

【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25年9月26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 中島 敬雄

【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】 大楽 信雄

【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】 投資のソムリエ

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

投資のソムリエ

（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】

5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により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）

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

（委託会社の略称：D I A M、当ファンドの略称：投資ソムリエ）

(5)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.15%^{*}（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

^{*}消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6)【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7)【申込期間】

平成25年10月12日から平成26年10月10日まで

ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」といいます。）には、お申込みの受付を行いません。

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います。

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

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(9)【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は以下の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドでは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、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>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に 安定的なリターンをめざします。

- ❖主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)にマザーファンド[※]を通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。
- ❖外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ^{*}を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

※国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド

*一部の外貨建資産の通貨については、DIAMがその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

基準価額の変動リスク^{*}を年率4%程度に抑えながら、 安定的な基準価額の上昇をめざします。

※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率4%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

*価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

年2回決算を行います。

- ❖毎年1月、7月の各11日(休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、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には、分配を行わないことがあります。

※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。

運用プロセス

■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。

・基本配分戦略は月次で行います。

■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。

・機動的配分戦略は日次で行います。

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)
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		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

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

投資対象資産

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本		
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 (一部ヘッジ)
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産複合(債券、株式、不動産投信)資産配分変更型))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

「年2回」とは目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

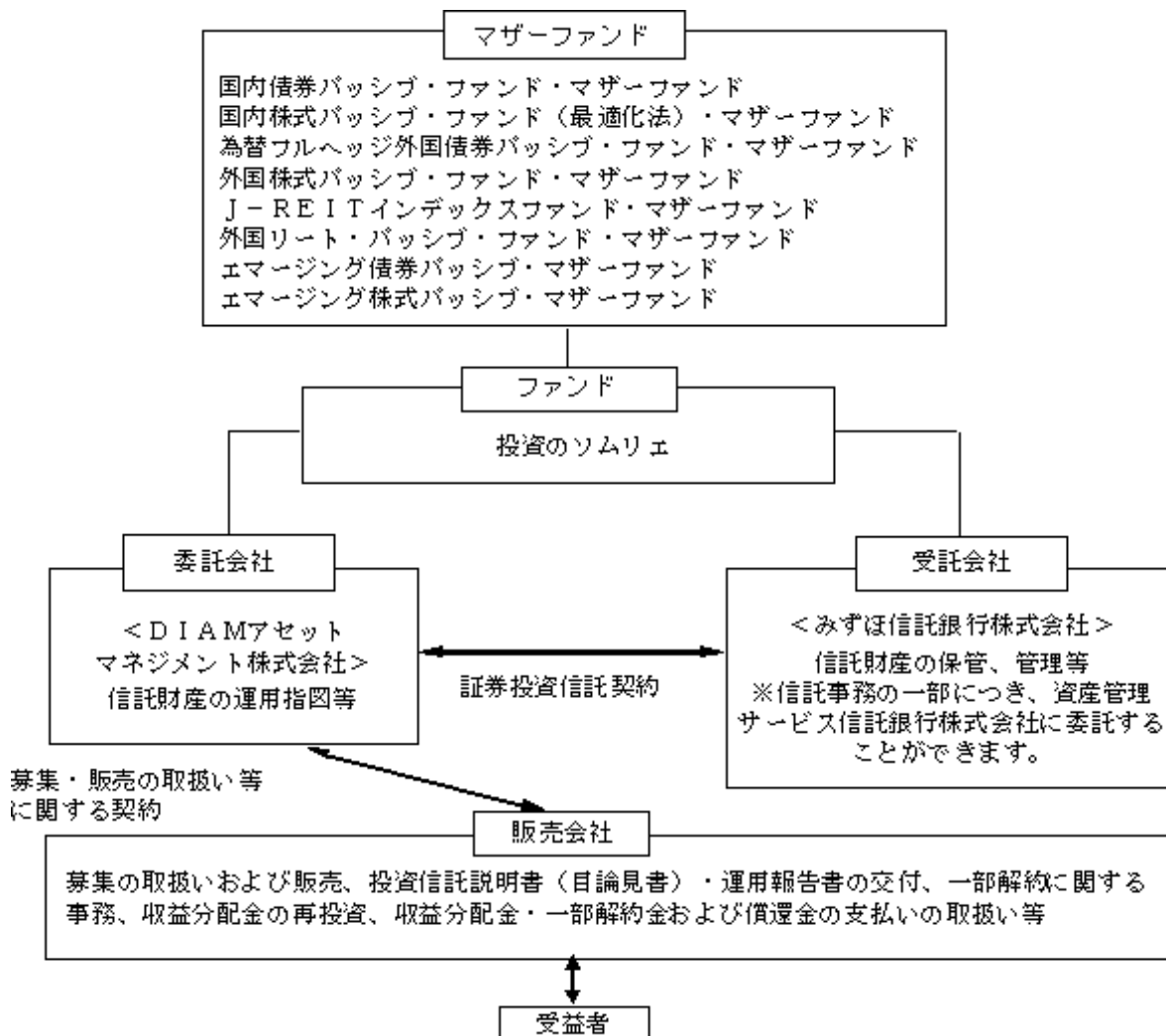
「あり」とは目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジ又は一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

(2)【ファンドの沿革】

平成24年10月26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4月24日	ファンドの名称を「投資のコンシェルジュ」から「投資のソムリエ」に変更
平成25年5月17日	投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

(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あります。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

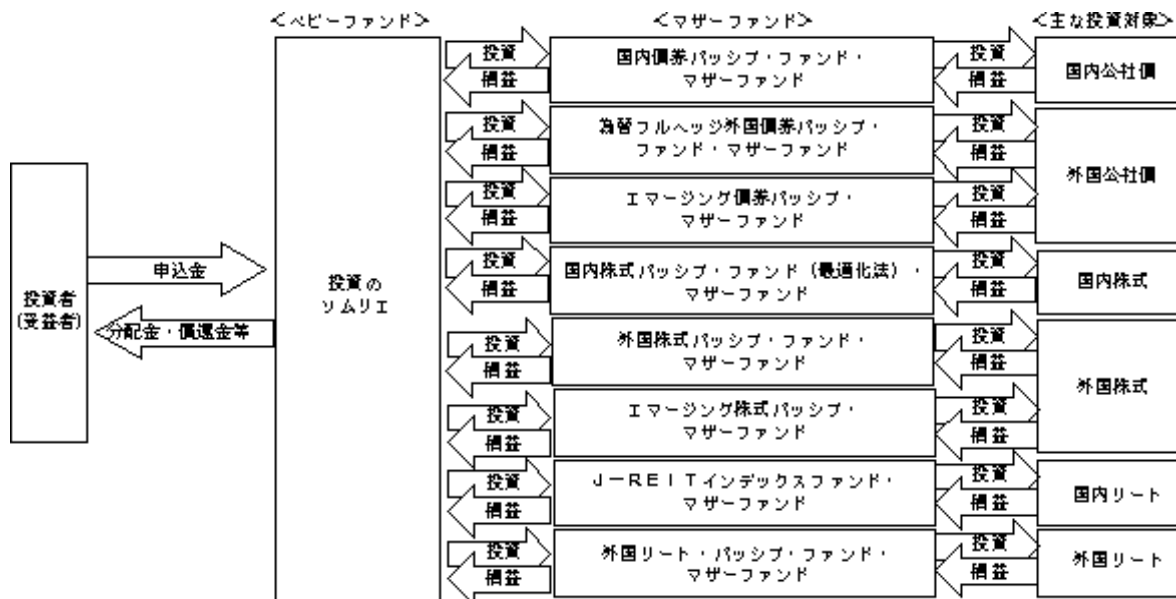
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結します。

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、収益分配金・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各マザーファンドにて行います。



当ファンドは、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、短期金融資産に投資する場合があります。

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25年7月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（平成25年7月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内二丁目5番1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、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、短期金融資産に投資する場合があります。

<投資態度>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

・国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド

（それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

・外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ^{*}を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

*一部の外貨建資産の通貨については、DIAMがその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、短期金融資産へ投資する場合があります。

基準価額の変動リスク^{*}を年率4%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すも

のであり、当ファンドが年率4%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

* 価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。

・基本配分戦略は月次で行います。

機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。

・機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(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国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債券のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債券についての社債券であって当該社債券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券を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債券」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、有価証券にかかるものに限ります。）
 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.および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.までの証券ならびに13.および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。

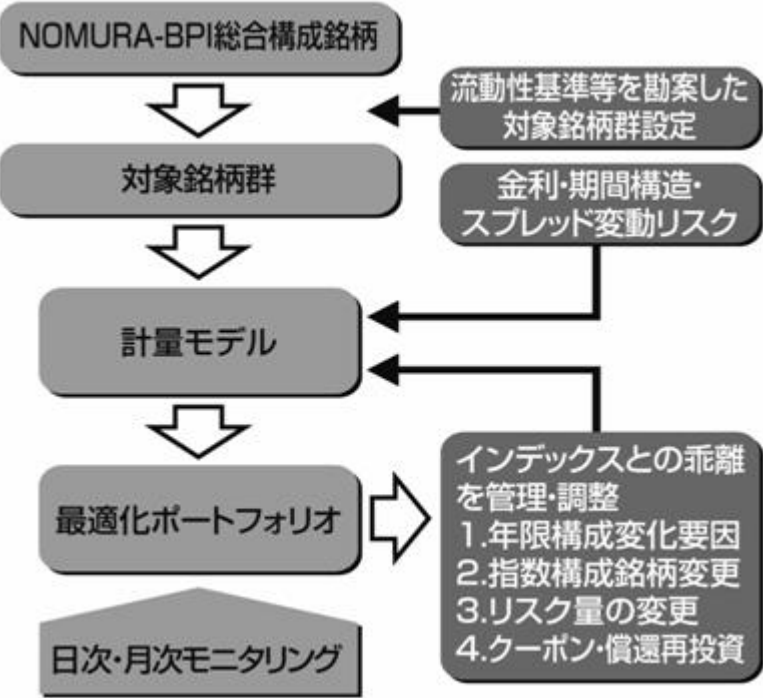
運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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の指図を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

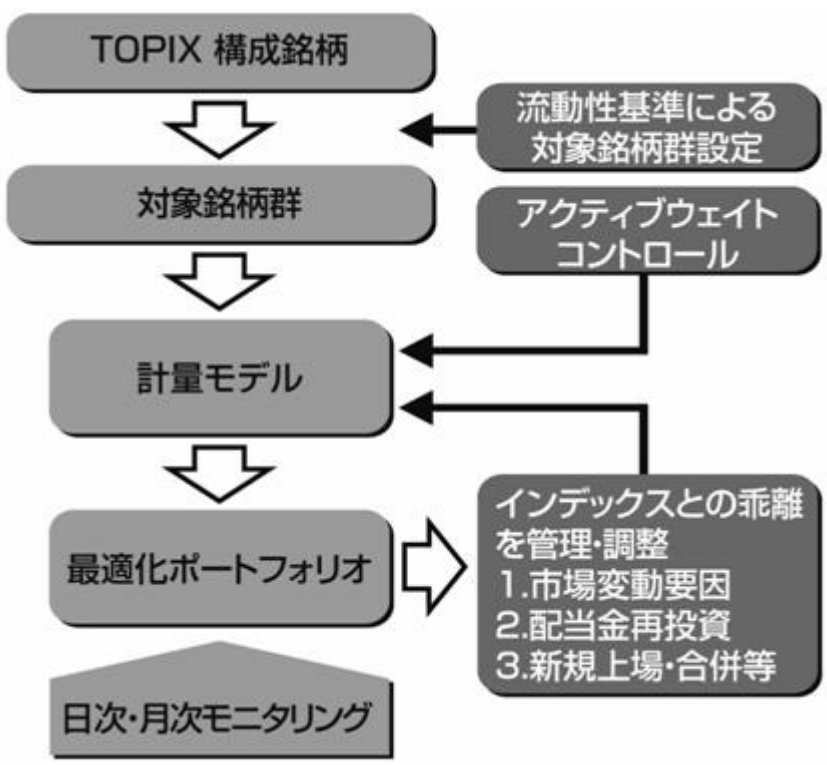
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</p> </div>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 <p>1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資 

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none">1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りませう。2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。3. 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
--------	---

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

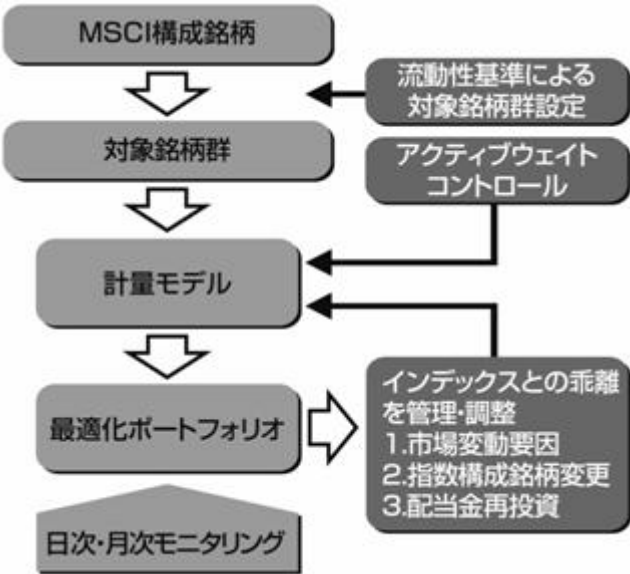
投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 <div data-bbox="363 495 1358 1570" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p><p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。</p><p>株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p><p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用をしていますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p><p>当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p><p>株東京証券取引所は、当社又は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p><p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p></div>
------	---

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

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

投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。</p> </div>
主な投資制限	<p>1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3.同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4.同一銘柄の転換社債等への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>5.外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p>

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

投資態度

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

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

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

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

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

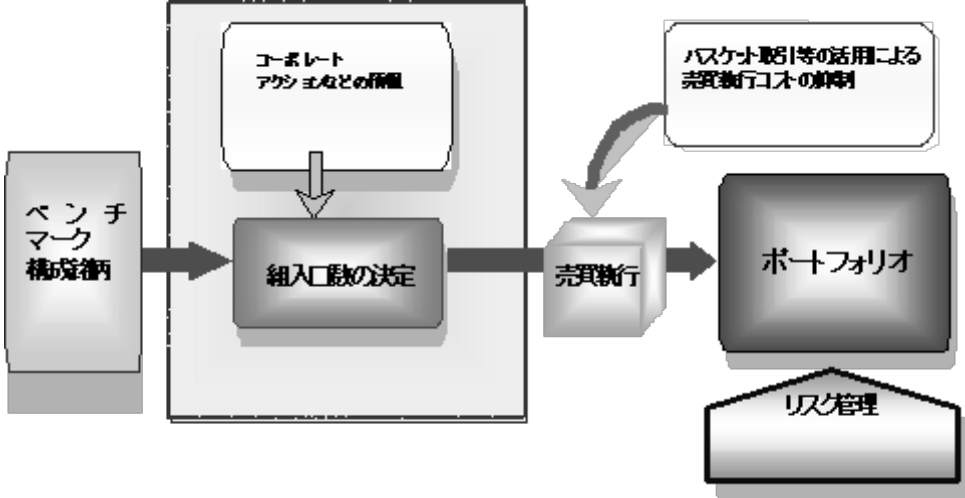
当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用を行います。当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

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

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

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

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

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

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。

投資態度	<p>1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</p> <p>Standard & Poor 's®並びに S&P®は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(以下「S&P」)の登録商標です。Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、DIAMアセットマネジメント株式会社に対しては特定の目的のために使用するサブライセンスが与えられています。S&P 先進国 REITインデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、DIAMアセットマネジメント株式会社に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ、S&P、およびその関連会社(以下総称してS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとする)は、DIAMアセットマネジメント株式会社の商品を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または商品に関する投資について、またS&P 先進国 REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追従する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスのDIAMアセットマネジメント株式会社に対するS&P 先進国 REITインデックスに関わる唯一の関係は、該当する指数、登録商標、サービスマーク、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの商号についての使用許諾を与えることです。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、DIAMアセットマネジメント株式会社又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくはDIAMアセットマネジメント株式会社が得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害（利益の損失、トレーディング損失、損失時間、のれんを含む）について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとDIAMアセットマネジメント株式会社間での合意及び協定において、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。</p>
------	--

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができます。
--------	---

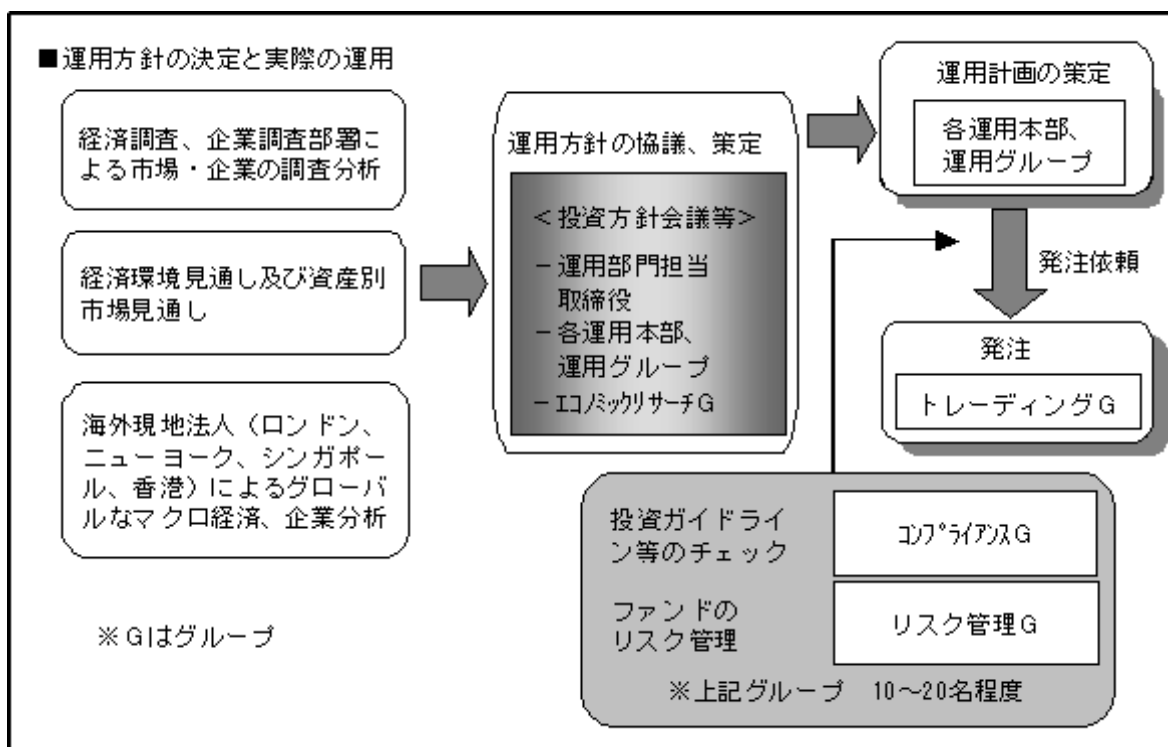
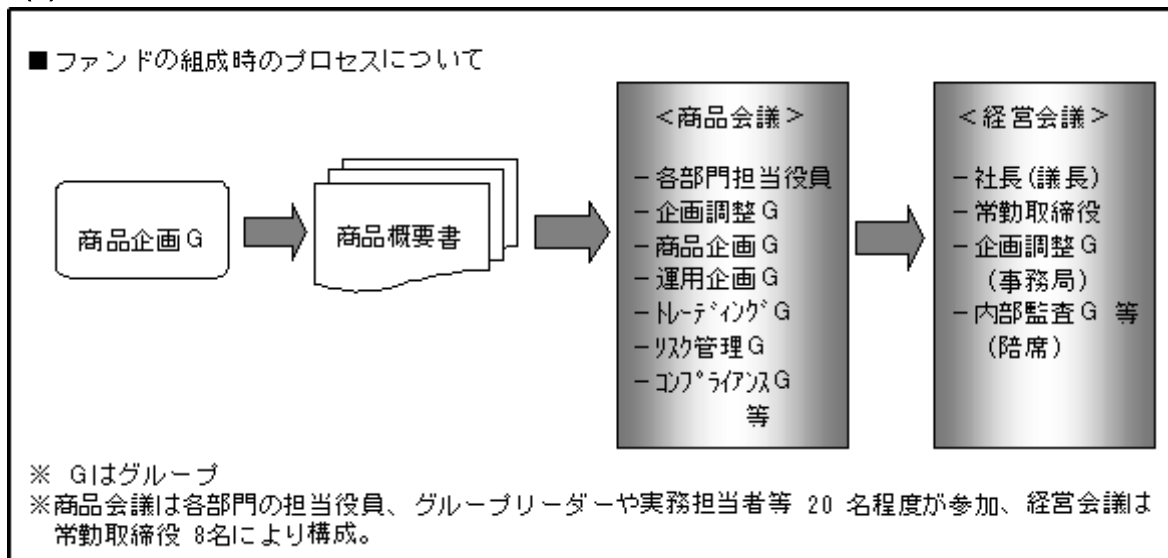
ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、当初組入時において、S & P もしくは M o o d y ' s の外貨建て長期格付が B B - 格もしくは B a 3 格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は J . P . モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、M S C I エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*) D R（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。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div data-bbox="363 331 1358 495" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>MSCIEマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。</p></div>
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3)【運用体制】



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

< ファンドの組成時のプロセスについて >

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

< 運用方針の決定と実際の運用 >

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

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

上記体制は平成25年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1)分配対象額の範囲

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

1)信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品賃料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかか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かか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かか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かか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)の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かかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(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。

収益分配金の支払い

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、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】

各マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。（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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

委託会社は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。以下同じ。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。（約款第17条第3項）

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）については制限を設けません。（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、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所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、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託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。

信用取引の指図および範囲（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せん。）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に資するため、および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に資するため、および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かか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かか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に資するため、および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かか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に資するため、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または受入れが必要と認めるときは、担保の提供また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に資するため、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、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または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受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）

- 1) 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の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

3)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

資産配分リスク

当ファンドの実質資産配分において、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合、基準価額が下がる場合があります。

当ファンドは短期金融債等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行います。当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追随できない場合があります。

株価変動リスク

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。

金利リスク

一般的に金利が上昇すると債券、リートの価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券、リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。

リートの価格変動リスク

当ファンドが実質的に投資対象とする不動産の価値および当該不動産による賃貸収入等の変動により基準価額が上下します。

為替リスク

当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない場合、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。

為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があります。その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られないことがあります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

信用リスク

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

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。

カントリーリスク

当ファンドの実質的な投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等によっては、運用上の制約を受ける可能性があり、基準価額が下がる要因となります。

< 分配金に関する留意点 >

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

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

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

< その他の留意点 >

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

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

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

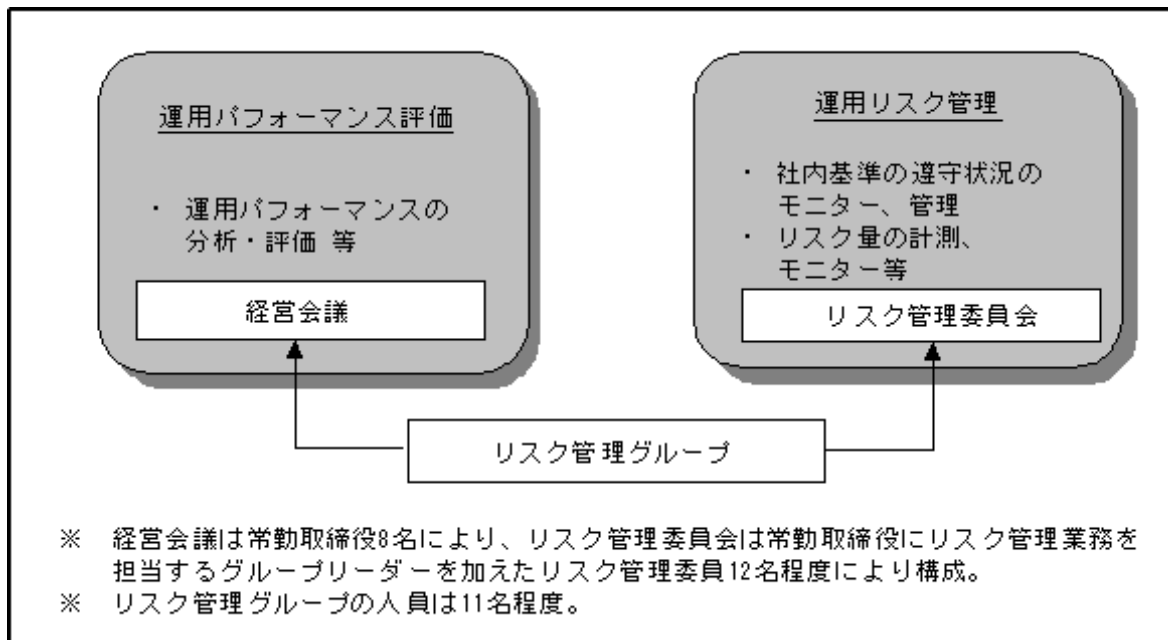
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである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発生した場合は、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、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券（リート）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25年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.15%^{*}（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

^{*}消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.470%^{*}（税抜1.40%）

^{*}消費税率が8%になった場合は、年率1.512%となります。

信託報酬の配分（税抜）	
委託会社	年率0.65%
販売会社	年率0.70%
受託会社	年率0.05%

信託報酬は、日々の基準価額に反映され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、受益者の負担とし、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中から支弁します。

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

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額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。

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

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

平成25年12月31日までの間は、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、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）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。

上記10.147%の税率は平成26年1月1日以降、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%）となる予定です。

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

平成25年12月31日までの間は、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、10.147%（所得税7.147%（復興特別所得税を含みます。）および地方税3%）の税率での申告分離

課税が適用されます。また特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、10.147%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。

上記10.147%の税率は平成26年1月1日以降、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%）となる予定です。

買取請求による換金の際の課税については、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開くなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

平成25年12月31日までの間は、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、7.147%（所得税7.147%（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。

上記7.147%の税率は平成26年1月1日以降、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））となる予定です。

買取請求による換金の際の課税については、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成25年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更になることがあります。

税金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、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別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25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	44,768,761	87.02
内 日本	44,768,761	87.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,675,803	12.98
純資産総額	51,444,564	100.00

その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	6,325,579	12.30
内 日本	6,325,579	12.30

（参考）マザーファンドの投資状況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	300,873,396,304	94.88
内 日本	300,873,396,304	94.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	16,250,071,151	5.12
純資産総額	317,123,467,455	100.00

その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	15,070,445,000	4.75
内 日本	15,070,445,000	4.75

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	354,066,140,800	78.96
内 日本	354,066,140,800	78.96
地方債証券	30,126,460,004	6.72
内 日本	30,126,460,004	6.72
特殊債券	31,767,663,692	7.08
内 日本	31,767,663,692	7.08
社債券	30,308,601,400	6.76
内 日本	30,308,601,400	6.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,122,157,574	0.47
純資産総額	448,391,023,470	100.00

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	10,658,997,500	98.59
内 日本	10,658,997,500	98.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	152,811,400	1.41
純資産総額	10,811,808,900	100.00

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	298,741,681,825	95.92
内 アメリカ	178,854,858,016	57.42
内 ユーロ	39,530,973,730	12.69
内 イギリス	29,705,301,145	9.54
内 カナダ	14,111,868,809	4.53
内 スイス	12,453,627,262	4.00
内 オーストラリア	9,993,943,730	3.21
内 スウェーデン	4,476,858,455	1.44
内 香港	4,009,859,989	1.29
内 シンガポール	2,081,682,482	0.67
内 デンマーク	1,588,310,247	0.51
内 ノルウェー	1,149,601,375	0.37
内 イスラエル	653,590,346	0.21
内 ニュージーランド	131,206,239	0.04
投資信託受益証券	998,838,027	0.32
内 オーストラリア	876,896,665	0.28
内 シンガポール	121,941,362	0.04
投資証券	5,634,153,694	1.81
内 アメリカ	4,635,950,649	1.49
内 ユーロ	387,578,225	0.12
内 イギリス	357,860,686	0.11
内 香港	136,038,100	0.04
内 カナダ	116,726,034	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,083,911,092	1.95
純資産総額	311,458,584,638	100.00

その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	365,555,000	0.12
内 日本	365,555,000	0.12
為替予約取引（売建）	78,927,000	0.03
内 日本	78,927,000	0.03

株価指数先物取引（買建）		5,902,699,839	1.90
内 アメリカ		3,635,178,272	1.17
内 ユーロ		1,152,608,440	0.37
内 イギリス		565,495,829	0.18
内 オーストラリア		288,190,402	0.09
内 カナダ		261,226,896	0.08

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券		3,778,967,884	13.82
内 オーストラリア		2,779,985,837	10.16
内 シンガポール		998,982,047	3.65
投資証券		23,431,568,930	85.67
内 アメリカ		18,501,968,665	67.65
内 ユーロ		1,913,356,537	7.00
内 イギリス		1,627,793,627	5.95
内 カナダ		735,808,053	2.69
内 香港		556,025,740	2.03
内 ニュージーランド		91,106,648	0.33
内 イスラエル		5,509,660	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		138,963,397	0.51
純資産総額		27,349,500,211	100.00

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		168,865,249,129	96.99
内 ユーロ		72,935,516,379	41.89
内 アメリカ		68,741,805,832	39.48
内 イギリス		12,532,158,931	7.20
内 カナダ		4,309,395,072	2.48
内 オーストラリア		2,390,552,423	1.37
内 メキシコ		1,726,142,730	0.99
内 デンマーク		1,412,310,523	0.81
内 ポーランド		1,274,068,181	0.73
内 スウェーデン		902,162,196	0.52
内 南アフリカ		872,125,800	0.50
内 マレーシア		655,232,183	0.38
内 シンガポール		616,538,593	0.35
内 ノルウェー		497,240,286	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,233,007,486	3.01
純資産総額		174,098,256,615	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	170,803,325,755	98.11
内 日本	170,803,325,755	98.11

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	35,736,886,302	95.11
内 香港	6,740,909,471	17.94
内 韓国	5,438,769,374	14.47
内 台湾	4,240,470,153	11.29
内 ブラジル	3,973,429,780	10.57
内 アメリカ	3,730,613,036	9.93
内 南アフリカ	2,642,495,185	7.03
内 インド	2,023,849,370	5.39
内 メキシコ	1,626,874,326	4.33
内 マレーシア	1,417,349,786	3.77
内 インドネシア	1,062,946,478	2.83
内 タイ	977,813,833	2.60
内 トルコ	667,078,598	1.78
内 ポーランド	593,900,359	1.58
内 フィリピン	393,289,206	1.05
内 チェコ	95,769,602	0.25
内 ハンガリー	78,723,934	0.21
内 モロッコ	32,603,811	0.09
投資信託受益証券	327,193,231	0.87
内 メキシコ	327,193,231	0.87
投資証券	55,473,722	0.15
内 メキシコ	45,261,740	0.12
内 トルコ	10,211,982	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,454,538,565	3.87
純資産総額	37,574,091,820	100.00

その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	409,659,344	1.09
内 日本	409,659,344	1.09
為替予約取引（売建）	499,490,000	1.33
内 日本	499,490,000	1.33
株価指数先物取引（買建）	1,437,690,968	3.83
内 アメリカ	1,437,690,968	3.83

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	33,066,591,981	95.44
内 アメリカ	33,066,591,981	95.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,578,649,474	4.56
純資産総額	34,645,241,455	100.00

その他資産の投資状況

平成25年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	332,653,440	0.96
内 日本	332,653,440	0.96

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 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	国内債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	15,508,477	1.1679 18,112,367	1.1700 18,144,918	- -	35.27%
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	10,414,339	1.1904 12,398,270	1.1940 12,434,720	- -	24.17%
3	外国株式パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,565,274	1.9484 4,998,427	1.9650 5,040,763	- -	9.80%
4	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,574,810	1.6465 4,239,616	1.5622 4,022,368	- -	7.82%
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,107,019	1.3385 2,820,429	1.3410 2,825,512	- -	5.49%
6	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,020,519	1.2126 1,237,491	1.1574 1,181,148	- -	2.30%
7	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	999,641	0.8146 814,342	0.8293 829,002	- -	1.61%
8	外国リート・パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	371,647	0.7860 292,115	0.7812 290,330	- -	0.56%

(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25年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	87.02%
合計	87.02%

(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。

【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】

平成25年7月31日現在

種類	地域	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	日本	ユーロ売/円買2013年10月	売建	13,000	1,694,262	1,690,390	3.29%
		イギリス・ポンド売/円買2013年10月	売建	8,500	1,276,201	1,269,220	2.47%
		カナダ・ドル売/円買2013年10月	売建	13,300	1,268,082	1,263,367	2.46%
		オーストラリア・ドル売/円買2013年10月	売建	14,300	1,298,142	1,259,544	2.45%
		アメリカ・ドル売/円買2013年10月	売建	8,600	851,581	843,058	1.64%

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

(注2) 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。

（参考）マザーファンドの投資資産

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,461,500	4,815.00 11,852,122,500	5,970.00 14,695,155,000	- -	4.63%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	14,319,800	538.00 7,704,052,400	601.00 8,606,199,800	- -	2.71%
3	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,430,200	3,790.00 5,420,458,000	4,485.00 6,414,447,000	- -	2.02%
4	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,616,300	3,580.00 5,786,354,000	3,630.00 5,867,169,000	- -	1.85%
5	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	915,900	3,478.23 3,185,714,640	6,240.00 5,715,216,000	- -	1.80%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	24,460,900	209.00 5,112,363,073	203.00 4,965,562,700	- -	1.57%
7	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,192,900	3,026.02 3,609,743,362	3,425.00 4,085,682,500	- -	1.29%
8	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	796,100	4,050.00 3,224,205,000	4,935.00 3,928,753,500	- -	1.24%
9	キヤノン 日本	株式 電気機器	1,110,800	3,310.00 3,676,748,000	3,025.00 3,360,170,000	- -	1.06%
10	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,323,000	2,143.00 2,835,189,000	2,491.00 3,295,593,000	- -	1.04%
11	武田薬品 日本	株式 医薬品	751,600	4,700.00 3,532,520,000	4,375.00 3,288,250,000	- -	1.04%
12	日立 日本	株式 電気機器	4,600,000	536.48 2,467,814,409	658.00 3,026,800,000	- -	0.95%
13	ファナック 日本	株式 電気機器	199,500	14,790.00 2,950,605,000	14,860.00 2,964,570,000	- -	0.93%
14	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	791,000	2,817.00 2,228,247,000	3,700.00 2,926,700,000	- -	0.92%
15	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	3,866,200	531.00 2,052,952,200	747.00 2,888,051,400	- -	0.91%
16	KDDI 日本	株式 情報・通信業	533,700	3,420.00 1,825,254,000	5,410.00 2,887,317,000	- -	0.91%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	353,400	6,440.00 2,275,896,000	7,890.00 2,788,326,000	- -	0.88%

18	三井不動産 日本	株式 不動産業	891,000	2,095.00 1,866,645,000	2,963.00 2,640,033,000	- -	0.83%
19	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,475,400	1,953.00 2,881,456,200	1,789.00 2,639,490,600	- -	0.83%
20	ソニー 日本	株式 電気機器	1,204,100	1,519.00 1,829,027,900	2,068.00 2,490,078,800	- -	0.79%
21	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,420,100	993.00 2,403,159,300	1,027.00 2,485,442,700	- -	0.78%
22	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	8,480,000	273.00 2,315,040,000	285.00 2,416,800,000	- -	0.76%
23	エヌ・ティ・ ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	15,583	136,900.00 2,133,312,700	149,500.00 2,329,658,500	- -	0.73%
24	東京海上HD 日本	株式 保険業	732,400	2,713.00 1,987,001,200	3,135.00 2,296,074,000	- -	0.72%
25	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	435,000	4,750.00 2,066,250,000	5,250.00 2,283,750,000	- -	0.72%
26	信越化学 日本	株式 化学	359,900	5,590.00 2,011,841,000	6,120.00 2,202,588,000	- -	0.69%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	628,800	2,473.00 1,555,022,400	3,480.00 2,188,224,000	- -	0.69%
28	三井物産 日本	株式 卸売業	1,632,000	1,406.00 2,294,592,000	1,315.00 2,146,080,000	- -	0.68%
29	デンソー 日本	株式 輸送用機器	473,300	3,700.00 1,751,210,000	4,460.00 2,110,918,000	- -	0.67%
30	小松製作所 日本	株式 機械	935,700	2,458.00 2,299,950,600	2,188.00 2,047,311,600	- -	0.65%

（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25年7月31日現在

種類	投資比率
株式	94.88%
合計	94.88%

（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25年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
輸送用機器	国内	11.38%
電気機器		10.80%
銀行業		9.72%
情報・通信業		6.57%
化学		5.14%
機械		4.76%
卸売業		4.30%

小売業	4.19%
医薬品	4.19%
陸運業	3.82%
食料品	3.79%
不動産業	3.33%
電気・ガス業	2.46%
建設業	2.35%
保険業	2.28%
サービス業	2.02%
証券、商品先物取引業	1.76%
鉄鋼	1.66%
その他製品	1.30%
精密機器	1.27%
その他金融業	1.22%
非鉄金属	0.95%
ゴム製品	0.92%
ガラス・土石製品	0.87%
繊維製品	0.70%
金属製品	0.63%
石油・石炭製品	0.62%
空運業	0.60%
鉱業	0.43%
海運業	0.32%
パルプ・紙	0.25%
倉庫・運輸関連業	0.22%
水産・農林業	0.07%
合計	94.88%

（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

平成25年7月31日現在

種類	地域	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX 先物 2509月	買建	1,339	15,142,521,731	15,070,445,000	4.75%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 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	3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	6,500,000,000	98.83 6,424,005,000	98.34 6,392,295,000	0.600000 2023/3/20	1.43%
2	3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	6,000,000,000	100.85 6,051,140,000	100.47 6,028,200,000	0.800000 2022/9/20	1.34%
3	3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	6,000,000,000	100.28 6,017,040,000	99.43 5,965,800,000	0.700000 2022/12/20	1.33%
4	3 2 6 回 利付国庫債券 (2 年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.06 5,503,660,000	99.98 5,499,065,000	0.100000 2015/3/15	1.23%
5	1 0 5 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.32 5,517,765,000	99.96 5,497,855,000	0.200000 2017/6/20	1.23%
6	9 7 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.99 5,049,930,000	100.76 5,038,000,000	0.400000 2016/6/20	1.12%
7	1 0 6 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.29 5,014,680,000	99.87 4,993,850,000	0.200000 2017/9/20	1.11%
8	1 0 7 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.33 5,016,905,000	99.80 4,990,200,000	0.200000 2017/12/20	1.11%
9	3 1 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	106.11 4,775,108,000	105.10 4,729,815,000	1.300000 2021/3/20	1.05%
10	3 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	102.69 4,621,170,000	102.48 4,611,735,000	1.000000 2022/3/20	1.03%
11	3 0 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	4,300,000,000	106.74 4,589,820,000	106.18 4,565,912,000	1.400000 2020/3/20	1.02%
12	1 0 3 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.61 4,527,875,000	100.39 4,517,820,000	0.300000 2017/3/20	1.01%
13	2 9 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	4,200,000,000	108.42 4,553,894,000	107.34 4,508,532,000	1.800000 2018/6/20	1.01%
14	8 9 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.82 4,335,561,000	100.53 4,323,005,000	0.400000 2015/6/20	0.96%

15	296回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	107.01 4,280,695,000	106.17 4,247,000,000	1.500000 2018/9/20	0.95%
16	297回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.53 4,261,405,000	105.85 4,234,200,000	1.400000 2018/12/20	0.94%
17	289回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	106.53 4,154,748,000	105.46 4,113,135,000	1.500000 2017/12/20	0.92%
18	92回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.65 4,026,320,000	100.39 4,015,720,000	0.300000 2015/9/20	0.90%
19	310回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	103.76 3,943,184,000	103.23 3,922,740,000	1.000000 2020/9/20	0.87%
20	312回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,700,000,000	105.15 3,890,883,000	104.46 3,865,131,000	1.200000 2020/12/20	0.86%
21	301回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	107.42 3,867,300,000	106.68 3,840,804,000	1.500000 2019/6/20	0.86%
22	87回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	3,800,000,000	100.83 3,831,692,000	100.53 3,820,444,000	0.500000 2014/12/20	0.85%
23	288回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	107.15 3,857,652,000	106.04 3,817,476,000	1.700000 2017/9/20	0.85%
24	305回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	105.74 3,806,664,000	105.56 3,800,484,000	1.300000 2019/12/20	0.85%
25	315回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	104.92 3,672,480,000	104.31 3,651,165,000	1.200000 2021/6/20	0.81%
26	282回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	105.79 3,596,962,000	104.83 3,564,390,000	1.700000 2016/9/20	0.79%
27	93回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	101.28 3,545,080,000	100.90 3,531,605,000	0.500000 2015/12/20	0.79%
28	88回 利付国庫債券(5 年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.94 3,533,110,000	100.62 3,521,910,000	0.500000 2015/3/20	0.79%
29	102回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.76 3,526,740,000	100.43 3,515,295,000	0.300000 2016/12/20	0.78%
30	285回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	106.48 3,513,939,000	105.46 3,480,246,000	1.700000 2017/3/20	0.78%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	78.96%
地方債証券	6.72%
特殊債券	7.08%
社債券	6.76%
合計	99.53%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	1,203	1,008,666.48 1,213,425,785	1,067,000.00 1,283,601,000	- -	11.87%
2	ジャパンリアルエステイト投資 法人 日本	投資証券	1,033	979,349.08 1,011,667,602	1,036,000.00 1,070,188,000	- -	9.90%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	3,616	181,431.58 656,056,622	193,000.00 697,888,000	- -	6.45%
4	ユナイテッド・アーバン投資法 人 日本	投資証券	4,123	123,083.25 507,472,259	121,800.00 502,181,400	- -	4.64%
5	アドバンス・レジデンス投資法 人 日本	投資証券	2,157	201,802.39 435,287,766	198,100.00 427,301,700	- -	3.95%
6	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	485	822,037.62 398,688,246	850,000.00 412,250,000	- -	3.81%
7	日本プライムリアルティ投資法 人 日本	投資証券	1,435	285,042.02 409,035,299	268,300.00 385,010,500	- -	3.56%
8	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	431	877,997.21 378,416,800	833,000.00 359,023,000	- -	3.32%
9	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	421	761,122.31 320,432,495	841,000.00 354,061,000	- -	3.27%
10	G L P 投資法人 日本	投資証券	3,196	89,721.77 286,750,780	96,000.00 306,816,000	- -	2.84%
11	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	2,767	103,035.26 285,098,573	109,500.00 302,986,500	- -	2.80%
12	野村不動産マスターファンド投 資法人 日本	投資証券	2,896	98,981.90 286,651,604	97,100.00 281,201,600	- -	2.60%
13	野村不動産オフィスファンド投 資法人 日本	投資証券	640	482,565.84 308,842,139	428,500.00 274,240,000	- -	2.54%
14	日本アコモデーションファンド 投資法人 日本	投資証券	401	609,320.87 244,337,670	644,000.00 258,244,000	- -	2.39%
15	アクティブ・プロパティーズ 投資法人 日本	投資証券	357	699,714.83 249,798,196	701,000.00 250,257,000	- -	2.31%
16	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	688	345,084.63 237,418,231	359,000.00 246,992,000	- -	2.28%

17	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	443	558,970.54 247,623,953	548,000.00 242,764,000	- -	2.25%
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	272	863,357.13 234,833,141	877,000.00 238,544,000	- -	2.21%
19	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	612	366,025.39 224,007,543	379,000.00 231,948,000	- -	2.15%
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	257	871,968.68 224,095,953	870,000.00 223,590,000	- -	2.07%
21	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	391	546,548.02 213,700,276	521,000.00 203,711,000	- -	1.88%
22	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券	498	365,469.19 182,003,659	390,000.00 194,220,000	- -	1.80%
23	福岡リート投資法人 日本	投資証券	240	728,943.31 174,946,395	745,000.00 178,800,000	- -	1.65%
24	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	4,559	34,821.75 158,752,377	37,750.00 172,102,250	- -	1.59%
25	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	2,314	65,960.41 152,632,389	66,800.00 154,575,200	- -	1.43%
26	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	295	522,466.81 154,127,710	510,000.00 150,450,000	- -	1.39%
27	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	213	684,870.16 145,877,345	672,000.00 143,136,000	- -	1.32%
28	プレミア投資法人 日本	投資証券	342	356,107.04 121,788,610	378,500.00 129,447,000	- -	1.20%
29	野村不動産レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	262	485,848.85 127,292,401	489,500.00 128,249,000	- -	1.19%
30	積水ハウス・S I 投資法人 日本	投資証券	278	444,678.93 123,620,743	449,500.00 124,961,000	- -	1.16%

(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25年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	98.59%
合計	98.59%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	110,566	45,615.44 5,043,517,638	44,461.62 4,915,944,096	- -	1.58%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	528,488	8,684.84 4,589,836,745	9,200.88 4,862,557,206	- -	1.56%
3	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	329,987	7,456.49 2,460,547,543	9,138.11 3,015,458,692	- -	0.97%
4	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	1,222,206	2,295.74 2,805,876,476	2,400.99 2,934,514,650	- -	0.94%
5	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	937,132	2,786.98 2,611,771,092	3,123.84 2,927,457,923	- -	0.94%
6	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	228,955	11,354.27 2,599,617,701	12,336.50 2,824,503,906	- -	0.91%
7	GOOGLE INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	31,479	77,448.57 2,438,003,787	87,381.43 2,750,680,148	- -	0.88%
8	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	320,866	7,532.06 2,416,783,400	7,889.55 2,531,490,018	- -	0.81%
9	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	590,524	3,466.38 2,046,981,912	4,242.94 2,505,558,372	- -	0.80%
10	NESTLE SA- REGISTERED スイス	株式 食品	380,693	6,642.96 2,528,930,779	6,542.85 2,490,821,001	- -	0.80%
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	450,646	4,834.71 2,178,745,142	5,426.76 2,445,550,571	- -	0.79%
12	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	2,177,728	1,081.25 2,354,671,160	1,100.39 2,396,367,839	- -	0.77%
13	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	124,490	19,570.49 2,436,330,631	19,224.66 2,393,278,022	- -	0.77%
14	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	784,580	2,654.04 2,082,310,469	2,910.03 2,283,154,161	- -	0.73%
15	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	644,019	3,461.32 2,229,159,339	3,473.99 2,237,317,884	- -	0.72%
16	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	82,923	21,711.41 1,800,375,594	24,430.19 2,025,825,059	- -	0.65%

17	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	271,696	6,674.86 1,813,535,458	6,991.36 1,899,525,225	- -	0.61%
18	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	472,093	3,622.86 1,710,329,217	3,954.58 1,866,932,179	- -	0.60%
19	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融サービス	356,566	4,362.80 1,555,629,606	5,078.58 1,810,849,812	- -	0.58%
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融サービス	1,270,991	1,191.20 1,514,015,593	1,424.12 1,810,045,736	- -	0.58%
21	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	193,987	8,822.00 1,711,355,240	8,745.79 1,696,570,263	- -	0.54%
22	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	355,814	4,051.79 1,441,684,684	4,712.74 1,676,860,293	- -	0.54%
23	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サービス	5,742,174	250.82 1,440,269,983	291.61 1,674,509,640	- -	0.54%
24	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	334,764	4,361.63 1,460,118,510	4,945.19 1,655,472,790	- -	0.53%
25	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	626,082	2,066.54 1,293,827,286	2,517.71 1,576,295,166	- -	0.51%
26	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,256,831	672.76 1,518,322,313	674.70 1,522,700,981	- -	0.49%
27	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	182,162	7,110.25 1,295,217,752	8,347.58 1,520,613,470	- -	0.49%
28	WAL-MART STORES INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	198,081	6,956.53 1,377,958,033	7,639.45 1,513,230,133	- -	0.49%
29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	452,767	3,172.26 1,436,297,174	3,306.27 1,496,972,846	- -	0.48%
30	SANOFI ユーロ	株式 医薬品	140,101	9,387.30 1,315,171,268	10,414.40 1,459,068,414	- -	0.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.92%
投資信託受益証券	0.32%
投資証券	1.81%
合計	98.05%

(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25年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
石油・ガス・消耗燃料	外国	8.90%
商業銀行		7.62%
医薬品		6.77%
保険		4.63%
メディア		2.87%
各種金融サービス		2.76%
化学		2.75%
各種電気通信サービス		2.70%
食品		2.68%
ソフトウェア		2.35%
飲料		2.33%
食品・生活必需品小売り		2.29%
コンピュータ・周辺機器		2.28%
情報技術サービス		2.22%
資本市場		2.19%
金属・鉱業		2.08%
航空宇宙・防衛		2.01%
コングロマリット		1.98%
専門小売り		1.69%
ホテル・レストラン・レジャー		1.66%
機械		1.66%
インターネットソフトウェア・サービス		1.63%
電力		1.62%
家庭用品		1.60%
バイオテクノロジー		1.59%
ヘルスケア機器・用品		1.48%
エネルギー設備・サービス		1.46%
タバコ		1.46%
半導体・半導体製造装置		1.46%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.42%
総合公益事業		1.35%
通信機器		1.28%
繊維・アパレル・贅沢品		1.22%
自動車		1.05%
陸運・鉄道		0.90%
電気設備		0.87%
無線通信サービス		0.79%
インターネット販売・カタログ販売		0.72%
不動産管理・開発		0.62%
複合小売り		0.62%
消費者金融		0.57%
航空貨物・物流サービス		0.53%

自動車部品	0.53%
商業サービス・用品	0.47%
専門サービス	0.46%
建設・土木	0.35%
電子装置・機器・部品	0.34%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.33%
パーソナル用品	0.31%
建設資材	0.29%
商社・流通業	0.28%
家庭用耐久財	0.26%
建設関連製品	0.20%
容器・包装	0.19%
ガス	0.19%
運送インフラ	0.16%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12%
紙製品・林産品	0.12%
旅客航空輸送業	0.11%
レジャー用品	0.10%
販売	0.09%
水道	0.08%
海運業	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.06%
事務用電子機器	0.04%
各種消費者サービス	0.03%
合計	95.92%

（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

平成25年7月31日現在

種類	地域	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	日本	アメリカ・ドル買/円売2013年08月	買建	2,100,000	205,945,950	205,947,000	0.07%
		ユーロ買/円売2013年08月	買建	600,000	77,999,880	78,024,000	0.03%
		イギリス・ポンド買/円売2013年08月	買建	300,000	45,124,950	44,838,000	0.01%
		カナダ・ドル買/円売2013年08月	買建	200,000	19,115,000	19,038,000	0.01%
		オーストラリア・ドル買/円売2013年08月	買建	200,000	18,047,500	17,708,000	0.01%
		アメリカ・ドル売/円買2013年08月	売建	500,000	49,039,250	49,035,000	0.02%

		イギリス・ポンド売/円買20 13年08月	売建	200,000	29,893,200	29,892,000	0.01%
株価指数 先物取引	アメリカ	S&P 500 FUTUR E Sep13	買建	88	3,558,825,444	3,635,178,272	1.17%
	ユーロ	DJ EURO STOXX 50 Sep13	買建	321	1,124,085,874	1,152,608,440	0.37%
	イギリス	FTSE 100 INDE X FUTURE Sep13	買建	58	552,493,434	565,495,829	0.18%
	オースト ラリア	SPI 200 FUTURE S Sep13	買建	26	279,658,610	288,190,402	0.09%
	カナダ	S&P/TSE 60 IX FUT Sep13	買建	19	257,317,984	261,226,896	0.08%

