|          | TIM PARTICIPACOES SA                      | 83,200    | 13.300    | 1,106,560.000                    |  |
|          | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA         | 23,250    | 9.720     | 225,990.000                      |  |
|          | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA         | 20,749    | 5.780     | 119,929.220                      |  |
|          | BANCO DO BRASIL SA                        | 48,300    | 22.700    | 1,096,410.000                    |  |
|          | USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA    | 37,962    | 13.660    | 518,560.920                      |  |
|          | AES TIETE SA                              | 12,300    | 18.570    | 228,411.000                      |  |
|          | INVESTIMENTOS ITAU SA                     | 276,879   | 8.620     | 2,386,696.980                    |  |

|  |         |        |               |  |
|--|---------|--------|---------------|--|
| LOJAS AMERICANAS SA                                | 38,236  | 15.180 | 580,422.480   |  |
| LOJAS AMERICANAS SA                                | 16,100  | 13.010 | 209,461.000   |  |
| MARCOPOLO SA                                       | 40,800  | 5.040  | 205,632.000   |  |
| GERDAU SA  | 91,130  | 17.650 | 1,608,444.500 |  |
| METALURGICA GERDAU SA                              | 24,400  | 22.130 | 539,972.000   |  |
| CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR | 12,606  | 97.110 | 1,224,168.660 |  |
| PETROLEO BRASILEIRO SA                             | 284,210 | 14.710 | 4,180,729.100 |  |
| PETROLEO BRASILEIRO SA                             | 400,512 | 15.770 | 6,316,074.240 |  |
| ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTICIPACOES SA            | 36,300  | 14.250 | 517,275.000   |  |
| KLABIN SA  | 42,400  | 12.370 | 524,488.000   |  |
| SOUZA CRUZ SA                                      | 33,700  | 22.880 | 771,056.000   |  |
| KROTON EDUCACIONAL SA                              | 20,900  | 39.050 | 816,145.000   |  |
| CCR SA   | 81,420  | 16.110 | 1,311,676.200 |  |
| WEG SA   | 22,900  | 28.600 | 654,940.000   |  |
| BANCO BRADESCO SA PREF                             | 195,749 | 27.420 | 5,367,437.580 |  |
| BANCO BRADESCO SA                                  | 63,560  | 29.600 | 1,881,376.000 |  |
| CIA HERING   | 16,000  | 27.300 | 436,800.000   |  |
| ALL AMERICA LATINA LOGISTICA                       | 45,400  | 7.000  | 317,800.000   |  |
| NATURA COSMETICOS SA                               | 17,600  | 38.710 | 681,296.000   |  |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA                        | 66,706  | 13.910 | 927,880.460   |  |
| BRADESPAR SA                                       | 22,300  | 22.370 | 498,851.000   |  |
| SUZANO PAPEL E CELULOSE SA                         | 36,300  | 9.210  | 334,323.000   |  |
| CPFL ENERGIA SA                                    | 27,640  | 18.250 | 504,430.000   |  |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA                           | 235,680 | 30.780 | 7,254,230.400 |  |
| PORTO SEGURO SA                                    | 9,400   | 27.790 | 261,226.000   |  |
| FIBRIA CELULOSE SA                                 | 30,690  | 26.450 | 811,750.500   |  |
| BRASKEM SA   | 14,130  | 19.920 | 281,469.600   |  |
| TRACTEBEL ENERGIA SA                               | 19,770  | 35.040 | 692,740.800   |  |
| LOCALIZA RENT A CAR                                | 14,805  | 31.150 | 461,175.750   |  |
| TELEFONICA BRASIL S.A.                             | 28,028  | 46.070 | 1,291,249.960 |  |
| LOJAS RENNEN SA                                    | 14,400  | 57.450 | 827,280.000   |  |
| EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA                        | 18,100  | 10.230 | 185,163.000   |  |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA                          | 31,552  | 53.500 | 1,688,032.000 |  |

|   |                    |        |                                   |             |  |
|---|--------------------|--------|-----------------------------------|-------------|--|
| COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO                   | 11,900             | 37.530 | 446,607.000                       |             |  |
| CIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA        | 6,000              | 33.000 | 198,000.000                       |             |  |
| TOTVS SA  | 13,000             | 35.230 | 457,990.000                       |             |  |
| EMBRAER SA                                      | 51,560             | 19.300 | 995,108.000                       |             |  |
| CIA ENERGETICA DE SAO PAULO                     | 17,900             | 21.150 | 378,585.000                       |             |  |
| BR PROPERTIES SA                                | 19,400             | 17.850 | 346,290.000                       |             |  |
| M DIAS BRANCO SA                                | 3,600              | 98.040 | 352,944.000                       |             |  |
| TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA     | 11,700             | 17.900 | 209,430.000                       |             |  |
| ODONTOPREV SA                                   | 22,600             | 9.230  | 208,598.000                       |             |  |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA                       | 37,600             | 16.910 | 635,816.000                       |             |  |
| JBS SA  | 77,800             | 8.600  | 669,080.000                       |             |  |
| OI SA-PREFERENCE                                | 61,924             | 4.280  | 265,034.720                       |             |  |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS                  | 64,949             | 13.230 | 859,275.270                       |             |  |
| CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO | 33,198             | 23.130 | 767,869.740                       |             |  |
| MRV ENGENHARIA E PARTICIPACOES SA               | 34,600             | 8.510  | 294,446.000                       |             |  |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA       | 7,900              | 46.850 | 370,115.000                       |             |  |
| BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL            | 18,300             | 11.540 | 211,182.000                       |             |  |
| ESTACIO PARTICIPACOES SA                        | 24,200             | 19.200 | 464,640.000                       |             |  |
| DURATEX SA                                      | 30,943             | 11.890 | 367,912.270                       |             |  |
| SUL AMERICA SA                                  | 15,448             | 14.000 | 216,272.000                       |             |  |
| HYPERMARCAS SA                                  | 31,100             | 16.750 | 520,925.000                       |             |  |
| BM&FBOVESPA SA                                  | 190,000            | 10.090 | 1,917,100.000                     |             |  |
| QUALICORP SA                                    | 22,700             | 20.200 | 458,540.000                       |             |  |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA                       | 88,600             | 14.020 | 1,242,172.000                     |             |  |
| CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO                  | 20,138             | 23.060 | 464,382.280                       |             |  |
| ECORODOVIAS INFRA E LOG SA                      | 17,300             | 13.210 | 228,533.000                       |             |  |
| CIELO SA  | 33,757             | 67.370 | 2,274,209.090                     |             |  |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES                     | 61,900             | 23.140 | 1,432,366.000                     |             |  |
| AMBEV SA  | 448,550            | 17.040 | 7,643,292.000                     |             |  |
| ブラジル・リアル 小計                                     | 4,456,694          |        | 87,758,814.300<br>(3,846,468,831) |             |  |
| ポーランド・ズロチ                                       | BANK MILLENNIUM SA | 23,631 | 7.430                             | 175,578.330 |  |

|                 |   |         |         |                                 |  |
|-----------------|---|---------|---------|---------------------------------|--|
|                 | MBANK   | 1,540   | 490.000 | 754,600.000                     |  |
|                 | BANK HANDLOWY W<br>WARSZAWIE SA                   | 3,518   | 102.700 | 361,298.600                     |  |
|                 | KGHM POLSKA MIEDZ SA                              | 12,689  | 114.100 | 1,447,814.900                   |  |
|                 | BANK PEKAO SA                                     | 11,647  | 179.350 | 2,088,889.450                   |  |
|                 | TELEKOMUNIKACJA<br>POLSKA SA                      | 69,255  | 10.050  | 696,012.750                     |  |
|                 | POLSKI KONCERN<br>NAFTOWY ORLEN                   | 34,308  | 42.550  | 1,459,805.400                   |  |
|                 | BANK ZACHODNI WBK SA                              | 2,841   | 377.000 | 1,071,057.000                   |  |
|                 | POWSZECHNA KASA<br>OSZCZEDNOSCI BANK<br>POLSKI SA | 87,802  | 38.650  | 3,393,547.300                   |  |
|                 | SYNTHOS SA  | 60,398  | 5.290   | 319,505.420                     |  |
|                 | EUROCASH SA                                       | 7,580   | 43.200  | 327,456.000                     |  |
|                 | GRUPA LOTOS SA                                    | 5,604   | 35.500  | 198,942.000                     |  |
|                 | POLSKIE GORNICTWO<br>NAFTOWE I<br>GAZOWNICTWO SA  | 147,281 | 5.000   | 736,405.000                     |  |
|                 | KERNEL HOLDING SA                                 | 4,994   | 41.610  | 207,800.340                     |  |
|                 | CYFROWY POLSAT SA                                 | 21,501  | 19.200  | 412,819.200                     |  |
|                 | GRUPA AZOTY SA                                    | 4,565   | 62.260  | 284,216.900                     |  |
|                 | ENEA SA   | 18,176  | 14.380  | 261,370.880                     |  |
|                 | POLSKA GRUPA<br>ENERGETYCZNA SA                   | 68,539  | 16.290  | 1,116,500.310                   |  |
|                 | TAURON POLSKA<br>ENERGIA SA                       | 82,524  | 4.350   | 358,979.400                     |  |
|                 | POWSZECHNY ZAKLAD<br>UBEZPIECZEN SA               | 5,301   | 431.000 | 2,284,731.000                   |  |
|                 | JASTRZEBSKA SPOLKA<br>WEGLOWA SA                  | 4,528   | 50.250  | 227,532.000                     |  |
|                 | ALIOR BANK SA                                     | 4,463   | 78.930  | 352,264.590                     |  |
| ポーランド・ズロチ       | 小計  | 682,685 |         | 18,537,126.770<br>(629,150,082) |  |
| マレーシア・<br>リンギット | PARKSON HOLDINGS BHD                              | 83,339  | 2.780   | 231,682.420                     |  |
|                 | AMMB HOLDINGS BHD                                 | 164,700 | 7.300   | 1,202,310.000                   |  |
|                 | GENTING PLANTATIONS<br>BHD                        | 10,100  | 10.840  | 109,484.000                     |  |
|                 | CIMB GROUP HOLDINGS<br>BHD                        | 441,700 | 7.300   | 3,224,410.000                   |  |
|                 | DIGI.COM BHD                                      | 343,500 | 4.850   | 1,665,975.000                   |  |
|                 | MALAYSIA AIRPORTS<br>HOLDINGS BHD                 | 57,600  | 8.930   | 514,368.000                     |  |
|                 | RHB CAPITAL BHD                                   | 64,500  | 8.000   | 516,000.000                     |  |
|                 | BERJAYA SPORTS TOTO<br>BHD                        | 79,878  | 4.000   | 319,512.000                     |  |
|                 | GAMUDA BHD  | 108,300 | 4.490   | 486,267.000                     |  |
|                 | GENTING BHD                                       | 187,400 | 10.280  | 1,926,472.000                   |  |
|                 | YTL CORP BHD                                      | 389,810 | 1.580   | 615,899.800                     |  |



|                                    |                |         |                                   |                |  |
|------------------------------------|----------------|---------|-----------------------------------|----------------|--|
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD     | 18,400         | 15.400  | 283,360.000                       |                |  |
| HONG LEONG BANK BHD                | 63,200         | 14.140  | 893,648.000                       |                |  |
| IJM CORP BHD                       | 102,980        | 5.790   | 596,254.200                       |                |  |
| IOI CORP BHD                       | 275,213        | 5.750   | 1,582,474.750                     |                |  |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD            | 48,000         | 24.000  | 1,152,000.000                     |                |  |
| MALAYAN BANKING BHD                | 428,975        | 9.900   | 4,246,852.500                     |                |  |
| LAFARGE MALAYSIA BHD               | 43,000         | 8.100   | 348,300.000                       |                |  |
| MMC CORP BHD                       | 51,000         | 2.940   | 149,940.000                       |                |  |
| ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD       | 85,100         | 4.830   | 411,033.000                       |                |  |
| MISC BHD                           | 86,780         | 5.700   | 494,646.000                       |                |  |
| PPB GROUP BHD                      | 38,000         | 15.780  | 599,640.000                       |                |  |
| PETRONAS DAGANGAN BHD              | 24,900         | 30.640  | 762,936.000                       |                |  |
| PETRONAS GAS BHD                   | 59,300         | 23.380  | 1,386,434.000                     |                |  |
| GENTING MALAYSIA BHD               | 280,200        | 4.360   | 1,221,672.000                     |                |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD       | 11,400         | 62.640  | 714,096.000                       |                |  |
| TELEKOM MALAYSIA BHD               | 105,000        | 5.520   | 579,600.000                       |                |  |
| TENAGA NASIONAL BHD                | 281,150        | 11.700  | 3,289,455.000                     |                |  |
| UMW HOLDINGS BHD                   | 57,900         | 11.700  | 677,430.000                       |                |  |
| DIALOG GROUP BHD                   | 139,700        | 3.400   | 474,980.000                       |                |  |
| PUBLIC BANK BHD (LOCAL)            | 3,600          | 19.220  | 69,192.000                        |                |  |
| PUBLIC BANK BHD                    | 109,200        | 19.240  | 2,101,008.000                     |                |  |
| YTL POWER INTERNATIONAL BHD        | 268,632        | 1.890   | 507,714.480                       |                |  |
| AIRASIA BHD                        | 83,400         | 2.390   | 199,326.000                       |                |  |
| SIME DARBY BERHAD                  | 276,400        | 9.300   | 2,570,520.000                     |                |  |
| AXIATA GROUP BERHAD                | 241,000        | 6.740   | 1,624,340.000                     |                |  |
| UEM SUNRISE BHD                    | 145,600        | 2.290   | 333,424.000                       |                |  |
| BUMI ARMADA BHD                    | 120,700        | 4.000   | 482,800.000                       |                |  |
| MAXIS BHD                          | 248,700        | 7.100   | 1,765,770.000                     |                |  |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD       | 257,900        | 6.790   | 1,751,141.000                     |                |  |
| SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD       | 337,800        | 4.670   | 1,577,526.000                     |                |  |
| ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD        | 207,400        | 3.010   | 624,274.000                       |                |  |
| IHH HEALTHCARE BHD                 | 233,800        | 3.850   | 900,130.000                       |                |  |
| FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD | 83,700         | 4.500   | 376,650.000                       |                |  |
| マレーシア・リングgit 小計                    | 6,748,857      |         | 45,560,947.150<br>(1,439,725,929) |                |  |
| メキシコ・ペソ                            | ALFA SAB DE CV | 274,300 | 37.410                            | 10,261,563.000 |  |

