

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成26年7月18日

【発行者名】 D I A Mアセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 西 惠正

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 上野 圭子

【電話番号】 03-3287-3110

【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】 D I A M新興国株式インデックスファンド< D C年金 >

【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】 500億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

D I A M新興国株式インデックスファンド< D C年金 >
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下、「委託会社」または「D I A M」（ダイヤモンド）といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

500億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（ 6 ） 【 申込単位 】

1口以上1口単位または1円以上1円単位（当初元本：1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

（ 7 ） 【 申込期間 】

継続申込期間：平成26年7月19日から平成27年7月17日まで

お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。なお、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、香港証券取引所、韓国証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、香港の銀行または韓国の銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は以下の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ） 【 その他 】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。

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

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 エマージング株式バシブ・マザーファンドを通じて、主として海外の金融商品取引所に上場している株式^(*)に実質的に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）^(注)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。

(注)MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

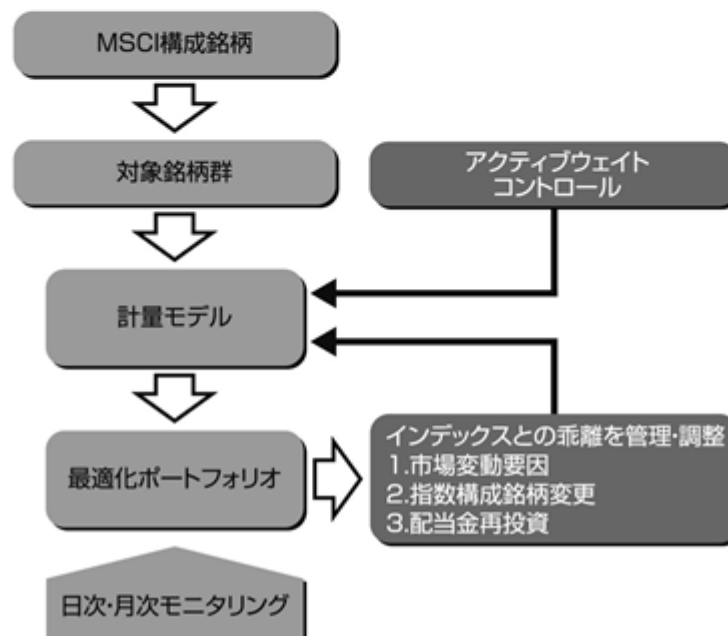
2 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

3 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

運用プロセス

現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。



分配方針

年1回の決算時(毎年4月18日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

「海外」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資対象資産

「株式」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

補足分類

「インデックス型」とは目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（株式））」とは目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。

(注) 商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（株式））に分類されます。

決算頻度

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

投資対象地域

「エマージング」とは目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態

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

為替ヘッジ

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

対象インデックス

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

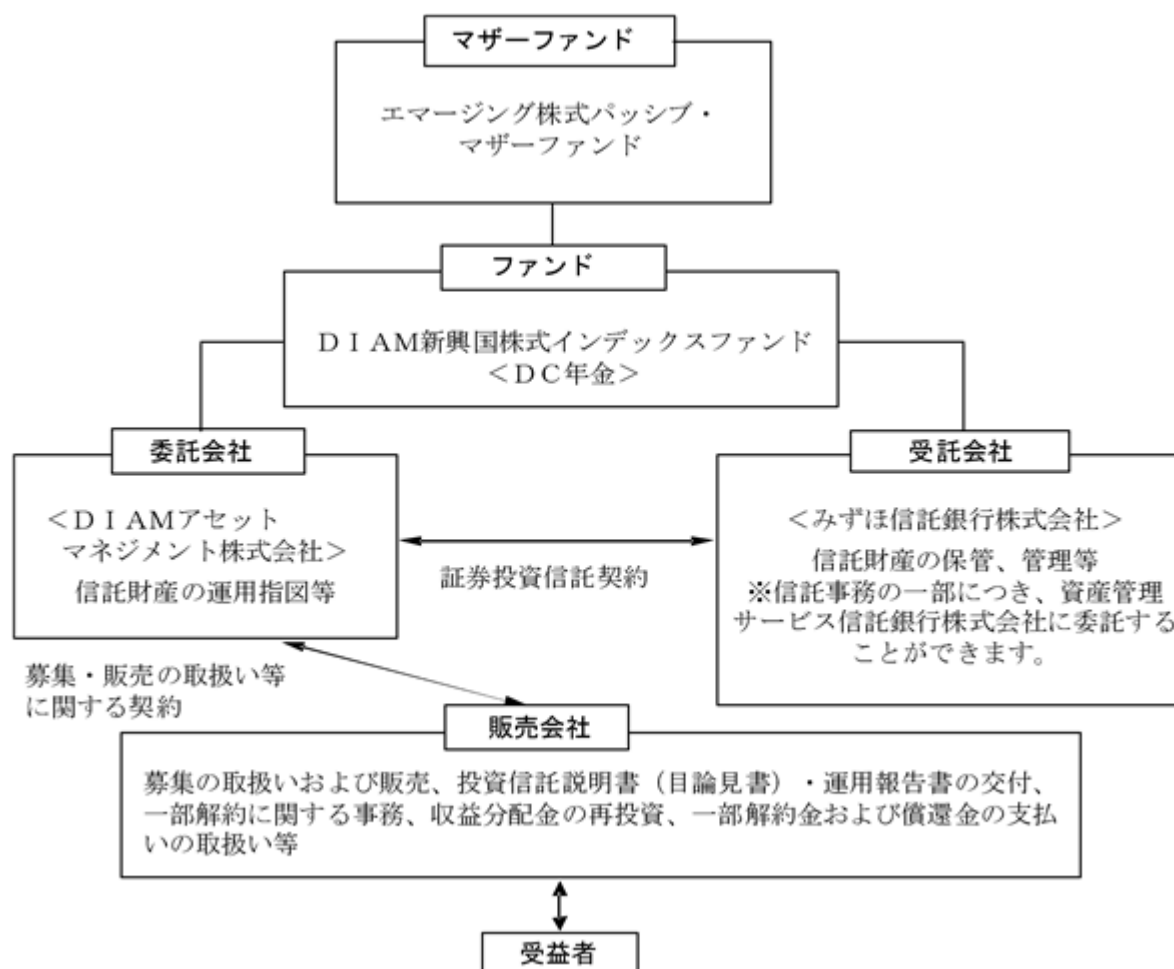
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（URL <http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

平成23年5月17日 信託契約締結、当初設定日、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものであります。

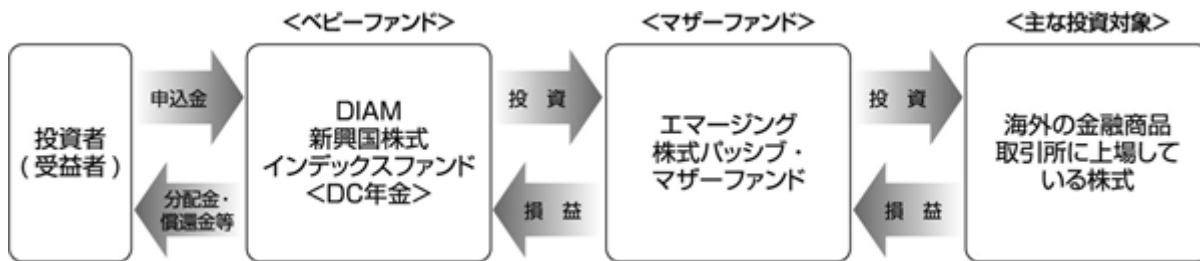
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：D I A Mアセットマネジメント株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内三丁目3番1号

資本金の額

20億円（平成26年4月30日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

大株主の状況

（平成26年4月30日現在）

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、主として海外の金融商品取引所に上場している株式^(*)に実質的に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

^(*) DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。

< 投資対象 >

エマージング株式パッシブ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

< 投資態度 >

主としてエマージング株式パッシブ・マザーファンド受益証券に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてDIAMアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託であるエマージング株式パッシブ・マザーファンドの受益証券のほか次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
 8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. ~ 12. の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
 15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、)。
 18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、)。
 21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 23. 外国の者に対する権利で22. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書、13. ならびに18. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から7. までの証券および13. ならびに18. の証券または証書のうち2. から7. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. の証券および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

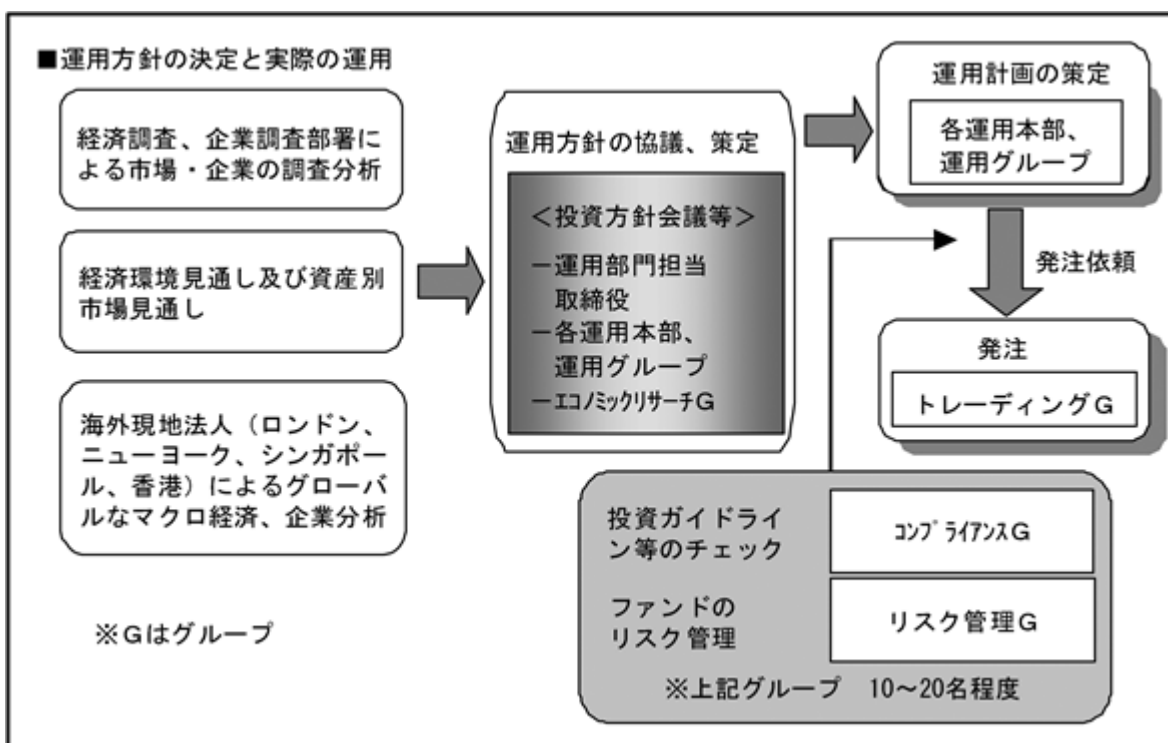
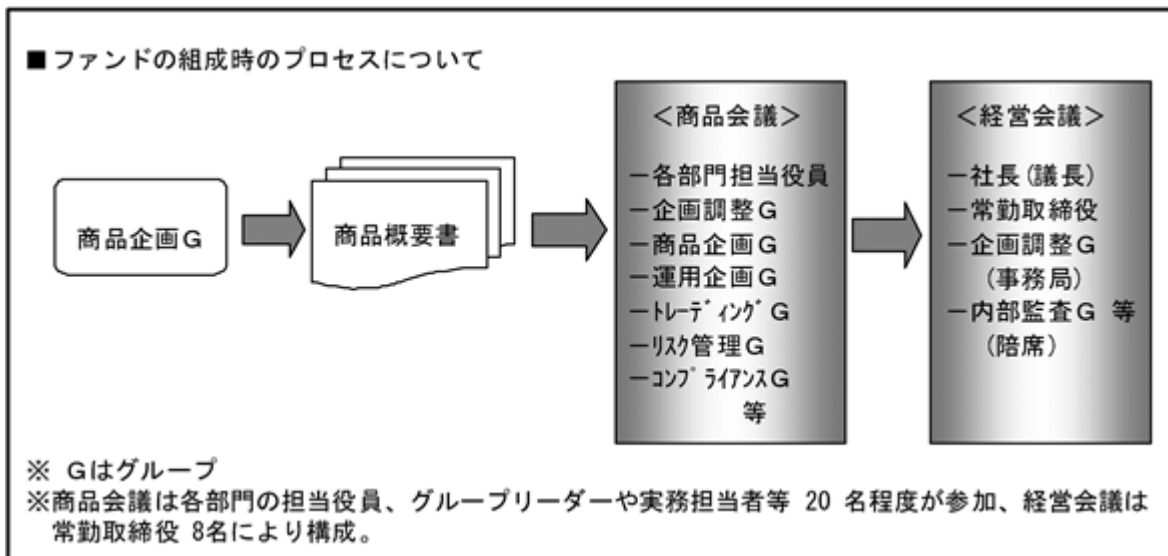
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

