

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年10月12日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券に係る ファンドの名称】	マネックス資産設計ファンド エボリューション
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

#### 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28年4月12日付をもって提出した有価証券届出書（平成28年9月30日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書で訂正済。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】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

#### ファンドの特色

##### ① 世界の株式、債券、リートを実質的な投資対象とし、分散された基本ポートフォリオを構築します。

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



##### <投資対象とするマザーファンド>

先進国株式	国内株式(リップ・ファンド(最適化法)-マザーファンド)
	外国株式(リップ・ファンド-マザーファンド)
新興国株式	エマージング株式(リップ-マザーファンド)
先進国債券	国内債券(リップ・ファンド-マザーファンド)
	外国債券(リップ・ファンド-マザーファンド)
新興国債券	エマージング債券(リップ-マザーファンド)
先進国リート	J-REITインデックスファンド-マザーファンド
	外国リート(リップ・ファンド-マザーファンド)

※外国リートの投資対象マザーファンドは2016年4月13日に「グローバルリート(リップ・ファンド)-マザーファンド」から「外国リート(リップ・ファンド)-マザーファンド」に変更した。なお、当該移行期間中においては、「グローバルリート(リップ・ファンド)-マザーファンド」にも保有することがあります。

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

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

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

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

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

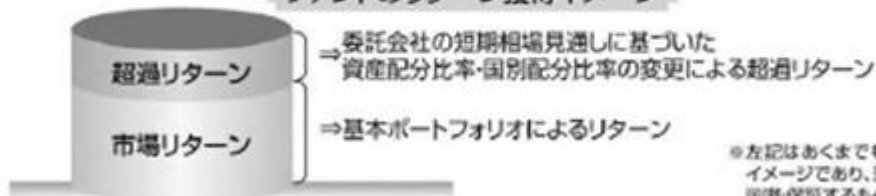
(\*)過去30年間(1985年～2015年)の日経平均株価の標準偏差は概ね年率20%程度です。

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

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

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

#### ファンドのリターン獲得イメージ



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

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

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

※上記の内容は、委託会社が信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の完全性、正確性を保証するものではありません。

※上記の内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

(略)

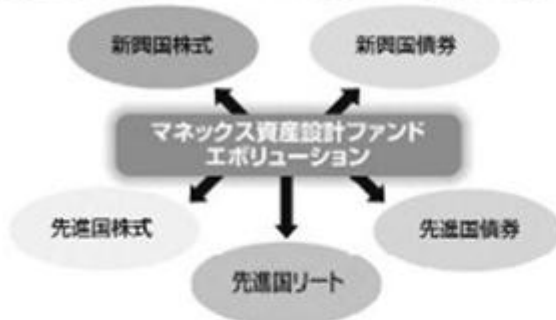
<訂正後>

(略)

## ファンドの特色

### ① 世界の株式、債券、リートを実質的な投資対象とし、分散された基本ポートフォリオを構築します。

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



#### <投資対象とするマザーファンド>

先進国株式	国内株式バシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
	外国株式バシブ・ファンド・マザーファンド
新興国株式	エマージング株式バシブ・マザーファンド
先進国債券	国内債券バシブ・ファンド・マザーファンド
	外国債券バシブ・ファンド・マザーファンド
新興国債券	エマージング債券バシブ・マザーファンド
先進国リート	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
	外国リートバシブ・ファンド・マザーファンド

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

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

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

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

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

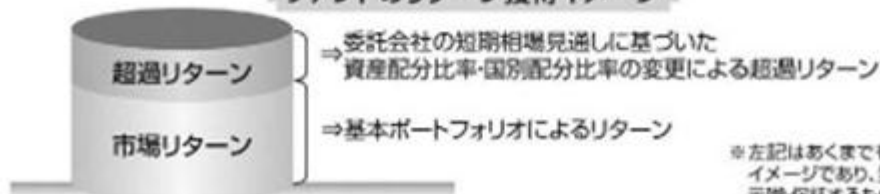
(\*)過去30年間(1985年～2015年)の日経平均株価の標準偏差は概ね年率20%程度です。

日経平均株価(日経平均)は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、日経平均白体及び日経平均を算定する手法に対して、著作権その他の一切の知的財産権を有します。本商品は、委託会社の責任のもとで組成・運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、本商品を保証するものではなく、本商品に関して一切の責任を負いません。

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

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

#### ファンドのリターン獲得イメージ



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

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

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

※上記の内容は、委託会社が信頼できると判断した情報に基づき作成しておりますが、情報の完全性、正確性を保証するものではありません。

※上記の内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

(略)

## 2【投資方針】

## (2)【投資対象】

&lt;訂正前&gt;

(略)

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

(略)

外国リートの投資対象マザーファンドは2016年4月13日に「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」から「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更しました。なお、当該移行期間中においては、「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」も少額保有することがあります。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

&lt;訂正後&gt;

(略)

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

(略)

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

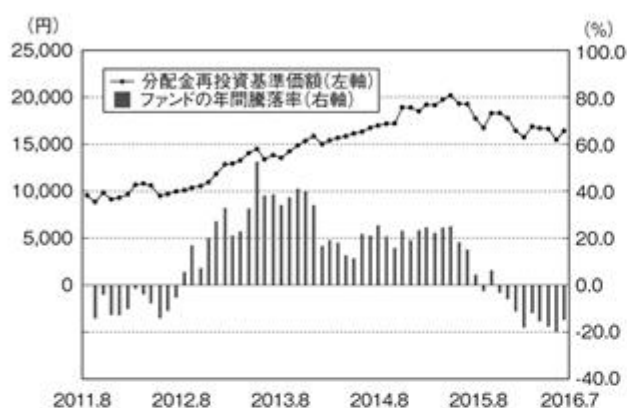
### 3【投資リスク】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク 「参考情報」」につきまして、以下の内容に更新・訂正いたします。

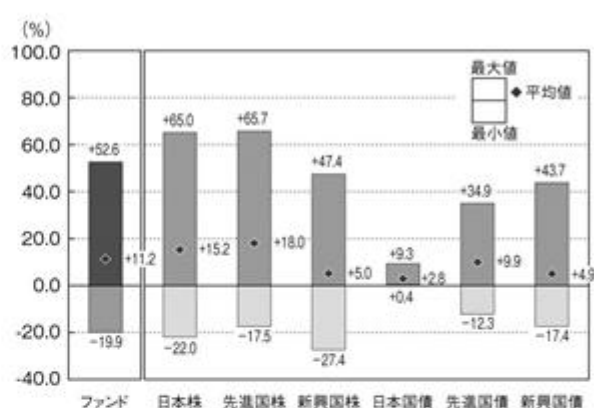
<更新・訂正後>

#### (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



2011年8月～2016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・ディバーシファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円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、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」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】

## (3)【信託報酬等】

&lt;訂正前&gt;

(略)

委託会社の信託報酬には、当ファンドおよびグローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの投資顧問会社への報酬が含まれます。

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

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

平成28年4月13日以降、グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンドへの投資を行わないこととなった場合には、上記の当該マザーファンドの投資顧問会社が受ける報酬は発生しません。

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社への報酬が含まれます。

(略)

## (5)【課税上の取扱い】

&lt;訂正前&gt;

(略)

上記は、平成28年4月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

上記は、平成28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28年7月29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	1,376,887,492	98.48
内 日本	1,376,887,492	98.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	21,186,968	1.52
純資産総額	1,398,074,460	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28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	277,175,488,620	97.94
内 日本	277,175,488,620	97.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,834,222,745	2.06
純資産総額	283,009,711,365	100.00

その他資産の投資状況

平成28年7月29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）	5,938,395,000	2.10
内 日本	5,938,395,000	2.10

（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28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	322,071,257,000	82.90
内 日本	322,071,257,000	82.90
地方債証券	24,707,867,774	6.36
内 日本	24,707,867,774	6.36
特殊債券	21,295,465,693	5.48
内 日本	21,295,465,693	5.48
社債券	18,726,857,290	4.82
内 日本	18,426,220,290	4.74
内 オランダ	201,234,000	0.05
内 イギリス	99,403,000	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,687,404,585	0.43
純資産総額	388,488,852,342	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-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	24,259,833,100	99.15
内 日本	24,259,833,100	99.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	208,299,475	0.85
純資産総額	24,468,132,575	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28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	249,682,972,832	96.13
内 アメリカ	154,111,187,000	59.33
内 イギリス	18,724,655,788	7.21
内 スイス	10,068,470,156	3.88
内 カナダ	9,892,199,020	3.81
内 フランス	9,066,026,536	3.49
内 ドイツ	9,063,982,216	3.49
内 オーストラリア	6,843,559,192	2.63
内 オランダ	4,457,508,022	1.72
内 アイルランド	4,337,413,806	1.67
内 スペイン	3,034,836,947	1.17
内 スウェーデン	2,781,750,841	1.07
内 香港	2,478,799,804	0.95
内 デンマーク	2,045,201,001	0.79
内 シンガポール	1,810,313,593	0.70
内 イタリア	1,769,740,271	0.68
内 ジョージア	1,548,575,073	0.60

内	ベルギー	1,354,809,745	0.52
内	バミューダ	1,047,572,762	0.40
内	フィンランド	1,013,210,882	0.39
内	オランダ領キュラソー	934,571,535	0.36
内	イスラエル	727,932,764	0.28
内	ケイマン諸島	690,127,971	0.27
内	ノルウェー	625,155,558	0.24
内	ルクセンブルグ	275,140,608	0.11
内	オーストリア	182,536,908	0.07
内	ニュージーランド	179,002,181	0.07
内	パナマ	163,815,871	0.06
内	ポルトガル	152,657,520	0.06
内	リベリア	103,756,628	0.04
内	イギリス領バージン諸島	78,747,419	0.03
内	パプアニューギニア	64,971,421	0.03
内	マン島	35,475,446	0.01
内	モーリシャス	19,268,347	0.01
投資信託受益証券		909,304,945	0.35
内	オーストラリア	786,816,070	0.30
内	シンガポール	122,488,875	0.05
投資証券		6,525,691,430	2.51
内	アメリカ	5,626,773,180	2.17
内	フランス	403,122,982	0.16
内	イギリス	297,763,218	0.11
内	香港	142,033,958	0.05
内	カナダ	55,998,092	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,615,076,319	1.01
純資産総額		259,733,045,526	100.00

## その他資産の投資状況

平成28年7月29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）	23,036,600	0.01
-	23,036,600	0.01
株価指数先物取引（買建）	2,540,671,710	0.98
内 アメリカ	1,695,284,805	0.65
内 ドイツ	450,037,269	0.17
内 イギリス	193,042,609	0.07
内 オーストラリア	108,353,880	0.04
内 カナダ	93,953,147	0.04

（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28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	256,280,776,808	96.93
内 アメリカ	111,806,507,022	42.29
内 フランス	26,028,361,985	9.84
内 イタリア	25,006,274,968	9.46
内 イギリス	19,930,387,687	7.54
内 ドイツ	19,366,682,179	7.33
内 スペイン	14,248,290,268	5.39
内 ベルギー	6,573,030,730	2.49
内 オランダ	6,176,300,262	2.34
内 カナダ	5,098,335,326	1.93
内 オーストラリア	4,942,650,470	1.87
内 オーストリア	3,928,902,111	1.49
内 メキシコ	2,041,058,113	0.77
内 アイルランド	1,958,567,890	0.74
内 デンマーク	1,638,364,466	0.62
内 フィンランド	1,464,859,677	0.55
内 ポーランド	1,379,327,066	0.52
内 スウェーデン	1,153,083,228	0.44
内 マレーシア	1,100,515,559	0.42
内 南アフリカ	1,068,323,726	0.40
内 シンガポール	829,427,989	0.31
内 ノルウェー	541,526,086	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,108,225,838	3.07
純資産総額	264,389,002,646	100.00