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	113,543	15,366.29 1,744,735,098	15,861.49 1,800,962,021	- -	6.58%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE ユーロ	投資証券	34,893	21,929.31 765,179,639	23,883.68 833,373,333	- -	3.05%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	52,785	14,694.81 775,665,710	15,647.68 825,962,957	- -	3.02%
4	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	737,963	987.68 728,873,827	1,006.81 742,991,110	- -	2.72%
5	HCP INC アメリカ	投資証券	166,166	4,246.21 705,577,385	4,381.23 728,012,062	- -	2.66%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	107,185	6,437.08 689,959,172	6,652.76 713,076,766	- -	2.61%
7	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	182,153	3,570.31 650,343,454	3,815.31 694,970,526	- -	2.54%
8	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	103,986	6,224.59 647,270,499	6,432.08 668,846,936	- -	2.45%
9	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	117,184	5,380.60 630,520,394	5,655.29 662,709,831	- -	2.42%
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	44,458	12,933.90 575,015,686	13,461.47 598,470,477	- -	2.19%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	55,470	10,008.28 555,159,612	10,663.25 591,490,899	- -	2.16%
12	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	62,179	7,694.11 478,412,675	8,450.57 525,448,166	- -	1.92%
13	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	272,185	1,588.58 432,387,859	1,767.40 481,060,204	- -	1.76%
14	LINK REIT/THE 香港	投資証券	837,523	475.56 398,298,786	480.69 402,597,306	- -	1.47%
15	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	285,077	1,304.81 371,972,651	1,410.24 402,029,681	- -	1.47%
16	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	164,645	1,913.62 315,068,149	2,102.83 346,221,301	- -	1.27%
17	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	149,324	2,045.04 305,374,980	2,196.99 328,063,633	- -	1.20%
18	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	364,178	853.82 310,942,843	889.34 323,880,429	- -	1.18%

19	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	50,227	5,742.84 288,445,627	6,229.06 312,867,036	- -	1.14%
20	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	71,681	4,009.92 287,435,477	4,335.13 310,746,883	- -	1.14%
21	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資信託受益証券	1,115,648	258.24 288,114,325	270.96 302,299,329	- -	1.11%
22	SL GREEN アメリカ	投資証券	33,459	8,363.50 279,834,571	8,945.87 299,320,091	- -	1.09%
23	STOCKLAND オーストラリア	投資信託受益証券	842,079	315.43 265,618,019	324.97 273,657,570	- -	1.00%
24	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	46,902	5,727.35 268,624,580	5,564.07 260,966,405	- -	0.95%
25	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	23,822	9,549.88 227,497,359	10,413.15 248,062,145	- -	0.91%
26	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	552,216	417.87 230,756,651	418.84 231,290,977	- -	0.85%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	91,539	2,352.07 215,306,314	2,501.03 228,942,700	- -	0.84%
28	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	13,871	14,986.90 207,883,396	16,090.02 223,184,722	- -	0.82%
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	30,970	6,419.54 198,813,184	7,025.47 217,578,818	- -	0.80%
30	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	260,165	727.43 189,253,328	782.47 203,572,724	- -	0.74%

（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25年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	13.82%
投資証券	85.67%
合計	99.49%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 0.25 05/15/15 アメリカ	国債証券	1,814,480,000	99.82 1,811,285,044	99.99 1,814,407,420	0.250000 2015/5/15	1.04%
2	US T N/B 0.375 03/15/15 アメリカ	国債証券	1,765,440,000	100.06 1,766,605,190	100.19 1,768,953,225	0.375000 2015/3/15	1.02%
3	US T N/B 0.375 01/15/16 アメリカ	国債証券	1,520,240,000	99.51 1,512,866,836	99.82 1,517,564,377	0.375000 2016/1/15	0.87%
4	US T N/B 4.25 11/15/14 アメリカ	国債証券	1,343,696,000	105.54 1,418,163,632	105.24 1,414,132,544	4.250000 2014/11/15	0.81%
5	US T N/B 2.625 06/30/14 アメリカ	国債証券	1,275,040,000	102.49 1,306,864,998	102.27 1,304,072,660	2.625000 2014/6/30	0.75%
6	US T N/B 0.375 06/15/15 アメリカ	国債証券	1,275,040,000	99.98 1,274,784,992	100.16 1,277,080,064	0.375000 2015/6/15	0.73%
7	US T N/B 4.25 08/15/15 アメリカ	国債証券	1,176,960,000	108.14 1,272,858,700	107.97 1,270,787,251	4.250000 2015/8/15	0.73%
8	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,137,728,000	111.35 1,266,917,014	111.15 1,264,652,935	3.625000 2020/2/15	0.73%
9	US T N/B 2.125 11/30/14 アメリカ	国債証券	1,176,960,000	102.66 1,208,349,523	102.58 1,207,384,416	2.125000 2014/11/30	0.69%
10	US T N/B 4.5 02/15/16 アメリカ	国債証券	1,078,880,000	110.18 1,188,742,350	110.16 1,188,569,729	4.500000 2016/2/15	0.68%
11	US T N/B 0.875 01/31/18 アメリカ	国債証券	1,206,384,000	97.99 1,182,159,809	98.42 1,187,335,196	0.875000 2018/1/31	0.68%
12	FRANCE OAT 3.0 10/25/15 ユーロ	国債証券	1,092,420,000	105.91 1,157,030,400	106.01 1,158,074,442	3.000000 2015/10/25	0.67%
13	US T N/B 2.625 12/31/14 アメリカ	国債証券	1,078,880,000	103.54 1,117,137,084	103.43 1,115,917,950	2.625000 2014/12/31	0.64%
14	US T N/B 1.25 10/31/15 アメリカ	国債証券	1,078,880,000	101.74 1,097,717,244	101.95 1,099,993,681	1.250000 2015/10/31	0.63%

15	US T N/B 2.375 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,029,840,000	105.00 1,081,332,000	105.25 1,083,978,688	2.375000 2017/7/31	0.62%
16	US T N/B 3.5 02/15/18 アメリカ	国債証券	961,184,000	109.89 1,056,321,992	110.07 1,058,052,123	3.500000 2018/2/15	0.61%
17	US T N/B 1.375 11/30/15 アメリカ	国債証券	1,029,840,000	102.05 1,050,951,720	102.24 1,052,929,012	1.375000 2015/11/30	0.60%
18	FRANCE OAT 3.25 04/25/16 ユーロ	国債証券	975,375,000	107.38 1,047,377,182	107.63 1,049,835,127	3.250000 2016/4/25	0.60%
19	US T N/B 4.25 08/15/14 アメリカ	国債証券	980,800,000	104.63 1,026,269,888	104.26 1,022,591,888	4.250000 2014/8/15	0.59%
20	US T N/B 2.375 09/30/14 アメリカ	国債証券	980,800,000	102.75 1,007,801,424	102.57 1,006,045,792	2.375000 2014/9/30	0.58%
21	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15 ユーロ	国債証券	949,365,000	105.43 1,000,981,975	105.24 999,149,700	3.750000 2015/1/4	0.57%
22	DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17 ユーロ	国債証券	884,340,000	111.43 985,446,592	111.64 987,347,923	3.750000 2017/1/4	0.57%
23	US T N/B 0.25 09/15/14 アメリカ	国債証券	980,800,000	100.05 981,368,864	100.03 981,143,280	0.250000 2014/9/15	0.56%
24	US T N/B 2.0 04/30/16 アメリカ	国債証券	931,760,000	103.74 966,663,729	103.98 968,918,588	2.000000 2016/4/30	0.56%
25	FRANCE OAT 3.5 04/25/15 ユーロ	国債証券	910,350,000	105.71 962,330,985	105.56 960,965,460	3.500000 2015/4/25	0.55%
26	ITALY BTPS 4.25 02/01/15 ユーロ	国債証券	910,350,000	103.72 944,242,330	104.15 948,138,628	4.250000 2015/2/1	0.54%
27	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 ユーロ	国債証券	845,325,000	110.52 934,281,150	110.99 938,268,483	3.750000 2017/4/25	0.54%
28	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	980,800,000	95.98 941,374,292	95.28 934,516,048	2.000000 2023/2/15	0.54%
29	US T N/B 4.0 02/15/15 アメリカ	国債証券	882,720,000	106.01 935,850,916	105.78 933,820,660	4.000000 2015/2/15	0.54%
30	FRANCE OAT 4.25 10/25/17 ユーロ	国債証券	793,305,000	113.48 900,242,514	113.98 904,264,570	4.250000 2017/10/25	0.52%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.99%
合計	96.99%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年7月31日現在

種類	地域	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	日本	ユーロ売/円買2013年08月	売建	568,118,800	73,364,741,128	73,878,168,752	42.43%
		アメリカ・ドル売/円買2013年08月	売建	708,214,400	70,344,535,854	69,454,586,208	39.89%
		イギリス・ポンド売/円買2013年08月	売建	84,170,900	12,677,980,922	12,579,341,005	7.23%
		カナダ・ドル売/円買2013年08月	売建	45,704,600	4,299,879,627	4,350,163,828	2.50%
		オーストラリア・ドル売/円買2013年08月	売建	27,290,600	2,475,165,095	2,415,491,006	1.39%
		メキシコ・ペソ売/円買2013年08月	売建	228,207,400	1,735,255,617	1,752,632,832	1.01%
		デンマーク・クローネ売/円買2013年08月	売建	82,626,500	1,430,802,264	1,441,832,425	0.83%
		ポーランド・ズロチ売/円買2013年08月	売建	42,133,300	1,253,448,821	1,296,441,641	0.74%
		スウェーデン・クローナ売/円買2013年08月	売建	61,743,800	908,010,497	923,687,248	0.53%
		南アフリカ・ランド売/円買2013年08月	売建	92,121,600	917,376,216	920,294,784	0.53%
		マレーシア・リングギット売/円買2013年08月	売建	21,200,000	659,864,840	640,664,000	0.37%
		シンガポール・ドル売/円買2013年08月	売建	8,285,800	648,926,524	639,083,754	0.37%
ノルウェー・クローネ売/円買2013年08月	売建	30,947,200	502,826,015	510,938,272	0.29%		

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	11,421	131,624.52 1,503,283,736	113,520.00 1,296,511,920	- -	3.45%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,533,083	328.10 831,109,893	333.53 844,884,503	- -	2.25%
3	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	621,000	1,019.75 633,265,694	1,053.11 653,982,862	- -	1.74%
4	CHINA CONSTRUCTION BANK 香港	株式 商業銀行	7,349,530	75.90 557,831,946	72.73 534,586,438	- -	1.42%
5	TENCENT HOLDINGS LTD 香港	株式 インターネットソフト ウェア・サービス	105,300	3,195.29 336,464,811	4,599.54 484,331,562	- -	1.29%
6	IND & COMM BK OF CHINA - H 香港	株式 商業銀行	7,509,235	64.16 481,867,461	64.38 483,508,377	- -	1.29%
7	AO GAZPROM ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	606,315	739.68 448,481,891	769.92 466,818,895	- -	1.24%
8	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	3,922,678	94.95 372,477,198	101.66 398,786,506	- -	1.06%
9	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	40,539	5,845.75 236,981,047	8,300.00 336,473,700	- -	0.90%
10	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	15,859	17,045.97 270,332,150	20,900.00 331,453,100	- -	0.88%
11	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,815,000	169.39 307,455,005	178.61 324,191,670	- -	0.86%
12	SBERBANK ADR アメリカ	株式 商業銀行	287,203	1,167.66 335,357,557	1,118.11 321,125,120	- -	0.85%
13	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	254,880	1,315.31 335,247,765	1,255.58 320,023,096	- -	0.85%
14	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信サービス	172,868	1,629.41 281,674,026	1,828.89 316,158,285	- -	0.84%
15	BANK OF CHINA LTD 香港	株式 商業銀行	7,569,200	43.26 327,469,811	41.23 312,146,238	- -	0.83%

16	LUKOIL SPON ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	52,787	5,869.54 309,835,813	5,865.18 309,605,467	- -	0.82%
17	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	422,212	733.60 309,738,744	707.28 298,624,721	- -	0.79%
18	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,020,609	253.08 258,304,040	257.34 262,652,705	- -	0.70%
19	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	211,349	1,388.66 293,492,674	1,209.60 255,648,912	- -	0.68%
20	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	55,411	3,736.13 207,022,984	4,532.09 251,128,193	- -	0.67%
21	PETRO CHINA CO LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,144,000	116.75 250,325,056	116.63 250,061,152	- -	0.67%
22	CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS PREF ブラジル	株式 飲料	69,590	3,405.56 236,993,507	3,527.83 245,502,176	- -	0.65%
23	ECOPETROL SA SP ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	52,448	4,533.88 237,793,392	4,470.48 234,468,070	- -	0.62%
24	VALE SA-PREF A ブラジル	株式 金属・鉱業	189,196	1,310.26 247,896,393	1,218.62 230,559,770	- -	0.61%
25	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	318,010	662.96 210,829,716	665.60 211,669,141	- -	0.56%
26	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	149,627	1,293.87 193,598,574	1,316.79 197,028,160	- -	0.52%
27	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	6,650	28,059.70 186,597,027	28,644.00 190,482,600	- -	0.51%
28	BANCOLOMBIA SA SPONS ADR アメリカ	株式 商業銀行	33,113	6,239.90 206,622,068	5,736.69 189,959,320	- -	0.51%
29	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV メキシコ	投資信託受益証券 -	195,700	1,142.49 223,586,977	968.17 189,471,064	- -	0.50%
30	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,581,200	79.77 205,906,233	72.73 187,750,035	- -	0.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.11%

投資信託受益証券	0.87%
投資証券	0.15%
合計	96.13%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成25年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	17.93%
石油・ガス・消耗燃料		10.97%
半導体・半導体製造装置		7.65%
無線通信サービス		5.78%
金属・鉱業		4.74%
保険		3.00%
自動車		2.75%
化学		2.51%
食品・生活必需品小売り		2.44%
食品		2.38%
不動産管理・開発		1.99%
電子装置・機器・部品		1.94%
コングロマリット		1.88%
各種電気通信サービス		1.82%
各種金融サービス		1.74%
飲料		1.64%
インターネットソフトウェア・サービス		1.60%
メディア		1.56%
情報技術サービス		1.46%
電力		1.38%
コンピュータ・周辺機器		1.13%
建設資材		1.12%
医薬品		0.96%
運送インフラ		0.90%
建設・土木		0.89%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.88%
機械		0.86%
自動車部品		0.80%
タバコ		0.79%
複合小売り		0.76%
専門小売り		0.70%
資本市場		0.69%
ガス		0.62%
家庭用品		0.59%
パーソナル用品		0.56%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.55%

家庭用耐久財	0.52%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.50%
ホテル・レストラン・レジャー	0.47%
旅客航空輸送業	0.35%
商社・流通業	0.31%
紙製品・林産品	0.29%
エネルギー設備・サービス	0.29%
電気設備	0.24%
繊維・アパレル・贅沢品	0.23%
海運業	0.22%
航空宇宙・防衛	0.19%
水道	0.18%
容器・包装	0.16%
販売	0.14%
消費者金融	0.14%
通信機器	0.14%
各種消費者サービス	0.13%
ソフトウェア	0.12%
総合公益事業	0.12%
陸運・鉄道	0.10%
レジャー用品	0.10%
商業サービス・用品	0.10%
航空貨物・物流サービス	0.06%
建設関連製品	0.06%
ヘルスケア機器・用品	0.04%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.01%
合計	95.11%

(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

平成25年7月31日現在

種類	地域	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	日本	アメリカ・ドル買/円売 2013年08月	買建	4,177,213	412,020,000	409,659,344	1.09%
		韓国・ウォン売/円買 2013年08月	売建	2,000,000,000	176,600,000	176,000,000	0.47%
		台湾・ドル売/円買 2013年08月	売建	49,000,000	160,720,000	160,230,000	0.43%
		南アフリカ・ランド売/円買 2013年08月	売建	9,000,000	91,803,600	89,910,000	0.24%
		インド・ルピー売/円買 2013年08月	売建	45,000,000	74,700,000	73,350,000	0.20%

株価指数 先物取引	アメリカ	MINI MSCI EM G MKT Sep 13	買建	310	1,425,531,009	1,437,690,968	3.83%
--------------	------	------------------------------	----	-----	---------------	---------------	-------

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

平成25年7月31日現在

順位	銘柄名 地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 アメリカ	国債証券	1,929,037,440	124.55 2,402,748,533	117.89 2,274,335,141	7.500000 2030/3/31	6.56%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 アメリカ	国債証券	500,208,000	144.07 720,674,676	138.06 690,612,175	11.000000 2018/7/24	1.99%
3	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 アメリカ	国債証券	529,632,000	131.14 694,568,232	110.00 582,595,200	6.050000 2040/1/11	1.68%
4	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 アメリカ	国債証券	529,632,000	115.55 612,019,200	109.09 577,802,030	5.000000 2020/4/29	1.67%
5	PERU 8.75 11/21/33 アメリカ	国債証券	392,320,000	166.44 652,998,004	146.68 575,454,976	8.750000 2033/11/21	1.66%
6	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 アメリカ	国債証券	617,904,000	109.39 675,937,936	90.55 559,512,072	4.750000 2044/3/8	1.61%
7	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 アメリカ	国債証券	304,048,000	197.62 600,890,062	175.60 533,908,288	12.750000 2028/6/24	1.54%
8	PERU 7.35 07/21/25 アメリカ	国債証券	372,704,000	143.02 533,063,819	128.60 479,334,614	7.350000 2025/7/21	1.38%
9	BRAZIL 7.125 01/20/37 アメリカ	国債証券	392,320,000	143.51 563,052,760	117.85 462,349,120	7.125000 2037/1/20	1.33%
10	BRAZIL 10.125 05/15/27 アメリカ	国債証券	294,240,000	175.75 517,126,800	153.70 452,246,880	10.125000 2027/5/15	1.31%
11	TURKEY 7.375 02/05/25 アメリカ	国債証券	382,512,000	133.65 511,227,288	116.75 446,582,760	7.375000 2025/2/5	1.29%
12	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16 アメリカ	国債証券	343,280,000	134.00 459,995,200	129.50 444,547,600	11.375000 2016/9/15	1.28%
13	PANAMA 6.7 01/26/36 アメリカ	国債証券	362,896,000	139.40 505,877,024	120.20 436,200,992	6.700000 2036/1/26	1.26%
14	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 アメリカ	国債証券	362,896,000	140.26 509,034,219	119.60 434,059,905	6.750000 2034/9/27	1.25%
15	COLOMBIA 7.375 03/18/19 アメリカ	国債証券	353,088,000	129.27 456,439,800	121.85 430,237,728	7.375000 2019/3/18	1.24%
16	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 アメリカ	国債証券	353,088,000	133.69 472,059,040	121.75 429,884,640	6.375000 2034/10/23	1.24%

17	TURKEY 7.25 03/15/15 アメリカ	国債証券	392,320,000	110.36 432,980,044	107.65 422,332,480	7.250000 2015/3/15	1.22%
18	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20 アメリカ	国債証券	372,704,000	119.85 446,685,744	112.50 419,292,000	5.125000 2020/1/15	1.21%
19	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 アメリカ	国債証券	392,320,000	117.35 460,391,443	105.29 413,073,728	5.625000 2042/4/4	1.19%
20	BRAZIL 4.875 01/22/21 アメリカ	国債証券	382,512,000	119.10 455,571,792	106.95 409,096,584	4.875000 2021/1/22	1.18%
21	COLOMBIA 6.125 01/18/41 アメリカ	国債証券	362,896,000	135.25 490,816,840	112.00 406,443,520	6.125000 2041/1/18	1.17%
22	RUSSIA FOREIGN BOND 3.625 04/29/15 アメリカ	国債証券	362,896,000	104.90 380,700,952	104.26 378,391,659	3.625000 2015/4/29	1.09%
23	BRAZIL 8.25 01/20/34 アメリカ	国債証券	284,432,000	158.75 451,564,243	130.75 371,894,840	8.250000 2034/1/20	1.07%
24	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19 アメリカ	国債証券	313,856,000	123.25 386,827,520	116.75 366,426,880	5.950000 2019/3/19	1.06%
25	COLOMBIA 7.375 09/18/37 アメリカ	国債証券	284,432,000	150.10 426,942,240	128.75 366,206,200	7.375000 2037/9/18	1.06%
26	HUNGARY 6.375 03/29/21 アメリカ	国債証券	333,472,000	109.15 364,001,361	105.75 352,646,640	6.375000 2021/3/29	1.02%
27	COLOMBIA 4.375 07/12/21 アメリカ	国債証券	333,472,000	114.10 380,491,552	104.50 348,478,240	4.375000 2021/7/12	1.01%
28	BRAZIL 5.875 01/15/19 アメリカ	国債証券	304,048,000	121.43 369,227,064	113.50 345,094,480	5.875000 2019/1/15	1.00%
29	TURKEY 6.875 03/17/36 アメリカ	国債証券	313,856,000	129.77 407,291,912	109.75 344,456,960	6.875000 2036/3/17	0.99%
30	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 アメリカ	国債証券	225,584,000	169.12 381,518,940	151.37 341,477,780	9.500000 2030/2/2	0.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成25年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	95.44%
合計	95.44%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年7月31日現在

種類	地域	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	日本	アメリカ・ドル買/円売2013年08月	買建	3,392,000	332,651,744	332,653,440	0.96%

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成25年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成25年1月11日)	50	50	1.0170	1.0170
第2特定期間末 (平成25年7月11日)	51	51	1.0312	1.0312
平成24年10月末日	49	-	0.9998	-
11月末日	50	-	1.0052	-
12月末日	50	-	1.0156	-
平成25年1月末日	51	-	1.0211	-
2月末日	51	-	1.0315	-
3月末日	51	-	1.0397	-
4月末日	52	-	1.0517	-
5月末日	52	-	1.0426	-
6月末日	51	-	1.0299	-
7月末日	51	-	1.0289	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	1.7
第2特定期間	1.4

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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特定期間については、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。

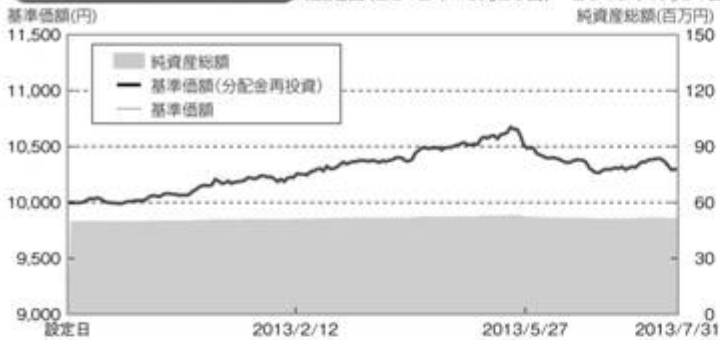
なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2013年7月31日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2012年10月26日)~2013年7月31日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2012年10月26日)
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第1期 (2013.01.11)	0円
第2期 (2013.04.11)	0円
第3期 (2013.07.11)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

(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。

■組入銘柄一覧

順位	銘柄名	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンドマザーファンド	35.27%
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンドマザーファンド	24.17%
3	外国株式パッシブ・ファンドマザーファンド	9.80%
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)マザーファンド	7.82%
5	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	5.49%
6	J-REITインデックスファンドマザーファンド	2.30%
7	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	1.61%
8	外国リートパッシブ・ファンドマザーファンド	0.56%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△12.30

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	78.96
内 日本	78.96
地方債証券	6.72
内 日本	6.72
特殊債券	7.08
内 日本	7.08
社債券	6.76
内 日本	6.76
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.47
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	328回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/3/20	1.43%
2	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2022/9/20	1.34%
3	326回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.700000	2022/12/20	1.33%
4	326回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2015/3/15	1.23%
5	105回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/6/20	1.23%

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	94.88
内 日本	94.88
コールローン、その他の資産(負債控除後)	5.12
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.63%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.71%
3	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.02%
4	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.85%
5	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.80%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	輸送用機器	11.38%
2	電気機器	10.80%
3	銀行業	9.72%
4	情報・通信業	6.57%
5	化学	5.14%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	4.75

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2013年7月31日

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	96.99
内 コーロ	41.89
内 アメリカ	39.48
内 イギリス	7.20
内 カナダ	2.48
内 オーストラリア	1.37
内 その他	4.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.01
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 0.25 05/15/15	国債証券	アメリカ	0.250000	2015/5/15	1.04%
2	US T N/B 0.375 03/15/15	国債証券	アメリカ	0.375000	2015/3/15	1.02%
3	US T N/B 0.375 01/15/16	国債証券	アメリカ	0.375000	2016/1/15	0.87%
4	US T N/B 4.25 11/15/14	国債証券	アメリカ	4.250000	2014/11/15	0.81%
5	US T N/B 2.625 06/30/14	国債証券	アメリカ	2.625000	2014/6/30	0.75%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△98.11

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.92
内 アメリカ	57.42
内 コーロ	12.69
内 イギリス	9.54
内 カナダ	4.53
内 スイス	4.00
内 その他	7.74
投資信託受益証券	0.32
内 オーストラリア	0.28
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.81
内 アメリカ	1.49
内 コーロ	0.12
内 イギリス	0.11
内 香港	0.04
内 カナダ	0.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.95
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ周辺機器	1.58%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.56%
3	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.97%
4	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.94%
5	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	0.94%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	石油・ガス・消耗燃料	8.90%
2	商業銀行	7.62%
3	医薬品	6.77%
4	保険	4.63%
5	メディア	2.87%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.12
為替予約取引(売建)	△0.03
株価指数先物取引(買建)	1.90

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	98.59
内 日本	98.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.41
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	11.87%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	9.90%
3	日本リートファンド投資法人	日本	6.45%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.64%
5	アドバンスレジデンス投資法人	日本	3.95%

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2013年7月31日

■外国リート・バッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	13.82
内 オーストラリア	10.16
内 シンガポール	3.65
投資証券	85.67
内 アメリカ	67.65
内 ユーロ	7.00
内 イギリス	5.95
内 カナダ	2.69
内 香港	2.03
内 その他	0.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	0.51
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	6.58%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	ユーロ	3.05%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.02%
4	WESTFIELD GROUP	オーストラリア	2.72%
5	HCP INC	アメリカ	2.66%

■エマーシング債券バッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	95.44
内 アメリカ	95.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.56
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	アメリカ	7.500000	2030/3/31	6.56%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.07/24/18	国債証券	アメリカ	11.000000	2018/7/24	1.99%
3	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	アメリカ	6.050000	2040/1/11	1.68%
4	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	アメリカ	5.000000	2020/4/29	1.67%
5	PERU 8.75 11/21/33	国債証券	アメリカ	8.750000	2033/11/21	1.66%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.96

■エマーシング株式バッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.11
内 香港	17.94
内 韓国	14.47
内 台湾	11.29
内 ブラジル	10.57
内 アメリカ	9.93
内 その他	30.91
投資信託受益証券	0.87
内 メキシコ	0.87
投資証券	0.15
内 メキシコ	0.12
内 トルコ	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.87
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	地域	業種	投資比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	半導体・半導体製造装置	3.45%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	2.25%
3	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.74%
4	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	香港	商業銀行	1.42%
5	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	香港	インターネットソフトウェアサービス	1.29%

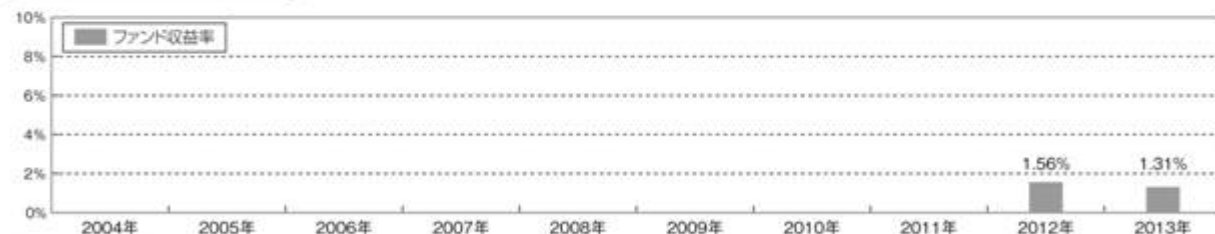
組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	17.93%
2	石油・ガス・消耗燃料	10.97%
3	半導体・半導体製造装置	7.65%
4	無線通信サービス	5.78%
5	金属・鉱業	4.74%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1.09
為替予約取引(売建)	△1.33
株価指数先物取引(買建)	3.83

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、2012年は設定日から年末までの収益率、および2013年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(4)【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	50,000,000	0
第2特定期間	0	0

(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。

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。

当ファンドでは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により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

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.15%^{*}(税抜3.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

^{*}消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を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、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、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。また、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、受益者が解約の請求をするときは、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

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5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したがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（「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24年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により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、信託期間中において、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、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け出ます。
- 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、書面決議の日および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、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 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、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、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、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、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

ロ．信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（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、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.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権

を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 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、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、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいま
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。
- j. 上記b.に該当しない場合の約款変更については、「運用報告書」にてお知らせいたします。

八. 関係法人との契約の更改

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

二. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

委託会社は、毎年1月11日、7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に運用報告書を作成し、当該信託財産にかかる知っている受益者に対して交付します。運用報告書は委託会社のホームページにおいても開示します。

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金受領権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5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、委託会社に帰属するものとします。

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計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は原則として毎計算期間終了後の翌営業日に収益分配金を販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。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、委託会社に帰属するものとします。

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て）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、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）当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

（３）当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成24年10月26日から平成25年1月11日までとなっております。

（４）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成25年1月12日から平成25年7月11日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

（５）平成25年4月24日に当ファンドの名称を「投資のコンシェルジュ」から「投資のソムリエ」へと変更しております。

1【財務諸表】

投資のソムリエ

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成25年1月11日現在	当 期 平成25年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,325,678	3,284,414
親投資信託受益証券	46,120,714	44,892,698
派生商品評価勘定	-	10,861
未収入金	-	3,600,000
流動資産合計	51,446,392	51,787,973
資産合計		
	51,446,392	51,787,973
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	392,000	14,454
未払受託者報酬	5,559	6,814
未払委託者報酬	200,691	208,515
その他未払費用	462	637
流動負債合計	598,712	230,420
負債合計		
	598,712	230,420
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 50,000,000	¹ 50,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	847,680	1,557,553
（分配準備積立金）	847,680	2,513,778
元本等合計	50,847,680	51,557,553
純資産合計		
	50,847,680	51,557,553
負債純資産合計		
	51,446,392	51,787,973

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自	平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自	平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
営業収益				
受取利息		1,022		2,086
有価証券売買等損益		3,332,714		1,910,984
為替差損益		2,279,344		739,928
営業収益合計		1,054,392		1,173,142
営業費用				
受託者報酬		5,559		13,458
委託者報酬		200,691		448,579
その他費用		462		1,232
営業費用合計		206,712		463,269
営業利益又は営業損失（ ）		847,680		709,873
経常利益又は経常損失（ ）		847,680		709,873
当期純利益又は当期純損失（ ）		847,680		709,873
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（ ）		-		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		847,680
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金	1	-	1	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		847,680		1,557,553

(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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期 平成25年1月11日現在	当期 平成25年7月11日現在
1. 1 期首元本額	50,000,000円	50,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 受益権の総数	50,000,000口	50,000,000口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期 自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	当期 自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(232,309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(615,371円)、信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は847,680円(1万口当たり169.54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。</p>	<p>(自平成25年1月12日 至平成25年4月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(278,074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(1,317,297円)、信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(847,680円)より分配対象収益は2,443,051円(1万口当たり488.61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。(以下、各期間において同じ。)</p> <p>(自平成25年4月12日 至平成25年7月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(70,727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(0円)及び分配準備積立金(2,443,051円)より分配対象収益は2,513,778円(1万口当たり502.76円)であります。なお、分配を行っておりません。</p>

(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	前 期 自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	当 期 自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11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、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。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成25年1月11日現在	当 期 平成25年7月11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	前期 平成25年1月11日現在	当期 平成25年7月11日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,870,789	254,891
合計	2,870,789	254,891

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	前期 平成25年1月11日 現在				当期 平成25年7月11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	17,342,258	-	17,734,258	392,000	5,447,546	-	5,451,139	3,593
アメリカ・ドル	1,513,703	-	1,533,380	19,677	560,319	-	557,480	2,839
イギリス・ポンド	5,181,085	-	5,284,433	103,348	1,071,642	-	1,066,562	5,080

オーストラリア・ドル	2,619,245	-	2,680,678	61,433	1,066,813	-	1,067,274	461
カナダ・ドル	2,845,920	-	2,897,280	51,360	1,177,878	-	1,182,588	4,710
ユーロ	5,182,305	-	5,338,487	156,182	1,570,894	-	1,577,235	6,341
合計	17,342,258	-	17,734,258	392,000	5,447,546	-	5,451,139	3,593

（注）時価の算定方法

1. 特定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。
特定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。
特定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。
・特定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。
・特定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. 特定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、特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	前 期 平成25年1月11日現在	当 期 平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.0170円	1.0312円
（1万口当たり純資産額）	（10,170円）	（10,312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25年7月11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	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,963,761	3,239,616	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16,276,477	19,009,297	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	726,559	887,491	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,899,357	3,698,427	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	53,459	42,115	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12,928,166	15,390,981	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	742,983	604,342	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,510,150	2,020,429	
親投資信託受益証券 合計		36,100,912	44,892,698	
合計		36,100,912	44,892,698	

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

「（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。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,274,614,333	10,305,997,660
株式	2	288,061,413,066	323,911,813,000
派生商品評価勘定		205,108,443	830,393,722
未収入金		3,376,637	10,750,287
未収配当金		324,804,849	256,560,240
流動資産合計		291,869,317,328	335,315,514,909
資産合計		291,869,317,328	335,315,514,909
負債の部			
流動負債			
前受金		169,900,000	837,615,000
未払解約金		125,621,000	302,718,000
流動負債合計		295,521,000	1,140,333,000
負債合計		295,521,000	1,140,333,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	237,448,868,793	202,562,042,559
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		54,124,927,535	131,613,139,350
元本等合計		291,573,796,328	334,175,181,909
純資産合計		291,573,796,328	334,175,181,909
負債純資産合計		291,869,317,328	335,315,514,909

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	253,178,626,296円	237,448,868,793円
同期中追加設定元本額	5,560,217,780円	18,162,113,075円
同期中一部解約元本額	21,289,975,283円	53,048,939,309円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式 インデックスファンド	3,342,203,908円	3,855,023,340円
D I A M国内株式パッシ ブ・ファンド	1,124,411,816円	1,293,638,430円
D I A M国内株式インデッ クスファンド< D C 年金 >	36,969,163,098円	37,845,908,406円
D I A Mバランス・ファン ド< D C 年金 > 1 安定型	957,396,034円	765,154,246円
D I A Mバランス・ファン ド< D C 年金 > 2 安定・成 長型	3,584,616,266円	2,859,458,936円
D I A Mバランス・ファン ド< D C 年金 > 3 成長型	3,627,226,257円	3,121,839,084円
D I A M D C バランス 3 0インデックスファンド	486,965,527円	394,168,833円
D I A M D C バランス 5 0インデックスファンド	1,564,883,551円	1,336,839,351円
D I A M D C バランス 7 0インデックスファンド	1,208,432,963円	1,110,011,421円
マネックス資産設計ファン ド< 隔月分配型 >	123,323,679円	121,688,174円
マネックス資産設計ファン ド< 育成型 >	1,524,084,288円	1,505,002,365円

マネックス資産設計ファン ド エボリューション	18,412,264円	19,921,906円
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド(新興国1 0)	47,575円	447,178円
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド(新興国2 0)	72,736円	938,056円
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド(新興国3 0)	98,899円	1,909,405円
投資のソムリエ	2,463,013円	1,963,761円
クルーズコントロール	8,460,239円	731,997円
D I A Mワールドバランス 2 5 V A (適格機関投資家 限定)	219,087,971円	171,780,489円
D I A Mグローバル・バラ ンスファンド2 5 V A (適 格機関投資家限定)	9,902,179,526円	6,634,581,043円
D I A Mグローバル・バラ ンスファンド5 0 V A (適 格機関投資家限定)	1,740,050,483円	1,307,919,165円
D I A M国際分散バランス ファンド3 0 V A (適格機 関投資家限定)	205,408,632円	160,569,000円
D I A M国際分散バランス ファンド5 0 V A (適格機 関投資家限定)	779,188,349円	612,152,345円
D I A M国内重視バランス ファンド3 0 V A (適格機 関投資家限定)	201,556,717円	147,490,509円
D I A M国内重視バランス ファンド5 0 V A (適格機 関投資家限定)	286,014,701円	231,173,116円
D I A M世界バランスファ ンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	19,405,357,081円	16,058,829,754円
D I A M世界バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	6,430,632,308円	5,340,516,978円
D I A Mバランスファンド 2 5 V A (適格機関投資家 限定)	4,819,546,621円	3,846,338,105円
D I A Mバランスファンド 3 7 . 5 V A (適格機関投 資家限定)	3,172,154,862円	2,590,147,425円
D I A Mバランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家 限定)	7,355,651,520円	6,156,965,800円
D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A (適 格機関投資家限定)	1,100,908,007円	856,350,813円

D I A Mグローバル・ア セット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	2,408,510,938円	1,897,386,268円
D I A M アクサ グロー バル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限 定)	2,416,554,459円	1,812,507,661円
D I A M世界アセットバラ ンスファンドV A (適格機 関投資家向け)	13,895,228,477円	9,967,969,824円
D I A Mグローバル 私募 ファンド(適格機関投資家 向け)	200,292,399円	113,023,493円
D I A M世界バランスファ ンド5 5 V A (適格機関投 資家限定)	4,434,605,750円	3,436,454,466円
D I A Mアイエヌジー世界 バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	9,117,855,893円	7,511,813,682円
D I A Mグローバル分散 ファンドV A (適格機関投 資家限定)	438,508,601円	340,256,026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)	39,496,785,494円	30,814,423,202円
D I A M世界アセットバラ ンスファンド4 0 V A (適 格機関投資家限定)	2,468,429,367円	1,715,757,687円
D I A M世界アセットバラ ンスファンド2 5 V A (適 格機関投資家限定)	4,750,729,993円	3,648,045,066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)	24,377,132,725円	18,784,738,540円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	255,241,831円	89,536,768円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	103,294円	111,722,556円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	161,931円	149,141円
D I A M世界アセットバラ ンスファンド4 V A (適格 機関投資家限定)	21,226,322,800円	16,600,911,191円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限 定)	274,023,461円	211,148,382円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限 定)	85,221,168円	68,311,460円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	202,479,650円	143,194,770円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	95,763円	79,134円

D I A Mバランス60VA （適格機関投資家限定）	146,629円	125,386円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA（12 12）（適格機関投資家限 定）	1,236,284,379円	1,034,935,394円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA（13 03）（適格機関投資家限 定）	4,154,900円	2,563,890,274円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA（13 06）（適格機関投資家限 定）	- 円	3,341,912,869円
D I A M世界アセットバ ランスファンド7VA（13 09）（適格機関投資家限 定）	- 円	4,289,888円
計	237,448,868,793円	202,562,042,559円
2 . 受益権の総数	237,448,868,793口	202,562,042,559口
3 . 2 差入代用有価証券	株式 2,130,000,000円	株式 3,190,000,000円

（金融商品に関する注記）

1 . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左
-------------------	--	----

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	41,537,448,229	60,857,375,899
合計	41,537,448,229	60,857,375,899

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成24年2月8日から平成25年1月11日まで及び平成25年2月8日から平成25年7月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成25年1月11日 現在				平成25年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,243,625,000	-	3,448,915,000	205,290,000	9,287,980,000	-	10,118,875,000	830,895,000
合計	3,243,625,000	-	3,448,915,000	205,290,000	9,287,980,000	-	10,118,875,000	830,895,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2279円	1.6497円
(1万口当たり純資産額)	(12,279円)	(16,497円)

[次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成25年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	94,000	304	28,576,000	
日本水産	236,600	208	49,212,800	
マルハニチロホールディングス	422,000	203	85,666,000	
ハウスイ	19,000	122	2,318,000	
サカタのタネ	32,500	1,398	45,435,000	
ホクト	22,600	1,779	40,205,400	
ショーボンドHD	19,500	4,225	82,387,500	
ミライト・ホールディングス	62,600	948	59,344,800	
タマホーム	9,300	1,300	12,090,000	
住石ホールディングス	65,000	127	8,255,000	
日鉄鉱業	56,000	388	21,728,000	
三井松島	144,000	144	20,736,000	
国際石油開発帝石	2,662	465,000	1,237,830,000	
日本海洋掘削	5,500	8,020	44,110,000	
関東天然瓦斯	23,000	816	18,768,000	
石油資源開発	31,200	4,420	137,904,000	
ダイセキ環境ソリューション	19	168,200	3,195,800	
安藤・間	123,900	240	29,736,000	
東急建設	78,030	257	20,053,710	
コムシスホールディングス	106,600	1,326	141,351,600	
ミサワホーム	25,900	1,930	49,987,000	
高松コンストラクショングP	16,600	1,604	26,626,400	
東建コーポレーション	8,210	5,830	47,864,300	
ヤマウラ	8,500	280	2,380,000	
大成建設	1,108,000	416	460,928,000	
大林組	657,000	590	387,630,000	
清水建設	670,000	441	295,470,000	
飛島建設	136,000	118	16,048,000	
長谷工コーポレーション	1,369,500	136	186,252,000	
松井建設	2,000	361	722,000	
鹿島建設	963,000	387	372,681,000	
不動産トラ	155,700	170	26,469,000	
大末建設	86,000	73	6,278,000	
鉄建建設	134,000	120	16,080,000	
太平工業	39,000	366	14,274,000	
西松建設	270,000	253	68,310,000	
三井住友建設	378,500	91	34,443,500	

大豊建設	62,000	144	8,928,000
前田建設	135,000	534	72,090,000
佐田建設	78,000	82	6,396,000
ナカノフード建設	17,000	229	3,893,000
奥村組	194,000	411	79,734,000
大和小田急建設	11,500	203	2,334,500
東鉄工業	28,700	2,003	57,486,100
イチケン	23,000	179	4,117,000
浅沼組	68,000	78	5,304,000
戸田建設	255,000	302	77,010,000
熊谷組	159,000	104	16,536,000
青木あすなる建設	12,500	557	6,962,500
北野建設	51,000	217	11,067,000
植木組	29,000	180	5,220,000
三井ホーム	29,000	510	14,790,000
矢作建設	27,400	457	12,521,800
ピーエス三菱	15,300	464	7,099,200
大東建託	83,200	8,830	734,656,000
新日本建設	26,300	338	8,889,400
N I P P O	51,000	1,895	96,645,000
東亜道路	41,000	488	20,008,000
前田道路	63,000	1,743	109,809,000
日本道路	65,000	620	40,300,000
東亜建設	192,000	144	27,648,000
若築建設	119,000	97	11,543,000
東洋建設	68,300	262	17,894,600
五洋建設	261,000	265	69,165,000
大林道路	26,000	453	11,778,000
世紀東急	81,000	86	6,966,000
福田組	33,000	346	11,418,000
住友林業	150,800	1,197	180,507,600
日本基礎技術	27,000	325	8,775,000
日成ビルド工業	66,000	192	12,672,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	112,000	159	17,808,000
巴コーポレーション	30,400	352	10,700,800
パナホーム	82,000	653	53,546,000
大和ハウス	546,000	1,795	980,070,000
ライト工業	49,600	837	41,515,200
積水ハウス	657,000	1,392	914,544,000
日特建設	19,400	359	6,964,600
北陸電気工事	12,000	335	4,020,000
ユアテック	36,000	319	11,484,000
西部電気工業	1,000	424	424,000

四電工	6,000	354	2,124,000
中電工	31,900	1,022	32,601,800
関電工	101,000	472	47,672,000
きんでん	119,000	945	112,455,000
東京エネシス	23,000	454	10,442,000
トーエネック	32,000	514	16,448,000
住友電設	15,300	1,460	22,338,000
日本電設工業	40,000	1,086	43,440,000
協和エクシオ	78,900	1,143	90,182,700
新日本空調	16,200	593	9,606,600
日本工営	69,000	377	26,013,000
N D S	35,000	285	9,975,000
九電工	36,000	427	15,372,000
三機工業	50,000	626	31,300,000
日揮	220,000	3,810	838,200,000
中外炉工業	71,000	257	18,247,000
ヤマト	16,000	359	5,744,000
太平電業	27,000	737	19,899,000
高砂熱学	63,000	864	54,432,000
三晃金属	25,000	247	6,175,000
N E C ネットズエスアイ	18,300	2,307	42,218,100
朝日工業社	24,000	359	8,616,000
アタカ大機	14,000	383	5,362,000
大気社	31,400	2,496	78,374,400
ダイダン	25,000	540	13,500,000
日比谷総合設備	27,300	1,019	27,818,700
東芝プラントシステム	36,000	1,628	58,608,000
日本製粉	135,000	516	69,660,000
日清製粉G本社	199,000	1,181	235,019,000
日東富士製粉	8,000	311	2,488,000
昭和産業	92,000	303	27,876,000
鳥越製粉	18,400	636	11,702,400
協同飼料	79,000	113	8,927,000
中部飼料	20,000	536	10,720,000
日本配合飼料	62,000	126	7,812,000
東洋精糖	37,000	101	3,737,000
日本甜菜糖	115,000	178	20,470,000
三井製糖	87,000	315	27,405,000
ネクスト	9,400	1,274	11,975,600
日本M&Aセンター	10,600	5,770	61,162,000
ノバレーゼ	5,800	668	3,874,400
アコーディア・ゴルフ	897	108,900	97,683,300
タケエイ	6,600	1,470	9,702,000

パソナグループ	204	64,100	13,076,400	
リンクアンドモチベーション	169	34,700	5,864,300	
G C Aサヴィアン	9,400	882	8,290,800	
エス・エム・エス	11,600	1,335	15,486,000	
テンプホールディングス	27,900	2,221	61,965,900	
リニカル	4,600	1,408	6,476,800	
クックパッド	9,400	2,707	25,445,800	
エスクリ	4,700	1,022	4,803,400	
森永製菓	215,000	207	44,505,000	
中村屋	52,000	408	21,216,000	
江崎グリコ	79,000	981	77,499,000	
名糖産業	10,100	1,015	10,251,500	
不二家	127,000	195	24,765,000	
山崎製パン	160,000	1,089	174,240,000	
第一屋製パン	31,000	126	3,906,000	
モロゾフ	36,000	322	11,592,000	
亀田製菓	12,300	2,996	36,850,800	
カルビー	20,000	9,950	199,000,000	
森永乳業	185,000	299	55,315,000	
ヤクルト	128,100	4,195	537,379,500	
明治ホールディングス	65,000	4,890	317,850,000	
雪印メグミルク	43,100	1,480	63,788,000	
プリマハム	123,000	203	24,969,000	
日本ハム	167,000	1,607	268,369,000	
伊藤ハム	120,000	435	52,200,000	
林兼産業	73,000	89	6,497,000	
丸大食品	106,000	322	34,132,000	
米久	9,200	799	7,350,800	
S Foods	14,500	882	12,789,000	
学情	7,100	713	5,062,300	
スタジオアリス	9,700	1,381	13,395,700	
シミックホールディングス	7,900	1,873	14,796,700	
システナ	20,900	749	15,654,100	
NECフィールドディング	16,500	1,215	20,047,500	
デジタルアーツ	7,200	1,124	8,092,800	
新日鉄住金SOL	12,900	1,946	25,103,400	
総合警備保障	74,400	1,826	135,854,400	
日本駐車場開発	2,122	8,370	17,761,140	
コア	7,400	739	5,468,600	
カカクコム	55,800	3,180	177,444,000	
アイロムホールディングス	417	9,640	4,019,880	
ルネサンス	9,700	739	7,168,300	
新日本科学	12,600	1,812	22,831,200	

ツクイ	24,400	1,128	27,523,200
エムスリー	484	231,300	111,949,200
ベストブライダル	12,200	756	9,223,200
アウトソーシング	7,300	703	5,131,900
ディー・エヌ・エー	100,800	1,915	193,032,000
博報堂DYHLDGS	28,300	7,290	206,307,000
ぐるなび	14,500	1,139	16,515,500
一休	128	154,500	19,776,000
ジャパンベストレスキューS	29	166,600	4,831,400
ジェイコムホールディングス	3,900	745	2,905,500
PGMホールディングス	28,900	926	26,761,400
バリューコマース	8,400	1,214	10,197,600
サッポロホールディングス	359,000	399	143,241,000
アサヒグループホールディング	440,300	2,724	1,199,377,200
麒麟HD	937,000	1,612	1,510,444,000
宝ホールディングス	172,000	925	159,100,000
オエノンホールディングス	57,000	240	13,680,000
養命酒	3,000	814	2,442,000
コカ・コーラウエスト	74,300	1,838	136,563,400
コカ・コーライーストジャパン	45,670	1,471	67,180,570
ダイドードリンコ	11,200	4,195	46,984,000
伊藤園	59,700	2,364	141,130,800
キーコーヒー	19,500	1,535	29,932,500
ユニカフェ	6,100	516	3,147,600
ジャパンフーズ	3,100	1,548	4,798,800
日清オイリオグループ	96,000	362	34,752,000
不二製油	53,300	1,688	89,970,400
J-オイルミルズ	93,000	302	28,086,000
ローソン	73,000	7,990	583,270,000
サンエー	7,300	4,910	35,843,000
麒麟堂	7,200	697	5,018,400
ダイユーエイト	4,200	641	2,692,200
カワチ薬品	13,400	2,135	28,609,000
エービーシー・マート	22,900	4,380	100,302,000
ハードオフコーポレーション	9,900	733	7,256,700
高千穂交易	8,300	904	7,503,200
アスクル	15,200	1,856	28,211,200
ゲオホールディングス	331	91,100	30,154,100
ポイント	17,810	5,090	90,652,900
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	26,000	103	2,678,000
伊藤忠食品	4,900	3,370	16,513,000
くらコーポレーション	11,400	1,742	19,858,800
キャンドウ	10,300	1,508	15,532,400