(参考) 当ファンドが投資するマザーファンドの概要

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の金融商品取引所に上場している株式 ^(*) に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 (*) DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券及び証書等を含みます。
主な投資対象	海外の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	主として海外の金融商品取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 原則として、株式の組入比率は高位を維持します。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

<ファンドの組成時のプロセスについて>

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

<運用方針の決定と実際の運用>

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

「投資方針会議」において決定された運用方針をファンドの投資方針に照らし合わせて運用計画を策定します。なお、運用計画の策定は、運用担当者およびアナリスト等の調査活動等から得られた情報も参考にされます。

個別の有価証券等の発注は、運用部門から独立したトレーディンググループで執行されます。

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

上記体制は平成26年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年4月18日。休業日の場合は翌営業日。）に以下の方針に基づき収益分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

(3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配方式

(1) 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1) 信託財産に属する利子配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する利子配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

(2)上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産に係る利子配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に全額が再投資されます。

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

(5)【投資制限】

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

マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。

株式への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

株式への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

非株式割合（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）は、信託財産総額の50%以下とします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

投資する株式等の範囲（約款第20条）

(1)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場（上場予定を含みます。）されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

(2)上記(1)の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図範囲（約款第21条）

(1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

(2)上記(1)の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
- 2.株式分割により取得する株券
- 3.有償増資により取得する株券
- 4.売出しにより取得する株券
- 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
- 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図（約款第22条）

- (1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
- (2)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (3)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図（約款第23条）

- (1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため異なる通貨、異なる受取金利、または異なる受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- (4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

- (1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

- (1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1. 2.の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (2) 上記(1) 1. 2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (3) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26条）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引の指図（約款第27条）

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

資金の借入れ（約款第33条）

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

(3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

カントリーリスク

当ファンドが実質的に投資を行う新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化などが金融市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制などの種々な規制の導入や政策の変更等の要因も金融市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

株価変動リスク

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

為替リスク

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

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

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

< その他の留意点 >

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

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス構成全銘柄を組入れない場合があること、資金流出入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

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

変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

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

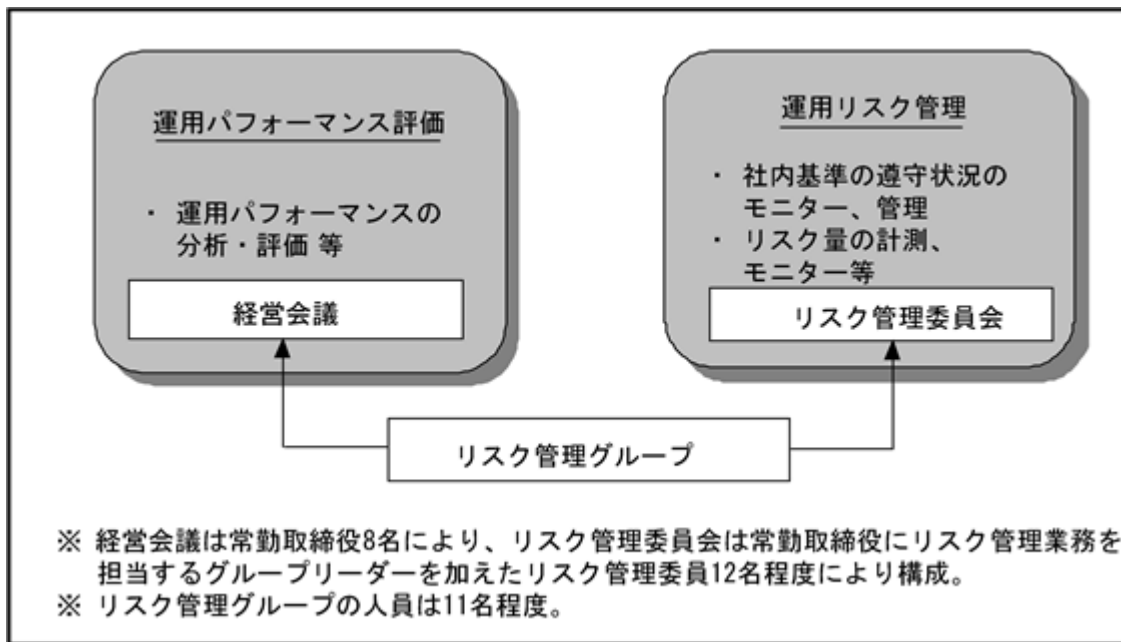
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回った場合、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

注意事項

- ・当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< 運用評価・運用リスク管理体制 >



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

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

上記体制は平成26年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.594%（税抜0.55%）

信託報酬の配分（税抜）	
委託会社	年率0.270%
販売会社	年率0.245%
受託会社	年率0.035%

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産留保額
ありません。
- ・その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

信託財産の財務諸表監査に要する費用は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

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

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、平成26年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成26年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	215,694,712	100.02
内 日本	215,694,712	100.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	40,753	0.02
純資産総額	215,653,959	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)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	36,504,681,311	94.81
内 韓国	5,926,280,569	15.39
内 台湾	4,406,583,247	11.45
内 ブラジル	4,174,654,517	10.84
内 中国	3,526,014,326	9.16
内 南アフリカ	2,881,626,225	7.48
内 インド	2,462,050,941	6.39
内 ロシア	1,797,980,902	4.67
内 ケイマン諸島	1,568,949,953	4.07
内 メキシコ	1,532,875,185	3.98
内 香港	1,499,466,113	3.89
内 マレーシア	1,422,363,440	3.69
内 インドネシア	977,093,338	2.54
内 タイ	849,222,986	2.21
内 ポーランド	638,550,263	1.66
内 トルコ	573,855,321	1.49
内 チリ	559,245,625	1.45
内 コロンビア	386,508,408	1.00
内 バミューダ	384,138,863	1.00
内 フィリピン	360,237,970	0.94
内 ギリシャ	228,499,089	0.59
内 チェコ	99,016,029	0.26
内 ハンガリー	87,498,039	0.23
内 エジプト	80,303,399	0.21
内 アメリカ	50,792,319	0.13
内 ペルー	26,150,720	0.07
内 ルクセンブルグ	4,723,524	0.01
投資信託受益証券	315,560,341	0.82
内 メキシコ	315,560,341	0.82
投資証券	69,282,811	0.18
内 メキシコ	40,942,679	0.11
内 トルコ	28,340,132	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,612,345,570	4.19
純資産総額	38,501,870,033	100.00

その他資産の投資状況

平成26年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	134,981,000	0.35
-	134,981,000	0.35
株価指数先物取引（買建）	1,586,001,726	4.12
内 アメリカ	1,586,001,726	4.12

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成26年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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	233,309,586	0.9331 217,723,774	0.9245 215,694,712	- -	100.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年4月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.02%
合計	100.02%

(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)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	10,426	136,863.00 1,426,933,638	135,864.00 1,416,518,064	- -	3.68%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,323,083	408.00 947,817,864	409.69 951,767,105	- -	2.47%
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	96,500	6,952.36 670,903,222	6,740.68 650,476,102	- -	1.69%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信 サービス	569,500	951.89 542,106,195	967.77 551,147,577	- -	1.43%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	6,765,530	72.10 487,818,392	71.44 483,342,994	- -	1.26%
6	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,901,235	63.63 439,169,060	61.78 426,386,593	- -	1.11%

7	OA O GAZPROM ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗 燃料	560,246	747.00 418,504,210	741.35 415,342,433	- -	1.08%
8	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	234,980	1,630.67 383,176,833	1,688.01 396,649,999	- -	1.03%
9	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	37,203	10,605.69 394,563,857	10,070.54 374,654,671	- -	0.97%
10	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	441,450	797.67 352,135,526	787.12 347,478,185	- -	0.90%
11	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信 サービス	3,282,978	101.18 332,193,053	103.69 340,439,894	- -	0.88%
12	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	14,504	23,976.00 347,747,904	23,376.59 339,054,206	- -	0.88%
13	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信 サービス	158,292	2,101.67 332,679,130	2,091.94 331,138,949	- -	0.86%
14	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,987,200	46.17 322,617,889	45.51 317,995,856	- -	0.83%
15	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,041,769	298.85 311,343,083	298.51 310,988,881	- -	0.81%
16	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗 燃料	389,912	751.35 292,960,615	765.57 298,505,046	- -	0.78%
17	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	192,649	1,533.43 295,414,545	1,538.93 296,474,963	- -	0.77%
18	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	51,465	5,685.23 292,590,825	5,711.50 293,942,862	- -	0.76%
19	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗 燃料	1,666,000	170.40 283,890,398	171.46 285,653,692	- -	0.74%
20	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗 燃料	48,902	5,373.68 262,783,978	5,450.64 266,547,353	- -	0.69%
21	PETRO CHINA CO LTD 中国	株式 石油・ガス・消耗 燃料	1,972,000	116.15 229,066,336	118.67 234,023,353	- -	0.61%
22	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	265,468	894.75 237,529,935	860.69 228,486,363	- -	0.59%

23	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・消耗 燃料	2,387,200	92.61 221,078,592	91.55 218,551,979	- -	0.57%
24	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製 造装置	132,507	1,569.09 207,916,733	1,643.89 217,828,257	- -	0.57%
25	VALE SA-PREF A ブラジル	株式 金属・鉱業	171,896	1,309.12 225,034,176	1,226.10 210,762,562	- -	0.55%
26	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動 産金融	138,452	1,504.45 208,295,219	1,517.45 210,094,541	- -	0.55%
27	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗 燃料	283,010	716.94 202,903,481	722.45 204,461,282	- -	0.53%
28	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 半導体・半導体製 造装置	1,923	108,891.00 209,397,393	105,494.39 202,865,731	- -	0.53%
29	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製 造装置	49,840	3,801.19 189,451,558	3,966.02 197,666,935	- -	0.51%
30	ECOPETROL SA SP ADR コロンビア	株式 石油・ガス・消耗 燃料	53,748	4,056.80 218,045,100	3,675.49 197,550,247	- -	0.51%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年4月30日現在

種類	投資比率
株式	94.81%
投資信託受益証券	0.82%
投資証券	0.18%
合計	95.81%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年4月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	17.51%
石油・ガス・消耗燃料		10.04%
半導体・半導体製造装置		8.66%
無線通信サービス		5.09%
金属・鉱業		4.61%
保険		3.06%
自動車		2.87%
食品		2.35%
化学		2.33%
電子装置・機器・部品		2.21%
インターネットソフトウェア・サービス		2.19%
食品・生活必需品小売り		2.11%
コングロマリット		1.79%
情報技術サービス		1.77%
メディア		1.65%
飲料		1.62%
各種電気通信サービス		1.60%
電力		1.57%
不動産管理・開発		1.56%
各種金融サービス		1.51%
コンピュータ・周辺機器		1.29%
建設資材		1.12%
医薬品		1.09%
建設・土木		1.06%
機械		0.89%
自動車部品		0.86%
運送インフラ		0.83%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.82%
複合小売り		0.75%
タバコ		0.74%
家庭用耐久財		0.71%
資本市場		0.69%
専門小売り		0.65%
ガス		0.63%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.58%
パーソナル用品		0.55%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.53%
ホテル・レストラン・レジャー		0.52%
家庭用品		0.47%
商社・流通業		0.34%
旅客航空輸送業		0.31%
エネルギー設備・サービス		0.27%
繊維・アパレル・贅沢品		0.26%
電気設備		0.26%
紙製品・林産品		0.26%
水道		0.23%
各種消費者サービス		0.22%