## その他資産の投資状況

平成28年7月29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）	243,005,450	0.09
-	243,005,450	0.09

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29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	3,971,604,878	11.37
内 オーストラリア	2,963,399,862	8.48
内 シンガポール	999,566,797	2.86
内 カナダ	8,638,219	0.02
投資証券	30,795,076,650	88.15
内 アメリカ	25,388,052,520	72.67
内 イギリス	1,653,695,718	4.73
内 フランス	1,477,782,066	4.23
内 カナダ	651,663,461	1.87
内 香港	624,067,516	1.79
内 ベルギー	228,738,600	0.65
内 ニュージーランド	174,014,738	0.50
内 オランダ	164,446,881	0.47
内 スペイン	148,285,962	0.42
内 アイルランド	78,442,953	0.22
内 ドイツ	65,427,659	0.19
内 シンガポール	53,624,640	0.15
内 イタリア	29,008,990	0.08
内 マン島	21,133,295	0.06
内 ガーンジィ	20,771,430	0.06
内 イスラエル	15,920,221	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	167,599,111	0.48
純資産総額	34,934,280,639	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。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	36,214,391,467	95.45
内 韓国	5,405,388,625	14.25
内 台湾	4,455,404,004	11.74
内 ケイマン諸島	3,876,655,333	10.22
内 中国	3,718,323,657	9.80
内 インド	3,093,209,062	8.15
内 ブラジル	2,690,953,723	7.09
内 南アフリカ	2,494,633,816	6.58
内 香港	1,591,946,926	4.20
内 ロシア	1,293,905,758	3.41
内 メキシコ	1,118,224,727	2.95
内 マレーシア	1,030,385,938	2.72
内 インドネシア	1,015,769,537	2.68
内 タイ	842,697,207	2.22
内 フィリピン	559,589,154	1.47
内 チリ	438,913,877	1.16
内 トルコ	423,160,795	1.12
内 ポーランド	401,418,739	1.06
内 バミューダ	393,678,221	1.04
内 カタール	337,424,630	0.89
内 アラブ首長国連邦	324,101,245	0.85
内 オランダ	169,081,472	0.45
内 コロンビア	160,423,170	0.42
内 ハンガリー	104,854,577	0.28
内 ギリシャ	67,518,213	0.18
内 チェコ	63,757,440	0.17
内 エジプト	47,059,576	0.12
内 マルタ	27,327,927	0.07
内 ペルー	26,999,143	0.07
内 マン島	21,246,131	0.06
内 アメリカ	20,338,844	0.05
投資信託受益証券	252,129,109	0.66
内 メキシコ	252,129,109	0.66
投資証券	111,966,643	0.30
内 メキシコ	49,407,919	0.13
内 南アフリカ	47,442,559	0.13
内 トルコ	15,116,165	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,361,201,821	3.59
純資産総額	37,939,689,040	100.00

## その他資産の投資状況

平成28年7月29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）	1,353,938,957	3.57
内 アメリカ	1,353,938,957	3.57

（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。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	52,084,043,044	96.60
内 トルコ	7,260,409,784	13.47
内 メキシコ	7,113,570,209	13.19
内 ロシア	6,587,185,246	12.22
内 インドネシア	5,608,935,225	10.40
内 ブラジル	5,150,649,633	9.55
内 フィリピン	4,433,900,204	8.22
内 コロンビア	4,084,954,778	7.58
内 ハンガリー	2,763,978,601	5.13
内 ベルギー	2,271,172,590	4.21
内 パナマ	2,000,610,973	3.71
内 南アフリカ	1,905,828,415	3.53
内 クロアチア	1,569,217,493	2.91
内 ルーマニア	1,333,629,893	2.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,831,918,503	3.40
純資産総額	53,915,961,547	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。

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成28年7月29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	231,039,891	2.5707 593,948,645	2.5595 591,346,601	- -	42.30%
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	533,617,263	0.8062 430,213,460	0.8706 464,567,189	- -	33.23%
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	65,836,077	1.7301 113,903,089	1.7168 113,027,376	- -	8.08%
4	外国リート・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	80,359,132	1.1085 89,085,482	1.1487 92,308,534	- -	6.60%
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	30,643,797	2.0207 61,922,155	1.9372 59,363,163	- -	4.25%
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	21,457,895	1.7474 37,497,020	1.7040 36,564,253	- -	2.62%
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	8,622,472	1.2978 11,190,585	1.3139 11,329,065	- -	0.81%
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	4,609,929	1.6486 7,600,261	1.8181 8,381,311	- -	0.60%

(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28年7月29日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.48%
合計	98.48%

(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。



(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28年7月29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	1,761,400	6,486.54 11,425,399,245	5,894.00 10,381,691,600	- -	3.67%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	11,214,900	534.86 5,998,455,918	522.00 5,854,177,800	- -	2.07%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,080,500	5,282.81 5,708,076,661	4,881.00 5,273,920,500	- -	1.86%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	792,000	5,150.50 4,079,197,434	5,703.00 4,516,776,000	- -	1.60%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,382,800	3,195.64 4,418,936,889	3,145.00 4,348,906,000	- -	1.54%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,119,200	3,397.39 3,802,363,731	3,308.00 3,702,313,600	- -	1.31%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,274,500	3,106.46 3,959,193,600	2,841.50 3,621,491,750	- -	1.28%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	879,400	4,635.41 4,076,388,197	4,025.00 3,539,585,000	- -	1.25%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	19,881,200	180.16 3,581,862,284	167.10 3,322,148,520	- -	1.17%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	999,400	2,584.05 2,582,507,576	3,282.00 3,280,030,800	- -	1.16%
11	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,044,500	2,834.82 2,960,978,696	2,749.50 2,871,852,750	- -	1.01%
12	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,609,900	1,658.53 2,670,073,678	1,721.50 2,771,442,850	- -	0.98%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	590,800	5,780.65 3,415,209,710	4,588.00 2,710,590,400	- -	0.96%
14	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	584,700	5,108.70 2,987,060,804	4,303.00 2,515,964,100	- -	0.89%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	143,600	16,400.39 2,355,096,206	17,325.00 2,487,870,000	- -	0.88%
16	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	258,900	10,802.28 2,796,710,396	9,485.00 2,455,666,500	- -	0.87%
17	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	126,800	22,228.54 2,818,579,524	19,220.00 2,437,096,000	- -	0.86%
18	キーエンス 日本	株式 電気機器	32,100	58,581.30 1,880,459,996	72,920.00 2,340,732,000	- -	0.83%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	566,300	3,927.24 2,224,001,260	4,040.00 2,287,852,000	- -	0.81%
20	キャノン 日本	株式 電気機器	762,400	3,349.96 2,554,014,116	2,935.00 2,237,644,000	- -	0.79%

21	花王 日本	株式 化学	376,700	6,189.12 2,331,444,652	5,553.00 2,091,815,100	- -	0.74%
22	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,039,000	2,236.36 2,323,583,200	1,929.00 2,004,231,000	- -	0.71%
23	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	1,930,500	1,075.90 2,077,026,483	1,012.00 1,953,666,000	- -	0.69%
24	村田製作所 日本	株式 電気機器	149,400	13,863.72 2,071,239,782	12,825.00 1,916,055,000	- -	0.68%
25	信越化学工業 日本	株式 化学	266,000	5,982.11 1,591,241,686	7,064.00 1,879,024,000	- -	0.66%
26	任天堂 日本	株式 その他製品	87,200	17,229.54 1,502,416,552	21,505.00 1,875,236,000	- -	0.66%
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,048,800	1,871.61 1,962,954,713	1,778.50 1,865,290,800	- -	0.66%
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	206,200	7,741.00 1,596,195,040	9,012.00 1,858,274,400	- -	0.66%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,511,000	1,146.04 1,731,681,480	1,217.50 1,839,642,500	- -	0.65%
30	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	500,600	4,104.80 2,054,863,140	3,601.00 1,802,660,600	- -	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28年7月29日現在

種類	投資比率
株式	97.94%
合計	97.94%

(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28年7月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.73%
輸送用機器		9.39%
情報・通信業		8.25%
銀行業		7.37%
化学		6.12%
医薬品		5.64%
食料品		4.98%
小売業		4.79%
機械		4.72%
陸運業		4.49%
卸売業		3.98%
サービス業		3.78%
建設業		3.25%
不動産業		2.56%
保険業		2.36%
電気・ガス業		1.85%
その他製品		1.75%
精密機器		1.48%
その他金融業		1.24%
鉄鋼		1.13%
証券、商品先物取引業		0.98%
ガラス・土石製品		0.91%
非鉄金属		0.85%
ゴム製品		0.85%
繊維製品		0.73%
金属製品		0.65%
空運業		0.58%
石油・石炭製品		0.46%
鉱業		0.28%
パルプ・紙		0.26%
海運業	0.21%	
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.10%	
合計	97.94%	

(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28年7月29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	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	101.02 4,546,125,000	101.41 4,563,495,000	0.100000 2020/6/20	1.17%
2	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.94 4,542,525,000	101.22 4,555,260,000	0.100000 2019/12/20	1.17%
3	106回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.54 4,524,705,000	100.53 4,524,030,000	0.200000 2017/9/20	1.16%
4	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,200,000,000	101.02 4,243,092,000	101.11 4,246,830,000	0.200000 2018/12/20	1.09%
5	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	103.35 4,134,275,000	105.73 4,229,200,000	0.400000 2025/9/20	1.09%
6	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	102.02 4,081,115,000	102.89 4,115,800,000	0.100000 2026/3/20	1.06%
7	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.06 4,042,440,000	101.48 4,059,320,000	0.100000 2020/9/20	1.04%
8	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	101.10 4,044,000,000	101.23 4,049,240,000	0.200000 2019/3/20	1.04%
9	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	103.36 3,617,600,000	102.81 3,598,595,000	0.100000 2026/6/20	0.93%
10	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,650,000	101.35 3,547,250,000	0.200000 2019/6/20	0.91%
11	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.00 3,535,210,000	101.31 3,546,165,000	0.100000 2020/3/20	0.91%
12	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.19 3,541,825,000	101.21 3,542,420,000	0.300000 2018/9/20	0.91%
13	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,300,000,000	100.64 3,321,285,000	100.65 3,321,516,000	0.200000 2017/12/20	0.85%
14	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	103.03 3,297,024,000	102.45 3,278,400,000	1.500000 2017/12/20	0.84%
15	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,200,000,000	101.37 3,244,044,000	101.57 3,250,336,000	0.100000 2020/12/20	0.84%

16	313回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,000,000,000	107.26 3,217,920,000	107.26 3,217,800,000	1.300000 2021/3/20	0.83%
17	339回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,000,000,000	103.25 3,097,560,000	105.71 3,171,360,000	0.400000 2025/6/20	0.82%
18	341回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	3,000,000,000	103.34 3,100,200,000	104.83 3,144,930,000	0.300000 2025/12/20	0.81%
19	127回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	3,000,000,000	101.57 3,047,255,000	101.66 3,049,890,000	0.100000 2021/3/20	0.79%
20	301回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,900,000,000	105.55 3,060,979,000	105.09 3,047,755,000	1.500000 2019/6/20	0.78%
21	310回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,800,000,000	105.16 2,944,704,000	105.22 2,946,188,000	1.000000 2020/9/20	0.76%
22	325回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,500,000,000	106.22 2,655,660,000	106.67 2,666,850,000	0.800000 2022/9/20	0.69%
23	143回 利付国庫債券(20年)	日本	国債証券	2,100,000,000	116.03 2,436,735,000	125.56 2,636,844,000	1.600000 2033/3/20	0.68%
24	305回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,500,000,000	105.57 2,639,425,000	105.30 2,632,675,000	1.300000 2019/12/20	0.68%
25	149回 利付国庫債券(20年)	日本	国債証券	2,100,000,000	113.46 2,382,670,000	124.70 2,618,784,000	1.500000 2034/6/20	0.67%
26	365回 利付国庫債券(2年)	日本	国債証券	2,500,000,000	100.84 2,521,025,000	100.67 2,516,875,000	0.100000 2018/6/15	0.65%
27	334回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,300,000,000	105.26 2,421,080,000	106.96 2,460,149,000	0.600000 2024/6/20	0.63%
28	141回 利付国庫債券(20年)	日本	国債証券	1,900,000,000	117.81 2,238,435,000	126.91 2,411,404,000	1.700000 2032/12/20	0.62%
29	297回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,300,000,000	104.41 2,401,614,000	103.95 2,390,988,000	1.400000 2018/12/20	0.62%
30	125回 利付国庫債券(20年)	日本	国債証券	1,800,000,000	125.51 2,259,324,000	132.37 2,382,822,000	2.200000 2031/3/20	0.61%