エレマテック	9,200	1,292	11,886,400	
パル	11,300	2,975	33,617,500	
J A L U X	6,000	1,000	6,000,000	
エディオン	83,500	619	51,686,500	
あらた	44,000	376	16,544,000	
サーラコーポレーション	16,700	498	8,316,600	
トーメンデバイス	3,000	1,675	5,025,000	
J Pホールディングス	31,000	624	19,344,000	
あみやき亭	34	304,000	10,336,000	
東京エレクトロデバイス	40	154,200	6,168,000	
ひらまつ	20,100	804	16,160,400	
双日	1,216,500	179	217,753,500	
ゲンキー	1,800	2,003	3,605,400	
アルフレッサホールディングス	49,900	5,190	258,981,000	
大黒天物産	3,800	2,780	10,564,000	
ハニーズ	15,310	1,093	16,733,830	
キッコーマン	179,000	1,725	308,775,000	
味の素	540,000	1,341	724,140,000	
キューピー	111,400	1,486	165,540,400	
ハウス食品	77,100	1,657	127,754,700	
カゴメ	78,700	1,735	136,544,500	
焼津水産化工	11,200	853	9,553,600	
アリアケジャパン	20,100	2,264	45,506,400	
ニチレイ	234,000	521	121,914,000	
横浜冷凍	48,200	823	39,668,600	
東洋水産	101,000	3,285	331,785,000	
日清食品H D	85,600	4,200	359,520,000	
永谷園	7,000	876	6,132,000	
フジッコ	24,000	1,131	27,144,000	
ロックフィールド	11,700	1,923	22,499,100	
日本たばこ産業	1,217,100	3,675	4,472,842,500	
ケンコーマヨネーズ	7,200	845	6,084,000	
わらべや日洋	13,300	1,560	20,748,000	
なとり	10,800	947	10,227,600	
片倉工業	25,700	1,295	33,281,500	
グンゼ	153,000	249	38,097,000	
ヒューリック	250,200	1,141	285,478,200	
神栄	25,000	305	7,625,000	
山下医科器械	1,600	1,997	3,195,200	
ラサ商事	9,300	442	4,110,600	
アルペン	14,800	2,022	29,925,600	
クオール	8,200	572	4,690,400	
アルコニックス	5,500	1,966	10,813,000	

ジェイアイエヌ	9,800	4,790	46,942,000
ビックカメラ	732	43,900	32,134,800
D C Mホールディングス	95,300	780	74,334,000
M o n o t a R O	26,000	2,778	72,228,000
あい ホールディングス	34,500	930	32,085,000
J . フロント リテイリング	456,000	845	385,320,000
ドトール・日レスHD	33,900	1,457	49,392,300
マツモトキヨシH L D G S	32,500	3,290	106,925,000
ブロンコビリー	2,600	1,844	4,794,400
スタートトゥデイ	53,500	2,061	110,263,500
物語コーポレーション	2,800	4,085	11,438,000
ココカラファイン	20,200	3,240	65,448,000
三越伊勢丹HD	383,500	1,504	576,784,000
東洋紡	865,000	157	135,805,000
ユニチカ	562,000	54	30,348,000
富士紡ホールディングス	98,000	258	25,284,000
日清紡ホールディングス	130,000	767	99,710,000
倉敷紡績	210,000	170	35,700,000
ダイワボウHD	176,000	164	28,864,000
シキボウ	125,000	121	15,125,000
日東紡績	150,000	355	53,250,000
トヨタ紡織	68,300	1,497	102,245,100
ウエルシアHD	6,800	5,210	35,428,000
クリエイトSDH	8,100	3,875	31,387,500
バイタルK S K H D	36,600	797	29,170,200
八洲電機	14,200	413	5,864,600
U K Cホールディングス	11,500	1,757	20,205,500
丸善C H I H D	12,000	318	3,816,000
T O K A Iホールディングス	75,500	333	25,141,500
日本毛織	65,000	741	48,165,000
大東紡織	32,000	70	2,240,000
トーア紡コーポレーション	93,000	71	6,603,000
ガイドーリミテッド	23,000	693	15,939,000
東京建物不動産販	10,300	510	5,253,000
三栄建築設計	5,100	850	4,335,000
野村不動産H L D G S	92,600	2,422	224,277,200
常和ホールディングス	4,300	2,701	11,614,300
フージャースHD	25,800	884	22,807,200
帝国繊維	22,000	788	17,336,000
ブックオフコーポレーション	11,000	701	7,711,000
日本コークス工業	165,000	112	18,480,000
ミタチ産業	3,800	435	1,653,000
あさひ	11,200	1,556	17,427,200

日本調剤	2,480	2,885	7,154,800
コスモス薬品	9,700	11,430	110,871,000
シップヘルスケアHD	27,600	3,640	100,464,000
ソフトクリエイイトHD	6,600	706	4,659,600
セブン&アイ・HLDGS	807,000	3,950	3,187,650,000
ツルハホールディングス	18,900	9,920	187,488,000
サンマルクホールディングス	6,300	4,800	30,240,000
フェリシモ	5,600	1,165	6,524,000
トリドール	16,800	1,041	17,488,800
クスリのアオキ	2,900	7,660	22,214,000
帝人	777,000	219	170,163,000
東レ	1,584,000	657	1,040,688,000
クラレ	348,700	1,382	481,903,400
旭化成	1,277,000	668	853,036,000
サカイオーベックス	55,000	160	8,800,000
稲葉製作所	8,800	1,617	14,229,600
宮地エンジニアリングG	69,000	177	12,213,000
トーカロ	11,600	1,326	15,381,600
アルファCO	7,000	1,020	7,140,000
SUMCO	125,100	1,081	135,233,100
川田テクノロジーズ	4,600	2,900	13,340,000
住江織物	56,000	253	14,168,000
日本フェルト	12,200	438	5,343,600
イチカワ	14,000	285	3,990,000
日本バイリン	26,000	508	13,208,000
エコナックホールディングス	63,000	55	3,465,000
日東製網	24,000	131	3,144,000
芦森工業	49,000	156	7,644,000
アツギ	171,000	111	18,981,000
ダイニック	39,000	175	6,825,000
共和レザー	12,800	304	3,891,200
セーレン	54,800	660	36,168,000
東海染工	30,000	123	3,690,000
小松精練	34,000	490	16,660,000
ワコールホールディングス	121,000	1,010	122,210,000
ホギメディカル	12,900	5,590	72,111,000
レナウン	44,200	129	5,701,800
クラウドディア	2,400	1,153	2,767,200
TSIホールディングス	105,600	652	68,851,200
デジタルハーツ	3,600	2,454	8,834,400
ITホールディングス	64,000	1,188	76,032,000
ネオス	41	59,500	2,439,500
電算システム	4,400	1,154	5,077,600

グリー	100,100	805	80,580,500
コーエーテクモHD	38,500	943	36,305,500
三菱総合研究所	7,500	2,159	16,192,500
ボルテージ	3,000	933	2,799,000
K L a b	6,100	1,709	10,424,900
ポルトゥウィン・ピットクル	3,200	2,597	8,310,400
ネクソン	159,000	1,161	184,599,000
エイチーム	1,500	3,050	4,575,000
ブロードリーフ	18,100	1,558	28,199,800
特種東海製紙	120,000	203	24,360,000
ダウンゴ	87	517,000	44,979,000
ベリサーブ	12	208,400	2,500,800
マクロミル	30,800	607	18,695,600
ティーガイア	24,400	931	22,716,400
テクマトリックス	5,800	548	3,178,400
GMOペイメントゲートウェイ	6,500	2,020	13,130,000
ザッパラス	114	70,200	8,002,800
インターネットイニシアティブ	22,600	3,505	79,213,000
S R Aホールディングス	9,300	1,102	10,248,600
朝日ネット	17,000	431	7,327,000
王子ホールディングス	904,000	425	384,200,000
日本製紙	98,800	1,435	141,778,000
三菱製紙	293,000	95	27,835,000
北越紀州製紙	127,500	426	54,315,000
中越パルプ	78,000	150	11,700,000
巴川製紙	32,000	180	5,760,000
大王製紙	86,000	604	51,944,000
レンゴー	164,000	491	80,524,000
トーモク	65,000	310	20,150,000
ザ・パック	14,600	1,700	24,820,000
コ・プケミカル	32,000	136	4,352,000
昭和電工	1,272,000	138	175,536,000
住友化学	1,407,000	327	460,089,000
日本化成	39,000	136	5,304,000
住友精化	39,000	394	15,366,000
日産化学	140,400	1,468	206,107,200
ラサ工業	73,000	126	9,198,000
クレハ	144,000	327	47,088,000
テイカ	35,000	285	9,975,000
石原産業	369,000	75	27,675,000
片倉チツカリン	13,000	273	3,549,000
日本曹達	122,000	535	65,270,000
東ソー	548,000	368	201,664,000

トクヤマ	297,000	334	99,198,000
セントラル硝子	183,000	306	55,998,000
東亜合成	241,000	424	102,184,000
ダイソー	82,000	301	24,682,000
関東電化	49,000	260	12,740,000
電気化学	410,000	355	145,550,000
イビデン	119,000	1,600	190,400,000
信越化学	367,200	6,880	2,526,336,000
日本カ - バイド	60,000	677	40,620,000
堺 化 学	77,000	283	21,791,000
エア・ウォーター	169,000	1,489	251,641,000
大陽日酸	269,000	726	195,294,000
日本化学工業	76,000	144	10,944,000
日本パ - カライジング	48,000	2,000	96,000,000
高压ガス	31,000	584	18,104,000
チタン工業	25,000	225	5,625,000
四国化成	30,000	676	20,280,000
戸田工業	30,000	269	8,070,000
ステラ ケミファ	9,100	1,555	14,150,500
保土谷化学	47,000	191	8,977,000
日本触媒	149,000	1,038	154,662,000
大日精化	74,000	432	31,968,000
カネカ	255,000	692	176,460,000
協和発酵キリン	245,000	1,108	271,460,000
三菱瓦斯化学	323,000	759	245,157,000
三井化学	869,000	237	205,953,000
J S R	187,800	1,953	366,773,400
東京応化工業	39,600	2,210	87,516,000
大阪有機化学	14,200	476	6,759,200
三菱ケミカルH L D G S	1,280,000	482	616,960,000
日本合成化学	42,000	1,095	45,990,000
ダイセル	244,000	883	215,452,000
住友ベ - クライト	160,000	383	61,280,000
積水化学	420,000	1,066	447,720,000
日本ゼオン	176,000	1,145	201,520,000
アイカ工業	57,500	1,993	114,597,500
宇部興産	980,000	189	185,220,000
積水樹脂	29,000	1,370	39,730,000
タキロン	48,000	421	20,208,000
旭有機材	73,000	226	16,498,000
日立化成	88,500	1,647	145,759,500
ニチバン	21,000	402	8,442,000
リケンテクノス	34,000	315	10,710,000

大倉工業	49,000	347	17,003,000
積水化成製品	53,000	263	13,939,000
群栄化学	56,000	635	35,560,000
タイガース ポリマー	10,300	409	4,212,700
ミライアル	5,100	1,604	8,180,400
日本カ-リット	16,600	585	9,711,000
日本化薬	144,000	1,317	189,648,000
イーピーエス	221	115,000	25,415,000
パナソニック インフォシス	4,600	2,248	10,340,800
フェイス	678	10,720	7,268,160
アミューズ	6,300	2,405	15,151,500
野村総合研究所	109,200	3,430	374,556,000
ドリームインキュベータ	65	163,000	10,595,000
サイバネットシステム	165	34,000	5,610,000
T A C	13,500	212	2,862,000
ケネディクス	194,800	594	115,711,200
電通	185,800	3,235	601,063,000
インテージ	5,800	2,385	13,833,000
テイクアンドギヴニーズ	800	24,130	19,304,000
ぴあ	6,200	1,670	10,354,000
シンプレクスホールディング	363	44,850	16,280,550
イオンファンタジー	6,800	1,679	11,417,200
ソースネクスト	5,000	1,303	6,515,000
ネクシィーズ	8,300	308	2,556,400
メディカルシステムネットワーク	11,300	456	5,152,800
日本精化	17,400	654	11,379,600
A D E K A	88,300	1,063	93,862,900
日油	159,000	594	94,446,000
ミヨシ油脂	70,000	163	11,410,000
ハリマ化成グループ	18,100	487	8,814,700
花 王	543,000	3,345	1,816,335,000
第一工業製薬	38,000	244	9,272,000
三洋化成	65,000	622	40,430,000
武田薬品	766,900	4,685	3,592,926,500
アステラス製薬	443,700	5,650	2,506,905,000
大日本住友製薬	145,000	1,375	199,375,000
塩野義製薬	298,500	2,148	641,178,000
田辺三菱製薬	170,500	1,379	235,119,500
わかもと製薬	7,000	301	2,107,000
あすか製薬	24,000	693	16,632,000
日本新薬	43,000	1,735	74,605,000
中外製薬	237,900	2,085	496,021,500
科研製薬	81,000	1,536	124,416,000

エーザイ	252,000	4,230	1,065,960,000
ロート製薬	86,000	1,406	120,916,000
小野薬品	100,100	6,860	686,686,000
久光製薬	63,600	5,800	368,880,000
有機合成薬品	15,000	280	4,200,000
持田製薬	76,000	1,375	104,500,000
参天製薬	70,100	4,415	309,491,500
扶桑薬品	70,000	333	23,310,000
日本ケミファ	29,000	559	16,211,000
ツムラ	55,900	2,892	161,662,800
日医工	29,800	2,247	66,960,600
テルモ	149,800	5,010	750,498,000
みらかホールディングス	53,500	4,740	253,590,000
キッセイ薬品工業	38,100	2,016	76,809,600
生化学工業	39,300	1,286	50,539,800
栄研化学	14,600	1,778	25,958,800
日水製薬	8,500	1,154	9,809,000
鳥居薬品	12,400	2,358	29,239,200
東和薬品	10,500	4,085	42,892,500
富士製薬工業	5,500	1,950	10,725,000
沢井製薬	13,500	12,000	162,000,000
ゼリア新薬工業	29,000	1,516	43,964,000
第一三共	645,500	1,726	1,114,133,000
キョーリン製薬HD	54,700	2,175	118,972,500
大幸薬品	9,600	1,481	14,217,600
ダイト	6,600	1,406	9,279,600
大塚ホールディングス	406,200	3,435	1,395,297,000
大正製薬HD	49,200	7,330	360,636,000
大日本塗料	118,000	158	18,644,000
日本ペイント	177,000	1,238	219,126,000
関西ペイント	232,000	1,322	306,704,000
中国塗料	63,000	529	33,327,000
日本特殊塗料	16,200	420	6,804,000
藤倉化成	24,400	454	11,077,600
太陽ホールディングス	16,800	3,170	53,256,000
D I C	725,000	248	179,800,000
サカタインクス	42,000	915	38,430,000
東洋インキSCホールディング	184,000	508	93,472,000
T & K T O K A	6,900	2,056	14,186,400
アルプス技研	8,500	991	8,423,500
サニックス	29,800	1,456	43,388,800
ダイオーズ	4,300	698	3,001,400
日本空調サービス	5,600	885	4,956,000

オリエンタルランド	60,700	15,990	970,593,000
ダスキン	55,300	1,890	104,517,000
パーク24	100,800	1,839	185,371,200
明光ネットワークジャパン	19,500	1,350	26,325,000
ファルコSDホールディングス	10,700	1,419	15,183,300
クレスコ	4,700	743	3,492,100
フジ・メディア・HD	1,867	194,800	363,691,600
秀英予備校	4,800	375	1,800,000
田谷	4,300	765	3,289,500
ラウンドワン	64,000	650	41,600,000
リゾートトラスト	34,600	3,190	110,374,000
オービック	6,650	27,420	182,343,000
TDCソフトウェアエンジニア	4,200	791	3,322,200
ヤフー	13,971	50,500	705,535,500
ビー・エム・エル	12,100	2,588	31,314,800
ワタベウェディング	6,400	739	4,729,600
トレンドマイクロ	76,600	3,320	254,312,000
もしもしホットライン	34,000	1,280	43,520,000
東急コミュニティー	5,300	4,955	26,261,500
リソー教育	2,111	8,450	17,837,950
日本オラクル	38,500	3,855	148,417,500
アルファシステムズ	6,400	1,259	8,057,600
フューチャーアーキテクト	23,400	515	12,051,000
シーエーシー	12,000	867	10,404,000
ソフトバンク・テクノ	4,700	1,294	6,081,800
トーセ	5,500	641	3,525,500
ユー・エス・エス	22,820	12,610	287,760,200
オービックビジネスC	6,100	6,220	37,942,000
伊藤忠テクノソリューションズ	22,700	4,100	93,070,000
アイティフォー	21,700	413	8,962,100
東京個別指導学院	11,300	208	2,350,400
東計電算	3,500	1,357	4,749,500
エクスネット	18	138,600	2,494,800
テー・オー・ダブリュー	7,400	600	4,440,000
大塚商会	17,300	11,970	207,081,000
総合メディカル	4,700	3,890	18,283,000
サイボウズ	321	27,740	8,904,540
ソフトブレーン	29,300	143	4,189,900
アグレックス	5,400	860	4,644,000
セントラルスポーツ	6,600	1,579	10,421,400
電通国際情報S	12,000	1,132	13,584,000
イーエムシステムズ	3,000	2,038	6,114,000
ウェザーニューズ	5,100	2,341	11,939,100

C I J	18,200	401	7,298,200	
WOWOW	60	346,000	20,760,000	
フルキャストホールディングス	19,500	239	4,660,500	
富士フィルムHLDGS	437,200	2,305	1,007,746,000	
コニカミノルタ	516,000	770	397,320,000	
資生堂	364,300	1,445	526,413,500	
ライオン	236,000	571	134,756,000	
高砂香料	68,000	478	32,504,000	
マングム	22,100	3,390	74,919,000	
ミルボン	10,200	3,565	36,363,000	
ファンケル	51,700	1,198	61,936,600	
コーセー	36,900	2,710	99,999,000	
ドクターシーラボ	140	277,300	38,822,000	
ポーラ・オルビスHD	24,400	3,390	82,716,000	
ノエビアホールディングス	12,500	1,588	19,850,000	
エステー	12,700	1,015	12,890,500	
コニシ	14,900	1,916	28,548,400	
長谷川香料	26,100	1,435	37,453,500	
小林製薬	31,000	5,180	160,580,000	
荒川化学工業	16,300	859	14,001,700	
メック	14,900	510	7,599,000	
日本高純度化学	55	200,000	11,000,000	
JCU	3,000	4,805	14,415,000	
新田ゼラチン	8,400	1,273	10,693,200	
アース製薬	14,900	3,385	50,436,500	
イハラケミカル	35,000	666	23,310,000	
北興化学	11,000	318	3,498,000	
大成ラミック	5,900	2,449	14,449,100	
クミアイ化学	43,000	636	27,348,000	
日本農薬	47,000	1,011	47,517,000	
昭和シエル石油	183,100	874	160,029,400	
コスモ石油	565,000	182	102,830,000	
富士興産	7,100	601	4,267,100	
ニチレキ	25,000	717	17,925,000	
東燃ゼネラル石油	308,000	972	299,376,000	
ユシロ化学	11,200	967	10,830,400	
ビービー・カストロール	9,800	417	4,086,600	
AOCホールディングス	47,500	344	16,340,000	
MORESCO	4,100	1,178	4,829,800	
出光興産	24,200	8,080	195,536,000	
JXホールディングス	2,271,600	502	1,140,343,200	
横浜ゴム	229,000	1,051	240,679,000	
東洋ゴム	170,000	629	106,930,000	

ブリヂストン	641,500	3,785	2,428,077,500
住友ゴム	159,600	1,748	278,980,800
藤倉ゴム	11,900	362	4,307,800
オカモト	71,000	305	21,655,000
アキレス	162,000	133	21,546,000
フ コ ク	8,600	819	7,043,400
ニッタ	20,200	2,011	40,622,200
クリエートメディック	6,300	866	5,455,800
東海ゴム工業	37,800	903	34,133,400
三ツ星ベルト	52,000	483	25,116,000
バンドー化学	68,000	377	25,636,000
鬼怒川ゴム	37,000	517	19,129,000
旭 硝 子	1,008,000	658	663,264,000
日本板硝子	932,000	102	95,064,000
石塚硝子	27,000	222	5,994,000
有沢製作所	32,000	427	13,664,000
日本山村硝子	81,000	172	13,932,000
日本電気硝子	362,000	493	178,466,000
オハラ	7,900	693	5,474,700
住友大阪セメント	363,000	336	121,968,000
太平洋セメント	1,127,000	350	394,450,000
デイ・シイ	21,500	313	6,729,500
リゾートソリューション	18,000	214	3,852,000
日本ヒユ - ム	20,000	602	12,040,000
日本コンクリ - ト	35,000	277	9,695,000
ジャパンパイル	14,900	686	10,221,400
東海カーボン	178,000	283	50,374,000
日本カーボン	108,000	192	20,736,000
東洋炭素	11,300	1,788	20,204,400
ノリタケ	106,000	278	29,468,000
T O T O	316,000	1,049	331,484,000
日本碍子	266,000	1,342	356,972,000
日本特殊陶業	176,000	1,959	344,784,000
ダントーホールディングス	30,000	109	3,270,000
M A R U W A	4,500	3,325	14,962,500
品川リフラクトリーズ	52,000	200	10,400,000
黒崎播磨	44,000	237	10,428,000
東京窯業	26,000	178	4,628,000
ニッカトー	7,300	474	3,460,200
フジインコーポレーテッド	18,600	1,120	20,832,000
エーアンドエーマテリアル	43,000	94	4,042,000

[次へ](#)

平成25年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
ニチアス	91,000	647	58,877,000	
新日鐵住金	8,651,000	289	2,500,139,000	
神戸製鋼所	2,836,000	140	397,040,000	
中山製鋼所	104,000	66	6,864,000	
合同製鐵	115,000	164	18,860,000	
J F Eホールディングス	522,100	2,425	1,266,092,500	
日新製鋼H D	86,700	824	71,440,800	
東京製鐵	112,900	426	48,095,400	
共英製鋼	19,100	1,581	30,197,100	
大和工業	42,300	3,120	131,976,000	
東京鐵鋼	40,000	378	15,120,000	
大阪製鐵	10,200	1,766	18,013,200	
淀川製鋼所	145,000	412	59,740,000	
東洋鋼鈹	43,000	360	15,480,000	
住友鋼管	14,000	1,078	15,092,000	
丸一鋼管	68,400	2,434	166,485,600	
モリ工業	31,000	320	9,920,000	
大同特殊鋼	316,000	544	171,904,000	
日本高周波	81,000	90	7,290,000	
日本冶金工	150,500	121	18,210,500	
山陽特殊製鋼	102,000	493	50,286,000	
愛知製鋼	109,000	464	50,576,000	
日立金属	172,200	1,069	184,081,800	
日本金属	53,000	121	6,413,000	
大平洋金属	131,000	444	58,164,000	
日本電工	81,000	284	23,004,000	
栗本鉄工所	90,000	267	24,030,000	
日本鑄鉄管	22,000	224	4,928,000	
日本製鋼所	316,000	597	188,652,000	
三菱製鋼	123,000	209	25,707,000	
日垂鋼業	29,000	330	9,570,000	
日本精線	14,000	448	6,272,000	
大紀アルミニウム	35,000	314	10,990,000	
日本軽金属H D	430,200	130	55,926,000	
三井金属	522,000	231	120,582,000	
東邦亜鉛	116,000	283	32,828,000	
三菱マテリアル	1,197,000	333	398,601,000	
住友鋁山	529,000	1,204	636,916,000	
D O W Aホールディングス	226,000	972	219,672,000	

古河機金	344,000	191	65,704,000	
大阪チタニウム	20,100	1,770	35,577,000	
東邦チタニウム	34,600	758	26,226,800	
住友軽金属	493,000	93	45,849,000	
古河スカイ	69,000	276	19,044,000	
古河電工	643,000	234	150,462,000	
住友電工	722,700	1,310	946,737,000	
フジクラ	329,000	370	121,730,000	
昭和電線HLDGS	264,000	86	22,704,000	
東京特殊電線	30,000	124	3,720,000	
タツタ電線	38,500	975	37,537,500	
沖電線	23,000	143	3,289,000	
カナレ電気	3,000	1,443	4,329,000	
平河ヒューテック	5,100	765	3,901,500	
リョービ	114,000	300	34,200,000	
アサヒHD	30,900	1,547	47,802,300	
東洋製罐グループHD	145,300	1,654	240,326,200	
ホッカンホールディングス	49,000	315	15,435,000	
コロナ	9,400	1,077	10,123,800	
横河ブリッジHLDGS	39,000	1,239	48,321,000	
日本橋梁	30,500	195	5,947,500	
駒井ハルテック	44,000	223	9,812,000	
高田機工	17,000	217	3,689,000	
三和ホールディングス	188,000	590	110,920,000	
文化シャッター-	53,000	582	30,846,000	
三協立山	26,800	2,380	63,784,000	
東洋シャッター-	5,700	600	3,420,000	
LIXILグループ	285,000	2,314	659,490,000	
日本フィルコン	15,000	422	6,330,000	
ノーリツ	40,200	1,772	71,234,400	
長府製作所	19,700	2,171	42,768,700	
リンナイ	32,900	7,240	238,196,000	
ユニプレス	34,300	1,922	65,924,600	
ダイニチ工業	10,600	763	8,087,800	
日東精工	27,000	327	8,829,000	
三洋工業	26,000	202	5,252,000	
岡部	40,400	1,003	40,521,200	
中国工業	33,000	85	2,805,000	
東プレ	39,400	899	35,420,600	
高周波熱錬	27,300	761	20,775,300	
東京製綱	139,000	141	19,599,000	
パイオラックス	8,800	2,676	23,548,800	
日本発条	148,000	1,170	173,160,000	

中央発條	26,000	319	8,294,000
アドバネクス	41,000	109	4,469,000
三浦工業	30,400	2,518	76,547,200
タクマ	69,000	792	54,648,000
リブセンス	3,400	5,340	18,156,000
ツガミ	55,000	556	30,580,000
オークマ	133,000	747	99,351,000
東芝機械	101,000	505	51,005,000
アマダ	313,000	738	230,994,000
アイダエンジニア	48,000	764	36,672,000
滝澤鉄工所	51,000	164	8,364,000
牧野フライス	95,000	603	57,285,000
オーエスジー	84,000	1,657	139,188,000
ダイジェット	24,000	160	3,840,000
旭ダイヤモンド	49,100	982	48,216,200
森精機製作所	107,800	1,242	133,887,600
ディスコ	22,700	6,530	148,231,000
日東工器	11,800	1,825	21,535,000
豊田自動織機	177,900	4,395	781,870,500
豊和工業	115,000	100	11,500,000
大阪機工	80,000	162	12,960,000
石川製作所	47,000	123	5,781,000
東洋機械金属	15,600	249	3,884,400
津田駒工業	50,000	176	8,800,000
エンシュウ	50,000	160	8,000,000
島精機製作所	26,600	1,788	47,560,800
日阪製作所	26,000	889	23,114,000
やまびこ	8,100	3,115	25,231,500
ペガサスミシン製造	18,900	397	7,503,300
ナプテスコ	101,200	2,030	205,436,000
三井海洋開発	16,900	3,135	52,981,500
レオン自動機	20,000	241	4,820,000
S M C	58,500	21,240	1,242,540,000
新川	17,200	747	12,848,400
ホソカワミクロン	34,000	731	24,854,000
ユニオンツール	11,200	1,963	21,985,600
オイレス工業	21,300	2,112	44,985,600
サト-ホールディングス	21,400	1,903	40,724,200
日本エアーテック	6,300	509	3,206,700
日精樹脂工業	15,000	775	11,625,000
ワイエイシイ	7,900	572	4,518,800
小松製作所	954,700	2,339	2,233,043,300
住友重機械	559,000	459	256,581,000

日立建機	104,400	2,134	222,789,600	
日 工	28,000	362	10,136,000	
巴工業	7,700	1,648	12,689,600	
井関農機	195,000	335	65,325,000	
T O W A	18,300	742	13,578,600	
丸山製作所	43,000	294	12,642,000	
北川鉄工所	88,000	168	14,784,000	
シンニッタン	16,300	395	6,438,500	
クボタ	1,068,000	1,621	1,731,228,000	
荏原実業	5,000	1,317	6,585,000	
東洋エンジニア	117,000	493	57,681,000	
三菱化工機	63,000	186	11,718,000	
月島機械	33,000	1,084	35,772,000	
帝国電機製作所	6,400	2,381	15,238,400	
東京機械	72,000	143	10,296,000	
新東工業	41,200	815	33,578,000	
渋谷工業	12,900	881	11,364,900	
アイチ コーポレーション	33,700	538	18,130,600	
小森コーポレーション	49,800	1,274	63,445,200	
鶴見製作所	14,000	883	12,362,000	
住友精密	32,000	402	12,864,000	
酒井重工業	39,000	298	11,622,000	
荏原製作所	421,000	568	239,128,000	
石井鉄工所	30,000	258	7,740,000	
西島製作所	23,600	876	20,673,600	
千代田化工建	158,000	1,248	197,184,000	
ダイキン工業	266,800	4,500	1,200,600,000	
オルガノ	35,000	526	18,410,000	
ト・ヨ・カネツ	110,000	284	31,240,000	
栗田工業	112,800	2,166	244,324,800	
椿本チエイン	104,000	590	61,360,000	
大同工業	40,000	267	10,680,000	
日本コンベヤ	65,000	80	5,200,000	
日 機 装	68,000	1,262	85,816,000	
木村化工機	18,800	676	12,708,800	
新興プランテック	45,000	778	35,010,000	
アネスト岩田	31,000	479	14,849,000	
ダイフク	89,500	941	84,219,500	
加藤製作所	46,000	534	24,564,000	
油研工業	39,000	231	9,009,000	
タダノ	94,000	1,499	140,906,000	
フジテック	57,000	948	54,036,000	
C K D	54,800	829	45,429,200	

キトー	12,400	1,618	20,063,200
平和	42,500	1,764	74,970,000
理想科学工業	13,000	2,232	29,016,000
SANKYO	59,300	4,620	273,966,000
日本金銭機械	18,100	1,343	24,308,300
マースエンジニアリング	11,200	1,878	21,033,600
福島工業	10,800	1,549	16,729,200
オーイズミ	7,000	1,023	7,161,000
ダイコク電機	8,200	1,805	14,801,000
アマノ	59,200	1,116	66,067,200
JUKI	126,000	156	19,656,000
サンデン	111,000	369	40,959,000
蛇の目マシン	190,000	82	15,580,000
ブラザー工業	252,500	1,166	294,415,000
マックス	31,000	1,103	34,193,000
モリタホールディングス	34,000	805	27,370,000
グローリー	58,300	2,348	136,888,400
大和冷機工業	32,000	575	18,400,000
セガサミーホールディングス	210,100	2,553	536,385,300
日本ピストンリング	72,000	177	12,744,000
リケン	71,000	419	29,749,000
TPR	21,800	1,699	37,038,200
ホシザキ電機	42,700	3,485	148,809,500
大豊工業	13,900	1,366	18,987,400
日本精工	435,000	1,015	441,525,000
NTN	420,000	333	139,860,000
ジェイテクト	207,700	1,217	252,770,900
不二越	181,000	463	83,803,000
ミネベア	266,000	383	101,878,000
日本トムソン	67,000	498	33,366,000
THK	129,900	2,285	296,821,500
ユーシン精機	9,700	1,824	17,692,800
前澤給装工業	7,500	1,315	9,862,500
イーグル工業	24,000	1,318	31,632,000
前澤工業	14,500	429	6,220,500
日本ピラ - 工業	20,000	720	14,400,000
キッツ	80,400	496	39,878,400
日立	4,694,000	650	3,051,100,000
東芝	3,858,000	470	1,813,260,000
三菱電機	1,955,000	1,061	2,074,255,000
富士電機	589,000	378	222,642,000
東洋電機製造	39,000	320	12,480,000
安川電機	214,000	1,215	260,010,000

シンフォニア テクノロジー	118,000	166	19,588,000
明 電 舎	194,000	345	66,930,000
オリジン電気	29,000	320	9,280,000
山洋電気	30,000	844	25,320,000
デンヨー	19,300	1,488	28,718,400
日立工機	52,100	826	43,034,600
三桜工業	24,900	732	18,226,800
マキタ	119,000	5,710	679,490,000
東芝テック	122,000	566	69,052,000
芝浦メカトロニクス	35,000	255	8,925,000
マブチモーター	27,600	5,400	149,040,000
日本電産	105,600	7,040	743,424,000
東光高岳HD	10,000	1,678	16,780,000
宮越ホールディングス	6,600	313	2,065,800
ダイヘン	107,000	475	50,825,000
ヤーマン	1,900	1,274	2,420,600
JVCケンウッド	117,900	237	27,942,300
第一精工	6,100	1,321	8,058,100
日新電機	39,000	648	25,272,000
大崎電気	26,000	531	13,806,000
オムロン	206,800	3,075	635,910,000
日東工業	28,700	1,805	51,803,500
I D E C	25,600	959	24,550,400
ジーエス・ユアサ コーポ	377,000	428	161,356,000
サクサホールディングス	50,000	168	8,400,000
メルコホールディングス	12,100	1,369	16,564,900
テクノメディカ	15	611,000	9,165,000
日本電気	2,529,000	226	571,554,000
富 士 通	1,884,000	402	757,368,000
沖 電 気	710,000	210	149,100,000
岩崎通信機	87,000	95	8,265,000
電気興業	51,000	558	28,458,000
サンケン電気	99,000	463	45,837,000
ナカヨ通信機	19,000	318	6,042,000
アイホン	11,300	1,613	18,226,900
ルネサスエレクトロニクス	50,700	442	22,409,400
セイコーエプソン	133,400	1,345	179,423,000
ワコム	143,600	1,163	167,006,800
アルバック	33,000	824	27,192,000
アクセル	9,900	1,841	18,225,900
ピクセラ	8,500	158	1,343,000
E I Z O	16,600	2,256	37,449,600
日本信号	49,400	754	37,247,600

京三製作所	42,000	348	14,616,000
能美防災	26,000	833	21,658,000
ホーチキ	18,000	475	8,550,000
エレコム	6,200	1,205	7,471,000
日本無線	42,000	342	14,364,000
パナソニック	2,233,200	838	1,871,421,600
シャープ	1,011,000	423	427,653,000
アンリツ	104,900	1,235	129,551,500
富士通ゼネラル	46,000	1,046	48,116,000
日立国際電気	45,000	1,129	50,805,000
ソ ニ ー	1,228,400	2,188	2,687,739,200
T D K	110,100	3,720	409,572,000
帝国通信工業	47,000	171	8,037,000
ミツミ電機	74,400	721	53,642,400
タムラ製作所	75,000	239	17,925,000
アルプス電気	143,300	786	112,633,800
池上通信機	63,000	106	6,678,000
パイオニア	237,500	204	48,450,000
日本電波工業	16,300	932	15,191,600
日本トリム	2,550	7,580	19,329,000
ローランド ディー . ジー .	8,700	3,360	29,232,000
日本コロムビア	195,000	44	8,580,000
フオスタ - 電機	20,000	1,695	33,900,000
クラリオン	103,000	128	13,184,000
S M K	58,000	315	18,270,000
ヨコオ	15,400	517	7,961,800
東 光	98,000	307	30,086,000
ティアック	106,000	60	6,360,000
ホシデン	52,900	559	29,571,100
ヒロセ電機	34,000	13,940	473,960,000
日本航空電子	45,000	1,028	46,260,000
T O A	21,000	817	17,157,000
ユニデン	57,000	230	13,110,000
アルパイン	38,200	991	37,856,200
スミダコーポレーション	12,700	488	6,197,600
アイコム	10,800	2,415	26,082,000
リオン	4,500	1,042	4,689,000
船井電機	19,700	1,039	20,468,300
横河電機	195,600	1,294	253,106,400
新電元工業	63,000	504	31,752,000
アズビル	54,700	2,165	118,425,500
日本光電工業	38,900	4,160	161,824,000
チ ノ ー	35,000	224	7,840,000

共和電業	22,000	314	6,908,000	
日本電子材料	9,200	408	3,753,600	
堀場製作所	38,700	3,715	143,770,500	
アドバンテスト	133,300	1,651	220,078,300	
小野測器	22,000	458	10,076,000	
エスペック	20,300	765	15,529,500	
パナソニックデバイス	17,700	412	7,292,400	
キーエンス	48,000	33,200	1,593,600,000	
日置電機	10,300	1,407	14,492,100	
シスメックス	69,000	6,350	438,150,000	
メガチップス	16,100	1,392	22,411,200	
O B A R A G R O U P	12,700	3,105	39,433,500	
日本電産コバル電子	20,500	456	9,348,000	
東京電波	6,000	780	4,680,000	
澤藤電機	12,000	264	3,168,000	
デンソー	482,900	4,790	2,313,091,000	
コーセル	28,500	1,220	34,770,000	
日立メディコ	14,000	1,304	18,256,000	
新日本無線	14,000	576	8,064,000	
オブテックス	12,500	1,562	19,525,000	
千代田インテグレ	8,600	1,429	12,289,400	
レーザーテック	14,000	1,346	18,844,000	
スタンレー電気	152,000	1,944	295,488,000	
岩崎電気	71,000	193	13,703,000	
ウシオ電機	118,500	1,319	156,301,500	
岡谷電機	11,200	337	3,774,400	
ヘリオステクノH	17,300	226	3,909,800	
日本セラミック	12,900	1,356	17,492,400	
日本デジタル研究所	16,600	1,072	17,795,200	
古河電池	14,000	563	7,882,000	
双信電機	9,900	352	3,484,800	
山一電機	21,700	180	3,906,000	
図 研	11,400	1,021	11,639,400	
日本電子	72,000	529	38,088,000	
カ シ オ	186,200	910	169,442,000	
ファナック	203,500	14,860	3,024,010,000	
日本シイエムケイ	42,200	327	13,799,400	
エンプラス	8,600	7,740	66,564,000	
ロ - ム	103,200	4,080	421,056,000	
浜松ホトニクス	76,200	3,675	280,035,000	
三井ハイテック	28,500	648	18,468,000	
新光電気工業	65,700	1,184	77,788,800	
京 セ ラ	162,500	10,760	1,748,500,000	

協栄産業	24,000	200	4,800,000	
太陽誘電	95,100	1,565	148,831,500	
村田製作所	205,100	7,780	1,595,678,000	
ユーシン	27,200	809	22,004,800	
双葉電子工業	36,200	1,217	44,055,400	
日東電工	168,700	6,200	1,045,940,000	
北陸電気工業	79,000	153	12,087,000	
東海理化電機	45,800	2,020	92,516,000	
ニチコン	61,600	1,077	66,343,200	
日本ケミコン	113,000	422	47,686,000	
K O A	24,700	982	24,255,400	
三井造船	757,000	173	130,961,000	
日立造船	773,500	157	121,439,500	
佐世保重工業	128,000	101	12,928,000	
三菱重工業	3,276,000	641	2,099,916,000	
川崎重工業	1,522,000	336	511,392,000	
I H I	1,336,000	424	566,464,000	
日本車輛	71,000	551	39,121,000	
ニチユ三菱フォークリフト	26,000	499	12,974,000	
近畿車輛	34,000	321	10,914,000	
F P G	12,600	1,470	18,522,000	
島根銀行	4,500	1,278	5,751,000	
じもとホールディングス	139,000	233	32,387,000	
全国保証	20,100	3,565	71,656,500	
日産自動車	2,469,200	1,092	2,696,366,400	
いすゞ自動車	1,133,000	799	905,267,000	
トヨタ自動車	2,511,300	6,380	16,022,094,000	*
日野自動車	244,000	1,632	398,208,000	
三菱自動車工業	4,875,000	146	711,750,000	
エフテック	6,800	1,637	11,131,600	
武蔵精密工業	20,800	2,466	51,292,800	
日産車体	67,000	1,182	79,194,000	
新明和工業	79,000	855	67,545,000	
極東開発工業	36,300	1,139	41,345,700	
日信工業	39,800	1,846	73,470,800	
トビー工業	146,000	206	30,076,000	
ティラド	66,000	388	25,608,000	
曙ブレーキ	90,900	510	46,359,000	
タチエス	26,300	1,368	35,978,400	
N O K	94,500	1,574	148,743,000	
フタバ産業	59,500	482	28,679,000	
カヤバ工業	149,000	520	77,480,000	
シロキ工業	43,000	215	9,245,000	

市光工業	46,000	149	6,854,000	
大同メタル工業	27,000	647	17,469,000	
プレス工業	83,000	451	37,433,000	
カルソニックカンセイ	133,000	454	60,382,000	
太平洋工業	39,900	794	31,680,600	
ケーヒン	40,400	1,503	60,721,200	
河西工業	24,000	531	12,744,000	
アイシン精機	178,800	3,895	696,426,000	
富士機工	23,000	307	7,061,000	
マ ッ ダ	3,095,000	436	1,349,420,000	
ダイハツ	207,000	2,020	418,140,000	
今仙電機製作所	14,300	1,486	21,249,800	
本田技研	1,649,100	3,790	6,250,089,000	
スズキ	408,600	2,485	1,015,371,000	
富士重工業	618,000	2,676	1,653,768,000	
ヤマハ発動機	297,100	1,410	418,911,000	
ショーワ	46,200	1,302	60,152,400	
小糸製作所	98,000	1,955	191,590,000	
T B K	20,000	480	9,600,000	
エクセディ	26,600	2,614	69,532,400	
ミツバ	36,000	1,803	64,908,000	
豊田合成	55,200	2,561	141,367,200	
愛三工業	20,300	1,103	22,390,900	
ヨ ロ ズ	14,300	1,625	23,237,500	
エフ・シー・シー	32,000	2,488	79,616,000	
新家工業	45,000	158	7,110,000	
シマノ	78,800	9,000	709,200,000	
タカタ	35,300	2,190	77,307,000	
テイ・エス テック	41,300	3,430	141,659,000	
小 野 建	16,900	950	16,055,000	
はるやま商事	8,200	711	5,830,200	
佐島電機	14,300	537	7,679,100	
カップ・クリエイトHD	14,200	1,828	25,957,600	
エコートレーディング	5,500	796	4,378,000	
伯東	11,900	923	10,983,700	
コンドーテック	15,800	596	9,416,800	
中山福	11,700	770	9,009,000	
ライトオン	14,600	967	14,118,200	
ナガイレーベン	25,600	1,570	40,192,000	
ジーンズメイト	6,600	271	1,788,600	
三菱食品	21,300	2,484	52,909,200	
良品計画	20,500	8,440	173,020,000	
三城ホールディングス	24,000	499	11,976,000	

松田産業	14,300	1,322	18,904,600
メディパルHD	193,000	1,301	251,093,000
アドヴァン	9,900	1,195	11,830,500
S P K	4,700	1,732	8,140,400
アズワン	12,700	2,418	30,708,600
スズデン	6,500	516	3,354,000
尾家産業	6,800	811	5,514,800
シモジマ	12,100	988	11,954,800
ドウシシャ	20,800	1,424	29,619,200
コナカ	23,500	1,142	26,837,000
高速	12,000	947	11,364,000
ハウス ローゼ	2,500	1,327	3,317,500
G - 7ホールディングス	6,000	744	4,464,000
イオン北海道	12,000	519	6,228,000
コジマ	28,500	312	8,892,000
ヒマラヤ	4,600	1,206	5,547,600
コーナン商事	25,200	1,176	29,635,200
黒田電気	25,800	1,369	35,320,200
ネットワンシステムズ	70,300	787	55,326,100
エコス	6,800	610	4,148,000
ワタミ	22,900	1,725	39,502,500
マルシェ	5,000	836	4,180,000
ドン・キホーテ	56,400	5,390	303,996,000
丸文	17,200	459	7,894,800
西松屋チェーン	38,100	956	36,423,600
ゼンショーホールディングス	73,400	1,188	87,199,200
ハビネット	12,100	745	9,014,500
幸楽苑	12,000	1,221	14,652,000
トーメンエレクトロニクス	9,900	1,260	12,474,000
ハークスレイ	5,700	765	4,360,500
サイゼリヤ	28,600	1,320	37,752,000
エクセル	8,400	1,175	9,870,000
マルカキカイ	6,300	1,254	7,900,200
アルゴグラフィックス	7,100	1,660	11,786,000
ガリバーインターナショナル	65,000	672	43,680,000
日本エム・ディ・エム	18,300	261	4,776,300
ポブラ	5,200	628	3,265,600
ユナイテッドアローズ	20,700	4,720	97,704,000
進和	11,400	1,230	14,022,000
エスケイジャパン	5,500	303	1,666,500
ダイトエレクトロン	9,300	397	3,692,100
ハイデイ日高	10,200	2,177	22,205,400
シークス	12,300	1,213	14,919,900

京都きもの友禅	12,900	1,077	13,893,300
コロワイド	64,000	978	62,592,000
田中商事	7,000	570	3,990,000
オーハシテクニカ	10,600	869	9,211,400
巻番屋	7,800	3,790	29,562,000
マクニカ	9,900	2,232	22,096,800
白銅	6,500	804	5,226,000
トップカルチャー	7,700	430	3,311,000
スギホールディングス	30,700	4,100	125,870,000
島津製作所	233,000	783	182,439,000
J M S	32,000	341	10,912,000
クボテック	46	37,950	1,745,700
ショットモリテックス	4,500	302	1,359,000
長野計器	13,800	764	10,543,200
ブイ・テクノロジー	41	258,500	10,598,500
スター精密	34,200	1,039	35,533,800
東京計器	62,000	237	14,694,000
愛知時計	24,000	286	6,864,000
日本電産トーソク	9,500	861	8,179,500
東京精密	35,100	2,232	78,343,200
マニー	6,000	3,700	22,200,000
ニコン	364,900	2,228	812,997,200
トプコン	43,900	1,026	45,041,400
オリンパス	230,500	3,065	706,482,500
理研計器	16,000	747	11,952,000
大日本スクリーン	200,000	547	109,400,000
キヤノン電子	17,900	1,837	32,882,300
タムロン	15,000	2,110	31,650,000
H O Y A	475,100	2,179	1,035,242,900
ノーリツ鋼機	17,600	690	12,144,000
エー・アンド・デイ	17,800	771	13,723,800
キヤノン	1,214,200	3,330	4,043,286,000
リコー	588,000	1,189	699,132,000
日本電産コバル	15,400	846	13,028,400
シチズンホールディングス	220,600	600	132,360,000
リズム時計	89,000	151	13,439,000
大研医器	4,800	2,112	10,137,600
パラマウントベッドHD	16,800	3,290	55,272,000
S H O B I	4,400	424	1,865,600
前田工織	14,500	922	13,369,000
永大産業	26,000	411	10,686,000
ダンロップスポーツ	10,700	1,150	12,305,000
バンダイナムコHLDGS	202,200	1,627	328,979,400

共立印刷	26,100	258	6,733,800
フランスベッドHLDGS	123,000	198	24,354,000
マーベラスAQL	231	49,850	11,515,350
パイロットコーポレーション	17,100	3,605	61,645,500
エイベックス・グループHD	36,500	3,205	116,982,500
トッパン・フォームズ	35,000	841	29,435,000
フジシールインターナショナル	23,800	2,871	68,329,800
タカラトミー	64,200	491	31,522,200
廣濟堂	16,900	492	8,314,800
アーク	66,300	279	18,497,700
レック	6,700	1,132	7,584,400
タカノ	8,900	468	4,165,200
プロネクサス	23,000	621	14,283,000
ホクシン	15,100	179	2,702,900
ウッドワン	33,000	326	10,758,000
大建工業	80,000	289	23,120,000
きもと	18,400	834	15,345,600
凸版印刷	552,000	711	392,472,000
大日本印刷	595,000	933	555,135,000
図書印刷	32,000	298	9,536,000
共同印刷	61,000	295	17,995,000
日本写真印刷	30,100	1,813	54,571,300
光村印刷	3,000	267	801,000
藤森工業	17,400	3,060	53,244,000
宝印刷	11,600	715	8,294,000
前澤化成工業	14,600	1,007	14,702,200
アシックス	182,100	1,636	297,915,600
ツツミ	9,800	2,502	24,519,600
ジェイ エス ピー	13,400	1,496	20,046,400
ニチハ	22,700	1,554	35,275,800
ローランド	17,400	1,049	18,252,600
エフピコ	10,100	6,390	64,539,000
小松ウオール工業	7,300	2,051	14,972,300
ヤマハ	143,600	1,229	176,484,400
河合楽器	68,000	177	12,036,000
クリナップ	20,100	807	16,220,700
ビジョン	14,800	8,400	124,320,000
天馬	16,400	1,300	21,320,000
兼松日産農林	31,000	162	5,022,000
キングジム	16,400	719	11,791,600
リンテック	41,800	1,838	76,828,400
TASAKI	4,100	499	2,045,900
信越ポリマー	40,300	328	13,218,400

東リ	54,000	203	10,962,000	
イトーキ	41,200	533	21,959,600	
任天堂	111,800	12,120	1,355,016,000	
三菱鉛筆	16,200	2,015	32,643,000	
松風	9,800	899	8,810,200	
タカラスタンダード	90,000	729	65,610,000	
コクヨ	101,600	718	72,948,800	
ナカバヤシ	43,000	205	8,815,000	
ニフコ	45,600	2,194	100,046,400	
グロープライド	95,000	117	11,115,000	
岡村製作所	75,000	635	47,625,000	
日本バルカー	85,000	257	21,845,000	
MUTOHホールディングス	27,000	518	13,986,000	
伊藤忠	1,539,200	1,215	1,870,128,000	
丸紅	1,582,000	708	1,120,056,000	
スクロール	25,700	266	6,836,200	
高島	36,000	309	11,124,000	
F & A アクアホールディングス	14,700	1,654	24,313,800	
三陽商会	106,000	244	25,864,000	
長瀬産業	109,200	1,318	143,925,600	
ナイガイ	77,000	60	4,620,000	
蝶理	12,400	1,042	12,920,800	
豊田通商	215,000	2,820	606,300,000	
オンワ - ドホールディングス	136,000	903	122,808,000	
三共生興	33,000	363	11,979,000	
兼松	411,000	118	48,498,000	
美津濃	97,000	578	56,066,000	
ツカモトコーポレーション	33,000	149	4,917,000	
ファミリーマート	59,200	4,385	259,592,000	
ルック	35,000	346	12,110,000	
三井物産	1,665,100	1,317	2,192,936,700	
日本紙パルプ	100,000	317	31,700,000	
東京エレクトロン	164,400	4,950	813,780,000	
日立ハイテクノロジーズ	58,500	2,279	133,321,500	
カメイ	22,900	813	18,617,700	
東都水産	36,000	156	5,616,000	
スターゼン	67,000	267	17,889,000	
セイコーHD	125,000	498	62,250,000	
山善	74,500	639	47,605,500	
椿本興業	22,000	267	5,874,000	
住友商事	1,138,400	1,327	1,510,656,800	
日本ユニシス	53,200	728	38,729,600	
内田洋行	43,000	297	12,771,000	

三菱商事	1,505,300	1,820	2,739,646,000
第一実業	45,000	431	19,395,000
キャノンマーケティングJPN	64,100	1,386	88,842,600
西華産業	67,000	256	17,152,000
佐藤商事	17,300	572	9,895,600
菱洋エレクトロ	22,800	830	18,924,000
東京産業	20,000	319	6,380,000
ユアサ商事	199,000	186	37,014,000
神鋼商事	50,000	195	9,750,000
阪和興業	193,000	401	77,393,000
カナデン	2,000	629	1,258,000
菱電商事	29,000	666	19,314,000
ニプロ	104,100	1,035	107,743,500
フルサト工業	9,800	892	8,741,600
岩谷産業	214,000	382	81,748,000
すてきナイスグループ	77,000	213	16,401,000
昭光通商	73,000	143	10,439,000
ニチモウ	29,000	190	5,510,000
極東貿易	23,000	216	4,968,000
イワキ	30,000	201	6,030,000
兼松エレクトロニクス	12,300	1,307	16,076,100
三愛石油	45,000	385	17,325,000
稲畑産業	47,900	846	40,523,400
G S Iクレオス	52,000	184	9,568,000
明和産業	15,800	333	5,261,400
ゴ・ルドウイン	47,000	467	21,949,000
ユニ・チャ・ム	113,100	5,490	620,919,000
デサント	51,000	701	35,751,000
ヤマトインタ-ナショナル	12,700	454	5,765,800
東邦ホールディングス	61,800	1,774	109,633,200
サンゲツ	34,300	2,576	88,356,800
ミツウロコグループ	31,400	493	15,480,200
シナネン	42,000	379	15,918,000
伊藤忠エネクス	42,800	509	21,785,200
サンリオ	48,700	5,120	249,344,000
サンワテクノス	9,500	987	9,376,500
リョーサン	31,400	1,720	54,008,000
新光商事	21,200	897	19,016,400
トーホー	42,000	366	15,372,000
三信電気	27,500	609	16,747,500
東陽テクニカ	26,600	1,266	33,675,600
モスフードサービス	25,300	1,898	48,019,400