不動産投資信託	0.20%
航空宇宙・防衛	0.19%
海運業	0.18%
ソフトウェア	0.16%
消費者金融	0.16%
陸運・鉄道	0.14%
容器・包装	0.14%
商業サービス・用品	0.12%
レジャー用品	0.10%
販売	0.10%
総合公益事業	0.08%
建設関連製品	0.08%
航空貨物・物流サービス	0.08%
ヘルスケア機器・用品	0.04%
通信機器	0.03%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.02%
合計	94.81%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年4月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
為替予約取引	-	南アフリカ・ランド売/円買 2014年05月	売建	13,900,000	133,931,750	134,981,000	0.35%
株価指数先物取引	NYS ELI FF EUS	MINI MSCI EM G MKT Jun14	買建	310	1,595,894,869	1,586,001,726	4.12%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成26年4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24年4月18日)	110	110	0.9070	0.9070
第2計算期間末 (平成25年4月18日)	152	152	1.0917	1.0917
第3計算期間末 (平成26年4月18日)	208	208	1.1767	1.1767
平成25年4月末日	160	-	1.1234	-
5月末日	178	-	1.1498	-
6月末日	159	-	1.0184	-
7月末日	171	-	1.0494	-
8月末日	170	-	1.0198	-
9月末日	175	-	1.1006	-
10月末日	192	-	1.1583	-
11月末日	198	-	1.1719	-
12月末日	199	-	1.1885	-
平成26年1月末日	185	-	1.0879	-
2月末日	191	-	1.1155	-
3月末日	201	-	1.1506	-
4月末日	215	-	1.1651	-

【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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	9.3
第2計算期間	20.4
第3計算期間	7.8

(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	129,313,073	7,768,224
第2計算期間	108,923,094	90,547,136
第3計算期間	148,613,450	111,268,284

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2014年4月30日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2011年5月17日)～2014年4月30日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日2011年5月17日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第1期	(2012.04.18)	0円
第2期	(2013.04.18)	0円
第3期	(2014.04.18)	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	エマージング株式バッシブ・マザーファンド	100.02%

■エマージング株式バッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	94.81
内 韓国	15.39
内 台湾	11.45
内 ブラジル	10.84
内 中国	9.16
内 南アフリカ	7.48
内 その他	40.49
投資信託受益証券	0.82
内 メキシコ	0.82
投資証券	0.18
内 メキシコ	0.11
内 トルコ	0.07
コールローン、その他の資産(負債控除後)	4.19
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(%)
為替予約取引(売建)	△0.35
株価指数先物取引(買建)	4.12

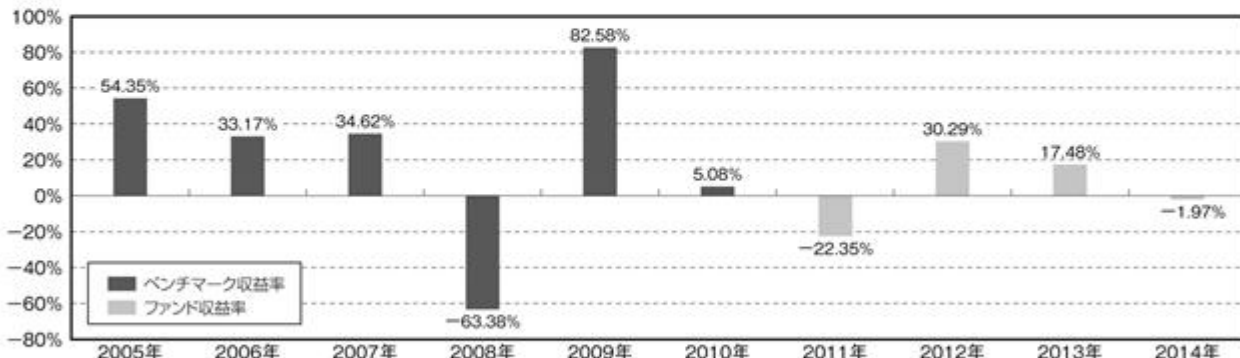
組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	半導体・半導体製造装置	3.68%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	2.47%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネット/ソフトウェアサービス	1.69%
4	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.43%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	商業銀行	1.26%
6	IND & COMM BK OF CHINA - H	株式	中国	商業銀行	1.11%
7	GAO ZAPROM ADR	株式	ロシア	石油・ガス・消耗燃料	1.08%
8	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	株式	ブラジル	商業銀行	1.03%
9	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	0.97%
10	AMBEV SA	株式	ブラジル	飲料	0.90%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	17.51%
2	石油・ガス・消耗燃料	10.04%
3	半導体・半導体製造装置	8.66%
4	無線通信サービス	5.09%
5	金属・鉱業	4.61%

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、2011年は設定日から年末までの収益率、および2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※2010年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは「MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」です。

- 掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。
- 当該ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- 委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度による取得のみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

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

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

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

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

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。

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

- ・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

- ・お申込手数料

ありません。

- ・お申込単位

1口以上1口単位または1円以上1円単位（当初元本：1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

- ・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

・解約単位

1口以上1口単位とします。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】**(1)【資産の評価】**

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

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

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(2)【保管】

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

（３）【信託期間】

信託期間は、平成23年5月17日から原則として無期限です。

ただし、下記(5)その他 イ．償還規定の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年4月19日から翌年4月18日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】**イ．償還規定**

a. 委託会社は、受益権の口数が10億口を下回る事となった場合、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生した場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとし、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、上記b.に規定する書面に付記します。

ロ．信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款はa. からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

- g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h.委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a.からg.の規定にしたがい信託約款を変更します。
- i.重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。
- j.上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

八.関係法人との契約の更改

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

二.公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。(URL <http://www.diam.co.jp/>)

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

ホ.運用報告書

委託会社は、毎年4月18日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

(URL <http://www.diam.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金受領権

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

(2)償還金受領権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

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

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成25年4月19日から平成26年4月18日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 平成25年4月18日現在	第3期 平成26年4月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,679,715	1,790,465
親投資信託受益証券	152,650,518	208,239,864
未収入金	2,349,000	1,272,000
流動資産合計	156,679,233	211,302,329
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,488,441	2,154,579
未払受託者報酬	26,708	35,268
未払委託者報酬	407,396	519,713
その他未払費用	5,362	7,089
流動負債合計	3,927,907	2,716,649
負債合計		
	3,927,907	2,716,649
純資産の部		
元本等		
元本	1,139,920,807	1,177,265,973
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,830,519	31,319,707
（分配準備積立金）	22,581,021	23,249,714
元本等合計	152,751,326	208,585,680
純資産合計		
	152,751,326	208,585,680
負債純資産合計		
	156,679,233	211,302,329

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 平成24年4月19日 至 平成25年4月18日		自 平成25年4月19日 至 平成26年4月18日	
営業収益				
受取利息		178		172
有価証券売買等損益		28,352,527		14,487,346
営業収益合計		28,352,705		14,487,518
営業費用				
受託者報酬		47,255		66,758
委託者報酬		733,946		983,604
その他費用		9,464		13,415
営業費用合計		790,665		1,063,777
営業利益又は営業損失（ ）		27,562,040		13,423,741
経常利益又は経常損失（ ）		27,562,040		13,423,741
当期純利益又は当期純損失（ ）		27,562,040		13,423,741
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		7,091,882		1,537,549
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,303,821		12,830,519
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,380,761		17,639,633
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,380,761		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		17,639,633
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,716,579		11,036,637
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		11,036,637
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,716,579		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,830,519		31,319,707

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
---------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 平成25年4月18日現在	第3期 平成26年4月18日現在
1 . 1 期首元本額	121,544,849円	139,920,807円
期中追加設定元本額	108,923,094円	148,613,450円
期中一部解約元本額	90,547,136円	111,268,284円
2 . 受益権の総数	139,920,807口	177,265,973口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期 自 平成24年4月19日 至 平成25年4月18日	第3期 自 平成25年4月19日 至 平成26年4月18日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,975,926円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(17,494,232円)、信託約款に規定される収益調整金(2,854,634円)及び分配準備積立金(2,110,863円)より分配対象収益は25,435,655円(1万口当たり1,817.86円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,080,945円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(7,805,247円)、信託約款に規定される収益調整金(21,136,537円)及び分配準備積立金(11,363,522円)より分配対象収益は44,386,251円(1万口当たり2,503.94円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自 平成24年4月19日 至 平成25年4月18日	第3期 自 平成25年4月19日 至 平成26年4月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 平成25年4月18日現在	第3期 平成26年4月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 平成25年4月18日現在	第3期 平成26年4月18日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	23,229,388	13,387,494
合計	23,229,388	13,387,494

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 平成25年4月18日現在	第3期 平成26年4月18日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0917円 (10,917円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年4月18日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	エマージング株式パッシブ・マザーファ ンド	223,074,306	208,239,864	
親投資信託受益証券 合計		223,074,306	208,239,864	
合計		223,074,306	208,239,864	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「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25年4月18日現在	平成26年4月18日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,584,549,837	302,809,303
コール・ローン		219,496,967	41,959,753
株式		36,216,662,867	38,723,995,289
投資信託受益証券		357,679,266	336,818,802
投資証券		11,592,386	75,515,634
派生商品評価勘定		111,973	31,231,692
未収配当金		85,711,235	72,035,048
差入委託証拠金		461,698,784	269,322,554
流動資産合計		38,937,503,315	39,853,688,075
資産合計		38,937,503,315	39,853,688,075
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		110,886,275	620,067
未払金		18,911	27,547,186
未払解約金		56,851,000	22,860,000
流動負債合計		167,756,186	51,027,253
負債合計		167,756,186	51,027,253
純資産の部			
元本等			
元本	1	45,016,456,005	42,638,365,556
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	6,246,708,876	2,835,704,734
元本等合計		38,769,747,129	39,802,660,822
純資産合計		38,769,747,129	39,802,660,822
負債純資産合計		38,937,503,315	39,853,688,075

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25年4月18日現在	平成26年4月18日現在
<p>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</p> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p> <p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p>	<p>48,417,285,492円</p> <p>7,119,500,097円</p> <p>10,520,329,584円</p>	<p>45,016,456,005円</p> <p>9,516,670,194円</p> <p>11,894,760,643円</p>

	D I A M新興国株式イン デックスファンド< D C 年金>	177,253,273円	223,074,306円
	マネックス資産設計ファ ンド エボリューション	245,802,538円	287,712,385円
	D I A M D C 8資産 バランスファンド（新興 国10）	32,951円	7,976,793円
	D I A M D C 8資産 バランスファンド（新興 国20）	131,081円	15,467,773円
	D I A M D C 8資産 バランスファンド（新興 国30）	313,276円	43,466,651円
	投資のソムリエ	1,916,987円	148,724,171円
	クルーズコントロール	1,158,600円	221,737,359円
	投資のソムリエ< D C年 金>	- 円	1,113,849円
	D I A M 8資産バラ ンスファンドN< D C年金 >	- 円	580,234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）	8,389,100,719円	8,137,288,756円
	新興国株式パッシブ私募 ファンド（適格機関投資 家限定）	3,379,419,679円	3,081,962,508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）	2,208,629,195円	2,174,785,248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）	19,015,789,636円	17,468,408,178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）	11,596,908,070円	10,826,067,345円
	計	45,016,456,005円	42,638,365,556円
2 .	受益権の総数	45,016,456,005口	42,638,365,556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 6,246,708,876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 2,835,704,734円であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年4月19日 至 平成25年4月18日	自 平成25年4月19日 至 平成26年4月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年4月18日現在	平成26年4月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年4月18日現在	平成26年4月18日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	294,654,069	2,060,312,072
投資信託受益証券	111,870,534	5,195,439
投資証券	2,085,827	2,742,300
合計	408,610,430	2,052,374,333

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成25年4月18日 現在				平成26年4月18日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	（円）		（円）	（円）	（円）		（円）	（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	5,007,380	-	5,005,500	1,880	29,757,227	-	29,895,425	138,198
アメリカ・ドル	-	-	-	-	26,862,227	-	26,967,425	105,198
南アフリカ・ランド	5,007,380	-	5,005,500	1,880	2,895,000	-	2,928,000	33,000
買 建	132,286,500	-	132,097,500	189,000	67,881,187	-	67,921,900	40,713
アメリカ・ドル	132,286,500	-	132,097,500	189,000	41,018,960	-	41,016,000	2,960
ユーロ	-	-	-	-	26,862,227	-	26,905,900	43,673
合計	137,293,880	-	137,103,000	187,120	97,638,414	-	97,817,325	97,485

