

【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28年7月15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28年7月16日から平成29年7月18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、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。

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ッシブ・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、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）(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書等を含みます。

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

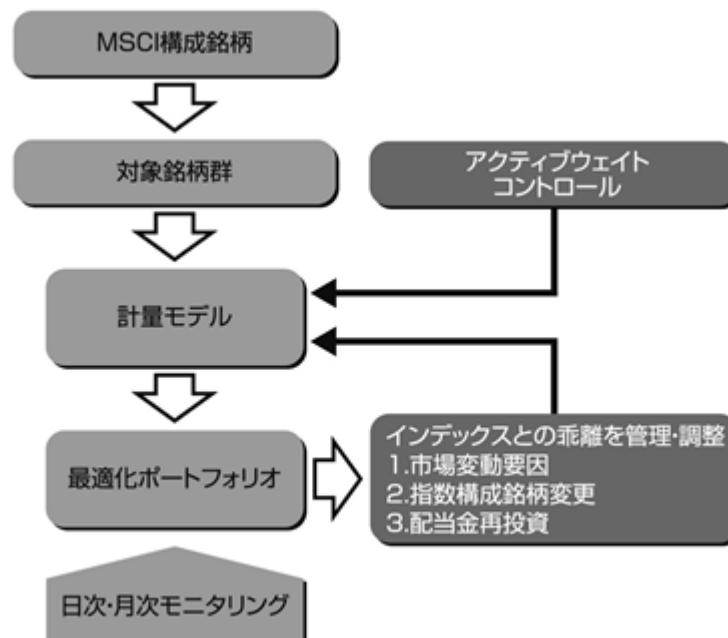
2 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

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。

日々・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。

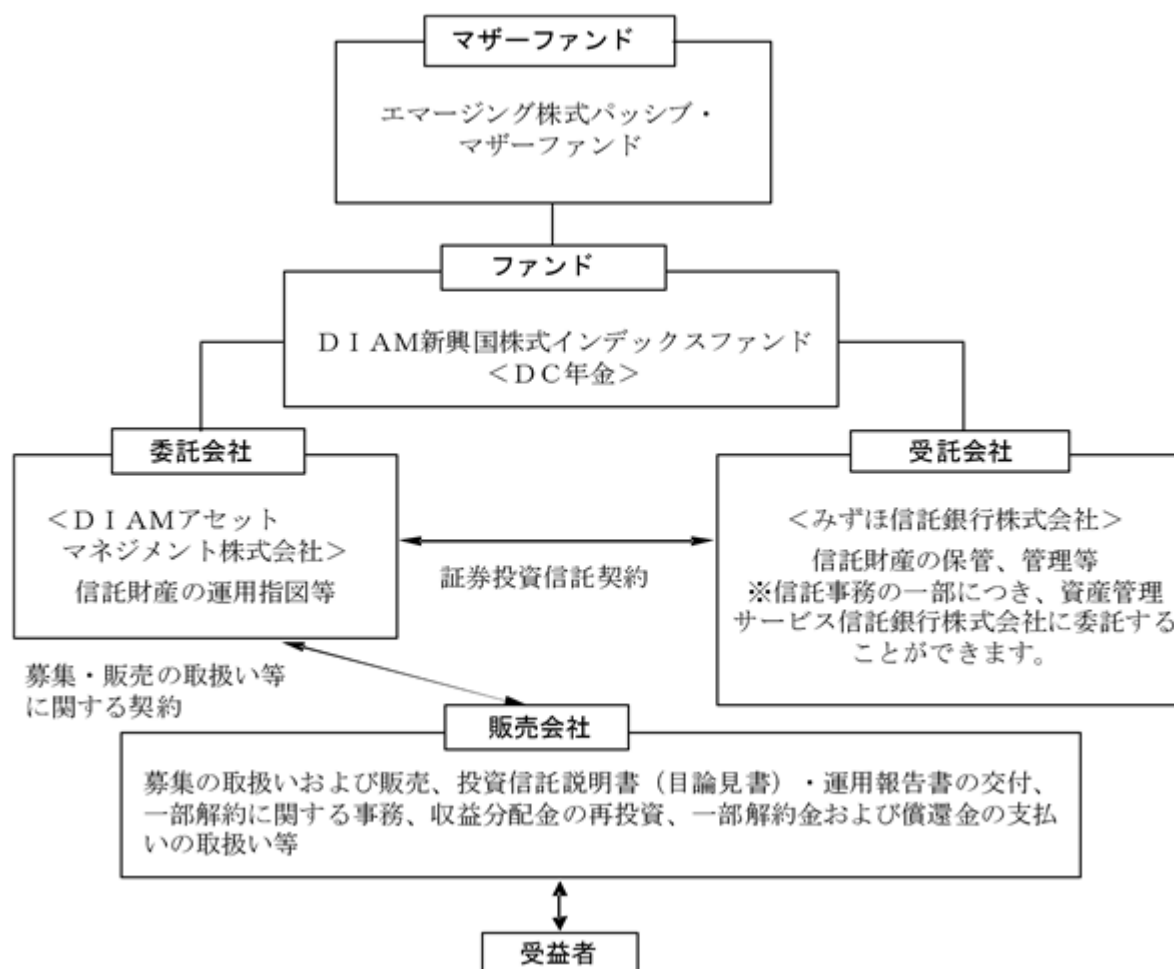
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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
平成25年1月18日	信託報酬率の変更
平成27年7月18日	信託報酬率の変更

(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。

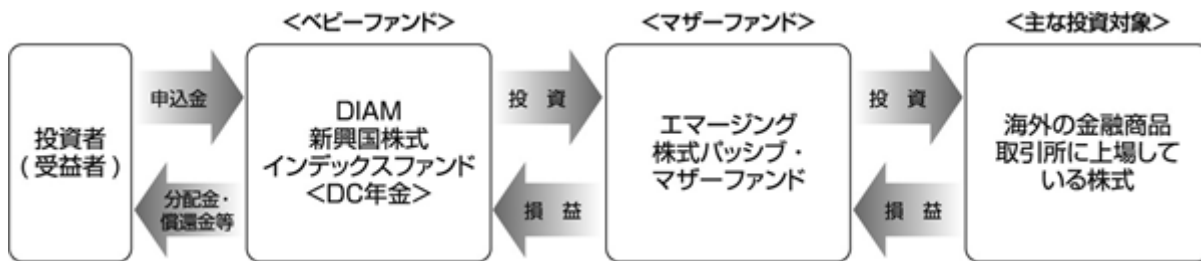
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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28年4月28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28年4月28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マーキング・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。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色> をご参照ください。

(2) 【投資対象】

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D I A Mアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である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書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。 ）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株

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

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 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ます。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
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。

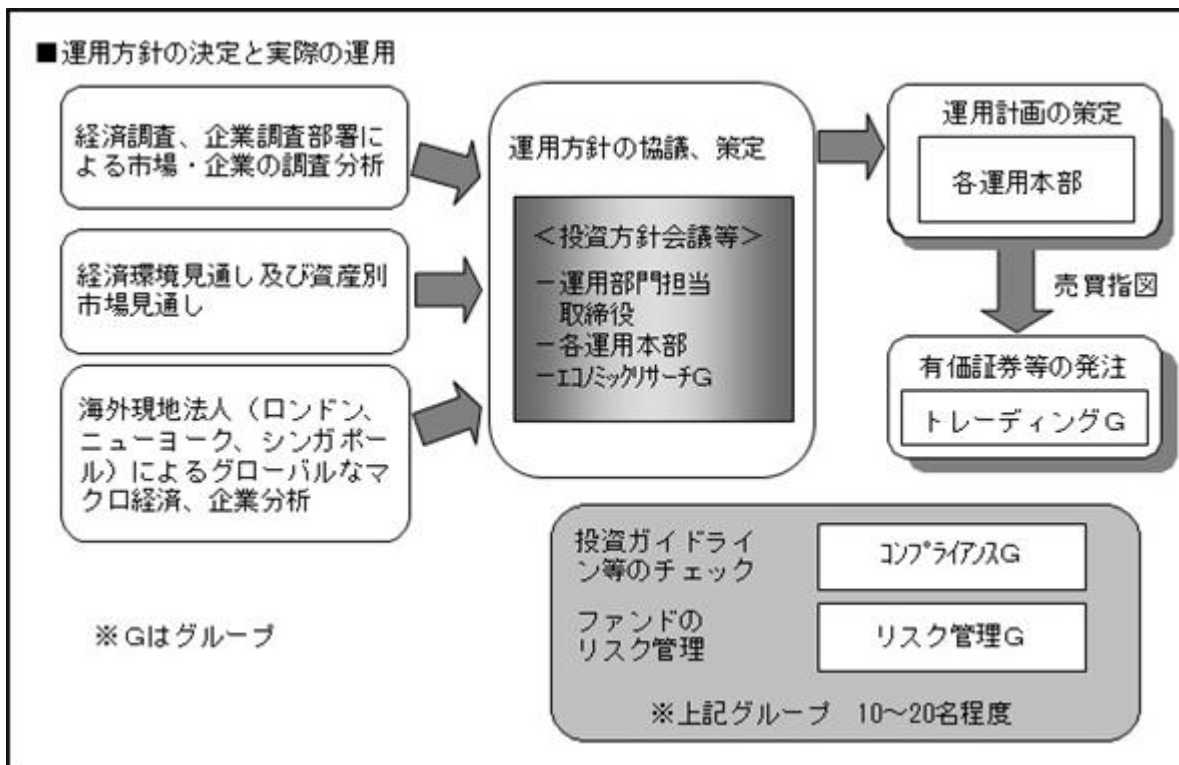
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

(参考) 当ファンドが投資対象と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】



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

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

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

マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

上記体制は平成28年4月28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す。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としません。）に対し支払われます。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るものとします。
- (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券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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った通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- (4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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。

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。当該インデックス構成銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

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。

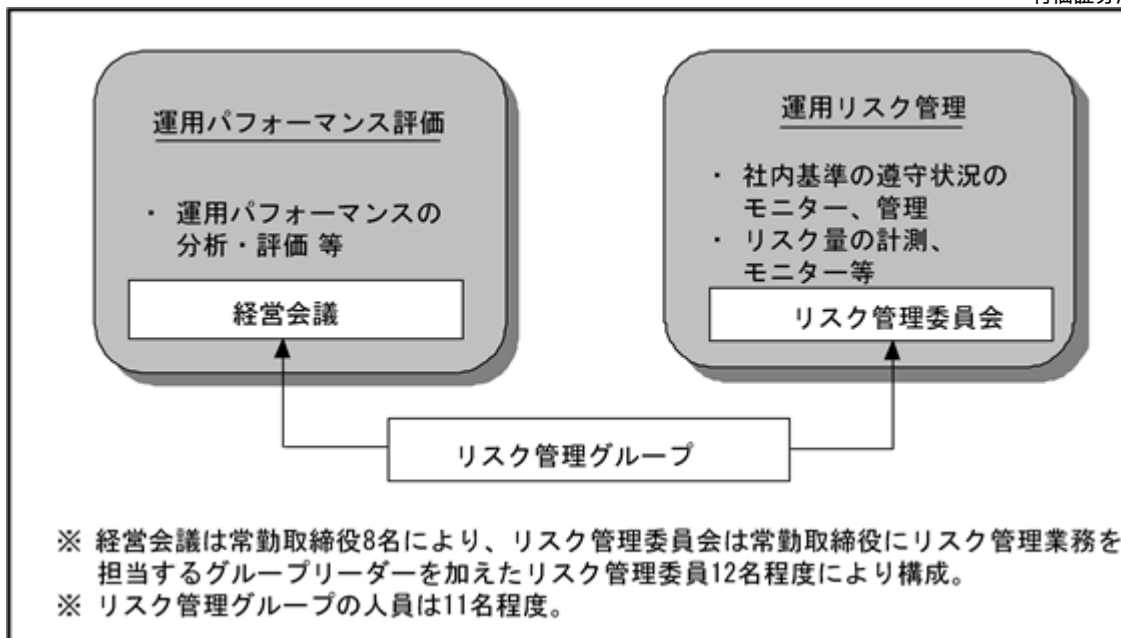
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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>