平成25年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
加賀電子	19,000	800	15,200,000	
三益半導体	17,300	869	15,033,700	
ソーダニツカ	2,000	412	824,000	
立花エレテック	11,800	1,000	11,800,000	
木曽路	23,700	1,882	44,603,400	
千趣会	34,900	853	29,769,700	
タカキユー	15,000	406	6,090,000	
ケーヨー	32,500	481	15,632,500	
アデランス	24,500	1,389	34,030,500	
上新電機	42,000	845	35,490,000	
日本瓦斯	26,600	1,176	31,281,600	
ベスト電器	60,500	177	10,708,500	
マルエツ	39,000	308	12,012,000	
ロイヤルホールディングス	32,300	1,559	50,355,700	
東天紅	15,000	188	2,820,000	
いなげや	21,300	992	21,129,600	
島忠	43,700	2,508	109,599,600	
チヨダ	22,800	2,405	54,834,000	
ライフコーポレーション	12,200	1,238	15,103,600	
カスミ	39,600	626	24,789,600	
リンガーハット	17,500	1,487	26,022,500	
さが美	16,000	108	1,728,000	
MR MAX	19,800	328	6,494,400	
テンアライド	15,500	307	4,758,500	
AOKIホールディングス	16,700	3,045	50,851,500	
オークワ	30,000	974	29,220,000	
コメリ	29,700	2,552	75,794,400	
青山商事	53,200	2,681	142,629,200	
しまむら	22,400	12,200	273,280,000	
CFSコーポレーション	13,000	389	5,057,000	
高島屋	261,000	1,101	287,361,000	
松屋	38,900	1,408	54,771,200	
エイチ・ツー・オーリテイリング	125,000	944	118,000,000	
丸栄	32,000	304	9,728,000	
ニッセンHD	34,900	313	10,923,700	
パルコ	37,000	1,106	40,922,000	
丸井グループ	251,500	1,090	274,135,000	
クレディセゾン	168,800	2,488	419,974,400	
原信ナルスHLDGS	10,800	1,731	18,694,800	

井筒屋	106,000	92	9,752,000	
ダイエー	111,900	344	38,493,600	
イズミヤ	72,000	481	34,632,000	
イオン	680,100	1,385	941,938,500	
ユニグループ・HD	184,600	639	117,959,400	
イズミ	47,800	3,085	147,463,000	
東武ストア	26,000	268	6,968,000	
平和堂	39,100	1,698	66,391,800	
フジ	21,300	1,794	38,212,200	
ヤオコー	9,700	3,665	35,550,500	
ゼビオ	26,200	2,185	57,247,000	
ケーズホールディングス	48,200	3,520	169,664,000	
P a l t a c	22,800	1,340	30,552,000	
O L Y M P I Cグループ	11,400	682	7,774,800	
日産東京販売HD	29,000	333	9,657,000	
新生銀行	1,670,000	237	395,790,000	
あおぞら銀行	701,000	315	220,815,000	
三菱UFJフィナンシャルG	14,609,000	653	9,539,677,000	
りそなホールディングス	1,984,300	507	1,006,040,100	
三井住友トラストHD	3,791,000	489	1,853,799,000	
三井住友フィナンシャルG	1,459,000	4,715	6,879,185,000	
第四銀行	246,000	341	83,886,000	
北越銀行	196,000	208	40,768,000	
西日本シティ銀行	677,000	276	186,852,000	
千葉銀行	744,000	728	541,632,000	
横浜銀行	1,193,000	546	651,378,000	
常陽銀行	727,000	563	409,301,000	
群馬銀行	432,000	592	255,744,000	
武蔵野銀行	30,800	3,585	110,418,000	
千葉興業銀行	37,000	814	30,118,000	
筑波銀行	80,700	368	29,697,600	
東京都民銀行	36,600	1,157	42,346,200	
七十七銀行	302,000	496	149,792,000	
青森銀行	142,000	260	36,920,000	
秋田銀行	133,000	270	35,910,000	
山形銀行	118,000	429	50,622,000	
岩手銀行	13,900	3,975	55,252,500	
東邦銀行	163,000	303	49,389,000	
東北銀行	100,000	150	15,000,000	
みちのく銀行	97,000	196	19,012,000	
ふくおかフィナンシャルG	783,000	443	346,869,000	
静岡銀行	565,000	1,128	637,320,000	
十六銀行	242,000	377	91,234,000	

スルガ銀行	188,000	1,810	340,280,000	
八十二銀行	356,000	615	218,940,000	
山梨中央銀行	115,000	442	50,830,000	
大垣共立銀行	257,000	306	78,642,000	
福井銀行	166,000	223	37,018,000	
北國銀行	217,000	350	75,950,000	
清水銀行	6,600	2,850	18,810,000	
滋賀銀行	181,000	523	94,663,000	
南都銀行	188,000	384	72,192,000	
百五銀行	173,000	429	74,217,000	
京都銀行	345,000	863	297,735,000	
三重銀行	80,000	212	16,960,000	
ほくほくフィナンシャルG	1,312,000	203	266,336,000	
広島銀行	569,000	441	250,929,000	
山陰合同銀行	112,000	771	86,352,000	
中国銀行	143,000	1,424	203,632,000	
鳥取銀行	62,000	193	11,966,000	
伊予銀行	206,000	996	205,176,000	
百十四銀行	212,000	327	69,324,000	
四国銀行	139,000	236	32,804,000	
阿波銀行	157,000	562	88,234,000	
鹿児島銀行	134,000	682	91,388,000	
大分銀行	114,000	324	36,936,000	
宮崎銀行	129,000	326	42,054,000	
肥後銀行	158,000	601	94,958,000	
佐賀銀行	117,000	214	25,038,000	
十八銀行	120,000	241	28,920,000	
沖縄銀行	14,400	4,195	60,408,000	
琉球銀行	40,200	1,281	51,496,200	
八千代銀行	9,900	2,945	29,155,500	
セブン銀行	651,100	370	240,907,000	
みずほフィナンシャルG	24,932,300	216	5,385,376,800	
紀陽ホールディングス	769,000	140	107,660,000	
山口フィナンシャルG	192,000	998	191,616,000	
アクリーティブ	108	20,490	2,212,920	
芙蓉総合リース	18,400	3,890	71,576,000	
興銀リース	29,100	3,350	97,485,000	
東京センチュリーリース	45,300	2,848	129,014,400	
S B Iホールディングス	245,300	1,250	306,625,000	
日本証券金融	74,000	813	60,162,000	
大阪証券金融	24,900	317	7,893,300	
アイフル	160,900	1,140	183,426,000	
日本アジア投資	132,000	117	15,444,000	

ポケットカード	19,400	735	14,259,000
長野銀行	68,000	184	12,512,000
名古屋銀行	174,000	389	67,686,000
北洋銀行	290,300	394	114,378,200
愛知銀行	7,000	4,655	32,585,000
第三銀行	110,000	163	17,930,000
中京銀行	79,000	186	14,694,000
東日本銀行	84,000	217	18,228,000
大光銀行	69,000	242	16,698,000
愛媛銀行	114,000	246	28,044,000
トマト銀行	76,000	179	13,604,000
みなと銀行	175,000	178	31,150,000
京葉銀行	159,000	527	83,793,000
関西アーバン銀行	269,000	111	29,859,000
栃木銀行	97,000	365	35,405,000
北日本銀行	5,700	2,254	12,847,800
東和銀行	213,000	92	19,596,000
福島銀行	238,000	80	19,040,000
大東銀行	125,000	87	10,875,000
リコーリース	13,300	2,881	38,317,300
イオンフィナンシャルサービス	70,300	3,005	211,251,500
アコム	38,750	3,450	133,687,500
ジャックス	107,000	589	63,023,000
オリコ	386,000	281	108,466,000
日立キャピタル	37,900	2,305	87,359,500
オリックス	1,150,400	1,485	1,708,344,000
三菱UFJリース	489,100	497	243,082,700
ジャフコ	26,400	4,245	112,068,000
トモニホールディングス	148,700	384	57,100,800
大和証券G本社	1,911,000	910	1,739,010,000
野村ホールディングス	3,944,300	821	3,238,270,300
岡三証券グループ	164,000	953	156,292,000
丸三証券	59,200	761	45,051,200
東洋証券	73,000	358	26,134,000
東海東京HD	221,600	813	180,160,800
光世証券	47,000	330	15,510,000
水戸証券	57,000	517	29,469,000
いちよし証券	43,300	1,414	61,226,200
松井証券	114,600	1,004	115,058,400
NK S Jホールディングス	428,600	2,535	1,086,501,000
だいこう証券ピジ	11,200	667	7,470,400
日本取引所グループ	48,700	11,610	565,407,000
マネックスG	2,187	43,750	95,681,250

カブドットコム証券	75,000	601	45,075,000	
極東証券	26,000	1,904	49,504,000	
岩井コスモホールディング	18,300	1,391	25,455,300	
フィデアホール	112,200	226	25,357,200	
池田泉州HD	159,400	526	83,844,400	
MS & AD	576,600	2,788	1,607,560,800	
SONY FH	184,800	1,682	310,833,600	
小林洋行	5,200	278	1,445,600	
第一生命	10,316	151,600	1,563,905,600	
東京海上HD	747,200	3,455	2,581,576,000	
イー・ギャランティ	5,600	3,215	18,004,000	
アサックス	34	157,000	5,338,000	
NECキャピタルソリューション	7,900	2,691	21,258,900	
T & Dホールディングス	661,600	1,402	927,563,200	
三井不動産	909,000	3,225	2,931,525,000	
三菱地所	1,350,000	2,771	3,740,850,000	
平和不動産	36,600	1,823	66,721,800	
東京建物	368,000	894	328,992,000	
ダイビル	49,800	1,143	56,921,400	
東急不動産	421,000	1,043	439,103,000	
京阪神ビルディング	25,400	565	14,351,000	
住友不動産	462,000	4,490	2,074,380,000	
太平洋興発	72,000	104	7,488,000	
大京	298,000	328	97,744,000	
テーオーシー	66,700	726	48,424,200	
東京楽天地	27,000	512	13,824,000	
レオパレス21	184,900	464	85,793,600	
フジ住宅	24,900	686	17,081,400	
空港施設	23,600	669	15,788,400	
明和地所	9,700	444	4,306,800	
住友不動産販売	6,970	5,840	40,704,800	
ゴールドクレスト	15,200	2,594	39,428,800	
東栄住宅	13,200	2,149	28,366,800	
リロ・ホールディング	7,000	5,240	36,680,000	
日本エスリード	8,600	1,160	9,976,000	
東急リパブル	20,500	2,189	44,874,500	
飯田産業	21,000	1,872	39,312,000	
日神不動産	11,600	693	8,038,800	
アーネストワン	32,000	2,167	69,344,000	
タカラレーベン	81,200	418	33,941,600	
サンヨーハウジ 名古屋	10,100	1,354	13,675,400	
イオンモール	99,400	2,641	262,515,400	
タクトホーム	103	199,100	20,507,300	

ランド	40,500	21	850,500
トーセイ	25,100	940	23,594,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,199	131,700	157,908,300
サンフロンティア不動産	174	108,300	18,844,200
ランドビジネス	13,100	621	8,135,100
グランディハウス	13,500	387	5,224,500
東武鉄道	1,110,000	537	596,070,000
相鉄ホールディングス	312,000	366	114,192,000
東京急行	1,150,000	711	817,650,000
京浜急行	502,000	891	447,282,000
小田急電鉄	626,000	997	624,122,000
京王電鉄	547,000	707	386,729,000
京成電鉄	293,000	974	285,382,000
富士急行	53,000	1,082	57,346,000
新京成電鉄	27,000	380	10,260,000
東日本旅客鉄道	360,500	8,380	3,020,990,000
西日本旅客鉄道	168,500	4,385	738,872,500
東海旅客鉄道	162,500	12,930	2,101,125,000
鴻池運輸	7,800	1,333	10,397,400
西日本鉄道	253,000	387	97,911,000
ハマキョウレックス	5,600	3,565	19,964,000
サカイ引越センター	3,600	2,650	9,540,000
近畿日本鉄道	1,765,000	448	790,720,000
阪急阪神HLDGS	1,234,000	590	728,060,000
南海電鉄	407,000	381	155,067,000
京阪電鉄	438,000	410	179,580,000
名糖運輸	8,400	637	5,350,800
名古屋鉄道	681,000	288	196,128,000
トランコム	5,200	2,916	15,163,200
日本通運	774,000	492	380,808,000
ヤマトホールディングス	364,000	2,244	816,816,000
山 九	237,000	378	89,586,000
日 新	74,000	288	21,312,000
丸 運	11,200	248	2,777,600
丸全昭和運輸	66,000	348	22,968,000
センコー	79,000	516	40,764,000
トナミホールディングス	41,000	225	9,225,000
日本梱包運輸	59,700	1,589	94,863,300
日石輸送	23,000	218	5,014,000
福山通運	118,000	602	71,036,000
セイノーホールディングス	151,000	921	139,071,000
神奈川中央交通	23,000	515	11,845,000
日立物流	33,900	1,578	53,494,200

日本郵船	1,547,000	286	442,442,000
商船三井	952,000	406	386,512,000
川崎汽船	855,000	210	179,550,000
N S ユナイテッド海運	85,000	154	13,090,000
乾 汽 船	23,500	362	8,507,000
明治海運	18,000	419	7,542,000
飯野海運	81,000	571	46,251,000
共栄タンカー	17,000	249	4,233,000
第一中央汽船	145,000	110	15,950,000
日本航空	220,000	5,340	1,174,800,000
A N A ホールディングス	3,842,000	218	837,556,000
パスコ	19,000	386	7,334,000
三菱倉庫	139,000	1,479	205,581,000
三井倉庫	91,000	532	48,412,000
住友倉庫	131,000	603	78,993,000
渋沢倉庫	51,000	451	23,001,000
ヤマタネ	90,000	189	17,010,000
東陽倉庫	32,000	263	8,416,000
日本トランスシティ	45,000	335	15,075,000
ケイヒン	36,000	186	6,696,000
安田倉庫	15,400	966	14,876,400
東洋埠頭	58,000	198	11,484,000
宇徳	16,200	346	5,605,200
上 組	216,000	848	183,168,000
サンリツ	1,700	524	890,800
キムラユニティー	4,700	977	4,591,900
キューソー流通システム	5,500	966	5,313,000
郵船ロジスティクス	15,600	902	14,071,200
近鉄エクスプレス	17,500	3,975	69,562,500
東海運	11,200	247	2,766,400
エーアイティー	3,300	1,289	4,253,700
東京放送HD	104,300	1,345	140,283,500
日本テレビH L D S	176,400	1,857	327,574,800
テレビ朝日	49,000	2,227	109,123,000
スカパーJ S A T H D	1,685	48,250	81,301,250
テレビ東京HD	14,300	1,732	24,767,600
アイ・ティー・シーネットワーク	17,600	894	15,734,400
日本電信電話	812,200	5,200	4,223,440,000
K D D I	544,400	5,200	2,830,880,000
光通信	19,400	5,710	110,774,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	15,895	157,200	2,498,694,000
G M O インターネット	64,600	1,032	66,667,200
学研ホールディングス	61,000	293	17,873,000

ゼンリン	25,800	1,120	28,896,000
昭文社	12,700	590	7,493,000
K A D O K A W A	16,700	3,765	62,875,500
インプレスホールディングス	17,900	136	2,434,400
東京電力	1,658,300	670	1,111,061,000
中部電力	598,100	1,487	889,374,700
関西電力	797,700	1,446	1,153,474,200
中国電力	270,200	1,579	426,645,800
北陸電力	191,500	1,582	302,953,000
東北電力	488,400	1,293	631,501,200
四国電力	176,000	1,940	341,440,000
九州電力	431,700	1,519	655,752,300
北海道電力	183,000	1,420	259,860,000
沖縄電力	11,700	3,985	46,624,500
電源開発	121,300	3,270	396,651,000
東京瓦斯	2,347,000	559	1,311,973,000
大阪瓦斯	1,897,000	426	808,122,000
東邦瓦斯	497,000	514	255,458,000
北海道瓦斯	35,000	255	8,925,000
西部瓦斯	220,000	245	53,900,000
静岡瓦斯	51,000	709	36,159,000
アイネット	8,500	780	6,630,000
松竹	127,000	925	117,475,000
東宝	137,800	2,258	311,152,400
エイチ・アイ・エス	16,700	4,670	77,989,000
東映	81,000	654	52,974,000
A O I P r o .	7,500	652	4,890,000
N T T データ	1,191	371,000	441,861,000
共立メンテナンス	10,200	3,835	39,117,000
イチネンホールディングス	21,600	704	15,206,400
建設技術研究所	11,500	767	8,820,500
スペース	11,200	941	10,539,200
アインファーマシーズ	11,700	4,290	50,193,000
燦ホールディングス	4,800	1,351	6,484,800
スバル興業	3,000	339	1,017,000
東京テアトル	79,000	175	13,825,000
よみうりランド	41,000	941	38,581,000
東京都競馬	158,000	441	69,678,000
常磐興産	64,000	195	12,480,000
カナモト	24,000	2,208	52,992,000
東京ドーム	152,000	703	106,856,000
D T S	18,400	1,471	27,066,400
スクウェア・エニックス・HD	70,100	1,218	85,381,800

シーイーシー	12,700	665	8,445,500
カブコン	37,100	1,685	62,513,500
アゴラ・ホスピタリティーG	86,000	47	4,042,000
日本空港ビルデング	66,700	1,697	113,189,900
トランス・コスモス	26,600	1,670	44,422,000
乃村工藝社	44,000	740	32,560,000
ジャステック	11,400	702	8,002,800
S C S K	45,900	1,955	89,734,500
藤田観光	52,000	435	22,620,000
K N T - C Tホールディングス	67,000	137	9,179,000
日本管財	7,600	1,473	11,194,800
トーカイ	9,100	2,788	25,370,800
白 洋 舎	5,000	216	1,080,000
セコム	212,400	5,600	1,189,440,000
日本システムウエア	7,800	433	3,377,400
セントラル警備保障	9,600	922	8,851,200
アイネス	26,400	666	17,582,400
丹青社	18,000	474	8,532,000
メイテック	30,100	2,519	75,821,900
T K C	16,200	1,723	27,912,600
アサツー ディ・ケイ	33,700	2,620	88,294,000
富士ソフト	26,600	2,002	53,253,200
応用地質	21,500	1,647	35,410,500
船井総合研究所	21,500	739	15,888,500
N S D	38,100	1,092	41,605,200
進学会	10,900	361	3,934,900
丸紅建材リース	17,000	177	3,009,000
コナミ	87,200	2,113	184,253,600
ベネッセホールディングス	62,200	3,590	223,298,000
イオンディライト	19,900	1,843	36,675,700
ナック	9,200	1,890	17,388,000
福井コンピュータH L D S	1,500	672	1,008,000
ニチイ学館	40,100	866	34,726,600
ダイセキ	30,200	1,850	55,870,000
ステップ	6,800	871	5,922,800
日鐵商事	43,000	273	11,739,000
元気寿司	6,100	1,243	7,582,300
トラスコ中山	22,200	2,047	45,443,400
ヤマダ電機	87,990	4,450	391,555,500
オートバックスセブン	71,400	1,515	108,171,000
アークランドサカモト	12,600	1,734	21,848,400
ニトリホールディングス	38,200	8,450	322,790,000
グルメ杵屋	14,000	702	9,828,000

愛眼	16,100	291	4,685,100
吉野家ホールディングス	522	115,200	60,134,400
加藤産業	28,000	2,094	58,632,000
イノテック	16,700	469	7,832,300
イエローハット	18,200	1,948	35,453,600
富士エレクトロニクス	10,000	1,315	13,150,000
松屋フーズ	9,300	1,577	14,666,100
J B C Cホールディングス	16,300	1,283	20,912,900
J Kホールディングス	16,300	572	9,323,600
サガミチェーン	23,000	807	18,561,000
日伝	8,700	2,356	20,497,200
ミロク情報サービス	13,500	359	4,846,500
北沢産業	11,000	176	1,936,000
杉本商事	10,500	853	8,956,500
因幡電機産業	22,700	2,693	61,131,100
住金物産	101,000	287	28,987,000
プレナス	21,600	1,705	36,828,000
ミニストップ	14,300	1,642	23,480,600
アークス	33,000	1,898	62,634,000
パロー	41,500	1,710	70,965,000
ミスミグループ本社	71,700	2,715	194,665,500
江守商事	4,600	1,298	5,970,800
アルテック	9,500	441	4,189,500
ベルク	9,600	1,783	17,116,800
大庄	9,100	1,298	11,811,800
タキヒヨー	29,000	436	12,644,000
ファーストリテイリング	45,100	38,700	1,745,370,000
ソフトバンク	934,400	5,720	5,344,768,000
スズケン	74,200	3,190	236,698,000
サンドラッグ	36,700	4,405	161,663,500
東京デリカ	6,600	1,639	10,817,400
ジェコス	13,500	635	8,572,500
ヤマザワ	5,100	1,657	8,450,700
やまや	4,000	1,420	5,680,000
ペルーナ	24,100	1,074	25,883,400
合計	306,054,644		323,911,813,000

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		876,030,630	1,008,631,797
国債証券		334,182,536,300	351,286,599,200
地方債証券		28,812,766,678	29,811,806,539
特殊債券		33,064,745,956	30,677,970,955
社債券		29,476,121,980	29,889,205,480
未収入金		-	2,346,344,000
未収利息		1,194,438,844	1,215,876,334
前払費用		64,014,583	53,775,022
流動資産合計		427,670,654,971	446,290,209,327
資産合計		427,670,654,971	446,290,209,327
負債の部			
流動負債			
未払解約金		191,180,000	449,588,000
流動負債合計		191,180,000	449,588,000
負債合計		191,180,000	449,588,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	368,547,050,465	381,744,908,581
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		58,932,424,506	64,095,712,746
元本等合計		427,479,474,971	445,840,621,327
純資産合計		427,479,474,971	445,840,621,327
負債純資産合計		427,670,654,971	446,290,209,327

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	349,359,284,958円	368,547,050,465円
同期中追加設定元本額	23,004,633,299円	52,235,681,787円
同期中一部解約元本額	3,816,867,792円	39,037,823,671円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ ファンド	3,991,216,113円	6,041,625,889円
D I A M国内債券インデック スファンド< D C 年金 >	9,774,671,371円	9,584,300,613円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 1 安定型	3,017,915,316円	3,459,872,744円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 2 安定・成長型	4,653,416,935円	5,536,825,211円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 3 成長型	1,837,401,615円	2,217,350,199円
D I A M D C バランス3 0インデックスファンド	1,205,781,061円	1,320,114,855円
D I A M D C バランス5 0インデックスファンド	1,246,466,334円	1,478,113,206円
D I A M D C バランス7 0インデックスファンド	164,434,297円	204,711,146円
マネックス資産設計ファンド < 隔月分配型 >	171,444,580円	170,792,784円
マネックス資産設計ファンド < 育成型 >	2,111,906,126円	2,117,734,243円
マネックス資産設計ファン ド エボリューション	4,544,968円	3,912,440円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国10）	252,886円	3,593,317円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国20）	140,671円	2,698,048円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国30）	23,301円	670,204円
投資のソムリエ	15,516,654円	16,276,477円
クルーズコントロール	9,210,180円	1,253,047円
みずほエマージングボンド オープン	10,801,911円	10,801,911円

D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券 ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A Mロシア株式ファンド	6,676,001円	- 円
D I A M国内債券パッシブ ファンド(適格機関投資家向 け)	14,957,916,660円	13,991,244,497円
D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限 定)	728,798,402円	756,941,623円
D I A Mグローバル・ balan スファンド25 V A (適格機 関投資家限定)	12,032,808,688円	10,682,521,021円
D I A Mグローバル・ balan スファンド50 V A (適格機 関投資家限定)	705,141,298円	701,513,587円
D I A M国際分散バランス ファンド30 V A (適格機関 投資家限定)	485,451,984円	502,326,175円
D I A M国際分散バランス ファンド50 V A (適格機関 投資家限定)	1,184,383,018円	1,232,190,346円
D I A M国内重視バランス ファンド30 V A (適格機関 投資家限定)	510,141,484円	494,415,878円
D I A M国内重視バランス ファンド50 V A (適格機関 投資家限定)	385,983,341円	413,470,795円
D I A M世界バランスファン ド40 V A (適格機関投資家 限定)	29,480,241,613円	32,291,705,733円
D I A M世界バランスファン ド50 V A (適格機関投資家 限定)	9,769,462,046円	10,739,659,742円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限 定)	13,019,722,192円	13,767,285,744円
D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家 限定)	4,819,111,382円	5,213,581,358円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限 定)	7,448,476,648円	8,260,686,736円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関 投資家限定)	1,670,954,094円	1,723,854,087円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機 関投資家限定)	6,098,817,308円	6,368,010,036円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	7,346,245,786円	7,299,350,500円

D I A M世界アセットバ ランスファンドV A (適 格機関投資家向け)	14,072,147,308円	13,379,912,347円
D I A Mグローバル 募 ファンド(適格機関投資家 向け)	608,623,338円	461,343,393円
D I A M世界バ ランスファンド5 5 V A (適 格機関投資家 限定)	13,481,093,387円	13,843,432,679円
D I A Mアイエヌ ジー世界バ ランスファンド3 5 V A (適 格機関投資家 限定)	7,151,217,773円	8,368,660,728円
D I A Mグローバル 分散ファン ドV A (適格機関投資家 限定)	1,494,650,417円	1,549,003,873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)	106,724,960,968円	110,271,679,860円
D I A M世界ア セットバ ランスファン ド4 0 V A (適格機 関投資家 限定)	2,499,662,584円	2,302,038,182円
D I A M世界ア セットバ ランスファン ド2 5 V A (適格機 関投資家 限定)	9,625,232,600円	9,792,868,160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)	32,937,435,569円	33,606,955,408円
D I A Mバ ランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	2,071,352,106円	962,691,235円
D I A Mバ ランス5 0 V A (適格機関投資家 限定)	261,734円	375,042,348円
D I A Mバ ランス7 0 V A (適格機関投資家 限定)	163,175円	200,402円
D I A M世界ア セットバ ランスファン ド4 V A (適格機 関投資家 限定)	35,827,613,691円	37,131,289,980円
D I A M世界バ ランス2 5 V A (適格機関投資家 限定)	912,114,674円	932,253,475円
D I A M国内バ ランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	201,397,299円	213,806,786円
D I A Mバ ランス2 0 V A (適格機関投資家 限定)	2,054,001,727円	1,924,614,132円
D I A Mバ ランス4 0 V A (適格機関投資家 限定)	339,154円	372,357円
D I A Mバ ランス6 0 V A (適格機関投資家 限定)	247,769円	280,116円
計	368,547,050,465円	381,744,908,581円
2 . 受益権の総数	368,547,050,465口	381,744,908,581口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,367,061,600	476,332,700
地方債証券	12,073,749	247,033,930
特殊債券	10,446,711	241,164,548
社債券	46,541,540	89,944,780
合計	1,391,082,680	1,054,475,958

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成24年2月15日から平成25年1月11日まで及び平成25年2月15日から平成25年7月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1599円	1.1679円
（1万口当たり純資産額）	（11,599円）	（11,679円）

[前へ](#) [次へ](#)

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25年7月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 1 9 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	1,999,880,000	
	3 2 1 回 利付国庫債券(2年)	2,200,000,000	2,199,846,000	
	3 2 2 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	2,999,580,000	
	3 2 3 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	2,999,340,000	
	3 2 4 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	1,999,540,000	
	3 2 5 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	2,999,280,000	
	3 2 6 回 利付国庫債券(2年)	5,500,000,000	5,498,625,000	
	3 2 7 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	999,730,000	
	3 2 8 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	2,999,160,000	
	8 5 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,517,375,000	
	8 7 回 利付国庫債券(5年)	3,800,000,000	3,820,862,000	
	8 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,522,225,000	
	8 9 回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,322,747,000	
	9 1 回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,414,352,000	
	9 2 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,015,200,000	
	9 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,531,360,000	
	9 5 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,024,800,000	
	9 6 回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,221,406,000	
	9 7 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,037,150,000	
	9 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,023,250,000	
	1 0 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,015,680,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,515,505,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,517,235,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,496,755,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	4,992,750,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	4,989,000,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	2,977,110,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,004,830,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	646,518,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,077,650,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,397,903,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	1,400,000,000	1,426,432,000	
2 6 3 回 利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,747,439,000		
2 6 6 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,342,182,000		
2 6 9 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,529,610,000		

270回	利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,431,640,000	
272回	利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,438,808,000	
274回	利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,479,944,000	
277回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,597,325,000	
280回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,576,770,000	
282回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,566,260,000	
284回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,419,991,000	
285回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,481,929,000	
286回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,292,696,000	
288回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,819,132,000	
289回	利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	4,114,500,000	
290回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,632,275,000	
293回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,510,338,000	
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,244,840,000	
297回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,231,680,000	
299回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,265,726,000	
301回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,835,980,000	
303回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,967,972,000	
305回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,793,572,000	
306回	利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,557,398,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,894,518,000	
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,077,560,000	
310回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	3,911,340,000	
312回	利付国庫債券(10年)	3,700,000,000	3,853,772,000	
313回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,713,840,000	
315回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,638,285,000	
317回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,578,350,000	
318回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,251,062,000	
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,061,220,000	
320回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,044,500,000	
321回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,597,245,000	
324回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,008,760,000	
325回	利付国庫債券(10年)	6,000,000,000	6,010,260,000	
326回	利付国庫債券(10年)	6,000,000,000	5,949,960,000	
328回	利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,374,615,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	998,620,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	119,892,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	113,776,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	223,922,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	241,200,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	218,936,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	224,444,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	330,642,000	

8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	509,875,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	399,404,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	319,953,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	314,601,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	558,670,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	226,974,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	453,720,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	223,394,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	900,778,200	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	219,694,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	340,575,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	549,160,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	533,722,600	
23回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	454,292,000	
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	681,510,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	658,662,000	
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,117,220,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,024,254,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	912,048,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,457,885,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,652,010,000	
31回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,296,948,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,763,232,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,867,392,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,619,805,000	
35回	利付国庫債券(30年)	2,200,000,000	2,280,124,000	
36回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,071,720,000	
37回	利付国庫債券(30年)	2,200,000,000	2,229,282,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,781,046,000	
39回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	303,474,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	671,166,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	443,348,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	793,461,600	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	900,936,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	989,679,400	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,013,094,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	556,405,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,058,319,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	567,595,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	851,955,000	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	660,096,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	610,780,500	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	784,518,000	

55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	895,058,100
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,240,299,300
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	659,550,000
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,044,826,200
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	815,464,000
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,299,402,000
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	663,378,000
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,216,479,000
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,102,464,000
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,448,087,500
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,410,250,000
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,329,789,300
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,580,012,000
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,603,598,500
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,563,044,000
83回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,803,552,000
85回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,252,560,000
88回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,069,064,000
90回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,818,304,000
92回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,908,964,000
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	776,279,000
94回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,233,694,000
95回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,947,571,000
97回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,036,628,000
99回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,785,904,000
100回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,255,200,000
102回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,191,422,000
105回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,332,218,000
107回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,215,600,000
109回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,938,114,000
111回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,233,100,000
113回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,417,492,000
114回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,410,518,000
116回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,768,525,000
118回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,288,824,000
119回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,358,149,000
121回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,217,768,000
123回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,709,125,000
125回	利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,521,421,000
128回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,256,280,000
129回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,031,450,000
130回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,261,952,000
132回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,423,808,000

	1 3 4 回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,227,444,000	
	1 3 5 回 利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,208,556,000	
	1 3 7 回 利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,209,482,000	
	1 4 0 回 利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,707,830,000	
	1 4 1 回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,503,650,000	
	1 4 3 回 利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,654,316,000	
	1 4 5 回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	299,553,000	
国債証券 合計		336,520,000,000	351,286,599,200	
地方債証券	6 1 7 回 東京都公募公債	200,000,000	203,520,000	
	6 1 9 回 東京都公募公債	200,000,000	204,566,000	
	6 2 0 回 東京都公募公債	200,000,000	203,960,000	
	6 2 2 回 東京都公募公債	106,800,000	109,070,568	
	6 2 3 回 東京都公募公債	200,000,000	204,368,000	
	6 2 7 回 東京都公募公債	100,000,000	102,921,000	
	6 2 8 回 東京都公募公債	100,000,000	103,410,000	
	6 2 9 回 東京都公募公債	494,000,000	509,165,800	
	6 3 2 回 東京都公募公債	115,300,000	120,873,602	
	6 3 3 回 東京都公募公債	100,000,000	104,754,000	
	6 3 4 回 東京都公募公債	200,000,000	209,742,000	
	6 3 8 回 東京都公募公債	200,000,000	210,758,000	
	6 4 0 回 東京都公募公債	150,000,000	158,020,500	
	6 4 1 回 東京都公募公債	100,000,000	105,450,000	
	6 5 9 回 東京都公募公債	203,500,000	216,314,395	
	6 6 4 回 東京都公募公債	300,000,000	316,569,000	
	6 6 7 回 東京都公募公債	300,000,000	319,794,000	
	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	211,180,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	519,035,000	
	6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	204,404,000	
	6 9 7 回 東京都公募公債	500,000,000	514,445,000	
	7 0 1 回 東京都公募公債	700,000,000	712,943,000	
	7 0 8 回 東京都公募公債	500,000,000	503,420,000	
	1 6 年度 1 1 回 北海道公募公債	250,000,000	254,335,000	
	1 8 年度 4 回 北海道公募公債	190,500,000	200,266,935	
	1 8 年度 6 回 北海道公募公債	100,000,000	105,713,000	
	1 9 年度 4 回 北海道公募公債	300,000,000	319,572,000	
	2 1 年度 6 回 北海道公募公債	200,000,000	213,014,000	
	2 2 年度 1 2 回 北海道公募公債	200,000,000	207,836,000	
	1 3 0 回 神奈川県公募公債	156,200,000	159,145,932	
	1 3 5 回 神奈川県公募公債	200,000,000	206,476,000	
	1 3 6 回 神奈川県公募公債	100,000,000	103,215,000	
	1 6 6 回 神奈川県公募公債	300,000,000	316,368,000	
	1 9 4 回 神奈川県公募公債	300,000,000	298,590,000	
2 7 8 回 大阪府公募公債	200,000,000	204,028,000		

285回	大阪府公募公債	100,000,000	103,103,000	
286回	大阪府公募公債	200,000,000	206,420,000	
289回	大阪府公募公債	200,000,000	208,660,000	
293回	大阪府公募公債	200,000,000	211,482,000	
301回	大阪府公募公債	100,000,000	105,775,000	
307回	大阪府公募公債	100,000,000	106,409,000	
310回	大阪府公募公債	240,000,000	253,699,200	
336回	大阪府公募公債	200,000,000	211,328,000	
345回	大阪府公募公債	300,000,000	311,466,000	
356回	大阪府公募公債	200,000,000	203,716,000	
364回	大阪府公募公債	300,000,000	298,086,000	
83回	大阪府公募公債 5年	300,000,000	300,114,000	
18年度1回	京都府公募公債	100,000,000	105,047,000	
17年度2回	兵庫県公募公債	200,000,000	204,236,000	
17年度9回	兵庫県公募公債	306,000,000	316,070,460	
17年度13回	兵庫県公募公債	105,000,000	109,153,800	
18年度1回	兵庫県公募公債	120,000,000	125,230,800	
19年度2回	兵庫県公募公債	200,000,000	211,594,000	
18年度5回	静岡県公募公債	129,800,000	136,724,830	
21年度5回	静岡県公募公債	197,000,000	207,565,110	
22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	206,180,000	
23年度9回	静岡県公募公債	200,000,000	204,404,000	
16年度2回	愛知県公募公債	200,000,000	203,684,000	
18年度2回	愛知県公募公債	160,300,000	168,794,297	
20年度4回	愛知県公募公債	100,000,000	106,393,000	
22年度6回	愛知県公募公債	200,000,000	207,990,000	
23年度20回	愛知県公募公債	500,000,000	511,880,000	
16年度2回	広島県公募公債	200,000,000	204,450,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	210,688,000	
17年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	204,170,000	
18年度1回	埼玉県公募公債	200,000,000	208,920,000	
21年度4回	埼玉県公募公債	440,000,000	466,518,800	
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	207,000,000	
16年度3回	福岡県公募公債	131,040,000	133,417,065	
17年度5回	福岡県公募公債	100,000,000	103,321,000	
17年度1回	福岡県公募公債	100,000,000	102,570,000	
18年度1回	福岡県公募公債	104,000,000	110,124,560	
21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	213,174,000	
16年度8回	千葉県公募公債	200,000,000	203,634,000	
17年度2回	千葉県公募公債	200,000,000	204,346,000	
19年度5回	千葉県公募公債	300,000,000	319,968,000	
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	211,474,000	
18年度2回	新潟県公募公債	169,000,000	178,305,140	

2 0 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,810,000	
2 1 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,319,000	
2 3 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,817,000	
2 5 回	共同発行市場公募地方債	304,000,000	310,575,520	
2 8 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,530,000	
2 9 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,132,000	
3 1 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,960,000	
3 2 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,668,000	
3 3 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,344,000	
3 5 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,344,000	
3 6 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,765,000	
3 7 回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,678,000	
3 8 回	共同発行市場公募地方債	170,000,000	178,734,600	
3 9 回	共同発行市場公募地方債	146,000,000	153,286,860	
4 0 回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	158,581,500	
4 7 回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	170,657,680	
5 4 回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	423,708,000	
5 5 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,312,000	
5 7 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,932,000	
6 1 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	317,478,000	
6 5 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,413,000	
7 5 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	535,465,000	
8 0 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	745,654,000	
9 4 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,003,000	
9 9 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	723,156,000	
1 0 6 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,563,000	
1 0 9 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,415,000	
1 1 1 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	704,494,000	
1 7 年度 3 回	大阪市公募公債	100,000,000	102,204,000	
1 7 年度 7 回	大阪市公募公債	200,000,000	205,234,000	
1 7 年度 8 回	大阪市公募公債	200,000,000	206,328,000	
1 7 年度 1 1 回	大阪市公募公債	100,000,000	103,583,000	
1 8 年度 2 回	大阪市公募公債	100,000,000	105,167,000	
1 8 年度 3 回	大阪市公募公債	150,000,000	158,430,000	
1 9 年度 5 回	大阪市公募公債	135,000,000	144,094,950	
1 2 回ひ号	名古屋市公募公債	200,000,000	204,490,000	
1 2 回せ号	名古屋市公募公債	359,500,000	369,138,195	
1 7 年度 1 回	京都市公募公債	100,000,000	102,523,000	
1 8 年度 3 回	京都市公募公債	101,700,000	107,720,640	
1 6 年度 5 回	神戸市公募公債	200,000,000	203,496,000	
1 7 年度 1 3 回	神戸市公募公債	103,000,000	106,718,300	
1 7 年度 1 回	横浜市公募公債	300,000,000	305,661,000	
2 2 年度 3 回	横浜市公募公債	200,000,000	207,536,000	

	2 2年度 5回 横浜市公募公債	200,000,000	208,492,000	
	2 3年度 4回 横浜市公募公債	450,000,000	459,868,500	
	1 6年度 7回 札幌市公募公債	100,000,000	102,233,000	
	1 9年度 7回 札幌市公募公債	300,000,000	316,227,000	
	2回 川崎市公募公債 1 5年	100,000,000	107,116,000	
	2 1年度 2回 北九州市公募公債	200,000,000	210,488,000	
	1 8年度 4回 福岡市公募公債	100,000,000	105,125,000	
	1 6年度 1回 広島市公募公債	100,000,000	101,748,000	
	1 6年度 2回 千葉市公募公債	100,000,000	101,859,000	
地方債証券 合計		28,749,240,000	29,811,806,539	
特殊債券	1 3回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	127,779,630	
	2 7回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	210,796,000	
	4 6回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	212,122,000	
	3 3 8回 政保道路債	264,000,000	270,029,760	
	3 3 9回 政保道路債	301,000,000	307,661,130	
	1 5回 高速道路機構債	400,000,000	422,348,000	
	2 5回 高速道路機構債	300,000,000	318,225,000	
	3 5回 高速道路機構債	400,000,000	423,312,000	
	4 8回 高速道路機構債	700,000,000	747,901,000	
	9 6回 高速道路機構債	700,000,000	692,083,000	
	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,143,000	
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	216,795,700	
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	112,137,480	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,965,000	
	1 6回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	317,548,980	
	1 7回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	128,890,560	
	1 8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	334,596,000	
	1 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,135,000	
	2 1回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	395,111,250	
	2 3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,378,000	
	3 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	316,287,000	
	3 3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	313,516,170	
	3 6回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	366,446,000	
	4 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	353,448,420	
	4 7回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,812,000	
	5 4回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	525,725,000	
	5 6回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,406,000	
	6 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	758,519,090	
	6 6回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	171,676,260	
	6 7回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	427,377,780	
7 1回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	633,738,000		
7 8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	740,222,000		
8 2回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,382,000		

8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,540,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	992,040,000	
4 1 回 日本道路・機構承継債	300,000,000	306,411,000	
8 4 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	203,844,000	
8 4 8 回 政保公営企業債券	200,000,000	203,694,000	
8 4 9 回 政保公営企業債券	261,000,000	266,895,990	
8 5 2 回 政保公営企業債券	300,000,000	306,648,000	
8 5 3 回 政保公営企業債券	204,000,000	208,269,720	
8 5 4 回 政保公営企業債券	304,000,000	311,858,400	
8 5 6 回 政保公営企業債券	200,000,000	206,054,000	
8 5 9 回 政保公営企業債券	207,000,000	213,967,620	
8 6 2 回 政保公営企業債券	239,000,000	249,726,320	
8 6 3 回 政保公営企業債券	200,000,000	210,416,000	
8 6 7 回 政保公営企業債券	200,000,000	210,198,000	
8 6 8 回 政保公営企業債券	101,000,000	106,270,180	
8 6 9 回 政保公営企業債券	102,000,000	107,446,800	
8 7 5 回 政保公営企業債券	482,000,000	509,131,780	
8 8 1 回 政保公営企業債券	500,000,000	527,385,000	
8 回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	692,410,110	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,477,130	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	526,850,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,369,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,490,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,694,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,580,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,876,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,832,000	
1 4 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	102,102,000	
1 5 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	306,459,000	
1 7 回 公営企業金融公庫債券	100,000,000	102,974,000	
2 0 回 公営企業金融公庫債券	200,000,000	210,606,000	
2 4 回 公営企業金融公庫債券	300,000,000	317,199,000	
1 4 8 回 政保阪神高速道路債	107,000,000	109,663,230	
1 8 6 回 政保中小企業債券	104,000,000	106,552,160	
1 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	215,002,000	
1 1 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	211,286,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	315,573,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	93,081,000	99,811,687	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	65,104,000	69,511,540	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	96,801,000	103,468,652	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	105,888,000	113,491,817	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	50,800,000	53,712,364	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	261,585,000	273,806,251	

4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,649,000	65,564,057	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,727,000	48,024,274	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	169,712,000	182,509,981	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	136,614,000	146,022,606	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,445,000	248,518,543	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	342,970,000	361,270,879	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	641,584,000	671,712,784	
7 1 4 号 利付商工債	300,000,000	302,868,000	
7 2 3 号 利付商工債	300,000,000	301,803,000	
7 3 2 号 利付商工債	400,000,000	404,168,000	
7 3 6 号 利付商工債	300,000,000	301,914,000	
7 4 0 号 利付商工債	300,000,000	301,896,000	
7 1 3 号 利附農林債	300,000,000	302,208,000	
7 1 7 号 利附農林債	300,000,000	302,511,000	
7 2 1 号 利附農林債	120,000,000	120,830,400	
7 3 7 号 利附農林債	300,000,000	302,124,000	
7 4 3 号 利附農林債	300,000,000	301,521,000	
2 4 1 回 利附信金中金債	300,000,000	302,160,000	
2 5 3 回 利附信金中金債	300,000,000	302,823,000	
2 6 1 回 利附信金中金債	300,000,000	301,953,000	
1 5 6 号 利附商工債(3年)	500,000,000	499,680,000	
1 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	104,403,700	
2 回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	104,259,270	
8 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	179,443,500	
4 回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	176,465,100	
1 0 回 政保中日本高速道路債券	215,000,000	226,414,350	
2 1 回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	319,962,000	
5 回 中日本高速道路債券	200,000,000	214,038,000	
1 回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	207,773,700	
5 回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	273,382,270	
6 回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	123,638,580	
特殊債券 合計	29,464,960,000	30,677,970,955	
社債券			
1 2 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	101,929,000	
1 4 回 G E キャピタル円貨債	100,000,000	103,050,000	
2 回 J P モルガン・チェース劣後債	100,000,000	102,747,000	
1 6 回 シティグループ円貨社債	100,000,000	102,378,000	
7 回 ウエストパック銀行円貨社債	100,000,000	101,405,000	
2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	305,751,000	
3 2 回 アサヒビール社債	100,000,000	100,667,000	
7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	106,523,000	
4 1 回 住友化学社債	100,000,000	104,987,000	
3 7 回 三菱化学社債	100,000,000	107,689,000	
3 4 回 三井化学社債	100,000,000	103,700,000	

1 1 回	武田薬品工業社債	100,000,000	100,324,000	
1 2 回	武田薬品工業社債	100,000,000	100,481,000	
2 4 回	新日本石油社債	100,000,000	102,350,000	
2 9 回	新日本製鐵社債	100,000,000	110,275,000	
6 4 回	新日本製鐵社債	100,000,000	104,186,000	
1 5 回	ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,415,000	
1 回	日本電産社債	100,000,000	99,831,000	
2 5 回	富士通社債	100,000,000	101,648,000	
1 0 回	パナソニック社債	200,000,000	200,782,000	
1 1 回	パナソニック社債	100,000,000	101,237,000	
1 7 回	ソニー社債	100,000,000	101,869,000	
3 回	パナソニック電工社債	100,000,000	102,132,000	
1 9 回	三菱重工業社債	100,000,000	105,395,000	
4 9 回	日産自動車社債	100,000,000	101,965,000	
5 1 回	日産自動車社債	100,000,000	100,935,000	
4 9 回	伊藤忠商事社債	100,000,000	108,632,000	
5 8 回	伊藤忠商事社債	100,000,000	100,806,000	
6 6 回	伊藤忠商事社債	200,000,000	199,670,000	
7 7 回	丸紅社債	100,000,000	101,024,000	
9 1 回	丸紅社債	100,000,000	99,715,000	
3 0 回	住友商事社債	100,000,000	103,638,000	
6 9 回	三菱商事社債	300,000,000	321,885,000	
7 7 回	三菱商事社債	150,000,000	151,189,500	
7 回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	320,964,000	
2 0 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,608,000	
2 4 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,682,000	
2 5 回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	304,020,000	
2 7 回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	302,193,000	
2 9 回	みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	502,600,000	
3 1 回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	299,670,000	
3 2 回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	199,074,000	
7 回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	110,712,000	
1 1 2 回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	201,416,000	
1 1 4 回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	201,636,000	
1 2 6 回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,823,000	
1 3 4 回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,515,000	
1 4 0 回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	298,761,000	
6 回	東京三菱銀行劣後社債	100,000,000	102,174,000	
7 回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	218,252,000	
8 回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	205,622,000	
1 1 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	212,842,000	
1 2 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	214,230,000	
2 5 回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	206,676,000	

28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	210,024,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	112,062,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,318,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	210,730,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	105,554,000	
10回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	208,620,000	
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	102,285,000	
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	105,088,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	105,606,000	
50回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,148,000	
51回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,602,000	
54回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,522,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	299,667,000	
8回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,171,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	103,107,000	
10回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	212,468,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	215,264,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	218,610,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	208,150,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	210,386,000	
1回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	102,159,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,146,000	
10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	107,174,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	217,596,000	
19回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	210,444,000	
38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	200,948,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,585,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,314,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,568,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	104,759,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	315,999,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	104,283,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	205,762,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	199,504,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,782,000	
12回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,775,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	101,021,000	
17回	野村ホールディングス社債	200,000,000	202,608,000	
20回	野村ホールディングス社債	100,000,000	101,028,000	
22回	野村ホールディングス社債	200,000,000	202,084,000	
39回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,526,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	106,016,000	
24回	三井不動産社債	100,000,000	103,365,000	

79回	三菱地所社債	200,000,000	210,802,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	105,909,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	212,766,000	
73回	住友不動産社債	100,000,000	101,057,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	99,278,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	107,467,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	105,941,000	
2回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	215,160,000	
3回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	219,372,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,149,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	341,115,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,482,000	
41回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,885,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,520,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	320,343,000	
3回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	221,660,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,489,000	
2回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	220,524,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,918,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,731,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	198,525,300	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,328,000	
3回	東京地下鉄社債	100,000,000	105,178,000	
5回	KDDI社債	100,000,000	110,655,000	
50回	日本電信電話社債	100,000,000	102,917,000	
51回	日本電信電話社債	200,000,000	210,542,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	213,418,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	312,393,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	215,164,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	193,706,000	
516回	東京電力社債	100,000,000	99,115,000	
519回	東京電力社債	372,000,000	366,304,680	
542回	東京電力社債	500,000,000	478,260,000	
407回	中部電力社債	100,000,000	105,943,000	
409回	中部電力社債	300,000,000	329,733,000	
467回	中部電力社債	100,000,000	101,615,000	
468回	中部電力社債	100,000,000	101,616,000	
471回	中部電力社債	300,000,000	304,974,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	107,005,000	
478回	中部電力社債	100,000,000	104,267,000	
480回	中部電力社債	200,000,000	208,580,000	
484回	中部電力社債	200,000,000	202,380,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	509,555,000	

