

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成27年10月13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 西 惠正
<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>	上野 圭子
<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。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

半期報告書の提出に伴い、平成27年4月13日付をもって提出した有価証券届出書（以下、「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

**2【訂正の内容】**

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 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】

##### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成27年1月30日現在）

(略)

大株主の状況

（平成27年1月30日現在）

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

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成27年7月31日現在）

(略)

大株主の状況

（平成27年7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】

##### (2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

(参考)当ファンドが投資するマザーファンドの概要

(略)

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
(略)	
投資態度	(略)
主な投資制限	(略)

(略)

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
(略)	
投資態度	(略)
主な投資制限	(略)

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

(参考)当ファンドが投資するマザーファンドの概要

(略)

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
(略)	
投資態度	(略)
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     E --&gt; D     F["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --&gt; D     G[日次・月次モニタリング] --&gt; D   </pre>
主な投資制限	(略)

(略)

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
(略)	
投資態度	(略)

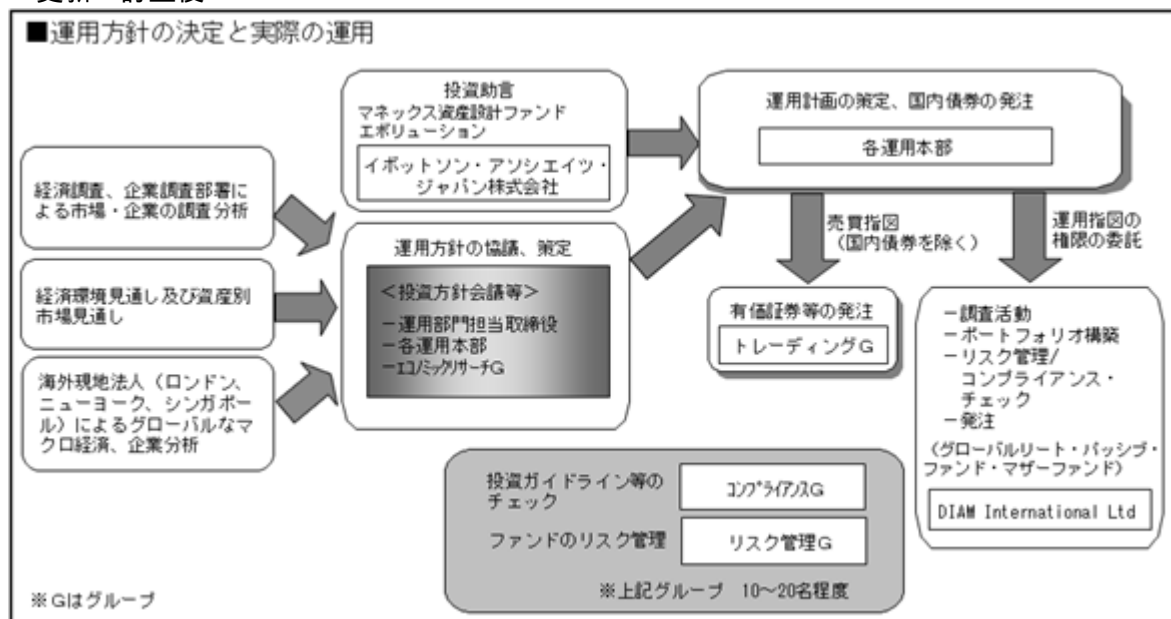
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
主な投資制限	(略)

(略)

## (3) 【運用体制】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (3) 運用体制」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

&lt;更新・訂正後&gt;



経済環境見通し、資産別市場見通し、基本投資方針およびファンドの運用方針は、運用部門担当取締役、各運用本部の運用担当者、エコ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。

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

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

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27年7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。

### 3【投資リスク】

<外部委託先に関する管理体制>

<訂正前>

（略）

上記体制は平成27年4月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

（略）

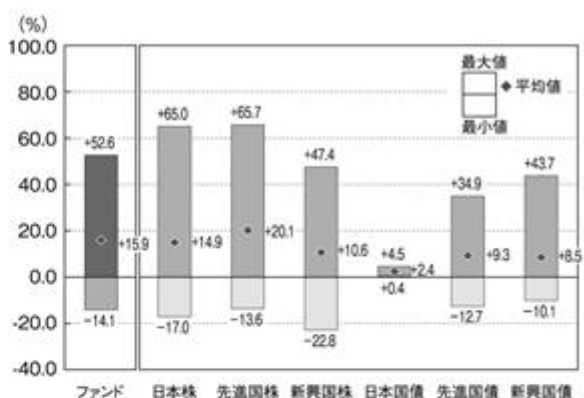
上記体制は平成27年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>



## (参考情報)

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

ファンド：2011年5月～2015年7月

代表的な資産クラス：2010年8月～2015年7月

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

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

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

\* 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## \*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株……MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

●「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、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なく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

●「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的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。

●「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

●「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

## (5)【課税上の取扱い】

&lt;訂正前&gt;

(略)

個人の受益者に対する課税

(略)

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。

(略)

上記は、平成27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。

(略)

<訂正後>

(略)

個人の受益者に対する課税

(略)

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。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等が追加される予定です。

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（平成28年1月1日以降、年間120万円）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。また、平成28年4月1日より、未成年者口座内の少額上場株式等に係る配当所得及び譲渡所得等の非課税措置（ジュニアNISA）が開始され、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万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年間非課税となる予定です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(略)

上記は、平成27年7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。

(略)

## 5【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成27年7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	1,520,827,362	98.41
内 日本	1,520,827,362	98.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	24,558,388	1.59
純資産総額	1,545,385,750	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

## 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27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	325,191,145,230	97.67
内 日本	325,191,145,230	97.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,765,934,323	2.33
純資産総額	332,957,079,553	100.00

## その他資産の投資状況

平成27年7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）	7,536,400,000	2.26
内 日本	7,536,400,000	2.26

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）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27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	339,337,444,800	81.13
内 日本	339,337,444,800	81.13
地方債証券	27,840,163,973	6.66
内 日本	27,840,163,973	6.66
特殊債券	26,407,772,104	6.31
内 日本	26,407,772,104	6.31
社債券	22,471,081,840	5.37
内 日本	22,163,903,840	5.30
内 アメリカ	307,178,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,185,919,973	0.52

純資産総額	418,242,382,690	100.00
-------	-----------------	--------

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

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

#### J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	23,189,034,900	98.90
内 日本	23,189,034,900	98.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	258,976,726	1.10
純資産総額	23,448,011,626	100.00

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

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

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	292,544,050,669	95.21
内 アメリカ	175,062,748,814	56.98
内 イギリス	24,341,706,515	7.92
内 スイス	12,843,681,326	4.18
内 フランス	11,351,262,503	3.69
内 ドイツ	11,291,071,818	3.67
内 カナダ	11,065,312,555	3.60
内 オーストラリア	7,726,959,622	2.51
内 アイルランド	5,269,626,239	1.72
内 オランダ	5,166,798,379	1.68
内 スペイン	4,498,997,341	1.46
内 スウェーデン	3,623,264,074	1.18
内 香港	2,931,650,283	0.95
内 イタリア	2,822,036,852	0.92
内 デンマーク	2,198,863,407	0.72
内 シンガポール	1,949,406,827	0.63
内 ジャージー	1,792,608,238	0.58
内 ベルギー	1,670,595,462	0.54
内 フィンランド	1,066,584,507	0.35
内 バミューダ	1,064,542,487	0.35
内 オランダ領キュラソー	1,021,923,803	0.33
内 イスラエル	834,893,731	0.27
内 ケイマン諸島	774,138,348	0.25
内 ノルウェー	695,423,815	0.23
内 ルクセンブルグ	438,190,326	0.14
内 オーストリア	213,949,945	0.07
内 パナマ	208,963,658	0.07
内 ポルトガル	207,379,135	0.07
内 ニューージーランド	141,104,469	0.05
内 リベリア	136,806,717	0.04
内 イギリス領バージン諸島	86,571,038	0.03
内 マン島	46,987,279	0.02

	内 モーリシャス	1,156	0.00
投資信託受益証券		868,383,138	0.28
	内 オーストラリア	758,660,917	0.25
	内 シンガポール	109,722,221	0.04
投資証券		6,319,598,666	2.06
	内 アメリカ	5,245,540,208	1.71
	内 イギリス	467,796,561	0.15
	内 フランス	425,704,032	0.14
	内 香港	141,322,800	0.05
	内 カナダ	39,235,065	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,519,143,244	2.45
純資産総額		307,251,175,717	100.00

その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	935,822,600	0.30
-	935,822,600	0.30
株価指数先物取引（買建）	6,676,411,222	2.17
内 アメリカ	4,305,558,642	1.40
内 ドイツ	1,272,569,370	0.41
内 イギリス	576,518,904	0.19
内 オーストラリア	279,776,497	0.09
内 カナダ	241,987,809	0.08

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	315,967,317,011	97.52
内 アメリカ	135,569,449,111	41.84
内 イタリア	30,993,668,225	9.57
内 フランス	30,588,167,634	9.44
内 イギリス	27,242,918,891	8.41
内 ドイツ	23,942,598,199	7.39
内 スペイン	16,730,391,999	5.16
内 オランダ	8,144,782,699	2.51
内 ベルギー	8,048,873,245	2.48
内 カナダ	6,715,809,357	2.07
内 オーストラリア	5,107,183,759	1.58
内 オーストリア	4,984,872,896	1.54
内 メキシコ	3,121,930,102	0.96
内 アイルランド	2,412,113,863	0.74
内 デンマーク	2,118,374,821	0.65
内 ポーランド	1,827,238,153	0.56
内 フィンランド	1,785,835,772	0.55
内 マレーシア	1,602,777,462	0.49
内 南アフリカ	1,574,201,247	0.49
内 スウェーデン	1,490,770,547	0.46
内 シンガポール	1,118,397,415	0.35
内 ノルウェー	846,961,614	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,039,723,805	2.48
純資産総額	324,007,040,816	100.00

## その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	464,340,790	0.14
-	464,340,790	0.14

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 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27年7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	292,388,829	10.67
内 オーストラリア	213,117,155	7.78
内 シンガポール	79,271,674	2.89
投資証券	2,412,642,238	88.02
内 アメリカ	1,902,092,949	69.39
内 イギリス	205,445,724	7.50
内 フランス	135,075,722	4.93
内 香港	47,947,360	1.75
内 カナダ	47,936,307	1.75
内 ベルギー	21,940,551	0.80
内 オランダ	17,238,674	0.63
内 ニュージーランド	11,842,227	0.43
内 シンガポール	8,386,560	0.31
内 ドイツ	5,522,445	0.20
内 スペイン	5,008,184	0.18
内 アイルランド	4,205,535	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	35,938,680	1.31
純資産総額	2,740,969,747	100.00

## その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	56,523,900	2.06
-	56,523,900	2.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	35,260,565,659	96.45
内 韓国	5,099,178,487	13.95
内 中国	4,613,226,036	12.62
内 台湾	4,409,882,307	12.06
内 インド	2,992,117,210	8.18
内 南アフリカ	2,773,658,836	7.59
内 ブラジル	2,539,434,986	6.95
内 ケイマン諸島	1,831,494,153	5.01
内 香港	1,811,925,083	4.96
内 ロシア	1,340,273,833	3.67
内 メキシコ	1,335,574,302	3.65
内 マレーシア	1,204,028,798	3.29
内 インドネシア	850,405,207	2.33
内 タイ	797,995,554	2.18
内 ポーランド	532,483,052	1.46
内 フィリピン	519,870,449	1.42
内 トルコ	493,568,765	1.35
内 バミューダ	453,971,807	1.24
内 チリ	433,480,044	1.19
内 カタール	355,657,675	0.97
内 アラブ首長国連邦	289,624,996	0.79
内 コロンビア	202,635,007	0.55
内 ハンガリー	86,414,036	0.24
内 チェコ	69,690,330	0.19
内 エジプト	66,618,725	0.18
内 ギリシャ	59,273,939	0.16
内 アメリカ	46,154,291	0.13
内 マルタ	36,045,793	0.10
内 ペルー	15,881,958	0.04
投資信託受益証券	270,549,187	0.74
内 メキシコ	270,549,187	0.74
投資証券	93,999,746	0.26
内 メキシコ	50,824,366	0.14
内 南アフリカ	23,577,904	0.06
内 トルコ	19,597,476	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	935,004,549	2.56
純資産総額	36,560,119,141	100.00