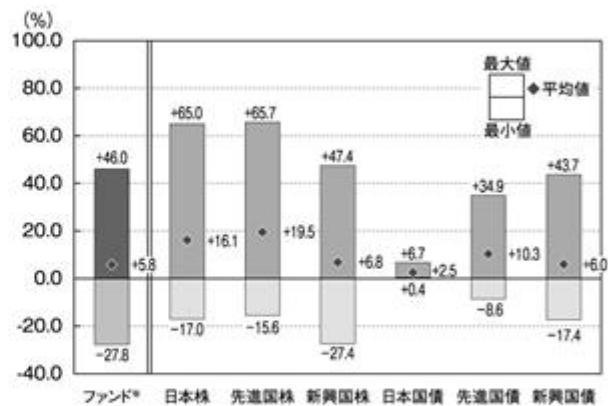


運用パフォーマンス評価は、運用部門から独立したリスク管理グループが月次で対象ファンドについて分析を行い、結果を「経営会議」に報告します。また、「経営会議」において運用パフォーマンス評価方法の協議も行い、適宜見直しを行います。

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28年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

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

ファンド:2011年5月~2016年4月(2011年5月~2012年4月は対象インデックスのデータ)
代表的な資産クラス:2011年5月~2016年4月

- *ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
- *ファンドの対象インデックスは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。

- *上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- *ファンドの年間騰落率がない期間については、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示していますので、ファンドの実績ではありません。対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
- *全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 - 先進国株……MSCIコクサイ・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)
 - 日本国債……NOMURA-BPI国債
 - 先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 - 新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的財産その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(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0.5886%（税抜0.545%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.267%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.245%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.033%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・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、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料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。

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税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ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等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。

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28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28年4月28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	976,558,653	100.02
内 日本	976,558,653	100.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	154,218	0.02
純資産総額	976,404,435	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28年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	34,988,105,594	94.72
内 韓国	5,502,660,890	14.90
内 台湾	4,164,533,433	11.27
内 中国	3,849,458,409	10.42
内 インド	2,920,967,321	7.91
内 ケイマン諸島	2,736,131,905	7.41
内 ブラジル	2,516,155,802	6.81
内 南アフリカ	2,347,847,177	6.36
内 香港	1,621,586,570	4.39
内 ロシア	1,384,391,415	3.75
内 メキシコ	1,266,138,885	3.43
内 マレーシア	1,208,188,586	3.27
内 インドネシア	937,154,621	2.54
内 タイ	769,117,087	2.08
内 トルコ	538,394,873	1.46
内 フィリピン	493,897,044	1.34
内 ポーランド	447,220,250	1.21
内 チリ	447,065,182	1.21
内 バミューダ	394,507,988	1.07
内 カタール	332,520,778	0.90
内 アラブ首長国連邦	330,823,170	0.90
内 コロンビア	176,121,375	0.48
内 オランダ	169,391,512	0.46
内 ハンガリー	110,951,855	0.30
内 ギリシャ	84,200,789	0.23
内 チェコ	64,343,837	0.17
内 エジプト	48,086,399	0.13
内 アメリカ	44,693,580	0.12
内 マルタ	35,853,855	0.10
内 マン島	27,691,960	0.07
内 ペルー	18,009,046	0.05
投資信託受益証券	259,709,509	0.70
内 メキシコ	259,709,509	0.70
投資証券	123,879,800	0.34
内 メキシコ	58,096,023	0.16
内 南アフリカ	46,656,284	0.13
内 トルコ	19,127,493	0.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,567,172,297	4.24
純資産総額	36,938,867,200	100.00

その他資産の投資状況

平成28年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	201,962,825	0.55
-	201,962,825	0.55
為替予約取引（売建）	202,037,791	0.55
-	202,037,791	0.55
株価指数先物取引（買建）	1,548,390,315	4.19
内 アメリカ	1,548,390,315	4.19

（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28年4月28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	1,117,599,741	0.8607 961,984,211	0.8738 976,558,653	- -	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28年4月28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28年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	9,718	124,660.80 1,211,453,732	124,670.00 1,211,543,060	- -	3.28%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,167,083	540.45 1,171,206,020	530.53 1,149,713,379	- -	3.11%
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	454,900	2,337.78 1,063,459,726	2,256.92 1,026,675,182	- -	2.78%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	540,000	1,271.88 686,817,663	1,296.14 699,915,600	- -	1.89%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	35,068	16,265.85 570,410,955	15,448.29 541,740,984	- -	1.47%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	7,402,530	71.72 530,917,555	71.31 527,918,829	- -	1.43%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,494,235	61.51 399,465,993	59.85 388,709,188	- -	1.05%
8	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インターネットソフトウェア・サービス	43,500	8,665.98 376,970,397	8,522.08 370,710,806	- -	1.00%
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,268,120	280.70 355,968,397	269.50 341,764,680	- -	0.93%
10	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	162,216	1,949.89 316,303,733	2,058.64 333,945,806	- -	0.90%
11	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,993,200	45.83 320,518,913	45.28 316,652,096	- -	0.86%
12	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	530,309	482.37 255,809,331	534.59 283,499,080	- -	0.77%
13	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	267,708	1,024.16 274,176,271	1,044.95 279,744,151	- -	0.76%
14	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	416,295	590.81 245,955,010	602.09 250,649,554	- -	0.68%
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	132,122	1,851.44 244,616,796	1,861.68 245,970,206	- -	0.67%

16	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	11,900	21,187.59 252,132,406	20,627.51 245,467,398	- -	0.66%
17	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	459,000	535.27 245,689,401	529.21 242,907,390	- -	0.66%
18	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,768,578	85.93 237,904,129	86.61 239,797,614	- -	0.65%
19	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,539,000	137.72 211,955,583	140.79 216,679,657	- -	0.59%
20	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	45,975	4,617.72 212,299,754	4,554.62 209,398,884	- -	0.57%
21	SBERBANK ADR ロシア	株式 商業銀行	243,824	829.06 202,145,636	852.20 207,788,946	- -	0.56%
22	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	240,715	814.82 196,141,442	832.54 200,406,551	- -	0.54%
23	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	13,636	14,532.16 198,160,579	14,289.09 194,846,167	- -	0.53%
24	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	114,824	1,767.27 202,925,830	1,692.20 194,305,632	- -	0.53%
25	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,809	103,014.57 186,353,374	102,996.59 186,320,849	- -	0.50%
26	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,255,200	75.20 169,604,079	77.82 175,510,940	- -	0.48%
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	41,845	4,191.52 175,394,327	4,168.42 174,427,785	- -	0.47%
28	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	655,000	278.91 182,692,461	262.05 171,647,990	- -	0.46%
29	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	48,847	3,415.63 166,843,504	3,497.40 170,837,683	- -	0.46%
30	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV オランダ	株式 家庭用耐久財	255,411	677.90 173,143,496	663.21 169,391,512	- -	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年4月28日現在

種類	投資比率
株式	94.72%
投資信託受益証券	0.70%
投資証券	0.34%
合計	95.76%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成28年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	15.76%
石油・ガス・消耗燃料		7.57%
インターネットソフトウェア・サービス		5.28%
コンピュータ・周辺機器		4.92%
半導体・半導体製造装置		4.71%
無線通信サービス		4.68%
保険		3.56%
金属・鉱業		2.94%
自動車		2.51%
不動産管理・開発		2.37%
コングロマリット		2.30%
メディア		2.18%
食品		2.18%
情報技術サービス		2.17%
電子装置・機器・部品		2.11%
化学		2.09%
各種電気通信サービス		1.98%
食品・生活必需品小売り		1.76%
各種金融サービス		1.66%
医薬品		1.62%
電力		1.34%
飲料		1.23%
資本市場		1.19%
パーソナル用品		1.13%
運送インフラ		1.09%
建設・土木		0.98%
建設資材		0.85%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.85%
家庭用耐久財		0.84%
タバコ		0.80%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.80%
自動車部品		0.79%
複合小売り		0.74%
機械		0.69%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.62%
ホテル・レストラン・レジャー		0.52%
繊維・アパレル・贅沢品		0.51%
家庭用品		0.49%

ガス	0.48%
専門小売り	0.45%
インターネット販売・カタログ販売	0.36%
紙製品・林産品	0.34%
水道	0.28%
不動産投資信託	0.27%
各種消費者サービス	0.25%
航空宇宙・防衛	0.24%
旅客航空輸送業	0.24%
電気設備	0.21%
バイオテクノロジー	0.19%
消費者金融	0.18%
陸運・鉄道	0.17%
ソフトウェア	0.16%
商業サービス・用品	0.16%
海運業	0.13%
航空貨物・物流サービス	0.11%
商社・流通業	0.10%
総合公益事業	0.10%
エネルギー設備・サービス	0.10%
容器・包装	0.08%
レジャー用品	0.07%
建設関連製品	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
販売	0.05%
通信機器	0.04%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.03%
合計	94.72%

(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28年4月28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	-	ブラジル・リアル買/ 円売2016年04月	買建	2,119,679	66,921,406	65,922,014	0.18%
		南アフリカ・ランド 買/円売2016年0 4月	買建	5,400,000	41,869,565	41,040,000	0.11%
		メキシコ・ペソ買/円 売2016年04月	買建	5,900,000	37,798,042	37,406,000	0.10%
		マレーシア・リンギッ ト買/円売2016年 04月	買建	1,120,000	31,883,755	31,561,600	0.09%
		インドネシア・ルピア 買/円売2016年0 4月	買建	2,000,000,000	16,873,388	16,600,000	0.04%
		コロンビア・ペソ買/ 円売2016年04月	買建	252,224,913	9,526,868	9,433,211	0.03%
		アメリカ・ドル売/円 買2016年04月	売建	1,841,058	204,873,024	202,037,791	0.55%
株価指数先物 取引	ICE - US	MINI MSCI EMG MKT Ju n16	買建	332	1,534,151,898	1,548,390,315	4.19%

(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28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
第4計算期間末 (平成27年4月20日)	612	612	1.4299	1.4299
第5計算期間末 (平成28年4月18日)	928	928	1.0709	1.0709
平成27年4月末日	631	-	1.4506	-
5月末日	691	-	1.4426	-
6月末日	650	-	1.3628	-
7月末日	656	-	1.2895	-
8月末日	598	-	1.1549	-
9月末日	592	-	1.0886	-
10月末日	690	-	1.1979	-
11月末日	691	-	1.1829	-
12月末日	721	-	1.1278	-
平成28年1月末日	758	-	1.0231	-
2月末日	759	-	0.9840	-
3月末日	946	-	1.1032	-
4月末日	976	-	1.0879	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000

【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
第4計算期間	21.5
第5計算期間	25.1

(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
第4計算期間	465,535,099	214,743,259
第5計算期間	757,488,929	318,103,025

(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:2016年4月28日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2011年5月17日)~2016年4月28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)