|  |           |         |                |  |
|--|-----------|---------|----------------|--|
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV                  | 39,400    | 153.800 | 6,059,720.000  |  |
| CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV  | 34,700    | 51.420  | 1,784,274.000  |  |
| EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV           | 26,300    | 143.680 | 3,778,784.000  |  |
| GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO          | 167,100   | 33.560  | 5,607,876.000  |  |
| GRUPO TELEVISA SAB                         | 241,200   | 82.010  | 19,780,812.000 |  |
| GRUPO BIMBO SAB DE CV                      | 149,800   | 36.660  | 5,491,668.000  |  |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA   | 23,200    | 162.360 | 3,766,752.000  |  |
| GRUPO CARSO SAB DE CV                      | 64,800    | 66.650  | 4,318,920.000  |  |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV         | 239,400   | 94.300  | 22,575,420.000 |  |
| MEXICHEM SAB DE CV                         | 105,088   | 54.420  | 5,718,888.960  |  |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV               | 11,645    | 331.390 | 3,859,036.550  |  |
| INDUSTRIAS CH SAB DE CV                    | 14,800    | 81.810  | 1,210,788.000  |  |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV         | 140,100   | 37.390  | 5,238,339.000  |  |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV  | 20,200    | 152.070 | 3,071,814.000  |  |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV                     | 373,752   | 42.930  | 16,045,173.360 |  |
| AMERICA MOVIL SAB DE CV                    | 3,386,078 | 14.280  | 48,353,193.840 |  |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA SA                | 207,900   | 34.940  | 7,264,026.000  |  |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV                 | 27,100    | 78.180  | 2,118,678.000  |  |
| WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV               | 518,900   | 33.090  | 17,170,401.000 |  |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV | 26,200    | 70.480  | 1,846,576.000  |  |
| GENOMMA LAB INTERNACIONAL SAB DE CV        | 69,800    | 34.500  | 2,408,100.000  |  |
| OHL MEXICO SAB DE CV                       | 71,500    | 33.680  | 2,408,120.000  |  |
| MINERA FRISCO SAB DE CV                    | 74,900    | 24.660  | 1,847,034.000  |  |
| COMPARTAMOS SAB DE CV                      | 130,900   | 23.740  | 3,107,566.000  |  |

|                              |   |            |                 |                                    |  |
|------------------------------|---|------------|-----------------|------------------------------------|--|
|                              | GRUPO COMERCIAL<br>CHEDRAUI SA DE CV                  | 37,900     | 40.960          | 1,552,384.000                      |  |
| メキシコ・ペソ 小計                   |   | 6,476,963  |                 | 206,645,907.710<br>(1,632,502,671) |  |
| ユーロ                          | PIRAEUS BANK S.A                                      | 95,279     | 1.740           | 165,785.460                        |  |
|                              | ALPHA BANK A.E.                                       | 140,087    | 0.730           | 102,263.510                        |  |
|                              | NATIONAL BANK OF<br>GREECE                            | 29,998     | 4.170           | 125,091.660                        |  |
|                              | TITAN CEMENT CO.<br>S.A.                              | 5,332      | 21.800          | 116,237.600                        |  |
|                              | HELLENIC TELECOMMUN<br>ORGANIZA                       | 22,982     | 11.670          | 268,199.940                        |  |
|                              | FOLLI FOLLIE SA                                       | 3,130      | 26.700          | 83,571.000                         |  |
|                              | HELLENIC PETRO  | 7,123      | 7.720           | 54,989.560                         |  |
|                              | OPAP SA   | 21,122     | 10.640          | 224,738.080                        |  |
|                              | JUMBO SA  | 10,130     | 12.680          | 128,448.400                        |  |
| PUBLIC POWER CORP            | 10,857  | 11.380     | 123,552.660     |                                    |  |
| ユーロ 小計                       |   | 346,040    |                 | 1,392,877.870<br>(196,688,284)     |  |
| 韓国・ウォン                       | CHEIL COMMUNICATIONS<br>INC                           | 9,830      | 27,700.000      | 272,291,000.000                    |  |
|                              | HYUNDAI MOTOR CO<br>LTD-2ND PFD                       | 3,555      | 127,000.000     | 451,485,000.000                    |  |
|                              | SAMSUNG FIRE &<br>MARINE INSURANC                     | 3,463      | 247,500.000     | 857,092,500.000                    |  |
|                              | DONGBU INSURANCE CO<br>LTD                            | 4,728      | 56,600.000      | 267,604,800.000                    |  |
|                              | COWAY CO LTD  | 5,520      | 64,400.000      | 355,488,000.000                    |  |
|                              | KT&G CORP   | 10,938     | 75,100.000      | 821,443,800.000                    |  |
|                              | S-1 CORPORATION                                       | 1,432      | 76,700.000      | 109,834,400.000                    |  |
|                              | KOREA GAS CORP  | 2,355      | 68,500.000      | 161,317,500.000                    |  |
|                              | CJ CORP   | 893        | 114,000.000     | 101,802,000.000                    |  |
|                              | CHEIL INDUSTRIES INC                                  | 5,177      | 79,800.000      | 413,124,600.000                    |  |
|                              | DOOSAN INFRACORE<br>CO.,LTD                           | 14,640     | 12,600.000      | 184,464,000.000                    |  |
|                              | DAEWOO SHIPBUILDING<br>& MARINE                       | 9,480      | 35,350.000      | 335,118,000.000                    |  |
|                              | SK TELECOM CO LTD                                     | 864        | 226,000.000     | 195,264,000.000                    |  |
|                              | DAELIM INDUSTRIAL CO                                  | 3,097      | 84,500.000      | 261,696,500.000                    |  |
|                              | DAEWOO SECURITIES CO<br>LTD                           | 20,370     | 8,760.000       | 178,441,200.000                    |  |
|                              | NCSOFT CORPORATION                                    | 1,442      | 218,000.000     | 314,356,000.000                    |  |
|                              | LG UPLUS CORP   | 19,290     | 11,000.000      | 212,190,000.000                    |  |
|                              | DOOSAN HEAVY<br>INDUSTRIES AND<br>CONSTRUCTION CO LTD | 5,440      | 35,250.000      | 191,760,000.000                    |  |
|                              | DAEWOO ENGINEERING &<br>CONSTRUCT                     | 12,500     | 6,620.000       | 82,750,000.000                     |  |
| DAEWOO INTERNATIONAL<br>CORP | 4,351   | 41,250.000 | 179,478,750.000 |                                    |  |

|   |        |             |                   |  |
|---|--------|-------------|-------------------|--|
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD            | 883    | 538,000.000 | 475,054,000.000   |  |
| LG CHEM LTD                               | 4,396  | 270,000.000 | 1,186,920,000.000 |  |
| LG CHEM LTD                               | 480    | 138,500.000 | 66,480,000.000    |  |
| LS CORP                                   | 2,059  | 84,500.000  | 173,985,500.000   |  |
| LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD              | 1,800  | 69,400.000  | 124,920,000.000   |  |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD            | 39,141 | 44,650.000  | 1,747,645,650.000 |  |
| HYUNDAI DEVELOPMENT CO                    | 6,713  | 24,350.000  | 163,461,550.000   |  |
| HYUNDAI MERCHANT MARINE                   | 5,812  | 12,250.000  | 71,197,000.000    |  |
| S-OIL CORP                                | 3,908  | 70,600.000  | 275,904,800.000   |  |
| HANWHA CHEMICAL CORPORATION               | 8,951  | 22,050.000  | 197,369,550.000   |  |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD                 | 6,278  | 43,950.000  | 275,918,100.000   |  |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION                | 1,767  | 205,500.000 | 363,118,500.000   |  |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES                  | 4,230  | 231,500.000 | 979,245,000.000   |  |
| HYUNDAI MOBIS                             | 6,448  | 279,500.000 | 1,802,216,000.000 |  |
| SK HYNIX INC                              | 51,520 | 38,150.000  | 1,965,488,000.000 |  |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | 6,782  | 60,800.000  | 412,345,600.000   |  |
| HYUNDAI MOTOR CO                          | 1,884  | 120,000.000 | 226,080,000.000   |  |
| HYUNDAI MOTOR CO                          | 14,863 | 228,000.000 | 3,388,764,000.000 |  |
| HYUNDAI MIPO DOCKYARD                     | 987    | 175,500.000 | 173,218,500.000   |  |
| HYUNDAI HYSCO                             | 3,580  | 41,500.000  | 148,570,000.000   |  |
| HYUNDAI STEEL CO                          | 4,970  | 79,400.000  | 394,618,000.000   |  |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA                  | 8,700  | 12,200.000  | 106,140,000.000   |  |
| KCC CORP                                  | 490    | 487,000.000 | 238,630,000.000   |  |
| KIA MOTORS CORP                           | 24,696 | 52,500.000  | 1,296,540,000.000 |  |
| KOREA ZINC CO LTD                         | 824    | 316,500.000 | 260,796,000.000   |  |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP                 | 24,417 | 35,300.000  | 861,920,100.000   |  |
| HANWHA CORP                               | 2,636  | 37,500.000  | 98,850,000.000    |  |
| KOREAN AIR CO LTD                         | 2,851  | 32,600.000  | 92,942,600.000    |  |
| OCI COMPANY LTD                           | 1,500  | 201,500.000 | 302,250,000.000   |  |
| HYUNDAI SECURITIES CO                     | 15,940 | 5,870.000   | 93,567,800.000    |  |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD               | 1,472  | 86,200.000  | 126,886,400.000   |  |
| KT CORP                                   | 3,668  | 31,600.000  | 115,908,800.000   |  |
| LG ELECTRONICS INC                        | 9,874  | 65,900.000  | 650,696,600.000   |  |

|  |        |               |                    |  |
|--|--------|---------------|--------------------|--|
| WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD          | 29,427 | 12,600.000    | 370,780,200.000    |  |
| LOTTE CONFECTIONERY CO LTD             | 71     | 1,866,000.000 | 132,486,000.000    |  |
| LG CORP                                | 9,046  | 60,800.000    | 549,996,800.000    |  |
| WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO LTD   | 15,973 | 9,340.000     | 149,187,820.000    |  |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCTION          | 4,132  | 35,700.000    | 147,512,400.000    |  |
| NAVER CORP                             | 2,756  | 670,000.000   | 1,846,520,000.000  |  |
| HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD        | 1,551  | 153,000.000   | 237,303,000.000    |  |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD       | 3,730  | 39,100.000    | 145,843,000.000    |  |
| DOOSAN CORP                            | 1,014  | 131,000.000   | 132,834,000.000    |  |
| AMOREPACIFIC GROUP                     | 314    | 471,500.000   | 148,051,000.000    |  |
| KANGWON LAND INC                       | 9,140  | 33,050.000    | 302,077,000.000    |  |
| POSCO                                  | 6,118  | 310,500.000   | 1,899,639,000.000  |  |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD             | 1,927  | 69,700.000    | 134,311,900.000    |  |
| SAMSUNG C&T CORP                       | 12,023 | 57,600.000    | 692,524,800.000    |  |
| SAMSUNG SDI CO LTD                     | 3,424  | 151,000.000   | 517,024,000.000    |  |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD       | 6,038  | 67,600.000    | 408,168,800.000    |  |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD             | 10,629 | 1,295,000.000 | 13,764,555,000.000 |  |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD        | 16,170 | 35,100.000    | 567,567,000.000    |  |
| SAMSUNG TECHWIN CO LTD                 | 4,103  | 52,300.000    | 214,586,900.000    |  |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD                | 1,936  | 960,000.000   | 1,858,560,000.000  |  |
| SHINSEGAE CO LTD                       | 882    | 244,000.000   | 215,208,000.000    |  |
| HYOSUNG CORP                           | 2,374  | 71,700.000    | 170,215,800.000    |  |
| ORION CORP                             | 274    | 858,000.000   | 235,092,000.000    |  |
| YUHAN CORP                             | 952    | 197,000.000   | 187,544,000.000    |  |
| SK HOLDINGS CO LTD                     | 2,331  | 181,500.000   | 423,076,500.000    |  |
| HALLA CLIMATE CONTROL                  | 4,350  | 36,000.000    | 156,600,000.000    |  |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD | 5,710  | 31,950.000    | 182,434,500.000    |  |
| GS HOLDINGS CORP                       | 5,448  | 53,400.000    | 290,923,200.000    |  |
| LG DISPLAY CO LTD                      | 21,078 | 25,800.000    | 543,812,400.000    |  |
| SK NETWORKS CO LTD                     | 16,150 | 8,070.000     | 130,330,500.000    |  |
| HITE JINRO CO LTD                      | 1,580  | 21,950.000    | 34,681,000.000     |  |
| CELLTRION INC                          | 5,987  | 46,450.000    | 278,096,150.000    |  |
| HANA FINANCIAL GROUP                   | 24,886 | 41,300.000    | 1,027,791,800.000  |  |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD                  | 1,245  | 223,000.000   | 277,635,000.000    |  |

|              |                                   |                |             |   |  |
|--------------|-----------------------------------|----------------|-------------|---|--|
|              | MIRAE ASSET<br>SECURITIES CO LTD  | 2,981          | 37,800.000  | 112,681,800.000                                     |  |
|              | LOTTE SHOPPING CO                 | 1,217          | 402,500.000 | 489,842,500.000                                     |  |
|              | SAMSUNG LIFE<br>INSURANCE CO LTD  | 5,717          | 100,500.000 | 574,558,500.000                                     |  |
|              | AMOREPACIFIC CORP                 | 322            | 982,000.000 | 316,204,000.000                                     |  |
|              | SAMSUNG CARD CO                   | 4,488          | 35,200.000  | 157,977,600.000                                     |  |
|              | SK INNOVATION CO LTD              | 6,016          | 131,500.000 | 791,104,000.000                                     |  |
|              | CJ CHEILJEDANG CORP               | 703            | 267,000.000 | 187,701,000.000                                     |  |
|              | LG INNOTEK CO LTD                 | 945            | 85,500.000  | 80,797,500.000                                      |  |
|              | SK C&C CO LTD                     | 2,582          | 127,000.000 | 327,914,000.000                                     |  |
|              | KB FINANCIAL GROUP<br>INC         | 37,974         | 39,850.000  | 1,513,263,900.000                                   |  |
|              | HYUNDAI WIA CORP                  | 1,471          | 173,000.000 | 254,483,000.000                                     |  |
|              | KOREA AEROSPACE<br>INDUSTRIES LTD | 2,980          | 28,800.000  | 85,824,000.000                                      |  |
|              | BS FINANCIAL GROUP<br>INC         | 13,320         | 15,550.000  | 207,126,000.000                                     |  |
|              | HANWHA LIFE<br>INSURANCE CO LTD   | 18,670         | 7,200.000   | 134,424,000.000                                     |  |
|              | E-MART CO LTD                     | 1,958          | 258,500.000 | 506,143,000.000                                     |  |
|              | DGB FINANCIAL GROUP<br>INC        | 14,590         | 16,350.000  | 238,546,500.000                                     |  |
|              | HANKOOK TIRE CO LTD<br>NEW        | 6,765          | 63,600.000  | 430,254,000.000                                     |  |
|              | NHN ENTERTAINMENT<br>CORP         | 1,403          | 80,500.000  | 112,941,500.000                                     |  |
|              | <b>韓国・ウォン 小計</b>                  | <b>770,756</b> |             | <b>59,699,406,370.000</b><br><b>(5,838,601,943)</b> |  |
| <b>香港・ドル</b> | JIANGXI COPPER CO<br>LTD          | 95,000         | 13.620      | 1,293,900.000                                       |  |
|              | JIANGSU EXPRESS                   | 136,000        | 9.090       | 1,236,240.000                                       |  |
|              | YANTAI CHANGYU<br>PIONEER WINE CO | 24,400         | 23.280      | 568,032.000   |  |
|              | CHINA MOBILE LIMITED              | 579,000        | 77.800      | 45,046,200.000                                      |  |
|              | ANHUI CONCH CEMENT<br>CO LTD      | 135,000        | 27.150      | 3,665,250.000                                       |  |
|              | DATANG INTERNATIONAL<br>POWER GEN | 280,000        | 3.470       | 971,600.000   |  |
|              | BEIJING ENTERPRISES               | 55,500         | 70.700      | 3,923,850.000                                       |  |
|              | HUANENG POWER<br>INTERNATIONAL IN | 292,000        | 7.580       | 2,213,360.000                                       |  |
|              | YANZHOU COAL MINING<br>CO LTD     | 126,000        | 6.200       | 781,200.000   |  |
|              | HENGAN INTERNATIONAL<br>GROUP     | 71,500         | 89.950      | 6,431,425.000                                       |  |
|              | CHONGQING CHANGAN<br>AUTOMOBILE   | 80,800         | 15.410      | 1,245,128.000                                       |  |
|              | NEW WORLD CHINA LAND<br>LTD       | 84,000         | 4.030       | 338,520.000   |  |