(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28年7月29日現在

種類	投資比率
国債証券	82.90%
地方債証券	6.36%
特殊債券	5.48%
社債券	4.82%
合計	99.57%

(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-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29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	2,902	651,478.08 1,890,589,401	630,000.00 1,828,260,000	- -	7.47%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	2,691	638,118.30 1,717,176,360	619,000.00 1,665,729,000	- -	6.81%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	5,245	258,789.58 1,357,351,385	252,000.00 1,321,740,000	- -	5.40%
4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	7,649	171,730.93 1,313,569,903	169,700.00 1,298,035,300	- -	5.31%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,069	180,254.20 1,093,962,748	191,300.00 1,160,999,700	- -	4.74%
6	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	3,785	240,395.35 909,896,408	254,700.00 964,039,500	- -	3.94%
7	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	4,976	179,761.39 894,492,717	188,500.00 937,976,000	- -	3.83%
8	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	1,794	454,678.24 815,692,763	450,500.00 808,197,000	- -	3.30%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,672	286,579.49 765,740,411	284,600.00 760,451,200	- -	3.11%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	5,330	126,224.76 672,778,005	130,200.00 693,966,000	- -	2.84%
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	7,707	94,270.37 726,541,802	86,200.00 664,343,400	- -	2.72%
12	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,232	568,389.64 700,256,040	535,000.00 659,120,000	- -	2.69%

13	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	995	653,892.36 650,622,904	611,000.00 607,945,000	- -	2.48%
14	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,598	164,583.12 592,170,098	160,500.00 577,479,000	- -	2.36%
15	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,019	529,193.03 539,247,706	548,000.00 558,412,000	- -	2.28%
16	ケネディクス・オフィス投資 法人 日本	投資証券	832	638,283.33 531,051,733	640,000.00 532,480,000	- -	2.18%
17	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	7,554	75,233.18 568,311,479	69,000.00 521,226,000	- -	2.13%
18	森トラスト総合リート投資法 人 日本	投資証券	2,713	204,332.68 554,354,569	189,700.00 514,656,100	- -	2.10%
19	日本アコモデーションファン ド投資法人 日本	投資証券	996	457,658.79 455,828,160	468,000.00 466,128,000	- -	1.91%
20	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	721	594,324.11 428,507,684	628,000.00 452,788,000	- -	1.85%
21	大和ハウス・レジデンシャル 投資法人 日本	投資証券	1,537	275,068.78 422,780,728	287,600.00 442,041,200	- -	1.81%
22	日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本	投資証券	1,808	245,757.95 444,330,375	239,500.00 433,016,000	- -	1.77%
23	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	725	569,474.19 412,868,793	589,000.00 427,025,000	- -	1.75%
24	ジャパンエクセレント投資法 人 日本	投資証券	2,676	149,814.62 400,903,940	145,000.00 388,020,000	- -	1.59%
25	プレミア投資法人 日本	投資証券	2,707	141,102.60 381,964,764	140,100.00 379,250,700	- -	1.55%
26	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	1,967	187,860.30 369,521,221	181,200.00 356,420,400	- -	1.46%
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,691	136,920.27 368,452,472	129,500.00 348,484,500	- -	1.42%
28	福岡リート投資法人 日本	投資証券	1,535	205,206.04 314,991,277	212,000.00 325,420,000	- -	1.33%
29	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	3,370	84,573.94 285,014,196	87,700.00 295,549,000	- -	1.21%
30	東急リアル・エステート投資 法人 日本	投資証券	2,009	152,972.09 307,320,940	146,200.00 293,715,800	- -	1.20%

(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28年7月29日現在

種類	投資比率
投資証券	99.15%
合計	99.15%

（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28年7月29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	451,881	9,821.62 4,438,205,508	10,895.18 4,923,326,098	- -	1.90%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	612,102	5,275.61 3,229,216,344	5,869.44 3,592,700,982	- -	1.38%
3	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	338,336	8,511.88 2,879,877,928	9,418.68 3,186,679,869	- -	1.23%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	224,831	10,701.59 2,406,051,031	12,996.11 2,921,929,126	- -	1.12%
5	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・カタ ログ販売	32,610	53,792.62 1,754,177,662	78,587.53 2,562,739,555	- -	0.99%
6	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマ リット	759,940	2,962.01 2,250,950,848	3,263.12 2,479,779,212	- -	0.95%
7	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	187,037	10,762.75 2,013,032,555	13,052.49 2,441,300,442	- -	0.94%
8	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	500,479	3,826.90 1,915,283,777	4,446.20 2,225,231,531	- -	0.86%
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	259,635	7,679.49 1,993,866,245	8,231.83 2,137,272,739	- -	0.82%
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	298,701	6,019.21 1,797,946,284	6,693.32 1,999,301,974	- -	0.77%
11	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス	25,346	71,369.06 1,808,920,323	77,887.92 1,974,147,276	- -	0.76%
12	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	392,807	4,936.21 1,938,979,107	5,025.73 1,974,143,731	- -	0.76%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	220,116	8,472.08 1,864,840,792	8,855.86 1,949,316,523	- -	0.75%



14	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	503,036	3,088.61 1,553,685,860	3,829.08 1,926,165,791	- -	0.74%
15	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,841	73,886.71 1,761,533,291	79,969.01 1,906,541,234	- -	0.73%
16	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	331,408	5,253.10 1,740,922,599	5,728.48 1,898,464,497	- -	0.73%
17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	153,421	9,006.19 1,381,738,987	10,628.91 1,630,698,277	- -	0.63%
18	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	185,580	7,619.75 1,414,073,974	8,562.38 1,589,008,150	- -	0.61%
19	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	334,562	4,507.19 1,507,936,522	4,557.93 1,524,911,180	- -	0.59%
20	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	57,289	26,080.80 1,494,142,977	26,177.66 1,499,692,250	- -	0.58%
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	103,213	12,251.37 1,264,501,010	14,405.78 1,486,864,101	- -	0.57%
22	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	97,101	13,454.74 1,306,469,672	15,080.33 1,464,315,744	- -	0.56%
23	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	198,378	5,957.75 1,181,887,827	7,085.94 1,405,694,843	- -	0.54%
24	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	385,003	3,011.90 1,159,591,866	3,630.68 1,397,824,001	- -	0.54%
25	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	226,173	5,152.35 1,165,322,988	6,101.26 1,379,940,413	- -	0.53%
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	117,564	10,309.65 1,212,044,488	11,290.93 1,327,407,435	- -	0.51%
27	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	410,147	2,633.15 1,079,981,609	3,186.89 1,307,096,818	- -	0.50%
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	125,945	9,340.03 1,176,331,051	10,348.02 1,303,281,630	- -	0.50%
29	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	156,281	7,365.73 1,151,124,634	8,269.01 1,292,290,683	- -	0.50%
30	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	840,771	1,250.85 1,051,685,208	1,532.88 1,288,805,758	- -	0.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
株式	96.13%
投資信託受益証券	0.35%
投資証券	2.51%
合計	98.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成28年7月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	7.90%
医薬品		6.75%
石油・ガス・消耗燃料		6.29%
保険		3.87%
ソフトウェア		3.34%
各種電気通信サービス		2.90%
インターネットソフトウェア・サービス		2.87%
メディア		2.78%
情報技術サービス		2.66%
化学		2.57%
バイオテクノロジー		2.53%
飲料		2.45%
食品		2.44%
コンピュータ・周辺機器		2.39%
半導体・半導体製造装置		2.34%
食品・生活必需品小売り		2.10%
航空宇宙・防衛		2.07%
ヘルスケア機器・用品		2.03%
電力		1.99%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.98%
専門小売り		1.96%
コングロマリット		1.94%
資本市場		1.84%
ホテル・レストラン・レジャー		1.83%
タバコ		1.64%
家庭用品		1.57%
各種金融サービス		1.48%
インターネット販売・カタログ販売		1.45%
金属・鉱業		1.44%
機械		1.36%
総合公益事業		1.21%
繊維・アパレル・贅沢品		1.19%
自動車		0.95%
通信機器		0.85%
陸運・鉄道		0.85%
電気設備		0.74%
パーソナル用品		0.71%
エネルギー設備・サービス		0.71%

航空貨物・物流サービス	0.59%
不動産管理・開発	0.58%
自動車部品	0.54%
消費者金融	0.50%
複合小売り	0.49%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.49%
専門サービス	0.47%
家庭用耐久財	0.46%
商業サービス・用品	0.46%
無線通信サービス	0.39%
電子装置・機器・部品	0.39%
建設資材	0.35%
建設・土木	0.33%
商社・流通業	0.31%
容器・包装	0.30%
建設関連製品	0.28%
運送インフラ	0.24%
ガス	0.23%
旅客航空輸送業	0.13%
水道	0.10%
販売	0.10%
レジャー用品	0.09%
紙製品・林産品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
海運業	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
合計	96.13%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29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 1.375 09/30/18 アメリカ	国債証券	2,140,610,000	101.46 2,172,007,527	101.36 2,169,872,138	1.375000 2018/9/30	0.82%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,879,560,000	109.69 2,061,783,342	109.50 2,058,118,200	3.625000 2020/2/15	0.78%
3	US T N/B 0.75 12/31/17 アメリカ	国債証券	1,983,980,000	99.98 1,983,583,204	100.10 1,986,063,179	0.750000 2017/12/31	0.75%
4	US T N/B 1.875 09/30/17 アメリカ	国債証券	1,879,560,000	101.71 1,911,838,310	101.44 1,906,794,824	1.875000 2017/9/30	0.72%
5	US T N/B 0.5 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,879,560,000	99.70 1,874,052,889	99.91 1,877,868,396	0.500000 2017/7/31	0.71%
6	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,722,930,000	106.17 1,829,252,010	106.45 1,834,179,590	2.625000 2020/8/15	0.69%
7	US T N/B 1.5 12/31/18 アメリカ	国債証券	1,775,140,000	101.72 1,805,778,916	101.77 1,806,613,232	1.500000 2018/12/31	0.68%
8	US T N/B 4.75 08/15/17 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	105.93 1,659,228,579	104.29 1,633,588,248	4.750000 2017/8/15	0.62%
9	US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	103.65 1,623,510,673	103.19 1,616,280,633	2.375000 2018/6/30	0.61%
10	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	101.82 1,594,806,660	103.00 1,613,335,989	1.750000 2022/5/15	0.61%
11	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	102.58 1,606,850,462	102.78 1,609,858,803	1.750000 2023/5/15	0.61%
12	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,566,300,000	100.54 1,574,808,141	102.25 1,601,541,750	1.625000 2022/8/15	0.61%
13	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,461,880,000	109.57 1,601,781,916	109.42 1,599,720,665	3.500000 2020/5/15	0.61%
14	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	1,461,880,000	105.34 1,540,046,723	104.30 1,524,857,790	3.500000 2018/2/15	0.58%
15	US T N/B 1.875 08/31/17 アメリカ	国債証券	1,461,880,000	101.71 1,486,936,623	101.34 1,481,513,048	1.875000 2017/8/31	0.56%
16	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,409,670,000	102.29 1,442,036,023	104.33 1,470,779,194	2.000000 2025/2/15	0.56%
17	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,357,460,000	106.89 1,451,097,590	106.54 1,446,265,033	3.125000 2019/5/15	0.55%
18	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,357,460,000	104.20 1,414,496,292	106.47 1,445,369,109	2.250000 2025/11/15	0.55%
19	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,409,670,000	100.85 1,421,666,291	101.53 1,431,252,047	1.375000 2020/5/31	0.54%
20	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	1,330,205,000	108.38 1,441,746,043	106.89 1,421,949,238	4.500000 2018/2/1	0.54%
21	US T N/B 0.75 02/28/18 アメリカ	国債証券	1,409,670,000	99.95 1,409,064,364	100.08 1,410,924,606	0.750000 2018/2/28	0.53%
22	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,326,134,000	104.09 1,380,412,664	105.03 1,392,851,801	2.125000 2021/12/31	0.53%
23	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,357,460,000	101.06 1,371,957,672	101.53 1,378,351,309	1.375000 2019/2/28	0.52%