期	分配日	分配金(円)
第1期	(2012.04.18)	0円
第2期	(2013.04.18)	0円
第3期	(2014.04.18)	0円
第4期	(2015.04.20)	0円
第5期	(2016.04.18)	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	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	100.02%

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	94.72
内 韓国	14.90
内 台湾	11.27
内 中国	10.42
内 インド	7.91
内 ケイマン諸島	7.41
内 その他	42.81
投資信託受益証券	0.70
内 メキシコ	0.70
投資証券	0.34
内 メキシコ	0.16
内 南アフリカ	0.13
内 トルコ	0.05
コールローン、その他の資産(負債控除後)	4.24
純資産総額	100.00

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	コンピュータ周辺機器	3.28%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.11%
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	2.78%
4	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.89%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.47%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	商業銀行	1.43%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H	株式	中国	商業銀行	1.05%
8	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	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	1.00%
9	HON HAI PRECISION INDUSTRY	株式	台湾	電子装置・機器・部品	0.93%
10	INFOSYS LTD	株式	インド	情報技術サービス	0.90%

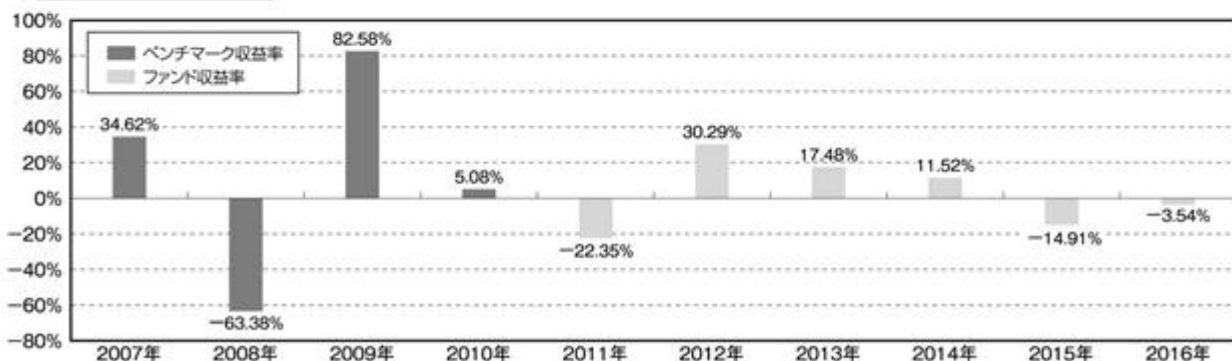
その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.55
為替予約取引(売建)	△0.55
株価指数先物取引(買建)	4.19

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	15.76%
2	石油・ガス・消耗燃料	7.57%
3	インターネットソフトウェアサービス	5.28%
4	コンピュータ周辺機器	4.92%
5	半導体・半導体製造装置	4.71%

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2016年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※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。

- 掲載データ等はい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。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

- ・お申込価額（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。

主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
外国株式	原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。 外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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10億口を下回るようになった場合、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議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信

託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ．信託約款の変更等

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

- g.上記a.からf.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.この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。
- 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。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
 - ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。
- (URL <http://www.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ます。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(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5期計算期間（平成27年4月21日から平成28年4月18日まで）の財務諸表について、P w C 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4期 平成27年4月20日現在	第5期 平成28年4月18日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	614,271
コール・ローン	4,071,568	5,232,179
親投資信託受益証券	612,070,797	928,744,211
流動資産合計	616,142,365	934,590,661
資産合計		
616,142,365		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,646,339	3,416,580
未払受託者報酬	87,611	134,236
未払委託者報酬	1,289,777	2,083,479
その他未払費用	17,760	18,872
流動負債合計	4,041,487	5,653,167
負債合計		
4,041,487		
純資産の部		
元本等		
元本	1,428,057,813	1,867,443,717
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	184,043,065	61,493,777
(分配準備積立金)	74,633,856	54,383,777
元本等合計	612,100,878	928,937,494
純資産合計		
612,100,878		
負債純資産合計		
616,142,365		
934,590,661		

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第4期	第5期
	自 平成26年4月19日 至 平成27年4月20日	自 平成27年4月21日 至 平成28年4月18日
営業収益		
受取利息	971	1,587
有価証券売買等損益	81,854,933	183,605,586
営業収益合計	81,855,904	183,603,999
営業費用		
受託者報酬	147,122	252,981
委託者報酬	2,165,943	3,878,483
その他費用	29,784	39,445
営業費用合計	2,342,849	4,170,909
営業利益又は営業損失（ ）	79,513,055	187,774,908
経常利益又は経常損失（ ）	79,513,055	187,774,908
当期純利益又は当期純損失（ ）	79,513,055	187,774,908
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	16,608,960	45,990,595
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	31,319,707	184,043,065
剰余金増加額又は欠損金減少額	138,926,198	138,643,317
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	138,926,198	138,643,317
剰余金減少額又は欠損金増加額	49,106,935	119,408,292
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	49,106,935	119,408,292
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	184,043,065	61,493,777

(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。
2 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月18日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成27年4月20日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期 平成27年4月20日現在	第5期 平成28年4月18日現在
1 . 1 期首元本額	177,265,973円	428,057,813円
期中追加設定元本額	465,535,099円	757,488,929円
期中一部解約元本額	214,743,259円	318,103,025円
2 . 受益権の総数	428,057,813口	867,443,717口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期 自 平成26年4月19日 至 平成27年4月20日	第5期 自 平成27年4月21日 至 平成28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（8,359,402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（54,544,693円）、信託約款に規定される収益調整金（109,409,209円）及び分配準備積立金（11,729,761円）より分配対象収益は184,043,065円（1万口当たり4,299.49円）であります。なお、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（12,528,330円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（305,822,864円）及び分配準備積立金（41,855,447円）より分配対象収益は360,206,641円（1万口当たり4,152.51円）であります。なお、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4期 自 平成26年4月19日 至 平成27年4月20日	第5期 自 平成27年4月21日 至 平成28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4期 平成27年4月20日現在	第5期 平成28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4期 平成27年4月20日現在	第5期 平成28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	74,500,163	170,238,405
合計	74,500,163	170,238,405

（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4期 平成27年4月20日現在	第5期 平成28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）	1.4299円 (14,299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28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	1,079,935,130	928,744,211	
親投資信託受益証券	合計	1,079,935,130	928,744,211	
合計		1,079,935,130	928,744,211	

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27年4月20日現在	平成28年4月18日現在
資産の部			
流動資産			
預金		834,852,535	1,696,126,661
金銭信託		-	2,678,365
コール・ローン		83,710,301	22,813,508
株式		39,439,949,428	33,602,771,553
投資信託受益証券		282,653,869	244,173,681
投資証券		83,648,470	111,180,483
派生商品評価勘定		89,659,351	73,246,441
未収配当金		60,028,611	59,549,862
差入委託証拠金		552,788,281	389,096,305
流動資産合計		41,427,290,846	36,201,636,859
資産合計		41,427,290,846	36,201,636,859
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		293,582	35,643
未払金		6,307,384	-
未払解約金		81,379,000	5,000,000
流動負債合計		87,979,966	5,035,643
負債合計		87,979,966	5,035,643
純資産の部			
元本等			
元本	1	36,225,490,538	42,091,475,182
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	5,113,820,342	5,894,873,966
元本等合計		41,339,310,880	36,196,601,216
純資産合計		41,339,310,880	36,196,601,216
負債純資産合計		41,427,290,846	36,201,636,859

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成27年4月20日現在	平成28年4月18日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,638,365,556円	36,225,490,538円
同期中追加設定元本額	7,305,093,714円	25,052,831,424円
同期中一部解約元本額	13,717,968,732円	19,186,846,780円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C年金>	536,339,640円	1,079,935,130円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	- 円	103,571,289円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	8,768,715円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	24,120,072円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	39,319,073円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	20,159,808円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	19,993,998円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	14,660,263円
たわらノーロード 新興国株式	- 円	175,098,352円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	453,850,074円	544,443,372円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	15,709,162円	30,730,003円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	45,530,715円	84,681,755円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	125,513,915円	196,116,080円
投資のソムリエ	830,497,051円	1,637,562,653円
クルーズコントロール	548,528,655円	1,441,271,717円
投資のソムリエ< D C年金>	12,229,861円	32,611,578円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	40,579,178円	100,653,854円
クルーズコントロール< D C年金>	135,432円	386,265円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	- 円	22,532,118円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	- 円	60,888,306円
投資のソムリエ< D C年金>リスク抑制型	- 円	2,023,995円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	1,795,104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）	6,769,178,497円	7,499,128,392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）	192,233,956円	190,433,666円
エマージング株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,125,014,153円	2,193,501,345円

	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	15,043,838,949円	16,266,515,185円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	9,486,311,300円	10,300,573,094円
	計	36,225,490,538円	42,091,475,182円
2 .	受益権の総数	36,225,490,538口	42,091,475,182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5,894,873,966 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26年4月19日 至 平成27年4月20日	自 平成27年4月21日 至 平成28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27年4月20日現在	平成28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27年4月20日現在	平成28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	4,146,358,555	2,983,049,452
投資信託受益証券	12,972,265	10,223,008
投資証券	57,477	9,230,731
合計	4,159,388,297	2,963,595,713

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成27年4月20日 現在				平成28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）
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	42,321,040	-	42,460,000	138,960	-	-	-	-
韓国・ウォン	42,321,040	-	42,460,000	138,960	-	-	-	-
合計	42,321,040	-	42,460,000	138,960	-	-	-	-

（注）時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成27年4月20日 現在				平成28年4月18日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	1,401,479,535	-	1,490,984,264	89,504,729	2,151,700,693	-	2,224,911,491	73,210,798
合計	1,401,479,535	-	1,490,984,264	89,504,729	2,151,700,693	-	2,224,911,491	73,210,798

(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27年4月20日現在	平成28年4月18日現在
1口当たり純資産額	1.1412円	0.8600円
(1万口当たり純資産額)	(11,412円)	(8,600円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28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	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	11,200	48.060	538,272.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,273	8.080	147,645.840	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	65,400	6.670	436,218.000	
	CREDICORP LTD	5,649	138.890	784,589.610	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	46,825	8.930	418,147.250	
	NETEASE INC-ADR	3,300	138.280	456,324.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	13,480	27.980	377,170.400	
	LUKOIL SPON ADR	44,939	42.070	1,890,583.730	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	48,121	1.645	79,159.040	
	GAZPROM PAO ADR	518,151	4.384	2,271,573.980	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	96,568	3.730	360,198.640	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	38,100	3.336	127,101.600	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	69,241	5.485	379,786.880	
	SISTEMA JSFC GDR	15,837	6.920	109,592.040	
	NOVATEK OAO GDR	8,065	91.000	733,915.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	11,500	193.220	2,222,030.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	50,794	13.620	691,814.280	
	ROSTELECOM SPON ADR	16,154	8.570	138,439.780	
	ROSNEFT OIL CO GDR	110,287	4.665	514,488.850	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	5,500	35.540	195,470.000	
	SEVERSTAL GDR	21,971	11.840	260,136.640	
	TATNEFT ADR	20,855	31.300	652,761.500	
	VTB BANK OJSC GDR	239,366	2.210	528,998.860	
	DP WORLD LTD	14,393	19.000	273,467.000	
	MAGNIT PJSC GDR	22,955	39.730	912,002.150	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	15,900	14.670	233,253.000	
	SOUFUN HOLDINGS LTD ADR	11,000	6.000	66,000.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	129,759	1.005	130,407.790	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,600	55.430	88,688.000	
	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO LTD ADR	4,200	75.540	317,268.000	
SBERBANK ADR	238,564	7.552	1,801,635.320		
YY INC-ADR	1,300	62.880	81,744.000		
MEGAFON PJSC GDR	11,719	10.750	125,979.250		
58.COM INC ADR	3,500	58.290	204,015.000		

	QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	2,300	43.820	100,786.000	
	JD.COM INC ADR	14,600	29.880	436,248.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	42,400	78.970	3,348,328.000	
アメリカ・ドル 小計		1,993,766		22,434,239.430 (2,423,122,201)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	FIRST GULF BANK PJSC	74,823	12.800	957,734.400	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	88,156	6.120	539,514.720	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	147,491	18.850	2,780,205.350	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	175,877	6.830	1,201,239.910	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC	55,579	8.950	497,432.050	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	298,755	6.650	1,986,720.750	
	ARABTEC HOLDING CO	190,922	1.710	326,476.620	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	265,978	2.780	739,418.840	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	174,604	1.550	270,636.200	
	EMAAR MALLS GROUP PJSC	178,166	2.960	527,371.360	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,650,351		9,826,750.200 (289,496,061)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	111,203	1,066.050	118,547,958.150	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,259	925.650	6,719,293.350	
	ASIAN PAINTS LTD	23,671	874.350	20,696,738.850	
	EICHER MOTORS LTD	1,038	19,896.300	20,652,359.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	31,625	1,332.450	42,138,731.250	
	SHREE CEMENT LTD	777	12,756.750	9,911,994.750	
	ICICI BANK LTD	94,024	240.650	22,626,875.600	
	STATE BANK OF INDIA LTD	123,307	191.900	23,662,613.300	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,923	1,270.450	3,713,525.350	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	23,672	480.750	11,380,314.000	
	TATA STEEL LTD	25,639	332.850	8,533,941.150	
	TATA MOTORS LTD	67,619	408.750	27,639,266.250	
	JSW STEEL LTD	5,060	1,313.550	6,646,563.000	
	TATA POWER CO LTD	83,703	70.000	5,859,210.000	
	NESTLE INDIA LTD	2,134	6,116.500	13,052,611.000	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	49,099	133.650	6,562,081.350	
	GAIL INDIA LTD	33,181	369.550	12,262,038.550	
	VEDANTA LTD	81,588	94.000	7,669,272.000	
	AXIS BANK LTD	46,701	440.500	20,571,790.500	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	78,975	213.350	16,849,316.250	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	881	6,026.500	5,309,346.500		

LUPIN LTD	18,592	1,548.900	28,797,148.800	
ACC LTD	3,300	1,469.950	4,850,835.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	128,340	1,114.950	143,092,683.000	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	48,150	401.900	19,351,485.000	
INFOSYS LTD	157,465	1,172.700	184,659,205.500	
WIPRO LTD	52,275	584.900	30,575,647.500	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	64,447	897.700	57,854,071.900	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,999	1,348.100	9,435,351.900	
HCL TECHNOLOGIES LTD	48,052	837.550	40,245,952.600	
DABUR INDIA LTD	44,319	267.550	11,857,548.450	
HERO MOTOCORP LTD	4,116	3,148.050	12,957,373.800	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	9,965	3,099.500	30,886,517.500	
BHARTI AIRTEL LTD	102,173	351.250	35,888,266.250	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	2,377.950	12,945,559.800	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	82,160	833.050	68,443,388.000	
DIVI'S LABORATORIES LTD	6,922	1,023.050	7,081,552.100	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,953	3,731.600	33,409,014.800	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	12,754	780.300	9,951,946.200	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,762	785.100	17,085,346.200	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	27,798	257.900	7,169,104.200	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,711	986.050	13,519,731.550	
CIPLA LTD/INDIA	30,629	511.900	15,678,985.100	
LARSEN & TOUBRO LTD	27,151	1,234.900	33,528,769.900	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,015	3,273.700	9,870,205.500	
ASHOK LEYLAND LTD	103,421	110.350	11,412,507.350	
BOSCH LTD	705	20,029.050	14,120,480.250	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	40,484	2,526.200	102,270,680.800	
NTPC LTD	105,410	137.150	14,456,981.500	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,629	1,084.800	7,191,139.200	
AMBUJA CEMENTS LTD	61,876	231.100	14,299,543.600	
BHARAT FORGE LTD	9,622	830.050	7,986,741.100	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	110,967	96.300	10,686,122.100	
ITC LTD	191,425	331.250	63,409,531.250	
UNITED PHOSPHORUS LTD	23,573	503.800	11,876,077.400	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	84,596	53.000	4,483,588.000	
SIEMENS INDIA LTD	3,547	1,170.450	4,151,586.150	
UNITED BREWERIES LTD	6,705	797.650	5,348,243.250	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,946	1,374.750	15,048,013.500	

	TECH MAHINDRA LTD	21,631	471.400	10,196,853.400	
	CAIRN INDIA LTD	43,218	155.200	6,707,433.600	
	IDEA CELLULAR LTD	103,591	114.650	11,876,708.150	
	MARICO LTD	38,600	251.400	9,704,040.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	25,765	171.600	4,421,274.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	70,134	233.550	16,379,795.700	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	25,236	162.650	4,104,635.400	
	BAJAJ AUTO LTD	6,953	2,582.500	17,956,122.500	
	COAL INDIA LTD	65,944	277.450	18,296,162.800	
	TATA MOTORS LTD	35,104	299.950	10,529,444.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	271.950	6,449,294.250	
	BHARTI INFRA TEL LTD	44,143	385.700	17,025,955.100	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	26,789	627.050	16,798,042.450	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	320.200	5,810,349.200	
	インド・ルピー 小計	3,131,446		1,693,138,877.900 (2,759,816,371)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	184,100	6,825.000	1,256,482,500.000	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	16,500.000	577,500,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	144,301	16,250.000	2,344,891,250.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	343,200	7,125.000	2,445,300,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	128,100	43,800.000	5,610,780,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,728,700	7,675.000	13,267,772,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,285,700	3,500.000	14,999,950,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	704,700	3,715.000	2,617,960,500.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	43,500	65,000.000	2,827,500,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	33,000	98,500.000	3,250,500,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	113,500	20,150.000	2,287,025,000.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	1,000,800	1,485.000	1,486,188,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	3,710.000	1,077,443,360.000	
	BANK MANDIRI	793,100	9,250.000	7,336,175,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	196,000	18,100.000	3,547,600,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	946,800	10,050.000	9,515,340,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	838,500	2,660.000	2,230,410,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	703,100	4,840.000	3,403,004,000.000	

	KALBE FARMA TBK PT	1,728,800	1,420.000	2,454,896,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	279,700	10,350.000	2,894,895,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,049,100	13,100.000	13,743,210,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	3,900.000	1,133,730,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,600	1,045.000	1,268,212,000.000	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	625,200	1,060.000	662,712,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,090.000	979,165,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	5,300.000	993,750,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	592,800	1,830.000	1,084,824,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,090,500	700.000	763,350,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	119,800	14,500.000	1,737,100,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	148,500	5,825.000	865,012,500.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	535,800	3,050.000	1,634,190,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	20,843,017		110,296,868,610.000 (904,434,323)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	8,895	82.700	735,616.500	
	QATAR NATIONAL BANK	17,679	140.700	2,487,435.300	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	13,439	38.950	523,449.050	
	OOREDOO QSC	6,737	91.100	613,740.700	
	DOHA BANK QSC	10,788	36.600	394,840.800	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,398	204.000	489,192.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	12,763	106.000	1,352,878.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,187	100.500	521,293.500	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	21,930	23.150	507,679.500	
	MASRAF AL RAYAN	32,030	34.850	1,116,245.500	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	34.500	273,102.000	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	73,441	18.000	1,321,938.000	
	VODAFONE QATAR	31,747	12.400	393,662.800	
	QATAR INSURANCE CO SAQ-RTS	1,779	31.000	55,149.000	
カタール・リアル 小計	246,729		10,786,222.650 (320,566,537)		
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	35,125	8,600.000	302,075,000.000	
	CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA	8,788	38,860.000	341,501,680.000	
	ECOPETROL SA	366,698	1,350.000	495,042,300.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	5,872	38,500.000	226,072,000.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	362,757	1,180.000	428,053,260.000	

	CEMENTOS ARGOS SA	38,592	11,580.000	446,895,360.000	
	GRUPO ARGOS SA	26,973	19,700.000	531,368,100.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	33,434	27,780.000	928,796,520.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	18,444	39,080.000	720,791,520.000	
コロンビア・ペソ	小計	896,683		4,420,595,740.000 (159,141,447)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	165.500	3,260,350.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	26.750	2,305,850.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	258,800	17.500	4,529,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	132,400	134.500	17,807,800.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	865,225	7.500	6,489,187.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	49,300	159.500	7,863,350.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,307,700	2.420	3,164,634.000	
	IRPC PCL NVDR	697,700	5.100	3,558,270.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	100,000	17.400	1,740,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	276,800	25.500	7,058,400.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	88,600	152.500	13,511,500.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	361,920	8.100	2,931,552.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	45,500	89.000	4,049,500.000	
	PTT PCL	86,000	286.000	24,596,000.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	164,100	21.700	3,560,970.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,050	450.000	4,972,500.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	35,700	393.000	14,030,100.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	22,700	450.000	10,215,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	99,400	159.500	15,854,300.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	105,300	53.000	5,580,900.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	308,200	24.200	7,458,440.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	30,300	201.000	6,090,300.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	139,810	38.250	5,347,732.500	
	THAI OIL PCL NVDR	75,100	70.000	5,257,000.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	89.000	3,702,400.000	
	CP ALL PCL NVDR	394,100	44.250	17,438,925.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	9.150	4,714,995.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	131,945	69.750	9,203,163.750	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	75,722	23.200	1,756,750.400	

	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	23.200	1,274,445.600	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	170,808	59.000	10,077,672.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	129,100	22.100	2,853,110.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	578,400	5.550	3,210,120.000	
タイ・パーツ 小計		7,459,413		235,464,217.750 (725,229,791)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,340	4,890.000	6,552,600.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	250.000	1,419,250.000	
	CEZ	13,430	422.000	5,667,460.000	
チェコ・コルナ 小計		20,447		13,639,310.000 (61,513,288)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,829,922	33.790	196,993,064.380	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,022	27,959.000	84,492,098.000	
	BANCO DE CHILE	2,124,153	71.600	152,089,354.800	
	EMPRESAS CMPC SA	114,623	1,506.100	172,633,700.300	
	EMPRESAS COPEC SA	39,358	6,521.400	256,669,261.200	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,190	7,462.400	98,429,056.000	
	ENTEL CHILE SA	12,381	5,840.400	72,309,992.400	
	ENDESA CHILE	274,605	899.530	247,015,435.650	
	ENERSIS SA	1,664,838	183.900	306,163,708.200	
	COLBUN SA	748,274	178.680	133,701,598.320	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	379.440	85,038,575.040	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	2,155.600	46,086,728.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	25,767	4,800.800	123,702,213.600	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,243	13,892.000	114,511,756.000	
	SACI FALABELLA	38,293	4,887.600	187,160,866.800	
	ITAU CORPBANCA	12,337,769	6.018	74,248,693.840	
	CENCOSUD SA	96,360	1,837.500	177,061,500.000	
	SONDA SA	39,110	1,300.000	50,843,000.000	
	AES GENER SA	209,506	339.030	71,028,819.180	
		BANCO DE CREDITO E INVERSIONES RTS	293	2,200.000	644,600.000
チリ・ペソ 小計		23,825,203		2,650,824,021.710 (429,433,492)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	191,935	8.490	1,629,528.150	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	20,373	22.420	456,762.660	
	ARCELIK	20,283	19.790	401,400.570	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	46,865	4.760	223,077.400	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	132,172	4.760	629,138.720	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	38.120	212,862.080	
	KOC HOLDING AS	47,656	14.680	699,590.080	