|   |           |        |                |  |
|---|-----------|--------|----------------|--|
| CNOOC LTD                                     | 1,695,000 | 13.900 | 23,560,500.000 |  |
| BRILLIANCE CHINA<br>AUTOMOTIVE                | 282,000   | 12.580 | 3,547,560.000  |  |
| CHINA OVERSEAS LAND<br>& INVESTME             | 377,120   | 22.100 | 8,334,352.000  |  |
| CHINA RESOURCES LAND<br>LTD                   | 192,000   | 19.520 | 3,747,840.000  |  |
| CITIC PACIFIC                                 | 133,000   | 10.200 | 1,356,600.000  |  |
| BEIJING CAPITAL<br>INTERNATIONAL              | 212,000   | 6.160  | 1,305,920.000  |  |
| LENOVO GROUP LTD                              | 630,000   | 9.540  | 6,010,200.000  |  |
| POLY PROPERTY GROUP<br>CO LTD                 | 217,000   | 4.100  | 889,700.000    |  |
| PETRO CHINA CO LTD                            | 1,978,000 | 8.030  | 15,883,340.000 |  |
| CHINA UNICOM HONG<br>KONG LTD                 | 450,742   | 10.960 | 4,940,132.320  |  |
| CHINA TAIPING<br>INSURANCE HOLDINGS<br>CO LTD | 68,800    | 14.020 | 964,576.000    |  |
| CHINA PETROLEUM &<br>CHEMICAL COR             | 2,473,200 | 5.870  | 14,517,684.000 |  |
| ENN ENERGY HOLDINGS<br>LTD                    | 72,000    | 53.500 | 3,852,000.000  |  |
| KUNLUN ENERGY<br>COMPANY LTD                  | 292,000   | 13.500 | 3,942,000.000  |  |
| COSCO PACIFIC LTD                             | 176,000   | 10.420 | 1,833,920.000  |  |
| SHOUGANG FUSHAN<br>RESOURCES GROUP LTD        | 316,000   | 2.510  | 793,160.000    |  |
| YUEXIU PROPERTY CO<br>LTD                     | 564,000   | 1.820  | 1,026,480.000  |  |
| CHINA MERCHANTS<br>HOLDINGS INTL              | 122,000   | 26.650 | 3,251,300.000  |  |
| ALUMINUM CORP OF<br>CHINA LTD                 | 446,000   | 2.770  | 1,235,420.000  |  |
| CHINA EVERBRIGHT LTD                          | 78,000    | 11.760 | 917,280.000    |  |
| CHINA GAS HOLDINGS<br>LTD                     | 188,000   | 11.240 | 2,113,120.000  |  |
| KINGBOARD CHEMICALS<br>HOLDINGS               | 54,900    | 19.800 | 1,087,020.000  |  |
| GEELY AUTOMOBILE<br>HOLDINGS LTD              | 470,000   | 3.410  | 1,602,700.000  |  |
| CHINA RESOURCES GAS<br>GROUP LTD              | 112,000   | 25.350 | 2,839,200.000  |  |
| BYD CO LTD                                    | 56,500    | 37.250 | 2,104,625.000  |  |
| CHINA TELECOM CORP<br>LTD                     | 1,318,000 | 3.710  | 4,889,780.000  |  |
| CHINA OILFIELD<br>SERVICES LTD                | 136,000   | 21.800 | 2,964,800.000  |  |
| CHINA EVERBRIGHT<br>INTERNATIONAL             | 290,000   | 10.520 | 3,050,800.000  |  |

|   |           |         |                |  |
|---|-----------|---------|----------------|--|
| LEE & MAN PAPER<br>MANUFACTURING LTD          | 197,000   | 5.110   | 1,006,670.000  |  |
| PICC PROPERTY &<br>CASUALTY -H                | 288,158   | 10.420  | 3,002,606.360  |  |
| AVICHINA INDUSTRY &<br>TECHNOLOGY             | 176,000   | 4.560   | 802,560.000    |  |
| CHINA RESOURCES<br>POWER HOLDINGS             | 189,200   | 19.540  | 3,696,968.000  |  |
| GREAT WALL MOTOR<br>COMPANY LTD               | 96,500    | 39.250  | 3,787,625.000  |  |
| CHINA LIFE INSURANCE<br>CO LTD                | 726,000   | 22.050  | 16,008,300.000 |  |
| ZIJIN MINING GROUP<br>CO LTD                  | 661,000   | 1.700   | 1,123,700.000  |  |
| SHANDONG WEIGAO<br>GROUP MEDICAL-H            | 148,000   | 10.000  | 1,480,000.000  |  |
| WEICHAI POWER CO LTD                          | 57,360    | 28.500  | 1,634,760.000  |  |
| SINOPEC SHANGHAI<br>PETROCHEMICAL             | 363,000   | 2.080   | 755,040.000    |  |
| CHINA OVERSEAS GRAND<br>OCEANS GROUP LTD      | 79,000    | 7.210   | 569,590.000    |  |
| CHINA VANKE CO LTD                            | 112,261   | 11.880  | 1,333,660.680  |  |
| SHANGHAI INDUSTRIAL                           | 38,000    | 27.300  | 1,037,400.000  |  |
| TINGYI HOLDING CORP                           | 176,000   | 22.150  | 3,898,400.000  |  |
| TSINGTAO BREWERY CO<br>LTD                    | 32,000    | 60.550  | 1,937,600.000  |  |
| GUANGDONG<br>INVESTMENTS LTD                  | 302,000   | 7.320   | 2,210,640.000  |  |
| CHINA RESOURCES<br>ENTERPRISE                 | 110,000   | 24.900  | 2,739,000.000  |  |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY<br>CO LTD                 | 164,000   | 7.240   | 1,187,360.000  |  |
| SINO<br>BIOPHARMACEUTICAL                     | 324,000   | 6.700   | 2,170,800.000  |  |
| CHINA SHIPPING<br>CONTAINER LINES             | 283,000   | 1.900   | 537,700.000    |  |
| CHINA MENGNIU DAIRY<br>CO                     | 142,000   | 37.000  | 5,254,000.000  |  |
| TENCENT HOLDINGS LTD                          | 98,200    | 496.600 | 48,766,120.000 |  |
| PING AN INSURANCE<br>GROUP CO-H               | 172,500   | 67.300  | 11,609,250.000 |  |
| BEIJING ENTERPRISES<br>WATER GROUP LTD        | 302,000   | 4.590   | 1,386,180.000  |  |
| GOME ELECTRICAL<br>APPLIANCES HOLDINGS<br>LTD | 1,220,240 | 1.390   | 1,696,133.600  |  |
| AIR CHINA / HONG<br>KONG                      | 168,000   | 5.290   | 888,720.000    |  |
| ZTE CORP                                      | 50,240    | 15.260  | 766,662.400    |  |



|   |           |        |                |  |
|---|-----------|--------|----------------|--|
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD            | 340,000   | 2.600  | 884,000.000    |  |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD               | 331,000   | 22.200 | 7,348,200.000  |  |
| COSCO HOLDINGS                            | 304,000   | 3.420  | 1,039,680.000  |  |
| BANK OF COMMUNICATIONS                    | 851,205   | 5.200  | 4,426,266.000  |  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD | 196,000   | 14.320 | 2,806,720.000  |  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC             | 67,000    | 36.300 | 2,432,100.000  |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK                   | 7,062,530 | 5.580  | 39,408,917.400 |  |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD | 60,000    | 27.300 | 1,638,000.000  |  |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H               | 286,000   | 11.640 | 3,329,040.000  |  |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD               | 104,000   | 7.910  | 822,640.000    |  |
| WUMART STORES INC                         | 51,000    | 12.020 | 613,020.000    |  |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD           | 190,000   | 6.530  | 1,240,700.000  |  |
| CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL              | 298,000   | 7.650  | 2,279,700.000  |  |
| GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD             | 69,000    | 11.080 | 764,520.000    |  |
| BANK OF CHINA LTD                         | 7,275,200 | 3.440  | 25,026,688.000 |  |
| SHUI ON LAND LTD                          | 345,600   | 2.350  | 812,160.000    |  |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD              | 151,500   | 18.100 | 2,742,150.000  |  |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD              | 60,000    | 11.800 | 708,000.000    |  |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD           | 102,000   | 11.120 | 1,134,240.000  |  |
| CHINA BLUECHEMICAL LTD                    | 184,000   | 4.660  | 857,440.000    |  |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD               | 462,470   | 14.960 | 6,918,551.200  |  |
| IND & COMM BK OF CHINA - H                | 6,980,235 | 4.950  | 34,552,163.250 |  |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES             | 297,600   | 4.470  | 1,330,272.000  |  |
| CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD  | 417,000   | 5.800  | 2,418,600.000  |  |
| CHINA COAL ENERGY CO                      | 308,000   | 4.210  | 1,296,680.000  |  |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD        | 27,000    | 17.400 | 469,800.000    |  |

|  |         |        |               |  |
|--|---------|--------|---------------|--|
| ZHUZHOU CSR TIMES<br>ELECTRIC CO LTD       | 46,000  | 25.900 | 1,191,400.000 |  |
| INTIME RETAIL GROUP<br>CO LTD              | 120,000 | 8.050  | 966,000.000   |  |
| HAIER ELECTRONICS<br>GROUP CO LTD          | 82,000  | 22.450 | 1,840,900.000 |  |
| CHINA AGRI-<br>INDUSTRIES HOLDINGS<br>LTD  | 215,800 | 3.650  | 787,670.000   |  |
| COUNTRY GARDEN<br>HOLDINGS CO LTD          | 459,509 | 4.660  | 2,141,311.940 |  |
| CHINA CITIC BANK-H                         | 629,800 | 3.970  | 2,500,306.000 |  |
| BELLE INTERNATIONAL<br>HOLDINGS LTD        | 435,000 | 9.610  | 4,180,350.000 |  |
| ANTA SPORTS PRODUCTS<br>LTD                | 78,000  | 11.000 | 858,000.000   |  |
| FOSUN INTERNATIONAL                        | 117,500 | 7.640  | 897,700.000   |  |
| FRANSHION PROPERTIES<br>CHINA LTD          | 402,000 | 2.630  | 1,057,260.000 |  |
| SINO-OCEAN LAND<br>HOLDINGS LTD            | 287,000 | 4.780  | 1,371,860.000 |  |
| SOHO CHINA LTD                             | 154,000 | 6.350  | 977,900.000   |  |
| GCL POLY ENERGY<br>HOLDINGS LTD            | 839,000 | 2.780  | 2,332,420.000 |  |
| CHINA RAILWAY GROUP<br>LTD                 | 396,000 | 3.700  | 1,465,200.000 |  |
| UNI-PRESIDENT CHINA<br>HOLDINGS LTD        | 105,000 | 7.540  | 791,700.000   |  |
| CHINA RAILWAY<br>CONSTRUCTION CORP         | 202,000 | 6.970  | 1,407,940.000 |  |
| WANT WANT CHINA<br>HOLDINGS LTD            | 573,000 | 10.780 | 6,176,940.000 |  |
| CHINA PACIFIC<br>INSURANCE GROUP CO<br>LTD | 263,800 | 28.100 | 7,412,780.000 |  |
| EVERGRANDE REAL<br>ESTATE GROUP LTD        | 662,000 | 2.860  | 1,893,320.000 |  |
| CSR CORP LTD - H                           | 227,000 | 6.040  | 1,371,080.000 |  |
| SUN ART RETAIL GROUP<br>LTD                | 230,500 | 11.260 | 2,595,430.000 |  |
| BBMG CORP                                  | 131,000 | 5.880  | 770,280.000   |  |
| SINOPHARM GROUP CO                         | 97,200  | 22.750 | 2,211,300.000 |  |
| CHINA RESOURCES<br>CEMENT                  | 258,000 | 5.040  | 1,300,320.000 |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE<br>GROUP CO LTD       | 229,805 | 7.940  | 1,824,651.700 |  |
| YINGDE GASES                               | 83,000  | 7.680  | 637,440.000   |  |
| CHONGQING RURAL<br>COMMERCIAL BANK         | 139,000 | 3.510  | 487,890.000   |  |