## その他資産の投資状況

平成27年7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）	52,092,600	0.14
-	52,092,600	0.14
為替予約取引（売建）	1,004,643,000	2.75
-	1,004,643,000	2.75
株価指数先物取引（買建）	964,984,685	2.64
内 アメリカ	964,984,685	2.64

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	56,589,644,081	96.86
内 トルコ	8,480,382,715	14.52
内 メキシコ	7,974,758,964	13.65
内 ロシア	7,400,547,548	12.67
内 ブラジル	5,932,235,946	10.15
内 インドネシア	5,430,372,273	9.29
内 コロンビア	4,499,838,772	7.70
内 フィリピン	4,464,798,464	7.64
内 ハンガリー	3,066,575,797	5.25
内 ベルギー	2,382,805,918	4.08
内 南アフリカ	2,077,151,884	3.56
内 クロアチア	1,832,571,921	3.14
内 パナマ	1,810,851,276	3.10
内 ルーマニア	1,236,752,603	2.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,833,720,283	3.14
純資産総額	58,423,364,364	100.00

## その他資産の投資状況

平成27年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	260,463,000	0.45
-	260,463,000	0.45

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	232,648,177	2.7732 645,185,183	3.0453 708,483,493	- -	45.85%
2	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	463,947,048	1.0449 484,814,015	1.0310 478,329,406	- -	30.95%
3	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	75,379,197	1.7896 134,901,511	1.8656 140,627,429	- -	9.10%
4	グローバルリート・パッシ ブ・ファンド・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	38,914,892	1.7861 69,508,625	1.7760 69,112,848	- -	4.47%
5	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	26,450,561	2.0044 53,018,661	2.3799 62,949,690	- -	4.07%
6	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	22,968,585	1.8937 43,497,535	1.9120 43,915,934	- -	2.84%
7	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	9,191,479	1.2337 11,340,144	1.2283 11,289,893	- -	0.73%
8	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	3,680,403	1.7847 6,568,670	1.6625 6,118,669	- -	0.40%

(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。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.41%
合計	98.41%

(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27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,843,200	7,700.00 14,192,640,000	8,253.00 15,211,929,600	- -	4.57%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	10,579,500	679.90 7,193,002,050	900.00 9,521,550,000	- -	2.86%
3	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	997,100	4,177.00 4,164,886,700	5,544.00 5,527,922,400	- -	1.66%
4	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	18,491,400	200.43 3,706,354,332	267.90 4,953,846,060	- -	1.49%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,031,800	3,606.00 3,720,670,800	4,763.50 4,914,979,300	- -	1.48%
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	697,400	7,136.00 4,976,646,400	6,881.00 4,798,809,400	- -	1.44%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,202,000	3,820.50 4,592,241,000	3,979.50 4,783,359,000	- -	1.44%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	884,700	3,525.80 3,119,279,100	4,813.50 4,258,503,450	- -	1.28%
9	K D D I 日本	株式 情報・通信業	1,339,600	2,595.33 3,476,708,802	3,150.50 4,220,409,800	- -	1.27%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	938,800	3,102.36 2,912,503,057	3,533.00 3,316,780,400	- -	1.00%
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	524,200	5,922.00 3,104,312,400	6,240.00 3,271,008,000	- -	0.98%
12	セブン&アイ・ホールディン グス 日本	株式 小売業	551,500	4,386.00 2,418,879,000	5,724.00 3,156,786,000	- -	0.95%
13	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	244,800	9,140.00 2,237,472,000	12,250.00 2,998,800,000	- -	0.90%
14	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,567,200	1,830.00 2,867,976,000	1,867.00 2,925,962,400	- -	0.88%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	139,100	20,035.00 2,786,868,500	20,680.00 2,876,588,000	- -	0.86%
16	キャノン 日本	株式 電気機器	719,100	3,732.50 2,684,040,750	3,972.00 2,856,265,200	- -	0.86%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	534,200	4,076.50 2,177,666,300	5,165.00 2,759,143,000	- -	0.83%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,010,300	2,223.00 2,245,896,900	2,679.50 2,707,098,850	- -	0.81%
19	三菱地所 日本	株式 不動産業	980,000	2,514.00 2,463,720,000	2,755.00 2,699,900,000	- -	0.81%
20	N T T ドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,016,700	1,996.50 2,029,841,550	2,614.50 2,658,162,150	- -	0.80%

21	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	119,600	19,475.00 2,329,210,000	21,720.00 2,597,712,000	- -	0.78%
22	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,207,000	798.70 2,561,430,900	804.40 2,579,710,800	- -	0.77%
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	140,200	12,780.00 1,791,756,000	18,400.00 2,579,680,000	- -	0.77%
24	三井不動産 日本	株式 不動産業	699,000	3,126.00 2,185,074,000	3,528.50 2,466,421,500	- -	0.74%
25	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	2,694,600	643.40 1,733,705,640	881.40 2,375,020,440	- -	0.71%
26	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,628,000	1,318.50 2,146,518,000	1,457.00 2,371,996,000	- -	0.71%
27	花王 日本	株式 化学	376,300	5,014.00 1,886,768,200	6,291.00 2,367,303,300	- -	0.71%
28	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,875,200	1,064.00 1,995,212,800	1,198.50 2,247,427,200	- -	0.67%
29	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	472,100	4,565.54 2,155,395,100	4,678.00 2,208,483,800	- -	0.66%
30	第一生命保険 日本	株式 保険業	844,900	1,720.00 1,453,228,000	2,522.00 2,130,837,800	- -	0.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
株式	97.67%
合計	97.67%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成27年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.55%
輸送用機器		10.76%
銀行業		9.51%
情報・通信業		6.86%
化学		5.76%
医薬品		4.85%
小売業		4.77%
機械		4.46%
食料品		4.40%
陸運業		4.10%
卸売業		3.96%
サービス業		3.14%
不動産業		2.79%
保険業		2.71%
建設業		2.56%
電気・ガス業		2.27%
その他製品		1.56%
精密機器		1.40%
証券、商品先物取引業		1.39%
その他金融業		1.31%
鉄鋼		1.26%
ガラス・土石製品		0.92%
ゴム製品		0.90%
非鉄金属		0.89%
繊維製品		0.72%
空運業		0.67%
金属製品		0.57%
石油・石炭製品		0.47%
鉱業		0.37%
海運業		0.26%
パルプ・紙	0.23%	
倉庫・運輸関連業	0.21%	
水産・農林業	0.07%	
合計		97.67%

(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27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	1 2 2 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	99.98 4,999,120,000	100.13 5,006,500,000	0.100000 2019/12/20	1.20%
2	1 2 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.05 5,002,610,000	100.09 5,004,600,000	0.100000 2020/3/20	1.20%
3	1 1 4 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.80 4,536,370,000	100.87 4,539,375,000	0.300000 2018/9/20	1.09%
4	1 1 8 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.34 4,515,420,000	100.58 4,526,100,000	0.200000 2019/6/20	1.08%
5	1 1 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.38 4,517,310,000	100.57 4,526,055,000	0.200000 2019/3/20	1.08%
6	1 1 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.42 4,518,900,000	100.57 4,525,785,000	0.200000 2018/12/20	1.08%
7	1 0 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,523,850,000	100.48 4,521,915,000	0.300000 2017/3/20	1.08%
8	1 0 6 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.37 4,516,830,000	100.41 4,518,675,000	0.200000 2017/9/20	1.08%
9	1 0 5 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.33 4,515,210,000	100.37 4,516,875,000	0.200000 2017/6/20	1.08%
10	1 0 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.39 4,317,028,000	100.46 4,319,909,000	0.200000 2017/12/20	1.03%
11	3 3 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.73 4,029,445,000	101.37 4,054,840,000	0.500000 2024/9/20	0.97%
12	3 3 8 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.07 4,002,970,000	100.13 4,005,560,000	0.400000 2025/3/20	0.96%
13	3 0 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	105.57 3,694,982,000	105.36 3,687,880,000	1.300000 2019/12/20	0.88%
14	3 0 1 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	105.97 3,603,082,000	105.61 3,590,740,000	1.500000 2019/6/20	0.86%
15	3 3 2 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.96 3,568,845,000	102.53 3,588,725,000	0.600000 2023/12/20	0.86%

16	113回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.76 3,526,775,000	100.81 3,528,665,000	0.300000 2018/6/20	0.84%
17	102回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.48 3,517,010,000	100.41 3,514,455,000	0.300000 2016/12/20	0.84%
18	282回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,400,000,000	102.64 3,489,998,000	101.91 3,465,212,000	1.700000 2016/9/20	0.83%
19	297回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,300,000,000	104.98 3,464,571,000	104.62 3,452,559,000	1.400000 2018/12/20	0.83%
20	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,300,000,000	101.75 3,357,810,000	102.32 3,376,824,000	0.600000 2024/6/20	0.81%
21	330回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,200,000,000	103.89 3,324,627,000	104.21 3,334,880,000	0.800000 2023/9/20	0.80%
22	289回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,200,000,000	104.09 3,330,912,000	103.54 3,313,344,000	1.500000 2017/12/20	0.79%
23	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,200,000,000	102.03 3,265,025,000	102.43 3,277,952,000	0.600000 2024/3/20	0.78%
24	313回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	107.04 3,211,320,000	106.65 3,199,560,000	1.300000 2021/3/20	0.77%
25	321回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	105.40 3,162,060,000	105.57 3,167,250,000	1.000000 2022/3/20	0.76%
26	296回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	105.05 3,151,770,000	104.61 3,138,330,000	1.500000 2018/9/20	0.75%
27	328回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	3,000,000,000	102.28 3,068,580,000	102.77 3,083,160,000	0.600000 2023/3/20	0.74%
28	120回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.31 3,009,570,000	100.57 3,017,280,000	0.200000 2019/9/20	0.72%
29	99回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.58 3,017,580,000	100.45 3,013,530,000	0.400000 2016/9/20	0.72%
30	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	104.76 2,933,448,000	104.59 2,928,576,000	1.000000 2020/9/20	0.70%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	81.13%
地方債証券	6.66%
特殊債券	6.31%
社債券	5.37%
合計	99.48%

(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27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,136	572,296.60 1,794,722,145	554,000.00 1,737,344,000	- -	7.41%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,908	561,501.45 1,632,846,220	556,000.00 1,616,848,000	- -	6.90%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	5,398	245,156.29 1,323,353,663	243,000.00 1,311,714,000	- -	5.59%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	5,874	183,625.55 1,078,616,493	180,000.00 1,057,320,000	- -	4.51%
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	3,844	234,116.22 899,942,783	244,500.00 939,858,000	- -	4.01%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	4,966	173,164.75 859,936,172	168,800.00 838,260,800	- -	3.57%
7	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,888	291,279.65 841,215,646	270,500.00 781,204,000	- -	3.33%
8	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,939	403,182.28 781,770,450	401,500.00 778,508,500	- -	3.32%
9	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,932	226,470.78 664,012,344	230,300.00 675,239,600	- -	2.88%
10	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,075	597,809.56 642,645,285	612,000.00 657,900,000	- -	2.81%
11	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	616	1,039,365.73 640,249,292	1,042,000.00 641,872,000	- -	2.74%
12	G L P投資法人 日本	投資証券	5,310	119,767.23 635,963,994	119,300.00 633,483,000	- -	2.70%