	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	47,602	4.030	191,836.060	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	52,710	3.770	198,716.700	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	13,047	23.040	300,602.880	
	TURK HAVA YOLLARI	38,365	7.570	290,423.050	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	81,365	11.760	956,852.400	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	202,941	8.510	1,727,027.910	
	TURKIYE IS BANKASI	119,206	4.950	590,069.700	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,218	73.900	755,110.200	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	14,893	20.480	305,008.640	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	78,404	4.180	327,728.720	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	89,021	10.000	890,210.000	
	COCA-COLA ICECEK AS	3,988	41.200	164,305.600	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,600	63.100	1,236,760.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	46,986	5.060	237,749.160	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	15,347	17.440	267,651.680	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	58,286	10.680	622,494.480	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	24,099	6.840	164,837.160	
トルコ・リラ 小計		1,380,946		13,479,744.000 (510,343,108)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	12,643	5,606.000	70,876,658.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,094	16,450.000	50,896,300.000	
	OTP BANK NYRT	21,675	7,323.000	158,726,025.000	
ハンガリー・フォロント 小計		37,412		280,498,983.000 (110,011,701)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	626,700	35.500	22,247,850.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	151,590	64.500	9,777,555.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	61,046	90.000	5,494,140.000	
	AYALA CORP	19,283	782.000	15,079,306.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	169,800	16.520	2,805,096.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.700	4,468,495.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,960	2,154.000	6,375,840.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	68.000	2,766,240.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	208,080	82.500	17,166,600.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	37,710	228.200	8,605,422.000	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	22,601	84.000	1,898,484.000	
	BDO UNIBANK INC	134,288	103.500	13,898,808.000	
	MEGAWORLD CORP	1,126,000	4.020	4,526,520.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	8,175	1,896.000	15,499,800.000	
	ROBINSONS LAND CORP	175,600	29.000	5,092,400.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	700,275	22.850	16,001,283.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	72,740	211.000	15,348,140.000	
	SM INVESTMENTS CORP	14,032	962.000	13,498,784.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	876,500	5.920	5,188,880.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,180,800	5.990	7,072,992.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	44.350	5,450,615.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	7,425	1,400.000	10,395,000.000	
フィリピン・ペソ	小計	6,111,035		208,658,250.750 (488,260,307)	
ブラジル・リアル	BRF SA	56,292	49.300	2,775,195.600	
	VALE SA	114,527	18.600	2,130,202.200	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	28.490	228,432.820	
	VALE SA-PREF A	161,096	14.290	2,302,061.840	
	RAIA DROGASIL SA	18,200	56.040	1,019,928.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	69,700	7.420	517,174.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	11.220	260,865.000	
	BANCO DO BRASIL SA	74,200	22.700	1,684,340.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	307,617	8.620	2,651,658.540	
	LOJAS AMERICANAS SA	56,874	16.300	927,046.200	
	LOJAS AMERICANAS SA	14,670	11.360	166,651.200	
	GERDAU SA	71,130	7.850	558,370.500	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	11,606	51.900	602,351.400	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	266,310	11.920	3,174,415.200	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	324,012	9.690	3,139,676.280	
	KROTON EDUCACIONAL SA	128,268	12.150	1,558,456.200	
	CCR SA	81,820	14.930	1,221,572.600	
	WEG SA	50,340	14.300	719,862.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	212,378	28.830	6,122,857.740	
	BANCO BRADESCO SA	63,492	31.810	2,019,680.520	
	NATURA COSMETICOS SA	14,800	29.090	430,532.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	23,506	11.920	280,191.520	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	31,400	12.520	393,128.000	
	CPFL ENERGIA SA	17,047	19.510	332,586.970	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	261,708	32.940	8,620,661.520	
	PORTO SEGURO SA	9,400	29.500	277,300.000	

FIBRIA CELULOSE SA	21,490	31.120	668,768.800	
B2W CIA DIGITAL	10,300	13.560	139,668.000	
BRASKEM SA	14,130	24.650	348,304.500	
TRACTEBEL ENERGIA SA	13,970	37.610	525,411.700	
LOCALIZA RENT A CAR	11,805	33.160	391,453.800	
TELEFONICA BRASIL S.A.	33,928	44.470	1,508,778.160	
LOJAS RENNER SA	55,300	21.750	1,202,775.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,100	12.060	218,286.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,352	72.900	2,285,560.800	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,000	31.780	349,580.000	
TOTVS SA	8,000	28.000	224,000.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	15,100	40.280	608,228.000	
EMBRAER SA	61,560	22.300	1,372,788.000	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,000	15.870	269,790.000	
M DIAS BRANCO SA	3,300	79.000	260,700.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	8,200	21.000	172,200.000	
ODONTOPREV SA	22,300	12.400	276,520.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	38,000	16.270	618,260.000	
JBS SA	61,100	9.650	589,615.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	42,349	7.800	330,322.200	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	30,398	24.970	759,038.060	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,000	56.430	395,010.000	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,200	12.080	292,336.000	
DURATEX SA	27,037	8.500	229,814.500	
SUL AMERICA SA	15,448	16.850	260,298.800	
HYPERMARCAS SA	29,900	28.940	865,306.000	
BM&FBOVESPA SA	146,900	17.100	2,511,990.000	
QUALICORP SA	17,800	15.500	275,900.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	25,900	17.000	440,300.000	
CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,259	41.350	837,709.650	
CIELO SA	88,123	32.950	2,903,652.850	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,700	33.250	1,951,775.000	
DURATEX SA-RCT	697	8.450	5,889.650	
AMBEV SA	405,495	18.990	7,700,350.050	
KLABIN SA	49,200	16.300	801,960.000	
ブラジル・リアル 小計	3,917,002		76,707,538.370 (2,344,949,448)	

ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	59,382	5.540	328,976.280	
	MBANK	1,260	336.000	423,360.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1,359	82.000	111,438.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,926	71.000	775,746.000	
	BANK PEKAO SA	12,189	155.450	1,894,780.050	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	6.230	365,078.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	27,324	71.970	1,966,508.280	
	LPP SA	94	6,044.900	568,220.600	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,637	288.100	759,719.700	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	77,110	26.050	2,008,715.500	
	CCC SA	1,127	160.650	181,052.550	
	SYNTHOS SA	46,508	3.980	185,101.840	
	EUROCASH SA	7,580	55.770	422,736.600	
	GRUPA LOTOS SA	7,977	27.510	219,447.270	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	173,156	5.040	872,706.240	
	CYFROWY POLSAT SA	16,740	24.070	402,931.800	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	89.820	346,076.460	
	ENEA SA	18,176	11.370	206,661.120	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	74,259	13.440	998,040.960	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	2.940	242,620.560	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	49,966	35.390	1,768,296.740		
ALIOR BANK SA	4,463	70.650	315,310.950		
ENERGA SA	16,930	12.880	218,058.400		
ポーランド・ズロチ 小計	754,140		15,581,583.900 (442,361,167)		
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	170,200	4.600	782,920.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.860	245,436.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	440,100	4.970	2,187,297.000	
	DIGI.COM BHD	283,900	4.740	1,345,686.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	69,120	6.680	461,721.600	
	RHB CAPITAL BHD	46,680	6.280	293,150.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	45,000	7.660	344,700.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	69,235	3.210	222,244.350	
	GAMUDA BHD	159,300	4.900	780,570.000	
	GENTING BHD	187,300	9.200	1,723,160.000	
	YTL CORP BHD	370,010	1.690	625,316.900	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	16,656	15.800	263,164.800	

HONG LEONG BANK BHD	46,008	13.560	623,868.480		
IJM CORP BHD	254,060	3.550	901,913.000		
IOI CORP BHD	238,713	4.520	1,078,982.760		
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,000	24.000	840,000.000		
MALAYAN BANKING BHD	432,875	9.170	3,969,463.750		
LAFARGE MALAYSIA BHD	20,400	9.200	187,680.000		
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	86,100	4.220	363,342.000		
MISC BHD	103,880	8.920	926,609.600		
PPB GROUP BHD	36,900	16.380	604,422.000		
PETRONAS DAGANGAN BHD	23,600	23.960	565,456.000		
PETRONAS GAS BHD	63,900	22.080	1,410,912.000		
GENTING MALAYSIA BHD	279,900	4.540	1,270,746.000		
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	55.540	633,156.000		
TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.700	636,500.000		
TENAGA NASIONAL BHD	289,850	14.400	4,173,840.000		
UMW HOLDINGS BHD	47,900	6.920	331,468.000		
DIALOG GROUP BHD	375,644	1.600	601,030.400		
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	217,630	19.200	4,178,496.000		
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.520	221,711.760		
AIRASIA BHD	83,400	2.130	177,642.000		
SIME DARBY BERHAD	267,600	7.970	2,132,772.000		
HARTALEGA HOLDINGS BHD	63,700	4.700	299,390.000		
AXIATA GROUP BERHAD	222,000	5.900	1,309,800.000		
BUMI ARMADA BHD	195,350	0.720	140,652.000		
MAXIS BHD	142,700	6.020	859,054.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	239,700	6.750	1,617,975.000		
SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	319,200	1.870	596,904.000		
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	125,500	2.970	372,735.000		
IHH HEALTHCARE BHD	206,600	6.680	1,380,088.000		
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	1.470	175,224.000		
WESTPORTS HOLDINGS BHD	99,600	4.220	420,312.000		
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	139,639	2.450	342,115.550		
マレーシア・リンギット 小計	6,908,913		42,619,628.350 (1,166,925,424)		
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	240,400	32.470	7,805,788.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	44,600	147.380	6,573,148.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	17,800	192.880	3,433,264.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	172,600	30.830	5,321,258.000	

	GRUPO TELEVISA SAB	209,100	92.160	19,270,656.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	147,300	49.150	7,239,795.000	
	GRUMA SAB DE CV	16,145	264.370	4,268,253.650	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,400	218.980	4,905,152.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	46,900	83.960	3,937,724.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	214,100	94.100	20,146,810.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	79,588	43.440	3,457,302.720	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,115	238.830	3,371,085.450	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	128,000	43.980	5,629,440.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	16,995	262.980	4,469,345.100	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	330,552	42.210	13,952,599.920	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,703,178	13.530	36,573,998.340	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,300	35.340	7,007,922.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	31,200	116.910	3,647,592.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	443,500	41.460	18,387,510.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	23,200	158.780	3,683,696.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	70,200	27.270	1,914,354.000	
	GENTERA SAB DE CV	95,000	34.870	3,312,650.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	29,000	50.790	1,472,910.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	56,500	46.120	2,605,780.000	
メキシコ・ペソ 小計		5,350,673		192,388,034.180 (1,171,643,128)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	500,000	0.230	115,000.000	
	ALPHA BANK A.E.	100,000	1.990	199,000.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	3,998	0.265	1,059.470	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	17.450	61,389.100	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,004	7.850	78,531.400	
	FF GROUP	3,130	18.270	57,185.100	
	EUROBANK ERGASIAS	1,630	0.750	1,222.500	
	OPAP SA	8,501	6.620	56,276.620	
	JUMBO SA	5,623	11.320	63,652.360	
PUBLIC POWER CORP	8,000	2.960	23,680.000		
ユーロ 小計		644,404		656,996.550 (80,179,859)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,090	16,200.000	114,858,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	1,068	140,000.000	149,520,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,205	104,500.000	334,922,500.000	

SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,015	299,000.000	901,485,000.000	
DONGBU INSURANCE CO LTD	3,482	74,900.000	260,801,800.000	
COWAY CO LTD	4,549	97,800.000	444,892,200.000	
KT&G CORP	9,311	116,000.000	1,080,076,000.000	
S-1 CORPORATION	1,763	92,000.000	162,196,000.000	
KOREA GAS CORP	2,659	39,600.000	105,296,400.000	
CJ CORP	1,369	202,000.000	276,538,000.000	
KAKAO CORP	2,808	101,200.000	284,169,600.000	
SK TELECOM CO LTD	1,614	210,500.000	339,747,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,400	90,500.000	217,200,000.000	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	15,692	8,000.000	125,536,000.000	
NCSOFT CORPORATION	1,480	243,500.000	360,380,000.000	
LG UPLUS CORP	18,179	11,100.000	201,786,900.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	26,000.000	105,300,000.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	6,539	6,060.000	39,626,340.000	
POSCO DAEWOO CORP	4,351	24,150.000	105,076,650.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	796	978,000.000	778,488,000.000	
LG CHEM LTD	3,930	335,000.000	1,316,550,000.000	
LG CHEM LTD	726	229,000.000	166,254,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	36,345	41,750.000	1,517,403,750.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	3,860	46,650.000	180,069,000.000	
S-OIL CORP	3,822	91,100.000	348,184,200.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	9,297	25,950.000	241,257,150.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,874	39,550.000	192,766,700.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,310	327,000.000	428,370,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,253	69,100.000	155,682,300.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,546	114,500.000	406,017,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,810	241,000.000	1,400,210,000.000	
SK HYNIX INC	49,783	27,650.000	1,376,499,950.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,330	40,100.000	293,933,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,667	101,500.000	169,200,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,404	151,500.000	2,030,706,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,811	61,000.000	415,471,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,220	12,350.000	286,767,000.000	
KCC CORP	483	419,000.000	202,377,000.000	
KIA MOTORS CORP	23,045	48,150.000	1,109,616,750.000	
KOREA ZINC CO LTD	772	499,500.000	385,614,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,829	59,100.000	1,290,093,900.000	
HANWHA CORP	3,785	37,050.000	140,234,250.000	

KOREAN AIR CO LTD	3,845	32,150.000	123,616,750.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	99,600.000	149,400,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	630	188,000.000	118,440,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,423	67,900.000	96,621,700.000	
KT CORP	3,085	30,800.000	95,018,000.000	
LG ELECTRONICS INC	9,022	62,900.000	567,483,800.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	43	2,434,000.000	104,662,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	60	1,878,000.000	112,680,000.000	
HANSSEM CO LTD	869	204,000.000	177,276,000.000	
LG CORP	7,994	71,400.000	570,771,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	11,590	9,800.000	113,582,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	28,200.000	111,249,000.000	
NAVER CORP	2,391	673,000.000	1,609,143,000.000	
PARADISE CO LTD	3,271	16,300.000	53,317,300.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,243	140,000.000	174,020,000.000	
DONGSUH CO INC	3,429	33,000.000	113,157,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,287	45,100.000	148,243,700.000	
OTTOGI CORP	112	888,000.000	99,456,000.000	
DOOSAN CORP	662	104,500.000	69,179,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,571	152,000.000	390,792,000.000	
KANGWON LAND INC	10,592	43,400.000	459,692,800.000	
POSCO	5,980	246,500.000	1,474,070,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,671	106,500.000	497,461,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,000	55,100.000	275,500,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	9,469	1,300,000.000	12,309,700,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	12,525	11,600.000	145,290,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,762	1,074,000.000	1,892,388,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	202,500.000	135,472,500.000	
HYOSUNG CORP	2,040	135,000.000	275,400,000.000	
ORION CORP	298	963,000.000	286,974,000.000	
YUHAN CORP	699	311,000.000	217,389,000.000	
HANON SYSTEMS	16,843	9,590.000	161,524,370.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	34,000.000	194,140,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,241	57,800.000	245,129,800.000	
LG DISPLAY CO LTD	19,682	25,050.000	493,034,100.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	6,440.000	66,203,200.000	
CELLTRION INC	5,894	108,200.000	637,730,800.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,109	25,000.000	627,725,000.000	

	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,731	185,000.000	320,235,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	4,483	25,050.000	112,299,150.000	
	LOTTE SHOPPING CO	1,045	272,000.000	284,240,000.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,832	121,000.000	826,672,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP	2,706	401,000.000	1,085,106,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	853	219,500.000	187,233,500.000	
	SAMSUNG CARD CO	2,877	39,500.000	113,641,500.000	
	SK INNOVATION CO LTD	5,533	166,000.000	918,478,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	710	361,500.000	256,665,000.000	
	KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,117	69,700.000	147,554,900.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,196	81,600.000	97,593,600.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,000	228,000.000	684,000,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	32,842	34,200.000	1,123,196,400.000	
	HYUNDAI WIA CORP	1,454	103,000.000	149,762,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	4,964	68,400.000	339,537,600.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	23,598	9,540.000	225,124,920.000	
	HANMI PHARM CO LTD	471	655,000.000	308,505,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,801	6,530.000	77,060,530.000	
	O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,833	65,900.000	120,794,700.000	
	E-MART CO LTD	1,929	174,500.000	336,610,500.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	13,539	9,190.000	124,423,410.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	48,900.000	121,369,800.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,577	53,000.000	348,581,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	797	193,000.000	153,821,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,643	168,500.000	445,345,500.000	
	WOORI BANK	27,802	9,770.000	271,625,540.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,491	142,500.000	924,967,500.000	
	韓国・ウォン 小計	698,064		55,938,551,810.000 (5,258,223,870)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	80,000	9.670	773,600.000	
	JIANGSU EXPRESS	110,000	10.300	1,133,000.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	5.220	845,640.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	525,500	89.850	47,216,175.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	116,000	21.950	2,546,200.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	256,000	2.370	606,720.000	
	BEIJING ENTERPRISES	44,500	43.000	1,913,500.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	358,000	6.930	2,480,940.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	212,000	4.660	987,920.000	

YANZHOU COAL MINING CO LTD	176,000	4.670	821,920.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	61,500	73.300	4,507,950.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	128,000	4.740	606,720.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	78,320	13.940	1,091,780.800	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	244,000	7.750	1,891,000.000	
CNOOC LTD	1,517,000	9.730	14,760,410.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	282,000	8.090	2,281,380.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	378,000	7.140	2,698,920.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	337,120	25.050	8,444,856.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	234,888	19.880	4,669,573.440	
CITIC LTD	371,000	12.240	4,541,040.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	148,000	8.610	1,274,280.000	
LENOVO GROUP LTD	618,000	6.460	3,992,280.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,816,000	5.330	9,679,280.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	508,742	10.000	5,087,420.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	136,790	17.380	2,377,410.200	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,193,200	5.310	11,645,892.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	77,000	14.700	1,131,900.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	70,000	46.800	3,276,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	248,000	6.710	1,664,080.000	
COSCO PACIFIC LTD	168,000	9.140	1,535,520.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	636,180	1.160	737,968.800	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	96,000	23.850	2,289,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	362,000	2.710	981,020.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	70,000	16.500	1,155,000.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	134,000	12.520	1,677,680.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	400,000	3.880	1,552,000.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	78,000	23.900	1,864,200.000	
BYD CO LTD	59,500	43.450	2,585,275.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,180,000	4.260	5,026,800.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	6.510	1,041,600.000	

ALIBABA PICTURES GROUP LTD	760,000	1.830	1,390,800.000	
SINOTRANS LTD	147,000	3.730	548,310.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	233,000	8.960	2,087,680.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	333,192	14.520	4,837,947.840	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	132,000	6.040	797,280.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	179,200	14.840	2,659,328.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	224,500	6.380	1,432,310.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	638,000	19.740	12,594,120.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	535,000	2.410	1,289,350.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	4.910	785,600.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,059,000	0.690	1,420,710.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	84,720	10.600	898,032.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	297,000	3.730	1,107,810.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	18.000	828,000.000	
TINGYI HOLDING CORP	186,000	9.390	1,746,540.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	30,000	30.300	909,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	232,000	10.440	2,422,080.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	112,000	15.040	1,684,480.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	8.180	948,880.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	373,000	5.760	2,148,480.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	1.930	546,190.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	230,000	13.560	3,118,800.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	443,000	165.300	73,227,900.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	446,500	37.850	16,900,025.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	338,000	5.200	1,757,600.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	1,097,240	1.100	1,206,964.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	4.090	1,112,480.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	6.220	1,007,640.000	
ZTE CORP	86,888	12.500	1,086,100.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	190,000	3.670	697,300.000	

CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	293,000	13.180	3,861,740.000	
COSCO HOLDINGS	133,000	3.280	436,240.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	742,205	5.070	3,762,979.350	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	142,000	12.160	1,726,720.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	62,000	58.550	3,630,100.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,209,530	5.070	36,552,317.100	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	46,000	40.050	1,842,300.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	228,000	9.170	2,090,760.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	141,000	5.990	844,590.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	284,000	4.340	1,232,560.000	
BANK OF CHINA LTD	6,810,200	3.240	22,065,048.000	
SHUI ON LAND LTD	338,100	2.100	710,010.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	117,500	11.100	1,304,250.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	90,800	11.020	1,000,616.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	393,470	17.000	6,688,990.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,326,235	4.350	27,519,122.250	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	209,600	3.730	781,808.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	358,000	9.850	3,526,300.000	
CHINA COAL ENERGY CO	256,000	3.750	960,000.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	13.800	745,200.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	48,500	47.050	2,281,925.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	105,000	14.540	1,526,700.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	489,142	3.130	1,531,014.460	
CHINA CITIC BANK-H	697,800	4.980	3,475,044.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	377,000	4.710	1,775,670.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	93,000	19.100	1,776,300.000	
FOSUN INTERNATIONAL	203,028	11.400	2,314,519.200	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	396,000	2.270	898,920.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	3.770	1,081,990.000	
SOHO CHINA LTD	196,000	3.930	770,280.000	

KINGSOFT CORP LTD	71,000	19.120	1,357,520.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,239,000	1.260	1,561,140.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	372,000	6.600	2,455,200.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	172,000	10.200	1,754,400.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	487,000	6.530	3,180,110.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	225,600	29.500	6,655,200.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	373,000	5.980	2,230,540.000	
CRRG CORP LTD - H	402,450	8.060	3,243,747.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	110,000	10.600	1,166,000.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	235,500	5.760	1,356,480.000	
SINOPHARM GROUP CO	100,800	35.750	3,603,600.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	195,805	8.700	1,703,503.500	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	250,000	4.170	1,042,500.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	239,000	5.990	1,431,610.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	56,800	16.340	928,112.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	342,000	2.550	872,100.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	178,000	5.310	945,180.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	126,500	11.440	1,447,160.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	67,100	27.550	1,848,605.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	503,880	7.350	3,703,518.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	306,000	3.690	1,129,140.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,976,000	2.830	5,592,080.000	
FAR EAST HORIZON LTD	159,000	6.560	1,043,040.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	187,500	18.740	3,513,750.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	280,000	13.460	3,768,800.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	49,400	12.320	608,608.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	553,000	3.380	1,869,140.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	22.050	738,675.000	