（注）時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成25年4月18日 現在				平成26年4月18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	2,252,229,795	-	2,141,642,613	110,587,182	653,972,117	-	684,681,227	30,709,110
合計	2,252,229,795	-	2,141,642,613	110,587,182	653,972,117	-	684,681,227	30,709,110

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年4月18日現在	平成26年4月18日現在
1口当たり純資産額	0.8612円	0.9335円
(1万口当たり純資産額)	(8,612円)	(9,335円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年4月18日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BANCOLOMBIA SA SPONS ADR	34,380	56.990	1,959,316.200	
	LATAM AIRLINES GROUP SP ADR	47,050	15.410	725,040.500	
	BANCO SANTANDER CHILE ADR	26,392	23.590	622,587.280	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,973	12.730	254,256.290	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS ADR	16,368	22.910	374,990.880	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	73,600	6.950	511,520.000	
	CREDICORP LTD	6,949	141.210	981,268.290	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA ADR	13,600	25.120	341,632.000	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHILE SP ADR	15,816	45.030	712,194.480	
	ENERSIS SA SPONS ADR	53,208	16.030	852,924.240	
	CORPBANCA SA ADR	22,465	18.190	408,638.350	
	INFOSYS LTD ADR	17,222	52.880	910,699.360	
	MOBILE TELESYSTEMS OJSC ADR	55,125	17.100	942,637.500	
	WIPRO LTD ADR	23,281	13.610	316,854.410	
	DR REDDYS LABORATORIES LTD ADR	634	42.150	26,723.100	
	QUIMICA Y MINERA DE CHIL-SP ADR	16,946	32.320	547,694.720	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,380	29.840	488,779.200	
	BANCO DE CHILE-ADR	6,318	76.870	485,664.660	
	VINA CONCHA Y TORO SA SP ADR	7,800	40.850	318,630.000	
	LUKOIL SPON ADR	51,555	52.370	2,699,935.350	
	GAIL INDIA LTD GDR	2,630	37.000	97,310.000	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	56,215	3.263	183,429.540	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD GDR	1,342	24.600	33,013.200	
OAQ GAZPROM ADR	592,241	7.280	4,311,514.480		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	91,980	4.915	452,081.700		

	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	84,200	1.228	103,397.600	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	72,932	7.060	514,899.920	
	SISTEMA JSFC GDR	13,077	23.840	311,755.680	
	NOVATEK OAO GDR	9,507	100.950	959,731.650	
	TELECOM EGYPT -GDR REG S	13,015	9.000	117,135.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	57,374	18.000	1,032,732.000	
	ROSTELECOM SPON ADR	17,771	13.690	243,284.990	
	LARSEN & TOUBRO LTD GDR	3,461	20.890	72,300.290	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD GDR	12,251	16.610	203,489.110	
	RANBAXY LABORATORIES LTD GDR	4,433	7.720	34,222.760	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD GDR	19,260	31.560	607,845.600	
	ROSNEFT OIL CO GDR	121,035	6.430	778,255.050	
	URALKALI -SPON GDR	26,381	22.250	586,977.250	
	SEVERSTAL GDR	21,786	7.310	159,255.660	
	TATNEFT GDR	23,880	35.240	841,531.200	
	VTB BANK OJSC GDR	275,950	2.095	578,115.250	
	MAGNIT OJSC GDR	26,398	52.050	1,374,015.900	
	ECOPETROL SA SP ADR	52,648	39.600	2,084,860.800	
	FEDERAL HYDROGENERATING ADR	135,146	1.458	197,042.860	
	SBERBANK ADR	274,981	8.720	2,397,834.320	
	CENCOSUD SA ADR	59,620	10.290	613,489.800	
	MEGAFON OAO GDR	9,723	26.250	255,228.750	
アメリカ・ドル	小計	2,604,299		33,626,737.170 (3,448,421,897)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	91,051	959.100	87,327,014.100	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,876	449.800	7,590,824.800	
	ASIAN PAINTS LTD	27,790	543.750	15,110,812.500	
	BANK OF BARODA	1,548	771.300	1,193,972.400	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	3,292	522.100	1,718,753.200	
	HDFC BANK LTD	112,154	718.700	80,605,079.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	20,857	996.950	20,793,386.150	
	ICICI BANK LTD	20,321	1,262.850	25,662,374.850	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	4,900	1,100.750	5,393,675.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	13,553	2,017.300	27,340,466.900	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	29,705	269.200	7,996,586.000	

RELIANCE CAPITAL LTD	8,069	374.050	3,018,209.450	
TATA STEEL LTD	34,054	418.900	14,265,220.600	
TATA MOTORS LTD	76,718	429.100	32,919,693.800	
JSW STEEL LTD	9,507	1,045.000	9,934,815.000	
TATA POWER CO LTD	116,490	83.950	9,779,335.500	
NESTLE INDIA LTD	1,596	4,763.250	7,602,147.000	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	65,796	181.250	11,925,525.000	
GAIL INDIA LTD	15,664	373.850	5,855,986.400	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	32,029	800.800	25,648,823.200	
SESA STERLITE LTD	110,959	192.700	21,381,799.300	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	80,421	322.350	25,923,709.350	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	1,065	4,401.200	4,687,278.000	
ACC LTD	6,455	1,358.350	8,768,149.250	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	145,891	879.800	128,354,901.800	
INFOSYS LTD	28,468	3,192.050	90,871,279.400	
WIPRO LTD	37,979	585.850	22,249,997.150	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	64,597	609.450	39,368,641.650	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,687	890.150	7,732,733.050	
HCL TECHNOLOGIES LTD	23,511	1,424.750	33,497,297.250	
DABUR INDIA LTD	20,857	179.050	3,734,445.850	
HERO MOTOCORP LTD	7,766	2,218.850	17,231,589.100	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,507	2,552.200	24,263,765.400	
BHARTI AIRTEL LTD	58,442	325.550	19,025,793.100	
UNITED SPIRITS LTD	7,850	2,853.400	22,399,190.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	61,992	625.050	38,748,099.600	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,562	1,324.800	3,394,137.600	
JINDAL STEEL & POWER LTD	43,566	280.300	12,211,549.800	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,445	747.800	10,054,171.000	
CIPLA LTD/INDIA	36,885	400.700	14,779,819.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	24,901	1,268.950	31,598,123.950	
JAI PRAKASH ASSOCIATES LTD	87,706	57.400	5,034,324.400	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,457	2,217.600	14,319,043.200	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	48,041	2,222.900	106,790,338.900	

	ADANI ENTERPRISES LTD	16,748	438.350	7,341,485.800	
	NTPC LTD	109,910	122.950	13,513,434.500	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,088	606.200	3,690,545.600	
	YES BANK LTD	9,775	417.100	4,077,152.500	
	AMBUJA CEMENTS LTD	77,639	216.650	16,820,489.350	
	RANBAXY LABORATORIES LTD	8,562	468.450	4,010,868.900	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	112,300	141.450	15,884,835.000	
	ITC LTD	211,620	353.250	74,754,765.000	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	55,596	131.400	7,305,314.400	
	SIEMENS INDIA LTD	5,734	756.500	4,337,771.000	
	UNITED BREWERIES LTD	5,209	816.950	4,255,492.550	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,583	838.750	10,553,991.250	
	TECH MAHINDRA LTD	4,815	1,771.800	8,531,217.000	
	CAIRN INDIA LTD	42,833	368.850	15,798,952.050	
	IDEA CELLULAR LTD	57,695	140.100	8,083,069.500	
	POWER FINANCE CORP LTD	25,765	190.600	4,910,809.000	
	DLF LTD	45,392	159.650	7,246,832.800	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	127,192	107.200	13,634,982.400	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	34,730	198.400	6,890,432.000	
	RELIANCE POWER LTD	63,381	72.950	4,623,643.950	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	34,322	248.100	8,515,288.200	
	BAJAJ AUTO LTD	8,032	2,016.050	16,192,913.600	
	OIL INDIA LTD	12,465	477.700	5,954,530.500	
	COAL INDIA LTD	43,852	290.900	12,756,546.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	20,882	230.000	4,802,860.000	
	TATA POWER CO LTD-RTS	16,308	22.950	374,268.600	
インド・ルピー	小計	2,809,408		1,392,965,371.500 (2,395,900,439)	
インドネシア・ルピア	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	28,350.000	992,250,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	185,201	21,600.000	4,000,341,600.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	451,600	7,200.000	3,251,520,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	152,500	30,800.000	4,697,000,000.000	

PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,025,200	7,825.000	15,847,190,000.000	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,585,600	2,325.000	10,661,520,000.000	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	687,000	4,210.000	2,892,270,000.000	
GUDANG GARAM TBK PT	49,500	50,600.000	2,504,700,000.000	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	141,000	23,450.000	3,306,450,000.000	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT	93,500	9,700.000	906,950,000.000	
BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	4,470.000	1,298,159,520.000	
BANK MANDIRI	895,300	9,850.000	8,818,705,000.000	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	143,000	15,000.000	2,145,000,000.000	
BANK RAKYAT INDONESIA	1,110,700	10,000.000	11,107,000,000.000	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,019,500	5,350.000	5,454,325,000.000	
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	732,500	5,050.000	3,699,125,000.000	
KALBE FARMA TBK PT	2,111,000	1,545.000	3,261,495,000.000	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	340,500	15,825.000	5,388,412,500.000	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,198,000	11,200.000	13,417,600,000.000	
XL AXIATA TBK PT	188,000	4,850.000	911,800,000.000	
LIPPO KARAWACI TBK PT	2,169,500	1,115.000	2,418,992,500.000	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	674,500	2,125.000	1,433,312,500.000	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,865.000	1,342,252,500.000	
JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	6,025.000	1,129,687,500.000	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	44,000	25,325.000	1,114,300,000.000	
BUMI SERPONG DAMAI PT	808,500	1,615.000	1,305,727,500.000	
ADARO ENERGY PT	1,090,500	980.000	1,068,690,000.000	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	123,000	9,975.000	1,226,925,000.000	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	151,500	6,375.000	965,812,500.000	
PT SURYA CITRA MEDIA TBK	393,500	3,270.000	1,286,745,000.000	
インドネシア・ルビア 小計	22,546,017		117,854,258,620.000	

(1,060,688,328)

タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	44,500	195.000	8,677,500.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	53.750	4,633,250.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	342,500	19.600	6,713,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	178,700	163.000	29,128,100.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	462,600	6.900	3,191,940.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	71,200	188.000	13,385,600.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	904,300	2.440	2,206,492.000	
	IRPC PCL NVDR	1,080,200	3.540	3,823,908.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	115,000	28.000	3,220,000.000	
	BANGKOK BANK PCL NVDR	59,100	194.500	11,494,950.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	268,400	27.750	7,448,100.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	99,700	237.000	23,628,900.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	263,900	10.100	2,665,390.000	
	PTT PCL	85,000	312.000	26,520,000.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	7,600	426.000	3,237,600.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	38,900	194.000	7,546,600.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	39,100	428.000	16,734,800.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	115,100	192.000	22,099,200.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	154,000	45.250	6,968,500.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	35,800	132.000	4,725,600.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	177,700	24.500	4,353,650.000	
	THAI OIL PCL NVDR	87,000	53.000	4,611,000.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	77.500	3,224,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	424,000	44.750	18,974,000.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	8.450	4,354,285.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	139,345	158.000	22,016,510.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	21,422	23.200	496,990.400	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	128,333	23.200	2,977,325.600	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	165,708	70.500	11,682,414.000	
タイ・パーツ 小計		6,152,208		280,739,605.000	