24	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	1,326,134,000	101.79 1,349,930,691	101.60 1,347,365,405	1.500000 2018/8/31	0.51%
25	US T N/B 4.0 08/15/18 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	108.00 1,353,283,200	106.82 1,338,597,571	4.000000 2018/8/15	0.51%
26	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	105.27 1,319,194,246	105.06 1,316,519,006	2.750000 2019/2/15	0.50%
27	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	101.92 1,277,186,080	104.31 1,307,071,084	2.000000 2025/8/15	0.49%
28	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	103.48 1,296,746,035	104.29 1,306,870,598	2.000000 2021/5/31	0.49%
29	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,253,040,000	100.88 1,264,079,282	101.55 1,272,512,241	1.375000 2020/4/30	0.48%
30	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,200,830,000	104.38 1,253,450,892	105.35 1,265,182,479	2.250000 2021/3/31	0.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
国債証券	96.93%
合計	96.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29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	89,960	21,934.07 1,973,189,675	23,397.38 2,104,829,150	- -	6.03%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	42,860	25,451.39 1,090,846,999	24,916.70 1,067,929,779	- -	3.06%
3	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	152,500	5,207.62 794,162,086	5,600.04 854,006,801	- -	2.44%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	103,630	7,712.44 799,240,259	8,183.39 848,045,265	- -	2.43%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	28,520	27,612.92 787,520,562	28,003.70 798,665,723	- -	2.29%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	98,160	7,352.98 721,768,991	7,781.37 763,820,103	- -	2.19%
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	39,820	18,395.26 732,499,302	19,033.67 757,921,042	- -	2.17%
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	106,100	6,948.62 737,248,861	6,980.47 740,628,609	- -	2.12%
9	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,546,635	374.40 579,067,406	421.86 652,474,576	- -	1.87%
10	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	44,600	13,402.17 597,737,133	14,560.32 649,390,486	- -	1.86%
11	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	51,530	10,216.27 526,444,583	11,017.35 567,724,261	- -	1.63%
12	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	169,260	3,022.10 511,522,119	3,305.93 559,562,930	- -	1.60%
13	HCP INC アメリカ	投資証券	135,640	3,664.06 496,994,000	4,074.46 552,660,893	- -	1.58%
14	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	74,810	6,821.48 510,315,554	7,380.40 552,128,142	- -	1.58%
15	LINK REIT 香港	投資証券	652,023	686.03 447,311,762	784.71 511,654,184	- -	1.46%
16	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	42,640	10,966.29 467,602,922	11,244.98 479,486,365	- -	1.37%
17	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	555,516	844.06 468,889,616	838.23 465,653,065	- -	1.33%
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	19,010	23,126.01 439,625,480	23,034.00 437,876,488	- -	1.25%
19	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	121,890	3,127.14 381,167,476	3,323.68 405,124,403	- -	1.16%
20	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	217,090	1,729.94 375,553,240	1,804.37 391,712,333	- -	1.12%
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	20,600	16,568.16 341,304,198	17,616.69 362,903,982	- -	1.04%
22	SL GREEN アメリカ	投資証券	29,130	10,688.63 311,360,033	12,144.04 353,756,059	- -	1.01%

23	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	232,960	1,581.07 368,326,534	1,497.70 348,904,588	- -	1.00%
24	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	36,670	8,587.98 314,921,518	9,305.91 341,247,734	- -	0.98%
25	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	36,380	9,207.26 334,960,424	8,978.03 326,620,789	- -	0.93%
26	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	69,460	4,021.61 279,341,104	4,306.28 299,114,264	- -	0.86%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	77,630	3,706.24 287,715,462	3,817.59 296,359,915	- -	0.85%
28	VEREIT INC アメリカ	投資証券	262,950	1,033.83 271,847,184	1,125.64 295,989,036	- -	0.85%
29	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	100,540	2,694.07 270,862,061	2,940.46 295,634,572	- -	0.85%
30	STOCKLAND オーストラリア	投資信託受益 証券	691,897	370.52 256,364,815	395.94 273,951,358	- -	0.78%

(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28年7月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	11.37%
投資証券	88.15%
合計	99.52%

(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。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29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	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	503,800	2,236.18 1,126,591,510	2,543.94 1,281,636,972	- -	3.38%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	9,061	121,480.88 1,100,738,289	140,301.69 1,271,273,703	- -	3.35%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,197,083	520.84 1,144,334,965	575.38 1,264,179,587	- -	3.33%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR 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	88,400	8,398.08 742,390,279	8,679.39 767,258,111	- -	2.02%
5	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	548,000	1,208.92 662,492,915	1,313.02 719,536,604	- -	1.90%
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	39,052	15,897.44 620,827,114	16,554.04 646,468,502	- -	1.70%
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	7,506,530	68.22 512,152,952	70.93 532,469,700	- -	1.40%
8	BAIDU INC -SPON ADR 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	24,200	19,332.78 467,853,496	17,295.08 418,541,047	- -	1.10%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,582,235	58.42 384,567,853	59.62 392,484,192	- -	1.03%
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,255,120	269.92 338,791,043	290.13 364,160,516	- -	0.96%
11	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	7,098,200	43.50 308,781,582	43.34 307,644,505	- -	0.81%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	134,064	1,750.05 234,619,548	2,187.35 293,245,426	- -	0.77%
13	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	164,374	1,832.14 301,157,566	1,680.89 276,296,256	- -	0.73%
14	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	257,808	1,042.17 268,680,602	1,051.14 270,992,919	- -	0.71%
15	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	420,995	602.30 253,569,138	615.85 259,273,643	- -	0.68%



16	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	539,379	458.72 247,428,106	429.68 231,764,845	- -	0.61%
17	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	466,500	506.76 236,406,005	496.67 231,698,421	- -	0.61%
18	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	246,884	792.67 195,699,653	891.74 220,158,016	- -	0.58%
19	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	249,015	830.40 206,782,752	871.20 216,941,868	- -	0.57%
20	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,586,000	130.91 207,632,384	128.67 204,082,673	- -	0.54%
21	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,637	100,341.00 164,258,229	114,699.19 187,762,590	- -	0.49%
22	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	116,614	1,656.67 193,191,810	1,601.10 186,711,375	- -	0.49%
23	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	39,101	4,397.02 171,928,216	4,483.27 175,300,445	- -	0.46%
24	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,293,200	71.58 164,168,013	76.31 175,012,896	- -	0.46%
25	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	42,296	3,934.89 166,430,330	4,086.02 172,822,724	- -	0.46%
26	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,807,678	74.26 208,515,276	60.99 171,257,127	- -	0.45%
27	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV オランダ	株式 家庭用耐久財	259,114	656.52 170,113,914	652.53 169,081,472	- -	0.45%
28	NAVER CORP 韓国	株式 インターネッ トソフトウェア・サービス	2,510	62,888.49 157,850,121	66,101.00 165,913,510	- -	0.44%
29	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	12,836	14,014.31 179,887,789	12,661.59 162,524,297	- -	0.43%
30	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	665,000	263.54 175,258,614	242.01 160,937,182	- -	0.42%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
株式	95.45%
投資信託受益証券	0.66%
投資証券	0.30%
合計	96.41%

（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

平成28年7月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	15.23%
インターネットソフトウェア・サービス		7.55%
石油・ガス・消耗燃料		6.90%
半導体・半導体製造装置		4.98%
コンピュータ・周辺機器		4.98%
無線通信サービス		4.35%
保険		3.19%
金属・鉱業		2.97%
自動車		2.57%
メディア		2.39%
電子装置・機器・部品		2.33%
不動産管理・開発		2.28%
食品		2.08%
コングロマリット		2.04%
各種電気通信サービス		2.04%
情報技術サービス		1.94%
化学		1.93%
食品・生活必需品小売り		1.91%
各種金融サービス		1.65%
医薬品		1.60%
電力		1.36%
飲料		1.14%
パーソナル用品		1.09%
資本市場		1.06%
運送インフラ		1.05%
建設・土木		0.93%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.92%
インターネット販売・カタログ販売		0.90%
家庭用耐久財		0.84%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.83%
建設資材		0.82%
自動車部品		0.81%
タバコ		0.80%
複合小売り		0.77%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.62%
機械		0.57%
繊維・アパレル・贅沢品		0.56%
ホテル・レストラン・レジャー		0.48%

ガス	0.46%
家庭用品	0.44%
専門小売り	0.42%
各種消費者サービス	0.37%
紙製品・林産品	0.31%
水道	0.29%
バイオテクノロジー	0.26%
不動産投資信託	0.26%
消費者金融	0.25%
旅客航空輸送業	0.24%
航空宇宙・防衛	0.23%
電気設備	0.23%
ソフトウェア	0.17%
陸運・鉄道	0.17%
商業サービス・用品	0.15%
海運業	0.11%
総合公益事業	0.10%
航空貨物・物流サービス	0.09%
レジャー用品	0.08%
容器・包装	0.07%
商社・流通業	0.07%
エネルギー設備・サービス	0.07%
建設関連製品	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.04%
販売	0.04%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.03%
通信機器	0.02%
合計	95.45%

(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28年7月29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	2,000,008,470	122.06 2,441,359,896	122.19 2,443,830,349	7.500000 2030/3/31	4.53%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	950,222,000	94.77 900,583,342	98.37 934,780,892	4.250000 2025/1/7	1.73%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	814,476,000	104.13 848,161,892	106.50 867,416,940	4.750000 2044/3/8	1.61%
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	574,310,000	122.10 701,271,667	125.87 722,912,712	6.050000 2040/1/11	1.34%
5	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 メキシコ	国債証券	647,404,000	103.83 672,208,971	104.75 678,155,690	3.600000 2025/1/30	1.26%
6	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	428,122,000	153.92 658,994,620	158.11 676,946,506	8.750000 2033/11/21	1.26%
7	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	616,078,000	106.77 657,825,116	107.75 663,824,045	4.000000 2023/10/2	1.23%
8	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア	国債証券	365,470,000	171.29 626,045,933	178.16 651,121,352	12.750000 2028/6/24	1.21%
9	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	542,984,000	115.32 626,170,193	119.62 649,544,610	5.550000 2045/1/21	1.20%
10	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	532,542,000	121.45 646,790,010	119.61 637,026,740	7.375000 2025/2/5	1.18%
11	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	553,426,000	114.35 632,847,852	113.85 630,075,501	7.375000 2019/3/18	1.17%
12	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	542,984,000	113.85 618,196,681	114.60 622,286,813	6.375000 2021/3/29	1.15%
13	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	584,752,000	102.81 601,208,592	105.90 619,252,368	4.875000 2021/1/22	1.15%
14	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	355,028,000	173.49 615,965,644	173.32 615,355,831	9.500000 2030/2/2	1.14%
15	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	480,332,000	119.41 573,589,502	126.60 608,100,312	5.625000 2050/11/18	1.13%
16	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	668,288,000	83.36 557,132,910	90.00 601,459,200	5.000000 2045/1/27	1.12%
17	RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 ロシア	国債証券	563,868,000	105.15 592,947,716	106.42 600,119,073	4.500000 2022/4/4	1.11%
18	TURKEY 6.625 02/17/45 トルコ	国債証券	511,658,000	118.04 604,000,260	116.81 597,713,759	6.625000 2045/2/17	1.11%
19	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	542,984,000	105.35 572,075,412	109.75 595,924,940	5.625000 2044/2/26	1.11%