4 1 0 回 関西電力社債	300,000,000	314,457,000	
4 3 3 回 関西電力社債	200,000,000	201,950,000	
4 4 1 回 関西電力社債	200,000,000	202,932,000	
4 4 6 回 関西電力社債	200,000,000	205,638,000	
2 9 8 回 中国電力社債	200,000,000	213,526,000	
3 1 0 回 中国電力社債	200,000,000	221,136,000	
3 5 0 回 中国電力社債	200,000,000	202,854,000	
2 4 5 回 北陸電力社債	200,000,000	212,828,000	
2 6 0 回 北陸電力社債	100,000,000	109,372,000	
2 8 1 回 北陸電力社債	200,000,000	212,360,000	
2 8 9 回 北陸電力社債	300,000,000	304,104,000	
3 7 5 回 東北電力社債	100,000,000	105,984,000	
3 8 0 回 東北電力社債	300,000,000	328,554,000	
4 2 7 回 東北電力社債	200,000,000	203,550,000	
4 3 2 回 東北電力社債	500,000,000	520,220,000	
2 3 7 回 四国電力社債	100,000,000	106,808,000	
2 5 7 回 四国電力社債	200,000,000	202,872,000	
3 8 2 回 九州電力社債	100,000,000	101,517,000	
3 8 3 回 九州電力社債	100,000,000	101,699,000	
3 8 7 回 九州電力社債	200,000,000	205,882,000	
2 5 7 回 北海道電力社債	200,000,000	218,098,000	
2 8 4 回 北海道電力社債	500,000,000	512,040,000	
2 8 6 回 北海道電力社債	100,000,000	101,311,000	
6 回 電源開発社債	100,000,000	101,278,000	
1 4 回 電源開発社債	100,000,000	102,333,000	
1 7 回 電源開発社債	100,000,000	104,515,000	
9 回 大阪ガス社債	100,000,000	111,398,000	
2 4 回 大阪瓦斯社債	100,000,000	101,739,000	
社債券 合計	28,812,000,000	29,889,205,480	
合計	423,546,200,000	441,665,582,174	

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。

[前へ](#) [次へ](#)

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		7,994,465	36,916,662
投資証券		13,890,668,820	11,578,688,330
未収入金		12,783,910	-
未収配当金		162,043,930	97,430,182
流動資産合計		14,073,491,125	11,713,035,174
資産合計		14,073,491,125	11,713,035,174
負債の部			
流動負債			
未払金		8,445,000	15,248,065
未払解約金		964,000	1,147,000
流動負債合計		9,409,000	16,395,065
負債合計		9,409,000	16,395,065
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,227,610,808	9,575,572,422
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	163,528,683	2,121,067,687
元本等合計		14,064,082,125	11,696,640,109
純資産合計		14,064,082,125	11,696,640,109
負債純資産合計		14,073,491,125	11,713,035,174

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	10,553,168,125円	14,227,610,808円
同期中追加設定元本額	4,611,354,108円	4,876,166,095円
同期中一部解約元本額	936,911,425円	9,528,204,481円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファンド < 隔月分配型 >	48,566,424円	45,593,563円
マネックス資産設計ファンド < 育成型 >	596,048,209円	563,959,185円
マネックス資産設計ファン ド エボリューション	2,524,222円	1,906,824円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国10）	16,922円	178,975円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国20）	34,942円	499,022円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国30）	52,962円	1,162,700円
投資のソムリエ	518,423円	726,559円
D I A M J - R E I T イン デックス私募ファンド201 210（適格機関投資家限 定）	4,521,953,369円	2,529,503,354円
D I A M J - R E I T イン デックス私募ファンド201 212（適格機関投資家限 定）	1,530,009,840円	1,513,433,495円
D I A M J - R E I T イン デックス私募ファンド201 301（適格機関投資家限 定）	- 円	503,763,684円
D I A M J - R E I T イン デックスファンド（適格機関 投資家向け）	6,867,544,748円	3,956,284,754円

	D I A Mグローバル 私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	295,961,762円	158,679,384円
	D I A Mグローバル分散ファ ンドV A(適格機関投資家限 定)	364,378,985円	299,880,923円
	計	14,227,610,808円	9,575,572,422円
2 .	受益権の総数	14,227,610,808口	9,575,572,422口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額 を下回っており、その差額は 163,528,683円であります。	

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	1,845,180,295	903,480,853
合計	1,845,180,295	903,480,853

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.9885円	1.2215円
（1万口当たり純資産額）	（9,885円）	（12,215円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成25年7月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	3,369	325,445,400	
	MIDリート投資法人	337	74,645,500	
	いちご不動産投資法人	1,710	103,455,000	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	376	277,864,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,273	493,241,000	
	インヴィンシブル投資法人	2,472	33,100,080	
	オリックス不動産投資法人	2,917	338,955,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	178	99,324,000	
	ケネディクスレジデンシャル投資法人	138	29,670,000	
	ケネディクス不動産投資法人	525	208,687,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	123	86,592,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,805	182,349,750	
	ジャパンエクセレント投資法人	412	224,952,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,089	1,198,989,000	
	スターツプロシード投資法人	266	44,821,000	
	トップリート投資法人	284	125,812,000	
	フロンティア不動産投資法人	455	408,590,000	
	プレミアム投資法人	361	139,707,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,345	567,022,500	
	阪急リート投資法人	190	93,575,000	
	産業ファンド投資法人	287	279,538,000	
	森トラスト総合リート投資法人	444	384,948,000	
	森ヒルズリート投資法人	467	284,870,000	
	積水ハウス・S I 投資法人	293	137,856,500	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	645	258,322,500	
	大和ハウスリート投資法人	225	158,400,000	
	大和証券オフィス投資法人	726	269,346,000	
	東急リアル・エステート投資法人	311	178,825,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	423	282,564,000	
	日本ビルファンド投資法人	1,269	1,479,654,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,512	440,445,600	
	日本プロロジスリート投資法人	511	443,548,000	
日本リテールファンド投資法人	3,812	777,648,000		
日本ロジスティクスファンド投資法人	271	246,610,000		
日本賃貸住宅投資法人	2,440	168,604,000		

	福岡リート投資法人	253	196,834,000	
	平和不動産リート投資法人	1,458	100,164,600	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	674	295,212,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	277	138,500,000	
投資証券	合計	42,923	11,578,688,330	
合計		42,923	11,578,688,330	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,995,117,588	3,607,514,372
コール・ローン		105,600,490	118,088,415
株式		299,969,453,942	305,289,685,731
投資信託受益証券		1,193,561,263	1,060,494,924
投資証券		5,865,091,266	5,837,908,298
派生商品評価勘定		96,096,811	71,967,377
未収入金		3,025,308	31,756,410
未収配当金		343,037,809	490,964,289
差入委託証拠金		1,563,569,155	951,211,272
流動資産合計		312,134,553,632	317,459,591,088
資産合計		312,134,553,632	317,459,591,088
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,400	9,713,777
未払解約金		84,532,000	215,771,000
流動負債合計		84,534,400	225,484,777
負債合計		84,534,400	225,484,777
純資産の部			
元本等			
元本	1	192,607,329,918	162,914,515,077
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		119,442,689,314	154,319,591,234
元本等合計		312,050,019,232	317,234,106,311
純資産合計		312,050,019,232	317,234,106,311
負債純資産合計		312,134,553,632	317,459,591,088

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	201,228,087,012円	192,607,329,918円
同期中追加設定元本額	1,510,315,240円	7,382,673,103円
同期中一部解約元本額	10,131,072,334円	37,075,487,944円
元本の内訳		

ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,264,941,534円	1,090,611,135円
D I A M外国株式インデックス ファンド< D C 年金 >	34,663,194,038円	33,484,443,583円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	192,635,419円	169,039,370円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	1,074,560,241円	959,945,405円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	1,293,270,382円	1,192,609,487円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	192,757,103円	161,057,872円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	517,224,432円	462,569,742円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	369,633,085円	357,715,615円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型 >	65,245,313円	84,946,212円
マネックス資産設計ファンド< 育成型 >	805,866,848円	1,052,118,798円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	153,265,189円	171,585,133円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国 1 0)	35,866円	382,707円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国 2 0)	55,158円	786,588円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国 3 0)	75,205円	1,608,717円
投資のソムリエ	219,014円	1,899,357円
クルーズコントロール	3,128,081円	304,242円
D I A M外国株式インデックス ファンド V A (適格機関投資家 専用)	542,138,384円	485,807,416円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	5,707,368,590円	4,344,869,700円
D I A M為替リスクコントロ ール型グローバル株式私募ファン ド(適格機関投資家限定)	12,254,128,984円	6,279,907,342円
D I A Mワールドバランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	72,514,634円	61,294,403円
D I A Mグローバル・バラン スファンド 2 5 V A (適格機関投 資家限定)	7,675,157,100円	5,535,761,423円
D I A Mグローバル・バラン スファンド 5 0 V A (適格機関投 資家限定)	1,345,528,917円	1,091,106,449円
D I A M国際分散バランスファ ンド 3 0 V A (適格機関投資家 限定)	158,826,564円	133,793,785円

D I A M国際分散バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	906,017,627円	766,286,772円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	77,853,986円	61,414,183円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	147,335,281円	128,453,130円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	15,008,817,486円	13,388,967,448円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	7,461,861,312円	6,679,116,242円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	2,484,248,662円	2,138,870,999円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	2,146,629,341円	1,890,982,843円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	5,689,028,414円	5,137,309,190円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	4,219,738,741円	3,543,461,737円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	5,538,044,320円	4,707,369,523円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	3,739,745,900円	3,025,703,036円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	3,576,182,757円	2,765,696,311円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	51,515,013円	28,820,733円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	15,300,439,503円	12,818,966,404円
D I A Mアイエヌジー世界バラ ンスファンド3 5 V A (適格機 関投資家限定)	2,846,622,975円	2,511,237,330円
D I A Mグローバル分散ファン ドV A (適格機関投資家限定)	115,996,456円	96,477,347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)	20,371,140,933円	17,138,219,774円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	1,909,202,112円	1,432,702,227円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	3,674,405,812円	3,043,917,210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）	12,575,501,262円	10,447,574,735円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	159,888円	186,590,586円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	250,516円	249,410円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A（適格機関投資 家限定）	16,414,596,880円	13,851,758,852円
D I A Mバランス4 0 V A（適 格機関投資家限定）	73,576円	65,769円
D I A Mバランス6 0 V A（適 格機関投資家限定）	151,084円	138,805円
計	192,607,329,918円	162,914,515,077円
2 . 受益権の総数	192,607,329,918口	162,914,515,077口

(金融商品に関する注記)

1 . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左
-------------------	--	----

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	23,967,239,175	15,942,727,630
投資信託受益証券	226,723,888	7,876,267
投資証券	570,431,456	41,283,351
合計	24,764,394,519	15,893,568,012

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成24年2月16日から平成25年1月11日まで及び平成25年2月16日から平成25年7月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成25年1月11日 現在				平成25年7月11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	-	-	-	-	205,624,370	-	204,823,000	801,370
アメリカ・ドル	-	-	-	-	110,638,600	-	109,560,000	1,078,600
イギリス・ポンド	-	-	-	-	30,036,860	-	30,078,000	41,140
ユーロ	-	-	-	-	64,948,910	-	65,185,000	236,090
買 建	29,594,900	-	29,592,500	2,400	-	-	-	-
ユーロ	29,594,900	-	29,592,500	2,400	-	-	-	-
合計	29,594,900	-	29,592,500	2,400	205,624,370	-	204,823,000	801,370

(注)時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成25年1月11日 現在				平成25年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	4,869,107,168	-	4,965,203,979	96,096,811	4,802,474,476	-	4,863,926,706	61,452,230
合計	4,869,107,168	-	4,965,203,979	96,096,811	4,802,474,476	-	4,863,926,706	61,452,230

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.6201円	1.9472円
(1万口当たり純資産額)	(16,201円)	(19,472円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成25年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	44,430	292.330	12,988,221.900	
	ABBOTT LABORATORIES	190,787	34.740	6,627,940.380	
	AES CORP	75,129	12.260	921,081.540	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	128,984	192.250	24,797,174.000	
	ADOBE SYSTEMS INC	57,711	47.250	2,726,844.750	
	ACE LTD	40,865	91.750	3,749,363.750	
	AGCO CORP	11,661	53.140	619,665.540	
	AIRGAS INC	8,926	98.870	882,513.620	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	25,897	96.530	2,499,837.410	
	ENERGEN CORP	8,985	56.350	506,304.750	
	ALLEGHANY CORP	1,956	398.220	778,918.320	
	ALLERGAN INC	35,741	89.320	3,192,386.120	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	113,944	53.920	6,143,860.480	
	RALPH LAUREN CORP	7,149	180.020	1,286,962.980	
	ALLSTATE CORP	56,333	50.300	2,833,549.900	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	91,227	81.210	7,408,544.670	
	ALTERA CORPORATION	38,100	33.840	1,289,304.000	
	ALCOA INC	123,518	7.920	978,262.560	
	AMGEN INC	90,300	102.060	9,216,018.000	
	HESS CORP	37,926	68.730	2,606,653.980	
	BEAM INC	18,885	63.270	1,194,853.950	
	AMERICAN EXPRESS CO	118,926	76.330	9,077,621.580	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	61,820	45.420	2,807,864.400	
	AFLAC INC	57,378	58.500	3,356,613.000	
	AMERICAN INTL GROUP	172,249	45.720	7,875,224.280	
	ANALOG DEVICES	37,380	46.730	1,746,767.400	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	60,231	88.620	5,337,671.220	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	24,417	100.120	2,444,630.040	
	NABORS INDUSTRIES LTD	36,022	14.990	539,969.780	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	56,765	35.130	1,994,154.450	
	TIME WARNER	110,477	61.010	6,740,201.770	
	VALERO ENERGY CORP	67,007	33.550	2,248,084.850	
	APACHE CORP	49,204	80.330	3,952,557.320	
ANSYS INC	12,522	76.640	959,686.080		
APPLE INC	114,388	420.730	48,126,463.240		

APPLIED MATERIALS INC	146,253	16.300	2,383,923.900	
ALBEMARLE CORP	10,917	65.210	711,897.570	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	78,603	35.900	2,821,847.700	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	13,584	57.090	775,510.560	
AMEREN CORP	35,614	34.800	1,239,367.200	
ARROW ELECTRONICS INC	11,621	41.510	482,387.710	
ASHLAND INC	9,468	85.420	808,756.560	
AUTOLIV INC	10,829	80.020	866,536.580	
AUTODESK INC	27,402	34.310	940,162.620	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	58,720	71.750	4,213,160.000	
AUTOZONE INC	4,116	433.480	1,784,203.680	
AVERY DENNISON CORP	15,202	44.400	674,968.800	
AVNET INC	15,099	35.220	531,786.780	
AVON PRODUCTS INC	52,897	21.860	1,156,328.420	
BMC SOFTWARE INC	15,666	45.720	716,249.520	
BAKER HUGHES INC	53,880	48.780	2,628,266.400	
BALL CORP	17,019	44.150	751,388.850	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	129,717	114.880	14,901,888.960	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	140,173	29.330	4,111,274.090	
CR BARD INC	9,099	109.440	995,794.560	
BAXTER INTERNATIONAL INC	65,317	71.320	4,658,408.440	
BED BATH & BEYOND INC	28,261	75.570	2,135,683.770	
BECTON DICKINSON & CO	24,757	99.100	2,453,418.700	
AMETEK INC	32,620	44.540	1,452,894.800	
VERIZON COMM INC	346,735	50.540	17,523,986.900	
WR BERKLEY CORP	18,150	42.980	780,087.000	
BEST BUY CO INC	33,006	28.470	939,680.820	
YUM! BRANDS INC	53,600	72.360	3,878,496.000	
FIRSTENERGY CORP	51,798	36.810	1,906,684.380	
SLM CORP	58,143	23.250	1,351,824.750	
H&R BLOCK INC	33,589	29.580	993,562.620	
ENSCO PLC-CL A	27,725	59.340	1,645,201.500	
BOEING CO	87,763	105.500	9,258,996.500	
ROBERT HALF INTL INC	14,807	33.640	498,107.480	
BORGWARNER INC	13,686	87.250	1,194,103.500	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	166,092	9.230	1,533,029.160	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	21,232	58.140	1,234,428.480	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	198,941	44.860	8,924,493.260	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	6,595	165.740	1,093,055.300	
ONEOK INC	24,605	42.850	1,054,324.250	
SEMPRA ENERGY	29,441	81.650	2,403,857.650	
FEDEX CORP	36,529	103.000	3,762,487.000	

VERISIGN INC	20,783	45.660	948,951.780	
AMPHENOL CORP	19,291	82.730	1,595,944.430	
BROWN-FORMAN CORP	14,456	70.720	1,022,328.320	
QUANTA SERVICES INC	25,480	27.180	692,546.400	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	18,492	21.780	402,755.760	
SIRIUS XM RADIO INC	418,910	3.590	1,503,886.900	
CSX CORP	122,939	23.910	2,939,471.490	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	20,538	18.850	387,141.300	
CABOT OIL & GAS CORP	25,912	71.220	1,845,452.640	
CAMPBELL SOUP CO	22,764	45.210	1,029,160.440	
SEAGATE TECHNOLOGY	40,239	45.830	1,844,153.370	
WHITING PETROLEUM CORP	13,133	48.580	638,001.140	
CONSTELLATION BRANDS INC	19,719	51.230	1,010,204.370	
CARDINAL HEALTH INC	43,211	48.790	2,108,264.690	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	45,706	35.370	1,616,621.220	
CATERPILLAR INC	80,513	84.960	6,840,384.480	
CELGENE CORP	50,766	125.080	6,349,811.280	
CORE LABORATORIES N.V.	6,020	156.130	939,902.600	
CITRIX SYSTEMS INC	23,666	65.290	1,545,153.140	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	68,847	21.400	1,473,325.800	
CENTURYLINK INC	77,880	35.460	2,761,624.800	
CERNER CORP	37,038	47.590	1,762,638.420	
JPMORGAN CHASE & CO	467,044	54.830	25,608,022.520	
CHUBB CORP	31,655	85.510	2,706,819.050	
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,505	62.540	1,094,762.700	
CIGNA CORP	34,621	74.880	2,592,420.480	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,804	48.510	1,154,732.040	
CINTAS CORP	15,201	47.250	718,247.250	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	134,501	4.020	540,694.020	
CISCO SYSTEMS INC	651,313	25.410	16,549,863.330	
CLOROX COMPANY	15,155	84.700	1,283,628.500	
EQUINIX INC	5,159	190.840	984,543.560	
COCA-COLA CO/THE	489,397	40.680	19,908,669.960	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	30,102	35.980	1,083,069.960	
COLGATE-PALMOLIVE CO	111,063	58.620	6,510,513.060	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	30,686	41.930	1,286,663.980	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	62,487	41.170	2,572,589.790	
COMERICA INC	18,671	41.630	777,273.730	
NRG ENERGY, INC.	44,248	27.850	1,232,306.800	
COMCAST CORP-CL A	257,916	42.910	11,067,175.560	
CA INC	39,190	29.240	1,145,915.600	
COMPUTER SCIENCES CORP	19,843	47.390	940,359.770	

CONAGRA FOODS INC	54,085	35.990	1,946,519.150	
CONSOLIDATED EDISON INC	36,790	57.880	2,129,405.200	
CMS ENERGY CORP	35,850	27.540	987,309.000	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	30,745	64.790	1,991,968.550	
MOLSON COORS BREWING CO	17,190	50.330	865,172.700	
CORNING INC	174,193	14.800	2,578,056.400	
DIRECTV	64,479	62.230	4,012,528.170	
CREE INC	13,242	68.700	909,725.400	
SEALED AIR CORP	20,323	26.770	544,046.710	
BROADCOM CORP-CL A	65,307	34.070	2,225,009.490	
CUMMINS INC	22,677	113.700	2,578,374.900	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	11,144	89.830	1,001,065.520	
DR HORTON INC	34,671	21.050	729,824.550	
DANAHER CORP	71,125	67.800	4,822,275.000	
MOODY'S CORP	25,138	60.030	1,509,034.140	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	37,563	69.690	2,617,765.470	
TARGET CORP	72,637	72.030	5,232,043.110	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,668	70.010	466,826.680	
DEERE & CO	43,812	82.870	3,630,700.440	
DELL INC	183,328	13.330	2,443,762.240	
MORGAN STANLEY	176,590	25.340	4,474,790.600	
REPUBLIC SERVICES INC	37,885	34.720	1,315,367.200	
THE WALT DISNEY CO	209,258	64.910	13,582,936.780	
DOLLAR TREE INC	28,836	54.290	1,565,506.440	
DOVER CORP	21,769	79.530	1,731,288.570	
DOW CHEMICAL	146,272	33.790	4,942,530.880	
OMNICOM GROUP	32,426	64.990	2,107,365.740	
DTE ENERGY CO	21,998	67.570	1,486,404.860	
XL GROUP PLC	34,834	30.940	1,077,763.960	
DUKE ENERGY CORP	84,260	68.590	5,779,393.400	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	35,585	74.840	2,663,181.400	
FLOWSERVE CORP	17,139	55.570	952,414.230	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,429	50.950	888,007.550	
EBAY INC	139,998	54.880	7,683,090.240	
EMC CORP/MASS	251,783	24.460	6,158,612.180	
BANK OF AMERICA CORP	1,323,717	13.370	17,698,096.290	
CITIGROUP INC	372,239	49.630	18,474,221.570	
EASTMAN CHEMICAL CO	19,571	73.000	1,428,683.000	
EATON CORP PLC	56,239	67.390	3,789,946.210	
EATON VANCE CORP	12,917	38.480	497,046.160	
DISH NETWORK CORP	28,168	41.660	1,173,478.880	
ECOLAB INC	34,105	88.660	3,023,749.300	

ELECTRONIC ARTS INC	35,610	23.900	851,079.000	
SALESFORCE.COM INC	65,152	39.740	2,589,140.480	
EMERSON ELECTRIC CO	86,730	57.100	4,952,283.000	
WEATHERFORD INTL LTD	91,917	14.170	1,302,463.890	
ENTERGY CORP	21,729	69.700	1,514,511.300	
EOG RESOURCES INC	32,653	142.270	4,645,542.310	
EQUIFAX INC	15,777	60.400	952,930.800	
EQT CORP	17,893	81.800	1,463,647.400	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	27,824	67.030	1,865,042.720	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	28,000	39.600	1,108,800.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	99,739	64.310	6,414,215.090	
EXXON MOBIL CORP	545,042	92.820	50,590,798.440	
FMC CORP	16,287	62.310	1,014,842.970	
NEXTERA ENERGY INC	50,017	81.630	4,082,887.710	
FAMILY DOLLAR STORES	13,430	68.500	919,955.000	
ASSURANT INC	8,352	52.300	436,809.600	
FASTENAL CO	34,680	45.770	1,587,303.600	
FIFTH THIRD BANCORP	105,628	18.790	1,984,750.120	
M&T BANK CORP	13,571	117.520	1,594,863.920	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	13,945	69.550	969,874.750	
FISERV INC	16,418	90.290	1,482,381.220	
FLIR SYSTEMS INC	20,650	28.890	596,578.500	
MACY'S INC	48,573	49.470	2,402,906.310	
FORD MOTOR CO	450,728	16.720	7,536,172.160	
FOREST LABORATORIES INC	24,901	43.350	1,079,458.350	
FOSSIL GROUP INC	6,562	108.920	714,733.040	
FRANKLIN RESOURCES INC	16,806	136.980	2,302,085.880	
FREEMPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	123,221	27.600	3,400,899.600	
FLEXTRONICS INTL LTD	74,709	7.860	587,212.740	
GAP INC/THE	40,217	44.100	1,773,569.700	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	15,658	41.870	655,600.460	
GENERAL DYNAMICS CORP	36,455	80.600	2,938,273.000	
GENERAL MILLS INC	78,782	49.910	3,932,009.620	
GENUINE PARTS CO	18,750	83.500	1,565,625.000	
GILEAD SCIENCES INC	186,753	55.330	10,333,043.490	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	23,633	66.730	1,577,030.090	
MCKESSON CORP	28,971	116.890	3,386,420.190	
NVIDIA CORP	71,382	14.430	1,030,042.260	
GENERAL ELECTRIC CO	1,261,753	23.540	29,701,665.620	
WW GRAINGER INC	7,144	261.650	1,869,227.600	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	15,422	70.090	1,080,927.980	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	20,710	74.510	1,543,102.100	

NUANCE COMMUNICATIONS INC	35,897	19.080	684,914.760	
HALLIBURTON CO	111,910	44.130	4,938,588.300	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,686	59.600	994,485.600	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	54,230	155.830	8,450,660.900	
HARLEY-DAVIDSON INC	25,751	53.990	1,390,296.490	
HARRIS CORP	14,775	50.170	741,261.750	
CONSOL ENERGY INC	28,063	27.340	767,242.420	
HASBRO INC	17,017	46.950	798,948.150	
HENRY SCHEIN INC	10,751	100.250	1,077,787.750	
DENBURY RESOURCES INC	47,155	17.500	825,212.500	
HELMERICH & PAYNE INC	13,583	64.590	877,325.970	
HERSHEY FOODS CORP	16,263	90.710	1,475,216.730	
HEWLETT-PACKARD CO	232,782	25.930	6,036,037.260	
F5 NETWORKS INC	9,598	71.950	690,576.100	
CROWN HOLDINGS INC NPR	20,737	42.250	876,138.250	
REYNOLDS AMERICAN INC	36,837	50.490	1,859,900.130	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	14,788	75.920	1,122,704.960	
JUNIPER NETWORKS INC	62,508	19.680	1,230,157.440	
HOLLYFRONTIER CORP	23,585	40.320	950,947.200	
HOLOGIC INC	34,080	18.930	645,134.400	
UNUM GROUP	30,372	31.470	955,806.840	
HOME DEPOT INC	182,033	79.400	14,453,420.200	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,878	60.550	840,312.900	
HORMEL FOODS CORP	20,809	39.790	827,990.110	
HUDSON CITY BANCORP INC	61,279	9.700	594,406.300	
CENTERPOINT ENERGY INC	56,244	24.040	1,352,105.760	
HUMANA INC	20,043	84.930	1,702,251.990	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	13,732	76.560	1,051,321.920	
RED HAT INC	23,998	48.330	1,159,823.340	
BIOGEN IDEC INC	29,204	219.700	6,416,118.800	
ILLINOIS TOOL WORKS	51,157	71.190	3,641,866.830	
INTUIT INC	33,577	63.360	2,127,438.720	
INGERSOLL-RAND PLC	36,286	57.990	2,104,225.140	
INTEL CORP	604,051	23.250	14,044,185.750	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,998	79.990	799,740.020	
INTL GAME TECH	36,187	17.260	624,587.620	
INTERNATIONAL PAPER CO	50,098	46.440	2,326,551.120	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	55,606	15.420	857,444.520	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,497	56.050	812,556.850	
JOHNSON & JOHNSON	339,357	89.240	30,284,218.680	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,681	31.770	1,641,905.370	
JOHNSON CONTROLS INC	81,485	36.040	2,936,719.400	

KLA-TENCOR CORP	21,075	59.240	1,248,483.000	
DEVON ENERGY CORP	47,291	55.270	2,613,773.570	
KELLOGG CO	31,667	65.970	2,089,071.990	
KEYCORP	112,373	11.790	1,324,877.670	
KIMBERLY-CLARK CORP	46,764	98.590	4,610,462.760	
BLACKROCK INC/NEW YORK	16,484	264.710	4,363,479.640	
KOHL'S CORP	27,527	53.550	1,474,070.850	
KROGER CO	63,399	37.340	2,367,318.660	
LSI CORP	55,560	7.330	407,254.800	
LAM RESEARCH CORP	20,116	49.520	996,144.320	
AKAMAI TECHNOLOGIES	21,419	43.520	932,154.880	
LEGG MASON INC	13,165	31.570	415,619.050	
LEGGETT & PLATT INC	19,896	31.770	632,095.920	
LENNAR CORP	18,341	34.560	633,864.960	
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,049	26.040	938,715.960	
ELI LILLY & CO	121,300	51.420	6,237,246.000	
L BRANDS INC	30,268	50.610	1,531,863.480	
LINCOLN NATIONAL CORP	35,107	39.990	1,403,928.930	
LINEAR TECH CORP	29,629	38.110	1,129,161.190	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	86,991	90.240	7,850,067.840	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	41,714	45.310	1,890,061.340	
LOCKHEED MARTIN CORP	34,270	111.520	3,821,790.400	
LOEWS CORP	41,060	45.000	1,847,700.000	
RANGE RESOURCES CORP	19,980	79.090	1,580,218.200	
LOWE'S COS INC	135,253	43.390	5,868,627.670	
DOMINION RESOURCES INC/VA	69,278	57.390	3,975,864.420	
IRON MOUNTAIN INC	20,204	27.360	552,781.440	
SCANA CORP	17,601	50.250	884,450.250	
MDU RESOURCES GROUP INC	21,313	27.530	586,746.890	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,258	15.350	633,310.300	
MCCORMICK & CO INC	14,416	70.490	1,016,183.840	
MCDONALD'S CORPORATION	121,031	99.980	12,100,679.380	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	33,018	55.890	1,845,376.020	
EVEREST RE GROUP LTD	7,022	127.760	897,130.720	
MANPOWERGROUP INC	7,953	59.480	473,044.440	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	12,156	65.470	795,853.320	
MARSH & MCLENNAN COS	66,593	40.860	2,720,989.980	
ENERGIZER HOLDINGS INC	7,466	103.000	768,998.000	
MASCO CORP	46,833	19.900	931,976.700	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	103.660	528,873.320	
MATTEL INC	44,148	46.520	2,053,764.960	
METLIFE INC	115,134	48.610	5,596,663.740	

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32,242	27.730	894,070.660	
MEDTRONIC INC	120,770	53.000	6,400,810.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,156	14.900	806,924.400	
CVS CAREMARK CORP	150,754	59.880	9,027,149.520	
MERCK & CO. INC.	367,687	47.960	17,634,268.520	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,600	96.850	1,026,610.000	
MICROSOFT CORP	969,138	34.700	33,629,088.600	
MICRON TECH INC	123,712	12.550	1,552,585.600	
RACKSPACE HOSTING INC	13,630	38.930	530,615.900	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,818	38.030	1,019,888.540	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	50,668	11.710	593,322.280	
3M CO	78,413	113.430	8,894,386.590	
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,039	112.770	793,788.030	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	29,468	58.430	1,721,815.240	
KANSAS CITY SOUTHERN	13,384	112.770	1,509,313.680	
MURPHY OIL CORPORATION	22,178	62.890	1,394,774.420	
MYLAN LABORATORIES	51,305	31.280	1,604,820.400	
ILLUMINA INC	15,876	74.620	1,184,667.120	
XCEL ENERGY INC	60,378	28.940	1,747,339.320	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	52,192	72.690	3,793,836.480	
NETAPP INC	45,318	38.750	1,756,072.500	
SEARS HOLDINGS CORP	4,862	44.710	217,380.020	
NEWELL RUBBERMAID INC	38,632	26.640	1,029,156.480	
DUN & BRADSTREET CORP	6,416	105.000	673,680.000	
NEWMONT MINING CORP	59,837	26.610	1,592,262.570	
NIKE INC-CL B	84,625	63.600	5,382,150.000	
NOBLE CORP	30,714	39.180	1,203,374.520	
NOBLE ENERGY INC	43,865	63.750	2,796,393.750	
NORDSTROM INC	19,877	62.590	1,244,101.430	
NORFOLK SOUTHERN CORP	38,275	73.420	2,810,150.500	
NORTHEAST UTILITIES	41,026	42.330	1,736,630.580	
NISOURCE INC	33,928	29.890	1,014,107.920	
COACH INC	34,483	58.600	2,020,703.800	
NORTHERN TRUST CORP	26,469	61.160	1,618,844.040	
NORTHROP GRUMMAN CORP	26,680	86.900	2,318,492.000	
WELLS FARGO & CO	609,150	42.070	25,626,940.500	
NUCOR CORP	35,421	44.160	1,564,191.360	
MONSANTO CO	64,150	101.490	6,510,583.500	
CHENIERE ENERGY INC	23,885	29.500	704,607.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	69,223	64.910	4,493,264.930	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	98,925	89.280	8,832,024.000	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	13,732	78.760	1,081,532.320	

ONYX PHARMACEUTICALS INC	8,272	133.800	1,106,793.600	
OGE ENERGY CORP	22,050	35.060	773,073.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,078	116.480	1,406,845.440	
OMNICARE INC	12,226	48.890	597,729.140	
ORACLE CORP	463,272	31.230	14,467,984.560	
OWENS-ILLINOIS INC	19,173	28.920	554,483.160	
PACCAR INC	44,115	54.770	2,416,178.550	
PALL CORP	13,652	69.540	949,360.080	
EXELON CORP	101,760	30.570	3,110,803.200	
PARKER HANNIFIN CORP	18,417	98.130	1,807,260.210	
PARTNERRE LTD	3,890	90.250	351,072.500	
PATTERSON COS INC	12,490	39.100	488,359.000	
PAYCHEX INC	40,014	38.480	1,539,738.720	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,943	46.760	651,974.680	
JC PENNEY CO INC HOLDING CO	20,021	17.080	341,958.680	
PPL CORPORATION	71,724	30.000	2,151,720.000	
PEPSICO INC	187,542	82.990	15,564,110.580	
PENTAIR LTD	26,019	58.850	1,531,218.150	
PERRIGO CO	10,959	127.840	1,400,998.560	
PFIZER INC	810,669	28.440	23,055,426.360	
CONOCOPHILLIPS	142,080	63.530	9,026,342.400	
PVH CORP	10,064	131.940	1,327,844.160	
PETSMART INC	12,432	70.630	878,072.160	
PG&E CORP	53,163	45.140	2,399,777.820	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,840	152.080	2,561,027.200	
ALTRIA GROUP INC	243,820	36.500	8,899,430.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	64,145	74.590	4,784,575.550	
POLARIS INDUSTRIES INC	8,760	98.230	860,494.800	
GARMIN LTD	13,579	35.780	485,856.620	
AETNA INC	47,696	64.050	3,054,928.800	
FLUOR CORP (NEW)	19,968	59.290	1,183,902.720	
PPG INDUSTRIES INC	16,667	156.040	2,600,718.680	
PRAXAIR INC	35,306	117.160	4,136,450.960	
PRECISION CASTPARTS CORP	17,625	234.320	4,129,890.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	53,078	113.650	6,032,314.700	
T ROWE PRICE GROUP INC	32,882	75.560	2,484,563.920	
QUEST DIAGNOSTICS	19,752	59.000	1,165,368.000	
PROCTER & GAMBLE CO	332,811	79.800	26,558,317.800	
PROGRESSIVE CORP	74,696	26.020	1,943,589.920	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	62,905	32.410	2,038,751.050	
PULTE GROUP INC	40,688	19.020	773,885.760	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	47,010	14.580	685,405.800	

ULTRA PETROLEUM CORP	18,970	21.010	398,559.700	
QUALCOMM INC	210,089	60.440	12,697,779.160	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	16,533	44.390	733,899.870	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,570	86.980	484,478.600	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,914	236.700	2,109,943.800	
RESMED INC	16,867	43.260	729,666.420	
US BANCORP	225,031	37.070	8,341,899.170	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,467	52.770	1,080,043.590	
ROSS STORES INC	28,266	67.000	1,893,822.000	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,374	106.690	893,422.060	
ROPER INDUSTRIES INC	12,181	128.180	1,561,360.580	
ROWAN COMPANIES PLC-A	13,327	34.980	466,178.460	
PEABODY ENERGY CORP	33,467	15.390	515,057.130	
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,457	87.500	1,527,487.500	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,326	34.920	570,103.920	
RAYTHEON COMPANY	41,630	68.180	2,838,333.400	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	14,108	85.660	1,208,491.280	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,012	182.720	1,098,512.640	
FMC TECHNOLOGIES INC	28,849	58.010	1,673,530.490	
ACCENTURE PLC-CL A	77,007	74.350	5,725,470.450	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	200,619	29.150	5,848,043.850	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	23,210	41.910	972,731.100	
SANDISK CORP	28,831	59.830	1,724,958.730	
SAFEWAY INC	23,620	24.450	577,509.000	
ROCKWELL COLLINS INC	18,475	66.680	1,231,913.000	
ST JUDE MEDICAL INC	35,998	47.070	1,694,425.860	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	45,908	81.570	3,744,715.560	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	35,841	44.860	1,607,827.260	
PRICELINE.COM INC	6,148	892.320	5,485,983.360	
SCHLUMBERGER LTD	163,526	76.180	12,457,410.680	
SCHWAB (CHARLES) CORP	144,247	21.940	3,164,779.180	
JOY GLOBAL INC	12,702	49.320	626,462.640	
ZIMMER HOLDINGS INC	22,237	77.200	1,716,696.400	
SPX CORP	5,525	74.470	411,446.750	
BUNGE LTD	17,339	74.110	1,284,993.290	
SEI INVESTMENTS CO	15,882	29.690	471,536.580	
WELLPOINT INC	36,812	84.750	3,119,817.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	28,187	56.550	1,593,974.850	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	36,833	38.410	1,414,755.530	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,587	184.850	2,141,856.950	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,617	27.540	457,632.180	
SIGMA-ALDRICH	14,239	82.910	1,180,555.490	

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	55,592	77.430	4,304,488.560	
ADVANCE AUTO PARTS	9,721	82.750	804,412.750	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	42,666	38.780	1,654,587.480	
EDISON INTERNATIONAL	40,713	47.750	1,944,045.750	
SOUTHERN CO	105,876	44.230	4,682,895.480	
BB&T CORP	82,994	34.800	2,888,191.200	
SOUTHWEST AIRLINES	17,528	13.140	230,317.920	
AT&T INC	666,183	35.390	23,576,216.370	
CHEVRON CORP	236,486	122.900	29,064,129.400	
MEADWESTVACO CORP	16,496	34.780	573,730.880	
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,491	79.960	1,398,580.360	
STAPLES INC	85,931	16.360	1,405,831.160	
STATE STREET CORP	55,303	68.580	3,792,679.740	
STARBUCKS CORP	89,728	68.100	6,110,476.800	
STRYKER CORP	38,480	66.350	2,553,148.000	
NETFLIX INC	6,260	243.820	1,526,313.200	
STERICYCLE INC	10,607	115.310	1,223,093.170	
SUNTRUST BANKS INC	64,306	33.930	2,181,902.580	
SYMANTEC CORP	83,895	23.100	1,937,974.500	
SYNOPSIS INC	22,281	36.840	820,832.040	
SYSCO CORP	73,723	34.950	2,576,618.850	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,904	422.680	2,072,822.720	
TESORO CORP	15,352	50.620	777,118.240	
TEXAS INSTRUMENTS INC	136,396	36.590	4,990,729.640	
TEXTRON INC	35,448	27.280	967,021.440	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	44,516	88.040	3,919,188.640	
TIFFANY & CO	15,300	75.900	1,161,270.000	
TOLL BROTHERS INC	17,142	32.510	557,286.420	
TORCHMARK CORP	13,057	68.580	895,449.060	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,367	25.300	616,485.100	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,997	116.400	1,280,050.800	
TRACTOR SUPPLY CO	8,907	122.170	1,088,168.190	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	31,924	27.770	886,529.480	
TYSON FOODS INC	28,867	26.770	772,769.590	
MARATHON OIL CORP	85,390	36.240	3,094,533.600	
UNION PACIFIC CORP	56,180	157.630	8,855,653.400	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	106,138	97.790	10,379,235.020	
UNITEDHEALTH GROUP INC	122,069	67.690	8,262,850.610	
SPRINT NEXTEL CORP	371,958	7.180	2,670,658.440	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,483	66.930	969,347.190	
VF CORP	11,069	197.890	2,190,444.410	
CBS CORP	70,482	51.170	3,606,563.940	

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,119	81.640	2,132,355.160	
VULCAN MATERIALS CO	15,610	49.330	770,041.300	
URBAN OUTFITTERS INC	13,462	42.340	569,981.080	
WALGREEN CO	109,586	47.850	5,243,690.100	
WAL-MART STORES INC	203,189	76.770	15,598,819.530	
WASTE MANAGEMENT INC	52,872	41.400	2,188,900.800	
WATERS CORP	10,272	104.280	1,071,164.160	
ACTAVIS INC	15,718	124.070	1,950,132.260	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	13,299	104.530	1,390,144.470	
WESTERN DIGITAL CORP	26,378	67.230	1,773,392.940	
WHIRLPOOL CORP	9,109	119.620	1,089,618.580	
WYNN RESORTS LTD	9,243	127.270	1,176,356.610	
WHOLE FOODS MARKET INC	43,894	54.660	2,399,246.040	
NASDAQ OMX GROUP	10,282	33.270	342,082.140	
CME GROUP INC	38,949	76.450	2,977,651.050	
WILLIAMS COS INC	78,697	33.180	2,611,166.460	
DICK'S SPORTING GOODS INC	13,866	49.830	690,942.780	
LKQ CORP	37,131	25.920	962,435.520	
PEPCO HOLDINGS INC	36,572	19.910	728,148.520	
ALLIANT ENERGY CORP	17,827	51.440	917,020.880	
WISCONSIN ENERGY CORP	28,552	41.740	1,191,760.480	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,824	59.480	465,371.520	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	26.160	650,076.000	
CARMAX INC	24,979	48.530	1,212,230.870	
XEROX CORP	146,264	9.600	1,404,134.400	
XILINX INC	32,314	41.160	1,330,044.240	
YAHOO! INC	117,324	26.560	3,116,125.440	
CIMAREX ENERGY CO	11,195	70.400	788,128.000	
TJX COMPANIES INC	86,711	51.770	4,489,028.470	
HOSPIRA INC	21,954	39.400	864,987.600	
CBRE GROUP INC	38,714	23.430	907,069.020	
LIBERTY GLOBAL PLC	24,021	77.420	1,859,705.820	
REGIONS FINANCIAL CORP	169,883	10.130	1,720,914.790	
GOOGLE INC	32,627	905.990	29,559,735.730	
T-MOBILE US INC	19,051	24.420	465,225.420	
LAS VEGAS SANDS CORP	49,833	53.150	2,648,623.950	
MOSAIC CO/THE	35,034	55.600	1,947,890.400	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	59,514	30.060	1,788,990.840	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	175,792	30.020	5,277,275.840	
HERBALIFE LTD	11,353	49.500	561,973.500	
CELANESE CORP	19,554	46.830	915,713.820	
WINDSTREAM CORP	73,694	8.150	600,606.100	

IHS INC-CLASS A	7,888	108.820	858,372.160	
DISCOVERY COMMNUCATIONS-A	17,131	82.860	1,419,474.660	
EXPEDIA INC	14,711	63.220	930,029.420	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,231	180.840	1,307,654.040	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	25,591	84.560	2,163,974.960	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	19,801	72.700	1,439,532.700	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	32,655	23.350	762,494.250	
GAMESTOP CORP. - CL. A	14,066	42.420	596,679.720	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,847	179.270	1,586,001.690	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,718	61.810	477,049.580	
VIACOM INC-CLASS B	52,891	70.150	3,710,303.650	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,870	382.030	1,478,456.100	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	10,239	30.750	314,849.250	
NYSE EURONEXT	31,411	41.590	1,306,383.490	
TRANSDIGM GROUP INC	6,075	160.800	976,860.000	
MASTERCARD INC	12,725	590.910	7,519,329.750	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	65,821	24.020	1,581,020.420	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	17,165	59.520	1,021,660.800	
WESTERN UNION CO	72,733	17.330	1,260,462.890	
WARNER CHILCOTT PLC - CLASS A	27,146	19.530	530,161.380	
SAIC INC	34,518	14.170	489,120.060	
KBR INC	15,988	32.520	519,929.760	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	45,731	26.240	1,199,981.440	
SPECTRA ENERGY CORP	81,160	35.290	2,864,136.400	
TIME WARNER CABLE INC	34,878	113.850	3,970,860.300	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	35,585	15.150	539,112.750	
DELTA AIR LINES INC	22,701	18.700	424,508.700	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,159	90.940	560,099.460	
DISCOVER FINANCIAL	60,224	49.740	2,995,541.760	
COVIDIEN PLC	56,572	58.050	3,284,004.600	
TE CONNECTIVITY LTD	50,456	46.700	2,356,295.200	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	12,141	88.300	1,072,050.300	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,339	65.690	810,548.910	
VMWARE INC	10,086	67.140	677,174.040	
TERADATA CORP	19,646	52.800	1,037,308.800	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	7,107	99.290	705,654.030	
INVESCO LTD	54,025	31.340	1,693,143.500	
CALPINE CORP NPR	42,931	21.210	910,566.510	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	200,847	88.430	17,760,900.210	
VISA INC	64,671	186.700	12,074,075.700	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	26,275	46.960	1,233,874.000	

	AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,996	41.750	918,333.000	
	LORILLARD INC	47,014	45.750	2,150,890.500	
	SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	11,070	71.000	785,970.000	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	13,126	74.430	976,968.180	
	MARATHON PETROLEUM CORP	40,014	68.300	2,732,956.200	
	CAREFUSION CORP	26,093	37.890	988,663.770	
	KINDER MORGAN INC/DELAWARE	83,416	39.320	3,279,917.120	
	XYLEM INC	22,549	28.970	653,244.530	
	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	53,644	69.810	3,744,887.640	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	32,468	38.330	1,244,498.440	
	LINKEDIN CORP	10,629	188.390	2,002,397.310	
	HCA HOLDINGS INC	28,526	37.270	1,063,164.020	
	NIELSEN HOLDINGS NV	26,310	33.530	882,174.300	
	VERISK ANALYTICS INC	19,955	61.670	1,230,624.850	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	23,363	72.950	1,704,330.850	
	FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	14,603	39.550	577,548.650	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	32,899	27.910	918,211.090	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	7,245	125.350	908,160.750	
	CIT GROUP INC	24,840	49.360	1,226,102.400	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	713,000	0.750	534,750.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	38,091	54.780	2,086,624.980	
	AON PLC	35,899	65.300	2,344,204.700	
	REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	48.730	558,640.720	
	QEP RESOURCES INC	25,069	29.470	738,783.430	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	36.100	555,687.300	
	GENERAL MOTORS CO	89,662	35.330	3,167,758.460	
	TRIPADVISOR INC	12,944	61.950	801,880.800	
	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	35,528	53.780	1,910,695.840	
	PHILLIPS 66	71,137	56.090	3,990,074.330	
	LIBERTY MEDIA CORP	11,365	135.060	1,534,956.900	
	FACEBOOK INC	193,636	25.800	4,995,808.800	
	ADT CORP	23,368	41.880	978,651.840	
	KRAFT FOODS GROUP INC	69,953	56.060	3,921,565.180	
	ABBVIE INC	190,314	43.910	8,356,687.740	
	ZOETIS INC	62,304	31.040	1,933,916.160	
	NEWS CORP/NEW-CL A	43,948	15.390	676,359.720	
	NEWS CORP/NEW-CL B	14,878	15.450	229,865.100	
アメリカ・ドル	小計	37,918,094		1,841,332,072.130 (183,415,087,706)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	92,697	3.985	369,397.540	
	AMEC PLC	28,599	10.370	296,571.630	

ANTOFAGASTA PLC	44,020	8.145	358,542.900	
SEVERN TRENT PLC	28,908	17.430	503,866.440	
BHP BILLITON PLC	254,829	17.215	4,386,881.230	
BARCLAYS PLC	1,510,050	3.020	4,560,351.000	
BT GROUP PLC	951,913	3.357	3,195,571.940	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	125,523	8.260	1,036,819.980	
AGGREKO PLC	27,635	18.100	500,193.500	
TULLOW OIL PLC	110,342	10.900	1,202,727.800	
BUNZL PLC	47,967	13.920	667,700.640	
EASYJET PLC	13,628	13.360	182,070.080	
CAPITA PLC	82,174	10.260	843,105.240	
AVIVA PLC	348,949	3.678	1,283,434.420	
CRODA INTERNATIONAL	18,042	25.810	465,664.020	
DIAGEO PLC	307,688	19.880	6,116,837.440	
SCHRODERS PLC	12,609	23.830	300,472.470	
NATIONAL GRID PLC	445,033	7.600	3,382,250.800	
GKN PLC	182,053	3.290	598,954.370	
KINGFISHER PLC	286,010	3.736	1,068,533.360	
BAE SYSTEMS PLC	394,089	4.202	1,655,961.970	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	235,775	34.820	8,209,685.500	
COBHAM PLC	147,144	2.867	421,861.840	
NEXT PLC	21,370	47.690	1,019,135.300	
REXAM PLC	94,964	4.753	451,363.890	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	116,230	22.850	2,655,855.500	
IMI PLC	37,027	13.430	497,272.610	
JOHNSON MATTHEY PLC	29,088	28.120	817,954.560	
SABMILLER PLC	119,199	32.030	3,817,943.970	
ANGLO AMERICAN PLC	168,043	12.680	2,130,785.240	
COMPASS GROUP PLC	234,521	8.895	2,086,064.290	
HSBC HOLDINGS PLC	2,255,293	7.215	16,271,938.990	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	714,594	1.876	1,340,578.340	
ARM HOLDINGS PLC	161,360	8.545	1,378,821.200	
CENTRICA PLC	651,893	3.746	2,441,991.170	
UNILEVER PLC	153,498	27.650	4,244,219.700	
MEGGITT PLC	95,590	5.620	537,215.800	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	274,675	2.820	774,583.500	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82,325	7.110	585,330.750	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	411,297	1.247	512,887.350	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	46,419	18.150	842,504.850	
PEARSON PLC	99,504	12.300	1,223,899.200	
PERSIMMON PLC	29,923	12.650	378,525.950	
PRUDENTIAL PLC	310,312	11.140	3,456,875.680	

RIO TINTO PLC	157,807	27.095	4,275,780.660	
VODAFONE GROUP PLC	5,947,987	1.925	11,449,874.970	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	77,660	49.500	3,844,170.000	
REED ELSEVIER PLC	155,014	7.975	1,236,236.650	
OLD MUTUAL PLC	601,615	1.927	1,159,312.100	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	231,515	11.960	2,768,919.400	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	270,153	3.013	813,970.980	
TRAVIS PERKINS PLC	32,096	16.200	519,955.200	
SSE PLC	110,312	16.000	1,764,992.000	
SERCO GROUP PLC	72,250	6.805	491,661.250	
BP PLC	2,334,859	4.694	10,959,828.140	
SHIRE PLC	63,164	22.200	1,402,240.800	
SAGE GROUP PLC(THE)	136,991	3.622	496,181.400	
INVENSYS PLC	92,740	4.309	399,616.660	
SMITHS GROUP PLC	46,973	13.760	646,348.480	
STANDARD CHARTERED PLC	287,804	15.060	4,334,328.240	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,638,190	0.661	3,726,843.590	
TATE & LYLE PLC	60,088	8.785	527,873.080	
BG GROUP PLC	409,135	11.570	4,733,691.950	
TESCO PLC	960,967	3.495	3,358,579.660	
3I GROUP PLC	119,685	3.718	444,988.830	
SMITH & NEPHEW PLC	123,146	7.685	946,377.010	
GLAXOSMITHKLINE PLC	595,378	17.530	10,436,976.340	
WEIR GROUP	26,057	21.520	560,746.640	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	29,945	14.920	446,779.400	
BABCOCK INT'L GROUP	43,025	11.840	509,416.000	
WPP PLC	154,991	11.730	1,818,044.430	
WOLSELEY PLC	34,490	32.670	1,126,788.300	
ASTRAZENECA PLC	149,585	32.695	4,890,681.570	
WHITBREAD PLC	22,710	31.610	717,863.100	
CARNIVAL PLC	22,689	24.400	553,611.600	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	195,589	4.528	885,626.990	
INTERTEK GROUP PLC	19,178	30.770	590,107.060	
WILLIAM HILL PLC	104,797	4.659	488,249.220	
BURBERRY GROUP PLC	53,390	15.090	805,655.100	
INVESTEC PLC	50,655	4.270	216,296.850	
INTERCONTINENTAL HOTELS	31,773	19.330	614,172.090	
VEDANTA RESOURCES PLC	14,891	10.620	158,142.420	
ICAP PLC	52,823	3.849	203,315.720	
ITV PLC	446,892	1.521	679,722.730	
SAINSBURY (J) PLC	147,222	3.738	550,315.830	