				(895,559,340)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,669	4,748.000	7,924,412.000	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	10,953	299.300	3,278,232.900	
	CEZ	16,503	585.000	9,654,255.000	
チェコ・コルナ	小計	29,125		20,856,899.900 (107,621,603)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	170,308	7.290	1,241,545.320	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,760	26.300	572,288.000	
	ARCELIK	27,213	12.450	338,801.850	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	39,011	6.550	255,522.050	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	166,902	2.940	490,691.880	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	23.000	128,432.000	
	KOC HOLDING AS	68,796	9.440	649,434.240	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	43,584	2.560	111,575.040	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	12,826	12.500	160,325.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,435	6.770	300,824.950	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	83,730	11.950	1,000,573.500	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	221,127	7.950	1,757,959.650	
	TURKIYE IS BANKASI	154,675	5.050	781,108.750	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,304	46.800	622,627.200	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	11,216	15.550	174,408.800	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	76,848	4.360	335,057.280	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	80,353	9.020	724,784.060	
	COCA-COLA ICECEK AS	5,353	50.250	268,988.250	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,384	49.050	1,146,985.200	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	57,549	4.320	248,611.680	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	16,685	16.950	282,810.750		
TURKIYE HALK BANKASI AS	57,669	13.400	772,764.600		
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	52,652	6.300	331,707.600		

	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	4,261	21.100	89,907.100	
トルコ・リラ 小計		1,459,225		12,787,734.750 (616,240,938)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	15,067	3,839.000	57,842,213.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,754	12,850.000	48,238,900.000	
	OTP BANK NYRT	19,837	4,328.000	85,854,536.000	
ハンガリー・フォリント 小計		38,658		191,935,649.000 (88,808,625)	
フィリピン・ペ ソ	AYALA LAND INC	581,400	30.400	17,674,560.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	163,780	57.900	9,482,862.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	75,426	95.100	7,173,012.600	
	AYALA CORP	17,403	618.000	10,755,054.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	212,800	29.200	6,213,760.000	
	DMCI HOLDINGS INC	70,370	69.050	4,859,048.500	
	GLOBE TELECOM INC	3,520	1,645.000	5,790,400.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	72,710	108.000	7,852,680.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	162,900	51.900	8,454,510.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	48,790	176.400	8,606,556.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	4,451	83.400	371,213.400	
	BDO UNIBANK INC	124,238	88.350	10,976,427.300	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	4,575	2,800.000	12,810,000.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	672,475	16.000	10,759,600.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	87,930	145.400	12,785,022.000	
	SM INVESTMENTS CORP	12,462	727.000	9,059,874.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	949,200	5.630	5,343,996.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,289,200	5.080	6,549,136.000	
ABOITIZ POWER CORP	221,200	37.400	8,272,880.000		
フィリピン・ペソ 小計		4,774,830		163,790,591.800 (378,356,267)	
ブラジル・レア ル	BRF SA	64,992	49.030	3,186,557.760	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA	26,730	13.500	360,855.000	
	VALE SA	133,627	31.650	4,229,294.550	

CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	32.420	259,943.560	
VALE SA-PREF A	180,896	28.540	5,162,771.840	
RAIA DROGASIL SA	21,900	18.370	402,303.000	
TIM PARTICIPACOES SA	83,200	11.180	930,176.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	11.980	278,535.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,749	7.670	159,144.830	
BANCO DO BRASIL SA	78,200	24.110	1,885,402.000	
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	37,962	9.340	354,565.080	
AES TIETE SA	12,300	18.160	223,368.000	
INVESTIMENTOS ITAU SA	276,879	9.640	2,669,113.560	
LOJAS AMERICANAS SA	38,236	17.030	651,159.080	
LOJAS AMERICANAS SA	16,100	14.550	234,255.000	
MARCOPOLO SA	40,800	4.260	173,808.000	
GERDAU SA	91,130	13.830	1,260,327.900	
METALURGICA GERDAU SA	24,400	16.920	412,848.000	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	14,206	106.940	1,519,189.640	
PETROLEO BRASILEIRO SA	294,710	15.630	4,606,317.300	
PETROLEO BRASILEIRO SA	407,912	16.380	6,681,598.560	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTICIPACOES SA	36,300	13.520	490,776.000	
SOUZA CRUZ SA	33,700	22.890	771,393.000	
KROTON EDUCACIONAL SA	20,900	47.730	997,557.000	
CCR SA	88,920	17.750	1,578,330.000	
WEG SA	22,900	34.660	793,714.000	
BANCO BRADESCO SA PREF	206,549	33.430	6,904,933.070	
BANCO BRADESCO SA	63,560	34.820	2,213,159.200	
CIA HERING	16,000	25.200	403,200.000	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	45,400	8.380	380,452.000	
NATURA COSMETICOS SA	17,600	40.710	716,496.000	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	66,706	9.370	625,035.220	
BRADESPAR SA	22,300	21.370	476,551.000	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	36,300	8.200	297,660.000	
CPFL ENERGIA SA	27,640	19.550	540,362.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	248,180	35.550	8,822,799.000	

PORTO SEGURO SA	9,400	34.920	328,248.000	
FIBRIA CELULOSE SA	32,290	23.740	766,564.600	
BRASKEM SA	14,130	16.190	228,764.700	
TRACTEBEL ENERGIA SA	19,770	33.880	669,807.600	
LOCALIZA RENT A CAR	14,805	34.860	516,102.300	
TELEFONICA BRASIL S.A.	28,028	46.450	1,301,900.600	
LOJAS RENNEN SA	14,400	64.620	930,528.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,100	10.440	188,964.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,552	57.300	1,807,929.600	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,900	38.430	457,317.000	
CIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA	6,000	35.500	213,000.000	
TOTVS SA	13,000	35.200	457,600.000	
EMBRAER SA	59,460	19.480	1,158,280.800	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,900	27.550	493,145.000	
BR PROPERTIES SA	19,400	18.210	353,274.000	
M DIAS BRANCO SA	3,600	97.580	351,288.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	11,700	20.120	235,404.000	
ODONTOPREV SA	22,600	9.420	212,892.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	37,600	19.030	715,528.000	
JBS SA	77,800	8.070	627,846.000	
OI SA-PREFERENCE	61,924	2.620	162,240.880	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	68,449	16.200	1,108,873.800	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	33,198	20.900	693,838.200	
MRV ENGENHARIA E PARTICIPACOES SA	34,600	7.350	254,310.000	
MULTIPLAN EMPREENHIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,900	49.900	394,210.000	
BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL	18,300	12.660	231,678.000	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,200	23.400	566,280.000	
DURATEX SA	30,943	11.000	340,373.000	
SUL AMERICA SA	15,448	16.370	252,883.760	
HYPERMARCAS SA	31,100	16.170	502,887.000	
BM&FBOVESPA SA	190,000	11.440	2,173,600.000	
QUALICORP SA	22,700	22.980	521,646.000	

	BANCO SANTANDER BRASIL SA	88,600	12.700	1,125,220.000	
	CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,138	27.900	561,850.200	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	17,300	13.840	239,432.000	
	CIELO SA	71,314	38.080	2,715,637.120	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	61,900	26.340	1,630,446.000	
	AMBEV SA	468,550	17.390	8,148,084.500	
	KLABIN SA	56,000	11.740	657,440.000	
	ITAUSA-INV ITAU-RCT	4,446	9.630	42,814.980	
	ブラジル・リアル 小計	4,639,597		95,992,080.790 (4,401,236,904)	
ポーランド・ズ ロチ	BANK MILLENNIUM SA	43,979	8.590	377,779.610	
	MBANK	1,540	519.300	799,722.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	3,518	113.300	398,589.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,689	112.450	1,426,878.050	
	BANK PEKAO SA	13,249	193.600	2,565,006.400	
	ORANGE POLSKA SA	69,255	10.320	714,711.600	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	34,308	43.550	1,494,113.400	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,841	385.000	1,093,785.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	87,802	42.000	3,687,684.000	
	SYNTHOS SA	60,398	5.170	312,257.660	
	EUROCASH SA	7,580	39.950	302,821.000	
	GRUPA LOTOS SA	5,604	38.700	216,874.800	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	147,281	4.240	624,471.440	
	KERNEL HOLDING SA	4,994	28.810	143,877.140	
	CYFROWY POLSAT SA	21,501	20.160	433,460.160	
	GRUPA AZOTY SA	4,565	56.000	255,640.000	
	ENEA SA	18,176	14.990	272,458.240	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	76,797	20.180	1,549,763.460	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	5.070	418,396.680	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	5,301	429.550	2,277,044.550	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,528	43.710	197,918.880	
	ALIOR BANK SA	4,463	83.800	373,999.400	
	ポーランド・ズロチ 小計	712,893		19,937,252.870 (675,075,382)	

マレーシア・リンギット	PARKSON HOLDINGS BHD	119,715	3.190	381,890.850	
	AMMB HOLDINGS BHD	204,800	7.190	1,472,512.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	10,100	10.660	107,666.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	477,100	7.400	3,530,540.000	
	DIGI.COM BHD	343,500	5.250	1,803,375.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	57,600	8.080	465,408.000	
	RHB CAPITAL BHD	64,500	8.420	543,090.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	81,735	3.890	317,949.150	
	GAMUDA BHD	165,800	4.580	759,364.000	
	GENTING BHD	187,400	9.580	1,795,292.000	
	YTL CORP BHD	478,610	1.500	717,915.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,400	15.220	280,048.000	
	HONG LEONG BANK BHD	63,200	14.000	884,800.000	
	IJM CORP BHD	102,980	6.400	659,072.000	
	IOI CORP BHD	275,213	4.770	1,312,766.010	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	48,000	23.860	1,145,280.000	
	MALAYAN BANKING BHD	428,975	9.830	4,216,824.250	
	LAFARGE MALAYSIA BHD	43,000	8.780	377,540.000	
	MMC CORP BHD	51,000	2.830	144,330.000	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	85,100	4.610	392,311.000	
	MISC BHD	109,680	6.740	739,243.200	
	PPB GROUP BHD	38,000	16.160	614,080.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	24,900	30.300	754,470.000	
	PETRONAS GAS BHD	68,400	23.800	1,627,920.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	280,200	4.240	1,188,048.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	61.500	701,100.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	105,000	5.900	619,500.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	281,150	11.880	3,340,062.000	
	UMW HOLDINGS BHD	57,900	10.780	624,162.000	
	DIALOG GROUP BHD	190,300	3.600	685,080.000	
	PUBLIC BANK BHD (LOCAL)	112,800	19.980	2,253,744.000	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	282,063	1.600	451,300.800	
	AIRASIA BHD	83,400	2.290	190,986.000	
SIME DARBY BERHAD	276,400	9.300	2,570,520.000		
AXIATA GROUP BERHAD	266,500	6.590	1,756,235.000		
UEM SUNRISE BHD	145,600	2.380	346,528.000		
BUMI ARMADA BHD	120,700	4.020	485,214.000		

	MAXIS BHD	248,700	6.910	1,718,517.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	257,900	6.830	1,761,457.000	
	SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	324,300	4.250	1,378,275.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	207,400	3.300	684,420.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	233,800	3.960	925,848.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	4.550	542,360.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	137,605	2.700	371,533.500	
	マレーシア・リンギット 小計	7,290,026		47,638,576.760 (1,508,237,340)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	274,300	33.980	9,320,714.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,400	146.510	5,772,494.000	
	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV	34,700	54.250	1,882,475.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	26,300	136.760	3,596,788.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	167,100	30.780	5,143,338.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	258,700	86.250	22,312,875.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	149,800	35.970	5,388,306.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	28,100	178.980	5,029,338.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	64,800	69.820	4,524,336.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	250,300	86.030	21,533,309.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	105,088	48.990	5,148,261.120	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,610	325.230	4,426,380.300	
	INDUSTRIAS CH SAB DE CV	14,800	73.150	1,082,620.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	160,100	36.040	5,770,004.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	21,800	165.240	3,602,232.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	373,752	41.160	15,383,632.320	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,406,578	12.890	43,910,790.420	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	241,200	35.290	8,511,948.000	