13	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,102	572,421.43 630,808,423	540,000.00 595,080,000	- -	2.54%
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	6,984	80,867.12 564,775,980	80,200.00 560,116,800	- -	2.39%
15	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	3,699	156,444.83 578,689,456	148,900.00 550,781,100	- -	2.35%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	899	625,590.44 562,405,808	574,000.00 516,026,000	- -	2.20%
17	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,487	160,920.10 561,128,399	145,300.00 506,661,100	- -	2.16%
18	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,076	460,781.14 495,800,509	440,500.00 473,978,000	- -	2.02%
19	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	7,038	61,253.25 431,100,418	66,000.00 464,508,000	- -	1.98%
20	野村不動産オフィスファンド投資法人 日本	投資証券	828	559,090.35 462,926,814	530,000.00 438,840,000	- -	1.87%
21	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,661	264,196.34 438,830,133	261,500.00 434,351,500	- -	1.85%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	783	559,132.45 437,800,711	552,000.00 432,216,000	- -	1.84%
23	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,844	250,066.79 461,123,161	233,500.00 430,574,000	- -	1.84%
24	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	779	520,223.36 405,254,004	489,000.00 380,931,000	- -	1.62%
25	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,798	151,153.17 422,926,577	135,800.00 379,968,400	- -	1.62%
26	プレミア投資法人 日本	投資証券	585	644,203.70 376,859,166	649,000.00 379,665,000	- -	1.62%
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,422	159,845.66 387,146,193	149,000.00 360,878,000	- -	1.54%
28	福岡リート投資法人 日本	投資証券	1,659	210,920.95 349,917,867	208,500.00 345,901,500	- -	1.48%
29	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,171	153,656.90 333,589,141	143,200.00 310,887,200	- -	1.33%
30	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	3,643	82,630.27 301,022,094	82,100.00 299,090,300	- -	1.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.90%
合計	98.90%

（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

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27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	451,246	15,763.00 7,112,992,141	15,178.77 6,849,361,413	- -	2.23%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	603,178	5,441.63 3,282,274,395	5,814.99 3,507,477,174	- -	1.14%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	324,220	11,581.61 3,754,991,150	10,296.56 3,338,350,812	- -	1.09%
4	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	378,626	6,863.13 2,598,560,670	7,212.92 2,731,001,319	- -	0.89%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	215,091	12,356.86 2,657,850,406	12,384.15 2,663,719,981	- -	0.87%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	778,640	3,119.60 2,429,050,015	3,239.92 2,522,735,046	- -	0.82%
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	288,234	7,401.46 2,133,354,381	8,563.72 2,468,355,731	- -	0.80%
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	249,232	9,013.16 2,246,368,640	9,346.50 2,329,449,131	- -	0.76%
9	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	178,005	12,141.48 2,161,245,393	12,821.00 2,282,202,105	- -	0.74%
10	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	473,777	4,296.74 2,035,699,240	4,431.94 2,099,755,596	- -	0.68%
11	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	473,039	4,233.47 2,002,596,990	4,316.59 2,041,916,363	- -	0.66%
12	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	30,569	47,362.19 1,447,814,883	66,579.71 2,035,275,167	- -	0.66%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	208,318	10,655.03 2,219,635,789	9,599.45 1,999,739,391	- -	0.65%
14	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	54,396	31,231.95 1,698,893,478	35,732.12 1,943,684,780	- -	0.63%

15	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	23,917	67,899.23 1,623,945,978	78,466.46 1,876,682,409	- -	0.61%
16	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	320,919	6,116.41 1,962,872,950	5,788.94 1,857,783,018	- -	0.60%
17	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	124,653	12,921.24 1,610,672,177	14,888.52 1,855,898,833	- -	0.60%
18	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	155,654	9,394.78 1,462,336,580	11,809.84 1,838,250,142	- -	0.60%
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	812,749	2,060.30 1,674,510,340	2,248.84 1,827,746,687	- -	0.59%
20	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	22,071	68,365.88 1,508,903,478	82,432.02 1,819,357,166	- -	0.59%
21	CITIGROUP INC アメリカ	株式 商業銀行	234,611	6,350.84 1,489,978,800	7,303.47 1,713,475,620	- -	0.56%
22	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	115,302	12,639.67 1,457,379,922	14,624.31 1,686,212,883	- -	0.55%
23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	144,792	13,989.23 2,025,528,763	11,539.44 1,670,818,770	- -	0.54%
24	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,485,361	1,157.15 1,718,797,486	1,116.34 1,658,171,225	- -	0.54%
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	319,580	5,208.29 1,664,465,565	5,031.06 1,607,826,921	- -	0.52%
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	219,478	7,294.79 1,601,046,446	7,258.82 1,593,151,471	- -	0.52%
27	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	88,977	18,400.09 1,637,185,128	17,719.11 1,576,593,606	- -	0.51%
28	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	101,644	13,878.83 1,410,700,365	14,445.69 1,468,318,568	- -	0.48%
29	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サー ビス	72,318	19,896.01 1,438,840,085	19,965.47 1,443,863,466	- -	0.47%
30	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	151,156	8,361.23 1,263,850,095	9,474.17 1,432,078,426	- -	0.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.21%
投資信託受益証券	0.28%
投資証券	2.06%
合計	97.55%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成27年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	9.39%
医薬品		7.63%
石油・ガス・消耗燃料		6.40%
保険		4.24%
メディア		3.13%
ソフトウェア		2.83%
コンピュータ・周辺機器		2.77%
各種電気通信サービス		2.65%
化学		2.63%
情報技術サービス		2.44%
バイオテクノロジー		2.38%
資本市場		2.26%
インターネットソフトウェア・サービス		2.25%
食品		2.18%
飲料		2.18%
食品・生活必需品小売り		2.14%
航空宇宙・防衛		2.01%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.89%
コングロマリット		1.87%
専門小売り		1.87%
ホテル・レストラン・レジャー		1.71%
半導体・半導体製造装置		1.62%
ヘルスケア機器・用品		1.59%
電力		1.56%
家庭用品		1.39%
タバコ		1.38%
機械		1.36%
各種金融サービス		1.31%
繊維・アパレル・贅沢品		1.27%
金属・鉱業		1.22%
通信機器		1.17%
総合公益事業		1.15%
インターネット販売・カタログ販売		1.11%
自動車		1.11%
陸運・鉄道		0.88%
エネルギー設備・サービス		0.85%
電気設備		0.75%
パーソナル用品		0.67%

不動産管理・開発	0.64%
複合小売り	0.59%
自動車部品	0.56%
航空貨物・物流サービス	0.56%
消費者金融	0.50%
専門サービス	0.50%
無線通信サービス	0.47%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.45%
家庭用耐久財	0.44%
商業サービス・用品	0.39%
電子装置・機器・部品	0.33%
建設資材	0.31%
商社・流通業	0.30%
建設・土木	0.28%
容器・包装	0.24%
建設関連製品	0.23%
運送インフラ	0.20%
旅客航空輸送業	0.16%
ガス	0.14%
紙製品・林産品	0.14%
水道	0.09%
海運業	0.08%
販売	0.08%
レジャー用品	0.08%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.05%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.21%

(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27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 0.625 07/15/16 アメリカ	国債証券	4,713,520,000	100.25 4,725,445,205	100.23 4,724,738,177	0.625000 2016/7/15	1.46%
2	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	2,728,880,000	103.18 2,815,849,405	102.28 2,791,125,752	2.500000 2024/5/15	0.86%
3	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	2,728,880,000	100.73 2,749,019,134	100.93 2,754,449,605	2.000000 2021/5/31	0.85%
4	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	2,704,072,000	98.42 2,661,571,182	97.75 2,643,230,380	2.000000 2025/2/15	0.82%
5	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	2,567,628,000	101.45 2,604,987,111	101.11 2,596,308,404	2.125000 2021/12/31	0.80%
6	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	2,480,800,000	104.79 2,599,679,936	103.80 2,575,268,864	3.250000 2016/12/31	0.79%
7	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	2,480,800,000	104.58 2,594,470,256	103.78 2,574,599,048	3.000000 2017/2/28	0.79%
8	US T N/B 3.0 09/30/16 アメリカ	国債証券	2,480,800,000	103.92 2,578,171,400	102.96 2,554,330,912	3.000000 2016/9/30	0.79%
9	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	2,232,720,000	109.71 2,449,517,112	109.12 2,436,455,700	3.625000 2020/2/15	0.75%
10	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	2,418,780,000	101.21 2,448,103,056	100.34 2,427,076,415	2.000000 2022/2/15	0.75%
11	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	2,356,760,000	99.17 2,337,316,730	99.69 2,349,666,152	0.750000 2017/12/31	0.73%
12	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	2,232,720,000	105.11 2,346,968,282	104.29 2,328,548,342	3.125000 2017/4/30	0.72%
13	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	2,232,720,000	99.59 2,223,722,138	99.86 2,229,661,173	0.625000 2017/5/31	0.69%
14	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	2,232,720,000	99.10 2,212,647,847	99.53 2,222,337,852	0.500000 2017/7/31	0.69%
15	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	2,232,720,000	98.42 2,197,465,351	99.23 2,215,528,056	1.125000 2019/5/31	0.68%
16	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	2,108,680,000	106.44 2,244,668,773	104.62 2,206,122,102	4.875000 2016/8/15	0.68%
17	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	2,046,660,000	104.72 2,143,385,151	104.63 2,141,543,157	2.625000 2020/8/15	0.66%
18	ITALY BTPS 4.0 02/01/17 イタリア	国債証券	2,009,100,000	107.12 2,152,228,284	105.87 2,127,034,170	4.000000 2017/2/1	0.66%
19	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,984,640,000	105.21 2,088,198,515	105.14 2,086,650,496	2.750000 2019/2/15	0.64%
20	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,860,600,000	109.41 2,035,812,702	108.18 2,012,852,898	4.750000 2017/8/15	0.62%
21	US T N/B 0.875 07/31/19 アメリカ	国債証券	1,984,640,000	97.18 1,928,812,076	97.93 1,943,617,491	0.875000 2019/7/31	0.60%
22	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,736,560,000	109.25 1,897,191,800	108.72 1,888,022,763	3.500000 2020/5/15	0.58%
23	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,922,620,000	97.27 1,870,190,152	97.92 1,882,648,730	1.000000 2019/11/30	0.58%

24	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	1,751,175,000	108.35 1,897,538,206	106.84 1,870,955,370	3.750000 2017/4/25	0.58%
25	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,736,560,000	107.08 1,859,543,179	106.51 1,849,627,421	3.500000 2018/2/15	0.57%
26	US T N/B 4.625 02/15/17 アメリカ	国債証券	1,736,560,000	107.78 1,871,820,658	106.16 1,843,653,655	4.625000 2017/2/15	0.57%
27	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,860,600,000	98.27 1,828,498,448	98.43 1,831,444,398	1.750000 2022/5/15	0.57%
28	US T N/B 2.75 11/30/16 アメリカ	国債証券	1,736,560,000	103.77 1,802,080,408	103.00 1,788,708,896	2.750000 2016/11/30	0.55%
29	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,588,275,000	111.92 1,777,756,207	110.58 1,756,314,495	4.500000 2018/2/1	0.54%
30	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,612,520,000	106.64 1,719,591,328	106.61 1,719,220,448	3.125000 2019/5/15	0.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.52%
合計	97.52%