平成25年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	10,689	41.050	438,783.450	
	G4S PLC	171,953	2.256	387,925.960	
	ADMIRAL GROUP PLC	22,361	13.500	301,873.500	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	461,462	21.810	10,064,486.220	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	315,744	22.715	7,172,124.960	
	INMARSAT PLC	63,120	6.715	423,850.800	
	PETROFAC LTD	29,942	13.020	389,844.840	
	STANDARD LIFE PLC	275,631	3.814	1,051,256.630	
	EXPERIAN PLC	123,000	11.900	1,463,700.000	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	9.485	245,917.590	
	TUI TRAVEL PLC	52,043	3.764	195,889.850	
	MELROSE PLC	160,488	2.722	436,848.330	
	FRESNILLO PLC NPR	23,779	9.035	214,843.260	
	RESOLUTION LTD	174,815	3.062	535,283.530	
	GLENCORE XSTRATA PLC	1,186,945	2.576	3,057,570.320	
	COCA-COLA HBC AG	25,293	16.790	424,669.470	
イギリス・ポンド 小計		35,052,225		202,432,355.100 (30,445,826,207)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	133,450	16.640	2,220,608.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	181,502	12.040	2,185,284.080	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	313,742	5.120	1,606,359.040	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	66,569	35.500	2,363,199.500	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	104,972	142.000	14,906,024.000	
	ISRAEL CORP LTD/THE	126	2,186.000	275,436.000	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	4,832	181.600	877,491.200	
イスラエル・シュケル 小計		805,193		24,434,401.820 (670,479,985)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	36.620	468,552.900	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	334,775	28.640	9,587,956.000	
	AMCOR LTD	144,717	10.800	1,562,943.600	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	378,691	29.040	10,997,186.640	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	190,644	3.360	640,563.840	
	TELSTRA CORP LTD	500,182	4.770	2,385,868.140	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,181	10.390	583,720.590	
	AMP LTD	380,894	4.410	1,679,742.540	
	ASX LTD	22,288	34.360	765,815.680	

BHP BILLITON LTD	394,269	31.830	12,549,582.270	
CALTEX AUSTRALIA LTD	14,149	18.440	260,907.560	
ALS LTD	34,895	9.140	318,940.300	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	2.440	248,267.560	
COMPUTERSHARE LT	50,472	10.100	509,767.200	
CSL LIMITED	60,823	65.960	4,011,885.080	
TRANSURBAN GROUP	160,451	6.800	1,091,066.800	
COCA-COLA AMATIL LTD	77,149	12.830	989,821.670	
COCHLEAR LTD	5,226	62.830	328,349.580	
ORIGIN ENERGY LTD	132,784	12.730	1,690,340.320	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	195,709	70.350	13,768,128.150	
BORAL LIMITED	84,744	4.270	361,856.880	
RIO TINTO LIMITED	53,066	52.390	2,780,127.740	
APA GROUP	122,365	6.240	763,557.600	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,859	5.670	1,269,280.530	
FLIGHT CENTRE LTD	4,423	44.650	197,486.950	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	68,718	9.690	665,877.420	
ORICA LTD	50,048	20.470	1,024,482.560	
LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	17.780	386,839.460	
SYDNEY AIRPORT	66,175	3.500	231,612.500	
MACQUARIE GROUP LTD	39,298	44.890	1,764,087.220	
WORLEYPARSONS LTD	23,411	20.420	478,052.620	
SUNCORP GROUP LTD	158,665	12.170	1,930,953.050	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	286,151	29.450	8,427,146.950	
NEWCREST MINING LTD	92,633	9.950	921,698.350	
INCITEC PIVOT LTD	165,148	2.890	477,277.720	
TOLL HOLDINGS LTD	72,011	5.390	388,139.290	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	127,737	1.355	173,083.630	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,314	16.570	2,374,712.980	
SANTOS LTD	120,305	13.930	1,675,848.650	
SONIC HEALTHCARE	45,868	14.690	673,800.920	
TABCORP HOLDINGS LTD	129,182	3.300	426,300.600	
WESFARMERS LTD	120,134	39.280	4,718,863.520	
ALUMINA LIMITED	388,179	1.070	415,351.530	
ILUKA RESOURCES LIM1	55,637	10.500	584,188.500	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	80,709	36.750	2,966,055.750	
WOOLWORTHS LTD	148,206	33.200	4,920,439.200	
METCASH LTD	79,084	3.650	288,656.600	
SEEK LTD	29,830	9.370	279,507.100	
TATTS GROUP LTD	141,350	3.240	457,974.000	
SP AUSNET	234,780	1.190	279,388.200	
AGL ENERGY LTD	75,845	14.860	1,127,056.700	

	BRAMBLES LTD	188,833	9.460	1,786,360.180	
	WHITEHAVEN COAL LTD	66,260	2.200	145,772.000	
	ASCIANO LTD	108,957	5.050	550,232.850	
	CROWN LTD	46,332	12.820	593,976.240	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	109,246	2.830	309,166.180	
	AURIZON HOLDINGS LTD	210,167	4.370	918,429.790	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	5.900	332,771.800	
オーストラリア・ドル 小計		7,487,672		112,505,820.180 (10,335,909,700)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	24,022	28.560	686,068.320	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	15,943	62.000	988,466.000	
	BARRICK GOLD CORP	118,208	14.690	1,736,475.520	
	ATCO LTD	2,966	43.590	129,287.940	
	TALISMAN ENERGY INC	125,274	12.200	1,528,342.800	
	BANK OF MONTREAL	79,622	62.200	4,952,488.400	
	BANK OF NOVA SCOTIA	143,316	55.740	7,988,433.840	
	NATIONAL BANK OF CANADA	21,076	75.040	1,581,543.040	
	BCE INC	32,838	43.460	1,427,139.480	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	70,893	38.200	2,708,112.600	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	38,361	94.940	3,641,993.340	
	BOMBARDIER INC 'B'	155,097	4.830	749,118.510	
	SAPUTO INC	15,632	46.950	733,922.400	
	RESEARCH IN MOTION LTD	56,591	9.800	554,591.800	
	CGI GROUP INC	29,163	30.790	897,928.770	
	CAE INC	31,436	11.380	357,741.680	
	CAMECO CORP	45,703	23.020	1,052,083.060	
	ROGERS COMM-CL B	46,012	41.000	1,886,492.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	49,439	74.400	3,678,261.600	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	131,277	32.670	4,288,819.590	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	9,334	83.180	776,402.120	
	CANADIAN UTILITIES LTD	15,036	35.920	540,093.120	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	53,167	103.450	5,500,126.150	
	AGRIUM INC	18,409	95.410	1,756,402.690	
	YAMANA GOLD INC	100,733	9.660	973,080.780	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,491	43.710	502,271.610	
	OPEN TEXT CORP	7,329	73.700	540,147.300	
	ELDORADO GOLD CORP	78,309	6.360	498,045.240	
	KINROSS GOLD CORP	125,461	4.870	610,995.070	
	FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	22.960	393,993.600	
	FORTIS INC	20,884	32.050	669,332.200	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,423	15.680	1,104,232.640	
TELUS CORP	26,152	31.440	822,218.880		

GREAT WEST LIFECO INC	39,777	30.550	1,215,187.350	
IMPERIAL OIL LTD	36,639	42.720	1,565,218.080	
ENBRIDGE INC	97,429	45.140	4,397,945.060	
IGM FINANCIAL INC	14,041	46.140	647,851.740	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	49,079	6.060	297,418.740	
MANULIFE FINANCIAL CORP	226,414	18.140	4,107,149.960	
LOBLAW CO LTD	17,526	47.060	824,773.560	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	35,435	17.920	634,995.200	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	7,922	42.790	338,982.380	
MAGNA INTERNATIONAL INC	29,587	76.870	2,274,352.690	
SUN LIFE FINANCIAL INC	72,863	33.270	2,424,152.010	
METRO INC	13,859	70.270	973,871.930	
HUSKY ENERGY INC	35,673	28.430	1,014,183.390	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,756	37.040	1,620,722.240	
ONEX CORP	10,676	49.070	523,871.320	
GOLDCORP INC	101,806	25.350	2,580,782.100	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	104,742	41.080	4,302,801.360	
POWER CORP OF CANADA	39,841	29.160	1,161,763.560	
POWER FINANCIAL CORP	32,185	32.050	1,031,529.250	
ROYAL BANK OF CANADA	174,000	61.230	10,654,020.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	20,986	44.500	933,877.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,454	129.170	2,771,213.180	
SHAW COMM INC-B	56,820	25.470	1,447,205.400	
SHOPPERS DRUG MART CORP	27,526	48.140	1,325,101.640	
NEW GOLD INC	51,627	6.780	350,031.060	
SUNCOR ENERGY INC	183,939	32.140	5,911,799.460	
ENCANA CORP	87,507	18.000	1,575,126.000	
TECK RESOURCES LTD-CL B	71,741	21.840	1,566,823.440	
THOMSON REUTERS CORP	49,184	35.060	1,724,391.040	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	110,792	84.180	9,326,470.560	
TRANSCANADA CORP	89,998	46.440	4,179,507.120	
TRANSALTA CORP	34,014	14.370	488,781.180	
WESTON (GEORGE) LTD	7,627	83.220	634,718.940	
INTACT FINANCIAL CORP	16,454	59.530	979,506.620	
SILVER WHEATON CORP	41,308	20.340	840,204.720	
CATAMARAN CORP	25,679	49.790	1,278,557.410	
BELL ALIANT INC	14,926	28.260	421,808.760	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,024	37.490	600,739.760	
CI FINANCIAL CORP	26,281	30.790	809,191.990	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	43.990	694,118.210	
KEYERA CORP	8,738	58.400	510,299.200	

	ALTAGAS LTD	12,358	37.120	458,728.960	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,549	33.060	1,274,429.940	
	TIM HORTONS INC	18,155	58.770	1,066,969.350	
	DOLLARAMA INC	6,908	76.650	529,498.200	
	BAYTEX ENERGY CORP	11,962	41.620	497,858.440	
	MEG ENERGY CORP	17,794	31.560	561,578.640	
	ATHABASCA OIL CORP	42,987	6.920	297,470.040	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	91,611	31.660	2,900,404.260	
	ENERPLUS CORP	20,814	16.280	338,851.920	
	VERMILION ENERGY INC	12,420	53.520	664,718.400	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	52,457	11.950	626,861.150	
	ARC RESOURCES LTD	38,621	28.150	1,087,181.150	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	53,022	19.930	1,056,728.460	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	32.090	358,381.120	
	BONAVISTA ENERGY CORP	16,429	14.260	234,277.540	
	PENGROWTH ENERGY CORP	76,902	5.350	411,425.700	
カナダ・ドル	小計	4,470,568		149,581,059.970 (14,307,428,386)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.080	510,000.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	139,000	5.040	700,560.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	250,000	4.290	1,072,500.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.560	460,118.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	210,000	16.340	3,431,400.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	63,000	10.850	683,550.000	
	SEMBCORP MARINE	108,000	4.400	475,200.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	40.700	529,100.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	141,000	7.320	1,032,120.000	
	CAPITALAND LTD	332,000	3.070	1,019,240.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	765,400	1.340	1,025,636.000	
	KEPPEL CORP LTD	174,500	10.660	1,860,170.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	332,000	1.910	634,120.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	0.905	372,645.510	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	323,200	10.150	3,280,480.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,001,867	3.750	3,757,001.250	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	10.090	659,886.000	
	KEPPEL LAND LTD	95,000	3.460	328,700.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	146,000	20.360	2,972,560.000	
	UOL GROUP LIMITED	9,000	6.560	59,040.000	
	STARHUB LTD	65,000	4.150	269,750.000	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	88,800	1.625	144,300.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.090	618,000.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	120,000	1.855	222,600.000	

	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	381,000	2.840	1,082,040.000	
シンガポール・ドル 小計		6,381,570		27,200,717.160 (2,143,416,513)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	186,528	26.600	4,961,644.800	
	SYNGENTA AG	11,240	389.800	4,381,352.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	393,062	63.350	24,900,477.700	
	CIE FINANC RICHEMONT-A	63,345	88.000	5,574,360.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	85,574	244.700	20,939,957.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,813	136.800	932,018.400	
	SIKA INHABER	262	2,541.000	665,742.000	
	SGS SA-REG	710	2,135.000	1,515,850.000	
	SULZER AG-REG	3,187	163.300	520,437.100	
	NOVARTIS AG-REG SHS	279,786	69.850	19,543,052.100	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,702	98.450	561,361.900	
	BARRY CALLEBAUT AG	390	884.000	344,760.000	
	SWISSCOM AG-REG	2,920	421.400	1,230,488.000	
	ABB LTD	265,814	21.130	5,616,649.820	
	ADECCO SA-REG	15,348	56.900	873,301.200	
	GEBERIT AG	4,974	246.600	1,226,588.400	
	LONZA GROUP AG-REG	5,846	73.850	431,727.100	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	3,667.000	333,697.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	42,855.000	557,115.000	
	UBS AG-REGISTERED	436,341	16.560	7,225,806.960	
	GIVAUDAN-REG	1,136	1,281.000	1,455,216.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,997	255.000	4,589,235.000	
	HOLCIM LTD-REG	27,289	65.900	1,798,345.100	
	ACTELION	12,017	59.850	719,217.450	
	SONOVA HOLDING AG	6,168	105.100	648,256.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,445	113.900	734,085.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,717	550.000	2,044,350.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	96.150	533,824.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,824	133.300	243,139.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,553	165.900	589,442.700	
SWISS PRIME SITE AG	8,711	69.350	604,107.850		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	271.250	545,212.500		
ARYZTA AG	13,689	54.000	739,206.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	30,873	38.970	1,203,120.810		
SWISS RE LTD	44,990	71.800	3,230,282.000		
TRANSOCEAN LTD	44,184	47.380	2,093,437.920		
スイス・フラン 小計		1,998,101		124,106,866.910 (13,025,015,682)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	77,654	165.400	12,843,971.600	

ATLAS COPCO AB-B SHS	55,503	148.100	8,219,994.300	
ELEKTA AB	46,758	108.100	5,054,539.800	
ERICSSON LM-B SHS	372,915	79.150	29,516,222.250	
GETINGE AB-B SHS	22,760	219.000	4,984,440.000	
SKF AB-B SHS	43,481	162.000	7,043,922.000	
SANDVIK AB	132,142	82.700	10,928,143.400	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	184,986	68.050	12,588,297.300	
SKANSKA AB-B SHS	39,626	115.900	4,592,653.400	
SWEDBANK AB	107,424	156.000	16,758,144.000	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	73,365	174.700	12,816,865.500	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,673	282.700	17,152,257.100	
VOLVO AB-B SHS	184,652	89.500	16,526,354.000	
SCANIA AB	35,390	140.300	4,965,217.000	
SWEDISH MATCH AB	24,727	239.300	5,917,171.100	
TELE2 AB-B SHS	44,358	81.250	3,604,087.500	
NORDEA AB	336,068	77.100	25,910,842.800	
INDUSTRIVARDEN C	18,353	115.500	2,119,771.500	
ELECTROLUX AB-SER B	28,642	169.000	4,840,498.000	
SECURITAS AB-B SHS	27,261	60.850	1,658,831.850	
INVESTOR AB-B SHS	55,047	194.800	10,723,155.600	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	116,141	235.200	27,316,363.200	
ASSA ABLOY AB-B	39,701	278.200	11,044,818.200	
TELIASONERA AB	280,470	45.350	12,719,314.500	
LUNDIN PETROLEUM AB	28,131	141.000	3,966,471.000	
BOLIDEN AB	40,727	83.050	3,382,377.350	
ALFA LAVAL AB	41,066	146.000	5,995,636.000	
KINNEVIK INVESTMENT B	23,218	195.900	4,548,406.200	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,723	493.900	3,814,389.700	
HUSQVARNA AB-B SHS	54,633	35.820	1,956,954.060	
RATOS AB	24,941	53.600	1,336,837.600	
HEXAGON AB	29,365	191.400	5,620,461.000	
スウェーデン・クローナ 小計	2,657,901		300,467,408.810 (4,504,006,458)	
デンマーク・ク ローネ				
CARLSBERG AS-B	12,479	535.000	6,676,265.000	
A P MOLLER A/S	147	43,680.000	6,420,960.000	
AP MOLLER MAERSK A	62	41,160.000	2,551,920.000	
DANSKE BANK A/S	84,736	102.000	8,643,072.000	
NOVOZYMES-B SHS	32,498	190.600	6,194,118.800	
NOVO NORDISK A/S-B	48,611	940.000	45,694,340.000	
TDC A/S	84,208	47.210	3,975,459.680	
COLOPLAST-B	15,865	336.300	5,335,399.500	

	DSV A/S	29,112	148.500	4,323,132.000	
	WILLIAM DEMANT	4,646	480.000	2,230,080.000	
デンマーク・クローネ 小計		312,364		92,044,746.980 (1,608,942,177)	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	111,882	8.660	968,898.120	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	341,753	2.320	792,866.960	
ニュージーランド・ドル 小計		453,635		1,761,765.080 (138,915,177)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	115,484	95.050	10,976,754.200	
	NORSK HYDRO ASA	130,459	24.750	3,228,860.250	
	TELENOR ASA	90,662	122.700	11,124,227.400	
	SUBSEA 7 SA	37,286	110.900	4,135,017.400	
	ORKLA ASA	86,098	51.850	4,464,181.300	
	STATOIL ASA	128,107	128.700	16,487,370.900	
	YARA INTERNATIONAL ASA	21,131	253.300	5,352,482.300	
	AKER SOLUTIONS ASA	18,936	84.950	1,608,613.200	
	SEADRILL LTD	45,817	255.300	11,697,080.100	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	21,678	93.900	2,035,564.200	
ノルウェー・クローネ 小計		695,658		71,110,151.250 (1,174,028,598)	
ユーロ	CRH PLC	92,675	15.435	1,430,438.620	
	KERRY GROUP PLC-A	19,924	46.595	928,358.780	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.168	407,037.450	
	UMICORE	13,643	32.430	442,442.490	
	AIR LIQUIDE	37,609	96.290	3,621,370.610	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	71,364	41.510	2,962,319.640	
	AXA	217,278	16.390	3,561,186.420	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,954	9.370	364,998.980	
	ADIDAS AG	25,113	84.430	2,120,290.590	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,240	13.920	2,007,820.800	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	309,702	0.627	194,183.150	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	55,622	14.080	783,157.760	
	DANONE	68,158	56.990	3,884,324.420	
	SAFRAN SA	31,493	42.610	1,341,916.730	
	INTESA SANPAOLO	1,470,722	1.283	1,886,936.320	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	40,285	69.000	2,779,665.000	
	ACCOR SA	17,313	27.575	477,405.970	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	9,683	29.325	283,953.970	
	BOUYGUES	22,659	19.900	450,914.100	
	BNP PARIBAS	123,363	44.100	5,440,308.300	
REED ELSEVIER NV	85,681	13.610	1,166,118.410		

THALES SA	12,532	37.670	472,080.440	
CAP GEMINI SA	18,774	39.000	732,186.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	71.760	471,247.920	
CHRISTIAN DIOR	6,765	132.650	897,377.250	
CGG	16,618	18.645	309,842.610	
UNICREDIT SPA	515,797	3.622	1,868,216.730	
NATIXIS	102,266	3.433	351,079.170	
KONINKLIJKE DSM NV	19,426	53.330	1,035,988.580	
DELHAIZE GROUP	12,505	49.855	623,436.770	
ELAN CORPORATION PLC	58,647	10.980	643,944.060	
COMMERZBANK AG	110,140	5.966	657,095.240	
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,176	96.050	1,457,654.800	
UNITED INTERNET	18,350	23.800	436,730.000	
FUCHS PETROLUB AG PEF	4,411	59.100	260,690.100	
PUBLICIS GROUPE	19,919	57.060	1,136,578.140	
MAN SE	5,152	84.500	435,344.000	
IBERDROLA SA	591,503	3.971	2,348,858.410	
ENI SPA	312,240	15.750	4,917,780.000	
JERONIMO MARTINS	33,291	15.810	526,330.710	
KESKO OYJ-B	8,791	22.490	197,709.590	
KBC GROUPE	30,921	30.955	957,159.550	
LAFARGE SA	24,016	46.930	1,127,070.880	
HANNOVER RUECK SE	5,730	55.960	320,650.800	
WARTSILA OYJ	21,069	35.930	757,009.170	
L'OREAL	29,216	129.050	3,770,324.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	30,418	132.400	4,027,343.200	
LAGARDERE S.C.A.	13,927	22.555	314,123.480	
GEA GROUP AG	20,171	28.230	569,427.330	
MEDIOBANCA SPA	81,452	4.468	363,927.530	
MICHELIN(CGDE)-B	21,992	72.800	1,601,017.600	
CONTINENTAL AG	13,371	111.700	1,493,540.700	
DEUTSCHE POST AG-REG	111,894	19.750	2,209,906.500	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,126	32.840	496,737.840	
AXEL SPRINGER AG	6,021	33.465	201,492.760	
OMV AG	19,954	32.890	656,287.060	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	67,989	2.836	192,816.800	
PERNOD-RICARD	26,170	88.410	2,313,689.700	
PIRELLI & C	30,073	8.930	268,551.890	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	19,395	58.880	1,141,977.600	
RENAULT SA	23,230	57.250	1,329,917.500	
REPSOL SA	101,124	16.810	1,699,894.440	
REMY COINTREAU	3,877	82.310	319,115.870	

MERCK KGAA	7,924	116.450	922,749.800	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	96,668	70.670	6,831,527.560	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	48,205	31.450	1,516,047.250	
SAIPEM	35,323	14.390	508,297.970	
RWE AG	64,201	22.335	1,433,929.330	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	19,633	40.240	790,031.920	
SOCIETE GENERALE-A	86,809	27.785	2,411,988.060	
VINCI S.A.	56,654	39.165	2,218,853.910	
SODEXO	12,740	68.160	868,358.400	
SOLVAY SA	6,923	101.900	705,453.700	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	65,031	57.110	3,713,920.410	
VIVENDI SA	143,667	15.000	2,155,005.000	
SAP AG	110,389	55.900	6,170,745.100	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	12,461	82.950	1,033,639.950	
TELEFONICA S.A	489,580	10.085	4,937,414.300	
TOTAL SA	260,619	38.240	9,966,070.560	
VALLOUREC	11,847	41.100	486,911.700	
E.ON SE	210,787	12.065	2,543,145.150	
VOEST-ALPINE AG	17,613	27.280	480,482.640	
ZODIAC AEROSPACE	5,696	107.300	611,180.800	
HENKEL AG & CO KGAA	17,444	61.810	1,078,213.640	
METRO AG	11,655	24.825	289,335.370	
SIEMENS AG-REG	95,036	78.940	7,502,141.840	
UPM-KYMMENE OYJ	66,925	7.700	515,322.500	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	27,987	5.900	165,123.300	
ING GROEP NV-CVA	460,348	7.479	3,442,942.690	
BAYER AG	101,317	83.320	8,441,732.440	
STORA ENSO OYJ-R SHS	67,549	5.430	366,791.070	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,464	73.590	1,432,355.760	
DAIMLER AG	118,888	48.755	5,796,384.440	
BASF SE	112,530	69.950	7,871,473.500	
CELESIO AG	16,256	15.440	250,992.640	
BEIERSDORF AG	12,865	69.860	898,748.900	
HOCHTIEF AG	4,785	53.340	255,231.900	
HEIDELBERGCEMENT AG	17,319	50.190	869,240.610	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	25,367	49.695	1,260,613.060	
ORANGE	218,731	7.275	1,591,268.020	
SAMPO OYJ-A SHS	51,825	32.350	1,676,538.750	
RANDSTAD HOLDINGS	13,985	33.405	467,168.920	
ALLIANZ SE	56,299	114.250	6,432,160.750	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	203,441	2.481	504,737.120	

KONINKLIJKE AHOLD NV	132,809	12.415	1,648,823.730	
PROSIEBEN MEDIA N/V VORZUG REG	13,630	33.740	459,876.200	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	15.230	415,763.770	
ERSTE GROUP BANK AG	30,671	19.900	610,352.900	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	21,515	143.200	3,080,948.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	124,180	9.067	1,125,940.060	
SOCIETE BIC SA	3,322	80.370	266,989.140	
DASSAULT SYSTEMES SA	7,659	99.260	760,232.340	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,991	19.940	378,680.540	
HEINEKEN NV	28,277	51.710	1,462,203.670	
AKZO NOBEL	28,476	46.840	1,333,815.840	
ASML HOLDING NV	41,667	64.840	2,701,688.280	
AEGON NV	221,649	5.735	1,271,157.010	
VOLKSWAGEN AG	3,623	156.250	566,093.750	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,186	163.150	2,803,895.900	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	677,870	6.420	4,351,925.400	
KERING	8,562	167.600	1,434,991.200	
CNP ASSURANCES	22,463	11.750	263,940.250	
ACCIONA S.A.	2,548	41.895	106,748.460	
FORTUM OYJ	52,604	14.540	764,862.160	
AGEAS	30,098	28.165	847,710.170	
UCB SA	13,239	43.015	569,475.580	
THYSSENKRUPP AG	44,483	14.890	662,351.870	
UNILEVER NV-CVA	200,571	31.270	6,271,855.170	
CARREFOUR SA	69,876	21.150	1,477,877.400	
GAS NATURAL SDG SA	36,738	15.420	566,499.960	
ATOS	6,025	57.600	347,040.000	
NOKIA OYJ	460,657	3.202	1,475,023.710	
POHJOLA BANK PLC	9,831	12.540	123,280.740	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	116,292	21.970	2,554,935.240	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,008	17.270	587,318.160	
SANOFI	146,054	79.110	11,554,331.940	
IMMOFINANZ AG	131,110	3.067	402,114.370	
STMICROELECTRONICS NV	80,884	7.229	584,710.430	
ELISA OYJ	13,898	15.620	217,086.760	
BANCO SANTANDER SA	1,303,098	5.095	6,639,284.310	
METSO OYJ	18,547	27.550	510,969.850	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	15,682	41.590	652,214.380	
QIAGEN N.V.	27,019	15.415	416,497.880	
LINDE AG	22,581	144.100	3,253,922.100	
FIAT SPA	119,079	5.850	696,612.150	
DEUTSCHE BANK AG-REG	122,166	33.095	4,043,083.770	

BMW VORZUG	6,146	54.770	336,616.420	
K & S	18,738	27.190	509,486.220	
SUEDZUCKER AG	11,866	24.950	296,056.700	
ENEL SPA	762,928	2.428	1,852,389.180	
COLRUYT NV	7,116	41.825	297,626.700	
VOPAK (KON.)	8,976	46.120	413,973.120	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	347,987	8.857	3,082,120.850	
BANCO POPULAR ESPANOL	144,093	2.571	370,463.100	
FINMECCANICA SPA	55,583	3.866	214,883.870	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	127,495	6.628	845,036.860	
KONINKLIJKE KPN NV	366,685	1.633	598,796.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	23,933	51.690	1,237,096.770	
BANCO SABADELL	351,035	1.511	530,413.880	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,358	59.260	554,555.080	
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.001	0.510	
OPAP SA	29,941	6.060	181,442.460	
FRAPORT AG	6,165	47.370	292,036.050	
HEINEKEN HOLDING NV-A	12,515	46.080	576,691.200	
INDITEX	27,058	98.600	2,667,918.800	
ANDRITZ AG	9,129	42.150	384,787.350	
MAPFRE SA	135,413	2.737	370,625.380	
ESSILOR INTL	24,973	81.860	2,044,289.780	
SNAM SPA	225,511	3.500	789,288.500	
CREDIT AGRICOLE SA	131,294	6.751	886,365.790	
ENAGAS	15,332	18.725	287,091.700	
WENDEL	4,087	82.970	339,098.390	
TENARIS SA	58,832	16.920	995,437.440	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	137,041	2.918	399,885.630	
TELECOM ITALIA SPA	1,035,863	0.528	546,935.660	
TELECOM ITALIA-RNC	792,074	0.421	333,463.150	
ATLANTIA SPA	38,919	12.750	496,217.250	
ILIAD SA	2,821	178.900	504,676.900	
BELGACOM SA	23,896	17.185	410,652.760	
SES FDR	39,141	22.735	889,870.630	
TERNA SPA	179,290	3.260	584,485.400	
GRIFOLS SA	17,550	30.370	532,993.500	
FERROVIAL SA	45,760	12.815	586,414.400	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	11,028	44.920	495,377.760	
EXOR SPA	9,585	24.000	230,040.000	
NESTE OIL OYJ	23,509	11.050	259,774.450	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	20.000	181,980.000	
IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.000	0.000	

FUGRO CERT	10,228	41.935	428,911.180	
KONE OYJ	18,998	63.100	1,198,773.800	
GDF SUEZ	163,724	15.225	2,492,697.900	
ALSTOM	28,395	25.040	711,010.800	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	37.145	186,653.620	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	22.355	390,094.750	
ELECTRICITE DE FRANCE	31,118	19.805	616,291.990	
ARKEMA SA	7,958	74.170	590,244.860	
LEGRAND SA	33,102	38.240	1,265,820.480	
ADP	4,749	74.900	355,700.100	
ORION OYJ	17,482	18.580	324,815.560	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	11.670	396,990.060	
SCOR SE	22,917	23.445	537,289.060	
REXEL SA	20,799	18.125	376,981.870	
PRYSMIAN SPA	27,099	14.780	400,523.220	
CAIXABANK	149,185	2.627	391,908.990	
BUREAU VERITAS SA	30,760	21.295	655,034.200	
GROUPE EUROTUNNEL SA	76,011	5.893	447,932.820	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	10.105	229,110.660	
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	47,618	25.570	1,217,592.260	
TNT EXPRESS NV W/I	34,234	5.938	203,281.490	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	12,189	84.400	1,028,751.600	
ENEL GREEN POWER SPA	224,723	1.613	362,478.190	
BRENTAG AG	5,161	122.000	629,642.000	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	125,533	3.156	396,182.140	
FIAT INDUSTRIAL SPA	109,614	8.800	964,603.200	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	5.900	345,781.300	
DELTA LLOYD NV	19,898	16.215	322,646.070	
EDENRED	27,224	23.725	645,889.400	
BANKIA SA	463,650	0.610	282,826.500	
ZIGGO NV	16,833	31.150	524,347.950	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	31,777	5.334	169,498.510	
DE MASTER BLENDERS1753 NVW	61,414	12.355	758,769.970	
HUGO BOSS AG -ORD	4,016	85.850	344,773.600	
OSRAM LICHT AG	9,503	27.645	262,710.430	
GEMALTO	8,626	70.540	608,478.040	
REPSOL SA-RTS	101,118	0.445	44,997.510	
ERSTE GROUP BANK AG-RTS	30,671	0.067	2,054.950	
IBERDROLA SA - RTS	591,503	0.132	78,078.390	

	ACS ACTIVIDADES CONS Y - RTS	18,991	1.110	21,080.010	
ユーロ 小計		24,060,969		302,743,345.630 (39,471,677,404)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	36,200	82.800	2,997,360.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	25.750	5,613,500.000	
	BANK OF EAST ASIA	193,260	27.900	5,391,954.000	
	CLP HOLDINGS LTD	236,000	62.900	14,844,400.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	211,000	13.260	2,797,860.000	
	LI & FUNG LTD	754,400	11.220	8,464,368.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	171,000	106.200	18,160,200.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	52.600	2,577,400.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	132,600	116.900	15,500,940.000	
	MTR CORP	165,500	28.600	4,733,300.000	
	FIRST PACIFIC CO	380,000	8.580	3,260,400.000	
	HANG SENG BANK LTD	100,200	114.600	11,482,920.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	150,700	47.700	7,188,390.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	172,000	68.800	11,833,600.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	189,750	66.050	12,532,987.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	713,740	19.460	13,889,380.400	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	254,000	84.150	21,374,100.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	88,000	33.400	2,939,200.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	261,000	36.350	9,487,350.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	88,000	30.500	2,684,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	451,500	23.750	10,723,125.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	86,000	20.250	1,741,500.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	430,700	10.960	4,720,472.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	13.460	3,095,800.000	
	SINO LAND CO	429,400	10.640	4,568,816.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	190,000	100.000	19,000,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	98,000	94.000	9,212,000.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	107,000	40.000	4,280,000.000	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	77,500	35.900	2,782,250.000	
	SJM HOLDINGS LTD	284,000	18.000	5,112,000.000	
	WYNN MACAU LTD	223,600	20.050	4,483,180.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	89,600	20.700	1,854,720.000	
	AIA GROUP LTD	1,449,000	34.050	49,338,450.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	104,000	7.240	752,960.000	
	SANDS CHINA LTD	320,000	38.100	12,192,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	22.800	3,720,960.000	
	FIRST PACIFIC CO LTD-RIGHTS	47,500	0.149	7,077.500	
香港・ドル 小計		9,345,350		315,338,920.400 (4,048,951,738)	

合計	131,639,300		305,289,685,731 (305,289,685,731)	
----	-------------	--	--------------------------------------	--

(2) 株式以外の有価証券

平成25年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	235,579.000	459,379.050		
		DEXUS PROPERTY GROUP	553,747.000	586,971.820		
		FEDERATION CENTRES	234,445.000	553,290.200		
		GOODMAN GROUP	214,527.000	1,021,148.520		
		GPT GROUP	198,416.000	767,869.920		
		LEND LEASE GROUP	79,483.000	704,219.380		
		MIRVAC GROUP	519,514.000	875,381.090		
		STOCKLAND	284,414.000	995,449.000		
		WESTFIELD GROUP	255,799.000	2,980,058.350		
		WESTFIELD RETAIL TRUST	418,064.000	1,279,275.840		
	オーストラリア・ドル 小計			2,993,988.000	10,223,043.170 (939,190,976)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.000	650,993.200		
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	309,115.000		
		CAPITAMALL TRUST	294,800.000	579,282.000		
シンガポール・ドル 小計			801,706.000	1,539,390.200 (121,303,948)		
投資信託受益証券 合計			3,795,694	1,060,494,924 (1,060,494,924)		
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	45,817.000	950,244.580		
		AMERICAN TOWER CORP	49,500.000	3,749,130.000		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	118,204.000	1,362,892.120		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,101.000	1,938,887.500		
		BOSTON PROPERTIES INC	18,404.000	1,966,651.440		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	448,434.750		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,517.000	950,416.250		
		DUKE REALTY TRUST	38,117.000	611,396.680		
		EQUITY RESIDENTIAL	42,680.000	2,471,598.800		
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,764.000	799,148.520		
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	57,341.000	1,174,917.090		
		HCP INC	52,697.000	2,371,365.000		
		HEALTH CARE REIT INC	30,578.000	2,008,363.040		
		HOST HOTELS & RESORTS INC	92,071.000	1,637,943.090		
		KIMCO REALTY	53,036.000	1,164,670.560		
LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.000	615,712.500				

	PLUM CREEK TIMBER CO	21,734.000	1,030,408.940	
	PROLOGIS INC	60,701.000	2,322,420.260	
	PUBLIC STORAGE	18,499.000	2,872,154.740	
	RAYONIER INC	16,734.000	935,095.920	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	723,907.590	
	REGENCY CENTERS CORP	10,144.000	520,995.840	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,237.000	5,987,709.600	
	SL GREEN	10,737.000	978,033.330	
	THE MACERICH COMPANY	15,776.000	990,732.800	
	UDR INC	28,307.000	720,413.150	
	VENTAS INC	36,306.000	2,492,406.900	
	VORNADO REALTY TRUST	20,461.000	1,748,801.670	
	WEYERHAEUSER CO	71,453.000	2,053,559.220	
アメリカ・ドル 小計		1,023,212.000	47,598,411.880 (4,741,277,807)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	113,808.000	689,676.480	
	HAMMERSON PLC	101,418.000	540,557.940	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	290,765.930	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,202.000	1,032,788.090	
	SEGRO PLC	87,111.000	255,932.110	
イギリス・ポンド 小計		499,649.000	2,809,720.550 (422,581,970)	
カナダ・ドル	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	35,844.000	617,950.560	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	210,481.530	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	398,356.280	
カナダ・ドル 小計		61,339.000	1,226,788.370 (117,342,308)	
ユーロ	CORIO NV	7,710.000	240,783.300	
	FONCIERE DES REGIONS	1,321.000	79,193.950	
	GECINA SA	2,977.000	265,340.010	
	KLEPIERRE	13,172.000	423,545.660	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	11,885.000	2,192,188.250	
ユーロ 小計		37,065.000	3,201,051.170 (417,353,051)	
香港・ドル	LINK REIT/THE	283,000.000	10,853,050.000	
香港・ドル 小計		283,000.000	10,853,050.000 (139,353,162)	
投資証券 合計		1,904,265	5,837,908,298 (5,837,908,298)	
合計			6,898,403,222 (6,898,403,222)	

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 575銘柄	57.82%	-%	-%	60.27%
	投資証券 29銘柄	-%	-%	1.49%	
イギリス・ポンド	株式 101銘柄	9.60%	-%	-%	9.89%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
イスラエル・シケル	株式 7銘柄	0.21%	-%	-%	0.21%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	3.26%	-%	-%	3.61%
	投資信託 受益証券 10銘柄	-%	0.30%	-%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	4.51%	-%	-%	4.62%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.04%	
シンガポール・ドル	株式 25銘柄	0.68%	-%	-%	0.73%
	投資信託 受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 36銘柄	4.11%	-%	-%	4.17%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	1.42%	-%	-%	1.44%
デンマーク・クローネ	株式 10銘柄	0.51%	-%	-%	0.52%
ニュージーランド・ドル	株式 2銘柄	0.04%	-%	-%	0.04%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.37%	-%	-%	0.38%
ユーロ	株式 230銘柄	12.44%	-%	-%	12.78%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 37銘柄	1.28%	-%	-%	1.34%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.04%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		18,439,789	3,324,618
コール・ローン		57,970,264	31,643,738
投資信託受益証券		4,401,188,168	3,945,506,632
投資証券		23,619,623,219	23,987,440,316
派生商品評価勘定		-	338,580
未収入金		-	79,722,216
未収配当金		149,712,809	118,116,832
流動資産合計		28,246,934,249	28,166,092,932
資産合計		28,246,934,249	28,166,092,932
負債の部			
流動負債			
未払金		2,477,553	-
未払解約金		13,000,000	41,018,000
流動負債合計		15,477,553	41,018,000
負債合計		15,477,553	41,018,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	41,124,927,128	35,700,508,547
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	12,893,470,432	7,575,433,615
元本等合計		28,231,456,696	28,125,074,932
純資産合計		28,231,456,696	28,125,074,932
負債純資産合計		28,246,934,249	28,166,092,932

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象 ファンドの期首における当該 親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	45,034,411,576円 11,164,917円 3,920,649,365円	41,124,927,128円 2,983,053,798円 8,407,472,379円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド（新興国10）	25,694円	280,570円
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド（新興国20）	51,388円	770,321円
D I A M D C 8 資産バ ランスファンド（新興国30）	77,082円	1,788,834円
投資のソムリエ	5,654,939円	53,459円
為替フルヘッジ型外国リー ト・パッシブ・ファンド（適 格機関投資家限定）	- 円	513,836,995円

	D I A M世界アセットバラン スファンドV A（適格機関投 資家向け）	16,666,781,683円	13,549,802,224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）	23,630,001,562円	20,950,223,722円
	D I A M海外リートインデッ クスファンド（適格機関投資 家限定）	822,334,780円	683,752,422円
計		41,124,927,128円	35,700,508,547円
2 .	受益権の総数	41,124,927,128口	35,700,508,547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12,893,470,432円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,575,433,615円であります。

(金融商品に関する注記)

1 . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	559,748,036	70,422,141
投資証券	1,748,972,717	1,227,725,316
合計	2,308,720,753	1,298,147,457

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成24年6月23日から平成25年1月11日まで及び平成25年6月25日から平成25年7月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成25年1月11日 現在			平成25年7月11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	-	-	-	-	22,250,580	-	21,912,000	338,580
アメリカ・ドル	-	-	-	-	22,250,580	-	21,912,000	338,580
合計	-	-	-	-	22,250,580	-	21,912,000	338,580

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.6865円	0.7878円
（1万口当たり純資産額）	（6,865円）	（7,878円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成25年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	95,968.000	210,169.920	
		ALE PROPERTY GROUP	70,206.000	188,854.140	
		ASPEN GROUP	369,425.000	62,802.250	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	26,734.000	84,479.440	
		AUSTRALAND PROPERTY GROUP	89,697.000	313,042.530	
		BWP TRUST	158,561.000	372,618.350	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	871,737.000	1,699,887.150	
		CHALLENGER DIVERSIFIED PRPT	41,006.000	99,644.580	
		CHARTER HALL GROUP	84,169.000	338,359.380	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	103,312.000	395,684.960	
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	863,283.000	949,611.300	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	487,826.000	480,508.610	
		DEXUS PROPERTY GROUP	1,796,743.000	1,904,547.580	
		FEDERATION CENTRES	526,456.000	1,242,436.160	
		GOODMAN GROUP	562,089.000	2,675,543.640	
		GPT GROUP	605,668.000	2,343,935.160	
		INVESTA OFFICE FUND	232,953.000	682,552.290	
		MIRVAC GROUP	1,357,036.000	2,286,605.660	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	244,846.000	390,529.370	
		STOCKLAND	857,444.000	3,001,054.000	
WESTFIELD GROUP	749,924.000	8,736,614.600			
WESTFIELD RETAIL TRUST	1,136,069.000	3,476,371.140			
	オーストラリア・ドル 小計		11,331,152.000	31,935,852.210 (2,933,946,742)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	147,400.000	234,366.000	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	180,000.000	151,200.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INVT	733,361.000	1,613,394.200	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	238,800.000	310,440.000	

		CACHE LOGISTICS TRUST	252,000.000	303,660.000	
		CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	411,405.000	294,154.570	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	757,806.000	1,110,185.790	
		CAPITAMALL TRUST	954,064.000	1,874,735.760	
		CAPITARETAIL CHINA TRUST	148,000.000	206,460.000	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	257,000.000	430,475.000	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	250,000.000	236,250.000	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	213,000.000	257,730.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	186,000.000	341,310.000	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	175,280.000	230,493.200	
		KEPPEL REIT	354,900.000	461,370.000	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	569,000.000	278,810.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	434,000.000	496,930.000	
		MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	631,000.000	596,295.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	447,120.000	590,198.400	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	539,920.000	585,813.200	
		PARKWAY LIFE REIT	125,000.000	297,500.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	229,000.000	269,075.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	509,000.000	419,925.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	791,291.000	1,246,283.320	
	シンガポール・ドル	小計	9,534,347.000	12,837,054.440 (1,011,559,890)	
投資信託受益証券 合計			20,865,499	3,945,506,632 (3,945,506,632)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	20,914.000	526,614.520	
		AGREE REALTY CORP	4,851.000	144,220.230	
		ALEXANDER'S INC.	801.000	248,798.610	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,178.000	1,791,622.320	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,842.000	419,804.980	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	38,928.000	1,620,572.640	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	57,044.000	828,849.320	

APARTMENT INVT & MGMT CO-A	54,214.000	1,649,732.020	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	26,919.000	314,683.110	
ASSOCIATED ESTATES RLTY CORP	19,206.000	318,051.360	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	45,313.000	6,230,537.500	
BIOMED REALTY TRUST INC	69,185.000	1,425,902.850	
BOSTON PROPERTIES INC	56,536.000	6,041,436.960	
BRANDYWINE REALTY TRUST	57,624.000	809,040.960	
BRE PROPERTIES -CL A	28,621.000	1,443,929.450	
CAMDEN PROPERTY TRUST	31,553.000	2,251,306.550	
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	24,639.000	294,682.440	
CAPLEASE INC	31,767.000	268,748.820	
CBL & ASSOCIATES	60,557.000	1,369,799.340	
CEDAR REALTY TRUST INC	21,069.000	115,458.120	
CHATHAM LODGING TRUST	8,236.000	147,342.040	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	18,213.000	413,617.230	
COLONIAL PROPERTIES TRUST	30,450.000	727,755.000	
COMMONWEALTH REIT	43,756.000	1,016,451.880	
CORESITE REALTY CORP	7,648.000	242,671.040	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	32,373.000	866,625.210	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	42,792.000	1,400,154.240	
COUSINS PROPERTIES INC	39,927.000	416,438.610	
CUBESMART	45,136.000	744,292.640	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	109,968.000	829,158.720	
DDR CORP	91,930.000	1,562,810.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	71,715.000	696,352.650	
DIGITAL REALTY TRUST INC	47,792.000	2,927,260.000	
DOUGLAS EMMETT INC	49,111.000	1,250,366.060	
DUKE REALTY TRUST	119,582.000	1,918,095.280	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	24,426.000	577,674.900	
EAST GROUP	11,420.000	664,301.400	
EDUCATION REALTY TRUST INC	43,345.000	456,422.850	
EPR PROPERTIES	17,301.000	872,143.410	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,476.000	1,184,136.800	
EQUITY ONE INC	23,513.000	540,799.000	

EQUITY RESIDENTIAL	118,974.000	6,889,784.340	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,134.000	2,303,983.340	
EXCEL TRUST INC	17,522.000	234,269.140	
EXTRA SPACE STORAGE INC	38,502.000	1,642,110.300	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,274.000	2,498,522.820	
FELCOR LODGING TR INC	39,741.000	242,817.510	
FIRST INDUSTRIAL RT	37,125.000	599,940.000	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	21,860.000	303,198.200	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,139.000	453,010.130	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	167,774.000	3,437,689.260	
GEO GROUP INC	26,337.000	908,889.870	
GETTY REALTY CORP	10,236.000	209,735.640	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,808.000	90,582.720	
GLIMCHER REALTY TRUST	54,834.000	609,754.080	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	20,632.000	533,130.880	
GYRODYNE CO OF AMERICA INC	584.000	41,212.880	
HCP INC	168,788.000	7,595,460.000	
HEALTH CARE REIT INC	105,591.000	6,935,216.880	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	33,233.000	877,351.200	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	19,291.000	210,271.900	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	67,079.000	378,996.350	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	30,335.000	1,093,880.100	
HOME PROPERTIES INC	19,347.000	1,253,879.070	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	51,883.000	1,409,661.110	
HOST HOTELS & RESORTS INC	277,389.000	4,934,750.310	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	16,414.000	342,724.320	
INLAND REAL ESTATE CORP	32,975.000	349,205.250	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	38,345.000	344,338.100	
KILROY REALTY CORP	27,987.000	1,509,338.910	
KIMCO REALTY	152,165.000	3,341,543.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	30,549.000	182,377.530	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	35,144.000	925,692.960	
LEXINGTON REALTY TRUST	69,475.000	837,868.500	

LIBERTY PROPERTY TRUST	44,684.000	1,693,076.760	
LTC PROPERTIES INC	12,913.000	517,811.300	
MACK CALI	30,664.000	734,096.160	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	56,640.000	830,342.400	
MID AMERICA	15,775.000	1,059,764.500	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	16,023.000	161,992.530	
MPG OFFICE TRUST INC	18,872.000	59,258.080	
NATIONAL HEALTH INVS INC	9,207.000	565,033.590	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	43,970.000	1,565,332.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	43,127.000	1,371,007.330	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,912.000	89,467.440	
PARKWAY PROPERTIES INC	16,021.000	289,980.100	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,300.000	628,867.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	23,596.000	463,661.400	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	61,931.000	1,127,763.510	
POST PROPERTIES, INC	20,106.000	983,585.520	
PROLOGIS INC	184,960.000	7,076,569.600	
PS BUSINESS PARKS	6,843.000	500,223.300	
PUBLIC STORAGE	53,643.000	8,328,612.180	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	22,736.000	354,681.600	
REALTY INCOME CORP	73,043.000	3,154,727.170	
REGENCY CENTERS CORP	34,045.000	1,748,551.200	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	20,665.000	284,763.700	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	11,893.000	173,994.590	
RLJ LODGING TRUST	45,230.000	1,050,692.900	
ROUSE PROPERTIES INC	8,211.000	168,489.720	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18,969.000	708,302.460	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	14,214.000	370,985.400	
SAUL CENTERS INC	4,925.000	229,012.500	
SELECT INCOME REIT	10,394.000	285,003.480	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	69,909.000	1,839,305.790	
SIMON PROPERTY GROUP INC	115,545.000	18,579,636.000	
SL GREEN	34,093.000	3,105,531.370	
SOVRAN SELF STORAGE INC	11,854.000	791,017.420	

	STAG INDUSTRIAL INC	16,093.000	313,652.570	
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	67,151.000	587,571.250	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	24,191.000	238,523.260	
	SUN COMMUNITIES INC	12,125.000	631,591.250	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	59,776.000	752,579.840	
	TANGER FACTORY OUTLET	34,932.000	1,195,722.360	
	TAUBMAN CENTERS INC	23,702.000	1,798,507.760	
	TERRENO REALTY CORP	6,486.000	121,871.940	
	THE MACERICH COMPANY	51,181.000	3,214,166.800	
	UDR INC	93,276.000	2,373,874.200	
	UMH PROPERTIES INC	4,787.000	51,891.080	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,446.000	193,267.620	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	9,498.000	196,798.560	
	VENTAS INC	108,870.000	7,473,925.500	
	VORNADO REALTY TRUST	63,371.000	5,416,319.370	
	WASHINGTON REIT	25,099.000	683,947.750	
	WEINGARTEN REALTY INVST	41,500.000	1,313,890.000	
	WHITESTONE REIT	6,106.000	99,894.160	
	WINTHROP REALTY TRUST	10,289.000	133,962.780	
	WP CAREY INC	21,005.000	1,443,253.550	
	アメリカ・ドル 小計	5,254,134.000	190,216,199.660 (18,947,435,649)	
イギリス・ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	48,447.000	212,682.330	
	BRITISH LAND CO PLC	371,384.000	2,250,587.040	
	DERWENT LONDON PLC	31,596.000	772,522.200	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	127,804.000	729,760.840	
	HAMMERSON PLC	265,000.000	1,412,450.000	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	231,767.000	202,796.120	
	INTU PROPERTIES PLC	247,899.000	808,894.430	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	290,958.000	2,777,194.110	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	227,958.000	255,085.000	
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	12,000.000	43,800.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	34,959.000	112,113.510	
	SEGRO PLC	275,279.000	808,769.700	
	SHAFTESBURY PLC	95,251.000	602,938.830	

	WORKSPACE GROUP PLC	37,853.000	167,650.930	
イギリス・ポンド	小計	2,298,155.000	11,157,245.040 (1,678,049,654)	
イスラエル・シケル	REIT 1 LTD	24,303.000	195,153.090	
イスラエル・シケル	小計	24,303.000	195,153.090 (5,355,001)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	12,924.000	402,841.080	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,963.000	358,726.110	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,509.000	540,206.290	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	5,859.000	154,677.600	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	21,573.000	549,032.850	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	18,407.000	399,984.110	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	12,432.000	528,981.600	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCE	30,756.000	292,489.560	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	23,649.000	481,257.150	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	9,327.000	125,727.960	
	DUNDEE INTL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,569.000	182,347.580	
	DUNDEE REAL ESTATE INV TRUST	19,484.000	619,396.360	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,544.000	310,318.080	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	46,917.000	1,014,814.710	
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	17,528.000	74,844.560	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,826.000	60,733.860	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	10,941.000	178,557.120	
	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	5,803.000	159,582.500	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,936.000	65,770.880	
	RETROCOM REIT	9,828.000	50,614.200	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	54,797.000	1,384,720.190	
カナダ・ドル	小計	377,572.000	7,935,624.350 (759,042,469)	