|       |   |            |         |                                    |  |
|-------|---|------------|---------|------------------------------------|--|
|       | CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP                       | 243,000    | 9.590   | 2,330,370.000                      |  |
|       | SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD               | 54,500     | 18.120  | 987,540.000                        |  |
|       | SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD              | 198,000    | 7.910   | 1,566,180.000                      |  |
|       | BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDINGS LTD                   | 15,500     | 71.550  | 1,109,025.000                      |  |
|       | ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | 44,280     | 7.040   | 311,731.200                        |  |
|       | LONGFOR PROPERTIES CO LTD                             | 135,500    | 11.300  | 1,531,150.000                      |  |
|       | NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD                       | 59,200     | 24.650  | 1,459,280.000                      |  |
|       | CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD                       | 484,900    | 8.080   | 3,917,992.000                      |  |
|       | AGRICULTURAL BANK OF CHINA                            | 1,998,000  | 3.600   | 7,192,800.000                      |  |
|       | ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD                         | 49,500     | 11.540  | 571,230.000                        |  |
|       | FAR EAST HORIZON LTD                                  | 190,000    | 6.140   | 1,166,600.000                      |  |
|       | CITIC SECURITIES CO LTD                               | 109,000    | 18.600  | 2,027,400.000                      |  |
|       | HAITONG SECURITIES CO LTD                             | 126,000    | 12.100  | 1,524,600.000                      |  |
|       | CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD    | 74,400     | 18.700  | 1,391,280.000                      |  |
|       | PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD              | 405,000    | 3.580   | 1,449,900.000                      |  |
|       | SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD                      | 82,500     | 10.900  | 899,250.000                        |  |
|       | HANERGY SOLAR GROUP LTD                               | 1,056,000  | 1.200   | 1,267,200.000                      |  |
| 香港・ドル | 小計  | 61,643,655 |         | 541,017,286.050<br>(7,206,350,250) |  |
| 台湾・ドル | ACER INC  | 203,069    | 18.450  | 3,746,623.050                      |  |
|       | ASUSTEK COMPUTER INC                                  | 61,554     | 289.000 | 17,789,106.000                     |  |
|       | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP                            | 48,616     | 79.500  | 3,864,972.000                      |  |
|       | ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC                | 634,729    | 27.450  | 17,423,311.050                     |  |
|       | ASIA CEMENT CORP                                      | 235,891    | 37.300  | 8,798,734.300                      |  |
|       | TAIWAN BUSINESS BANK                                  | 261,498    | 9.180   | 2,400,551.640                      |  |

|   |           |         |                |  |
|---|-----------|---------|----------------|--|
| FORMOSA<br>INTERNATIONAL HOTELS<br>CORP         | 1,914     | 335.000 | 641,190.000    |  |
| TAIWAN FERTILIZER CO<br>LTD                     | 85,000    | 65.500  | 5,567,500.000  |  |
| VANGUARD<br>INTERNATIONAL<br>SEMICONDUCTOR CORP | 78,000    | 34.350  | 2,679,300.000  |  |
| UNIMICRON TECHNOLOGY<br>CORP                    | 138,210   | 23.950  | 3,310,129.500  |  |
| CHICONY ELECTRONICS<br>CO LTD                   | 51,596    | 77.000  | 3,972,892.000  |  |
| QUANTA COMPUTER INC                             | 249,858   | 72.100  | 18,014,761.800 |  |
| HIGHWEALTH<br>CONSTRUCTION CORP                 | 16,600    | 60.500  | 1,004,300.000  |  |
| CHENG UEI PRECISION<br>INDUSTRY CO LTD          | 42,286    | 60.900  | 2,575,217.400  |  |
| EVA AIRWAYS CORP                                | 158,227   | 16.600  | 2,626,568.200  |  |
| CATCHER TECHNOLOGY<br>CO LTD                    | 61,760    | 204.000 | 12,599,040.000 |  |
| CHANG HWA COMMERCIAL<br>BANK                    | 446,357   | 18.500  | 8,257,604.500  |  |
| CHINA AIRLINES                                  | 232,156   | 10.800  | 2,507,284.800  |  |
| CHENG SHIN RUBBER<br>INDUSTRY CO                | 169,169   | 77.700  | 13,144,431.300 |  |
| CHINA STEEL CORP                                | 1,104,155 | 26.250  | 28,984,068.750 |  |
| CHINA MOTORS CO                                 | 15,000    | 29.000  | 435,000.000    |  |
| CHINA LIFE INSURANCE<br>CO LTD/TAIWAN           | 238,344   | 31.350  | 7,472,084.400  |  |
| ADVANTECH CO LTD                                | 32,251    | 201.000 | 6,482,451.000  |  |
| FARGLORY LAND<br>DEVELOPMENT CO LTD             | 23,460    | 49.800  | 1,168,308.000  |  |
| CLEVO CO  | 35,424    | 64.100  | 2,270,678.400  |  |
| CHINA PETROCHEMICAL<br>DEVELOPMENT CORP         | 93,200    | 13.800  | 1,286,160.000  |  |
| COMPAL ELECTRONICS<br>INC                       | 306,304   | 22.500  | 6,891,840.000  |  |
| CTCI CORP                                       | 39,000    | 44.700  | 1,743,300.000  |  |
| DELTA ELECTRONICS<br>INC                        | 177,448   | 165.500 | 29,367,644.000 |  |
| CHUNGHWA TELECOM CO<br>LTD                      | 372,327   | 92.000  | 34,254,084.000 |  |
| AU OPTRONICS CORP                               | 873,194   | 9.550   | 8,339,002.700  |  |
| TAIWAN MOBILE CO LTD                            | 160,800   | 94.900  | 15,259,920.000 |  |
| EVERGREEN MARINE<br>CORP                        | 206,399   | 17.750  | 3,663,582.250  |  |
| FAR EASTERN<br>DEPARTMENT STORES CO<br>LTD      | 108,781   | 28.450  | 3,094,819.450  |  |

|                                       |           |           |                |  |
|---------------------------------------|-----------|-----------|----------------|--|
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP          | 323,807   | 33.800    | 10,944,676.600 |  |
| FENG HSIN IRON & STEEL CO             | 39,150    | 54.000    | 2,114,100.000  |  |
| ECLAT TEXTILE CO LTD                  | 16,000    | 330.000   | 5,280,000.000  |  |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD          | 58,285    | 130.000   | 7,577,050.000  |  |
| FORMOSA PLASTICS CORP                 | 400,633   | 79.000    | 31,650,007.000 |  |
| FORMOSA TAFFETA CO LTD                | 89,000    | 33.800    | 3,008,200.000  |  |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO          | 303,594   | 81.600    | 24,773,270.400 |  |
| TRANSCEND INFORMATION INC             | 22,897    | 88.200    | 2,019,515.400  |  |
| EPISTAR CORP                          | 90,149    | 61.500    | 5,544,163.500  |  |
| GIANT MANUFACTURING                   | 32,151    | 195.000   | 6,269,445.000  |  |
| MEDIATEK INC                          | 118,570   | 415.500   | 49,265,835.000 |  |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD        | 676,936   | 43.350    | 29,345,175.600 |  |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD     | 483,782   | 17.400    | 8,417,806.800  |  |
| HOTAI MOTOR CO LTD                    | 23,000    | 377.000   | 8,671,000.000  |  |
| FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD | 180,000   | 62.000    | 11,160,000.000 |  |
| SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD              | 29,088    | 141.000   | 4,101,408.000  |  |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD       | 893,600   | 17.350    | 15,503,960.000 |  |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO           | 752,067   | 47.400    | 35,647,975.800 |  |
| CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING          | 1,449,403 | 9.200     | 13,334,507.600 |  |
| E. SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD       | 422,026   | 19.350    | 8,166,203.100  |  |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY            | 1,083,769 | 81.800    | 88,652,304.200 |  |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD         | 939,075   | 24.650    | 23,148,198.750 |  |
| LARGAN PRECISION CO LTD               | 9,220     | 1,150.000 | 10,603,000.000 |  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD     | 462,526   | 14.600    | 6,752,879.600  |  |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO        | 460,213   | 10.400    | 4,786,215.200  |  |
| INVENTEC CO LTD                       | 211,005   | 26.450    | 5,581,082.250  |  |
| LCY CHEMICAL CORP                     | 30,250    | 40.700    | 1,231,175.000  |  |
| HTC CORPORATION                       | 66,832    | 131.000   | 8,754,992.000  |  |

|                                      |           |         |                 |  |
|--------------------------------------|-----------|---------|-----------------|--|
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP              | 192,014   | 46.400  | 8,909,449.600   |  |
| RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP        | 43,496    | 125.000 | 5,437,000.000   |  |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD    | 667,967   | 14.450  | 9,652,123.150   |  |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD        | 1,255,943 | 20.050  | 25,181,657.150  |  |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD       | 709,975   | 18.350  | 13,028,041.250  |  |
| MERIDA INDUSTRY CO LTD               | 19,000    | 212.000 | 4,028,000.000   |  |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC             | 82,560    | 46.100  | 3,806,016.000   |  |
| NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD          | 76,119    | 36.650  | 2,789,761.350   |  |
| NAN YA PLASTICS CORP                 | 458,828   | 67.400  | 30,925,007.200  |  |
| WISTRON CORP                         | 240,481   | 25.300  | 6,084,169.300   |  |
| KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP  | 31,020    | 97.600  | 3,027,552.000   |  |
| POU CHEN CORP                        | 130,990   | 42.500  | 5,567,075.000   |  |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP       | 453,841   | 52.200  | 23,690,500.200  |  |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP           | 62,392    | 197.000 | 12,291,224.000  |  |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP           | 113,480   | 83.100  | 9,430,188.000   |  |
| PHISON ELECTRONICS CORP              | 14,658    | 192.500 | 2,821,665.000   |  |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD           | 45,569    | 53.600  | 2,442,498.400   |  |
| RUENTEX INDUSTRIES LTD               | 52,715    | 75.000  | 3,953,625.000   |  |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD            | 84,886    | 68.200  | 5,789,225.200   |  |
| SILICONWARE PRECISION INDS           | 314,743   | 37.500  | 11,802,862.500  |  |
| STANDARD FOODS CORP                  | 14,628    | 90.500  | 1,323,834.000   |  |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP | 106,666   | 48.350  | 5,157,301.100   |  |
| TAIWAN CEMENT CORP                   | 330,874   | 43.800  | 14,492,281.200  |  |
| TAIWAN GLASS INDUSTRIAL CORP         | 61,301    | 33.100  | 2,029,063.100   |  |
| TSRC CORP                            | 67,790    | 45.000  | 3,050,550.000   |  |
| TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD   | 143,000   | 33.400  | 4,776,200.000   |  |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR                 | 2,363,083 | 103.000 | 243,397,549.000 |  |
| U-MING MARINE TRANSPORT CORP         | 22,000    | 52.500  | 1,155,000.000   |  |

|           |  |            |         |                                      |  |
|-----------|--|------------|---------|--------------------------------------|--|
|           | UNITED<br>MICROELECTRONICS<br>CORP         | 1,109,525  | 12.650  | 14,035,491.250                       |  |
|           | WAN HAI LINES LTD                          | 122,587    | 15.300  | 1,875,581.100                        |  |
|           | WALSIN LIHWA CORP                          | 378,000    | 9.610   | 3,632,580.000                        |  |
|           | YANG MING MARINE<br>TRANSPORT              | 86,668     | 13.800  | 1,196,018.400                        |  |
|           | YULON MOTOR CO                             | 93,149     | 54.400  | 5,067,305.600                        |  |
|           | INNOLUX CORPORATION                        | 571,410    | 11.350  | 6,485,503.500                        |  |
|           | WPG HOLDINGS CO LTD                        | 111,526    | 35.250  | 3,931,291.500                        |  |
|           | HIWIN TECHNOLOGIES<br>CORP                 | 18,936     | 252.000 | 4,771,872.000                        |  |
|           | HERMES MICROVISION<br>INC                  | 3,000      | 908.000 | 2,724,000.000                        |  |
|           | MSTAR SEMICONDUCTOR<br>INC                 | 15,035     | 330.500 | 4,969,067.500                        |  |
|           | PEGATRON CORP                              | 122,554    | 39.050  | 4,785,733.700                        |  |
|           | CHAILEASE HOLDING CO<br>LTD                | 71,500     | 79.000  | 5,648,500.000                        |  |
|           | SCINOPHARM TAIWAN<br>LTD                   | 13,520     | 89.300  | 1,207,336.000                        |  |
|           | TPK HOLDING CO LTD                         | 24,494     | 172.500 | 4,225,215.000                        |  |
|           | ASIA PACIFIC TELECOM<br>CO LTD             | 141,000    | 15.500  | 2,185,500.000                        |  |
|           | ZHEN DING TECHNOLOGY<br>HOLDING LTD        | 14,385     | 77.300  | 1,111,960.500                        |  |
|           | TAIWAN COOPERATIVE<br>FINANCIAL HOLDING    | 420,666    | 16.350  | 6,877,889.100                        |  |
| 台湾・ドル 小計  |  | 28,107,579 |         | 1,254,710,871.140<br>(4,316,205,397) |  |
| 南アフリカ・ランド | AFRICAN BANK<br>INVESTMENTS LTD            | 112,536    | 11.340  | 1,276,158.240                        |  |
|           | AFRICAN RAINBOW<br>MINERALS LTD            | 11,263     | 195.340 | 2,200,114.420                        |  |
|           | BARLOWORLD LTD                             | 23,384     | 97.420  | 2,278,069.280                        |  |
|           | BIDVEST GROUP LTD                          | 27,457     | 269.980 | 7,412,840.860                        |  |
|           | TRUWORTHS<br>INTERNATIONAL LTD             | 42,285     | 78.600  | 3,323,601.000                        |  |
|           | STEINHOFF<br>INTERNATIONAL<br>HOLDINGS LTD | 114,872    | 47.250  | 5,427,702.000                        |  |
|           | ASSORE LTD                                 | 3,722      | 343.000 | 1,276,646.000                        |  |
|           | DISCOVERY LTD                              | 27,542     | 82.300  | 2,266,706.600                        |  |
|           | REDEFINE PROPERTIES<br>LTD                 | 207,686    | 9.570   | 1,987,555.020                        |  |
|           | MASSMART HOLDINGS<br>LTD                   | 10,432     | 124.430 | 1,298,053.760                        |  |
|           | GOLD FIELDS LTD                            | 63,646     | 33.410  | 2,126,412.860                        |  |
|           | REMGRO LTD                                 | 50,492     | 208.960 | 10,550,808.320                       |  |