(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27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	6,827	22,530.62 153,816,580	23,088.80 157,627,275	- -	5.75%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	3,149	23,201.68 73,062,096	25,182.60 79,300,009	- -	2.89%
3	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	7,500	8,690.24 65,176,818	9,214.93 69,111,987	- -	2.52%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	2,070	27,767.66 57,479,061	33,197.66 68,719,161	- -	2.51%
5	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	7,221	8,877.54 64,104,736	8,535.19 61,632,624	- -	2.25%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	2,688	19,611.96 52,716,960	21,239.36 57,091,424	- -	2.08%
7	VENTAS INC アメリカ	投資証券	6,772	8,572.40 58,052,322	8,231.29 55,742,325	- -	2.03%
8	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	10,384	5,166.26 53,646,506	4,986.40 51,778,860	- -	1.89%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	3,158	15,982.55 50,472,905	15,299.09 48,314,537	- -	1.76%
10	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	14,397	3,242.40 46,680,913	3,336.67 48,038,124	- -	1.75%
11	HCP INC アメリカ	投資証券	9,752	5,518.53 53,816,798	4,744.52 46,268,656	- -	1.69%
12	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	16,978	2,176.19 36,947,523	2,481.83 42,136,598	- -	1.54%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	1,510	25,140.42 37,962,045	27,757.67 41,914,083	- -	1.53%
14	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	3,429	12,551.00 43,037,381	11,961.17 41,014,876	- -	1.50%
15	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	16,813	2,838.03 47,715,885	2,424.98 40,771,222	- -	1.49%
16	LINK REIT/THE 香港	投資証券	55,800	729.60 40,711,680	719.20 40,131,360	- -	1.46%
17	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	111,632	328.00 36,616,211	358.81 40,055,303	- -	1.46%
18	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	23,791	1,425.65 33,917,705	1,604.58 38,174,676	- -	1.39%
19	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	39,895	724.87 28,919,087	905.19 36,112,710	- -	1.32%
20	SL GREEN アメリカ	投資証券	2,245	14,487.87 32,525,272	14,166.60 31,804,035	- -	1.16%
21	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	3,250	8,774.58 28,517,416	9,685.04 31,476,390	- -	1.15%
22	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	5,130	5,863.37 30,079,092	5,905.54 30,295,442	- -	1.11%



23	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	9,422	3,109.68 29,299,431	3,032.77 28,574,834	- -	1.04%
24	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	1,620	16,735.47 27,111,472	16,938.90 27,441,021	- -	1.00%
25	UDR INC アメリカ	投資証券	6,529	3,783.21 24,700,643	4,145.41 27,065,426	- -	0.99%
26	KLEPIERRE フランス	投資証券	4,763	4,676.03 22,271,947	5,675.70 27,033,394	- -	0.99%
27	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	3,160	8,465.72 26,751,706	8,017.94 25,336,708	- -	0.92%
28	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	2,660	7,262.54 19,318,361	9,033.83 24,029,996	- -	0.88%
29	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	18,500	1,184.82 21,919,170	1,267.03 23,440,092	- -	0.86%
30	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	37,352	509.22 19,020,691	586.24 21,897,486	- -	0.80%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.67%
投資証券	88.02%
合計	98.69%

(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27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	8,630	153,291.50 1,322,905,702	129,154.50 1,114,603,335	- -	3.05%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,926,083	559.63 1,077,900,158	544.30 1,048,376,607	- -	2.87%
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	403,200	2,538.34 1,023,462,384	2,284.80 921,231,360	- -	2.52%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	480,000	1,717.09 824,206,398	1,598.40 767,232,000	- -	2.10%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	6,577,530	121.86 801,539,740	100.63 661,962,619	- -	1.81%
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	31,026	17,979.97 557,846,768	17,301.79 536,805,584	- -	1.47%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	5,772,235	108.20 624,601,913	85.75 495,026,873	- -	1.35%
8	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,221,200	85.80 533,806,426	67.52 420,055,424	- -	1.15%
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,044,781	364.92 381,262,140	357.23 373,234,430	- -	1.02%
10	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	117,374	2,544.27 298,631,215	2,604.80 305,736,968	- -	0.84%
11	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	144,500	2,115.02 305,620,931	2,086.50 301,499,250	- -	0.82%
12	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,562,278	128.64 329,621,590	116.58 298,726,767	- -	0.82%
13	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	408,000	869.43 354,729,999	716.00 292,128,000	- -	0.80%
14	OAQ GAZPROM ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	470,714	706.94 332,768,425	577.53 271,851,568	- -	0.74%
15	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	583,000	613.93 357,926,776	462.40 269,579,200	- -	0.74%
16	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信サービス	129,742	2,234.24 289,875,317	2,015.65 261,515,500	- -	0.72%

17	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	368,695	697.09 257,015,238	695.50 256,430,985	- -	0.70%
18	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	237,608	1,217.30 289,240,563	1,076.18 255,709,642	- -	0.70%
19	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,403,000	211.24 296,382,546	155.52 218,194,560	- -	0.60%
20	PETRO CHINA CO LTD 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,658,000	168.02 278,578,068	124.64 206,653,120	- -	0.57%
21	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	40,874	6,123.60 250,296,283	5,050.90 206,450,846	- -	0.56%
22	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	102,149	1,813.80 185,278,028	1,950.29 199,220,428	- -	0.54%
23	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	197,378	1,127.43 222,531,187	994.89 196,371,174	- -	0.54%
24	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	12,070	17,821.57 215,106,389	15,945.00 192,456,150	- -	0.53%
25	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,007,200	111.70 224,218,352	94.24 189,158,528	- -	0.52%
26	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	43,212	4,557.23 196,927,432	4,238.94 183,173,308	- -	0.50%
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	37,015	4,839.06 179,117,898	4,837.26 179,051,456	- -	0.49%
28	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	45,831	4,722.33 216,429,298	3,667.34 168,078,317	- -	0.46%
29	GRUPO TELEVIS SA SAB メキシコ	株式 メディア	193,300	811.66 156,894,090	851.17 164,531,624	- -	0.45%
30	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV メキシコ	投資信託受益 証券 -	145,300	1,095.48 159,174,111	1,128.73 164,004,992	- -	0.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
株式	96.45%
投資信託受益証券	0.74%
投資証券	0.26%
合計	97.44%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成27年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	17.27%
石油・ガス・消耗燃料		7.76%
無線通信サービス		5.63%
コンピュータ・周辺機器		4.74%
半導体・半導体製造装置		4.74%
保険		4.33%
インターネットソフトウェア・サービス		2.93%
金属・鉱業		2.80%
情報技術サービス		2.40%
食品		2.37%
不動産管理・開発		2.36%
電子装置・機器・部品		2.30%
自動車		2.29%
メディア		2.29%
コングロマリット		2.04%
化学		2.02%
食品・生活必需品小売り		1.97%
各種金融サービス		1.84%
医薬品		1.80%
各種電気通信サービス		1.67%
電力		1.28%
資本市場		1.27%
飲料		1.17%
建設・土木		1.17%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		1.05%
運送インフラ		1.03%
建設資材		0.93%
パーソナル用品		0.93%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.89%
家庭用耐久財		0.78%
複合小売り		0.74%
タバコ		0.73%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.72%
自動車部品		0.71%
機械		0.70%
家庭用品		0.70%
繊維・アパレル・贅沢品		0.62%
専門小売り		0.56%

ガス	0.52%
ホテル・レストラン・レジャー	0.49%
紙製品・林産品	0.39%
電気設備	0.30%
旅客航空輸送業	0.29%
水道	0.28%
不動産投資信託	0.28%
航空宇宙・防衛	0.26%
商社・流通業	0.26%
商業サービス・用品	0.20%
海運業	0.18%
ソフトウェア	0.17%
消費者金融	0.15%
エネルギー設備・サービス	0.15%
陸運・鉄道	0.15%
各種消費者サービス	0.14%
容器・包装	0.13%
航空貨物・物流サービス	0.11%
総合公益事業	0.11%
レジャー用品	0.09%
建設関連製品	0.07%
販売	0.07%
通信機器	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.03%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.03%
インターネット販売・カタログ販売	0.02%
合計	96.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	2,488,552,500	117.93 2,934,986,569	116.72 2,904,762,901	7.500000 2030/3/31	4.97%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,203,188,000	98.19 1,181,422,081	94.67 1,139,118,239	4.250000 2025/1/7	1.95%
3	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア	国債証券	818,664,000	122.61 1,003,845,796	119.92 981,823,735	11.000000 2018/7/24	1.68%
4	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	855,876,000	104.62 895,460,265	103.15 882,836,094	4.000000 2023/10/2	1.51%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	880,684,000	103.20 908,918,605	97.50 858,666,900	4.750000 2044/3/8	1.47%
6	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	707,028,000	122.58 866,698,490	118.20 835,707,096	7.375000 2025/2/5	1.43%
7	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	682,220,000	121.99 832,264,986	116.00 791,375,200	6.050000 2040/1/11	1.35%
8	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	769,048,000	103.96 799,566,801	102.30 786,774,556	5.000000 2020/4/29	1.35%
9	TURKEY 6.25 09/26/22 トルコ	国債証券	669,816,000	113.19 758,169,692	110.67 741,292,065	6.250000 2022/9/26	1.27%
10	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	632,604,000	118.04 746,776,618	116.20 735,085,848	7.375000 2019/3/18	1.26%
11	TURKEY 6.75 04/03/18 トルコ	国債証券	645,008,000	110.57 713,190,307	109.81 708,315,535	6.750000 2018/4/3	1.21%
12	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ	国債証券	682,220,000	102.69 700,633,738	101.60 693,135,520	3.625000 2022/3/15	1.19%
13	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	669,816,000	106.23 711,574,066	103.45 692,924,652	4.875000 2021/1/22	1.19%
14	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	458,948,000	156.97 720,419,358	149.20 684,750,416	8.750000 2033/11/21	1.17%
15	INDONESIA 11.625 03/04/19 インドネシア	国債証券	520,968,000	132.38 689,662,400	130.94 682,181,547	11.625000 2019/3/4	1.17%
16	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	496,160,000	138.27 686,077,644	134.13 665,499,408	6.375000 2034/10/23	1.14%
17	TURKEY 6.0 01/14/41 トルコ	国債証券	632,604,000	109.94 695,531,972	104.39 660,406,945	6.000000 2041/1/14	1.13%
18	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	570,584,000	116.42 664,299,941	114.55 653,609,677	6.375000 2021/3/29	1.12%
19	TURKEY 6.875 03/17/36 トルコ	国債証券	570,584,000	119.99 684,689,636	114.33 652,405,745	6.875000 2036/3/17	1.12%

20	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	595,392,000	116.60 694,270,486	108.50 646,000,320	6.125000 2041/1/18	1.11%
21	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	595,392,000	112.36 669,022,144	108.12 643,767,600	5.550000 2045/1/21	1.10%
22	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン	国債証券	434,140,000	148.62 645,259,181	145.75 632,780,757	7.750000 2031/1/14	1.08%
23	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17 メキシコ	国債証券	595,392,000	107.01 637,150,066	105.95 630,817,824	5.625000 2017/1/15	1.08%
24	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 メキシコ	国債証券	620,200,000	102.33 634,700,276	99.37 616,323,750	3.600000 2025/1/30	1.05%
25	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	545,776,000	118.88 648,825,951	112.07 611,678,452	5.625000 2050/11/18	1.05%
26	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	719,432,000	93.38 671,862,660	84.75 609,718,620	5.000000 2045/1/27	1.04%
27	COLOMBIA 4.375 07/12/21 コロンビア	国債証券	570,584,000	106.23 606,133,864	104.40 595,689,696	4.375000 2021/7/12	1.02%
28	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア	国債証券	384,524,000	158.56 609,739,706	154.35 593,551,246	12.750000 2028/6/24	1.02%
29	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	570,584,000	110.19 628,733,952	102.00 581,995,680	5.625000 2044/2/26	1.00%
30	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	570,584,000	107.08 611,021,040	100.50 573,436,920	5.750000 2110/10/12	0.98%