ニュージーランド・ドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	107,983.000	178,171.950	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	356,767.000	372,821.510	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	355,414.000	398,063.680	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	80,000.000	111,600.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	98,722.000	137,223.580	
ニュージーランド・ドル 小計		998,886.000	1,197,880.720 (94,452,895)	
ユーロ	AEDIFICA	3,311.000	163,563.400	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	23,799.000	200,839.760	
	ALTAREA	1,226.000	146,629.600	
	ANF IMMOBILIER	3,251.000	74,740.490	
	BEFIMMO	6,039.000	300,440.250	
	BENI STABILI SPA	293,656.000	141,542.190	
	COFINIMMO SA	5,668.000	485,917.640	
	CORIO NV	35,719.000	1,115,504.370	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,503.000	391,587.000	
	FONCIERE DES REGIONS	13,734.000	823,353.300	
	GECINA SA	9,921.000	884,258.730	
	HAMBORNER REIT AG	14,676.000	104,199.600	
	ICADE	8,403.000	549,556.200	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	61,847.000	46,385.250	
	KLEPIERRE	36,298.000	1,167,162.190	
	MERCIALYS	20,991.000	320,637.520	
	NIEUWE STEEN INVS	18,742.000	99,238.890	
	SILIC	3,146.000	259,922.520	
	SOCIETE TOUR EIFFEL	2,129.000	99,722.360	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	35,462.000	6,540,965.900	
VASTNED	7,264.000	228,234.880		
WAREHOUSES DE PAUW	4,186.000	208,044.200		
WERELDHAVE NV	7,932.000	413,098.560		
ユーロ 小計		630,903.000	14,765,544.800 (1,925,131,731)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	1,165,000.000	4,030,900.000	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	456,000.000	3,105,360.000	
	LINK REIT/THE	852,523.000	32,694,257.050	
	PROSPERITY REIT	369,000.000	852,390.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	283,000.000	650,900.000	

	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	374,000.000	1,163,140.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	626,000.000	2,516,520.000	
	香港・ドル 小計	4,125,523.000	45,013,467.050 (577,972,917)	
投資証券 合計		13,709,476	23,987,440,316 (23,987,440,316)	
合計			27,932,946,948 (27,932,946,948)	

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 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	投資証券 128銘柄	-%	67.37%	67.83%
イギリス・ポンド	投資証券 14銘柄	-%	5.97%	6.01%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.02%	0.02%
オーストラリア・ドル	投資信託 受益証券 22銘柄	10.43%	-%	10.50%
カナダ・ドル	投資証券 21銘柄	-%	2.70%	2.72%
シンガポール・ドル	投資信託 受益証券 24銘柄	3.60%	-%	3.62%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	0.34%	0.34%
ユーロ	投資証券 23銘柄	-%	6.84%	6.89%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	-%	2.06%	2.07%

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		340,737,696	377,715,907
コール・ローン		1,634,268,887	3,016,499,153
国債証券		141,400,678,896	170,119,201,964
派生商品評価勘定		-	25,758,139
未収利息		1,594,408,481	1,776,283,152
前払費用		36,069,334	142,713,556
流動資産合計		145,006,163,294	175,458,171,871
資産合計		145,006,163,294	175,458,171,871
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,879,804,960	1,082,773,223
未払金		-	1,035,767,598
未払解約金		53,229,000	160,462,000
流動負債合計		4,933,033,960	2,279,002,821
負債合計		4,933,033,960	2,279,002,821
純資産の部			
元本等			
元本	1	116,679,461,522	145,461,934,158
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		23,393,667,812	27,717,234,892
元本等合計		140,073,129,334	173,179,169,050
純資産合計		140,073,129,334	173,179,169,050
負債純資産合計		145,006,163,294	175,458,171,871

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	108,398,144,071円	116,679,461,522円
同期中追加設定元本額	8,851,337,723円	37,534,757,836円
同期中一部解約元本額	570,020,272円	8,752,285,200円
元本の内訳		
ファンド名		
投資のソムリエ	5,633,663円	12,928,166円
D I A Mグローバル分散ファ ンドV A（適格機関投資家限 定）	280,840,608円	303,806,430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）	25,636,117,795円	27,021,200,634円
D I A M世界アセットバラン スファンド4 0 V A（適格機 関投資家限定）	2,402,688,786円	2,257,645,021円
D I A M世界アセットバラン スファンド2 5 V A（適格機 関投資家限定）	9,251,857,468円	9,604,108,727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）	39,576,487,767円	41,200,995,833円
D I A Mバランス3 0 V A （適格機関投資家限定）	746,308,747円	353,904,877円
D I A M世界アセットバラン スファンド4 V A（適格機関 投資家限定）	34,437,658,902円	36,415,603,213円

D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	592,015,461円	565,990,869円
D I A M世界アセットバラン スファンド7VA(121 2)(適格機関投資家限定)	3,737,333,398円	4,132,593,753円
D I A M世界アセットバラン スファンド7VA(130 3)(適格機関投資家限定)	12,518,927円	10,205,726,638円
D I A M世界アセットバラン スファンド7VA(130 6)(適格機関投資家限定)	-円	13,369,811,068円
D I A M世界アセットバラン スファンド7VA(130 9)(適格機関投資家限定)	-円	17,618,929円
計	116,679,461,522円	145,461,934,158円
2. 受益権の総数	116,679,461,522口	145,461,934,158口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2． 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,252,661,136	85,738,154
合計	1,252,661,136	85,738,154

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成24年6月23日から平成25年1月11日まで及び平成25年6月25日から平成25年7月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成25年1月11日 現在			平成25年7月11日 現在		
	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
	うち 1 年 超			うち 1 年 超		
市場取引以外の取引						
為替予約取引						
売 建	139,221,922,498	144,101,727,458	4,879,804,960	171,218,813,420	172,277,016,590	1,058,203,170
アメリカ・ドル	57,984,976,380	59,819,848,947	1,834,872,567	70,344,535,854	70,531,072,096	186,536,242
イギリス・ポンド	11,065,953,435	11,346,909,530	280,956,095	12,677,980,922	12,653,411,397	24,569,525
オーストラリア・ドル	2,120,566,469	2,230,978,848	110,412,379	2,475,165,095	2,501,729,302	26,564,207
カナダ・ドル	3,955,648,376	4,134,525,516	178,877,140	4,299,879,627	4,367,531,576	67,651,949
シンガポール・ドル	611,570,982	630,545,487	18,974,505	648,926,524	652,672,466	3,745,942

スウェーデン・クローナ	890,088,362	-	920,832,816	30,744,454	908,010,497	-	924,304,686	16,294,189
デンマーク・クローネ	1,139,679,019	-	1,184,121,006	44,441,987	1,430,802,264	-	1,444,311,220	13,508,956
ノルウェー・クローネ	338,169,873	-	351,483,991	13,314,118	502,826,015	-	510,319,328	7,493,313
ポーランド・ズロチ	1,076,817,473	-	1,118,744,257	41,926,784	1,253,448,821	-	1,272,004,327	18,555,506
マレーシア・リングギット	609,773,480	-	626,672,000	16,898,520	659,864,840	-	667,588,000	7,723,160
メキシコ・ペソ	1,253,324,954	-	1,332,218,760	78,893,806	1,735,255,617	-	1,770,889,424	35,633,807
ユーロ	57,318,979,935	-	59,538,926,300	2,219,946,365	73,364,741,128	-	74,059,966,768	695,225,640
南アフリカ・ランド	856,373,760	-	865,920,000	9,546,240	917,376,216	-	921,216,000	3,839,784
買 建	-	-	-	-	729,747,126	-	730,935,212	1,188,086
アメリカ・ドル	-	-	-	-	564,883,070	-	565,678,200	795,130
ユーロ	-	-	-	-	164,864,056	-	165,257,012	392,956
合計	139,221,922,498	-	144,101,727,458	4,879,804,960	171,948,560,546	-	173,007,951,802	1,057,015,084

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2005円	1.1905円
(1万口当たり純資産額)	(12,005円)	(11,905円)

[前へ](#) [次へ](#)

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25年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.25 05/15/15	18,500,000.000	18,476,135.000	
		US T N/B 0.25 09/15/14	10,000,000.000	10,005,800.000	
		US T N/B 0.25 12/15/15	4,000,000.000	3,974,040.000	
		US T N/B 0.375 01/15/16	15,500,000.000	15,435,210.000	
		US T N/B 0.375 03/15/15	18,000,000.000	18,018,900.000	
		US T N/B 0.375 06/15/15	13,000,000.000	13,004,550.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	6,000,000.000	5,885,100.000	
		US T N/B 0.625 08/31/17	9,300,000.000	9,072,522.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	7,000,000.000	6,790,770.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	12,300,000.000	12,015,993.000	
		US T N/B 1.0 06/30/19	5,000,000.000	4,764,050.000	
		US T N/B 1.0 08/31/16	8,800,000.000	8,857,376.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	6,000,000.000	5,692,500.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	5,500,000.000	5,188,865.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	5,000,000.000	4,741,750.000	
		US T N/B 1.25 01/31/19	6,400,000.000	6,246,976.000	
		US T N/B 1.25 08/31/15	8,000,000.000	8,140,880.000	
		US T N/B 1.25 09/30/15	9,000,000.000	9,160,650.000	
		US T N/B 1.25 10/31/15	11,000,000.000	11,198,000.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	2,500,000.000	2,471,675.000	
		US T N/B 1.375 11/30/15	10,500,000.000	10,714,095.000	
		US T N/B 1.375 11/30/18	2,000,000.000	1,972,640.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	6,300,000.000	6,210,414.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	4,000,000.000	3,985,280.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	5,000,000.000	4,616,000.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	5,700,000.000	5,231,745.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	6,000,000.000	5,629,920.000	
		US T N/B 1.75 05/31/16	6,000,000.000	6,181,620.000	
		US T N/B 1.875 09/30/17	6,000,000.000	6,153,720.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	5,000,000.000	4,815,600.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	10,000,000.000	9,458,200.000	
		US T N/B 2.0 04/30/16	9,500,000.000	9,853,210.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	5,000,000.000	4,839,050.000			
US T N/B 2.125 08/15/21	4,500,000.000	4,414,905.000			
US T N/B 2.125 11/30/14	12,000,000.000	12,316,320.000			

US T N/B 2.25 01/31/15	8,000,000.000	8,242,800.000	
US T N/B 2.25 07/31/18	4,000,000.000	4,138,280.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	7,000,000.000	7,275,030.000	
US T N/B 2.375 03/31/16	6,000,000.000	6,285,180.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	4,000,000.000	4,164,840.000	
US T N/B 2.375 07/31/17	10,500,000.000	10,991,295.000	
US T N/B 2.375 09/30/14	10,000,000.000	10,265,600.000	
US T N/B 2.5 03/31/15	7,000,000.000	7,261,660.000	
US T N/B 2.5 04/30/15	7,000,000.000	7,271,460.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	6,500,000.000	6,839,170.000	
US T N/B 2.625 04/30/18	3,000,000.000	3,162,180.000	
US T N/B 2.625 06/30/14	13,000,000.000	13,309,660.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	5,500,000.000	5,684,745.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	7,000,000.000	7,214,340.000	
US T N/B 2.625 12/31/14	11,000,000.000	11,381,920.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	7,500,000.000	7,918,875.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	4,500,000.000	3,747,645.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,500,000.000	3,742,380.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	7,000,000.000	7,497,630.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,500,000.000	3,081,890.000	
US T N/B 3.0 09/30/16	6,000,000.000	6,413,880.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	3,700,000.000	3,347,168.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	7,700,000.000	6,937,161.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	8,000,000.000	8,606,240.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,841,685.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	4,500,000.000	4,766,445.000	
US T N/B 3.125 10/31/16	7,000,000.000	7,515,130.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	4,000,000.000	3,624,040.000	
US T N/B 3.25 03/31/17	7,000,000.000	7,561,050.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	7,000,000.000	7,520,870.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	7,000,000.000	7,555,030.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,500,000.000	4,903,200.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	9,800,000.000	10,724,826.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,100,000.000	2,066,190.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	5,000,000.000	5,471,850.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	11,600,000.000	12,801,644.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	4,500,000.000	4,936,275.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	3,000,000.000	3,311,700.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,700,000.000	2,757,780.000	
US T N/B 3.75 11/15/18	6,000,000.000	6,657,180.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	3,000,000.000	3,340,530.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	3,000,000.000	3,139,200.000	

US T N/B 4.0 02/15/15	9,000,000.000	9,529,740.000	
US T N/B 4.125 05/15/15	3,000,000.000	3,207,750.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,500,000.000	1,671,900.000	
US T N/B 4.25 08/15/14	10,000,000.000	10,445,300.000	
US T N/B 4.25 08/15/15	12,000,000.000	12,960,360.000	
US T N/B 4.25 11/15/14	13,700,000.000	14,440,622.000	
US T N/B 4.25 11/15/17	3,000,000.000	3,374,760.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,000,000.000	3,338,070.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,200,000.000	1,362,372.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	3,000,000.000	3,408,150.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,200,000.000	2,497,858.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	3,000,000.000	3,408,750.000	
US T N/B 4.5 02/15/16	11,000,000.000	12,108,580.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,313,580.000	
US T N/B 4.5 05/15/17	4,000,000.000	4,514,680.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,500,000.000	1,735,185.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,500,000.000	1,738,005.000	
US T N/B 4.625 02/15/17	6,000,000.000	6,771,060.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,500,000.000	2,952,125.000	
US T N/B 4.625 11/15/16	7,000,000.000	7,869,470.000	
US T N/B 4.75 02/15/37	500,000.000	598,550.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,000,000.000	2,406,700.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	3,700,000.000	4,225,770.000	
US T N/B 4.875 08/15/16	8,000,000.000	9,003,120.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	700,000.000	867,069.000	
US T N/B 5.125 05/15/16	5,000,000.000	5,628,500.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	1,200,000.000	1,490,244.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,200,000.000	1,490,052.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,906,275.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	500,000.000	636,130.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,000,000.000	2,635,000.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,000,000.000	2,685,300.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,000,000.000	1,383,350.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,000,000.000	2,640,620.000	
US T N/B 7.125 02/15/23	1,400,000.000	1,947,960.000	
US T N/B 7.25 08/15/22	800,000.000	1,113,680.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,000,000.000	2,863,120.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	1,000,000.000	1,366,670.000	
アメリカ・ドル 小計	673,000,000.000 (67,037,530,000)	698,346,542.000 (69,562,299,049)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 1.0 09/07/17	3,700,000.000	3,690,750.000

UK TREASURY 1.25 07/22/18	2,300,000.000	2,288,730.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/17	2,300,000.000	2,373,140.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,400,000.000	3,217,760.000	
UK TREASURY 2.0 01/22/16	3,500,000.000	3,627,400.000	
UK TREASURY 2.75 01/22/15	3,000,000.000	3,109,200.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,500,000.000	1,408,050.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,700,000.000	1,762,220.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,000,000.000	2,249,600.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,300,000.000	2,586,120.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,000,000.000	2,239,540.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,300,000.000	1,436,500.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,000,000.000	2,274,400.000	
UK TREASURY 4.0 09/07/16	2,900,000.000	3,202,180.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,100,000.000	2,392,320.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,300,000.000	2,628,210.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,500,000.000	1,704,000.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,500,000.000	1,726,350.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,100,000.000	2,380,980.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,000,000.000	2,271,400.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,600,000.000	1,825,600.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,900,000.000	2,192,220.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,000,000.000	2,326,000.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,900,000.000	2,236,680.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,200,000.000	2,602,600.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	2,200,000.000	2,613,820.000	

	UK TREASURY 4.75 09/07/15	2,500,000.000	2,734,500.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,100,000.000	2,548,560.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,000,000.000	2,453,000.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/18	2,250,000.000	2,640,375.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,000,000.000	2,467,800.000	
	UK TREASURY 5.0 09/07/14	2,500,000.000	2,634,750.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,500,000.000	2,058,900.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,500,000.000	2,149,350.000	
	UK TREASURY 8.0 12/07/15	500,000.000	591,250.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	600,000.000	787,440.000	
	イギリス・ボンド 小計	74,650,000.000 (11,227,360,000)	83,431,695.000 (12,548,126,928)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,000,000.000	2,123,640.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,000,000.000	2,205,000.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	1,900,000.000	2,171,871.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,100,000.000	985,831.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	600,000.000	556,740.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	600,000.000	525,882.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,000,000.000	1,048,730.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,000,000.000	1,058,520.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	2,000,000.000	2,114,320.000	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/15	1,450,000.000	1,517,758.500	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	2,000,000.000	2,204,500.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,800,000.000	2,042,136.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,000,000.000	2,299,440.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	2,500,000.000	2,767,500.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	3,000,000.000	3,192,630.000	

オーストラリア・ドル 小計		24,950,000.000 (2,292,156,500)	26,814,498.500 (2,463,447,977)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	500,000.000	804,605.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	1,500,000.000	1,463,700.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	1,500,000.000	1,498,425.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,644,750.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	800,000.000	793,560.000	
	CANADA 2.0 12/01/14	4,000,000.000	4,048,240.000	
	CANADA 2.25 08/01/14	2,000,000.000	2,024,080.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,500,000.000	1,540,530.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	1,500,000.000	1,562,100.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	4,300,000.000	4,477,203.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,300,000.000	1,388,348.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	1,500,000.000	1,627,995.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,550,000.000	1,730,451.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	2,700,000.000	2,961,279.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	2,300,000.000	2,473,443.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	1,500,000.000	1,635,270.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,160,180.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	1,200,000.000	1,336,356.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	3,500,000.000	3,719,415.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,700,000.000	2,296,343.000	
CANADA 5.75 06/01/29	1,500,000.000	2,068,305.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,500,000.000	2,142,750.000		
カナダ・ドル 小計		41,450,000.000 (3,964,692,500)	45,397,328.000 (4,342,254,423)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.875 07/01/15	1,000,000.000	1,053,130.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	500,000.000	489,940.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,000,000.000	1,072,900.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,000,000.000	1,079,190.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	960,831.000	
	SINGAPORE 3.625 07/01/14	600,000.000	620,286.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	1,000,000.000	1,110,870.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,400,000.000	1,591,562.000	
シンガポール・ドル 小計		7,400,000.000 (583,120,000)	7,978,709.000 (628,722,269)	
スウェーデン・ク ローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	7,000,000.000	6,559,140.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	6,200,000.000	6,531,514.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	5,000,000.000	5,519,700.000	

	SWEDEN 3.5 06/01/22	8,000,000.000	8,932,880.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	6,000,000.000	6,575,940.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,000,000.000	9,129,680.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	8,000,000.000	8,565,760.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	7,000,000.000	8,505,350.000	
スウェーデン・クローネ 小計		55,200,000.000 (827,448,000)	60,319,964.000 (904,196,260)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	4,700,000.000	4,564,640.000	
	DENMARK 2.0 11/15/14	6,000,000.000	6,156,120.000	
	DENMARK 2.5 11/15/16	3,300,000.000	3,538,128.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	11,100,000.000	12,425,340.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	11,000,000.000	11,986,700.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	6,000,000.000	6,883,140.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	10,000,000.000	11,828,000.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	13,550,000.000	19,137,613.500	
	DENMARK 7.0 11/10/24	3,000,000.000	4,632,300.000	
デンマーク・クローネ 小計		68,650,000.000 (1,200,002,000)	81,151,981.500 (1,418,536,637)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 2.0 05/24/23	3,100,000.000	2,939,420.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	5,500,000.000	6,022,500.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	6,200,000.000	6,792,100.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	5,500,000.000	6,231,500.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	7,700,000.000	8,200,115.000	
ノルウェー・クローネ 小計		28,000,000.000 (462,280,000)	30,185,635.000 (498,364,834)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.75 04/25/18	3,700,000.000	3,762,900.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	1,700,000.000	1,710,115.000	
	POLAND 4.75 04/25/17	800,000.000	842,600.000	
	POLAND 4.75 10/25/16	3,000,000.000	3,148,170.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	1,000,000.000	1,050,000.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	4,900,000.000	5,278,868.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	3,500,000.000	3,848,600.000	
	POLAND 5.5 04/25/15	4,000,000.000	4,176,000.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	3,000,000.000	3,329,550.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,200,000.000	1,414,476.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,646,304.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,500,000.000	2,840,825.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	6,000,000.000	6,428,400.000	
ポーランド・ズロチ 小計		38,500,000.000 (1,164,240,000)	41,476,808.000 (1,254,258,674)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.741 02/27/15	4,000,000.000	4,036,720.000	

	MALAYSIA 3.814 02/15/17	3,000,000.000	3,036,270.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	500,000.000	504,050.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,114,600.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	3,000,000.000	3,078,450.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	4,000,000.000	4,161,880.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,500,000.000	1,584,120.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,200,000.000	1,389,696.000	
マレーシア・リングgit 小計		21,200,000.000 (667,588,000)	21,905,786.000 (689,813,201)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	24,500,000.000	32,847,150.000	
	MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16	12,500,000.000	13,084,625.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	20,000,000.000	20,901,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,121,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	7,000,000.000	7,622,860.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	30,000,000.000	32,980,800.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	25,000,000.000	28,340,500.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	18,000,000.000	21,590,460.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,000,000.000	20,040,620.000	
	MEXICAN BONDS 9.5 12/18/14	35,000,000.000	37,595,950.000	
メキシコ・ペソ 小計		199,000,000.000 (1,548,220,000)	226,126,365.000 (1,759,263,120)	
ユーロ	AUSTRIA 1.75 10/20/23	400,000.000	388,400.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	700,000.000	730,940.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	500,000.000	533,190.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,200,000.000	1,312,080.000	
	AUSTRIA 3.4 10/20/14	1,400,000.000	1,458,660.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,250,000.000	1,408,650.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	1,500,000.000	1,600,200.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,700,000.000	1,933,240.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	900,000.000	1,032,120.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	300,000.000	371,952.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,800,000.000	2,091,960.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	1,500,000.000	1,668,000.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,400,000.000	1,736,700.000	
	AUSTRIA 4.3 07/15/14	650,000.000	678,119.000	

AUSTRIA 4.3 09/15/17	800,000.000	917,200.000	
AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,500,000.000	1,766,550.000	
AUSTRIA 4.65 01/15/18	1,600,000.000	1,869,760.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	900,000.000	1,146,600.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	900,000.000	1,302,210.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	800,000.000	779,760.000	
BELGIUM 2.75 03/28/16	1,100,000.000	1,168,354.000	
BELGIUM 3.0 09/28/19	800,000.000	865,864.000	
BELGIUM 3.25 09/28/16	1,300,000.000	1,406,340.000	
BELGIUM 3.5 03/28/15	600,000.000	633,774.000	
BELGIUM 3.5 06/28/17	1,500,000.000	1,649,805.000	
BELGIUM 3.75 09/28/15	1,600,000.000	1,722,048.000	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,000,000.000	2,255,680.000	
BELGIUM 4.0 03/28/17	1,600,000.000	1,786,000.000	
BELGIUM 4.0 03/28/18	2,600,000.000	2,941,042.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	1,500,000.000	1,710,465.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,700,000.000	1,936,640.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	900,000.000	990,990.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,300,000.000	1,495,520.000	
BELGIUM 4.25 09/28/14	1,000,000.000	1,049,520.000	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		BELGIUM 4.25 09/28/21	1,800,000.000	2,090,664.000	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	1,800,000.000	2,080,332.000	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,407,300.000	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	2,400,000.000	3,024,504.000	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,800,000.000	2,328,228.000	
		BELGIUM 5.5 09/28/17	1,000,000.000	1,185,400.000	
		BELGIUM 8.0 03/28/15	1,400,000.000	1,585,570.000	
		BUNDESOBL 0.5 02/23/18	2,000,000.000	1,995,300.000	
		BUNDESOBL 0.5 10/13/17	800,000.000	801,656.000	
		BUNDESOBL 1.75 10/09/15	500,000.000	518,565.000	
		BUNDESOBL 2.0 02/26/16	2,000,000.000	2,096,200.000	
		BUNDESOBL 2.5 02/27/15	4,000,000.000	4,159,080.000	
		BUNDESOBL 2.75 04/08/16	2,500,000.000	2,675,375.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,450,000.000	3,417,501.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	2,200,000.000	2,195,402.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,100,000.000	3,171,610.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,500,000.000	2,629,000.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	2,300,000.000	2,489,060.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,000,000.000	2,151,600.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,000,000.000	2,197,800.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,500,000.000	1,514,400.000	
		DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	2,500,000.000	2,835,625.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,500,000.000	2,867,450.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	5,200,000.000	5,525,260.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,000,000.000	2,307,800.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,800,000.000	2,107,080.000	
		DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	4,000,000.000	4,332,000.000	
		DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	3,000,000.000	3,470,190.000	

DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	7,300,000.000	7,700,916.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	6,800,000.000	7,615,320.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	2,500,000.000	2,906,950.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,000,000.000	3,465,450.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,800,000.000	3,584,840.000	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	4,000,000.000	4,449,720.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/14	3,000,000.000	3,123,330.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	4,000,000.000	4,608,120.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	3,100,000.000	3,652,110.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	2,292,960.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,500,000.000	1,998,900.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,400,000.000	3,331,680.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,800,000.000	2,621,160.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,200,000.000	3,208,480.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,800,000.000	2,588,940.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,300,000.000	1,871,740.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,000,000.000	1,550,600.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,200,000.000	1,853,040.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	800,000.000	789,280.000	
FINLAND 1.75 04/15/16	900,000.000	937,125.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	200,000.000	200,570.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	730,625.000	
FINLAND 3.125 09/15/14	800,000.000	829,000.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	900,000.000	1,021,365.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	800,000.000	916,720.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	900,000.000	1,019,700.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,100,000.000	1,312,245.000	
FINLAND 4.25 07/04/15	700,000.000	756,987.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	600,000.000	713,370.000	

FR TREASURY 2.5 01/15/15	2,000,000.000	2,070,740.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,000,000.000	1,554,190.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/15	7,000,000.000	7,411,600.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	2,400,000.000	2,399,160.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,100,000.000	4,140,877.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,300,000.000	4,561,655.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	1,400,000.000	1,394,302.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	3,900,000.000	4,206,345.000	
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	8,400,000.000	8,930,796.000	
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	7,500,000.000	8,093,775.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	3,700,000.000	4,088,278.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	4,500,000.000	5,084,775.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,700,000.000	4,042,250.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	6,500,000.000	7,238,075.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,300,000.000	4,924,790.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	3,800,000.000	4,352,748.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	2,500,000.000	2,856,550.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,200,000.000	2,497,880.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,100,000.000	1,251,976.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/14	5,000,000.000	5,247,000.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,800,000.000	3,190,964.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	4,200,000.000	4,910,934.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	6,100,000.000	6,977,668.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	3,300,000.000	3,838,890.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	4,200,000.000	4,946,088.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,800,000.000	3,450,020.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,500,000.000	3,142,925.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	5,500,000.000	6,295,190.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,000,000.000	4,001,580.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,900,000.000	4,058,753.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,000,000.000	2,726,080.000	

FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,000,000.000	1,432,900.000	
IRISH 3.9 03/20/23	600,000.000	598,806.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,100,000.000	1,160,060.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,100,000.000	1,158,905.000	
IRISH 4.5 10/18/18	900,000.000	964,980.000	
IRISH 4.6 04/18/16	1,400,000.000	1,504,342.000	
IRISH 5.0 10/18/20	1,300,000.000	1,407,510.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,300,000.000	1,425,047.000	
IRISH 5.5 10/18/17	1,000,000.000	1,112,960.000	
IRISH 5.9 10/18/19	1,000,000.000	1,133,400.000	
ITALY BTPS 3.0 04/15/15	6,800,000.000	6,951,300.000	
ITALY BTPS 3.5 11/01/17	2,000,000.000	2,035,400.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,800,000.000	2,795,520.000	
ITALY BTPS 3.75 04/15/16	4,000,000.000	4,163,200.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/15	6,700,000.000	6,935,840.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	5,000,000.000	5,193,500.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,000,000.000	3,000,300.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	6,500,000.000	6,773,000.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,000,000.000	2,676,000.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,000,000.000	3,049,200.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/15	7,000,000.000	7,297,500.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,000,000.000	3,121,500.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,900,000.000	2,987,000.000	
ITALY BTPS 4.25 08/01/14	3,700,000.000	3,815,884.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	3,000,000.000	3,109,200.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	4,000,000.000	4,232,800.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,700,000.000	2,819,340.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	2,700,000.000	2,830,680.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,500,000.000	2,499,750.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,100,000.000	2,117,703.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	3,400,000.000	3,593,460.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	3,800,000.000	3,931,480.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,400,000.000	3,571,700.000	

ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,700,000.000	1,697,654.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	700,000.000	663,726.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,000,000.000	2,115,000.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,500,000.000	2,605,000.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,500,000.000	2,525,250.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,200,000.000	2,195,600.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,800,000.000	2,772,560.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	2,700,000.000	2,931,660.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,400,000.000	3,551,300.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,100,000.000	2,276,295.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,700,000.000	2,918,889.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.000	1,867,960.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,500,000.000	3,947,300.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,900,000.000	3,390,100.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,100,000.000	1,368,290.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,400,000.000	1,914,080.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	2,000,000.000	2,036,880.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,300,000.000	1,266,837.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,500,000.000	1,551,390.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	2,000,000.000	2,133,820.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,250,000.000	1,230,125.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/15	2,500,000.000	2,600,000.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/15	2,600,000.000	2,760,680.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,800,000.000	2,019,240.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,800,000.000	2,052,720.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,900,000.000	2,207,610.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,600,000.000	1,954,992.000	
NETHERLANDS 3.75 07/15/14	2,000,000.000	2,073,600.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,500,000.000	1,863,750.000	

	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	2,100,000.000	2,325,330.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	2,500,000.000	2,871,750.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,500,000.000	1,747,500.000	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	1,700,000.000	1,955,000.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,209,120.000	
	SPAIN 3.0 04/30/15	3,900,000.000	3,956,160.000	
	SPAIN 3.15 01/31/16	2,500,000.000	2,538,000.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	2,800,000.000	2,842,840.000	
	SPAIN 3.75 10/31/15	1,100,000.000	1,130,261.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	3,000,000.000	3,064,800.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,700,000.000	2,669,625.000	
	SPAIN 4.0 07/30/15	2,500,000.000	2,591,675.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	2,000,000.000	2,048,500.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,700,000.000	1,426,725.000	
	SPAIN 4.25 10/31/16	2,500,000.000	2,606,450.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	2,000,000.000	2,032,400.000	
	SPAIN 4.4 01/31/15	4,500,000.000	4,680,090.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	2,300,000.000	2,394,530.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	2,000,000.000	2,074,800.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,800,000.000	1,734,570.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,300,000.000	1,168,570.000	
	SPAIN 4.75 07/30/14	2,500,000.000	2,584,675.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,300,000.000	3,278,220.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,300,000.000	2,379,580.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,600,000.000	1,483,200.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,700,000.000	1,777,435.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	2,300,000.000	2,467,325.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	2,000,000.000	2,163,800.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,800,000.000	1,886,940.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,500,000.000	2,716,675.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,100,000.000	1,174,250.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,100,000.000	2,261,700.000	
	ユーロ 小計	511,400,000.000 (66,676,332,000)	561,171,353.000 (73,165,521,004)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	30,027,500.000	
	SOUTH AFRICA 13.5 09/15/15	10,000,000.000	11,486,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	10,000,000.000	7,576,900.000	

	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	18,000,000.000	17,241,840.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	18,000,000.000	18,730,620.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	3,000,000.000	2,936,400.000	
	南アフリカ・ランド 小計	84,000,000.000 (844,200,000)	87,999,760.000 (884,397,588)	
国債証券 合計		158,495,169,000 (158,495,169,000)	170,119,201,964 (170,119,201,964)	
合計		158,495,169,000 (158,495,169,000)	170,119,201,964 (170,119,201,964)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 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	国債証券 115銘柄	40.17%	40.89%
イギリス・ポンド	国債証券 36銘柄	7.25%	7.38%
オーストラリア・ドル	国債証券 15銘柄	1.42%	1.45%
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	2.51%	2.55%
シンガポール・ドル	国債証券 8銘柄	0.36%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.52%	0.53%
デンマーク・クローネ	国債証券 9銘柄	0.82%	0.83%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.29%	0.29%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.72%	0.74%
マレーシア・リングギット	国債証券 8銘柄	0.40%	0.41%
メキシコ・ペソ	国債証券 10銘柄	1.02%	1.03%
ユーロ	国債証券 216銘柄	42.25%	43.01%
南アフリカ・ランド	国債証券 6銘柄	0.51%	0.52%

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,365,343,588	992,664,393
コール・ローン		44,222,614	46,958,165
株式		36,734,491,312	36,199,479,112
投資信託受益証券		302,202,050	338,155,005
投資証券		11,259,718	57,640,197
派生商品評価勘定		42,251,470	1,383,096
未収入金		2,507,041	316,708
未収配当金		39,768,123	210,596,664
差入委託証拠金		337,545,580	330,446,115
流動資産合計		38,879,591,496	38,177,639,455
資産合計		38,879,591,496	38,177,639,455
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		493,833	53,988,210
未払金		18,137	-
未払解約金		14,800,000	28,032,000
流動負債合計		15,311,970	82,020,210
負債合計		15,311,970	82,020,210
純資産の部			
元本等			
元本	1	46,090,797,565	46,837,683,733
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	7,226,518,039	8,742,064,488
元本等合計		38,864,279,526	38,095,619,245
純資産合計		38,864,279,526	38,095,619,245
負債純資産合計		38,879,591,496	38,177,639,455

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
<p>1. 1 本報告書における開示対象 ファンドの期首における当該 親投資信託の元本額</p>	49,877,517,289円	46,090,797,565円
<p>同期中追加設定元本額</p>	36,697,937円	5,659,718,503円
<p>同期中一部解約元本額</p>	3,823,417,661円	4,912,832,335円
<p>元本の内訳</p>		

ファンド名		
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	177,467,718円	205,402,668円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	205,971,270円	251,571,533円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	34,126円	447,018円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	70,837円	1,229,400円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国30）	108,947円	2,885,753円
投資のソムリエ	3,188,354円	742,983円
クルーズコントロール	6,108,126円	631,162円
エマージング株式パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）	8,883,398,642円	8,849,633,854円
新興国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家限定）	3,193,053,982円	3,098,812,860円
エマージング株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,238,317,504円	2,208,777,825円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	19,406,269,848円	20,017,056,544円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	11,976,808,211円	12,200,492,133円
計	46,090,797,565円	46,837,683,733円
2 . 受益権の総数	46,090,797,565口	46,837,683,733口
3 . 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,226,518,039円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,742,064,488円であります。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	<p>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。</p>	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	2,523,885,670	1,607,778,540
投資信託受益証券	74,330,994	28,837,558
投資証券	2,423,449	2,592,131
合計	2,600,640,113	1,639,208,229

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成24年4月19日から平成25年1月11日まで及び平成25年4月19日から平成25年7月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成25年1月11日 現在				平成25年7月11日 現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年超				うち1年超			
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	12,517,026	-	12,515,022	2,004

アメリカ・ドル	-	-	-	-	10,006,026	-	10,005,022	1,004
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	2,511,000	-	2,510,000	1,000
買 建	-	-	-	-	10,006,026	-	9,990,000	16,026
台湾・ドル	-	-	-	-	10,006,026	-	9,990,000	16,026
合計	-	-	-	-	22,523,052	-	22,505,022	14,022

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成25年1月11日 現在			平成25年7月11日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,752,411,953	-	1,794,169,590	41,757,637	1,531,982,874	-	1,479,391,782	52,591,092
合計	1,752,411,953	-	1,794,169,590	41,757,637	1,531,982,874	-	1,479,391,782	52,591,092

(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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.8432円	0.8134円
(1万口当たり純資産額)	(8,432円)	(8,134円)

[前へ](#) [次へ](#)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成25年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BANCOLOMBIA SA SPONS ADR	33,513	53.210	1,783,226.730	
	LATAM AIRLINES GROUP SP ADR	44,681	15.140	676,470.340	
	BANCO SANTANDER CHILE ADR	29,592	22.670	670,850.640	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	22,773	13.550	308,574.150	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS ADR	13,420	28.240	378,980.800	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PEF	73,600	6.390	470,304.000	
	CREDICORP LTD	6,949	113.500	788,711.500	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA ADR	12,600	32.600	410,760.000	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHILE SP ADR	18,116	41.250	747,285.000	
	ENERSIS SA SPONS ADR	59,508	15.240	906,901.920	
	CORPBANCA SA ADR	28,165	16.200	456,273.000	
	INFOSYS LTD ADR	22,922	42.580	976,018.760	
	ICICI BANK LTD ADR	5,235	36.970	193,537.950	
	MOBILE TELESYSTEMS OJSC ADR	55,725	19.000	1,058,775.000	
	WIPRO LTD ADR	23,281	7.540	175,538.740	
	DR REDDYS LABORATORIES LTD ADR	2,834	37.490	106,246.660	
	QUIMICA Y MINERA DE CHIL-SP ADR	17,246	38.840	669,834.640	
	HDFC BANK LTD ADR	16,230	35.780	580,709.400	
	SOUTHERN COPPER CORP	18,880	26.960	509,004.800	
	BANCO DE CHILE-ADR	6,178	82.560	510,055.680	
	VINA CONCHA Y TORO SA SP ADR	9,200	37.000	340,400.000	
	LUKOIL SPON ADR	55,818	57.500	3,209,535.000	
	GAIL INDIA LTD GDR	5,146	31.810	163,694.260	
ORASCOM TELECOM HOLDING SAE GDR(EG/USD)	56,215	2.828	158,976.020		
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD GDR	1,342	17.590	23,605.780		
STATE BANK OF INDIA LTD GDR	348	63.100	21,958.800		
OAO GAZPROM ADR	639,493	6.860	4,386,921.980		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	63,230	4.950	312,988.500		

	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	63,600	4.791	304,707.600	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	82,342	7.730	636,503.660	
	SISTEMA JSFC GDR	15,472	20.900	323,364.800	
	AXIS BANK LTD GDR	7,904	21.380	168,987.520	
	NOVATEK OAO GDR	10,020	119.300	1,195,386.000	
	TELECOM EGYPT -GDR REG S	13,015	9.790	127,416.850	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	57,374	13.800	791,761.200	
	ROSTELECOM SPON ADR	20,623	18.500	381,525.500	
	LARSEN & TOUBRO LTD GDR	11,382	23.740	270,208.680	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD GDR	12,251	15.250	186,827.750	
	RANBAXY LABORATORIES LTD GDR	4,433	5.720	25,356.760	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD GDR	23,468	28.590	670,950.120	
	ROSNEFT OIL CO GDR	128,660	7.070	909,626.200	
	URALKALI -SPON GDR	29,649	32.850	973,969.650	
	TMK OAO GDR	7,851	11.250	88,323.750	
	SEVERSTAL GDR	29,652	6.900	204,598.800	
	TATNEFT GDR	26,352	34.800	917,049.600	
	VTB BANK OJSC GDR	191,844	2.765	530,448.660	
	LSR GROUP OJSC GDR	23,720	4.046	95,971.120	
	MAGNIT OJSC GDR	28,589	53.500	1,529,511.500	
	ECOPETROL SA SP ADR	55,848	40.400	2,256,259.200	
	FEDERAL HYDROGENERATING ADR	135,146	1.569	212,044.070	
	SBERBANK ADR	296,585	11.070	3,283,195.950	
	CENCOSUD SA ADR	60,720	13.760	835,507.200	
	MEGAFON OAO GDR	9,723	32.050	311,622.150	
	アメリカ・ドル 小計	2,688,463		38,227,264.340 (3,807,817,801)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	91,051	856.000	77,939,656.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,876	335.050	5,654,303.800	
	ASIAN PAINTS LTD	2,779	4,782.800	13,291,401.200	
	BANK OF BARODA	3,101	552.450	1,713,147.450	
	BANK OF INDIA	7,114	226.700	1,612,743.800	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	1,417	375.350	531,870.950	
	HDFC BANK LTD	116,501	659.300	76,809,109.300	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	20,857	912.550	19,033,055.350	
	ICICI BANK LTD	35,149	1,038.550	36,503,993.950	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	4,900	1,020.650	5,001,185.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	13,645	1,876.300	25,602,113.500	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	29,705	228.650	6,792,048.250	
	RELIANCE CAPITAL LTD	6,164	376.950	2,323,519.800	

TATA STEEL LTD	34,054	256.200	8,724,634.800	
TATA MOTORS LTD	76,718	284.050	21,791,747.900	
JSW STEEL LTD	9,507	594.100	5,648,108.700	
TATA POWER CO LTD	116,490	86.400	10,064,736.000	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	65,796	184.200	12,119,623.200	
GAIL INDIA LTD	15,664	314.650	4,928,677.600	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	32,029	726.350	23,264,264.150	
SESA GOA LTD	47,629	141.500	6,739,503.500	
AXIS BANK LTD	23,282	1,256.750	29,259,653.500	
TITAN INDUSTRIES LTD	24,340	250.150	6,088,651.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	80,421	296.150	23,816,679.150	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	1,065	5,003.250	5,328,461.250	
LUPIN LTD	9,024	860.850	7,768,310.400	
ACC LTD	6,455	1,249.900	8,068,104.500	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	156,373	827.500	129,398,657.500	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	28,113	242.250	6,810,374.250	
INFOSYS LTD	26,400	2,501.150	66,030,360.000	
WIPRO LTD	25,204	364.850	9,195,679.400	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	88,645	594.950	52,739,342.750	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,687	971.200	8,436,814.400	
HCL TECHNOLOGIES LTD	21,929	839.600	18,411,588.400	
DABUR INDIA LTD	51,262	154.400	7,914,852.800	
HERO MOTOCORP LTD	4,828	1,652.350	7,977,545.800	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	8,411	2,261.500	19,021,476.500	
BHARTI AIRTEL LTD	59,891	290.100	17,374,379.100	
UNITED SPIRITS LTD	8,867	2,637.150	23,383,609.050	
CANARA BANK	8,703	346.450	3,015,154.350	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	35,584	1,081.450	38,482,316.800	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,118	1,007.100	2,133,037.800	
JINDAL STEEL & POWER LTD	43,566	218.800	9,532,240.800	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,445	692.650	9,312,679.250	
WOCKHARDT LTD	1,878	961.700	1,806,072.600	
CIPLA LTD/INDIA	36,885	400.100	14,757,688.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	11,257	1,413.700	15,914,020.900	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	87,706	53.250	4,670,344.500	
ULTRATECH CEMENT LTD	5,608	1,953.200	10,953,545.600	

TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	50,609	1,511.950	76,518,277.550	
ADANI ENTERPRISES LTD	18,071	200.100	3,616,007.100	
NTPC LTD	109,910	141.100	15,508,301.000	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,697	569.900	2,106,920.300	
AMBUJA CEMENTS LTD	81,663	193.950	15,838,538.850	
IDFC LTD	117,034	128.150	14,997,907.100	
RANBAXY LABORATORIES LTD	8,562	345.700	2,959,883.400	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	112,300	98.200	11,027,860.000	
ITC LTD	234,311	345.550	80,966,166.050	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	55,596	140.300	7,800,118.800	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LTD	180,533	83.750	15,119,638.750	
SIEMENS INDIA LTD	3,609	523.350	1,888,770.150	
UNITED BREWERIES LTD	5,209	842.600	4,389,103.400	
UNITECH LTD	145,720	19.950	2,907,114.000	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,583	811.150	10,206,700.450	
CAIRN INDIA LTD	43,852	286.650	12,570,175.800	
IDEA CELLULAR LTD	61,933	140.500	8,701,586.500	
POWER FINANCE CORP LTD	25,765	139.750	3,600,658.750	
DLF LTD	45,392	173.800	7,889,129.600	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	127,192	108.150	13,755,814.800	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	73,000	149.250	10,895,250.000	
RELIANCE POWER LTD	63,381	73.600	4,664,841.600	
RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	34,322	201.100	6,902,154.200	
BAJAJ AUTO LTD	8,032	1,862.400	14,958,796.800	
OIL INDIA LTD	12,465	534.250	6,659,426.250	
COAL INDIA LTD	43,852	289.900	12,712,694.800	
インド・ルピー 小計	3,305,686		1,292,852,921.050 (2,171,992,907)	
インドネシア・ルピア				
BUMI RESOURCES TBK PT	1,569,500	475.000	745,512,500.000	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	17,500.000	612,500,000.000	
UNITED TRACTORS TBK PT	185,201	16,700.000	3,092,856,700.000	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	464,000	6,850.000	3,178,400,000.000	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	176,000	29,400.000	5,174,400,000.000	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,169,500	6,500.000	14,101,750,000.000	
TELEKOMUNIKASI TBK	969,000	11,300.000	10,949,700,000.000	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	687,000	4,400.000	3,022,800,000.000	

	GUDANG GARAM TBK PT	49,500	46,450.000	2,299,275,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	181,000	21,800.000	3,945,800,000.000	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT	93,500	12,150.000	1,136,025,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	5,500.000	1,597,288,000.000	
	BANK MANDIRI	1,003,500	7,750.000	7,777,125,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	1,194,500	7,250.000	8,660,125,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,121,000	5,750.000	6,445,750,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	732,500	3,925.000	2,875,062,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,577,500	1,390.000	3,582,725,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	340,500	15,000.000	5,107,500,000.000	
	INDOSAT TBK PT	164,500	4,425.000	727,912,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,327,500	9,450.000	12,544,875,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	188,000	4,300.000	808,400,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	2,169,500	1,130.000	2,451,535,000.000	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	674,500	1,960.000	1,322,020,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,775.000	1,300,087,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	6,100.000	1,143,750,000.000	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	44,000	26,500.000	1,166,000,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	808,500	1,450.000	1,172,325,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,705,000	720.000	1,227,600,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	123,000	10,800.000	1,328,400,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	21,699,617		109,497,499,700.000 (1,105,924,748)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	81,600	193.000	15,748,800.000	
	BANK OF AYUDHYA	261,300	37.750	9,864,075.000	
	BEC WORLD PLC	104,100	60.500	6,298,050.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	342,500	18.100	6,199,250.000	
	SIAM MAKRO PCL NVDR	11,600	782.000	9,071,200.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	178,700	152.500	27,251,750.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	247,000	6.950	1,716,650.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	71,200	175.000	12,460,000.000	
	IRPC PCL NVDR	1,080,200	3.120	3,370,224.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	11,500	231.000	2,656,500.000	
	BANGKOK BANK PCL NVDR	63,100	191.000	12,052,100.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	323,900	27.750	8,988,225.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	112,700	278.000	31,330,600.000	

	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	467,500	10.100	4,721,750.000	
	PTT PCL	89,800	343.000	30,801,400.000	
	SIAM CEMENT PCL	12,800	438.000	5,606,400.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	7,600	438.000	3,328,800.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	47,100	158.000	7,441,800.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	31,400	438.000	13,753,200.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	127,500	179.000	22,822,500.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	154,000	40.250	6,198,500.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	35,800	145.000	5,191,000.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	177,700	20.200	3,589,540.000	
	THAI OIL PCL NVDR	87,000	64.500	5,611,500.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	62,000	69.750	4,324,500.000	
	CP ALL PCL NVDR	443,000	35.250	15,615,750.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	142,045	163.000	23,153,335.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	21,422	18.200	389,880.400	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	128,333	18.200	2,335,660.600	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	177,208	71.000	12,581,768.000	
	タイ・パーツ 小計	5,101,608		314,474,708.000 (1,006,319,066)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,669	3,560.000	5,941,640.000	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	15,215	255.500	3,887,432.500	
	CEZ	17,644	475.000	8,380,900.000	
	チェコ・コルナ 小計	34,528		18,209,972.500 (91,596,161)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	194,379	6.860	1,333,439.940	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,760	25.800	561,408.000	
	ARCELIK	27,213	12.600	342,883.800	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	40,618	5.060	205,527.080	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	166,902	1.920	320,451.840	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	13,160	25.500	335,580.000	
	KOC HOLDING AS	68,796	8.780	604,028.880	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	49,513	2.720	134,675.360	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	12,826	12.800	164,172.800	

	TURK HAVA YOLLARI	46,784	8.040	376,143.360	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	85,537	11.250	962,291.250	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	240,611	7.140	1,717,962.540	
	TURKIYE IS BANKASI	154,675	5.000	773,375.000	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,304	43.000	572,072.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	76,848	4.060	312,002.880	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	95,036	9.650	917,097.400	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,817	54.000	368,118.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,418	40.500	867,429.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	83,017	4.070	337,879.190	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	16,685	11.850	197,717.250	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	67,504	14.350	968,682.400	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	52,652	6.980	367,510.960	
	KOZA ALTIN ISLETMELERİ AS	4,261	23.050	98,216.050	
トルコ・リラ	小計	1,560,316		12,838,664.980 (662,089,953)	
ハンガリー・ フォロント	MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICATIONS PLC	46,948	327.000	15,351,996.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,754	17,000.000	63,818,000.000	
	OTP BANK NYRT	23,604	5,060.000	119,436,240.000	
ハンガリー・フォロント	小計	74,306		198,606,236.000 (88,300,332)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	655,600	28.350	18,586,260.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	229,880	49.400	11,356,072.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	76,309	92.000	7,020,428.000	
	AYALA CORP	17,833	567.000	10,111,311.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	212,800	24.000	5,107,200.000	
	DMCI HOLDINGS INC	70,370	50.900	3,581,833.000	
	GLOBE TELECOM INC	3,520	1,511.000	5,318,720.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	72,710	87.750	6,380,302.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	48,790	140.000	6,830,600.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	14,501	107.600	1,560,307.600	
	BDO UNIBANK INC	135,688	84.500	11,465,636.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	4,575	2,802.000	12,819,150.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	672,475	16.300	10,961,342.500	
UNIVERSAL ROBINA CORP	87,930	118.000	10,375,740.000		