|                               |         |           |                |  |
|-------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| THE FOSCHINI GROUP LTD        | 19,461  | 96.300    | 1,874,094.300  |  |
| NORTHAM PLATINUM LTD          | 35,773  | 42.500    | 1,520,352.500  |  |
| MMI HOLDINGS LTD              | 113,466 | 26.100    | 2,961,462.600  |  |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD    | 173,761 | 24.200    | 4,205,016.200  |  |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD    | 40,073  | 27.750    | 1,112,025.750  |  |
| EXXARO RESOURCES LTD          | 12,410  | 148.090   | 1,837,796.900  |  |
| LIBERTY HOLDINGS LTD          | 7,868   | 125.200   | 985,073.600    |  |
| MTN GROUP LTD                 | 162,066 | 215.000   | 34,844,190.000 |  |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD         | 33,492  | 130.150   | 4,358,983.800  |  |
| FIRSTRAND LTD                 | 315,942 | 34.320    | 10,843,129.440 |  |
| NASPERS LTD                   | 37,891  | 1,093.780 | 41,444,417.980 |  |
| NEDBANK GROUP LTD             | 16,600  | 207.170   | 3,439,022.000  |  |
| NETCARE LTD                   | 95,948  | 25.800    | 2,475,458.400  |  |
| PICK'N PAY STORES LTD         | 27,363  | 51.550    | 1,410,562.650  |  |
| REUNERT LTD                   | 16,315  | 66.400    | 1,083,316.000  |  |
| RMB HOLDINGS LTD              | 78,470  | 47.950    | 3,762,636.500  |  |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD   | 6,114   | 380.010   | 2,323,381.140  |  |
| SAPPI LTD                     | 65,224  | 32.850    | 2,142,608.400  |  |
| SASOL LTD                     | 53,966  | 520.000   | 28,062,320.000 |  |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD         | 40,558  | 160.700   | 6,517,670.600  |  |
| MR PRICE GROUP LTD            | 23,912  | 165.850   | 3,965,805.200  |  |
| STANDARD BANK GROUP LTD       | 117,987 | 130.250   | 15,367,806.750 |  |
| SPAR GROUP LTD/THE            | 19,656  | 126.050   | 2,477,638.800  |  |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD       | 77,570  | 74.590    | 5,785,946.300  |  |
| IMPERIAL HOLDINGS LTD         | 19,114  | 203.810   | 3,895,624.340  |  |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | 31,288  | 265.000   | 8,291,320.000  |  |
| BARCLAYS AFRICA GROUP LTD     | 29,034  | 131.600   | 3,820,874.400  |  |
| TIGER BRANDS LTD              | 14,014  | 264.510   | 3,706,843.140  |  |
| NAMPAK LTD                    | 60,915  | 39.330    | 2,395,786.950  |  |
| SANLAM LTD                    | 168,975 | 53.700    | 9,073,957.500  |  |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD  | 26,330  | 75.980    | 2,000,553.400  |  |
| INVESTEC LTD                  | 29,615  | 77.280    | 2,288,647.200  |  |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD  | 55,032  | 116.150   | 6,391,966.800  |  |
| KUMBA IRON ORE LTD            | 7,833   | 422.820   | 3,311,949.060  |  |
| PPC LTD                       | 69,881  | 29.400    | 2,054,501.400  |  |



|           |                                       |             |         |                                    |  |
|-----------|---------------------------------------|-------------|---------|------------------------------------|--|
|           | LIFE HEALTHCARE<br>GROUP HOLDINGS LTD | 103,090     | 40.410  | 4,165,866.900                      |  |
|           | RMI HOLDINGS                          | 60,982      | 26.700  | 1,628,219.400                      |  |
|           | VODACOM GROUP PTY<br>LTD              | 34,684      | 131.200 | 4,550,540.800                      |  |
| 南アフリカ・ランド | 小計                                    | 2,997,990   |         | 283,802,035.460<br>(2,710,309,439) |  |
| 合計        |                                       | 151,807,031 |         | 36,394,271,057<br>(36,394,271,057) |  |

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

| 種 類      | 通 貨     | 銘 柄                                     | 券面総額          | 評価額                             | 備考                            |
|----------|---------|---|---------------|---------------------------------|-------------------------------|
| 投資信託受益証券 | メキシコ・ペソ | CEMEX SAB DE CV                         | 1,148,621.000 | 18,171,184.220                  |                               |
|          |         | FOMENTO ECONOMICO<br>MEXICANO SAB DE CV | 188,500.000   | 23,624,705.000                  |                               |
|          | メキシコ・ペソ | 小計                                      | 1,337,121.000 | 41,795,889.220<br>(330,187,525) |                               |
| 投資信託受益証券 | 合計      |   | 1,337,121     | 330,187,525<br>(330,187,525)    |                               |
| 投資証券     | トルコ・リラ  | EMLAK KONUT<br>GAYRIMENKUL YATIRIM      | 219,394.000   | 476,084.980                     |                               |
|          |         | トルコ・リラ                                  | 小計            | 219,394.000                     | 476,084.980<br>(22,566,428)   |
|          | メキシコ・ペソ | FIBRA UNO<br>ADMINISTRACION SA          | 145,400.000   | 6,433,950.000                   |                               |
|          |         | メキシコ・ペソ                                 | 小計            | 145,400.000                     | 6,433,950.000<br>(50,828,205) |
| 投資証券     | 合計      |   | 364,794       | 73,394,633<br>(73,394,633)      |                               |
| 合計       |         |   |               | 403,582,158<br>(403,582,158)    |                               |

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、内数で表示してあります。

## 3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨          | 銘柄数                                     | 組入株式<br>時価比率      | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率    | 有価証券の合計<br>金額に対する比率 |
|-------------|---|-------------------|------------------------|-------------------|---------------------|
| アメリカ・ドル     | 株式 48銘柄                                 | 9.59%             | -%                     | -%                | 9.89%               |
| インド・ルピー     | 株式 71銘柄                                 | 5.75%             | -%                     | -%                | 5.94%               |
| インドネシア・ルピア  | 株式 30銘柄                                 | 2.31%             | -%                     | -%                | 2.39%               |
| タイ・バーツ      | 株式 30銘柄                                 | 2.13%             | -%                     | -%                | 2.20%               |
| チェコ・コルナ     | 株式 3銘柄                                  | 0.24%             | -%                     | -%                | 0.25%               |
| トルコ・リラ      | 株式 24銘柄<br>投資証券 1銘柄                     | 1.43%<br>-%       | -%<br>-%               | -%<br>0.06%       | 1.53%               |
| ハンガリー・フォリント | 株式 3銘柄                                  | 0.27%             | -%                     | -%                | 0.28%               |
| フィリピン・ペソ    | 株式 19銘柄                                 | 0.88%             | -%                     | -%                | 0.90%               |
| ブラジル・レアル    | 株式 75銘柄                                 | 10.13%            | -%                     | -%                | 10.45%              |
| ポーランド・ズロチ   | 株式 22銘柄                                 | 1.66%             | -%                     | -%                | 1.71%               |
| マレーシア・リンギット | 株式 44銘柄                                 | 3.79%             | -%                     | -%                | 3.91%               |
| メキシコ・ペソ     | 株式 26銘柄<br>投資信託<br>受益証券 2銘柄<br>投資証券 1銘柄 | 4.30%<br>-%<br>-% | -%<br>0.87%<br>-%      | -%<br>-%<br>0.13% | 5.47%               |
| ユーロ         | 株式 10銘柄                                 | 0.52%             | -%                     | -%                | 0.53%               |
| 韓国・ウォン      | 株式 105銘柄                                | 15.37%            | -%                     | -%                | 15.87%              |
| 香港・ドル       | 株式 137銘柄                                | 18.98%            | -%                     | -%                | 19.58%              |
| 台湾・ドル       | 株式 107銘柄                                | 11.37%            | -%                     | -%                | 11.73%              |
| 南アフリカ・ランド   | 株式 50銘柄                                 | 7.14%             | -%                     | -%                | 7.37%               |

(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。

## 「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

| 科 目         | 注記<br>番号 | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在   |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部        |          |                |                |
| 流動資産        |          |                |                |
| 預金          |          | 941,248,301    | 935,551,132    |
| コール・ローン     |          | 19,530,549     | 155,668,597    |
| 国債証券        |          | 35,830,887,459 | 33,982,851,042 |
| 派生商品評価勘定    |          | 363            | -              |
| 未収利息        |          | 599,179,050    | 654,823,508    |
| 前払費用        |          | 35,309,531     | 14,320,492     |
| 流動資産合計      |          | 37,426,155,253 | 35,743,214,771 |
| 資産合計        |          | 37,426,155,253 | 35,743,214,771 |
| 負債の部        |          |                |                |
| 流動負債        |          |                |                |
| 派生商品評価勘定    |          | 36,508         | -              |
| 未払解約金       |          | 9,691,000      | 4,583,000      |
| 流動負債合計      |          | 9,727,508      | 4,583,000      |
| 負債合計        |          | 9,727,508      | 4,583,000      |
| 純資産の部       |          |                |                |
| 元本等         |          |                |                |
| 元本          | 1        | 28,309,027,227 | 25,243,130,380 |
| 剰余金         |          |                |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 9,107,400,518  | 10,495,501,391 |
| 元本等合計       |          | 37,416,427,745 | 35,738,631,771 |
| 純資産合計       |          | 37,416,427,745 | 35,738,631,771 |
| 負債純資産合計     |          | 37,426,155,253 | 35,743,214,771 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>               |

## （貸借対照表に関する注記）

| 項目                                      | 平成25年1月11日現在    | 平成26年1月14日現在    |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 31,076,824,958円 | 28,309,027,227円 |
| 同期中追加設定元本額                              | 7,572,229,978円  | 3,977,475,657円  |
| 同期中一部解約元本額                              | 10,340,027,709円 | 7,043,372,504円  |
| 元本の内訳<br>ファンド名                          |                 |                 |
| マネックス資産設計                               | 26,438,145円     | 33,290,175円     |
| ファンド エボリューション                           |                 |                 |
| D I A M D C 8 資産<br>バランスファンド<br>(新興国10) | 20,941円         | 4,487,571円      |
| D I A M D C 8 資産<br>バランスファンド<br>(新興国20) | 42,705円         | 8,312,309円      |
| D I A M D C 8 資産<br>バランスファンド<br>(新興国30) | 66,084円         | 21,137,131円     |
| 投資のソムリエ                                 | 8,245,126円      | 111,323,605円    |
| クルーズコントロール                              | 3,610,106円      | 53,525,426円     |
| 投資のソムリエ< D C<br>年金>                     | - 円             | 1,280,751円      |
| D I A M 8 資産バラ<br>ンスファンドN< D C<br>年金>   | - 円             | 358,267円        |
| グローバル債券ファン<br>ド(適格機関投資家限<br>定)          | 355,245,944円    | 321,885,428円    |

|   |                 |                 |
|---|-----------------|-----------------|
| 為替フルヘッジ型エ<br>マージング債券ファン<br>ド（適格機関投資家限<br>定）                 | 3,075,966,234円  | 835,800,885円    |
| エマージング債券パッ<br>シブファンドV A（適<br>格機関投資家専用）                      | 5,394,845,780円  | 5,153,890,667円  |
| D I A M世界アセット<br>バランスファンド2 V<br>A（適格機関投資家限<br>定）            | 12,023,062,130円 | 11,458,441,241円 |
| D I A M世界アセット<br>バランスファンド3 V<br>A（適格機関投資家限<br>定）            | 7,421,484,032円  | 7,073,097,903円  |
| D I A Mグローバル・<br>リスクファクター・パ<br>リティ戦略ファンド<br>（適格機関投資家限<br>定） | - 円             | 166,299,021円    |
| 計   | 28,309,027,227円 | 25,243,130,380円 |
| 2 . 受益権の総数  | 28,309,027,227口 | 25,243,130,380口 |

## (金融商品に関する注記)

## 1 . 金融商品の状況に関する事項

| 項目               | 自 平成24年1月12日<br>至 平成25年1月11日  | 自 平成25年1月12日<br>至 平成26年1月14日 |
|------------------|---|------------------------------|
| 1 . 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左                           |

|                           |   |    |
|---------------------------|---|----|
| 2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <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、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。</p> | 同左 |
| 3 . 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。</p>   | 同左 |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                         | 平成25年1月11日現在   | 平成26年1月14日現在  |
|----------------------------|--|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   | 同左  |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>(1)有価証券<br/>「（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<br/>「（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<br/>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> | <p>(1)有価証券<br/>「（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<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品<br/>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> |
| 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。         | 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。   |



## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類   | 平成25年1月11日現在              | 平成26年1月14日現在              |
|------|---------------------------|---------------------------|
|      | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） | 当期の<br>損益に含まれた<br>評価差額（円） |
| 国債証券 | 1,692,481,219             | 4,187,953,904             |
| 合計   | 1,692,481,219             | 4,187,953,904             |

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成24年4月19日から平成25年1月11日まで及び平成25年4月19日から平成26年1月14日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

| 種類        | 平成25年1月11日 現在 |           |           |             | 平成26年1月14日 現在 |           |           |             |
|-----------|---------------|-----------|-----------|-------------|---------------|-----------|-----------|-------------|
|           | 契約額等<br>（円）   | うち<br>1年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） | 契約額等<br>（円）   | うち<br>1年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |
|           |               |           |           |             |               |           |           |             |
| 市場取引以外の取引 |               |           |           |             |               |           |           |             |
| 為替予約取引    |               |           |           |             |               |           |           |             |
| 売 建       | 8,081,965     | -         | 8,118,110 | 36,145      | -             | -         | -         | -           |
| アメリカ・ドル   | 8,081,965     | -         | 8,118,110 | 36,145      | -             | -         | -         | -           |
| 合計        | 8,081,965     | -         | 8,118,110 | 36,145      | -             | -         | -         | -           |

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

|                           | 平成25年1月11日現在         | 平成26年1月14日現在         |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.3217円<br>(13,217円) | 1.4158円<br>(14,158円) |