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成27年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.86%
合計	96.86%

(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27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2709月	買建	454	7,456,312,096	7,536,400,000	2.26%

(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27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2015年08月	売建	5,650,000	700,862,570	700,769,500	0.23%
		ユーロ売/円買201 5年08月	売建	850,000	115,388,180	115,387,500	0.04%
		イギリス・ポンド売/ 円買2015年08月	売建	340,000	65,765,078	65,762,800	0.02%
		オーストラリア・ドル 売/円買2015年0 8月	売建	300,000	27,175,500	27,174,000	0.01%
		カナダ・ドル売/円買 2015年08月	売建	280,000	26,728,912	26,728,800	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P 500 FUTURE Sep15	買建	66	4,234,592,257	4,305,558,642	1.40%
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep 15	買建	262	1,252,291,035	1,272,569,370	0.41%
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep15	買建	45	566,554,809	576,518,904	0.19%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURE Sep15	買建	22	276,063,752	279,776,497	0.09%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep 15	買建	15	237,888,327	241,987,809	0.08%

(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27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2015年08月	売建	2,368,000	293,799,988	293,703,040	0.09%
		ユーロ売/円買201 5年08月	売建	1,257,000	171,078,202	170,637,750	0.05%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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

平成27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2015年08月	売建	390,000	48,389,640	48,371,700	1.76%
		オーストラリア・ドル 売/円買2015年0 8月	売建	90,000	8,153,100	8,152,200	0.30%

（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。

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2015年08月	買建	420,000	52,095,036	52,092,600	0.14%
		アメリカ・ドル売/円 買2015年08月	売建	8,100,000	1,005,015,600	1,004,643,000	2.75%
株価指数先物 取引	ICE-U S	MINI MSCI EMG MKT Se p15	買建	175	1,006,350,784	964,984,685	2.64%

（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27年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買 2 0 1 5 年 0 8 月	売建	2,100,000	260,559,600	260,463,000	0.45%

(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27年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成23年1月11日)	251	251	1.0795	1.0795
第2計算期間末 (平成24年1月11日)	413	413	0.9400	0.9400
第3計算期間末 (平成25年1月11日)	552	552	1.2495	1.2495
第4計算期間末 (平成26年1月14日)	760	760	1.5426	1.5426
第5計算期間末 (平成27年1月13日)	1,260	1,260	1.8245	1.8245
平成26年7月末日	970	-	1.6746	-
8月末日	1,003	-	1.6989	-
9月末日	1,080	-	1.7182	-
10月末日	1,128	-	1.7212	-
11月末日	1,237	-	1.8919	-
12月末日	1,267	-	1.8894	-
平成27年1月末日	1,300	-	1.8519	-
2月末日	1,372	-	1.9207	-
3月末日	1,412	-	1.9158	-
4月末日	1,494	-	1.9736	-
5月末日	1,553	-	2.0193	-
6月末日	1,527	-	1.9306	-
7月末日	1,545	-	1.9276	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
平成27年1月14日～ 平成27年7月13日	-

## 【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
第5計算期間	18.3
平成27年1月14日～ 平成27年7月13日	5.2

(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
第5計算期間	349,195,243	151,369,883
平成27年1月14日～ 平成27年7月13日	197,203,424	99,378,607

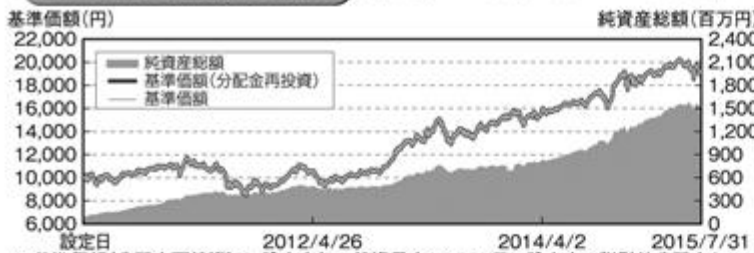
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## << 参考情報 >>

データの基準日:2015年7月31日

### 基準価額・純資産の推移 （設定日（2010年5月28日）～2015年7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	外国株式パッシブ・ファンドマザー・ファンド	45.85%
2	エマージング株式パッシブ・マザー・ファンド	30.95%
3	エマージング債券パッシブ・マザー・ファンド	9.10%
4	グローバルリートパッシブ・ファンドマザー・ファンド	4.47%
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	4.07%
6	外国債券パッシブ・ファンドマザー・ファンド	2.84%
7	国内債券パッシブ・ファンドマザー・ファンド	0.73%
8	J-REITインデックスファンドマザー・ファンド	0.40%

#### ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド

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

##### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.67
内 日本	97.67
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.33
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)	2.26

#### ■外国株式パッシブ・ファンド・マザー・ファンド

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

##### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.21
内 アメリカ	56.98
内 イギリス	7.92
内 スイス	4.18
内 フランス	3.69
内 ドイツ	3.67
内 その他	18.77
投資信託受益証券	0.28
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.06
内 アメリカ	1.71
内 イギリス	0.15
内 フランス	0.14
内 香港	0.05
内 カナダ	0.01
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.45
純資産総額	100.00

#### ■エマージング株式パッシブ・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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

##### ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	96.45
内 韓国	13.95
内 中国	12.62
内 台湾	12.06
内 インド	8.18
内 南アフリカ	7.59
内 その他	42.05
投資信託受益証券	0.74
内 メキシコ	0.74
投資証券	0.26
内 メキシコ	0.14
内 南アフリカ	0.06
内 トルコ	0.05
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.56
純資産総額	100.00

##### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.57%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.86%
3	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.66%
4	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.49%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.48%

##### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ関連	2.23%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.14%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油ガス消費燃料	1.09%
4	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.89%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.87%

##### 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(売建)	△0.30
株価指数先物取引(買建)	2.17

### 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
第5期	(2015.01.13)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万円当たりです。

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

○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3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」につきましては、以下の内容を追加いたします。

##### < 追 加 >

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成27年1月14日から平成27年7月13日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## マネックス資産設計ファンド エボリューション

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第5期 平成27年1月13日現在	第6期中間計算期間末 平成27年7月13日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	39,232,209	33,616,469
親投資信託受益証券	1,232,396,645	1,496,935,187
未収入金	-	6,200,000
流動資産合計	1,271,628,854	1,536,751,656
<b>資産合計</b>	<b>1,271,628,854</b>	<b>1,536,751,656</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,297,101	15,070,530
未払受託者報酬	423,364	540,201
未払委託者報酬	5,625,180	7,177,337
その他未払費用	42,999	54,903
流動負債合計	11,388,644	22,842,971
<b>負債合計</b>	<b>11,388,644</b>	<b>22,842,971</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,690,737,646	1,788,562,463
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	569,502,564	725,346,222
( 分配準備積立金 )	249,004,134	218,133,135
元本等合計	1,260,240,210	1,513,908,685
<b>純資産合計</b>	<b>1,260,240,210</b>	<b>1,513,908,685</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>1,271,628,854</b>	<b>1,536,751,656</b>



## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第5期中間計算期間		第6期中間計算期間	
	自	平成26年1月15日 至 平成26年7月14日	自	平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
<b>営業収益</b>				
受取利息		4,684		7,998
有価証券売買等損益		54,950,635		71,788,542
営業収益合計		54,955,319		71,796,540
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		309,323		540,201
委託者報酬		14,110,049		17,177,337
その他費用		31,403		54,903
営業費用合計		4,450,775		7,772,441
営業利益又は営業損失（ ）		50,504,544		64,024,099
経常利益又は経常損失（ ）		50,504,544		64,024,099
中間純利益又は中間純損失（ ）		50,504,544		64,024,099
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		1,167,935		9,453,155
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		267,436,213		569,502,564
剰余金増加額又は欠損金減少額		79,864,151		184,458,932
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		79,864,151		184,458,932
剰余金減少額又は欠損金増加額		31,165,460		83,186,218
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		31,165,460		83,186,218
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		365,471,513		725,346,222

## ( 3 ) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い  当ファンドは、原則として毎年1月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成27年1月13日、当中間計算期間末日を平成27年7月13日としております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期 平成27年1月13日現在	第6期中間計算期間末 平成27年7月13日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	492,912,286円 349,195,243円 151,369,883円	690,737,646円 197,203,424円 99,378,607円
2 . 受益権の総数	690,737,646口	788,562,463口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期中間計算期間 自 平成26年1月15日 至 平成26年7月14日	第6期中間計算期間 自 平成27年1月14日 至 平成27年7月13日
1 . 1 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	48,411円	70,683円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 平成27年1月13日現在	第6期中間計算期間末 平成27年7月13日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第5期 平成27年1月13日現在	第6期中間計算期間末 平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1,8245円	1,9198円
（1万口当たり純資産額）	（18,245円）	（19,198円）

（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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

#### 貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,144,078,193	6,929,438,458
株式	2	310,021,808,430	315,699,614,616
派生商品評価勘定		8,725,236	2,617,084
未収配当金		360,610,366	298,154,084
前払金		263,403,000	143,547,000
流動資産合計		319,798,625,225	323,073,371,242
資産合計		319,798,625,225	323,073,371,242
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		287,544,680	72,741,556
未払金		28,653,456	-
未払解約金		134,159,000	2,328,014,000
流動負債合計		450,357,136	2,400,755,556
負債合計		450,357,136	2,400,755,556
純資産の部			
元本等			
元本	1	163,582,012,277	138,587,667,315
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		155,766,255,812	182,084,948,371
元本等合計		319,348,268,089	320,672,615,686
純資産合計		319,348,268,089	320,672,615,686
負債純資産合計		319,798,625,225	323,073,371,242

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	184,628,470,006円	163,582,012,277円
同期中追加設定元本額	28,326,130,672円	9,763,833,161円
同期中一部解約元本額	49,372,588,401円	34,758,178,123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	4,050,936,134円	4,362,404,421円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,668,247,005円	1,529,860,430円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >	36,410,499,984円	35,429,218,983円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	761,856,710円	684,915,524円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,874,848,892円	2,641,508,603円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,083,858,969円	2,776,171,231円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	397,344,864円	345,968,388円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,320,795,677円	1,219,714,464円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,145,795,156円	1,060,913,826円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	79,034,540円	63,921,903円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,242,527,851円	1,181,223,508円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	28,285,705円	26,322,530円

D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	16,523,767円	17,299,081円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	31,567,277円	36,031,952円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	77,789,847円	89,203,441円
投資のソムリエ	145,126,893円	756,128,700円
クルーズコントロール	715,684,317円	140,012,301円
投資のソムリエ<DC年金>	2,119,892円	10,399,168円
D I A M 8資産バランスファンドN< DC年金>	31,437,441円	46,400,295円
D I A M D C バランス・F(成長 型)	4,310,499円	16,893,023円
クルーズコントロール<DC年金>	156,681円	41,111円
D I A Mアクティブアロケーション私募 ファンド(適格機関投資家限定)	-円	423,890,044円
D I A Mワールドバランス25VA(適 格機関投資家限定)	133,832,298円	110,619,477円
D I A Mグローバル・バランスファンド 25VA(適格機関投資家限定)	2,351,220,226円	1,202,685,119円
D I A Mグローバル・バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	635,341,939円	502,571,390円
D I A M国際分散バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	72,672,077円	44,077,447円
D I A M国際分散バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	306,900,165円	203,591,769円
D I A M国内重視バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	63,142,007円	46,860,062円
D I A M国内重視バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	120,735,185円	74,467,407円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	10,603,997,795円	6,938,509,908円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,748,124,949円	2,641,592,306円
D I A Mバランスファンド25VA(適 格機関投資家限定)	3,017,936,362円	2,284,966,402円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,080,118,791円	1,607,489,058円
D I A Mバランスファンド50VA(適 格機関投資家限定)	5,208,226,785円	4,197,637,341円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スVA(適格機関投資家限定)	441,450,309円	330,395,030円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スVA2(適格機関投資家限定)	1,193,777,005円	867,775,378円
D I A M アクサ グローバル バラン スファンド30VA(適格機関投資家限 定)	1,285,199,215円	996,950,326円