	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	27,100	81.810	2,217,051.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	518,900	33.400	17,331,260.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	26,200	77.460	2,029,452.000	
	GENOMMA LAB INTERNACIONAL SAB DE CV	69,800	31.640	2,208,472.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	71,500	34.040	2,433,860.000	
	MINERA FRISCO SAB DE CV	74,900	26.330	1,972,117.000	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	130,900	22.220	2,908,598.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	44,300	40.750	1,805,225.000	
メキシコ・ペソ	小計	6,594,028		205,245,876.160 (1,609,127,669)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	206,279	1.710	352,737.090	
	ALPHA BANK A.E.	368,087	0.695	255,820.460	
	NATIONAL BANK OF GREECE	29,998	3.140	94,193.720	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,332	23.360	124,555.520	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	22,982	11.220	257,858.040	
	FOLLI FOLLIE SA	3,130	25.000	78,250.000	
	HELLENIC PETRO	7,123	6.600	47,011.800	
	OPAP SA	24,294	11.350	275,736.900	
	JUMBO SA	10,590	12.100	128,139.000	
	PUBLIC POWER CORP	10,857	11.420	123,986.940	
ユーロ	小計	688,672		1,738,289.470 (246,176,555)	
韓国・ウォン	CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,830	23,600.000	231,988,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,555	142,000.000	504,810,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,463	239,000.000	827,657,000.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,728	54,800.000	259,094,400.000	
	COWAY CO LTD	5,520	78,600.000	433,872,000.000	
	KT&G CORP	10,938	81,100.000	887,071,800.000	
	S-1 CORPORATION	1,432	82,000.000	117,424,000.000	
	KOREA GAS CORP	2,355	63,900.000	150,484,500.000	
	CJ CORP	1,359	130,500.000	177,349,500.000	
	CHEIL INDUSTRIES INC	5,177	68,400.000	354,106,800.000	
	DOOSAN INFRACORE CO.,LTD	14,640	13,300.000	194,712,000.000	

DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	9,480	30,700.000	291,036,000.000	
SK TELECOM CO LTD	864	205,500.000	177,552,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	3,097	82,900.000	256,741,300.000	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	20,370	8,780.000	178,848,600.000	
NCSOFT CORPORATION	1,442	207,000.000	298,494,000.000	
LG UPLUS CORP	19,290	10,400.000	200,616,000.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	5,440	37,100.000	201,824,000.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	12,500	8,110.000	101,375,000.000	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	4,351	38,200.000	166,208,200.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	883	479,000.000	422,957,000.000	
LG CHEM LTD	4,702	262,500.000	1,234,275,000.000	
LG CHEM LTD	480	146,500.000	70,320,000.000	
LS CORP	2,059	81,900.000	168,632,100.000	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	1,800	67,700.000	121,860,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	42,091	46,450.000	1,955,126,950.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	6,713	29,450.000	197,697,850.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	5,812	10,500.000	61,026,000.000	
S-OIL CORP	3,908	62,300.000	243,468,400.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,951	17,500.000	156,642,500.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,278	41,950.000	263,362,100.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,767	182,500.000	322,477,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	4,230	207,500.000	877,725,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,787	308,500.000	2,093,789,500.000	
SK HYNIX INC	52,930	38,050.000	2,013,986,500.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,782	56,100.000	380,470,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,167	133,000.000	288,211,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	15,167	240,000.000	3,640,080,000.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	987	156,000.000	153,972,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,364	69,900.000	444,843,600.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	17,110	12,700.000	217,297,000.000	
KCC CORP	490	515,000.000	252,350,000.000	

KIA MOTORS CORP	25,990	59,100.000	1,536,009,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	824	326,000.000	268,624,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	25,927	39,150.000	1,015,042,050.000	
HANWHA CORP	4,116	31,050.000	127,801,800.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,851	34,150.000	97,361,650.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	175,500.000	263,250,000.000	
HYUNDAI SECURITIES CO	15,940	7,050.000	112,377,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,472	88,700.000	130,566,400.000	
KT CORP	3,668	31,900.000	117,009,200.000	
LG ELECTRONICS INC	9,874	70,700.000	698,091,800.000	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD	34,337	12,100.000	415,477,700.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	71	1,818,000.000	129,078,000.000	
LG CORP	9,046	60,600.000	548,187,600.000	
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,973	9,240.000	147,590,520.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,132	38,000.000	157,016,000.000	
NAVER CORP	2,756	737,000.000	2,031,172,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,551	146,500.000	227,221,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,730	38,250.000	142,672,500.000	
DOOSAN CORP	1,014	134,500.000	136,383,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	314	514,000.000	161,396,000.000	
KANGWON LAND INC	9,140	30,700.000	280,598,000.000	
POSCO	6,506	308,500.000	2,007,101,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,891	77,500.000	224,052,500.000	
SAMSUNG C&T CORP	12,023	64,300.000	773,078,900.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,424	157,500.000	539,280,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	6,038	73,700.000	445,000,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,997	1,370,000.000	15,065,890,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	16,170	30,900.000	499,653,000.000	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	4,103	57,400.000	235,512,200.000	
SAMSUNG ELECTRONICS- PFD	2,025	1,090,000.000	2,207,250,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	882	232,500.000	205,065,000.000	
HYOSUNG CORP	2,374	72,800.000	172,827,200.000	
ORION CORP	365	774,000.000	282,510,000.000	
YUHAN CORP	952	181,500.000	172,788,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,331	189,500.000	441,724,500.000	

	HALLA CLIMATE CONTROL	4,350	42,400.000	184,440,000.000	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	29,300.000	167,303,000.000	
	GS HOLDINGS CORP	5,448	49,600.000	270,220,800.000	
	LG DISPLAY CO LTD	23,128	28,750.000	664,930,000.000	
	SK NETWORKS CO LTD	16,150	9,600.000	155,040,000.000	
	HITE JINRO CO LTD	220	24,800.000	5,456,000.000	
	CELLTRION INC	5,987	49,550.000	296,655,850.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	26,966	38,400.000	1,035,494,400.000	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,245	258,000.000	321,210,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	2,981	44,150.000	131,611,150.000	
	LOTTE SHOPPING CO	1,217	324,000.000	394,308,000.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,258	100,000.000	625,800,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP	322	1,297,000.000	417,634,000.000	
	SAMSUNG CARD CO	5,268	35,000.000	184,380,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	6,016	125,500.000	755,008,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	703	298,000.000	209,494,000.000	
	LG INNOTEK CO LTD	945	114,500.000	108,202,500.000	
	SK C&C CO LTD	2,582	144,500.000	373,099,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	37,974	36,950.000	1,403,139,300.000	
	HYUNDAI WIA CORP	1,471	162,000.000	238,302,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	2,980	33,200.000	98,936,000.000	
	BS FINANCIAL GROUP INC	16,320	15,700.000	256,224,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	18,670	6,950.000	129,756,500.000	
	E-MART CO LTD	2,117	248,000.000	525,016,000.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	14,590	15,450.000	225,415,500.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,765	58,700.000	397,105,500.000	
	NHN ENTERTAINMENT CORP	1,403	85,200.000	119,535,600.000	
韓国・ウォン	小計	801,382		63,300,211,020.000 (6,273,050,912)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	133,000	13.560	1,803,480.000	
	JIANGSU EXPRESS	110,000	8.890	977,900.000	
	YANTAI CHANGYU PIONEER WINE CO	24,400	20.140	491,416.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	601,500	71.950	43,277,925.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	135,000	30.850	4,164,750.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	280,000	3.150	882,000.000	

BEIJING ENTERPRISES	51,000	69.700	3,554,700.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	292,000	7.900	2,306,800.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	180,000	6.220	1,119,600.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	71,500	83.100	5,941,650.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	80,800	14.740	1,190,992.000	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	286,000	6.490	1,856,140.000	
CNOOC LTD	1,769,000	12.880	22,784,720.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	282,000	12.640	3,564,480.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	154,000	6.560	1,010,240.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	407,120	20.050	8,162,756.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	192,000	16.760	3,217,920.000	
CITIC PACIFIC	133,000	13.860	1,843,380.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	212,000	5.410	1,146,920.000	
LENOVO GROUP LTD	630,000	9.280	5,846,400.000	
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	217,000	3.620	785,540.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,086,000	8.780	18,315,080.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	462,742	10.480	4,849,536.160	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	79,000	13.200	1,042,800.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,523,200	7.000	17,662,400.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	80,000	56.950	4,556,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	320,000	12.660	4,051,200.000	
COSCO PACIFIC LTD	176,000	10.640	1,872,640.000	
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LTD	316,000	2.490	786,840.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	564,000	1.560	879,840.000	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	122,000	25.500	3,111,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	446,000	2.970	1,324,620.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	10.980	856,440.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	188,000	13.140	2,470,320.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	54,900	15.420	846,558.000	

GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	470,000	2.840	1,334,800.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	112,000	23.650	2,648,800.000	
BYD CO LTD	56,500	47.550	2,686,575.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,318,000	3.560	4,692,080.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	182,000	18.420	3,352,440.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	290,000	10.220	2,963,800.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	197,000	4.260	839,220.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	318,158	10.660	3,391,564.280	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	176,000	4.170	733,920.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	189,200	21.000	3,973,200.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	96,500	39.900	3,850,350.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	741,000	21.150	15,672,150.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	661,000	1.890	1,249,290.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	8.180	1,308,800.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	57,360	28.500	1,634,760.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	363,000	1.960	711,480.000	
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS GROUP LTD	79,000	5.310	419,490.000	
CHINA VANKE CO LTD	112,261	12.660	1,421,224.260	
SHANGHAI INDUSTRIAL	38,000	25.050	951,900.000	
TINGYI HOLDING CORP	196,000	22.350	4,380,600.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	32,000	58.100	1,859,200.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	302,000	7.720	2,331,440.000	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	118,000	22.850	2,696,300.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	164,000	7.020	1,151,280.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	324,000	6.360	2,060,640.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	1.880	532,040.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	142,000	40.950	5,814,900.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	102,000	525.500	53,601,000.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	186,000	60.050	11,169,300.000	

BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	302,000	5.310	1,603,620.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	1,220,240	1.460	1,781,550.400	
AIR CHINA / HONG KONG	168,000	4.570	767,760.000	
ZTE CORP	50,240	16.180	812,883.200	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	340,000	3.020	1,026,800.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	331,000	22.100	7,315,100.000	
COSCO HOLDINGS	174,500	3.270	570,615.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	851,205	5.000	4,256,025.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	196,000	13.620	2,669,520.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	70,500	41.900	2,953,950.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,042,530	5.450	38,381,788.500	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	60,000	27.350	1,641,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	286,000	10.900	3,117,400.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	124,000	6.560	813,440.000	
WUMART STORES INC	51,000	9.030	460,530.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	190,000	5.530	1,050,700.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	298,000	7.970	2,375,060.000	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD	69,000	10.700	738,300.000	
BANK OF CHINA LTD	7,371,200	3.490	25,725,488.000	
SHUI ON LAND LTD	345,600	2.140	739,584.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	151,500	16.820	2,548,230.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	8.490	509,400.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	102,000	10.960	1,117,920.000	
CHINA BLUECHEMICAL LTD	184,000	4.200	772,800.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	462,470	14.020	6,483,829.400	
IND & COMM BK OF CHINA - H	7,296,235	4.810	35,094,890.350	

CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	297,600	3.770	1,121,952.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	417,000	5.340	2,226,780.000	
CHINA COAL ENERGY CO	308,000	4.320	1,330,560.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	69,000	16.920	1,167,480.000	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC CO LTD	46,000	24.750	1,138,500.000	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	120,000	8.230	987,600.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	82,000	19.120	1,567,840.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	215,800	3.130	675,454.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	459,509	3.420	1,571,520.780	
CHINA CITIC BANK-H	740,800	4.670	3,459,536.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	501,000	8.470	4,243,470.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	78,000	11.940	931,320.000	
FOSUN INTERNATIONAL	164,000	9.820	1,610,480.000	
FRANSHION PROPERTIES CHINA LTD	402,000	2.510	1,009,020.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	4.290	1,231,230.000	
SOHO CHINA LTD	208,500	6.260	1,305,210.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	937,000	2.580	2,417,460.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	396,000	3.730	1,477,080.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	105,000	6.500	682,500.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	202,000	7.010	1,416,020.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	573,000	12.420	7,116,660.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	263,800	25.600	6,753,280.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	662,000	3.750	2,482,500.000	
CSR CORP LTD - H	227,000	6.120	1,389,240.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	230,500	9.760	2,249,680.000	
BBMG CORP	131,000	6.380	835,780.000	
SINOPHARM GROUP CO	90,400	20.550	1,857,720.000	