20	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア	国債証券	501,216,000	117.36 588,265,733	117.69 589,886,122	11.000000 2018/7/24	1.09%
21	BRAZIL 5.875 01/15/19 ブラジル	国債証券	532,542,000	109.40 582,600,948	109.50 583,133,490	5.875000 2019/1/15	1.08%
22	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	469,890,000	118.80 558,240,388	119.57 561,847,473	6.750000 2022/2/7	1.04%
23	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	375,912,000	145.49 546,936,297	148.00 556,357,278	6.375000 2034/10/23	1.03%
24	RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19 ロシア	国債証券	542,984,000	101.42 550,721,730	102.44 556,238,239	3.500000 2019/1/16	1.03%
25	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	501,216,000	106.99 536,290,678	110.25 552,590,640	5.750000 2110/10/12	1.02%
26	TURKEY 6.75 04/03/18 トルコ	国債証券	522,100,000	107.82 562,959,963	105.52 550,946,025	6.750000 2018/4/3	1.02%
27	INDONESIA 11.625 03/04/19 インドネシア	国債証券	438,564,000	124.91 547,813,425	123.91 543,446,580	11.625000 2019/3/4	1.01%
28	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン	国債証券	344,586,000	156.48 539,233,129	156.79 540,293,618	7.750000 2031/1/14	1.00%
29	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	396,796,000	129.69 514,613,086	135.08 536,031,716	6.700000 2036/1/26	0.99%
30	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	459,448,000	109.27 502,051,360	114.75 527,216,580	6.125000 2041/1/18	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28年7月29日現在

種類	投資比率
国債証券	96.60%
合計	96.60%

(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28年7月29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 2809月	買建	447	5,718,043,428	5,938,395,000	2.10%

(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28年7月29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 2016年08月	売建	150,000	15,701,820	15,660,000	0.01%
		ユーロ売/円買 201 6年08月	売建	40,000	4,633,520	4,626,400	0.00%
		イギリス・ポンド売/ 円買 2016年08月	売建	20,000	2,769,200	2,750,200	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P 500 FU TURE Sep16	買建	30	1,652,472,605	1,695,284,805	0.65%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Sep 16	買建	131	435,213,001	450,037,269	0.17%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Sep16	買建	21	189,973,627	193,042,609	0.07%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Sep1 6	買建	10	103,394,780	108,353,880	0.04%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT S ep16	買建	7	92,093,365	93,953,147	0.04%

(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28年7月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売2016年08月	買建	1,051,000	121,705,898	121,558,660	0.05%
		アメリカ・ドル買/円売2016年08月	買建	888,000	92,954,774	92,707,200	0.04%
		イギリス・ポンド買/円売2016年08月	買建	209,000	28,742,098	28,739,590	0.01%

(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。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29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	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 16	買建	296	1,305,397,232	1,353,938,957	3.57%

(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。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(平成28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
第6計算期間末 (平成28年1月12日)	1,328	1,328	1.6123	1.6123
平成27年7月末日	1,545	-	1.9276	-
8月末日	1,427	-	1.7742	-
9月末日	1,373	-	1.6733	-
10月末日	1,518	-	1.8299	-
11月末日	1,514	-	1.8318	-
12月末日	1,458	-	1.7773	-
平成28年1月末日	1,363	-	1.6441	-
2月末日	1,308	-	1.5744	-
3月末日	1,413	-	1.6882	-
4月末日	1,406	-	1.6697	-
5月末日	1,411	-	1.6631	-
6月末日	1,315	-	1.5473	-
7月末日	1,398	-	1.6424	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成28年1月13日～ 平成28年7月12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
第6計算期間	11.6
平成28年1月13日～ 平成28年7月12日	1.7

(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
第6計算期間	321,028,252	187,743,422
平成28年1月13日～ 平成28年7月12日	80,395,849	54,048,997

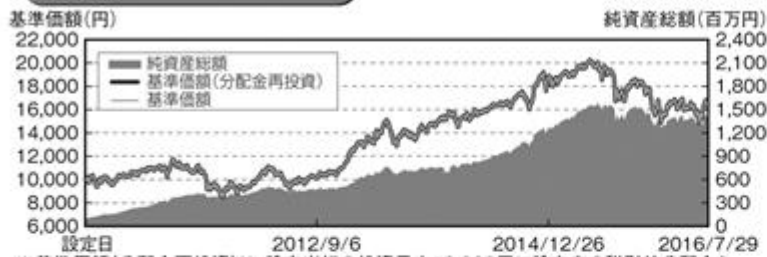
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2016年7月29日

## 基準価額・純資産の推移 (設定日(2010年5月28日)~2016年7月29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他の資産(負債控除後)として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。

## 分配の推移(税引前)

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
第6期	(2016.01.12)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄一覧

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	投資比率
1	外国株式パッシブ・ファンドマザー・ファンド	42.30%
2	エマーシング株式パッシブ・マザー・ファンド	33.23%
3	エマーシング債券パッシブ・マザー・ファンド	8.08%
4	外国リートパッシブ・ファンドマザー・ファンド	6.60%
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	4.25%
6	外国債券パッシブ・ファンドマザー・ファンド	2.62%
7	国内債券パッシブ・ファンドマザー・ファンド	0.81%
8	J-REITインデックスファンドマザー・ファンド	0.60%

## ■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	97.94
内 日本	97.94
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.06
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(%)
株債指数先物取引(買建)	2.10

## ■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	96.13
内 アメリカ	59.33
内 イギリス	7.21
内 スイス	3.88
内 カナダ	3.81
内 フランス	3.49
内 その他	18.41
投資信託受益証券	0.35
内 オーストラリア	0.30
内 シンガポール	0.05
投資証券	2.51
内 アメリカ	2.17
内 フランス	0.16
内 イギリス	0.11
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.01
純資産総額	100.00

## ■エマーシング株式パッシブ・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	95.45
内 韓国	14.25
内 台湾	11.74
内 ケイマン諸島	10.22
内 中国	9.80
内 インド	8.15
内 その他	41.29
投資信託受益証券	0.66
内 メキシコ	0.66
投資証券	0.30
内 メキシコ	0.13
内 南アフリカ	0.13
内 トルコ	0.04
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.59
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	3.67%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.07%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.86%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.60%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.54%

## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.73%
2	輸送用機器	9.39%
3	情報・通信業	8.25%
4	銀行業	7.37%
5	化学	6.12%

## 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・通信	1.90%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.38%
3	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消費財	1.23%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.12%
5	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット	0.99%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	7.90%
2	医薬品	6.75%
3	石油・ガス・消費財	6.29%
4	保険	3.87%
5	ソフトウェア	3.34%

## 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)	△0.01
株債指数先物取引(買建)	0.98

## 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	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	タイ/中国	インターネット	3.38%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・通信	3.35%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・電子部品	3.33%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR	株式	タイ/中国	インターネット	2.02%
5	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.90%

## 組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	15.23%
2	インターネット	7.56%
3	石油・ガス・消費財	6.90%
4	半導体・電子部品	4.98%
5	コンピュータ・通信	4.98%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株債指数先物取引(買建)	3.57

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。  
○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2016年7月29日

## 主要な資産の状況

## ■国内債券バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	82.90
内 日本	82.90
地方債証券	6.36
内 日本	6.36
特殊債証券	5.48
内 日本	5.48
社債券	4.82
内 日本	4.74
内 オランダ	0.05
内 イギリス	0.03
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.43
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	新設/満期	利率(%)	償還日	投資比率
1	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.17%
2	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.17%
3	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.16%
4	116回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2018/12/20	1.09%
5	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	1.09%

## ■外国債券バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	96.93
内 アメリカ	42.29
内 フランス	9.84
内 イタリア	9.46
内 イギリス	7.54
内 ドイツ	7.33
内 その他	20.47
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.07
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	新設/満期	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 1.375 09/30/18	国債証券	アメリカ	1.375000	2018/9/30	0.82%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.78%
3	US T N/B 0.75 12/31/17	国債証券	アメリカ	0.750000	2017/12/31	0.75%
4	US T N/B 1.875 09/30/17	国債証券	アメリカ	1.875000	2017/9/30	0.72%
5	US T N/B 0.5 07/31/17	国債証券	アメリカ	0.500000	2017/7/31	0.71%

## その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.09

## ■エマージング債券バッシブ・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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(%)
国債証券	96.60
内 トルコ	13.47
内 メキシコ	13.19
内 ロシア	12.22
内 インドネシア	10.40
内 ブラジル	9.55
内 その他	37.77
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.40
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	新設/満期	利率(%)	償還日	投資比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	ロシア	7.500000	2030/3/31	4.53%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.73%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.61%
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.050000	2040/1/11	1.34%
5	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	メキシコ	3.600000	2025/1/30	1.26%

## ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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(%)
投資証券	99.15
内 日本	99.15
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.85
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	7.47%
2	ジャパシリアルエステイト投資法人	日本	6.81%
3	日本リテールファンド投資法人	日本	5.40%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	5.31%
5	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.74%

## ■外国リート・バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	11.37
内 オーストラリア	8.48
内 シンガポール	2.86
内 カナダ	0.02
投資証券	88.15
内 アメリカ	72.67
内 イギリス	4.73
内 フランス	4.23
内 カナダ	1.87
内 香港	1.79
内 その他	2.88
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.48
純資産総額	100.00

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	6.03%
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.06%
3	PROLOGIS INC	アメリカ	2.44%
4	WELLTOWER INC	アメリカ	2.43%
5	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.29%

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2010年は設定日から年末までの収益率、および2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### 第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28年1月13日から平成28年7月12日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任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6期 平成28年1月12日現在	第7期中間計算期間末 平成28年7月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	32,503,016	18,445,057
親投資信託受益証券	1,306,262,396	1,330,266,171
流動資産合計	1,338,765,412	1,348,711,228
資産合計	1,338,765,412	1,348,711,228
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,172,528	1,446,617
未払受託者報酬	559,501	2,705
未払委託者報酬	7,433,843	35,943
その他未払費用	38,311	173
流動負債合計	10,204,183	1,485,438
負債合計	10,204,183	1,485,438
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,824,022,476	1,850,369,328
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	504,538,753	496,856,462
(分配準備積立金)	217,725,724	204,139,254
元本等合計	1,328,561,229	1,347,225,790
純資産合計	1,328,561,229	1,347,225,790
負債純資産合計	1,338,765,412	1,348,711,228