D I A M世界アセットバランスファンド V A ( 適格機関投資家向け )	5,670,823,408円	4,137,523,941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 )	93,432,732円	41,335,811円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	2,000,498,285円	1,372,939,277円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	6,655,657,141円	5,328,123,989円
D I A Mグローバル分散ファンドV A ( 適格機関投資家限定 )	212,459,752円	42,257,264円
D I A M世界アセットバランスファンド 2 V A ( 適格機関投資家限定 )	24,462,739,747円	20,173,972,938円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,039,739,874円	815,084,480円
D I A M世界アセットバランスファンド 2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	2,809,479,751円	2,348,889,165円
D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A ( 適格機関投資家限定 )	15,371,060,815円	12,747,730,166円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	38,223円	32,872円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	91,866円	79,718円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	65,471,021円	30,821,108円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A ( 適格機関投資家限定 )	13,766,293,963円	11,362,729,500円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機 関投資家限定 )	129,858,692円	108,420,018円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機 関投資家限定 )	45,696,398円	39,657,049円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	35,334円	30,381円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	110,635,704円	85,457,525円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	122,223円	2,616,293円
D I A M世界アセットバランスファンド 7 V A ( 1 2 1 2 ) ( 適格機関投資家限 定 )	818,354,088円	706,709,914円
D I A M世界アセットバランスファンド 7 V A ( 1 3 0 3 ) ( 適格機関投資家限 定 )	2,114,709,804円	1,838,513,776円
D I A M世界アセットバランスファンド 7 V A ( 1 3 0 6 ) ( 適格機関投資家限 定 )	2,751,007,520円	2,406,210,855円
D I A M世界アセットバランスファンド 7 V A ( 1 3 0 9 ) ( 適格機関投資家限 定 )	112,382,727円	89,899,928円
計	163,582,012,277円	138,587,667,315円

2 .	受益権の総数		163,582,012,277口		138,587,667,315口	
3 .	2	差入代用有価証券	株式	3,759,500,000円	株式	4,056,500,000円



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	8,951,710,000	-	8,673,095,000	278,615,000	6,169,032,000	-	6,099,030,000	70,002,000
合計	8,951,710,000	-	8,673,095,000	278,615,000	6,169,032,000	-	6,099,030,000	70,002,000

## （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ではありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.9522円	2.3139円
（1万口当たり純資産額）	(19,522円)	(23,139円)

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,634,847,374	3,934,112,077
国債証券		356,864,761,900	339,419,433,800
地方債証券		28,477,614,128	27,806,378,865
特殊債券		28,012,463,691	26,394,939,609
社債券		24,240,352,600	22,467,211,060
未収利息		1,166,808,153	1,082,770,376
前払費用		33,009,293	22,151,015
流動資産合計		441,429,857,139	421,126,996,802
資産合計		441,429,857,139	421,126,996,802
負債の部			
流動負債			
未払解約金		219,016,000	2,918,128,000
流動負債合計		219,016,000	2,918,128,000
負債合計		219,016,000	2,918,128,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	355,706,109,986	341,625,978,311
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		85,504,731,153	76,582,890,491
元本等合計		441,210,841,139	418,208,868,802
純資産合計		441,210,841,139	418,208,868,802
負債純資産合計		441,429,857,139	421,126,996,802

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	384,301,757,056円	355,706,109,986円
	同期中追加設定元本額	46,387,869,490円	32,021,080,215円
	同期中一部解約元本額	74,983,516,560円	46,101,211,890円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M国内債券バッシブ・ファンド	8,382,784,644円	10,194,070,381円
	D I A M国内債券インデックスファンド	10,855,812,915円	10,964,684,981円
	< D C 年金 >		
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	4,226,550,798円	4,504,016,816円
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	6,556,972,539円	7,051,594,720円
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	2,709,546,666円	2,885,281,806円
	D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	1,654,448,516円	1,727,685,920円
	D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,773,518,243円	1,922,594,428円
	D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	258,526,847円	285,162,823円
	マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	121,943,264円	124,568,526円
	マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	1,935,623,071円	2,344,669,637円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	7,965,036円	6,016,165円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 1 0 )	153,360,119円	182,328,817円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 2 0 )	106,659,104円	141,269,796円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 3 0 )	30,926,406円	42,287,045円
	投資のソムリエ	3,643,791,819円	9,912,612,951円
	クルーズコントロール	1,274,868,230円	333,830,632円
	投資のソムリエ< D C 年金 >	55,337,003円	139,816,158円
	D I A M 8 資産バランスファンドN < D C 年金 >	290,351,381円	505,119,320円
	D I A M D C バランス・F (成長型)	3,715,649円	17,797,024円
	クルーズコントロール< D C 年金 >	279,469円	94,924円
	みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
	D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
	D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
	D I A M国内債券バッシブファンド(適格機関投資家向け)	12,736,663,724円	12,027,510,061円

D I A Mアクティブアロケーション私募 ファンド(適格機関投資家限定)	- 円	24,226,043円
D I A Mワールドバランス25VA(適 格機関投資家限定)	713,490,099円	695,661,130円
D I A Mグローバル・バランスファンド 25VA(適格機関投資家限定)	4,576,994,987円	2,756,649,468円
D I A Mグローバル・バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	411,769,532円	383,538,547円
D I A M国際分散バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	275,098,932円	196,961,758円
D I A M国際分散バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	746,440,714円	583,185,967円
D I A M国内重視バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	255,985,978円	224,202,904円
D I A M国内重視バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	261,050,260円	189,733,936円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	25,790,521,333円	19,874,418,620円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	9,115,933,857円	7,566,552,491円
D I A Mバランスファンド25VA(適 格機関投資家限定)	13,055,910,431円	11,638,320,717円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	5,059,949,119円	4,614,755,065円
D I A Mバランスファンド50VA(適 格機関投資家限定)	8,443,676,938円	8,013,294,102円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スVA(適格機関投資家限定)	1,075,116,553円	947,817,654円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スVA2(適格機関投資家限定)	4,837,898,699円	4,155,687,596円
D I A M アクサ グローバル balan スファンド30VA(適格機関投資家限 定)	6,251,610,037円	5,746,873,429円
D I A M世界アセットバランスファンド VA(適格機関投資家向け)	9,193,418,931円	7,904,120,989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)	492,774,489円	900,011,011円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	9,735,911,951円	7,874,894,570円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	8,722,859,092円	8,201,760,441円
D I A Mグローバル分散ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,163,837,203円	260,636,911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)	105,848,232,159円	102,773,581,647円
D I A M世界アセットバランスファンド 40VA(適格機関投資家限定)	1,685,556,270円	1,557,161,668円

D I A M世界アセットバランスファンド 2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	9,113,269,251円	8,971,992,352円
D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A ( 適格機関投資家限定 )	33,245,672,660円	32,496,632,249円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	496,271円	502,014円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	372,604円	380,784円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	106,141,365円	58,836,852円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A ( 適格機関投資家限定 )	37,214,558,363円	36,228,782,319円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機 関投資家限定 )	699,496,865円	681,242,814円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機 関投資家限定 )	172,879,508円	176,716,604円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	575,601円	578,700円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	628,772,729円	575,067,603円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適格機関投 資家限定 )	330,923円	8,325,586円
計	355,706,109,986円	341,625,978,311円
2 . 受益権の総数	355,706,109,986口	341,625,978,311口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1,240円	1,224円
（1万口当たり純資産額）	(12,404円)	(12,242円)



## 「J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		90,967,370	514,592,003
投資証券		29,378,877,000	20,592,277,900
未収入金		201,772,800	-
未収配当金		220,408,007	203,063,456
流動資産合計		29,892,025,177	21,309,933,359
資産合計		29,892,025,177	21,309,933,359
負債の部			
流動負債			
未払金		-	432,153,693
未払解約金		202,740,000	2,791,000
流動負債合計		202,740,000	434,944,693
負債合計		202,740,000	434,944,693
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,405,369,329	13,080,131,931
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		13,283,915,848	7,794,856,735
元本等合計		29,689,285,177	20,874,988,666
純資産合計		29,689,285,177	20,874,988,666
負債純資産合計		29,892,025,177	21,309,933,359

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	13,323,636,866円	16,405,369,329円
同期中追加設定元本額	39,560,113,964円	7,771,120,284円
同期中一部解約元本額	36,478,381,501円	11,096,357,682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>	31,580,500円	19,617,425円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	498,552,758円	361,892,952円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,134,070円	3,559,190円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	5,774,762円	7,439,572円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	14,676,677円	20,152,377円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	39,950,229円	56,381,518円
投資のソムリエ	160,194,756円	273,099,340円
投資のソムリエ<DC年金>	2,357,889円	3,553,582円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	10,739,939円	19,370,382円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201210（適格機関投資家限定）	2,085,521,517円	2,053,707,555円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212（適格機関投資家限定）	1,126,860,320円	1,109,657,775円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401（適格機関投資家限定）	2,196,070,750円	2,161,914,672円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家向け）	9,195,588,058円	6,177,926,213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）	133,968,705円	56,348,609円

D I A Mグローバル分散ファンドV A (適格機関投資家限定)	164,822,352円	40,588,147円
D I A Mグローバル・リスクファク ター・パリティ戦略ファンド(適格機関 投資家限定)	270,176,885円	273,826,779円
D I A Mグローバル・リスクファク ター・パリティ戦略ファンドI I(適格 機関投資家限定)	138,455,191円	403,618,175円
D I A M リスクコントロールJ - R E I Tファンド(適格機関投資家限定)	325,943,971円	37,477,668円
計	16,405,369,329円	13,080,131,931円
2 . 受益権の総数	16,405,369,329口	13,080,131,931口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.8097円	1.5959円
（1万口当たり純資産額）	（18,097円）	（15,959円）

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,318,013,164	1,752,765,889
コール・ローン		108,708,644	1,282,659,298
株式		286,112,610,214	291,030,892,832
投資信託受益証券		905,249,900	848,351,630
投資証券		6,475,558,260	6,279,970,441
派生商品評価勘定		1,509,601	15,327,722
未収入金		-	69,728,729
未収配当金		310,992,682	364,321,040
差入委託証拠金		1,478,157,835	1,063,368,206
流動資産合計		300,710,800,300	302,707,385,787
資産合計		300,710,800,300	302,707,385,787
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		197,368,051	7,277,394
未払解約金		103,764,000	1,591,118,000
流動負債合計		301,132,051	1,598,395,394
負債合計		301,132,051	1,598,395,394
純資産の部			
元本等			
元本	1	109,595,049,033	101,093,625,635
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		190,814,619,216	200,015,364,758
元本等合計		300,409,668,249	301,108,990,393
純資産合計		300,409,668,249	301,108,990,393
負債純資産合計		300,710,800,300	302,707,385,787