	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	114,000	6.780	772,920.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	256,000	7.970	2,040,320.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	2.940	949,620.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	833,000	2.680	2,232,440.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	113,000	15.960	1,803,480.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	112,561	20.100	2,262,476.100	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	80,000	5.630	450,400.000	
	CAR INC	72,000	9.170	660,240.000	
	CGN POWER CO LTD	838,000	2.570	2,153,660.000	
	DALIAN WANDA COMMERCIAL PROPERTIES CO LTD	50,200	47.300	2,374,460.000	
	GF SECURITIES CO LTD	118,200	19.200	2,269,440.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	114,800	18.500	2,123,800.000	
香港・ドル	小計	65,687,186		532,004,176.040 (7,410,818,172)	
台湾・ドル	ACER INC	274,532	12.300	3,376,743.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	60,554	284.500	17,227,613.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	47,616	88.400	4,209,254.400	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	536,729	34.550	18,543,986.950	
	ASIA CEMENT CORP	204,928	29.900	6,127,347.200	
	TAIWAN BUSINESS BANK	393,839	8.610	3,390,953.790	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	71,000	45.750	3,248,250.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	50.600	3,946,800.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,082	82.000	3,778,724.000	
	QUANTA COMPUTER INC	228,858	55.300	12,655,847.400	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	63,070	48.500	3,058,895.000	
	EVA AIRWAYS CORP	111,624	16.950	1,892,026.800	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	264.000	14,720,640.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	364,393	16.700	6,085,363.100	
	CHINA AIRLINES	232,156	11.050	2,565,323.800	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	136,169	67.500	9,191,407.500	
	CHINA STEEL CORP	1,018,058	22.700	23,109,916.600	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	242,695	24.850	6,030,970.750	
	ADVANTECH CO LTD	30,264	232.500	7,036,380.000	

COMPAL ELECTRONICS INC	330,304	20.600	6,804,262.400	
DELTA ELECTRONICS INC	166,663	150.000	24,999,450.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	322,327	110.500	35,617,133.500	
AU OPTRONICS CORP	731,194	9.900	7,238,820.600	
TAIWAN MOBILE CO LTD	139,800	106.500	14,888,700.000	
EVERGREEN MARINE CORP	160,392	12.250	1,964,802.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	265,824	25.750	6,844,968.000	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	26,630	158.000	4,207,540.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	17,022	378.500	6,442,827.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	53,285	116.000	6,181,060.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	352,633	82.000	28,915,906.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	36,000	31.100	1,119,600.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	274,594	84.800	23,285,571.200	
TRANSCEND INFORMATION INC	19,897	96.900	1,928,019.300	
GIANT MANUFACTURING	26,151	195.000	5,099,445.000	
MEDIATEK INC	127,507	234.000	29,836,638.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	582,936	40.750	23,754,642.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	505,189	15.900	8,032,505.100	
HOTAI MOTOR CO LTD	19,000	351.000	6,669,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	130,000	71.800	9,334,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	27,088	114.000	3,088,032.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	792,141	10.950	8,673,943.950	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	701,920	36.600	25,690,272.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,150,403	8.450	9,720,905.350	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	603,128	18.050	10,886,460.400	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,233,120	82.900	102,225,648.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	931,495	23.000	21,424,385.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	2,465.000	20,262,300.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	639,751	11.650	7,453,099.150	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	739,724	6.410	4,741,630.840	
INVENTEC CO LTD	231,005	22.150	5,116,760.750	
HTC CORPORATION	65,832	83.900	5,523,304.800	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	172,893	39.800	6,881,141.400	

RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	37,496	60.100	2,253,509.600	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	833,650	9.880	8,236,462.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,315,452	16.400	21,573,412.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	765,323	15.900	12,168,635.700	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	21,950	130.000	2,853,500.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	62,560	73.100	4,573,136.000	
NAN YA PLASTICS CORP	406,828	66.300	26,972,696.400	
WISTRON CORP	160,601	19.400	3,115,659.400	
POU CHEN CORP	208,990	41.000	8,568,590.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	407,297	59.000	24,030,523.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,392	235.000	10,902,120.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	101,480	94.000	9,539,120.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	10,658	272.000	2,898,976.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	75,547	38.650	2,919,891.550	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	45,715	47.050	2,150,890.750	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	79,791	72.800	5,808,784.800	
SILICONWARE PRECISION INDS	181,743	51.000	9,268,893.000	
STANDARD FOODS CORP	32,120	79.800	2,563,176.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	124,666	33.550	4,182,544.300	
TAIWAN CEMENT CORP	264,874	33.550	8,886,522.700	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	156,000	26.400	4,118,400.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,111,083	159.500	336,717,738.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,019,525	12.850	13,100,896.250	
YULON MOTOR CO	65,149	30.400	1,980,529.600	
INOTERA MEMORIES INC	202,000	29.200	5,898,400.000	
INNOLUX CORPORATION	794,345	11.200	8,896,664.000	
WPG HOLDINGS CO LTD	137,526	34.500	4,744,647.000	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	16,879	151.500	2,557,168.500	
HERMES MICROVISION INC	3,000	794.000	2,382,000.000	
PEGATRON CORP	176,554	73.500	12,976,719.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	90,076	56.600	5,098,301.600	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	10.750	2,021,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	34,385	69.700	2,396,634.500	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	685,424	14.350	9,835,834.400	

	OBI PHARMA INC	9,000	414.000	3,726,000.000	
	CASETEK HOLDINGS LTD	6,000	169.000	1,014,000.000	
台湾・ドル 小計		26,658,474		1,225,981,194.980 (4,094,777,191)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	0.310	34,886.160	
	BARLOWORLD LTD	18,561	78.960	1,465,576.560	
	BIDVEST GROUP LTD	27,000	361.680	9,765,360.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	40,339	105.750	4,265,849.250	
	DISCOVERY LTD	29,704	126.350	3,753,100.400	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	370,520	12.160	4,505,523.200	
	MASSMART HOLDINGS LTD	9,965	137.410	1,369,290.650	
	GOLD FIELDS LTD	73,055	58.620	4,282,484.100	
	REMGRO LTD	41,677	260.600	10,861,026.200	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	17,301	147.700	2,555,357.700	
	MMI HOLDINGS LTD	96,226	25.110	2,416,234.860	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	210,782	24.510	5,166,266.820	
	EXXARO RESOURCES LTD	12,410	76.740	952,343.400	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,184	600.090	1,910,686.560	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	10,532	141.190	1,487,013.080	
	MTN GROUP LTD	142,331	142.590	20,294,977.290	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	34,529	218.500	7,544,586.500	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	57.500	1,163,052.500	
	FIRSTRAND LTD	291,232	46.640	13,583,060.480	
	PSG GROUP LTD	8,154	206.490	1,683,719.460	
	NASPERS LTD	34,175	2,140.000	73,134,500.000	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	21,138	74.600	1,576,894.800	
	NEDBANK GROUP LTD	18,686	181.360	3,388,892.960	
	NETCARE LTD	84,426	35.750	3,018,229.500	
	PICK'N PAY STORES LTD	23,031	70.720	1,628,752.320	
	RMB HOLDINGS LTD	66,732	59.240	3,953,203.680	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,251	398.250	2,091,210.750	
	SAPPI LTD	38,531	64.500	2,485,249.500	
	SASOL LTD	47,530	448.480	21,316,254.400	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	38,220	169.180	6,466,059.600	
	MR PRICE GROUP LTD	21,087	187.520	3,954,234.240	
	BRAIT SE	28,931	162.410	4,698,683.710	
STANDARD BANK GROUP LTD	103,856	128.480	13,343,418.880		
SPAR GROUP LTD/THE	12,805	211.290	2,705,568.450		
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	84,012	88.500	7,435,062.000		
IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,901	150.000	1,935,150.000		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	29,069	331.240	9,628,815.560		

BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	28,200	140.010	3,948,282.000	
TIGER BRANDS LTD	13,168	333.500	4,391,528.000	
SANLAM LTD	147,862	67.470	9,976,249.140	
INVESTEC LTD	23,104	108.740	2,512,328.960	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	66,179	46.300	3,064,087.700	
PIONEER FOODS LTD	12,824	148.030	1,898,336.720	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC	18,394	188.340	3,464,325.960	
MONDI LTD	9,069	277.500	2,516,647.500	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	71,611	37.660	2,696,870.260	
RMI HOLDINGS	59,287	42.280	2,506,654.360	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	32,270	24.240	782,224.800	
VODACOM GROUP PTY LTD	30,582	165.620	5,064,990.840	
SIBANYE GOLD LTD	64,504	55.060	3,551,590.240	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	78,947	15.850	1,251,309.950	
FORTRESS INCOME FUND LTD	57,017	35.810	2,041,778.770	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	247,425	89.130	22,052,990.250	
南アフリカ・ランド 小計	3,201,089		333,540,770.970 (2,451,524,667)	
合計	181,416,393		33,602,771,553 (33,602,771,553)	

(2) 株式以外の有価証券

平成28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	1,158,953.000	14,880,956.520	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	156,400.000	25,213,244.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,315,353.000	40,094,200.520 (244,173,681)	
投資信託受益証券 合計			1,315,353	244,173,681 (244,173,681)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	476,810.620	
	トルコ・リラ 小計		162,734.000	476,810.620 (18,052,050)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,900.000	8,383,157.000	
	メキシコ・ペソ 小計		208,900.000	8,383,157.000 (51,053,426)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	20,966.000	2,571,479.900	
		RESILIENT REIT LTD	22,906.000	3,153,010.900	
南アフリカ・ランド 小計		43,872.000	5,724,490.800 (42,075,007)		
投資証券 合計			415,506	111,180,483	

(111,180,483)

合計		355,354,164	
		(355,354,164)	

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 37銘柄	6.69%	-%	-%	7.14%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.80%	-%	-%	0.85%
インド・ルピー	株式 73銘柄	7.62%	-%	-%	8.13%
インドネシア・ルピア	株式 31銘柄	2.50%	-%	-%	2.66%
カタール・リアル	株式 14銘柄	0.89%	-%	-%	0.94%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.44%	-%	-%	0.47%
タイ・バーツ	株式 33銘柄	2.00%	-%	-%	2.14%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.17%	-%	-%	0.18%
チリ・ペソ	株式 20銘柄	1.19%	-%	-%	1.26%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.41% -%	-% -%	-% 0.05%	1.56%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.30%	-%	-%	0.32%
フィリピン・ペソ	株式 22銘柄	1.35%	-%	-%	1.44%
ブラジル・レアル	株式 61銘柄	6.48%	-%	-%	6.91%
ポーランド・ズロチ	株式 23銘柄	1.22%	-%	-%	1.30%
マレーシア・リンギット	株式 44銘柄	3.22%	-%	-%	3.44%
メキシコ・ペソ	株式 24銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	3.24% -% -%	-% 0.67% -%	-% -% 0.14%	4.32%
ユーロ	株式 10銘柄	0.22%	-%	-%	0.24%
韓国・ウォン	株式 107銘柄	14.53%	-%	-%	15.48%
香港・ドル	株式 141銘柄	20.47%	-%	-%	21.82%
台湾・ドル	株式 88銘柄	11.31%	-%	-%	12.06%
南アフリカ・ランド	株式 53銘柄 投資証券 2銘柄	6.77% -%	-% -%	-% 0.12%	7.34%

(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28年4月28日現在

資産総額	981,166,584円
負債総額	4,762,149円
純資産総額（ - ）	976,404,435円
発行済数量	897,514,658口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0879円