	SM INVESTMENTS CORP	29,962	860.000	25,767,320.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	949,200	5.900	5,600,280.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,289,200	4.780	6,162,376.000	
	ABOITIZ POWER CORP	221,200	33.800	7,476,560.000	
フィリピン・ペソ 小計		4,792,543		166,481,438.600 (382,907,308)	
ブラジル・リアル	BRF SA	69,692	47.680	3,322,914.560	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA	26,730	15.360	410,572.800	
	VALE SA	137,927	28.970	3,995,745.190	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	12,518	29.800	373,036.400	
	VALE SA-PREF A	204,696	26.440	5,412,162.240	
	RAIA DROGASIL SA	21,900	20.400	446,760.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	83,200	8.290	689,728.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	9.040	210,180.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	22,749	4.540	103,280.460	
	BANCO DO BRASIL SA	60,300	20.540	1,238,562.000	
	CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	14,700	81.800	1,202,460.000	
	CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS PREF	73,290	82.820	6,069,877.800	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	37,962	6.750	256,243.500	
	AES TIETE SA	12,300	21.880	269,124.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	297,486	7.780	2,314,441.080	
	LOJAS AMERICANAS SA	42,136	15.210	640,888.560	
	LOJAS AMERICANAS SA	16,100	12.910	207,851.000	
	MARCOPOLO SA	20,400	12.500	255,000.000	
	GERDAU SA	91,130	12.830	1,169,197.900	
	METALURGICA GERDAU SA	38,400	16.100	618,240.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	12,606	98.200	1,237,909.200	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	318,010	13.800	4,388,538.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	448,312	15.210	6,818,825.520	
	ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTICIPACOES SA	36,300	12.930	469,359.000	
	KLABIN SA	68,000	10.700	727,600.000	
	SOUZA CRUZ SA	41,200	27.490	1,132,588.000	
KROTON EDUCACIONAL SA	20,900	30.040	627,836.000		
CCR SA	92,020	16.850	1,550,537.000		
WEG SA	22,900	27.860	637,994.000		
BANCO BRADESCO SA PREF	225,549	26.070	5,880,062.430		

BANCO BRADESCO SA	66,560	28.800	1,916,928.000	
CIA HERING	16,000	31.470	503,520.000	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	45,400	8.630	391,802.000	
NATURA COSMETICOS SA	17,600	48.040	845,504.000	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	66,706	5.520	368,217.120	
BRADSPAR SA	22,300	20.250	451,575.000	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	40,700	7.940	323,158.000	
CPFL ENERGIA SA	27,640	20.650	570,766.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	267,980	26.990	7,232,780.200	
PORTO SEGURO SA	13,800	23.890	329,682.000	
FIBRIA CELULOSE SA	30,690	25.320	777,070.800	
BRASKEM SA	14,130	15.780	222,971.400	
TRACTEBEL ENERGIA SA	19,770	34.800	687,996.000	
LOCALIZA RENT A CAR	14,805	30.790	455,845.950	
TELEFONICA BRASIL S.A.	32,428	46.850	1,519,251.800	
LOJAS RENNER SA	14,400	61.610	887,184.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	38,500	11.250	433,125.000	
ARTERIS SA	10,900	20.500	223,450.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	34,852	52.430	1,827,290.360	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,900	41.750	496,825.000	
CIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA	6,000	34.000	204,000.000	
TOTVS SA	13,000	34.160	444,080.000	
EMBRAER SA	61,160	20.980	1,283,136.800	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,900	19.100	341,890.000	
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPACOES SA	123,500	0.590	72,865.000	
BR PROPERTIES SA	19,400	18.300	355,020.000	
M DIAS BRANCO SA	3,600	84.000	302,400.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	11,700	21.700	253,890.000	
ODONTOPREV SA	30,000	8.960	268,800.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	46,000	18.740	862,040.000	
JBS SA	77,800	6.550	509,590.000	
OI SA-PREFERENCE	82,024	3.460	283,803.040	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	55,569	20.250	1,125,272.250	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	33,198	22.490	746,623.020	
MRV ENGENHARIA E PARTICIPACOES SA	34,600	6.100	211,060.000	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,900	51.160	404,164.000	

	BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL	18,300	13.620	249,246.000	
	DURATEX SA	30,943	13.000	402,259.000	
	SUL AMERICA SA	15,448	12.710	196,344.080	
	MPX ENERGIA SA	18,300	7.130	130,479.000	
	HYPERMARCAS SA	34,400	15.140	520,816.000	
	BM&FBOVESPA SA	207,100	12.510	2,590,821.000	
	MULTIPLUS SA	5,200	28.300	147,160.000	
	QUALICORP SA	22,700	14.990	340,273.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	101,800	12.900	1,313,220.000	
	CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,338	21.400	435,233.200	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	20,600	14.900	306,940.000	
	CIELO SA	36,657	55.650	2,039,962.050	
	ITAUSA-INV ITAU-RCT	7,393	7.790	57,591.470	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	61,900	17.750	1,098,725.000	
	MPX ENERGIA SA-RTS	3,923	0.800	3,138.400	
	BANCO SANTANDER BRASIL-RTS	302,171	0.010	3,021.710	
	ブラジル・リアル 小計	4,930,248		90,646,321.290 (3,987,531,674)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	23,631	5.200	122,881.200	
	BRE BANK SA	1,540	388.000	597,520.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	3,518	91.010	320,173.180	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,968	113.500	1,698,868.000	
	BANK PEKAO SA	13,427	144.250	1,936,844.750	
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	69,255	7.900	547,114.500	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	34,308	46.980	1,611,789.840	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,841	291.500	828,151.500	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	94,279	35.000	3,299,765.000	
	SYNTHOS SA	60,398	4.550	274,810.900	
	EUROCASH SA	7,580	58.500	443,430.000	
	GRUPA LOTOS SA	5,604	38.500	215,754.000	
	POLSKIE GORNICITWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	177,841	6.220	1,106,171.020	
	KERNEL HOLDING SA	4,994	52.480	262,085.120	
	CYFROWY POLSAT SA	21,501	20.400	438,620.400	
	GRUPA AZOTY SA	5,000	67.000	335,000.000	
	ENEA SA	18,176	13.490	245,194.240	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	78,285	14.910	1,167,229.350	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	153,857	4.310	663,123.670	

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	6,137	420.500	2,580,608.500	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,528	64.590	292,463.520	
	ALIOR BANK SA	4,463	87.000	388,281.000	
ポーランド・ズロチ 小計		806,131		19,375,879.690 (585,926,602)	
マレーシア・ リンギット	PARKSON HOLDINGS BHD	83,339	3.750	312,521.250	
	AMMB HOLDINGS BHD	217,500	7.550	1,642,125.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	7,700	9.960	76,692.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	467,700	8.230	3,849,171.000	
	DIGI.COM BHD	395,900	4.620	1,829,058.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	57,600	6.480	373,248.000	
	RHB CAPITAL BHD	64,500	8.570	552,765.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	79,878	4.250	339,481.500	
	GAMUDA BHD	197,700	4.900	968,730.000	
	GENTING BHD	218,200	9.950	2,171,090.000	
	YTL CORP BHD	572,010	1.630	932,376.300	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,400	14.220	261,648.000	
	HONG LEONG BANK BHD	63,200	13.980	883,536.000	
	IJM CORP BHD	102,980	5.700	586,986.000	
	IOI CORP BHD	275,213	5.450	1,499,910.850	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	48,000	21.500	1,032,000.000	
	MALAYAN BANKING BHD	440,075	10.420	4,585,581.500	
	LAFARGE MALAYSIA BHD	62,300	10.180	634,214.000	
	MMC CORP BHD	46,600	2.660	123,956.000	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	85,100	5.430	462,093.000	
	MISC BHD	119,380	5.240	625,551.200	
	PPB GROUP BHD	54,500	14.340	781,530.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	24,900	26.080	649,392.000	
	PETRONAS GAS BHD	67,000	20.940	1,402,980.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	340,000	3.950	1,343,000.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	58.820	670,548.000	
TELEKOM MALAYSIA BHD	105,000	5.400	567,000.000		
TENAGA NASIONAL BHD	281,150	8.490	2,386,963.500		
UMW HOLDINGS BHD	57,900	14.300	827,970.000		
PUBLIC BANK BHD(Local)	3,600	16.960	61,056.000		
PUBLIC BANK BHD	109,200	16.980	1,854,216.000		
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	268,632	1.630	437,870.160		

	AIRASIA BHD	83,400	3.210	267,714.000	
	SIME DARBY BERHAD	288,100	9.440	2,719,664.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	286,700	6.660	1,909,422.000	
	UEM SUNRISE BHD	145,600	3.010	438,256.000	
	BUMI ARMADA BHD	120,700	4.000	482,800.000	
	MAXIS BHD	248,700	6.850	1,703,595.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	291,500	6.620	1,929,730.000	
	SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	369,000	4.030	1,487,070.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	207,400	3.000	622,200.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	248,000	3.960	982,080.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	134,800	4.490	605,252.000	
	マレーシア・リングgit 小計	7,370,457		47,873,043.260 (1,507,522,133)	
メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	300,000	31.440	9,432,000.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	45,800	178.230	8,162,934.000	
	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV	34,700	46.270	1,605,569.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	26,300	157.550	4,143,565.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	193,700	34.600	6,702,020.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	274,000	63.880	17,503,120.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	176,600	38.630	6,822,058.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	64,800	60.950	3,949,560.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	191,600	73.020	13,990,632.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	105,088	52.860	5,554,951.680	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,555	400.510	5,428,913.050	
	INDUSTRIAS CH SAB DE CV	17,900	82.070	1,469,053.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	166,200	42.910	7,131,642.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	20,200	148.870	3,007,174.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	402,352	37.170	14,955,423.840	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,100,878	13.670	56,059,002.260	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	237,100	30.260	7,174,646.000	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,800	95.730	4,192,974.000		
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	568,600	36.070	20,509,402.000		
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	41,300	64.170	2,650,221.000		

	GENOMMA LAB INTERNACIONAL SAB DE CV	96,400	26.480	2,552,672.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	71,500	34.030	2,433,145.000	
	MINERA FRISCO SAB DE CV	74,900	36.590	2,740,591.000	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	130,900	23.130	3,027,717.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	37,900	45.180	1,712,322.000	
メキシコ・ペソ 小計		7,436,073		212,911,307.830 (1,656,449,974)	
モロッコ・ディルハム	ATTIJARIWafa BANK	3,037	328.450	997,502.650	
	MAROC TELECOM	11,381	98.530	1,121,369.930	
	DOUJA PROMOTION GROUPE ADDOHA SA	17,278	44.990	777,337.220	
モロッコ・ディルハム 小計		31,696		2,896,209.800 (33,914,616)	
韓国・ウォン	CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,830	24,100.000	236,903,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,555	94,800.000	337,014,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,913	240,500.000	941,076,500.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,728	49,600.000	234,508,800.000	
	COWAY CO LTD	5,520	57,700.000	318,504,000.000	
	KT&G CORP	10,938	77,800.000	850,976,400.000	
	S-1 CORPORATION	3,323	67,600.000	224,634,800.000	
	KOREA GAS CORP	2,623	55,900.000	146,625,700.000	
	CJ CORP	1,357	116,500.000	158,090,500.000	
	CHEIL INDUSTRIES INC	5,177	86,900.000	449,881,300.000	
	DOOSAN INFRACORE CO.,LTD	11,440	10,650.000	121,836,000.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	9,480	27,250.000	258,330,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	864	211,500.000	182,736,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	3,097	80,100.000	248,069,700.000	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	20,370	9,620.000	195,959,400.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,761	174,000.000	306,414,000.000	
	LG UPLUS CORP	22,490	12,400.000	278,876,000.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	5,440	41,000.000	223,040,000.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	12,500	6,760.000	84,500,000.000	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	4,351	32,750.000	142,495,250.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	1,043	540,000.000	563,220,000.000		
LG CHEM LTD	5,085	254,000.000	1,291,590,000.000		
LG CHEM LTD	480	116,500.000	55,920,000.000		

LS CORP	2,059	67,100.000	138,158,900.000	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	1,800	59,000.000	106,200,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	45,541	38,650.000	1,760,159,650.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	6,713	23,600.000	158,426,800.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	4,918	14,150.000	69,589,700.000	
S-OIL CORP	4,395	72,000.000	316,440,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,951	17,250.000	154,404,750.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	8,038	44,750.000	359,700,500.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,767	145,500.000	257,098,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	4,230	183,500.000	776,205,000.000	
HYUNDAI MOBIS	7,312	246,500.000	1,802,408,000.000	
SK HYNIX INC	55,780	27,500.000	1,533,950,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	8,029	55,600.000	446,412,400.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,475	89,900.000	222,502,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	16,668	219,000.000	3,650,292,000.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	1,103	123,500.000	136,220,500.000	
HYUNDAI HYSKO	3,580	36,950.000	132,281,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,180	63,600.000	393,048,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,220	10,900.000	198,598,000.000	
KCC CORP	490	332,000.000	162,680,000.000	
KIA MOTORS CORP	28,277	60,900.000	1,722,069,300.000	
KOREA ZINC CO LTD	824	260,000.000	214,240,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,757	27,000.000	749,439,000.000	
HANWHA CORP	4,426	29,400.000	130,124,400.000	
KOREAN AIR CO LTD	3,541	29,150.000	103,220,150.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	136,000.000	204,000,000.000	
HYUNDAI SECURITIES CO	15,940	6,050.000	96,437,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,472	82,000.000	120,704,000.000	
KT CORP	3,668	35,800.000	131,314,400.000	
LG ELECTRONICS INC	10,884	67,700.000	736,846,800.000	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD	44,397	10,700.000	475,047,900.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	71	1,592,000.000	113,032,000.000	
LG CORP	10,335	63,200.000	653,172,000.000	
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,973	10,900.000	174,105,700.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,132	26,750.000	110,531,000.000	
NHN CORP	4,454	280,000.000	1,247,120,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,610	159,000.000	255,990,000.000	

KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,090	39,900.000	163,191,000.000	
DOOSAN CORP	1,014	126,000.000	127,764,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	314	369,500.000	116,023,000.000	
KANGWON LAND INC	12,570	31,800.000	399,726,000.000	
POSCO	7,060	301,500.000	2,128,590,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,956	68,200.000	201,599,200.000	
SAMSUNG C&T CORP	13,685	51,900.000	710,251,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,424	141,000.000	482,784,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	6,038	79,300.000	478,813,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	11,815	1,248,000.000	14,745,120,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	16,170	37,400.000	604,758,000.000	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	4,103	65,900.000	270,387,700.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	2,186	804,000.000	1,757,544,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	882	223,000.000	196,686,000.000	
HYOSUNG CORP	2,374	61,800.000	146,713,200.000	
ORION CORP	352	930,000.000	327,360,000.000	
YUHAN CORP	952	201,000.000	191,352,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,747	166,500.000	457,375,500.000	
HALLA CLIMATE CONTROL	4,350	32,250.000	140,287,500.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	30,500.000	174,155,000.000	
GS HOLDINGS CORP	5,448	50,800.000	276,758,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,808	27,700.000	659,481,600.000	
SK NETWORKS CO LTD	16,150	6,250.000	100,937,500.000	
HITE JINRO CO LTD	1,350	28,200.000	38,070,000.000	
CELLTRION INC	6,011	45,750.000	275,003,250.000	
HANA FINANCIAL GROUP	29,416	32,150.000	945,724,400.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,245	183,000.000	227,835,000.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	2,981	36,500.000	108,806,500.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,217	365,000.000	444,205,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,643	109,500.000	727,408,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	322	910,000.000	293,020,000.000	
SAMSUNG CARD CO	4,488	37,700.000	169,197,600.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,016	138,000.000	830,208,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	703	266,000.000	186,998,000.000	
LG INNOTEK CO LTD	945	83,200.000	78,624,000.000	
SK C&C CO LTD	2,582	99,000.000	255,618,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	41,294	34,250.000	1,414,319,500.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,471	157,000.000	230,947,000.000	

	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	2,980	30,700.000	91,486,000.000	
	BS FINANCIAL GROUP INC	18,050	15,600.000	281,580,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	18,670	6,700.000	125,089,000.000	
	E-MART CO LTD	2,328	205,500.000	478,404,000.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	14,590	15,650.000	228,333,500.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	8,024	55,400.000	444,529,600.000	
韓国・ウォン	小計	856,399		60,596,436,550.000 (5,368,844,278)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	155,000	12.040	1,866,200.000	
	JIANGSU EXPRESS	136,000	7.620	1,036,320.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	164,000	2.800	459,200.000	
	YANTAI CHANGYU PIONEER WINE CO	24,400	31.480	768,112.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	645,500	81.100	52,350,050.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	133,500	20.600	2,750,100.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	280,000	3.280	918,400.000	
	BEIJING ENTERPRISES	55,500	55.250	3,066,375.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	358,000	7.750	2,774,500.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	212,000	5.490	1,163,880.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	77,000	79.800	6,144,600.000	
	CNOOC LTD	1,898,000	13.100	24,863,800.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	328,000	8.660	2,840,480.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	439,120	20.250	8,892,180.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	220,000	20.550	4,521,000.000	
	CITIC PACIFIC	133,000	8.230	1,094,590.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	212,000	4.720	1,000,640.000	
	LENOVO GROUP LTD	630,000	6.900	4,347,000.000	
	POLY PROPERTY GROUP CO LTD	217,000	4.000	868,000.000	
	PETRO CHINA CO LTD	2,244,000	9.120	20,465,280.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	510,742	10.400	5,311,716.800	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	68,800	10.680	734,784.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,705,200	5.430	14,689,236.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	82,000	42.400	3,476,800.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	366,000	12.880	4,714,080.000	
	COSCO PACIFIC LTD	176,000	9.790	1,723,040.000	
	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LTD	316,000	2.730	862,680.000	

YUEXIU PROPERTY CO LTD	564,000	1.920	1,082,880.000	
CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	122,000	22.650	2,763,300.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	446,000	2.390	1,065,940.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	112,000	10.280	1,151,360.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	316,000	7.900	2,496,400.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	62,400	15.940	994,656.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	470,000	2.850	1,339,500.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	112,000	20.200	2,262,400.000	
BYD CO LTD	56,500	28.350	1,601,775.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,428,000	3.800	5,426,400.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	170,000	15.220	2,587,400.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	246,000	6.080	1,495,680.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	302,000	4.810	1,452,620.000	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	92,000	5.610	516,120.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	344,158	8.610	2,963,200.380	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	200,000	3.880	776,000.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	189,200	20.150	3,812,380.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	109,500	34.750	3,805,125.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	798,000	17.760	14,172,480.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	661,000	1.520	1,004,720.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	148,000	7.750	1,147,000.000	
WEICHAI POWER CO LTD	57,360	22.950	1,316,412.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	242,000	2.400	580,800.000	
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS GROUP LTD	79,000	9.240	729,960.000	
CHINA VANKE CO LTD	151,761	13.320	2,021,456.520	
SHANGHAI INDUSTRIAL	38,000	23.050	875,900.000	
TINGYI HOLDING CORP	206,000	19.440	4,004,640.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	32,000	55.800	1,785,600.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	302,000	6.320	1,908,640.000	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	134,000	23.800	3,189,200.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	164,000	6.450	1,057,800.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	324,000	5.060	1,639,440.000	

CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	450,000	1.870	841,500.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	142,000	28.850	4,096,700.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	109,300	304.400	33,270,920.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	200,500	50.200	10,065,100.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	1,220,240	0.690	841,965.600	

[前へ](#) [次へ](#)

平成25年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	AIR CHINA / HONG KONG	168,000	5.190	871,920.000	
	ZTE CORP	50,240	11.680	586,803.200	
	SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	340,000	2.420	822,800.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	360,000	20.200	7,272,000.000	
	COSCO HOLDINGS	304,000	3.270	994,080.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS	851,205	4.900	4,170,904.500	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	196,000	11.660	2,285,360.000	
	PARKSON RETAIL GROUP LTD	181,500	2.980	540,870.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK	7,679,530	5.350	41,085,485.500	
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	60,000	21.100	1,266,000.000	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	286,000	9.630	2,754,180.000	
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	122,000	7.520	917,440.000	
	WUMART STORES INC	51,000	14.120	720,120.000	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	190,000	4.840	919,600.000	
	CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	298,000	6.370	1,898,260.000	
	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD	69,000	10.200	703,800.000	
	BANK OF CHINA LTD	7,982,200	3.120	24,904,464.000	
	SHUI ON LAND LTD	345,600	2.110	729,216.000	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	151,500	14.700	2,227,050.000	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	11.960	717,600.000	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	102,000	10.160	1,036,320.000	
	CHINA BLUECHEMICAL LTD	184,000	3.890	715,760.000	
	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	393,927	12.900	5,081,658.300	
	IND & COMM BK OF CHINA - H	7,860,235	4.800	37,729,128.000	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	92,000	4.570	420,440.000	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	297,600	4.400	1,309,440.000	
	CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	417,000	5.390	2,247,630.000	
	CHINA COAL ENERGY CO	422,000	4.030	1,700,660.000	
	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC CO LTD	47,000	16.760	787,720.000	

INTIME RETAIL GROUP CO LTD	120,000	7.740	928,800.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	82,000	12.080	990,560.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	215,800	3.260	703,508.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	459,509	3.900	1,792,085.100	
CHINA CITIC BANK-H	856,800	3.480	2,981,664.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	535,000	10.800	5,778,000.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	109,000	7.120	776,080.000	
FOSUN INTERNATIONAL	117,500	5.600	658,000.000	
FRANSHION PROPERTIES CHINA LTD	402,000	2.400	964,800.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	3.880	1,113,560.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	260,000	1.560	405,600.000	
SOHO CHINA LTD	229,500	6.250	1,434,375.000	
DAH CHONG HONG HOLDINGS LTD	182,000	5.620	1,022,840.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	839,000	1.700	1,426,300.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	396,000	3.240	1,283,040.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	105,000	7.320	768,600.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	202,000	6.100	1,232,200.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	629,000	10.560	6,642,240.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	285,400	24.800	7,077,920.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	662,000	3.100	2,052,200.000	
CSR CORP LTD - H	227,000	4.210	955,670.000	
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP LTD	247,000	3.150	778,050.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	230,500	10.580	2,438,690.000	
BBMG CORP	131,000	4.280	560,680.000	
SINOPHARM GROUP CO	97,200	18.440	1,792,368.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	258,000	3.950	1,019,100.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	229,805	6.940	1,594,846.700	
YINGDE GASES	118,500	6.960	824,760.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	241,000	3.120	751,920.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	293,000	8.190	2,399,670.000	

	SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	54,500	14.800	806,600.000	
	SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	198,000	4.940	978,120.000	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	156,280	4.980	778,274.400	
	LONGFOR PROPERTIES CO LTD	135,500	10.760	1,457,980.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	59,200	22.800	1,349,760.000	
	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	547,900	7.620	4,174,998.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,176,000	3.080	6,702,080.000	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	93,500	7.500	701,250.000	
	FAR EAST HORIZON LTD	190,000	4.790	910,100.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	146,500	13.300	1,948,450.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD	170,800	9.080	1,550,864.000	
	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	74,400	11.920	886,848.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	405,000	3.410	1,381,050.000	
香港・ドル	小計	66,604,312		520,037,625.000 (6,677,283,105)	
台湾・ドル	ACER INC	237,069	22.700	5,381,466.300	
	ASUSTEK COMPUTER INC	69,554	262.000	18,223,148.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	48,135	72.200	3,475,347.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	634,729	25.250	16,026,907.250	
	ASIA CEMENT CORP	300,717	36.200	10,885,955.400	
	TAIWAN BUSINESS BANK	251,441	8.950	2,250,396.950	
	FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS CORP	3,559	373.500	1,329,286.500	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	85,000	72.400	6,154,000.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	35.450	2,765,100.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	138,210	28.500	3,938,985.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	51,086	76.200	3,892,753.200	
	QUANTA COMPUTER INC	249,858	66.800	16,690,514.400	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	16,600	63.500	1,054,100.000	
	CHENG UEI PRECISION INDUSTRY CO LTD	42,286	58.000	2,452,588.000	
	EVA AIRWAYS CORP	158,227	16.650	2,634,479.550	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	73,760	146.500	10,805,840.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	417,157	17.100	7,133,384.700	

CHINA AIRLINES	232,156	11.150	2,588,539.400	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	147,104	97.400	14,327,929.600	
CHINA STEEL CORP	1,225,896	24.050	29,482,798.800	
CHINA MOTORS CO	40,000	26.050	1,042,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	209,074	29.200	6,104,960.800	
ADVANTECH CO LTD	32,251	143.000	4,611,893.000	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO LTD	19,000	56.000	1,064,000.000	
CLEVO CO	56,424	54.000	3,046,896.000	
CHINA PETROCHEMICAL DEVELOPMENT CORP	247,200	15.400	3,806,880.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	489,304	18.600	9,101,054.400	
CTCI CORP	39,000	57.900	2,258,100.000	
DELTA ELECTRONICS INC	197,448	147.000	29,024,856.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	411,327	99.400	40,885,903.800	
AU OPTRONICS CORP	873,194	10.650	9,299,516.100	
TAIWAN MOBILE CO LTD	181,800	109.500	19,907,100.000	
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	48,144	66.400	3,196,761.600	
EVERGREEN MARINE CORP	206,399	16.100	3,323,023.900	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORES CO LTD	105,613	27.900	2,946,602.700	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	317,458	32.700	10,380,876.600	
FENG HSIN IRON & STEEL CO	44,150	51.700	2,282,555.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,285	130.500	7,606,192.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	419,840	72.700	30,522,368.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	89,000	28.250	2,514,250.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	315,140	73.300	23,099,762.000	
TRANSCEND INFORMATION INC	22,897	86.800	1,987,459.600	
EPISTAR CORP	90,149	52.000	4,687,748.000	
GIANT MANUFACTURING	32,151	220.000	7,073,220.000	
MEDIATEK INC	128,570	351.500	45,192,355.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	632,936	38.950	24,652,857.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	460,745	16.800	7,740,516.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	27,000	376.500	10,165,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	180,000	80.000	14,400,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	29,088	121.500	3,534,192.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,017,600	15.500	15,772,800.000	

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	754,373	41.750	31,495,072.750	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,449,403	8.420	12,203,973.260	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	383,660	18.950	7,270,357.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,082,609	75.900	82,170,023.100	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	869,827	24.300	21,136,796.100	
LARGAN PRECISION CO LTD	11,220	950.000	10,659,000.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	551,654	13.300	7,336,998.200	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	666,108	9.900	6,594,469.200	
INVENTEC CO LTD	289,005	19.500	5,635,597.500	
LCY CHEMICAL CORP	29,250	37.600	1,099,800.000	
HTC CORPORATION	77,832	191.000	14,865,912.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	230,865	50.600	11,681,769.000	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	42,230	102.000	4,307,460.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	618,693	14.700	9,094,787.100	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,298,078	18.950	24,598,578.100	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	666,644	17.800	11,866,263.200	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	34,000	198.000	6,732,000.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	82,560	56.800	4,689,408.000	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	76,119	35.300	2,687,000.700	
NAN YA PLASTICS CORP	498,840	59.000	29,431,560.000	
WISTRON CORP	229,030	27.600	6,321,228.000	
KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP	31,020	111.500	3,458,730.000	
POU CHEN CORP	235,990	29.700	7,008,903.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	428,152	59.400	25,432,228.800	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	62,392	208.000	12,977,536.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	113,480	73.800	8,374,824.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	14,658	246.500	3,613,197.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,907	53.900	3,983,587.300	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	48,139	66.600	3,206,057.400	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	80,844	72.200	5,836,936.800	
SILICONWARE PRECISION INDS	314,743	37.200	11,708,439.600	
STANDARD FOODS CORP	12,720	100.000	1,272,000.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	150,666	38.250	5,762,974.500	
TAIWAN CEMENT CORP	396,874	36.950	14,664,494.300	

TAIWAN GLASS INDUSTRIAL CORP	146,301	27.050	3,957,442.050	
TSRC CORP	67,790	58.900	3,992,831.000	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	264,000	30.700	8,104,800.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,628,083	106.000	278,576,798.000	
TUNG HO STEEL ENTERPRISE CORP	88,952	26.550	2,361,675.600	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	66,000	46.600	3,075,600.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,298,525	13.900	18,049,497.500	
WAN HAI LINES LTD	122,587	15.600	1,912,357.200	
WALSIN LIHWA CORP	378,000	8.510	3,216,780.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	86,668	12.100	1,048,682.800	
YULON MOTOR CO	93,149	48.750	4,541,013.750	
INNOLUX CORPORATION	698,410	14.850	10,371,388.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	160,526	34.850	5,594,331.100	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	18,385	185.500	3,410,417.500	
HERMES MICROVISION INC	5,000	902.000	4,510,000.000	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	26,035	227.000	5,909,945.000	
PEGATRON CORP	151,554	51.500	7,805,031.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	65,000	67.900	4,413,500.000	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	13,000	69.100	898,300.000	
TPK HOLDING CO LTD	24,494	391.500	9,589,401.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	13,700	68.000	931,600.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	441,195	16.600	7,323,837.000	
台湾・ドル 小計	30,244,670		1,321,498,911.160 (4,400,591,374)	
南アフリカ・ランド				
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	81,286	15.650	1,272,125.900	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	11,263	144.950	1,632,571.850	
BARLOWORLD LTD	23,384	81.930	1,915,851.120	
BIDVEST GROUP LTD	32,026	239.010	7,654,534.260	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	54,290	85.410	4,636,908.900	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	132,396	24.870	3,292,688.520	
ASSORE LTD	3,722	321.310	1,195,915.820	
DISCOVERY LTD	32,316	85.940	2,777,237.040	
REDEFINE PROPERTIES LTD	237,133	9.920	2,352,359.360	
MASSMART HOLDINGS LTD	10,432	170.040	1,773,857.280	
GOLD FIELDS LTD	73,287	49.600	3,635,035.200	

REMGRO LTD	53,485	188.000	10,055,180.000	
THE FOSCHINI GROUP LTD	26,769	95.500	2,556,439.500	
NORTHAM PLATINUM LTD	34,423	34.550	1,189,314.650	
MMI HOLDINGS LTD	113,466	20.860	2,366,900.760	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	173,761	25.450	4,422,217.450	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,073	34.500	1,382,518.500	
EXXARO RESOURCES LTD	18,819	144.800	2,724,991.200	
LIBERTY HOLDINGS LTD	15,051	115.780	1,742,604.780	
MTN GROUP LTD	180,712	182.450	32,970,904.400	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	40,730	128.670	5,240,729.100	
FIRSTSTRAND LTD	336,892	28.000	9,432,976.000	
NASPERS LTD	42,015	757.840	31,840,647.600	
NEDBANK GROUP LTD	22,441	169.800	3,810,481.800	
NETCARE LTD	95,948	23.100	2,216,398.800	
PICK'N PAY STORES LTD	27,363	37.770	1,033,500.510	
REUNERT LTD	21,244	66.260	1,407,627.440	
RMB HOLDINGS LTD	78,470	37.700	2,958,319.000	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	8,608	280.000	2,410,240.000	
SAPPI LTD	71,555	25.290	1,809,625.950	
SASOL LTD	57,813	431.500	24,946,309.500	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	45,571	183.990	8,384,608.290	
MR PRICE GROUP LTD	29,298	129.400	3,791,161.200	
STANDARD BANK GROUP LTD	124,652	106.000	13,213,112.000	
SPAR GROUP LTD/THE	19,656	112.250	2,206,386.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	81,527	64.510	5,259,306.770	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	23,293	203.000	4,728,479.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	31,288	232.120	7,262,570.560	
ABSA GROUP LTD	29,933	137.000	4,100,821.000	
TIGER BRANDS LTD	14,950	287.170	4,293,191.500	
NAMPAK LTD	85,660	32.560	2,789,089.600	
SANLAM LTD	186,962	45.990	8,598,382.380	
INVESTEC LTD	29,615	63.850	1,890,917.750	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	55,032	88.350	4,862,077.200	
KUMBA IRON ORE LTD	7,833	459.930	3,602,631.690	
PPC LTD	69,881	28.680	2,004,187.080	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	103,090	35.550	3,664,849.500	
RMI HOLDINGS	60,982	24.900	1,518,451.800	
VODACOM GROUP PTY LTD	40,318	106.500	4,293,867.000	
南アフリカ・ランド 小計	3,190,714		265,121,102.510 (2,664,467,080)	

合計	160,727,767		36,199,479,112 (36,199,479,112)	
----	-------------	--	------------------------------------	--

(2) 株式以外の有価証券

平成25年7月11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	1,235,121.000	16,797,645.600	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	204,800.000	26,667,008.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,439,921.000	43,464,653.600 (338,155,005)	
投資信託受益証券 合計			1,439,921	338,155,005 (338,155,005)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	73,844.000	188,302.200	
	トルコ・リラ 小計		73,844.000	188,302.200 (9,710,744)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	145,400.000	6,160,598.000	
	メキシコ・ペソ 小計		145,400.000	6,160,598.000 (47,929,453)	
投資証券 合計			219,244	57,640,197 (57,640,197)	
合計				395,795,202 (395,795,202)	

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 53銘柄	10.00%	-%	-%	10.41%
インド・ルピー	株式 75銘柄	5.70%	-%	-%	5.94%
インドネシア・ルピア	株式 29銘柄	2.90%	-%	-%	3.02%
タイ・バーツ	株式 30銘柄	2.64%	-%	-%	2.75%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.24%	-%	-%	0.25%
トルコ・リラ	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	1.74% -%	-% -%	-% 0.03%	1.84%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.23%	-%	-%	0.24%
フィリピン・ペソ	株式 18銘柄	1.01%	-%	-%	1.05%
ブラジル・リアル	株式 82銘柄	10.47%	-%	-%	10.90%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.54%	-%	-%	1.60%
マレーシア・リングgit	株式 43銘柄	3.96%	-%	-%	4.12%

メキシコ・ペソ	株式	25銘柄	4.35%	-%	-%	5.58%
	投資信託 受益証券	2銘柄	-%	0.89%	-%	
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.13%	
モロッコ・ディルハム	株式	3銘柄	0.09%	-%	-%	0.09%
韓国・ウォン	株式	104銘柄	14.09%	-%	-%	14.67%
香港・ドル	株式	136銘柄	17.53%	-%	-%	18.25%
台湾・ドル	株式	107銘柄	11.55%	-%	-%	12.03%
南アフリカ・ランド	株式	49銘柄	6.99%	-%	-%	7.28%

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		941,248,301	993,288,048
コール・ローン		19,530,549	26,655,503
国債証券		35,830,887,459	33,069,651,653
派生商品評価勘定		363	200,070
未収利息		599,179,050	625,185,201
前払費用		35,309,531	31,963,416
流動資産合計		37,426,155,253	34,746,943,891
資産合計		37,426,155,253	34,746,943,891
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		36,508	-
未払解約金		9,691,000	23,650,000
流動負債合計		9,727,508	23,650,000
負債合計		9,727,508	23,650,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	28,309,027,227	25,952,878,514
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		9,107,400,518	8,770,415,377
元本等合計		37,416,427,745	34,723,293,891
純資産合計		37,416,427,745	34,723,293,891
負債純資産合計		37,426,155,253	34,746,943,891

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11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	27,922,375,206円	28,309,027,227円
同期中追加設定元本額	2,209,280,184円	2,361,571,124円
同期中一部解約元本額	1,822,628,163円	4,717,719,837円
元本の内訳		
ファンド名		
マネックス資産設計ファン ド エボリューション	26,438,145円	33,962,135円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国10）	20,941円	267,612円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国20）	42,705円	737,069円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国30）	66,084円	1,723,423円
投資のソムリエ	8,245,126円	1,510,150円
クルーズコントロール	3,610,106円	382,873円
グローバル債券ファンド（適 格機関投資家限定）	355,245,944円	321,885,428円
為替フルヘッジ型エマージ ング債券ファンド（適格機関投 資家限定）	3,075,966,234円	885,794,406円
エマージング債券パッシブ ファンドV A（適格機関投資 家専用）	5,394,845,780円	5,256,993,244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）	12,023,062,130円	12,084,180,790円

D I A M世界アセットバラン スファンド3 V A（適格機関 投資家限定）	7,421,484,032円	7,365,441,384円
計	28,309,027,227円	25,952,878,514円
2. 受益権の総数	28,309,027,227口	25,952,878,514口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年10月26日 至 平成25年1月11日	自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,692,481,219	3,935,186,226
合計	1,692,481,219	3,935,186,226

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成24年4月19日から平成25年1月11日まで及び平成25年4月19日から平成25年7月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成25年1月11日 現在				平成25年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	8,081,965	-	8,118,110	36,145	13,148,070	-	12,948,000	200,070
アメリカ・ドル	8,081,965	-	8,118,110	36,145	13,148,070	-	12,948,000	200,070
合計	8,081,965	-	8,118,110	36,145	13,148,070	-	12,948,000	200,070

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成25年1月11日現在	平成25年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3217円	1.3379円
（1万口当たり純資産額）	（13,217円）	（13,379円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成25年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 10.125 05/15/27	3,000,000.000	4,529,700.000	
		BRAZIL 11.0 08/17/40	2,700,000.000	3,199,500.000	
		BRAZIL 12.25 03/06/30	800,000.000	1,361,360.000	
		BRAZIL 2.625 01/05/23	2,500,000.000	2,136,250.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	3,900,000.000	4,135,950.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	3,100,000.000	3,030,250.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	3,100,000.000	3,518,500.000	
		BRAZIL 6.0 01/17/17	2,400,000.000	2,692,320.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	4,000,000.000	4,670,000.000	
		BRAZIL 7.875 03/07/15	2,100,000.000	2,303,700.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	2,900,000.000	3,715,770.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,500,000.000	3,433,250.000	
		BRAZIL 8.875 04/15/24	2,500,000.000	3,414,750.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	2,200,000.000	2,841,300.000	
		BULGARIA 8.25 01/15/15	1,700,000.000	1,862,350.000	
		COLOMBIA 11.75 02/25/20	900,000.000	1,311,300.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	3,400,000.000	3,503,700.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	3,700,000.000	4,060,750.000	
		COLOMBIA 7.375 01/27/17	2,650,000.000	3,095,200.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	3,600,000.000	4,345,200.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	2,900,000.000	3,639,500.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	1,300,000.000	1,687,400.000	
		COLOMBIA 8.25 12/22/14	1,900,000.000	2,083,179.000	
		CROATIA 6.25 04/27/17	1,900,000.000	2,012,366.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	1,700,000.000	1,784,150.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	2,000,000.000	2,137,800.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	1,600,000.000	1,722,640.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	2,700,000.000	2,868,750.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	3,400,000.000	3,604,000.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	1,600,000.000	1,712,000.000	
		INDONESIA 11.625 03/04/19	2,000,000.000	2,689,400.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	2,300,000.000	2,075,750.000	
		INDONESIA 4.875 05/05/21	2,400,000.000	2,373,000.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	2,600,000.000	2,281,500.000			
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,200,000.000	2,335,960.000			

INDONESIA 6.625 02/17/37	1,400,000.000	1,466,710.000	
INDONESIA 6.875 01/17/18	3,000,000.000	3,330,000.000	
INDONESIA 6.875 03/09/17	1,550,000.000	1,719,880.000	
INDONESIA 7.25 04/20/15	1,000,000.000	1,075,000.000	
INDONESIA 7.5 01/15/16	1,000,000.000	1,103,750.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,300,000.000	2,755,630.000	
INDONESIA 8.5 10/12/35	1,900,000.000	2,417,845.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	1,600,000.000	1,752,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	3,700,000.000	4,317,900.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,900,000.000	2,294,250.000	
PANAMA 7.25 03/15/15	2,200,000.000	2,389,640.000	
PANAMA 8.875 09/30/27	1,800,000.000	2,471,814.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	1,900,000.000	2,726,500.000	
PERU 5.625 11/18/50	2,500,000.000	2,531,425.000	
PERU 6.55 03/14/37	1,900,000.000	2,224,900.000	
PERU 7.125 03/30/19	1,700,000.000	2,050,200.000	
PERU 7.35 07/21/25	3,800,000.000	4,824,860.000	
PERU 8.375 05/03/16	1,200,000.000	1,392,240.000	
PERU 8.75 11/21/33	4,000,000.000	5,761,200.000	
PHILIPPINES 10.625 03/16/25	1,800,000.000	2,826,000.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	2,400,000.000	2,486,640.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	1,500,000.000	1,563,750.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	1,600,000.000	1,800,000.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	1,600,000.000	1,854,000.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,600,000.000	4,221,000.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	1,000,000.000	1,188,750.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	2,300,000.000	2,987,125.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	1,700,000.000	2,178,125.000	
PHILIPPINES 9.375 01/18/17	500,000.000	618,530.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	2,300,000.000	3,412,625.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	1,500,000.000	2,017,500.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	2,500,000.000	2,825,825.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 3.625 04/29/15	3,700,000.000	3,836,900.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	5,400,000.000	5,773,410.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	19,668,000.000	22,966,913.530	

RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	5,100,000.000	6,926,055.000	
RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	3,100,000.000	5,381,290.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.25 04/04/17	2,000,000.000	2,066,400.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	1,600,000.000	1,626,240.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	4,000,000.000	4,041,800.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	1,600,000.000	1,544,000.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	1,800,000.000	1,912,500.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,400,000.000	1,505,000.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	800,000.000	829,000.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	2,700,000.000	3,067,875.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	1,700,000.000	2,786,130.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	1,500,000.000	1,497,705.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	2,200,000.000	2,299,000.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	3,400,000.000	3,225,750.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,500,000.000	2,681,250.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	2,000,000.000	2,254,200.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	2,100,000.000	2,212,875.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	3,200,000.000	3,465,920.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	1,800,000.000	2,040,750.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	2,300,000.000	2,604,750.000	
TURKEY 7.0 09/26/16	3,000,000.000	3,330,000.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	1,300,000.000	1,446,250.000	
TURKEY 7.25 03/15/15	4,000,000.000	4,268,960.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	3,900,000.000	4,543,500.000	
TURKEY 7.5 07/14/17	2,200,000.000	2,510,750.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	1,800,000.000	2,092,500.000	
TURKEY 8.0 02/14/34	1,900,000.000	2,284,750.000	
UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16	3,500,000.000	4,503,800.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	3,400,000.000	3,349,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	6,300,000.000	5,638,500.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	3,800,000.000	4,199,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17	3,000,000.000	3,348,000.000	

	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	3,200,000.000	2,960,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	3,200,000.000	3,680,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,400,000.000	5,859,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.625 03/03/15	2,500,000.000	2,718,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	3,700,000.000	4,371,920.000	
	UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	1,400,000.000	1,785,280.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.0 09/24/22	900,000.000	1,190,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.125 12/30/19	1,700,000.000	2,265,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	1,700,000.000	2,346,000.000	
	アメリカ・ドル 小計	288,168,000.000 (28,704,414,480)	331,991,282.530 (33,069,651,653)	
国債証券 合計		28,704,414,480 (28,704,414,480)	33,069,651,653 (33,069,651,653)	
合計		28,704,414,480 (28,704,414,480)	33,069,651,653 (33,069,651,653)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 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	国債証券 111銘柄	95.24%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(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。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成25年7月31日現在

資産総額	51,493,732円
負債総額	49,168円
純資産総額（ - ）	51,444,564円
発行済数量	50,000,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0289円

（参考）マザーファンドの現況

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	318,202,564,377円
負債総額	1,079,096,922円
純資産総額（ - ）	317,123,467,455円
発行済数量	202,991,927,320口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5622円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	454,763,444,470円
負債総額	6,372,421,000円
純資産総額（ - ）	448,391,023,470円
発行済数量	383,240,080,368口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1700円

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	11,132,118,003円
負債総額	320,309,103円
純資産総額（ - ）	10,811,808,900円
発行済数量	9,341,443,352口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1574円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	311,661,782,043円
負債総額	203,197,405円
純資産総額（ - ）	311,458,584,638円
発行済数量	158,500,755,232口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9650円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	27,384,304,987円
負債総額	34,804,776円

純資産総額(-)	27,349,500,211円
発行済数量	35,009,993,973口
1口当たり純資産額(/)	0.7812円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	174,850,879,956円
負債総額	752,623,341円
純資産総額(-)	174,098,256,615円
発行済数量	145,812,443,669口
1口当たり純資産額(/)	1.1940円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	37,736,374,466円
負債総額	162,282,646円
純資産総額(-)	37,574,091,820円
発行済数量	45,306,180,476口
1口当たり純資産額(/)	0.8293円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成25年7月31日現在

資産総額	34,654,269,455円
負債総額	9,028,000円
純資産総額(-)	34,645,241,455円
発行済数量	25,835,480,684口
1口当たり純資産額(/)	1.3410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かか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、当該譲渡にかか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かかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

直近5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。

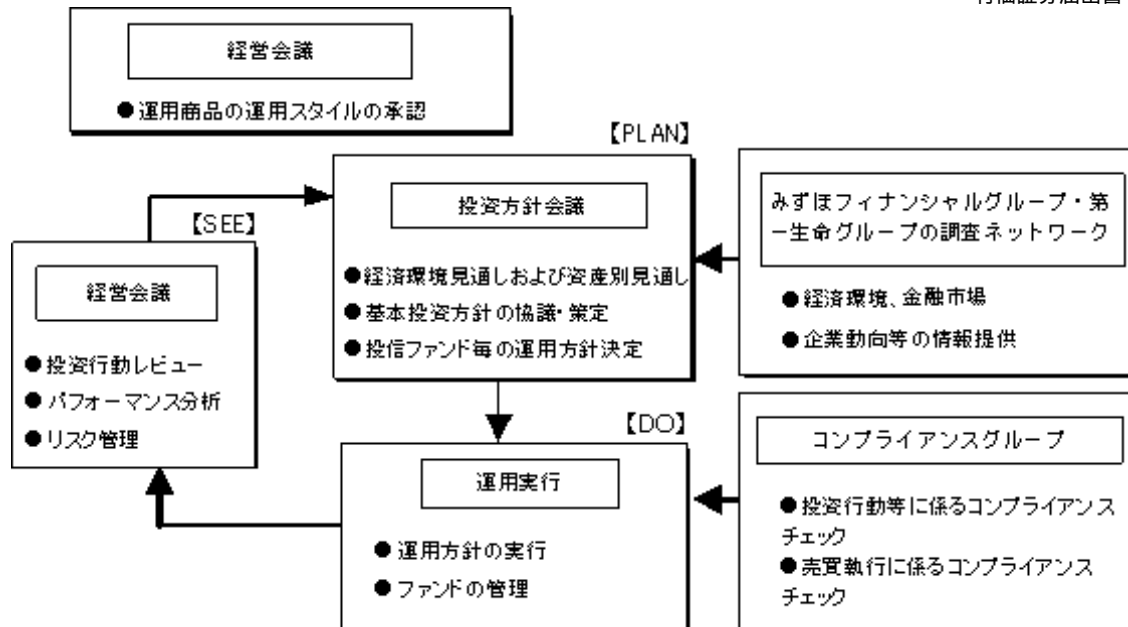
投資運用の意思決定機構

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25年7月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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25年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は294本（親投資信託を除く）あり、以下の通りです。

基本的性格	本数	純資産総額 (単位：円)
単位型株式投資信託	10	22,363,692,013
追加型株式投資信託	275	4,666,286,574,951
単位型公社債投資信託	8	83,684,378,117
追加型公社債投資信託	0	0
証券投資信託以外の投資信託	1	134,803,414
合計	294	4,772,469,448,495

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
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28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)		第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	23,208,602		23,374,427	
運用受託報酬	4,966,992		5,374,163	
投資助言報酬	943,057		885,923	
その他営業収益	697,063		715,164	
営業収益計		29,815,715		30,349,678
営業費用				
支払手数料	10,154,958		10,846,568	
広告宣伝費	164,286		177,553	
公告費	-		3,769	
調査費	4,590,302		4,546,312	
調査費	2,888,013		3,001,788	
委託調査費	1,702,289		1,544,523	
委託計算費	335,754		341,978	
営業雑経費	496,565		456,677	
通信費	26,941		25,513	
印刷費	399,066		374,775	
協会費	25,014		25,492	
諸会費	41		42	
支払販売手数料	45,500		30,854	
営業費用計		15,741,867		16,372,860
一般管理費				
給料	4,630,102		4,870,759	
役員報酬	245,224		242,014	
給料・手当	3,824,122		4,035,751	
賞与	560,755		592,994	
交際費	35,987		36,212	
寄付金	3,156		2,693	
旅費交通費	213,642		187,653	
租税公課	84,346		95,064	
不動産賃借料	656,463		675,811	
退職給付費用	164,627		173,065	
固定資産減価償却費	475,556		524,750	
福利厚生費	24,887		26,642	
修繕費	6,721		6,018	
賞与引当金繰入	574,646		724,974	
役員退職慰労引当金繰入	30,048		47,820	
役員退職金	27,503		7,200	
機器リース料	1,510		35	
事務委託費	323,740		224,066	
消耗品費	58,739		60,044	
器具備品費	2,889		2,065	
諸経費	114,695		159,247	
一般管理費計		7,429,267		7,824,126
営業利益		6,644,580		6,152,691

（単位：千円）

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

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	2,428,478	2,428,478
当期変動額	-	-
当期末残高	2,428,478	2,428,478
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	123,293	123,293
当期変動額	-	-
当期末残高	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	13,430,000	15,630,000
当期変動額	2,200,000	700,000
当期末残高	15,630,000	16,330,000
研究開発積立金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額	-	-
当期末残高	300,000	300,000
運用責任準備積立金		
当期首残高	200,000	200,000
当期変動額	-	-
当期末残高	200,000	200,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	4,459,380	3,463,300
当期変動額		
剰余金の配当	2,208,000	2,712,000
別途積立金の積立	2,200,000	700,000
当期純利益	3,411,920	3,894,102
当期末残高	3,463,300	3,945,403
利益剰余金合計		
当期首残高	18,512,674	19,716,594
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	19,716,594	20,898,697
株主資本合計		
当期首残高	22,941,152	24,145,072
当期変動額	1,203,920	1,182,102
当期末残高	24,145,072	25,327,175
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	216,534	136,143

	当期変動額（純額）	80,390	32,375
	当期末残高	136,143	103,768
純資産合計			
	当期首残高	23,157,686	24,281,215
	当期変動額	1,123,529	1,149,727
	当期末残高	24,281,215	25,430,943

[次へ](#)

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）
「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針 平成24年5月17日）
<p>(1) 概要</p> <p>財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法、退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものであります。</p> <p>(2) 適用予定日</p> <p>平成25年4月1日以後に開始する事業年度の期末から適用予定であります。ただし、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。</p> <p>(3) 当該会計基準等の適用による影響</p> <p>財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

2. 関係会社項目

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

(千円)

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

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 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23年6月28日 定時株主総会	普通 株式	2,208,000	92,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(リース取引関係)

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

リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額

該当事項はありません。

未経過リース料期末残高相当額

該当事項はありません。

支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

(千円)

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

減価償却費相当額の算定方法
該当事項はありません。

利息相当額の算定方法
該当事項はありません。

2. オペレーティング・リース取引 該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第27期（平成24年3月31日現在）

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

第28期（平成25年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

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

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期（平成24年3月31日現在）

	1年以内 （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	12,520,524	-	-	-
合計	12,520,524	-	-	-

第28期（平成25年3月31日現在）

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

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第27期（平成24年3月31日現在）

（千円）

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

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

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券
第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

関係会社株式について338,244千円減損処理を行っております。

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託
第27期（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表日における 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	6,548,577	495,939

第28期（平成25年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（千円）

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

3. 退職給付費用に関する事項

（千円）

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（1）割引率

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

（2）退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

（3）数理計算上の差異の処理年数

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 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	523,845	未払費用	158,645
	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	203,092	未払費用	75,484

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

第27期（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

(注5) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注6) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

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

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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

5【その他】

(1) 定款の変更等

平成25年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】**

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成25年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでおります。

(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
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
水戸証券株式会社（ 1）	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

*平成25年3月末現在

（ 1）水戸証券株式会社は、平成25年10月1日より募集・販売の取扱い等を開始します。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成25年8月21日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 和田 渉 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」に掲げられている投資のソムリエの平成25年1月12日から平成25年7月11日までの特定期間の財務諸表、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、投資のソムリエの平成25年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。

財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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