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	135,913,743,805円	109,595,049,033円
	同期中追加設定元本額	10,573,446,453円	7,048,160,386円
	同期中一部解約元本額	36,892,141,225円	15,549,583,784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	967,569,789円	1,057,710,072円
	D I A M外国株式インデックスファンド < D C 年金 >	34,130,353,349円	33,874,452,407円
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	142,401,445円	140,592,583円
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	826,694,029円	828,101,362円
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,036,116,296円	1,037,093,422円
	D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	141,615,188円	137,192,322円
	D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	404,789,618円	403,472,656円
	D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	322,188,869円	330,112,172円
	マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	51,106,864円	46,028,751円
	マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	795,210,482円	842,449,000円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	212,134,966円	230,975,699円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 1 0 )	11,580,508円	13,626,492円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 2 0 )	22,293,003円	28,038,338円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 3 0 )	55,218,896円	70,469,211円
	投資のソムリエ	161,486,875円	246,196,365円
	クルーズコントロール	259,259,955円	48,135,914円
	投資のソムリエ< D C 年金 >	2,415,761円	3,430,343円
	D I A M 8 資産バランスファンド N < D C 年金 >	22,120,203円	36,616,505円
	D I A M D C バランス・F (成長型)	1,434,718円	6,359,319円
	クルーズコントロール< D C 年金 >	56,934円	13,159円
	D I A M外国株式インデックスファンド V A (適格機関投資家専用)	359,550,244円	307,689,726円
	D I A M外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	3,395,213,038円	3,402,793,462円
	D I A Mアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	- 円	248,285,051円

D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	39,602,290円	37,428,332円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,627,167,742円	951,806,758円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	439,590,284円	397,074,310円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	50,186,746円	34,876,695円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	317,924,792円	241,092,306円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	21,792,015円	18,508,821円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,688,057円	39,300,546円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	7,323,098,894円	5,490,210,710円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,883,246,591円	3,135,710,029円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,390,488,703円	1,204,917,500円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,258,021,391円	1,112,676,523円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,600,959,018円	3,321,021,838円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	1,545,547,137円	1,305,925,295円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	2,485,691,766円	2,062,752,135円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,778,266,700円	1,582,584,702円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	1,305,107,887円	1,085,198,775円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	28,088,225円	11,130,233円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,278,827,547円	4,894,631,283円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	1,865,824,960円	1,660,483,001円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	49,556,839円	11,112,697円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	11,272,588,735円	10,638,721,878円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	718,334,219円	644,913,031円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,940,746,945円	1,858,539,067円



D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A (適格機関投資家限定)	7,083,202,420円	6,721,777,124円
D I A Mバランス30 V A (適格機関投 資家限定)	132,536円	128,952円
D I A Mバランス50 V A (適格機関投 資家限定)	254,447円	249,413円
D I A Mバランス70 V A (適格機関投 資家限定)	165,877,353円	89,390,196円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定)	9,518,527,609円	8,990,836,536円
D I A Mバランス20 V A (適格機関投 資家限定)	73,879円	69,952円
D I A Mバランス40 V A (適格機関投 資家限定)	229,568,347円	204,545,606円
D I A Mバランス60 V A (適格機関投 資家限定)	253,929円	6,177,060円
計	109,595,049,033円	101,093,625,635円
2 . 受益権の総数	109,595,049,033口	101,093,625,635口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	432,311,540	-	432,108,000	203,540	321,761,660	-	324,334,900	2,573,240
アメリカ・ドル	271,602,040	-	271,400,000	202,040	254,237,632	-	256,004,100	1,766,468
イギリス・ポンド	71,625,200	-	71,624,000	1,200	14,955,424	-	15,199,200	243,776
オーストラリア・ドル	19,224,600	-	19,224,000	600	8,173,260	-	8,190,900	17,640
カナダ・ドル	-	-	-	-	6,699,056	-	6,754,300	55,244
ユーロ	69,859,700	-	69,860,000	300	37,696,288	-	38,186,400	490,112
買 建	-	-	-	-	154,787,648	-	154,779,300	8,348
アメリカ・ドル	-	-	-	-	95,548,596	-	95,542,200	6,396
イギリス・ポンド	-	-	-	-	15,199,632	-	15,199,200	432
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	7,280,736	-	7,280,000	736
カナダ・ドル	-	-	-	-	6,754,776	-	6,754,300	476
ユーロ	-	-	-	-	30,003,908	-	30,003,600	308
合計	432,311,540	-	432,108,000	203,540	476,549,308	-	479,114,200	2,581,588

(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27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	6,635,183,872	-	6,439,121,882	196,061,990	3,035,394,383	-	3,046,026,299	10,631,916
合計	6,635,183,872	-	6,439,121,882	196,061,990	3,035,394,383	-	3,046,026,299	10,631,916

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	2.7411円	2.9785円
(1万口当たり純資産額)	(27,411円)	(29,785円)

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		6,451,879,863	1,360,934,554
コール・ローン		231,146,245	2,732,970,410
国債証券		339,509,632,851	313,493,457,074
派生商品評価勘定		3,786,257	-
未収入金		-	2,612,479,827
未収利息		3,502,272,218	3,253,191,813
前払費用		148,326,271	93,224,520
流動資産合計		349,847,043,705	323,546,258,198
資産合計		349,847,043,705	323,546,258,198
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,651	1,992,268
未払解約金		423,444,000	2,706,096,000
流動負債合計		423,445,651	2,708,088,268
負債合計		423,445,651	2,708,088,268
純資産の部			
元本等			
元本	1	184,357,351,879	170,818,512,952
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		165,066,246,175	150,019,656,978
元本等合計		349,423,598,054	320,838,169,930
純資産合計		349,423,598,054	320,838,169,930
負債純資産合計		349,847,043,705	323,546,258,198

## 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 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。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準  外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	238,565,930,026円	184,357,351,879円
	同期中追加設定元本額	11,391,660,724円	11,864,235,884円
	同期中一部解約元本額	65,600,238,871円	25,403,074,811円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M外国債券パッシブ・ファンド	3,747,764,642円	3,739,955,077円
	D I A M外国債券インデックスファンド	4,536,125,259円	4,504,600,141円
	< D C 年金 >		
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	332,819,158円	360,227,743円
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	1,204,193,283円	1,231,175,425円
	D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,283,089,973円	1,388,504,234円
	D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	306,121,293円	318,368,598円
	D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	670,724,830円	686,249,995円
	D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	478,391,835円	529,196,806円
	マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	32,054,046円	29,719,643円
	マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	501,452,891円	547,594,817円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	16,624,909円	16,155,417円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 1 0 )	5,160,065円	6,286,163円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 2 0 )	8,782,941円	11,901,686円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国 3 0 )	19,744,365円	27,855,502円
	クルーズコントロール	885,022,133円	210,093,026円
	D I A M 8 資産バランスファンドN < D C 年金 >	9,721,038円	17,249,939円
	D I A M D C バランス・F (成長型)	1,738,674円	8,400,893円
	クルーズコントロール< D C 年金 >	194,019円	58,648円
	D I A Mパッシブ資産分散ファンド	2,227,629,276円	2,024,104,501円
	D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,688,226,666円	6,718,913,906円
	D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,764,591,206円	4,837,773,709円
	外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	1,251,618,358円	2,394,893,160円

D I A Mアクティブアロケーション私募 ファンド(適格機関投資家限定)	- 円	523,400,475円
D I A Mワールドバランス25VA(適 格機関投資家限定)	137,985,876円	137,666,300円
D I A Mグローバル・バランスファンド 25VA(適格機関投資家限定)	11,665,120,371円	7,191,626,493円
D I A Mグローバル・バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	1,049,947,106円	999,639,025円
D I A M国際分散バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	174,793,937円	128,129,662円
D I A M国際分散バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	315,815,862円	252,620,337円
D I A M国内重視バランスファンド30 VA(適格機関投資家限定)	64,978,129円	58,314,719円
D I A M国内重視バランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	41,538,704円	30,894,116円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	16,371,118,623円	12,955,794,481円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,857,045,002円	3,287,713,334円
D I A Mバランスファンド25VA(適 格機関投資家限定)	7,253,810,263円	6,638,042,197円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	3,481,523,297円	3,252,346,181円
D I A Mバランスファンド50VA(適 格機関投資家限定)	5,372,075,522円	5,223,682,080円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スVA(適格機関投資家限定)	1,141,104,943円	1,029,170,047円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スVA2(適格機関投資家限定)	4,307,979,910円	3,792,253,872円
D I A M アクサ グローバル balan スファンド30VA(適格機関投資家限 定)	5,322,553,526円	4,991,876,586円
D I A M世界アセットバランスファンド VA(適格機関投資家向け)	21,651,573,016円	18,875,693,648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)	107,414,303円	54,973,620円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,089,052,823円	2,568,237,535円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	12,515,502,603円	11,984,474,146円
D I A Mグローバル分散ファンドVA (適格機関投資家限定)	147,929,554円	34,311,159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)	16,797,561,741円	16,733,153,615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)	21,114,464,344円	21,157,537,979円



D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	118,487円	122,238円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	236,667円	246,953円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	67,394,745円	38,353,447円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	18,916,107,776円	18,862,307,444円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	135,102,481円	134,936,264円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	110,039円	112,876円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	285,475,407円	268,358,046円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	125,962円	3,245,048円
計	184,357,351,879円	170,818,512,952円
2. 受益権の総数	184,357,351,879口	170,818,512,952口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,302,259,946	-	1,298,475,340	3,784,606	149,977,374	-	151,927,320	1,949,946
アメリカ・ドル	432,142,366	-	432,116,000	26,366	-	-	-	-
イギリス・ボン ド	170,990,190	-	169,211,700	1,778,490	-	-	-	-
カナダ・ドル	144,001,273	-	143,996,160	5,113	-	-	-	-
ユーロ	555,126,117	-	553,151,480	1,974,637	149,977,374	-	151,927,320	1,949,946
買 建	-	-	-	-	970,528,082	-	970,485,760	42,322
アメリカ・ドル	-	-	-	-	436,828,581	-	436,799,340	29,241
イギリス・ボン ド	-	-	-	-	96,897,654	-	96,894,900	2,754
カナダ・ドル	-	-	-	-	97,075,780	-	97,068,940	6,840
ユーロ	-	-	-	-	339,726,067	-	339,722,580	3,487
合計	1,302,259,946	-	1,298,475,340	3,784,606	1,120,505,456	-	1,122,413,080	1,992,268

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.8954円	1.8782円
（1万口当たり純資産額）	（18,954円）	（18,782円）

## 「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		163,507,945	24,162,644
コール・ローン		43,671,003	22,609,171
投資信託受益証券		373,604,589	305,253,319
投資証券		2,991,717,674	2,420,542,286
派生商品評価勘定		2,335,790	-
未収入金		11,116,000	-
未収配当金		16,313,022	10,824,110
流動資産合計		3,602,266,023	2,783,391,530
資産合計		3,602,266,023	2,783,391,530
負債の部			
流動負債			
未払解約金		183,025,000	361,000
流動負債合計		183,025,000	361,000
負債合計		183,025,000	361,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,923,727,376	1,599,573,563
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		1,495,513,647	1,183,456,967
元本等合計		3,419,241,023	2,783,030,530
純資産合計		3,419,241,023	2,783,030,530
負債純資産合計		3,602,266,023	2,783,391,530

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	2,498,251,197円	1,923,727,376円
	同期中追加設定元本額	205,080,258円	30,687,186円
	同期中一部解約元本額	779,604,079円	354,840,999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>	29,781,473円	18,140,323円
	マネックス資産設計ファンド<育成型>	459,755,435円	333,094,710円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	46,261,613円	37,390,672円
	D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,308,892,727円	1,178,218,184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）	79,036,128円	32,729,674円
	計	1,923,727,376円	1,599,573,563円
2 .	受益権の総数	1,923,727,376口	1,599,573,563口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	158,320,673	-	155,984,883	2,335,790	-	-	-	-
アメリカ・ドル	119,862,000	-	118,000,000	1,862,000	-	-	-	-
イギリス・ポンド	10,856,520	-	10,743,600	112,920	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	10,712,570	-	10,574,300	138,270	-	-	-	-
ユーロ	9,932,943	-	9,817,983	114,960	-	-	-	-
香港・ドル	6,956,640	-	6,849,000	107,640	-	-	-	-
合計	158,320,673	-	155,984,883	2,335,790	-	-	-	-