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間		第7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	自	平成28年1月13日 至 平成28年7月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		7,998		1,050
有価証券売買等損益		71,788,542		17,477,530
営業収益合計		71,796,540		17,476,480
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		5,512
受託者報酬		540,201		507,806
委託者報酬		17,177,337		16,747,077
その他費用		54,903		33,359
営業費用合計		7,772,441		7,293,754
営業利益又は営業損失( )		64,024,099		24,770,234
経常利益又は経常損失( )		64,024,099		24,770,234
中間純利益又は中間純損失( )		64,024,099		24,770,234
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( )		9,453,155		1,490,936
期首剰余金又は期首欠損金( )		569,502,564		504,538,753
剰余金増加額又は欠損金減少額		184,458,932		48,682,222
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		184,458,932		48,682,222
剰余金減少額又は欠損金増加額		83,186,218		33,085,215
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		83,186,218		33,085,215
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金( )		725,346,222		496,856,462

## (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28年1月12日、当中間計算期間末日を平成28年7月12日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 平成28年1月12日現在	第7期中間計算期間末 平成28年7月12日現在
1. 1 期首元本額	690,737,646円	824,022,476円
期中追加設定元本額	321,028,252円	80,395,849円
期中一部解約元本額	187,743,422円	54,048,997円
2. 受益権の総数	824,022,476口	850,369,328口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	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	第7期中間計算期間 自 平成28年1月13日 至 平成28年7月12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	70,683円	40,157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6期 平成28年1月12日現在	第7期中間計算期間末 平成28年7月12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6期 平成28年1月12日現在	第7期中間計算期間末 平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額	1,6123円	1,5843円
(1万口当たり純資産額)	(16,123円)	(15,843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、「外国リート・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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,393,222,349	3,295,677,894
株式	2	276,342,361,426	275,829,654,590
派生商品評価勘定		-	144,735,900
未収入金		-	758,704
未収配当金		375,847,721	377,071,737
前払金		167,729,000	-
流動資産合計		280,279,160,496	279,647,898,825
資産合計		280,279,160,496	279,647,898,825
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		260,639,956	-
前受金		-	50,180,000
未払金		37,223,144	-
未払解約金		173,697,000	155,451,000
流動負債合計		471,560,100	205,631,000
負債合計		471,560,100	205,631,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	137,895,802,136	148,415,661,869
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		141,911,798,260	131,026,605,956
元本等合計		279,807,600,396	279,442,267,825
純資産合計		279,807,600,396	279,442,267,825
負債純資産合計		280,279,160,496	279,647,898,825

## 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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	163,582,012,277円	137,895,802,136円
同期中追加設定元本額	31,054,451,267円	30,552,232,484円
同期中一部解約元本額	56,740,661,408円	20,032,372,751円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	5,243,119,200円	6,375,520,105円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,434,903,894円	1,517,074,465円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	6,372,306円	9,129,781円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	13,241,995円	18,120,418円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	33,085,052円	38,387,875円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	15,617,096円	19,030,231円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	10,949,401円	16,030,252円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,175,343円	15,535,935円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	37,229,466,103円	38,872,857,208円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	753,957,603円	919,699,441円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,677,160,685円	3,081,394,557円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,838,691,583円	3,099,880,644円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	360,300,606円	408,716,759円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,205,856,079円	1,309,764,939円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,077,747,976円	1,144,691,409円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	59,990,854円	64,244,342円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,225,789,571円	1,348,137,318円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	26,328,141円	30,643,797円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	23,879,309円	30,983,724円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	46,943,703円	64,287,197円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	101,897,155円	125,237,009円
投資のソムリエ	1,437,588,833円	1,071,677,253円
クルーズコントロール	411,063,743円	1,082,505,190円
投資のソムリエ<DC年金>	25,711,338円	24,728,210円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	68,146,669円	107,114,949円
DIAM DC バランス・F(成長型)	50,706,467円	78,510,194円
クルーズコントロール<DC年金>	65,644円	294,314円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	5,635,268円	13,048,526円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	7,643,548円	32,481,566円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	378,598円	3,612,277円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	475,439円
DIAM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)	290,705,619円	250,610,082円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	106,160,395円	124,900,758円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	576,396,892円	295,019,238円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	464,365,370円	479,199,961円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	40,121,091円	37,607,363円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	164,133,734円	149,398,370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)	39,392,533円	39,191,992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)	59,164,711円	53,768,869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)	5,310,699,991円	3,932,407,510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)	2,014,996,367円	1,387,516,225円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,925,294,426円	1,986,458,914円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,534,659,208円	1,621,942,721円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,028,185,938円	4,256,737,317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)	313,152,279円	351,862,082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)	814,928,278円	890,989,010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)	953,342,133円	1,034,171,932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)	3,906,961,067円	4,231,721,310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)	41,880,337円	46,003,219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)	1,304,865,632円	1,490,614,509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)	5,298,661,400円	5,637,233,765円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	19,928,952,130円	22,795,736,028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)	764,217,632円	834,560,866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)	2,257,945,180円	2,618,584,387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)	12,639,527,962円	14,363,871,126円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	34,355円	8,463,623円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	9,206,801円	3,687,271円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	15,369,659円	1,287,419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)	11,341,448,728円	12,951,006,433円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	106,482,768円	117,577,546円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	40,013,403円	46,345,852円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	23,270,239円	49,518,456円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	38,722,783円	85,470円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	117,038円	134,219円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	670,998,289円	729,123,003円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,887,540,594円	1,971,158,603円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,485,634,300円	2,597,804,800円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	94,839,111円	105,546,296円
	計	137,895,802,136円	148,415,661,869円
2.	受益権の総数	137,895,802,136口	148,415,661,869口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,377,500,000円	株式 2,721,500,000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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

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28年1月12日 現在				平成28年7月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,312,334,000	-	3,051,765,000	260,569,000	3,408,175,000	-	3,553,000,000	144,825,000
合計	3,312,334,000	-	3,051,765,000	260,569,000	3,408,175,000	-	3,553,000,000	144,825,000

## (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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額	2.0291円	1.8828円
(1万口当たり純資産額)	(20,291円)	(18,828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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,378,512,489	4,311,453,474
国債証券		339,001,056,200	322,124,996,600
地方債証券		27,726,101,297	24,865,502,878
特殊債券		23,820,724,355	21,390,621,441
社債券		21,974,406,920	18,809,990,520
未収利息		1,017,983,517	882,367,222
前払費用		20,720,985	7,312,311
流動資産合計		416,939,505,763	392,392,244,446
資産合計		416,939,505,763	392,392,244,446
負債の部			
流動負債			
未払金		851,602,400	2,553,334,000
未払解約金		227,765,000	282,886,000
流動負債合計		1,079,367,400	2,836,220,000
負債合計		1,079,367,400	2,836,220,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	332,334,674,604	293,429,460,781
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		83,525,463,759	96,126,563,665
元本等合計		415,860,138,363	389,556,024,446
純資産合計		415,860,138,363	389,556,024,446
負債純資産合計		416,939,505,763	392,392,244,446



## 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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	355,706,109,986円 83,582,766,525円 106,954,201,907円	332,334,674,604円 29,692,297,488円 68,597,511,311円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	10,422,340,439円	9,939,629,834円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	179,996,085円	172,180,702円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	134,619,110円	123,653,996円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	58,341,657円	36,694,771円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	441,457,931円	358,912,607円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	110,920,540円	109,095,285円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	19,733,972円	14,849,516円
たわらノーロード 国内債券	145,101,455円	867,835,410円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	- 円	755,274円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	11,440,979,213円	12,122,084,328円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	4,607,514,076円	4,455,584,454円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	6,981,550,379円	6,480,666,778円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,859,964,156円	2,577,558,464円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,702,593,088円	1,632,857,136円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,868,821,247円	1,751,975,900円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	277,399,912円	244,957,185円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	116,791,587円	106,713,310円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,431,182,324円	2,235,435,942円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	9,416,069円	8,622,472円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	238,570,350円	241,658,986円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,177,768円	180,929,656円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	45,802,577円	42,599,566円
投資のソムリエ	7,838,572,612円	8,397,162,509円
クルーズコントロール	909,261,368円	1,849,980,078円
投資のソムリエ<DC年金>	140,353,064円	193,382,273円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	696,372,772円	830,691,516円
DIAM DC バランス・F(成長型)	48,959,007円	60,028,288円
クルーズコントロール<DC年金>	144,945円	503,215円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,304,061円	5,984,109円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,498,216円	14,854,699円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,924,563円	42,386,066円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	1,290,856円
みずほエマージング債券オープン	10,801,911円	10,801,911円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券バッシブファンド(適格機関投資家向け)	31,119,371,814円	31,069,835,454円
DIAM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)	775,948,701円	1,017,679,760円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	627,350,416円	565,187,887円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,243,748,653円	487,442,086円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	333,618,744円	263,811,800円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	168,338,894円	120,775,930円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	442,409,232円	308,333,672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)	177,024,127円	134,933,432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)	141,749,531円	98,616,394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)	14,319,323,771円	8,118,962,428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)	5,433,174,282円	2,864,915,809円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	9,230,597,150円	7,291,975,868円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	4,137,017,580円	3,347,753,977円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	7,238,748,293円	5,855,748,971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)	844,399,916円	726,773,720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)	3,663,128,444円	3,065,894,724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)	5,142,793,879円	4,268,643,026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)	7,021,084,542円	5,822,179,052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)	884,082,241円	839,267,900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)	7,038,621,101円	6,155,191,528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)	7,564,188,784円	6,389,387,464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)	95,566,153,088円	83,634,375,559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)	1,372,854,302円	1,148,667,373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)	8,115,982,356円	7,203,461,902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)	30,286,852,009円	26,338,733,812円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	495,530円	93,379,444円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	41,401,133円	12,695,134円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	27,629,632円	1,771,365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)	33,976,620,681円	29,685,358,819円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	630,558,152円	532,331,561円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	167,965,929円	149,060,577円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	418,821,258円	684,215,766円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	243,744,056円	414,302円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	351,001円	308,265円
	計	332,334,674,604円	293,429,460,781円
2.	受益権の総数	332,334,674,604口	293,429,460,781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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額	1,2513円	1,3276円
（1万口当たり純資産額）	（12,513円）	（13,276円）

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		64,656,718	882,564,332
投資証券		22,044,521,100	23,952,942,300
未収入金		1,934,442,837	-
未収配当金		196,965,222	165,028,773
流動資産合計		24,240,585,877	25,000,535,405
資産合計		24,240,585,877	25,000,535,405
負債の部			
流動負債			
未払金		490,278	807,398,140
未払解約金		104,733,000	187,000
流動負債合計		105,223,278	807,585,140
負債合計		105,223,278	807,585,140
純資産の部			
元本等			
元本	1	15,337,732,833	13,435,861,348
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		8,797,629,766	10,757,088,917
元本等合計		24,135,362,599	24,192,950,265
純資産合計		24,135,362,599	24,192,950,265
負債純資産合計		24,240,585,877	25,000,535,405

## 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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,405,369,329円	15,337,732,833円
同期中追加設定元本額	16,153,512,718円	7,386,306,766円
同期中一部解約元本額	17,221,149,214円	9,288,178,251円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	397,486円	770,094円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,218,861円	1,796,596円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	3,050,633円	4,124,246円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	971,903円	1,604,893円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,001,579円	1,589,159円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,030,011円	1,669,466円
たわらノーロード 国内リート	67,911,873円	454,389,186円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	- 円	5,448,856円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,438,842円	16,021,050円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	375,068,015円	341,601,580円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	4,469,392円	4,609,929円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	9,721,510円	9,473,646円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	25,042,951円	27,212,976円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	61,581,809円	58,441,189円
投資のソムリエ	577,590,467円	360,195,576円