CHINA RESOURCES CEMENT	258,000	6.070	1,566,060.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	229,805	8.680	1,994,707.400	
YINGDE GASES	83,000	8.000	664,000.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	139,000	3.430	476,770.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	280,000	8.600	2,408,000.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	74,500	15.840	1,180,080.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	198,000	8.810	1,744,380.000	
BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	15,500	52.150	808,325.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	120,480	5.760	693,964.800	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	135,500	11.260	1,525,730.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	69,200	23.150	1,601,980.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	484,900	8.060	3,908,294.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,921,000	3.330	6,396,930.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	86,000	9.810	843,660.000	
FAR EAST HORIZON LTD	215,000	5.480	1,178,200.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	109,000	16.720	1,822,480.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	126,000	11.360	1,431,360.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	49,400	16.820	830,908.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	405,000	3.120	1,263,600.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	82,500	8.560	706,200.000	
HANERGY SOLAR GROUP LTD	1,056,000	1.060	1,119,360.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	449,000	4.230	1,899,270.000	
香港・ドル 小計	63,801,055		553,635,842.530 (7,324,602,197)	

台湾・ドル	ACER INC	203,069	19.400	3,939,538.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	66,554	310.000	20,631,740.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	48,616	90.300	4,390,024.800	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	634,729	33.700	21,390,367.300	
	ASIA CEMENT CORP	235,891	39.500	9,317,694.500	
	TAIWAN BUSINESS BANK	261,498	9.040	2,363,941.920	
	FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS CORP	1,914	368.000	704,352.000	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	85,000	62.600	5,321,000.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	42.800	3,338,400.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	138,210	27.050	3,738,580.500	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	51,596	78.800	4,065,764.800	
	QUANTA COMPUTER INC	249,858	81.800	20,438,384.400	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	16,600	70.000	1,162,000.000	
	CHENG UEI PRECISION INDUSTRY CO LTD	42,286	62.000	2,621,732.000	
	EVA AIRWAYS CORP	158,227	15.750	2,492,075.250	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	66,760	239.000	15,955,640.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	446,357	17.950	8,012,108.150	
	CHINA AIRLINES	232,156	10.350	2,402,814.600	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	169,169	88.600	14,988,373.400	
	CHINA STEEL CORP	1,159,155	25.750	29,848,241.250	
	CHINA MOTORS CO	57,000	27.950	1,593,150.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	238,344	27.900	6,649,797.600	
	ADVANTECH CO LTD	32,251	198.500	6,401,823.500	
	FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO LTD	23,460	52.100	1,222,266.000	
	CLEVO CO	48,424	59.200	2,866,700.800	
	CHINA PETROCHEMICAL DEVELOPMENT CORP	200,200	13.200	2,642,640.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	415,304	22.250	9,240,514.000		
CTCI CORP	39,000	50.100	1,953,900.000		
DELTA ELECTRONICS INC	177,448	183.000	32,472,984.000		

CHUNGHWA TELECOM CO LTD	386,327	94.300	36,430,636.100	
AU OPTRONICS CORP	873,194	11.550	10,085,390.700	
TAIWAN MOBILE CO LTD	160,800	97.200	15,629,760.000	
EVERGREEN MARINE CORP	206,399	17.700	3,653,262.300	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORES CO LTD	108,781	27.750	3,018,672.750	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	323,807	32.100	10,394,204.700	
FENG HSIN IRON & STEEL CO	63,150	50.800	3,208,020.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	16,000	342.000	5,472,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,285	147.500	8,597,037.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	400,633	77.600	31,089,120.800	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	89,000	32.950	2,932,550.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	303,594	73.900	22,435,596.600	
TRANSCEND INFORMATION INC	22,897	101.500	2,324,045.500	
EPISTAR CORP	90,149	71.400	6,436,638.600	
GIANT MANUFACTURING	32,151	230.500	7,410,805.500	
MEDIATEK INC	140,507	461.500	64,843,980.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	714,936	41.600	29,741,337.600	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	483,782	17.300	8,369,428.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	23,000	369.000	8,487,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	180,000	65.400	11,772,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	29,088	149.000	4,334,112.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	893,600	15.450	13,806,120.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	752,067	44.050	33,128,551.350	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,449,403	8.760	12,696,770.280	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	422,026	19.000	8,018,494.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,098,769	87.900	96,581,795.100	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	939,075	23.800	22,349,985.000	

LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	1,600.000	14,752,000.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	579,300	13.850	8,023,305.000	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	591,213	9.490	5,610,611.370	
INVENTEC CO LTD	211,005	29.300	6,182,446.500	
LCY CHEMICAL CORP	30,250	34.350	1,039,087.500	
HTC CORPORATION	66,832	157.000	10,492,624.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	192,014	46.400	8,909,449.600	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	43,496	131.500	5,719,724.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	667,967	14.100	9,418,334.700	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,255,943	19.450	24,428,091.350	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	709,975	18.050	12,815,048.750	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	19,000	205.500	3,904,500.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	82,560	45.850	3,785,376.000	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	76,119	36.350	2,766,925.650	
NAN YA PLASTICS CORP	458,828	66.700	30,603,827.600	
WISTRON CORP	240,481	25.900	6,228,457.900	
KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP	31,020	116.500	3,613,830.000	
POU CHEN CORP	201,990	41.400	8,362,386.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	453,841	51.000	23,145,891.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	62,392	225.000	14,038,200.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	97,480	76.700	7,476,716.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	14,658	198.000	2,902,284.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	34,569	55.000	1,901,295.000	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	52,715	73.700	3,885,095.500	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	84,886	76.100	6,459,824.600	
SILICONWARE PRECISION INDS	314,743	42.300	13,313,628.900	
STANDARD FOODS CORP	32,628	84.700	2,763,591.600	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	127,666	46.850	5,981,152.100	
TAIWAN CEMENT CORP	330,874	48.450	16,030,845.300	

	TAIWAN GLASS INDUSTRIAL CORP	61,301	29.000	1,777,729.000	
	TSRC CORP	67,790	45.150	3,060,718.500	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	181,000	32.650	5,909,650.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,450,083	120.000	294,009,960.000	
	U-MING MARINE TRANSPORT CORP	51,000	50.700	2,585,700.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,109,525	12.850	14,257,396.250	
	WAN HAI LINES LTD	122,587	15.300	1,875,581.100	
	WALSIN LIHWA CORP	378,000	9.870	3,730,860.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	86,668	12.750	1,105,017.000	
	YULON MOTOR CO	93,149	49.200	4,582,930.800	
	INNOLUX CORPORATION	571,410	11.200	6,399,792.000	
	WPG HOLDINGS CO LTD	111,526	37.100	4,137,614.600	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	18,936	305.000	5,775,480.000	
	HERMES MICROVISION INC	3,000	1,260.000	3,780,000.000	
	PEGATRON CORP	149,554	46.050	6,886,961.700	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	86,500	74.300	6,426,950.000	
	SCINOPHARM TAIWAN LTD	27,520	83.000	2,284,160.000	
	TPK HOLDING CO LTD	24,494	226.500	5,547,891.000	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	141,000	14.200	2,002,200.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	14,385	87.300	1,255,810.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	486,666	16.400	7,981,322.400	
	台湾・ドル 小計	29,148,255		1,375,342,139.620 (4,676,163,275)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	10.900	1,226,642.400	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	11,263	207.940	2,342,028.220	
	BARLOWORLD LTD	23,384	115.000	2,689,160.000	
	BIDVEST GROUP LTD	29,573	283.350	8,379,509.550	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	42,285	77.800	3,289,773.000	
	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	176,164	52.140	9,185,190.960	
	ASSORE LTD	3,722	427.010	1,589,331.220	
	DISCOVERY LTD	27,542	89.000	2,451,238.000	

REDEFINE PROPERTIES LTD	299,835	9.860	2,956,373.100	
MASSMART HOLDINGS LTD	10,432	129.000	1,345,728.000	
GOLD FIELDS LTD	63,646	42.740	2,720,230.040	
REMGRO LTD	50,492	208.140	10,509,404.880	
THE FOSCHINI GROUP LTD	19,461	102.000	1,985,022.000	
NORTHAM PLATINUM LTD	35,773	41.560	1,486,725.880	
MMI HOLDINGS LTD	113,466	26.020	2,952,385.320	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	173,761	24.490	4,255,406.890	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,073	32.750	1,312,390.750	
EXXARO RESOURCES LTD	12,410	142.000	1,762,220.000	
LIBERTY HOLDINGS LTD	11,685	129.860	1,517,414.100	
MTN GROUP LTD	164,424	216.000	35,515,584.000	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,551	183.730	7,266,705.230	
FIRSTRAND LTD	315,942	38.000	12,005,796.000	
NASPERS LTD	39,519	1,090.000	43,075,710.000	
NEDBANK GROUP LTD	20,156	222.500	4,484,710.000	
NETCARE LTD	95,948	25.000	2,398,700.000	
PICK'N PAY STORES LTD	27,363	54.600	1,494,019.800	
REUNERT LTD	16,315	68.600	1,119,209.000	
RMB HOLDINGS LTD	78,470	50.600	3,970,582.000	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,114	505.210	3,088,853.940	
SAPPI LTD	65,224	33.600	2,191,526.400	
SASOL LTD	53,966	584.300	31,532,333.800	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,558	168.360	6,828,344.880	
MR PRICE GROUP LTD	23,912	155.180	3,710,664.160	
STANDARD BANK GROUP LTD	117,987	138.900	16,388,394.300	
SPAR GROUP LTD/THE	19,656	123.960	2,436,557.760	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,570	68.480	5,311,993.600	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	19,114	192.790	3,684,988.060	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,558	278.000	9,607,124.000	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	29,034	154.540	4,486,914.360	
TIGER BRANDS LTD	15,835	275.620	4,364,442.700	
NAMPAK LTD	60,915	36.400	2,217,306.000	
SANLAM LTD	180,750	55.050	9,950,287.500	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	39,667	74.080	2,938,531.360	

INVESTEC LTD	29,615	88.480	2,620,335.200	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	55,032	122.010	6,714,454.320	
KUMBA IRON ORE LTD	7,833	380.000	2,976,540.000	
PPC LTD	69,881	30.400	2,124,382.400	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	103,090	40.830	4,209,164.700	
RMI HOLDINGS	60,982	30.200	1,841,656.400	
VODACOM GROUP PTY LTD	34,684	128.800	4,467,299.200	
南アフリカ・ランド 小計	3,201,168		308,979,285.380 (3,018,727,618)	
合計	157,290,846		38,723,995,289 (38,723,995,289)	

(2) 株式以外の有価証券

平成26年4月18日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,148,621.000	19,572,501.840	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	188,500.000	23,389,080.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,337,121.000	42,961,581.840 (336,818,802)	
投資信託受益証券	合計		1,337,121	336,818,802 (336,818,802)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	219,394.000	603,333.500	
		トルコ・リラ	小計	219,394.000	603,333.500 (29,074,641)
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	145,400.000	5,923,596.000	
		メキシコ・ペソ	小計	145,400.000	5,923,596.000 (46,440,993)
投資証券	合計		364,794	75,515,634 (75,515,634)	
合計				412,334,436 (412,334,436)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信 託受益証券 時価比率	組入投資証 券時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 47銘柄	8.66%	-%	-%	8.81%
インド・ルピー	株式 70銘柄	6.02%	-%	-%	6.12%
インドネシア・ルピア	株式 30銘柄	2.66%	-%	-%	2.71%
タイ・バーツ	株式 29銘柄	2.25%	-%	-%	2.29%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.27%	-%	-%	0.27%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.55% -%	-% -%	-% 0.07%	1.65%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.22%	-%	-%	0.23%
フィリピン・ペソ	株式 19銘柄	0.95%	-%	-%	0.97%
ブラジル・レアル	株式 76銘柄	11.06%	-%	-%	11.25%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.70%	-%	-%	1.72%
マレーシア・リンギット	株式 44銘柄	3.79%	-%	-%	3.85%
メキシコ・ペソ	株式 26銘柄 投資信託受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	4.04% -% -%	-% 0.85% -%	-% -% 0.12%	5.09%
ユーロ	株式 10銘柄	0.62%	-%	-%	0.63%
韓国・ウォン	株式 104銘柄	15.76%	-%	-%	16.03%
香港・ドル	株式 139銘柄	18.40%	-%	-%	18.72%
台湾・ドル	株式 106銘柄	11.75%	-%	-%	11.95%
南アフリカ・ランド	株式 50銘柄	7.58%	-%	-%	7.71%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年4月30日現在

資産総額	217,225,834円
負債総額	1,571,875円
純資産総額（ - ）	215,653,959円
発行済数量	185,093,586口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1651円