（参考）

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成28年4月28日現在

資産総額	38,075,073,716円
負債総額	1,136,206,516円
純資産総額（ - ）	36,938,867,200円
発行済数量	42,274,266,907口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8738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カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

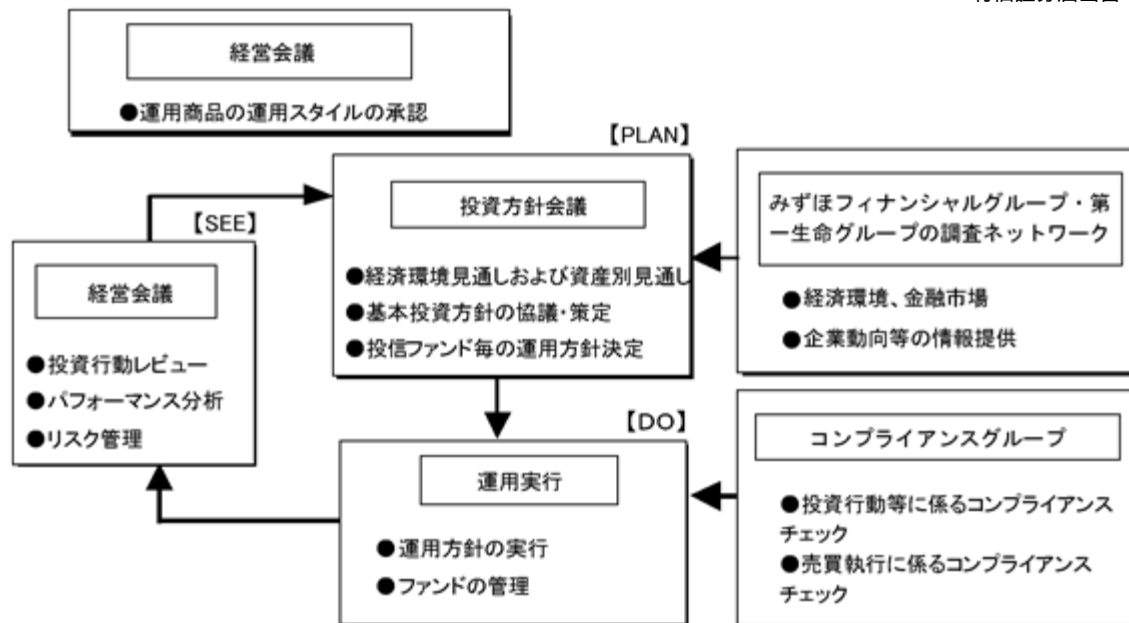
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成28年4月28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28年4月28日現在、委託会社の運用する投資信託は421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)
単体型株式投資信託	6	74,284,971,539
追加型株式投資信託	372	5,825,192,212,947
単体型公社債投資信託	43	314,580,388,571
追加型公社債投資信託	0	0
合計	421	6,214,057,573,057

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
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31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,051,921	12,951,736
金銭の信託	14,169,657	13,094,914
前払費用	57,309	44,951
未収委託者報酬	4,622,292	4,460,404
未収運用受託報酬	1,737,052	1,859,778
未収投資助言報酬	2 312,206	2 277,603
未収収益	260,845	205,097
繰延税金資産	411,797	341,078
その他	46,782	40,689
流動資産計	33,669,865	33,276,255
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 138,967	1 29,219
車両運搬具	1 941	1 549
器具備品	1 243,908	1 184,683
建設仮勘定	49,116	444,155
無形固定資産		
商標権	1 101	1 7
ソフトウェア	1 1,702,633	1 1,645,861
ソフトウェア仮勘定	202,399	53,036
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 188	1 146
投資その他の資産		
投資有価証券	613,137	458,701
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
繰延税金資産	582,861	679,092
差入保証金	733,907	2,040,945
その他	96,862	89,835
固定資産計	6,688,771	8,862,580
資産合計	40,358,637	42,138,836

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,605,579	966,681
未払金	2,515,377	2,055,332
未払償還金	49,873	49,873
未払手数料	1,836,651	1,744,274
その他未払金	628,852	261,185
未払費用	2 2,196,267	2 3,076,566
未払法人税等	1,539,263	1,223,957
未払消費税等	671,243	352,820
賞与引当金	722,343	728,769
その他	30,000	-
流動負債計	9,280,074	8,404,128
固定負債		
退職給付引当金	868,928	997,396
役員退職慰労引当金	110,465	154,535
固定負債計	979,394	1,151,932
負債合計	10,259,468	9,556,060
（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	25,417,784	28,000,340
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	19,480,000	22,030,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	5,314,491	5,347,047
株主資本計	29,846,262	32,428,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	252,905	153,956
評価・換算差額等計	252,905	153,956
純資産合計	30,099,168	32,582,775
負債・純資産合計	40,358,637	42,138,836

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	28,170,831		30,188,445	
運用受託報酬	7,064,021		7,595,678	
投資助言報酬	1,032,659		993,027	
その他営業収益	828,240		724,211	
営業収益計		37,095,752		39,501,363
営業費用				
支払手数料	12,416,659		12,946,176	
広告宣伝費	527,620		468,931	
公告費	288		258	
調査費	6,317,052		7,616,390	
調査費	4,129,778		4,969,812	
委託調査費	2,187,273		2,646,578	
委託計算費	385,121		412,257	
営業雑経費	488,963		548,183	
通信費	34,089		34,855	
印刷費	414,215		436,756	
協会費	24,177		23,698	
諸会費	37		40	
支払販売手数料	16,443		52,833	
営業費用計		20,135,705		21,992,198
一般管理費				
給料	5,260,910		5,382,757	
役員報酬	242,666		242,446	
給料・手当	4,378,307		4,431,015	
賞与	639,936		709,295	
交際費	37,625		43,975	
寄付金	2,697		2,628	
旅費交通費	242,164		254,276	
租税公課	127,947		180,892	
不動産賃借料	686,770		1,128,367	
退職給付費用	218,863		226,460	
固定資産減価償却費	628,056		902,248	
福利厚生費	33,310		36,173	
修繕費	13,807		31,617	
賞与引当金繰入額	722,343		728,769	
役員退職慰労引当金繰入額	50,327		49,320	
役員退職慰労金	25,501		5,250	
機器リース料	87		140	
事務委託費	231,303		251,913	
事務用消耗品費	67,208		70,839	
器具備品費	5,869		14,182	
諸経費	135,032		214,532	
一般管理費計		8,489,827		9,524,346
営業利益		8,470,220		7,984,819

（単位：千円）

	第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）		第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		17,346		25,274
受取利息		2,404		2,079
時効成立分配金・償還金		974		-
為替差益		652		3,996
雑収入		1,822		6,693
営業外収益計		23,200		38,044
営業外費用				
金銭の信託運用損		163,033		305,368
時効成立後支払分配金・償還金		65		-
外国税支払損失		47,515		-
営業外費用計		210,614		305,368
経常利益		8,282,806		7,717,494
特別利益				
投資有価証券売却益		-		3,377
特別利益計		-		3,377
特別損失				
固定資産除却損	1	12,988	1	624
固定資産売却損	2	-	2	2,653
ゴルフ会員権売却損		1,080		-
ゴルフ会員権評価損		-		6,307
関係会社株式評価損		202,477		-
特別損失計		216,547		9,584
税引前当期純利益		8,066,259		7,711,286
法人税、住民税及び事業税		2,969,684		2,557,305
法人税等調整額		29,428		27,424
法人税等合計		2,940,256		2,584,730
当期純利益		5,126,003		5,126,556

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
会計方針の変更による累積的影響額									
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491	25,417,784	29,846,262
当期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の積立				2,550,000			2,550,000	-	-
当期純利益							5,126,556	5,126,556	5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556	2,582,556	2,582,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818

	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	252,905	30,099,168
会計方針の変更による累積的影響額		
会計方針の変更を反映した当期首残高	252,905	30,099,168
当期変動額		
剰余金の配当		2,544,000
別途積立金の積立		-
当期純利益		5,126,556
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	98,949	98,949
当期変動額合計	98,949	2,483,607
当期末残高	153,956	32,582,775

重要な会計方針

項目	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

（1）概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

（2）適用予定日

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

会計上の見積りの変更

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

追加情報

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne 株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 D I A Mアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 8 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
建物	582,075	767,802
車両運搬具	3,981	4,374
器具備品	735,461	562,853
商標権	836	930
ソフトウェア	2,015,473	2,613,791
電信電話専用施設利用権	1,408	1,451

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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
流動資産	未収投資助言報酬	311,994	276,211
流動負債	未払費用	492,035	622,004

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	0	182
ソフトウェア	12,988	442

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
器具備品	-	2,653

(株主資本等変動計算書関係)

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当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28年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(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、本社オフィス等の不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等でありませ

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	26,427,656	26,427,656	-
(1) 未払法人税等	1,223,957	1,223,957	-
負債計	1,223,957	1,223,957	-

(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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
非上場株式	80,246	77,696
関係会社株式	2,316,596	3,229,196
差入保証金	733,907	2,040,945

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

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

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

差入保証金は、本社オフィス等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30期(平成27年3月31日現在)

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

第31期(平成28年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,951,736	-	-	-
合計	12,951,736	-	-	-

(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30期の貸借対照表計上額2,316,596千円、第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	365,683	146,101	219,581
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

（注）非上場株式（貸借対照表計上額77,696千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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
第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
該当事項はありません。

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

区分	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
その他有価証券	5,927	3,377	-

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30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28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	13,094,914	825,986

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035
会計方針の変更による累積的影響額	203,600	-
会計方針の変更を反映した期首残高	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	49,633	51,531
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

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

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	973,035	1,086,550
未積立退職給付債務	973,035	1,086,550
未認識数理計算上の差異	89,550	79,449
未認識過去勤務費用	14,556	9,704
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396
退職給付引当金	868,928	997,396
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	174,402	179,999

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
割引率	0.89%	0.89%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第30期事業年度43,461千円、第31期事業年度44,193千円であります。

(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30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	118,238	79,702
未払事業所税	5,527	5,581
賞与引当金	239,095	224,898
未払法定福利費	30,557	28,395
未払確定拠出年金掛金	2,650	2,500
外国税支払損失	15,727	-
資産除去債務	-	13,244
減価償却超過額（一括償却資産）	2,158	3,389
減価償却超過額	130,844	136,503
繰延資産償却超過額（税法上）	2,710	1,339
退職給付引当金	281,232	305,591
役員退職慰労引当金	35,724	47,318
ゴルフ会員権評価損	1,940	3,768
関係会社株式評価損	176,106	166,740
その他有価証券評価差額金	-	1,196
繰延税金資産合計	1,042,515	1,020,171
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	47,855	-
繰延税金負債合計	47,855	-
差引繰延税金資産の純額	994,659	1,020,171

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29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30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28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	30,188,445	8,588,706	724,211	39,501,363

（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30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

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30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	9,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	800,617	未払費用	308,974
								増資の引受	912,600	-	-
	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	473,948	未払費用	157,130

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売、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	3,023,040 879,733 1,787	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	372,837 12,155,931 123
	みずほ第 一ファイ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払 費用 未払金	292,861 7,581
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻 (純額) 信託報酬の 支払	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,254,132円02銭	1,357,615円66銭
1株当たり当期純利益金額	213,583円46銭	213,606円51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30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または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28年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	343,146	日本において保険業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成28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】

第一生命保険株式会社は、委託会社の株式を12,000株（持株比率50.00%）所有しています。

この他に、委託会社と上記関係法人間に資本関係はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31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28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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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28年6月1日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 > の平成27年4月21日から平成28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< D C 年金 > の平成28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。