投資のソムリエ<DC年金>	10,300,179円	8,275,506円
DIAM 8資産バランスファン ドN<DC年金>	27,363,706円	32,820,619円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	254,694円	1,819,886円
ダイナミック・ナビゲーション	-円	383,417円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 10(適格機関投資家限定)	2,017,708,759円	993,509,510円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	1,090,204,032円	1,072,040,993円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	2,124,936,873円	2,091,078,459円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	6,951,010,304円	7,366,841,007円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	57,261,963円	59,812,821円
DIAM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)	834,883,747円	231,706,681円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	1,038,835,576円	251,146,339円
DIAM リスクコントロール J-REITファンド(適格機 関投資家限定)	37,477,668円	37,477,668円
計	15,337,732,833円	13,435,861,348円
2. 受益権の総数	15,337,732,833口	13,435,861,348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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額	1,5736円	1,8006円
（1万口当たり純資産額）	（15,736円）	（18,006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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,843,175,851	2,482,691,968
コール・ローン		99,622,215	831,783,347
株式		239,368,397,850	240,877,083,386
投資信託受益証券		710,818,356	881,187,225
投資証券		5,843,780,192	6,347,144,213
派生商品評価勘定		214,385	214,206,748
未収入金		1,939,313	25,112,960
未収配当金		344,637,908	315,083,668
差入委託証拠金		1,662,902,378	1,777,093,124
流動資産合計		251,875,488,448	253,751,386,639
資産合計		251,875,488,448	253,751,386,639
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		344,558,300	16
未払金		-	11,092,249
未払解約金		100,968,000	153,234,000
流動負債合計		445,526,300	164,326,265
負債合計		445,526,300	164,326,265
純資産の部			
元本等			
元本	1	97,735,137,391	102,743,119,077
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		153,694,824,757	150,843,941,297
元本等合計		251,429,962,148	253,587,060,374
純資産合計		251,429,962,148	253,587,060,374
負債純資産合計		251,875,488,448	253,751,386,639

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	109,595,049,033円	97,735,137,391円
同期中追加設定元本額	17,681,386,328円	15,556,223,841円
同期中一部解約元本額	29,541,297,970円	10,548,242,155円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,152,620,379円	1,860,070,953円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,948,687円	7,070,818円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,286,868円	16,314,685円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	25,891,522円	37,700,196円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	12,127,549円	14,738,824円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	8,505,193円	14,433,689円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	8,744,923円	15,258,200円
たわらノーロード 先進国株式	271,389,618円	1,626,782,483円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	- 円	426,031円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	34,267,965,537円	35,153,246,632円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	156,636,797円	175,410,587円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	836,424,717円	919,847,850円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,060,659,656円	1,122,290,696円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	140,986,314円	145,919,659円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	406,671,520円	406,699,674円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	338,651,848円	343,433,795円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	42,663,525円	45,778,536円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	872,208,370円	951,244,965円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	231,794,603円	231,426,141円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	18,857,253円	23,489,567円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	36,754,707円	49,505,505円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	80,148,275円	95,169,676円

投資のソムリエ	339,757,071円	401,696,368円
クルーズコントロール	159,910,174円	410,352,661円
投資のソムリエ<DC年金>	6,043,950円	9,319,256円
DIAM 8資産バランスファン ドN<DC年金>	53,767,391円	83,698,246円
DIAM DC バランス・F (成長型)	18,740,201円	28,675,864円
クルーズコントロール<DC年 金>	25,159円	111,489円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,464,834円	3,313,185円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	1,957,062円	8,249,488円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	73,969円	2,039,677円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	634,103円
DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用)	251,105,219円	208,696,593円
DIAM外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,401,821,371円	3,250,363,008円
DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	174,358,190円	145,609,101円
DIAM先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	- 円	392,381円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	35,597,952円	40,539,307円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	451,682,842円	223,630,974円
DIAMグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	363,764,256円	363,341,022円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	31,437,072円	28,499,478円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	192,853,625円	169,807,939円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	15,423,325円	14,847,320円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	30,887,628円	27,147,646円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	4,160,443,133円	2,980,691,956円

D I A M世界バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	2,368,277,596円	1,578,073,421円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,005,184,802円	1,003,410,109円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	1,051,917,126円	1,075,482,053円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	3,155,528,740円	3,225,614,018円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A ( 適格機関投 資家限定 )	1,233,229,496円	1,334,768,278円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 ( 適格機関 投資家限定 )	1,925,332,257円	2,026,788,286円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,492,762,853円	1,567,593,129円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A ( 適格機関投資家 向け )	1,018,540,451円	1,066,158,344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 )	11,130,233円	12,333,699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 )	4,623,912,268円	5,086,524,668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 )	1,693,059,024円	1,739,502,696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 )	10,410,355,488円	11,517,500,979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 )	598,466,354円	632,413,399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 )	1,768,131,803円	1,984,427,572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 )	6,600,216,428円	7,259,619,136円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	133,759円	32,096,738円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	28,727,295円	11,009,666円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	43,970,103円	3,528,117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 )	8,884,320,454円	9,814,474,097円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	54,572,307円	113,400,844円

	D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	91,043,052円	187,990円
	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	273,217円	295,614円
	計	97,735,137,391円	102,743,119,077円
2.	受益権の総数	97,735,137,391口	102,743,119,077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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

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28年1月12日 現在				平成28年7月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	122,124,485	-	121,910,100	214,385	18,512,747	-	18,512,600	147
アメリカ・ドル	67,145,430	-	67,140,300	5,130	-	-	-	-
イギリス・ボンド	15,445,830	-	15,427,800	18,030	14,686,155	-	14,686,100	55
オーストラリア・ドル	2,473,620	-	2,473,200	420	774,370	-	774,300	70
カナダ・ドル	7,493,510	-	7,461,000	32,510	782,038	-	782,000	38
ユーロ	29,566,095	-	29,407,800	158,295	2,270,184	-	2,270,200	16
買 建	-	-	-	-	656,516,465	-	668,944,200	12,427,735
アメリカ・ドル	-	-	-	-	448,578,690	-	456,837,000	8,258,310
イギリス・ボンド	-	-	-	-	50,849,448	-	52,068,900	1,219,452
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	26,649,000	-	27,104,000	455,000
カナダ・ドル	-	-	-	-	27,001,100	-	27,370,000	368,900
ユーロ	-	-	-	-	103,438,227	-	105,564,300	2,126,073
合計	122,124,485	-	121,910,100	214,385	675,029,212	-	687,456,800	12,427,882

## (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28年1月12日 現在				平成28年7月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,666,776,185	-	5,322,217,885	344,558,300	5,204,120,381	-	5,405,899,231	201,778,850
合計	5,666,776,185	-	5,322,217,885	344,558,300	5,204,120,381	-	5,405,899,231	201,778,850

## (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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額	2.5726円	2.4682円
(1万口当たり純資産額)	(25,726円)	(24,682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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,698,070,125	4,317,387,365
コール・ローン		291,474,629	2,067,898,391
国債証券		278,281,011,942	250,744,122,597
派生商品評価勘定		503,338	32,110,877
未収利息		2,758,190,278	2,159,667,982
前払費用		79,304,720	119,039,967
流動資産合計		287,108,555,032	259,440,227,179
資産合計		287,108,555,032	259,440,227,179
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		68,304	232
未払金		2,595,316,426	-
未払解約金		164,480,000	170,610,000
流動負債合計		2,759,864,730	170,610,232
負債合計		2,759,864,730	170,610,232
純資産の部			
元本等			
元本	1	157,146,877,456	154,773,243,960
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		127,201,812,846	104,496,372,987
元本等合計		284,348,690,302	259,269,616,947
純資産合計		284,348,690,302	259,269,616,947
負債純資産合計		287,108,555,032	259,440,227,179

## 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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	184,357,351,879円  24,072,208,637円 51,282,683,060円	157,146,877,456円  20,605,329,402円 22,978,962,898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	4,632,609,121円	4,657,576,294円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	16,724,661円	18,453,626円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	49,393,546円	49,958,425円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	89,340,619円	76,117,034円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	40,990,271円	38,466,174円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	40,835,253円	44,194,140円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	30,173,710円	30,803,761円
たわらノーロード 先進国債券	62,320,567円	336,310,017円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	- 円	606,412円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	4,607,021,121円	4,667,939,685円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	381,621,256円	409,560,484円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,288,327,853円	1,342,108,909円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,366,997,870円	1,396,294,182円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	325,115,189円	329,414,218円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	702,091,373円	702,091,373円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	519,717,784円	508,486,226円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	27,522,794円	27,854,849円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	566,824,244円	575,214,392円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	23,731,784円	22,038,818円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	8,579,678円	10,139,432円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	14,982,115円	18,447,725円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	30,501,024円	34,021,297円
クルーズコントロール DIAM 8資産バランスマ ンドN<DC年金>	592,777,382円 24,577,735円	1,493,506,912円 34,924,753円
DIAM DC バランス・F (成長型)	23,881,626円	34,167,706円
クルーズコントロール<DC年 金>	94,958円	406,569円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	4,320,630円	9,652,400円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	5,894,605円	24,004,043円
ダイナミック・ナビゲーシ ョン	-円	1,293,257円
DIAMパッシブ資産分散ファ ンド	1,825,343,934円	1,681,199,585円
DIAM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)	6,964,866,690円	7,844,833,698円
DIAM外国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	4,693,991,211円	4,309,315,918円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	2,391,636,066円	4,584,579,483円
DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	329,808,770円	246,920,518円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	128,365,986円	135,908,048円
DIAMグローバル・バラン スファンド25VA(適格機関投 資家限定)	3,354,131,198円	1,541,804,314円

D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A ( 適格機関投資家 限定)	899,947,592円	834,638,389円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A ( 適格機関投資家 限定)	113,441,262円	95,495,469円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A ( 適格機関投資家 限定)	198,730,313円	162,474,503円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A ( 適格機関投資家 限定)	47,708,392円	42,645,519円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A ( 適格機関投資家 限定)	23,864,059円	19,463,620円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A ( 適格機関投資家限 定)	9,650,231,702円	6,418,647,576円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限 定)	2,440,640,362円	1,509,710,690円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	5,443,074,652円	5,044,482,862円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限 定)	3,018,044,259円	2,867,773,547円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定)	4,878,613,601円	4,629,898,206円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A ( 適格機関投 資家限定)	946,789,436円	957,544,555円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 ( 適格機関 投資家限定)	3,449,631,113円	3,393,963,726円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	4,623,134,564円	4,498,153,103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)	17,389,138,689円	16,925,006,734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)	54,973,620円	56,954,254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)	2,366,232,785円	2,432,893,808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)	11,247,854,827円	11,168,532,699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)	16,086,647,926円	16,532,238,451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)	20,408,738,102円	20,832,660,363円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	124,405円	27,666,037円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	27,840,409円	10,037,825円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	18,575,269円	1,401,032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)	18,317,153,960円	18,781,902,219円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	128,954,949円	127,936,598円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	84,456,122円	162,127,584円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	117,081,015円	234,554円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	141,447円	145,360円
計	157,146,877,456円	154,773,243,960円
2 . 受益権の総数	157,146,877,456口	154,773,243,960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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

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28年1月12日 現在				平成28年7月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	85,913,818	-	85,410,480	503,338	32,804,158	-	32,804,390	232
ユーロ	85,913,818	-	85,410,480	503,338	32,804,158	-	32,804,390	232
買 建	1,250,924,084	-	1,250,855,780	68,304	1,674,302,693	-	1,706,413,570	32,110,877
アメリカ・ドル	562,946,128	-	562,918,410	27,718	670,247,125	-	682,586,340	12,339,215
イギリス・ボン ド	187,711,251	-	187,704,900	6,351	83,706,014	-	85,713,420	2,007,406
カナダ・ドル	-	-	-	-	167,252,528	-	169,537,600	2,285,072
ポーランド・ズ ロチ	25,000,678	-	24,976,850	23,828	-	-	-	-
ユーロ	475,266,027	-	475,255,620	10,407	753,097,026	-	768,576,210	15,479,184
合計	1,336,837,902	-	1,336,266,260	435,034	1,707,106,851	-	1,739,217,960	32,110,645