（参考）

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年4月30日現在

資産総額	38,908,509,824円
負債総額	406,639,791円
純資産総額（ - ）	38,501,870,033円
発行済数量	41,645,007,604口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9245円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(4)受益権の譲渡の対抗要件

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

(5)受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

直近5ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

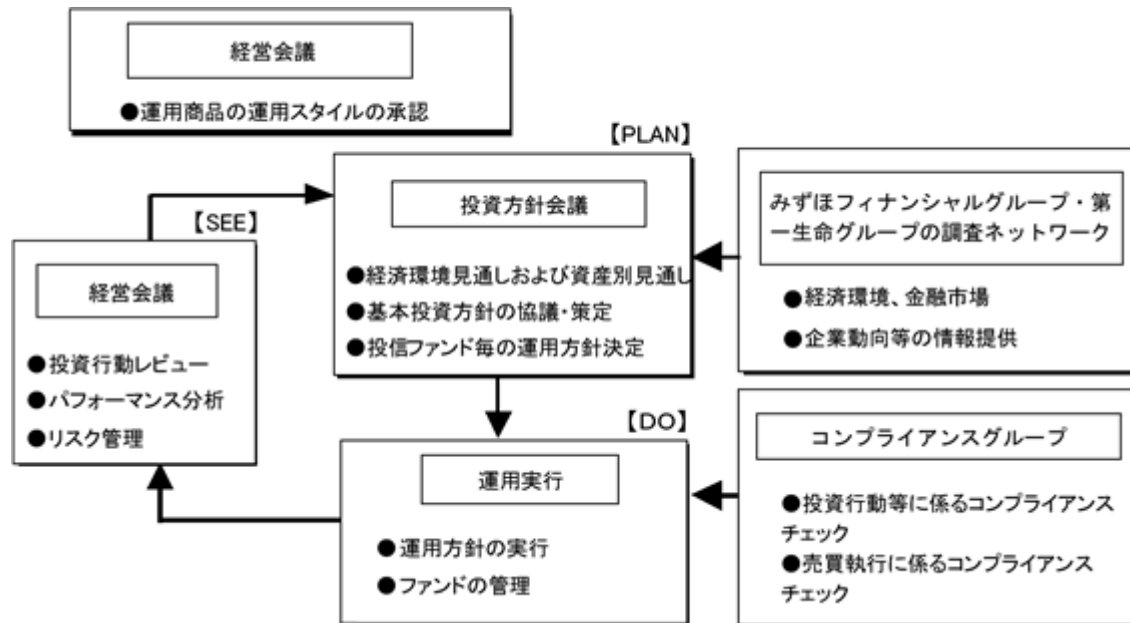
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成26年4月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年4月30日現在、委託会社の運用する投資信託は324本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	8	21,585,792,437
追加型株式投資信託	306	4,979,897,021,901
単位型公社債投資信託	10	105,446,546,365
追加型公社債投資信託	0	0
合計	324	5,106,929,360,703

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	10,806,745	11,487,360
金銭の信託	10,214,440	10,952,459
前払費用	69,143	64,554
未収委託者報酬	3,073,481	3,854,410
未収運用受託報酬	1,173,744	1,415,502
未収投資助言報酬	2 245,819	2 255,218
未収収益	244,974	275,082
繰延税金資産	426,229	401,327
その他	25,354	23,246
流動資産計	26,279,933	28,729,163
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 142,820	1 122,181
車両運搬具	1 2,770	1 1,615
器具備品	1 231,732	1 140,023
建設仮勘定	1,207	29,509
無形固定資産		
商標権	1 289	1 195
ソフトウェア	1 1,261,335	1 1,188,444
ソフトウェア仮勘定	68,920	642,834
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 292	1 231
投資その他の資産		
投資有価証券	4,002,042	4,178,284
関係会社株式	400,579	617,159
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	661,777	622,698
差入保証金	731,564	731,197
その他	89,047	88,154
固定資産計	5,718,557	6,310,469
資産合計	31,998,491	35,039,633

（単位：千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	571,153	760,493
未払金	1,547,527	1,972,562
未払収益分配金	48	-
未払償還金	84,932	51,109
未払手数料	1,195,452	1,554,065
その他未払金	267,093	367,387
未払費用	2 1,306,837	2 1,466,924
未払法人税等	1,299,068	1,721,861
未払消費税等	116,872	195,272
賞与引当金	724,974	668,366
その他	100,000	10,000
流動負債計	5,666,434	6,795,481
固定負債		
退職給付引当金	802,603	947,759
役員退職慰労引当金	98,510	136,010
固定負債計	901,113	1,083,769
負債合計	6,567,548	7,879,251
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	20,898,697	22,488,744
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	16,330,000	17,130,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	3,945,403	4,735,451
株主資本計	25,327,175	26,917,222
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	103,768	243,159
評価・換算差額等計	103,768	243,159
純資産合計	25,430,943	27,160,381
負債・純資産合計	31,998,491	35,039,633

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第28期 （ 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日 ）		第29期 （ 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日 ）	
営業収益				
委託者報酬	23,374,427		25,437,511	
運用受託報酬	5,374,163		6,328,414	
投資助言報酬	885,923		926,837	
その他営業収益	715,164		835,020	
営業収益計		30,349,678		33,527,783
営業費用				
支払手数料	10,846,568		11,284,530	
広告宣伝費	177,553		316,226	
公告費	3,769		319	
調査費	4,546,312		5,226,606	
調査費	3,001,788		3,635,440	
委託調査費	1,544,523		1,591,166	
委託計算費	341,978		356,496	
営業雑経費	456,677		540,260	
通信費	25,513		32,834	
印刷費	374,775		466,075	
協会費	25,492		25,048	
諸会費	42		38	
支払販売手数料	30,854		16,264	
営業費用計		16,372,860		17,724,440
一般管理費				
給料	4,870,759		5,009,676	
役員報酬	242,014		255,603	
給料・手当	4,035,751		4,171,884	
賞与	592,994		582,188	
交際費	36,212		34,917	
寄付金	2,693		2,515	
旅費交通費	187,653		232,436	
租税公課	95,064		103,775	
不動産賃借料	675,811		683,633	
退職給付費用	173,065		221,376	
固定資産減価償却費	524,750		561,503	
福利厚生費	26,642		32,812	
修繕費	6,018		9,184	
賞与引当金繰入額	724,974		668,366	
役員退職慰労引当金繰入額	47,820		47,298	
役員退職慰労金	7,200		6,528	
機器リース料	35		35	
事務委託費	224,066		215,100	
事務用消耗品費	60,044		67,394	
器具備品費	2,065		3,191	
諸経費	159,247		118,672	

一般管理費計		7,824,126		8,018,417
営業利益		6,152,691		7,784,925

（単位：千円）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）		第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	
	営業外収益			
受取配当金	10,223		15,024	
受取利息	3,554		2,318	
時効成立分配金・償還金	2,080		33,872	
金銭の信託運用益	168,444		-	
雑収入	4,957		4,746	
営業外収益計		189,260		55,962
営業外費用				
為替差損	6,549		7,364	
金銭の信託運用損	-		213,744	
雑損失	-		10,952	
営業外費用計		6,549		232,061
経常利益		6,335,402		7,608,826
特別損失				
固定資産除却損	1	1,752	1	22
固定資産売却損	2	115	2	1,448
特別損失計		1,868		1,470
税引前当期純利益		6,333,533		7,607,355
法人税、住民税及び事業税		2,573,893		2,934,516
法人税等調整額		134,463		13,207
法人税等合計		2,439,430		2,921,308
当期純利益		3,894,102		4,686,047

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	15,630,000	300,000	200,000	3,463,300	19,716,594	24,145,072
当期変動額									
剰余金の 配当							2,712,000	2,712,000	2,712,000
別途積立金 の積立				700,000			700,000	-	-
当期純利益							3,894,102	3,894,102	3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	700,000	-	-	482,102	1,182,102	1,182,102
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	136,143	24,281,215
当期変動額		
剰余金の 配当		2,712,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		3,894,102
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	32,375	32,375
当期変動額 合計	32,375	1,149,727
当期末残高	103,768	25,430,943

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責任 準備積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	16,330,000	300,000	200,000	3,945,403	20,898,697	25,327,175
当期変動額									
剰余金の 配当							3,096,000	3,096,000	3,096,000
別途積立金 の積立				800,000			800,000	-	-
当期純利益							4,686,047	4,686,047	4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)									
当期変動額 合計	-	-	-	800,000	-	-	790,047	1,590,047	1,590,047
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券評 価差額金	
当期首残高	103,768	25,430,943
当期変動額		
剰余金の 配当		3,096,000
別途積立金 の積立		-
当期純利益		4,686,047
株主資本以 外の項目の 当期変動額 (純額)	139,391	139,391
当期変動額 合計	139,391	1,729,438
当期末残高	243,159	27,160,381

重要な会計方針

項目	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当期末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

（1）概要

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

（2）適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正により財務諸表に与える影響額については、現在評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第28期 （平成25年3月31日現在）	第29期 （平成26年3月31日現在）
建物	539,393	562,127
車両運搬具	2,152	3,308
器具備品	565,794	664,016
商標権	649	742
ソフトウェア	1,071,133	1,502,289
電信電話専用施設利用権	1,304	1,365

2. 関係会社項目

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

(千円)

		第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	241,190	255,084
流動負債	未払費用	334,888	392,646

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	-	22
ソフトウェア	1,752	0

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	第29期 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)
器具備品	115	1,448

(株主資本等変動計算書関係)

第28期(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成26年6月30日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第28期（平成25年3月31日現在）

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
非上場株式	80,246	80,246
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
差入保証金	731,564	731,197

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第28期(平成25年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	10,806,412	-	-	-
合計	10,806,412	-	-	-

第29期(平成26年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第28期及び第29期の貸借対照表計上額2,119,074千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

4. その他有価証券

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

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

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

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第28期（平成25年3月31日現在）

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

	（千円）
（1）退職給付債務	936,125
（2）未認識数理計算上の差異	133,522
退職給付引当金	802,603

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

(1) 勤務費用	102,125
(2) 利息費用	11,108
(3) 数理計算上の差異の費用処理額	17,593
(4) 確定拠出年金 拠出額	41,923
(5) その他	314
退職給付費用	173,065

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

1.5%

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

退職給付債務の期首残高	936,125
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の発生額	14,996
退職給付の支払額	34,684
過去勤務費用の発生額	24,260
退職給付債務の期末残高	1,079,828

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

	(千円)
非積立型制度の退職給付債務	1,079,828
未積立退職給付債務	1,079,828
未認識数理計算上の差異	112,660
未認識過去勤務費用	19,408
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759
退職給付引当金	947,759
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	947,759

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)
勤務費用	124,724
利息費用	14,405
数理計算上の差異の費用処理額	35,858
過去勤務費用の費用処理額	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	179,840

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第28期	第29期
	(平成25年3月31日現在)	(平成26年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	107,022	123,518
未払事業所税	5,986	5,841
賞与引当金	275,562	238,205
未払法定福利費	34,566	31,036
未払確定拠出年金掛金	3,091	2,724
減価償却超過額（一括償却資産）	5,192	3,183
減価償却超過額	159,737	152,470
繰延資産償却超過額（税法上）	27,873	10,908
退職給付引当金	286,796	337,781
役員退職慰労引当金	35,109	48,474
ゴルフ会員権評価損	2,138	2,138
投資有価証券評価損	22,907	-
関係会社株式評価損	121,913	121,913
その他有価証券評価差額金	109	-
繰延税金資産合計	1,088,007	1,078,198
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	54,172
繰延税金負債合計	-	54,172
差引繰延税金資産の純額	1,088,007	1,024,025

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（注7）株式会社みずほ銀行は平成25年7月1日付で株式会社みずほコーポレート銀行（株式会社みずほ銀行に商号変更）に吸収合併されており、合併後の取引については吸収合併後の株式会社みずほ銀行（旧株式会社みずほコーポレート銀行）に引き継いでおります。

（1株当たり情報）

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
1株当たり純資産額	1,059,622円64銭	1,131,682円58銭
1株当たり当期純利益金額	162,254円29銭	195,251円97銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	第29期 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）
当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,894,102千円	4,686,047千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

平成26年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額* (単位：百万円)	事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,000	日本において銀行業務を営んでおります。

*平成26年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成26年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年6月4日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	柴 毅 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和 田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>の平成25年4月19日から平成26年4月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>の平成26年4月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。