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

| 種 類                    | 通 貨           | 銘 柄                        | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|------------------------|---------------|----------------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券                   | アメリカ・ドル       | BRAZIL 10.125 05/15/27     | 1,800,000.000 | 2,625,480.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 11.0 08/17/40       | 1,800,000.000 | 2,052,000.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 12.25 03/06/30      | 800,000.000   | 1,352,800.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 2.625 01/05/23      | 2,500,000.000 | 2,137,500.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 4.875 01/22/21      | 3,900,000.000 | 4,085,250.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 5.625 01/07/41      | 3,600,000.000 | 3,477,600.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 5.875 01/15/19      | 2,100,000.000 | 2,352,000.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 6.0 01/17/17        | 2,400,000.000 | 2,667,600.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 7.125 01/20/37      | 4,000,000.000 | 4,530,000.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 7.875 03/07/15      | 2,100,000.000 | 2,260,650.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 8.25 01/20/34       | 2,900,000.000 | 3,619,200.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 8.75 02/04/25       | 2,000,000.000 | 2,632,000.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 8.875 04/15/24      | 2,500,000.000 | 3,298,500.000 |    |
|                        |               | BRAZIL 8.875 10/14/19      | 2,200,000.000 | 2,808,300.000 |    |
|                        |               | COLOMBIA 11.75<br>02/25/20 | 900,000.000   | 1,281,555.000 |    |
|                        |               | COLOMBIA 2.625<br>03/15/23 | 1,100,000.000 | 965,250.000   |    |
|                        |               | COLOMBIA 4.375<br>07/12/21 | 3,400,000.000 | 3,497,750.000 |    |
|                        |               | COLOMBIA 6.125<br>01/18/41 | 4,000,000.000 | 4,330,000.000 |    |
|                        |               | COLOMBIA 7.375<br>01/27/17 | 2,650,000.000 | 3,087,250.000 |    |
|                        |               | COLOMBIA 7.375<br>03/18/19 | 3,600,000.000 | 4,338,000.000 |    |
|                        |               | COLOMBIA 7.375<br>09/18/37 | 2,900,000.000 | 3,588,750.000 |    |
|                        |               | COLOMBIA 8.125<br>05/21/24 | 1,800,000.000 | 2,284,920.000 |    |
|                        |               | CROATIA 5.5 04/04/23       | 1,700,000.000 | 1,687,250.000 |    |
|                        |               | CROATIA 6.25 04/27/17      | 1,900,000.000 | 2,048,200.000 |    |
|                        |               | CROATIA 6.375 03/24/21     | 1,700,000.000 | 1,791,800.000 |    |
|                        |               | CROATIA 6.625 07/14/20     | 2,000,000.000 | 2,176,900.000 |    |
|                        |               | CROATIA 6.75 11/05/19      | 1,600,000.000 | 1,756,160.000 |    |
| HUNGARY 4.125 02/19/18 | 1,500,000.000 | 1,527,750.000              |               |               |    |

|                                |               |               |  |
|--------------------------------|---------------|---------------|--|
| HUNGARY 5.375 02/21/23         | 2,500,000.000 | 2,512,350.000 |  |
| HUNGARY 6.25 01/29/20          | 2,700,000.000 | 2,949,750.000 |  |
| HUNGARY 6.375 03/29/21         | 3,400,000.000 | 3,715,180.000 |  |
| HUNGARY 7.625 03/29/41         | 1,600,000.000 | 1,824,800.000 |  |
| INDONESIA 11.625<br>03/04/19   | 2,300,000.000 | 3,050,950.000 |  |
| INDONESIA 3.75<br>04/25/22     | 2,300,000.000 | 2,081,500.000 |  |
| INDONESIA 4.875<br>05/05/21    | 2,700,000.000 | 2,659,500.000 |  |
| INDONESIA 5.25<br>01/17/42     | 2,600,000.000 | 2,193,750.000 |  |
| INDONESIA 5.875<br>03/13/20    | 2,200,000.000 | 2,329,140.000 |  |
| INDONESIA 6.625<br>02/17/37    | 1,700,000.000 | 1,693,795.000 |  |
| INDONESIA 6.875<br>01/17/18    | 2,600,000.000 | 2,917,980.000 |  |
| INDONESIA 6.875<br>03/09/17    | 1,250,000.000 | 1,395,375.000 |  |
| INDONESIA 7.25<br>04/20/15     | 1,000,000.000 | 1,067,500.000 |  |
| INDONESIA 7.5 01/15/16         | 1,000,000.000 | 1,102,500.000 |  |
| INDONESIA 7.75<br>01/17/38     | 2,300,000.000 | 2,555,070.000 |  |
| INDONESIA 8.5 10/12/35         | 1,900,000.000 | 2,267,365.000 |  |
| PANAMA 5.2 01/30/20            | 3,200,000.000 | 3,507,200.000 |  |
| PANAMA 6.7 01/26/36            | 4,000,000.000 | 4,488,000.000 |  |
| PANAMA 7.125 01/29/26          | 1,900,000.000 | 2,296,625.000 |  |
| PANAMA 8.875 09/30/27          | 1,800,000.000 | 2,415,510.000 |  |
| PANAMA 9.375 04/01/29          | 1,900,000.000 | 2,633,400.000 |  |
| PERU 5.625 11/18/50            | 2,500,000.000 | 2,534,775.000 |  |
| PERU 6.55 03/14/37             | 2,100,000.000 | 2,450,910.000 |  |
| PERU 7.125 03/30/19            | 1,700,000.000 | 2,069,750.000 |  |
| PERU 7.35 07/21/25             | 3,800,000.000 | 4,806,240.000 |  |
| PERU 8.375 05/03/16            | 1,200,000.000 | 1,378,140.000 |  |
| PERU 8.75 11/21/33             | 4,000,000.000 | 5,722,400.000 |  |
| PHILIPPINES 10.625<br>03/16/25 | 1,800,000.000 | 2,799,000.000 |  |
| PHILIPPINES 4.0<br>01/15/21    | 2,400,000.000 | 2,497,848.000 |  |
| PHILIPPINES 5.0<br>01/13/37    | 1,500,000.000 | 1,560,000.000 |  |
| PHILIPPINES 5.5<br>03/30/26    | 1,900,000.000 | 2,120,875.000 |  |
| PHILIPPINES 6.375<br>01/15/32  | 1,600,000.000 | 1,894,000.000 |  |
| PHILIPPINES 6.375<br>10/23/34  | 3,300,000.000 | 3,935,250.000 |  |

|                                       |                |                |  |
|---------------------------------------|----------------|----------------|--|
| PHILIPPINES 6.5<br>01/20/20           | 1,000,000.000  | 1,188,750.000  |  |
| PHILIPPINES 7.75<br>01/14/31          | 2,700,000.000  | 3,591,000.000  |  |
| PHILIPPINES 8.375<br>06/17/19         | 1,200,000.000  | 1,536,000.000  |  |
| PHILIPPINES 9.375<br>01/18/17         | 500,000.000    | 611,980.000    |  |
| PHILIPPINES 9.5<br>02/02/30           | 2,300,000.000  | 3,473,000.000  |  |
| PHILIPPINES 9.875<br>01/15/19         | 1,500,000.000  | 1,995,000.000  |  |
| ROMANIA 6.75 02/07/22                 | 3,000,000.000  | 3,423,750.000  |  |
| RUSSIA FOREIGN BOND<br>3.625 04/29/15 | 3,700,000.000  | 3,829,685.000  |  |
| RUSSIA FOREIGN BOND<br>5.0 04/29/20   | 5,000,000.000  | 5,381,250.000  |  |
| RUSSIAN FEDERATION<br>03/31/30        | 18,876,000.000 | 22,127,202.240 |  |
| RUSSIAN FEDERATION<br>11.0 07/24/18   | 4,600,000.000  | 6,186,540.000  |  |
| RUSSIAN FEDERATION<br>12.75 06/24/28  | 3,500,000.000  | 5,940,200.000  |  |
| RUSSIAN FEDERATION<br>3.25 04/04/17   | 2,000,000.000  | 2,092,100.000  |  |
| RUSSIAN FEDERATION 4.5<br>04/04/22    | 1,600,000.000  | 1,636,000.000  |  |
| RUSSIAN FEDERATION<br>5.625 04/04/42  | 4,000,000.000  | 4,032,600.000  |  |
| SOUTH AFRICA 4.665<br>01/17/24        | 1,900,000.000  | 1,843,000.000  |  |
| SOUTH AFRICA 5.5<br>03/09/20          | 2,600,000.000  | 2,789,020.000  |  |
| SOUTH AFRICA 5.875<br>05/30/22        | 1,000,000.000  | 1,080,000.000  |  |
| SOUTH AFRICA 6.25<br>03/08/41         | 800,000.000    | 836,000.000    |  |
| SOUTH AFRICA 6.875<br>05/27/19        | 2,300,000.000  | 2,633,500.000  |  |
| TURKEY 11.875 01/15/30                | 1,700,000.000  | 2,589,100.000  |  |
| TURKEY 3.25 03/23/23                  | 2,000,000.000  | 1,689,200.000  |  |
| TURKEY 4.875 04/16/43                 | 1,900,000.000  | 1,505,750.000  |  |
| TURKEY 5.125 03/25/22                 | 1,500,000.000  | 1,457,040.000  |  |
| TURKEY 5.625 03/30/21                 | 2,700,000.000  | 2,765,880.000  |  |
| TURKEY 6.0 01/14/41                   | 3,400,000.000  | 3,120,350.000  |  |
| TURKEY 6.25 09/26/22                  | 2,200,000.000  | 2,304,060.000  |  |
| TURKEY 6.75 04/03/18                  | 2,000,000.000  | 2,196,500.000  |  |
| TURKEY 6.75 05/30/40                  | 2,100,000.000  | 2,113,125.000  |  |
| TURKEY 6.875 03/17/36                 | 2,900,000.000  | 2,958,870.000  |  |
| TURKEY 7.0 03/11/19                   | 2,300,000.000  | 2,538,625.000  |  |

|      |  |                                     |                                     |  |
|------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
|      | TURKEY 7.0 06/05/20                      | 2,300,000.000                       | 2,526,550.000                       |  |
|      | TURKEY 7.0 09/26/16                      | 3,000,000.000                       | 3,304,230.000                       |  |
|      | TURKEY 7.25 03/05/38                     | 1,300,000.000                       | 1,387,100.000                       |  |
|      | TURKEY 7.25 03/15/15                     | 4,000,000.000                       | 4,228,200.000                       |  |
|      | TURKEY 7.375 02/05/25                    | 3,900,000.000                       | 4,299,750.000                       |  |
|      | TURKEY 7.5 07/14/17                      | 2,200,000.000                       | 2,465,650.000                       |  |
|      | TURKEY 7.5 11/07/19                      | 1,800,000.000                       | 2,027,700.000                       |  |
|      | TURKEY 8.0 02/14/34                      | 1,900,000.000                       | 2,185,950.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>11.375 09/15/16 | 3,000,000.000                       | 3,800,700.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>3.625 03/15/22  | 3,400,000.000                       | 3,376,200.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>4.75 03/08/44   | 6,300,000.000                       | 5,733,000.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>5.125 01/15/20  | 2,300,000.000                       | 2,553,000.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>5.625 01/15/17  | 2,300,000.000                       | 2,560,360.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>5.75 10/12/2110 | 3,200,000.000                       | 2,982,400.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>5.95 03/19/19   | 3,200,000.000                       | 3,696,000.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>6.05 01/11/40   | 5,400,000.000                       | 5,894,100.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>6.625 03/03/15  | 2,500,000.000                       | 2,665,000.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>6.75 09/27/34   | 3,900,000.000                       | 4,559,490.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>7.5 04/08/33    | 1,400,000.000                       | 1,773,940.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>8.0 09/24/22    | 900,000.000                         | 1,147,500.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>8.125 12/30/19  | 1,700,000.000                       | 2,269,500.000                       |  |
|      | UNITED MEXICAN STATES<br>8.3 08/15/31    | 1,700,000.000                       | 2,320,500.000                       |  |
|      | アメリカ・ドル 小計                               | 290,376,000.000<br>(30,001,648,320) | 328,908,740.240<br>(33,982,851,042) |  |
| 国債証券 | 合計                                       | 30,001,648,320<br>(30,001,648,320)  | 33,982,851,042<br>(33,982,851,042)  |  |
| 合計   |  | 30,001,648,320<br>(30,001,648,320)  | 33,982,851,042<br>(33,982,851,042)  |  |

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における ( ) 内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における ( ) 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

| 通貨      | 銘柄数        | 組入債券<br>時価比率 | 有価証券の合計金額<br>に対する比率 |
|---------|------------|--------------|---------------------|
| アメリカ・ドル | 国債証券 114銘柄 | 95.09%       | 100%                |

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。



## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成26年1月31日現在

|                |              |
|----------------|--------------|
| 資産総額           | 768,139,716円 |
| 負債総額           | 2,004,998円   |
| 純資産総額（ - ）     | 766,134,718円 |
| 発行済数量          | 510,666,784口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.5003円      |

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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



## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

## グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

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

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 36,865,262,955円 |
| 負債総額           | 81,238,263円     |
| 純資産総額（ - ）     | 36,784,024,692円 |
| 発行済数量          | 42,670,407,050口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.8621円         |

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 34,988,613,548円 |
| 負債総額           | 24,354,000円     |
| 純資産総額（ - ）     | 34,964,259,548円 |
| 発行済数量          | 24,928,985,772口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.4026円         |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### (2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (4)受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

### (5)受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

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

##### 直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

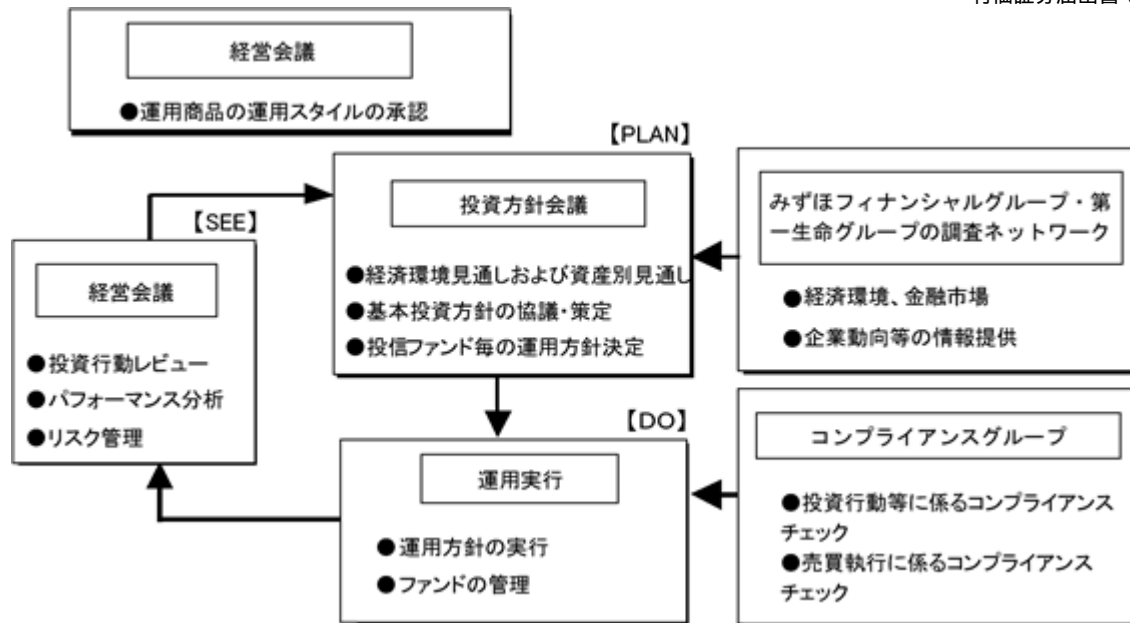
###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に基づく登録を受けて、投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

平成26年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は313本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

| 基本的性格         | 本数  | 純資産総額<br>(単位：円)   |
|---------------|-----|-------------------|
| 単位型株式投資信託     | 9   | 21,961,797,499    |
| 追加型株式投資信託     | 294 | 4,918,644,239,908 |
| 単位型公社債投資信託    | 9   | 89,747,666,936    |
| 追加型公社債投資信託    | 0   | 0                 |
| 証券投資信託以外の投資信託 | 1   | 102,550,316       |
| 合計            | 313 | 5,030,456,254,659 |