(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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8094円 (18,094円)	1.6752円 (16,752円)

## 「外国リート・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28年7月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		884,678,726
コール・ローン		46,162,071
投資信託受益証券		3,847,993,381
投資証券		29,792,500,300
派生商品評価勘定		7,520
未収配当金		104,133,978
流動資産合計		34,675,475,976
資産合計		34,675,475,976
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,898
未払金		807,257,409
未払解約金		22,000,000
流動負債合計		829,259,307
負債合計		829,259,307
純資産の部		
元本等		
元本	1	30,432,201,770
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		3,414,014,899
元本等合計		33,846,216,669
純資産合計		33,846,216,669
負債純資産合計		34,675,475,976

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年7月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	26,797,491,574円
同期中追加設定元本額	14,768,972,344円
同期中一部解約元本額	11,134,262,148円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド	85,146,602円
<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド	31,624,429円
<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	13,199,640円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	30,478,935円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	70,478,490円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	27,512,661円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	26,962,207円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,522,170円
たわらノーロード 先進国リート	860,500,318円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	8,288,672円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	26,181,578円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	543,841,270円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	80,620,116円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	15,564,819円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	43,803,050円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	94,210,786円
投資のソムリエ	1,786,627,593円
投資のソムリエ<DC年金>	41,327,733円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	55,490,458円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 ダイナミック・ナビゲーション	6,032,939円 613,211円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,447,767,054円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	4,891,687円
為替フルヘッジ型外国リート・パッシブ・ファンド(適格機関投資家限定)	235,476,312円
DIAM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)	105,114,015円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	4,746,502,433円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	50,484,750円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	12,778,876,412円
DIAM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)	3,036,946,149円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	3,586,745,115円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	562,370,166円
計	30,432,201,770円
2. 受益権の総数	30,432,201,770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28年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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>
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。

## (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28年7月12日 現在			
	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	26,247,789	-	26,240,380	7,409
ユーロ	15,664,269	-	15,664,380	111
香港・ドル	10,583,520	-	10,576,000	7,520
買 建	33,366,287	-	33,364,500	1,787
アメリカ・ドル	33,366,287	-	33,364,500	1,787
合計	59,614,076	-	59,604,880	5,622

## （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28年7月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1122円 (11,122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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		504,593,573	1,913,540,021
コール・ローン		39,386,400	165,821,823
株式		30,903,849,398	34,364,026,070
投資信託受益証券		213,344,522	238,713,333
投資証券		99,523,361	112,514,755
派生商品評価勘定		-	75,339,411
未収入金		-	779,327
未収配当金		15,714,978	213,239,791
差入委託証拠金		296,519,211	370,605,641
流動資産合計		32,072,931,443	37,454,580,172
資産合計		32,072,931,443	37,454,580,172
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		50,458,335	3,573,072
未払金		126,028,250	863,610,121
未払解約金		16,871,000	13,690,000
流動負債合計		193,357,585	880,873,193
負債合計		193,357,585	880,873,193
純資産の部			
元本等			
元本	1	39,843,963,916	44,260,154,983
剰余金			
剰余金又は欠損金( )	2	7,964,390,058	7,686,448,004
元本等合計		31,879,573,858	36,573,706,979
純資産合計		31,879,573,858	36,573,706,979
負債純資産合計		32,072,931,443	37,454,580,172

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



## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	39,367,301,761円	39,843,963,916円
同期中追加設定元本額	18,976,406,990円	14,378,345,545円
同期中一部解約元本額	18,499,744,835円	9,962,154,478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 >	870,537,540円	1,288,572,678円
D I A M新興国株式インデック スファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	19,979,163円	109,971,037円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	8,599,925円	9,493,872円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	25,440,862円	25,710,953円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	81,231,193円	39,215,095円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	21,077,324円	19,789,538円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	21,035,717円	22,745,716円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	27,436,748円	15,870,387円
たわらノーロード 新興国株式	- 円	428,760,326円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	- 円	12,626,903円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	510,196,135円	534,755,049円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	29,658,485円	35,045,169円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	76,889,791円	98,599,627円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	188,143,542円	212,453,833円
投資のソムリエ	1,077,540,227円	1,812,394,970円
クルーズコントロール	462,865,911円	1,236,123,712円
投資のソムリエ< D C 年金 >	19,208,691円	41,920,471円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C 年金 >	84,150,830円	124,852,987円
クルーズコントロール< D C 年 金 >	72,955円	335,983円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	8,415,198円	19,941,295円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	11,161,515円	49,625,147円
投資のソムリエ< D C 年金 >リ スク抑制型	234,481円	6,129,158円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	545,601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)	7,098,394,804円	7,655,896,389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)	191,028,343円	190,433,666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)	2,145,904,763円	2,193,601,345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)	16,439,453,886円	17,211,263,822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)	10,425,305,887円	10,863,480,254円
	計	39,843,963,916円	44,260,154,983円
2 .	受益権の総数	39,843,963,916口	44,260,154,983口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,964,390,058円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,686,448,004円であります。

## （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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

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28年1月12日 現在				平成28年7月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	212,547,798	-	216,119,132	3,571,334
アメリカ・ドル	-	-	-	-	212,547,798	-	216,119,132	3,571,334
買 建	153,134,540	-	153,127,000	7,540	329,266,388	-	335,057,456	5,791,068
アメリカ・ドル	153,134,540	-	153,127,000	7,540	-	-	-	-
インドネシア・ルピア	-	-	-	-	17,844,335	-	18,034,910	190,575
コロンビア・ペソ	-	-	-	-	6,044,824	-	6,132,580	87,756
タイ・バーツ	-	-	-	-	23,548,743	-	23,891,100	342,357
フィリピン・ペソ	-	-	-	-	8,025,375	-	8,137,500	112,125
ブラジル・リアル	-	-	-	-	72,249,141	-	73,265,646	1,016,505
マレーシア・リンギット	-	-	-	-	28,225,705	-	28,824,180	598,475
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	38,895,150	-	39,627,000	731,850
台湾・ドル	-	-	-	-	116,409,498	-	118,668,000	2,258,502
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	18,023,617	-	18,476,540	452,923
合計	153,134,540	-	153,127,000	7,540	541,814,186	-	551,176,588	2,219,734

(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28年1月12日 現在				平成28年7月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	854,188,415	-	803,737,620	50,450,795	1,772,295,700	-	1,841,842,305	69,546,605
合計	854,188,415	-	803,737,620	50,450,795	1,772,295,700	-	1,841,842,305	69,546,605

## (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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額	0.8001円	0.8263円
(1万口当たり純資産額)	(8,001円)	(8,263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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,681,575,183	3,570,541,099
コール・ローン		25,347,818	723,278,214
国債証券		45,261,801,641	51,366,112,029
派生商品評価勘定		290,000	12,619,440
未収入金		7,879,336,545	-
未収利息		689,019,990	683,319,278
前払費用		340,566,713	138,750,189
流動資産合計		55,877,937,890	56,494,620,249
資産合計		55,877,937,890	56,494,620,249
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,951,000	-
未払金		252,327,600	2,886,677,215
未払解約金		12,725,000	10,146,000
流動負債合計		268,003,600	2,896,823,215
負債合計		268,003,600	2,896,823,215
純資産の部			
元本等			
元本	1	32,117,451,125	31,262,426,139
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		23,492,483,165	22,335,370,895
元本等合計		55,609,934,290	53,597,797,034
純資産合計		55,609,934,290	53,597,797,034
負債純資産合計		55,877,937,890	56,494,620,249

## 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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	23,920,411,405円	32,117,451,125円
同期中追加設定元本額	45,832,277,434円	15,989,325,978円
同期中一部解約元本額	37,635,237,714円	16,844,350,964円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	13,743,994円	94,766,105円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	62,230,620円	66,007,340円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	15,001,959円	16,757,240円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	38,845,125円	46,563,531円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	95,788,554円	101,573,970円
投資のソムリエ	1,426,851,882円	2,864,387,945円
クルーズコントロール	249,216,579円	587,740,770円
投資のソムリエ<DC年金>	25,542,585円	66,121,012円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	42,875,511円	58,760,088円
クルーズコントロール<DC年金>	39,295円	159,825円
DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）	2,268,568円	4,714,367円

D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	3,061,585円	11,801,452円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	351,697円	12,547,457円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	390,666円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	5,714,487,906円	3,120,641,050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)	436,148,271円	503,111,358円
エマージング債券パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	3,685,046,795円	3,663,571,532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)	8,357,358,025円	8,220,355,918円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	5,300,140,113円	5,178,166,088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)	2,965,384,800円	3,037,431,770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II(適格機関投資家限 定)	3,683,067,261円	3,606,856,655円
計	32,117,451,125円	31,262,426,139円
2 . 受益権の総数	32,117,451,125口	31,262,426,139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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

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28年1月12日 現在				平成28年7月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000	-	-	-	-
アメリカ・ドル	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	685,468,560	-	698,088,000	12,619,440
アメリカ・ドル	-	-	-	-	685,468,560	-	698,088,000	12,619,440
合計	8,560,672,000	-	8,563,333,000	2,661,000	685,468,560	-	698,088,000	12,619,440

(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28年1月12日現在	平成28年7月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7315円 (17,315円)	1.7144円 (17,144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28年7月29日現在

資産総額	1,399,944,604円
負債総額	1,870,144円
純資産総額( - )	1,398,074,460円
発行済数量	851,224,271口
1口当たり純資産額( / )	1.6424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28年7月29日現在

資産総額	283,753,919,033円
負債総額	744,207,668円
純資産総額( - )	283,009,711,365円
発行済数量	146,094,339,413口
1口当たり純資産額( / )	1.9372円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	398,735,456,342円
負債総額	10,246,604,000円
純資産総額( - )	388,488,852,342円
発行済数量	295,667,334,525口
1口当たり純資産額( / )	1.3139円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	24,553,451,575円
負債総額	85,319,000円
純資産総額( - )	24,468,132,575円
発行済数量	13,458,318,935口
1口当たり純資産額( / )	1.8181円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	259,987,986,034円
負債総額	254,940,508円
純資産総額( - )	259,733,045,526円
発行済数量	101,479,245,363口
1口当たり純資産額( / )	2.5595円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	264,533,397,966円
負債総額	144,395,320円
純資産総額（ - ）	264,389,002,646円
発行済数量	155,159,431,634口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7040円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	34,948,764,639円
負債総額	14,484,000円
純資産総額（ - ）	34,934,280,639円
発行済数量	30,411,475,690口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1487円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	38,268,118,676円
負債総額	328,429,636円
純資産総額（ - ）	37,939,689,040円
発行済数量	43,579,576,666口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8706円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成28年7月29日現在

資産総額	53,948,501,547円
負債総額	32,540,000円
純資産総額（ - ）	53,915,961,547円
発行済数量	31,404,166,557口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7168円

## 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】

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>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。

平成28年7月29日現在、D I A Mアセットマネジメント株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	389	5,918,600,293,964
単位型公社債投資信託	48	353,027,465,726
単位型株式投資信託	7	79,600,055,072
合計	444	6,351,227,814,762

（ご参考）

平成28年7月29日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

・みずほ投信投資顧問株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	13	250,148,557,515
追加型株式投資信託	234	2,260,638,584,910
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,491,433,486
合計	250	2,512,278,575,911

・新光投信株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
-------	----	----------

追加型公社債投資信託	25	622,747,870,142
追加型株式投資信託	244	3,210,390,488,192
単位型公社債投資信託	6	40,614,819,596
単位型株式投資信託	75	269,539,047,169
合計	350	4,143,292,225,099

独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月25日

DIAMアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド エボリューションの平成28年1月13日から平成28年7月12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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド エボリューションの平成28年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年1月13日から平成28年7月12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**

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

以上

---

上記は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。

XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。