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7774円 (17,774円)	1.7399円 (17,399円)



## 「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 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,428,844,217	248,464,699
コール・ローン		44,695,119	658,287,423
株式		38,353,170,787	36,292,364,793
投資信託受益証券		297,864,319	274,130,570
投資証券		91,615,781	96,583,938
派生商品評価勘定		20,925,632	544,512
未収入金		76,392	74,409
未収配当金		24,764,588	201,554,902
差入委託証拠金		421,436,133	112,423,029
流動資産合計		40,683,392,968	37,884,428,275
資産合計		40,683,392,968	37,884,428,275
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,359,020	8,084,635
未払金		57,551,435	-
未払解約金		11,211,000	896,208,000
流動負債合計		71,121,455	904,292,635
負債合計		71,121,455	904,292,635
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,367,301,761	34,877,056,190
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		1,244,969,752	2,103,079,450
元本等合計		40,612,271,513	36,980,135,640
純資産合計		40,612,271,513	36,980,135,640
負債純資産合計		40,683,392,968	37,884,428,275

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,097,535,766円	39,367,301,761円
	同期中追加設定元本額	8,038,458,670円	5,795,099,854円
	同期中一部解約元本額	10,768,692,675円	10,285,345,425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< D C 年金 >	425,843,375円	624,375,460円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	352,069,381円	471,911,104円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	15,920,298円	19,255,615円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	40,474,103円	52,387,010円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	110,434,511円	143,956,918円
	投資のソムリエ	163,231,034円	993,644,405円
	クルーズコントロール	635,058,506円	128,593,567円
	投資のソムリエ< D C 年金 >	2,424,454円	13,059,934円
	D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金 >	29,770,153円	49,802,281円
	クルーズコントロール< D C 年金 >	139,333円	27,835円
	エマージング株式パッシブファンドV A（適格機関投資家専用）	7,257,789,094円	6,483,405,232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）	3,074,267,724円	192,233,956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）	2,127,223,667円	2,125,053,586円
	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	15,436,504,597円	14,453,464,848円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	9,696,151,531円	9,125,884,439円
	計	39,367,301,761円	34,877,056,190円
2 .	受益権の総数	39,367,301,761口	34,877,056,190口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	330,420,160	-	330,400,000	20,160	-	-	-	-
アメリカ・ドル	330,420,160	-	330,400,000	20,160	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	159,247,660	-	159,237,000	10,660
アメリカ・ドル	-	-	-	-	159,247,660	-	159,237,000	10,660
合計	330,420,160	-	330,400,000	20,160	159,247,660	-	159,237,000	10,660

(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27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,504,858,799	-	1,523,405,251	18,546,452	726,028,713	-	718,499,250	7,529,463
合計	1,504,858,799	-	1,523,405,251	18,546,452	726,028,713	-	718,499,250	7,529,463

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.0316円	1.0603円
(1万口当たり純資産額)	(10,316円)	(10,603円)

## 「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 番号	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		685,209,686	623,791,834
コール・ローン		443,812,212	982,056,029
国債証券		40,303,011,312	48,532,599,607
派生商品評価勘定		22,176	-
未収利息		686,705,887	767,284,639
前払費用		72,571,702	161,039,789
流動資産合計		42,191,332,975	51,066,771,898
資産合計		42,191,332,975	51,066,771,898
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,423,900	27,880
未払解約金		9,628,000	955,732,000
流動負債合計		16,051,900	955,759,880
負債合計		16,051,900	955,759,880
純資産の部			
元本等			
元本	1	23,920,411,405	27,089,131,404
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		18,254,869,670	23,021,880,614
元本等合計		42,175,281,075	50,111,012,018
純資産合計		42,175,281,075	50,111,012,018
負債純資産合計		42,191,332,975	51,066,771,898

## 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27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	25,243,130,380円	23,920,411,405円
同期中追加設定元本額	12,688,399,670円	16,203,857,560円
同期中一部解約元本額	14,011,118,645円	13,035,137,561円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,510,133円	75,276,928円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	9,269,550円	10,713,973円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	23,576,273円	30,173,185円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	64,534,061円	83,712,861円
投資のソムリエ	317,759,242円	1,107,588,380円
クルーズコントロール	388,706,635円	82,664,940円
投資のソムリエ＜DC年金＞	4,658,413円	15,453,480円
D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	17,435,324円	29,537,927円
クルーズコントロール＜DC年金＞	85,282円	22,814円
グローバル債券ファンド（適格機関投資家限定）	321,885,428円	- 円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	2,179,089,966円	4,780,408,947円
為替フルヘッジ型エマージング債券ファンド（適格機関投資家限定）	717,844,856円	430,579,099円



エマージング債券パッシブファンドV A (適格機関投資家専用)	4,168,767,002円	3,864,258,176円
D I A M世界アセットバランスファンド 2 V A (適格機関投資家限定)	9,023,579,707円	8,553,729,531円
D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A (適格機関投資家限定)	5,668,623,377円	5,402,368,452円
D I A Mグローバル・リスクファク ター・パリティ戦略ファンド(適格機関 投資家限定)	633,964,361円	1,061,772,771円
D I A Mグローバル・リスクファク ター・パリティ戦略ファンドI I (適格 機関投資家限定)	323,121,795円	1,560,869,940円
計	23,920,411,405円	27,089,131,404円
2 . 受益権の総数	23,920,411,405口	27,089,131,404口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成27年1月13日 現在				平成27年7月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	363,462,176	-	363,440,000	22,176	-	-	-	-
アメリカ・ドル	363,462,176	-	363,440,000	22,176	-	-	-	-
買 建	413,523,900	-	407,100,000	6,423,900	416,493,880	-	416,466,000	27,880
アメリカ・ドル	413,523,900	-	407,100,000	6,423,900	416,493,880	-	416,466,000	27,880
合計	776,986,076	-	770,540,000	6,401,724	416,493,880	-	416,466,000	27,880

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成27年1月13日現在	平成27年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.7632円	1.8499円
(1万口当たり純資産額)	(17,632円)	(18,499円)

## 2【ファンドの現況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## 【純資産額計算書】

平成27年7月31日現在

資産総額	1,548,843,127円
負債総額	3,457,377円
純資産総額（ - ）	1,545,385,750円
発行済数量	801,720,764口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9276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27年7月31日現在

資産総額	334,349,814,193円
負債総額	1,392,734,640円
純資産総額（ - ）	332,957,079,553円
発行済数量	139,901,517,046口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3799円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	424,825,443,690円
負債総額	6,583,061,000円
純資産総額（ - ）	418,242,382,690円
発行済数量	340,506,370,999口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2283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27年7月31日現在

資産総額	23,533,068,990円
負債総額	85,057,364円
純資産総額（ - ）	23,448,011,626円
発行済数量	14,104,450,365口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6625円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	307,804,103,320円
負債総額	552,927,603円
純資産総額（ - ）	307,251,175,717円
発行済数量	100,894,274,261口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0453円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	325,871,182,816円
負債総額	1,864,142,000円
純資産総額（ - ）	324,007,040,816円
発行済数量	169,460,386,116口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9120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27年7月31日現在

資産総額	2,795,969,747円
負債総額	55,000,000円
純資産総額（ - ）	2,740,969,747円
発行済数量	1,543,297,670口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7760円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	37,884,364,639円
負債総額	1,324,245,498円
純資産総額（ - ）	36,560,119,141円
発行済数量	35,461,373,304口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0310円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年7月31日現在

資産総額	58,858,910,364円
負債総額	435,546,000円
純資産総額（ - ）	58,423,364,364円
発行済数量	31,315,412,668口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8656円

## 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】

原届出書の「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」につきまして、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額

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

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構

##### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

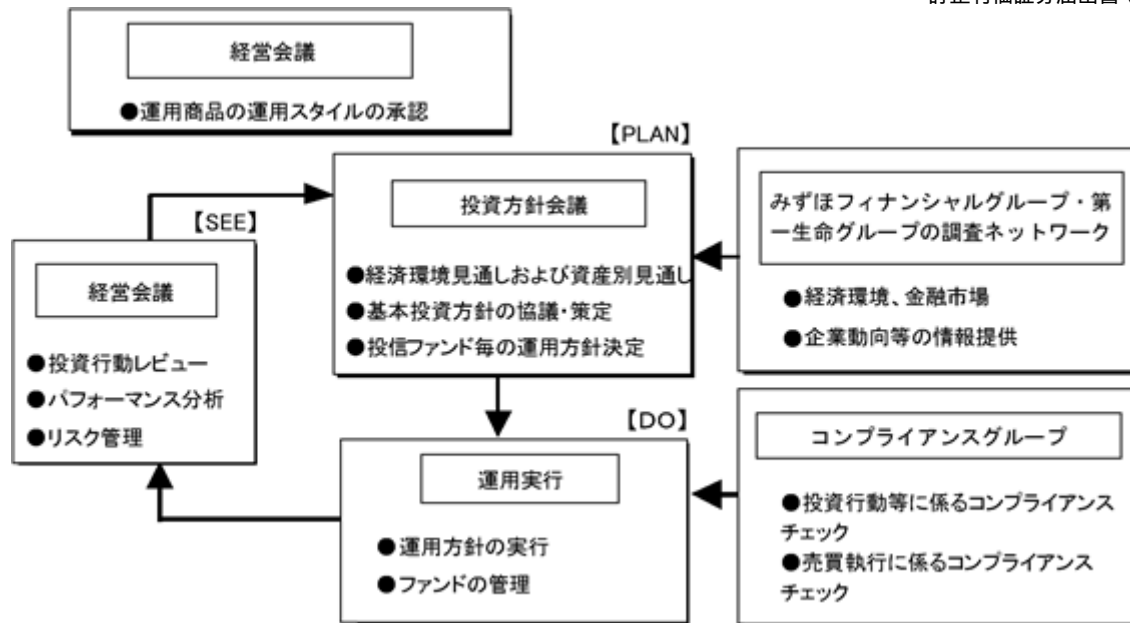
##### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成27年7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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

### <更新・訂正後>

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

平成27年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は375本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	6	23,992,674,369
追加型株式投資信託	339	5,904,571,221,646
単位型公社債投資信託	30	246,332,588,361
追加型公社債投資信託	0	0
合計	375	6,174,896,484,376

### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第30期事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。



## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

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

（単位：千円）

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

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

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

（単位：千円）

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

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 重要な会計方針

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

## 会計方針の変更

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

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

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

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

## 注記事項

（貸借対照表関係）

### 1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

### 2. 関係会社項目

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

（千円）

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



## （損益計算書関係）

## 1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

## 2. 固定資産売却損の内訳

（千円）

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

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

### (3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

#### 第29期（平成26年3月31日現在）

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

#### 第30期（平成27年3月31日現在）

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第29期（平成26年3月31日現在）

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

## 第30期（平成27年3月31日現在）

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

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

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券  
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券  
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券  
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第29期（平成26年3月31日現在）

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

## 2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

## 3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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



## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

## （セグメント情報等）

## 1．セグメント情報

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

## 2．関連情報

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

## （1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者との取引)

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社の関係会社	東京都千代田区	2,102 億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務1名, 出向2名, 転籍3名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	801,412	未収投資助言報酬	212,159

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その 他 の 関 係 会 社	第一生命保険株式会社の関係会社	東京都千代田区	3,431 億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	862,448	未収投資助言報酬	237,575

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

## 第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## （1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

平成27年3月末日現在 247,369百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成27年3月末日現在

#### (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27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26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。



## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年8月27日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### P w C あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	鶴 田 光夫 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27年1月14日から平成27年7月13日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド エボリューションの平成27年7月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成27年1月14日から平成27年7月13日まで）の損益の状況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

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、公認会計士の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

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

X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成27年6月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。