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

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

（単位：千円）

|              | 第27期<br>（平成24年3月31日現在） | 第28期<br>（平成25年3月31日現在） |
|--------------|------------------------|------------------------|
| （負債の部）       |                        |                        |
| 流動負債         |                        |                        |
| 預り金          | 132,805                | 571,153                |
| 未払金          | 1,460,128              | 1,547,527              |
| 未払収益分配金      | 670                    | 48                     |
| 未払償還金        | 86,391                 | 84,932                 |
| 未払手数料        | 1,088,348              | 1,195,452              |
| その他未払金       | 284,718                | 267,093                |
| 未払費用         | 2 1,105,512            | 2 1,306,837            |
| 未払法人税等       | 1,195,056              | 1,299,068              |
| 未払消費税等       | 92,354                 | 116,872                |
| 賞与引当金        | 574,646                | 724,974                |
| その他          | -                      | 100,000                |
| 流動負債計        | 4,560,503              | 5,666,434              |
| 固定負債         |                        |                        |
| 退職給付引当金      | 680,768                | 802,603                |
| 役員退職慰労引当金    | 56,690                 | 98,510                 |
| 固定負債計        | 737,458                | 901,113                |
| 負債合計         | 5,297,962              | 6,567,548              |
| （純資産の部）      |                        |                        |
| 株主資本         |                        |                        |
| 資本金          | 2,000,000              | 2,000,000              |
| 資本剰余金        | 2,428,478              | 2,428,478              |
| 資本準備金        | 2,428,478              | 2,428,478              |
| 利益剰余金        | 19,716,594             | 20,898,697             |
| 利益準備金        | 123,293                | 123,293                |
| その他利益剰余金     |                        |                        |
| 別途積立金        | 15,630,000             | 16,330,000             |
| 研究開発積立金      | 300,000                | 300,000                |
| 運用責任準備積立金    | 200,000                | 200,000                |
| 繰越利益剰余金      | 3,463,300              | 3,945,403              |
| 株主資本計        | 24,145,072             | 25,327,175             |
| 評価・換算差額等     |                        |                        |
| その他有価証券評価差額金 | 136,143                | 103,768                |
| 評価・換算差額等計    | 136,143                | 103,768                |
| 純資産合計        | 24,281,215             | 25,430,943             |
| 負債・純資産合計     | 29,579,177             | 31,998,491             |



## （ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

|             | 第27期<br>（ 自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日 ） |            | 第28期<br>（ 自 平成24年4月 1日<br>至 平成25年3月31日 ） |            |
|-------------|--|------------|--|------------|
|             | 営業収益                                     |            |  |            |
| 委託者報酬       | 23,208,602                               |            | 23,374,427                               |            |
| 運用受託報酬      | 4,966,992                                |            | 5,374,163                                |            |
| 投資助言報酬      | 943,057                                  |            | 885,923                                  |            |
| その他営業収益     | 697,063                                  |            | 715,164                                  |            |
| 営業収益計       |  | 29,815,715 |  | 30,349,678 |
| 営業費用        |  |            |  |            |
| 支払手数料       | 10,154,958                               |            | 10,846,568                               |            |
| 広告宣伝費       | 164,286                                  |            | 177,553                                  |            |
| 公告費         | -  |            | 3,769                                    |            |
| 調査費         | 4,590,302                                |            | 4,546,312                                |            |
| 調査費         | 2,888,013                                |            | 3,001,788                                |            |
| 委託調査費       | 1,702,289                                |            | 1,544,523                                |            |
| 委託計算費       | 335,754                                  |            | 341,978                                  |            |
| 営業雑経費       | 496,565                                  |            | 456,677                                  |            |
| 通信費         | 26,941                                   |            | 25,513                                   |            |
| 印刷費         | 399,066                                  |            | 374,775                                  |            |
| 協会費         | 25,014                                   |            | 25,492                                   |            |
| 諸会費         | 41                                       |            | 42                                       |            |
| 支払販売手数料     | 45,500                                   |            | 30,854                                   |            |
| 営業費用計       |  | 15,741,867 |  | 16,372,860 |
| 一般管理費       |  |            |  |            |
| 給料          | 4,630,102                                |            | 4,870,759                                |            |
| 役員報酬        | 245,224                                  |            | 242,014                                  |            |
| 給料・手当       | 3,824,122                                |            | 4,035,751                                |            |
| 賞与          | 560,755                                  |            | 592,994                                  |            |
| 交際費         | 35,987                                   |            | 36,212                                   |            |
| 寄付金         | 3,156                                    |            | 2,693                                    |            |
| 旅費交通費       | 213,642                                  |            | 187,653                                  |            |
| 租税公課        | 84,346                                   |            | 95,064                                   |            |
| 不動産賃借料      | 656,463                                  |            | 675,811                                  |            |
| 退職給付費用      | 164,627                                  |            | 173,065                                  |            |
| 固定資産減価償却費   | 475,556                                  |            | 524,750                                  |            |
| 福利厚生費       | 24,887                                   |            | 26,642                                   |            |
| 修繕費         | 6,721                                    |            | 6,018                                    |            |
| 賞与引当金繰入     | 574,646                                  |            | 724,974                                  |            |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 30,048                                   |            | 47,820                                   |            |
| 役員退職金       | 27,503                                   |            | 7,200                                    |            |
| 機器リース料      | 1,510                                    |            | 35                                       |            |
| 事務委託費       | 323,740                                  |            | 224,066                                  |            |
| 消耗品費        | 58,739                                   |            | 60,044                                   |            |
| 器具備品費       | 2,889                                    |            | 2,065                                    |            |
| 諸経費         | 114,695                                  |            | 159,247                                  |            |

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

（単位：千円）

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

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

( 単位：千円 )

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

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

## 重要な会計方針

| 項目                       | 第28期<br>(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)   |
|--------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法       | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式<br/>：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券<br/>時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法<br/>(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)<br/>時価のないもの：移動平均法による原価法</p>  |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法      | 時価法  |
| 3. デリバティブの評価基準及び評価方法     | 時価法  |
| 4. 固定資産の減価償却の方法          | <p>(1) 有形固定資産<br/>定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産<br/>自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)<br/>法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。<br/>なお、この変更による営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> |
| 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。  |
| 6. 引当金の計上基準              | <p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>                  |
| 7. 消費税等の処理方法             | 税抜方式によっております。  |

## 未適用の会計基準等

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針 平成24年5月17日）

## （1）概要

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

## （2）適用予定日

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

## （3）当該会計基準等の適用による影響

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

## 注記事項

（貸借対照表関係）

## 1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

## 2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第27期(自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 発行済株式の種類 | 当事業年度期首<br>株式数(株) | 当事業年度<br>増加株式数(株) | 当事業年度<br>減少株式数(株) | 当事業年度末<br>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<br>種類 | 配当金の<br>総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-----------|--------------------|---------------------|------------|------------|
| 平成23年6月28日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式  | 2,208,000          | 92,000              | 平成23年3月31日 | 平成23年6月29日 |



## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

| 決議                   | 株式の種類    | 配当の原資     | 配当金の総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日        | 効力発生日     |
|----------------------|----------|-----------|----------------|---------------------|------------|-----------|
| 平成24年6月29日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式 | 利益剰<br>余金 | 2,712,000      | 113,000             | 平成24年3月31日 | 平成24年7月2日 |

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 発行済株式の種類 | 当事業年度期首<br>株式数（株） | 当事業年度<br>増加株式数（株） | 当事業年度<br>減少株式数（株） | 当事業年度末<br>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<br>総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日        | 効力発生日     |
|----------------------|----------|--------------------|---------------------|------------|-----------|
| 平成24年6月29日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式 | 2,712,000          | 113,000             | 平成24年3月31日 | 平成24年7月2日 |

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成25年6月28日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

| 決議                   | 株式の種類    | 配当の<br>原資 | 配当金の<br>総額<br>(千円) | 1株当たり<br>配当額<br>(円) | 基準日        | 効力発生日     |
|----------------------|----------|-----------|--------------------|---------------------|------------|-----------|
| 平成25年6月28日<br>定時株主総会 | 普通<br>株式 | 利益剰余金     | 3,096,000          | 129,000             | 平成25年3月31日 | 平成25年7月1日 |

## (リース取引関係)

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

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

未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

## 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

（千円）

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

## 減価償却費相当額の算定方法

該当事項はありません。

## 利息相当額の算定方法

該当事項はありません。

## 2. オペレーティング・リース取引

該当事項はありません。

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

## 第27期（平成24年3月31日現在）

|                      | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|----------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金            | 12,520,748       | 12,520,748 | -          |
| (2) 金銭の信託            | 6,548,577        | 6,548,577  | -          |
| (3) 投資有価証券<br>其他有価証券 | 370,636          | 370,636    | -          |
| 資産計                  | 19,439,962       | 19,439,962 | -          |
| (1) 未払法人税等           | 1,195,056        | 1,195,056  | -          |
| 負債計                  | 1,195,056        | 1,195,056  | -          |

## 第28期（平成25年3月31日現在）

|                      | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|----------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金            | 10,806,745       | 10,806,745 | -          |
| (2) 金銭の信託            | 10,214,440       | 10,214,440 | -          |
| (3) 投資有価証券<br>其他有価証券 | 320,332          | 320,332    | -          |
| 資産計                  | 21,341,518       | 21,341,518 | -          |
| (1) 未払法人税等           | 1,299,068        | 1,299,068  | -          |
| 負債計                  | 1,299,068        | 1,299,068  | -          |

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

| 区分      | 第27期<br>(平成24年3月31日現在) | 第28期<br>(平成25年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式   | 80,246                 | 80,246                 |
| 関係会社株式  | 2,119,074              | 2,119,074              |
| 長期差入保証金 | 731,197                | 731,564                |

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期（平成24年3月31日現在）

|       | 1年以内<br>（千円） | 1年超5年以内<br>（千円） | 5年超10年以内<br>（千円） | 10年超<br>（千円） |
|-------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| （1）預金 | 12,520,524   | -               | -                | -            |
| 合計    | 12,520,524   | -               | -                | -            |

第28期（平成25年3月31日現在）

|       | 1年以内<br>（千円） | 1年超5年以内<br>（千円） | 5年超10年以内<br>（千円） | 10年超<br>（千円） |
|-------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| （1）預金 | 10,806,412   | -               | -                | -            |
| 合計    | 10,806,412   | -               | -                | -            |

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第27期及び第28期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 4. その他有価証券

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

| 区 分                      | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額 | 取得原価    | 差額      |
|--------------------------|------------------------|---------|---------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  |                        |         |         |
| 株式                       | 359,540                | 146,101 | 213,438 |
| 債券                       | -                      | -       | -       |
| その他（投資信託）                | 3,482                  | 3,000   | 482     |
| 小計                       | 363,022                | 149,101 | 213,920 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの |                        |         |         |
| 株式                       | -                      | -       | -       |
| 債券                       | -                      | -       | -       |
| その他（投資信託）                | 7,614                  | 10,000  | 2,386   |
| 小計                       | 7,614                  | 10,000  | 2,386   |
| 合計                       | 370,636                | 159,101 | 211,534 |

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

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

| 区 分                      | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額 | 取得原価    | 差額      |
|--------------------------|------------------------|---------|---------|
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  |                        |         |         |
| 株式                       | 307,639                | 146,101 | 161,537 |
| 債券                       | -                      | -       | -       |
| その他（投資信託）                | 4,005                  | 3,000   | 1,005   |
| 小計                       | 311,644                | 149,101 | 162,543 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの |                        |         |         |
| 株式                       | -                      | -       | -       |
| 債券                       | -                      | -       | -       |
| その他（投資信託）                | 8,688                  | 10,000  | 1,312   |
| 小計                       | 8,688                  | 10,000  | 1,312   |
| 合計                       | 320,332                | 159,101 | 161,231 |

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

## 5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

## 7. 減損処理を行った有価証券

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

該当事項はありません。

## （金銭の信託関係）

## 1. 運用目的の金銭の信託

## 第27期（平成24年3月31日現在）

|            | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額（千円） | 当事業年度の損益に含まれた<br>評価差額（千円） |
|------------|----------------------------|---------------------------|
| 運用目的の金銭の信託 | 6,548,577                  | 495,939                   |

## 第28期（平成25年3月31日現在）

|            | 貸借対照表日における<br>貸借対照表計上額（千円） | 当事業年度の損益に含まれた<br>評価差額（千円） |
|------------|----------------------------|---------------------------|
| 運用目的の金銭の信託 | 10,214,440                 | 946,377                   |

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引関係）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。



## 2. 退職給付債務に関する事項

(千円)

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

## 3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

## (1) 割引率

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

## (2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

## (3) 数理計算上の差異の処理年数

5年（各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理する方法）

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

|      | 投資信託<br>（千円） | 投資顧問<br>（千円） | その他<br>（千円） | 合計<br>（千円） |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 23,208,602   | 5,910,049    | 697,063     | 29,815,715 |

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

|      | 投資信託<br>（千円） | 投資顧問<br>（千円） | その他<br>（千円） | 合計<br>（千円） |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 23,374,427   | 6,260,086    | 715,164     | 30,349,678 |

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者との取引)

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

| 属性       | 会社等の名称             | 住所              | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被所<br>有)割合 | 関係内容                               |             | 取引の内容                          | 取引金額<br>(千円) | 科目           | 期末<br>残高<br>(千円) |
|----------|--------------------|-----------------|------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------|-------------|--------------------------------|--------------|--------------|------------------|
|          |                    |                 |                  |                   |                            | 役員の<br>兼任等                         | 事業上<br>の関係  |                                |              |              |                  |
| その他の関係会社 | 第一生命<br>保険株式<br>会社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,102<br>億円      | 生命保<br>険業         | (被所有)<br>直接<br>50%         | 兼務<br>1名,<br>出向<br>2名,<br>転籍<br>3名 | 資産運用<br>の助言 | 資産運用<br>の<br>助言の顧<br>問<br>料の受入 | 687,972      | 未収投資<br>助言報酬 | 177,282          |

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

| 属性               | 会社等の名称             | 住所              | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被所<br>有)割合 | 関係内容                               |             | 取引の内容                  | 取引金額<br>(千円) | 科目           | 期末<br>残高<br>(千円) |
|------------------|--------------------|-----------------|------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------|-------------|------------------------|--------------|--------------|------------------|
|                  |                    |                 |                  |                   |                            | 役員の<br>兼任等                         | 事業上<br>の関係  |                        |              |              |                  |
| その他<br>の関係<br>会社 | 第一生命<br>保険株式<br>会社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,102<br>億円      | 生命保<br>険業         | (被所有)<br>直接<br>50%         | 兼務<br>1名,<br>出向<br>2名,<br>転籍<br>3名 | 資産運用<br>の助言 | 資産運用の<br>助言の顧問<br>料の受入 | 710,289      | 未収投資<br>助言報酬 | 203,114          |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

## 第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

| 属性          | 会社等の名称                       | 住所                          | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被所<br>有)割合 | 関係内容       |                   | 取引の<br>内容                    | 取引<br>金額<br>(千円) | 科目       | 期末残高<br>(千円) |
|-------------|------------------------------|-----------------------------|------------------|-------------------|----------------------------|------------|-------------------|------------------------------|------------------|----------|--------------|
|             |                              |                             |                  |                   |                            | 役員の<br>兼任等 | 事業上<br>の関係        |                              |                  |          |              |
| 子<br>会<br>社 | DIAM<br>International<br>Ltd | London<br>United<br>Kingdom | 4,000<br>千GBP    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100%         | 兼務<br>2名   | 当社預<br>り資産<br>の運用 | 当社預り<br>資産の運<br>用の顧問<br>料の支払 | 523,845          | 未払<br>費用 | 158,645      |
|             | DIAM U.S.A.,<br>Inc.         | New<br>York<br>U.S.A.       | 4,000<br>千USD    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100%         | 兼務<br>2名   | 当社預<br>り資産<br>の運用 | 当社預り<br>資産の運<br>用の顧問<br>料の支払 | 203,092          | 未払<br>費用 | 75,484       |

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

| 属性          | 会社等の名称                       | 住所                          | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容           |                   | 取引の<br>内容                    | 取引<br>金額<br>(千円) | 科目       | 期末残高<br>(千円) |
|-------------|------------------------------|-----------------------------|------------------|-------------------|--------------------------------|----------------|-------------------|------------------------------|------------------|----------|--------------|
|             |                              |                             |                  |                   |                                | 役員<br>の兼<br>任等 | 事業上<br>の関係        |                              |                  |          |              |
| 子<br>会<br>社 | DIAM<br>International<br>Ltd | London<br>United<br>kingdom | 4,000<br>千GBP    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100%             | 兼務<br>2名       | 当社預<br>り資産<br>の運用 | 当社預り<br>資産の運<br>用の顧問<br>料の支払 | 520,967          | 未払<br>費用 | 175,664      |
|             | DIAM U.S.A.,<br>Inc.         | New<br>York<br>U.S.A.       | 4,000<br>千USD    | 資産の<br>運用         | (所有)<br>直接<br>100%             | 兼務<br>2名       | 当社預<br>り資産<br>の運用 | 当社預り<br>資産の運<br>用の顧問<br>料の支払 | 214,290          | 未払<br>費用 | 89,815       |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (3)兄弟会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

| 属性                       | 会社等の名称                                     | 住所              | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容           |                                      | 取引の内容   | 取引金額<br>(千円)                        | 科目   | 期末残高<br>(千円)                      |
|--------------------------|--|-----------------|------------------|-------------------|--------------------------------|----------------|--------------------------------------|---|-------------------------------------|--|-----------------------------------|
|                          |  |                 |                  |                   |                                | 役員<br>の兼<br>任等 | 事業上<br>の関係                           |   |                                     |  |                                   |
| その他の<br>関係会<br>社の子<br>会社 | 株式会社<br>みずほ銀<br>行                          | 東京都<br>千代田<br>区 | 7,000<br>億円      | 銀行業               | -                              | -              | 当社設<br>定投資<br>信託の<br>販売、<br>預金取<br>引 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料<br><br>預金の引出<br>(純額)<br><br>受取利息 | 1,548,354<br><br>91,135<br><br>104  | 未払<br>手数料<br><br>現金・<br>預金<br><br>未収<br>収益 | 122,786<br><br>433,779<br><br>-   |
|                          | 株式会社<br>みずほ<br>コーポ<br>レート銀<br>行            | 東京都<br>千代田<br>区 | 14,040<br>億円     | 銀行業               | -                              | -              | 当社設<br>定投資<br>信託の<br>販売、<br>預金取<br>引 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料<br><br>預金の預入<br>(純額)<br><br>受取利息 | 450,766<br><br>392,267<br><br>3,654 | 未払<br>手数料<br><br>現金・<br>預金<br><br>未収<br>収益 | 83,446<br><br>11,440,025<br><br>- |
|                          | みずほ第<br>一フィナ<br>ンシャル<br>テクノロ<br>ジー株式<br>会社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 2億円              | 金融<br>技術<br>研究等   | -                              | -              | 当社預<br>り資産<br>の助言                    | 当社預り資<br>産の助言の<br>顧問料の支<br>払<br><br>業務委託料<br>の支払      | 237,031<br><br>15,140               | 未払<br>費用<br><br>未払<br>費用                   | 127,757<br><br>6,373              |
|                          | 資産管理<br>サービス<br>信託銀行<br>株式会社               | 東京都<br>中央区      | 500<br>億円        | 資産管<br>理等         | -                              | -              | 当社信<br>託財産<br>の運用                    | 信託元本の<br>追加<br>(純額)<br><br>信託報酬の<br>支払                | 1,000,000<br><br>5,087              | 金銭の<br>信託                                  | 6,548,577                         |

## 第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

| 属性                   | 会社等の名称                                     | 住所              | 資本金<br>又は出<br>資金 | 事業の<br>内容又<br>は職業 | 議決権<br>等の所<br>有(被<br>所有)<br>割合 | 関係内容           |                                      | 取引の内容   | 取引金額<br>(千円)                          | 科目   | 期末残高<br>(千円)                       |
|----------------------|--|-----------------|------------------|-------------------|--------------------------------|----------------|--------------------------------------|---|---------------------------------------|--|------------------------------------|
|                      |  |                 |                  |                   |                                | 役員<br>の兼<br>任等 | 事業上<br>の関係                           |   |                                       |  |                                    |
| その他の<br>関係会社<br>の子会社 | 株式会社<br>みずほ銀行                              | 東京都<br>千代田<br>区 | 7,000<br>億円      | 銀行業               | -                              | -              | 当社設<br>定投資<br>信託の<br>販売、<br>預金取<br>引 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料<br><br>預金の預入<br>(純額)<br><br>受取利息 | 1,661,638<br><br>191,782<br><br>106   | 未払<br>手数料<br><br>現金・<br>預金<br><br>未収<br>収益 | 142,323<br><br>625,561<br><br>-    |
|                      | 株式会社<br>みずほ<br>コーポ<br>レート銀行                | 東京都<br>千代田<br>区 | 14,040<br>億円     | 銀行業               | -                              | -              | 当社設<br>定投資<br>信託の<br>販売、<br>預金取<br>引 | 投資信託の<br>販売代行手<br>数料<br><br>預金の引出<br>(純額)<br><br>受取利息 | 460,605<br><br>1,912,442<br><br>3,210 | 未払<br>手数料<br><br>現金・<br>預金<br><br>未収<br>収益 | 100,875<br><br>9,527,582<br><br>61 |
|                      | みずほ第<br>一フィナ<br>ンシャル<br>テクノロ<br>ジー株式<br>会社 | 東京都<br>千代田<br>区 | 2億円              | 金融<br>技術<br>研究等   | -                              | -              | 当社預<br>り資産<br>の助言                    | 当社預り資<br>産の助言の<br>顧問料の支<br>払<br><br>業務委託料<br>の支払      | 259,435<br><br>11,140                 | 未払<br>費用<br><br>未払<br>費用                   | 132,250<br><br>5,848               |
|                      | 資産管理<br>サービス<br>信託銀行<br>株式会社               | 東京都<br>中央区      | 500<br>億円        | 資産管<br>理等         | -                              | -              | 当社信<br>託財産<br>の運用                    | 信託元本の<br>追加<br>(純額)<br><br>信託報酬の<br>支払                | 3,500,000<br><br>5,908                | 金銭の<br>信託                                  | 10,214,440                         |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 業務委託料は、委託業務に係る人件費から算出された手数料に基づく個別契約により決定しております。



（注4）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれており  
ます。

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

|              | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） | 第28期<br>（自 平成24年4月 1日<br>至 平成25年3月31日） |
|--------------|--|--|
| 1株当たり純資産額    | 1,011,717円32銭                          | 1,059,622円64銭                          |
| 1株当たり当期純利益金額 | 142,163円33銭                            | 162,254円29銭                            |

（注1）潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株引受権付社債及び転換社債を発行し  
ていないため記載しておりません。

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|              | 第27期<br>（自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月31日） | 第28期<br>（自 平成24年4月 1日<br>至 平成25年3月31日） |
|--------------|--|--|
| 当期純利益        | 3,411,920千円                            | 3,894,102千円                            |
| 普通株主に帰属しない金額 | -                                      | -                                      |
| 普通株式に係る当期純利益 | 3,411,920千円                            | 3,894,102千円                            |
| 期中平均株式数      | 24,000株                                | 24,000株                                |

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

（単位：千円）

|              | 第29期中間会計期間末<br>（平成25年9月30日現在） |
|--------------|-------------------------------|
| （負債の部）       |                               |
| 流動負債         |                               |
| 預り金          | 915,630                       |
| 未払金          | 1,777,659                     |
| 未払収益分配金      | 48                            |
| 未払償還金        | 51,109                        |
| 未払手数料        | 1,403,573                     |
| その他未払金       | 322,928                       |
| 未払費用         | 1,320,067                     |
| 未払法人税等       | 1,362,916                     |
| 未払消費税等       | 149,912                       |
| 賞与引当金        | 592,328                       |
|              | 流動負債計                         |
|              | 6,118,515                     |
| 固定負債         |                               |
| 退職給付引当金      | 870,468                       |
| 役員退職慰労引当金    | 121,100                       |
|              | 固定負債計                         |
|              | 991,568                       |
| 負債合計         | 7,110,084                     |
| （純資産の部）      |                               |
| 株主資本         |                               |
| 資本金          | 2,000,000                     |
| 資本剰余金        | 2,428,478                     |
| 資本準備金        | 2,428,478                     |
| 利益剰余金        | 20,051,026                    |
| 利益準備金        | 123,293                       |
| その他利益剰余金     | 19,927,733                    |
| 別途積立金        | 17,130,000                    |
| 研究開発積立金      | 300,000                       |
| 運用責任準備積立金    | 200,000                       |
| 繰越利益剰余金      | 2,297,733                     |
|              | 株主資本計                         |
|              | 24,479,504                    |
| 評価・換算差額等     |                               |
| その他有価証券評価差額金 | 109,475                       |
|              | 評価・換算差額等計                     |
|              | 109,475                       |
| 純資産合計        | 24,588,979                    |
| 負債・純資産合計     | 31,699,064                    |

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

## 重要な会計方針

| 項目                     | 第29期中間会計期間<br>(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)  |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | (1)子会社株式及び関連会社株式<br>：移動平均法による原価法<br><br>(2)その他有価証券<br>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）<br>時価のないもの：移動平均法による原価法  |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法    | 時価法   |
| 3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 時価法   |
| 4. 固定資産の減価償却の方法        | (1)有形固定資産：定率法<br>なお、主な耐用年数は次のとおりであります。<br>建物 … 6～18年<br>車両運搬具 … 6年<br>器具備品 … 3～20年<br><br>(2)無形固定資産：定額法<br>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。  |
| 5. 引当金の計上基準            | (1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。<br><br>(2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。<br><br>(3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異及び過去勤務債務の費用処理方法は以下のとおりであります。<br>数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理<br>過去勤務債務：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理<br><br>(4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。 |

| 項目                           | 第29期中間会計期間<br>(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)               |
|------------------------------|--|
| 6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準     | 外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 |
| 7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。              |

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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



## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

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

## (金融商品関係)

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

|                      | 中間貸借対照表計上額<br>(千円) | 時価<br>(千円) | 差額<br>(千円) |
|----------------------|--------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金            | 9,422,331          | 9,422,331  | -          |
| (2) 金銭の信託            | 9,988,674          | 9,988,674  | -          |
| (3) 投資有価証券<br>其他有価証券 | 329,200            | 329,200    | -          |
| 資産計                  | 19,740,206         | 19,740,206 | -          |
| (1) 未払法人税等           | 1,362,916          | 1,362,916  | -          |
| 負債計                  | 1,362,916          | 1,362,916  | -          |

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## 負債

### (1) 未払法人税等

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

### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

| 区分     | 中間貸借対照表計上額<br>(千円) |
|--------|--------------------|
| 非上場株式  | 80,246             |
| 関係会社株式 | 2,119,074          |
| 差入保証金  | 731,197            |

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

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

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

## （有価証券関係）

## 第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

## 1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式

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

## 3．その他有価証券

| 区 分                        | 中間貸借対照表<br>計上額（千円） | 取得原価<br>（千円） | 差額<br>（千円） |
|----------------------------|--------------------|--------------|------------|
| 中間貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えるもの  |                    |              |            |
| 株式                         | 315,920            | 146,101      | 169,818    |
| 債券                         | -                  | -            | -          |
| その他（投資信託）                  | 4,263              | 3,000        | 1,263      |
| 小計                         | 320,184            | 149,101      | 171,082    |
| 中間貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの |                    |              |            |
| 株式                         | -                  | -            | -          |
| 債券                         | -                  | -            | -          |
| その他（投資信託）                  | 9,016              | 10,000       | 984        |
| 小計                         | 9,016              | 10,000       | 984        |
| 合計                         | 329,200            | 159,101      | 170,098    |

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

## （金銭の信託関係）

## 第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

## 1．満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 2．その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## （1）サービスごとの情報

|      | 投資信託<br>（千円） | 投資顧問<br>（千円） | その他<br>（千円） | 合計<br>（千円） |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 12,617,519   | 3,487,859    | 409,599     | 16,514,977 |

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## （1株当たり情報）

| 第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）                |            |     |
|---|------------|-----|
| 1株当たり純資産額   | 1,024,540円 | 82銭 |
| 1株当たり中間純利益金額                                      | 93,680円    | 39銭 |
| なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。 |            |     |

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|              | 第29期中間会計期間<br>（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日） |
|--------------|--|
| 中間純利益        | 2,248,329千円                            |
| 普通株主に帰属しない金額 | -                                      |
| 普通株式に係る中間純利益 | 2,248,329千円                            |
| 期中平均株式数      | 24,000株                                |

（重要な後発事象）

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

平成25年3月末日現在 247,369百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

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

| 名 称         | 資本金の額 <sup>*</sup><br>(単位:百万円) | 事 業 の 内 容                        |
|-------------|--------------------------------|----------------------------------|
| マネックス証券株式会社 | 7,425                          | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |

\* 平成25年3月末日現在

#### (3) 投資顧問会社

##### a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

##### b. 資本金の額

平成25年3月末日現在 9,557.5万円

##### c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

#### (4) 投資顧問会社

##### a. 名称

DIAM International Ltd

##### b. 資本金の額

平成25年12月末日現在 400万ポンド

##### c. 事業の内容

イギリスにおいて投資顧問業務を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

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

その他委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

### 第3【その他】

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



## 独立監査人の監査報告書

平成25年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

### 新日本有限責任監査法人

|                    |       |         |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 山内 正彦 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 浅野 功 印  |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 近藤 敏弘 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

(注2) 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年2月26日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

|                |       |         |
|----------------|-------|---------|
| 指定社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 柴 毅 印   |
| 指定社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 和 田 渉 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド エボリューションの平成25年1月12日から平成26年1月14日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド エボリューションの平成26年1月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

|                    |       |         |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 山内 正彦 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 浅野 功 印  |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 近藤 敏弘 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

（注2）中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。