

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年4月14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。

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書の提出に伴い、平成25年9月26日付をもって提出した有価証券届出書（平成25年10月18日、平成25年10月23日、平成25年11月1日、平成25年11月11日、平成25年12月2日および平成25年12月5日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書で訂正済。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

（５）【申込手数料】

<訂正前>

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。

（略）

<訂正後>

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（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。

（略）

（７）【申込期間】

<訂正前>

（略）

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。

（略）

<訂正後>

（略）

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」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

（略）

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成25年7月31日現在）

(略)

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%

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成26年1月31日現在）

(略)

大株主の状況

（平成26年1月31日現在）

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

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<訂正前>

(略)

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。

<訂正後>

(略)

上記体制は平成26年1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。

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<運用評価・運用リスク管理体制>

(略)

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。

<訂正後>

(略)

<運用評価・運用リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成26年1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】

<訂正前>

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。

(略)

<訂正後>

お申込日の翌営業日の基準価額に、 3.24% (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。

(略)

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

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。

(略)

<訂正後>

ファンドの日々の純資産総額に対して年率 1.512% (税抜1.40%)

(略)

(5)【課税上の取扱い】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」

につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

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

換金（解約）時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成26年1月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

<個別元本について>

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

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

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

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成26年1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	859,155,270	53.10
内 日本	859,155,270	53.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	758,884,842	46.90
純資産総額	1,618,040,112	100.00

その他資産の投資状況

平成26年1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)	112,499,218	6.95
内 日本	112,499,218	6.95
為替予約取引(売建)	112,499,218	6.95
内 日本	112,499,218	6.95

(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。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	309,380,255,810	97.90
内 日本	309,380,255,810	97.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,645,971,305	2.10
純資産総額	316,026,227,115	100.00

その他資産の投資状況

平成26年1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)	6,743,250,000	2.13
内 日本	6,743,250,000	2.13

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	356,477,373,400	79.58
内 日本	356,477,373,400	79.58
地方債証券	29,455,263,509	6.58
内 日本	29,455,263,509	6.58
特殊債券	30,536,881,322	6.82
内 日本	30,536,881,322	6.82
社債券	28,314,501,320	6.32
内 日本	28,314,501,320	6.32
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,176,603,303	0.71
純資産総額	447,960,622,854	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	28,099,868,120	99.06
内 日本	28,099,868,120	99.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	267,376,951	0.94
純資産総額	28,367,245,071	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	291,088,043,166	94.98
内 アメリカ	173,259,727,788	56.53
内 ユーロ	40,943,116,078	13.36
内 イギリス	29,014,481,647	9.47
内 カナダ	13,107,510,970	4.28
内 スイス	12,243,054,131	3.99
内 オーストラリア	9,250,371,893	3.02
内 スウェーデン	4,358,482,683	1.42
内 香港	3,611,146,709	1.18
内 シンガポール	1,747,494,435	0.57
内 デンマーク	1,671,038,506	0.55
内 ノルウェー	1,075,964,162	0.35
内 イスラエル	645,092,178	0.21
内 ニュージーランド	160,561,986	0.05
投資信託受益証券	823,313,101	0.27
内 オーストラリア	703,782,216	0.23
内 シンガポール	119,530,885	0.04
投資証券	5,139,794,132	1.68
内 アメリカ	4,130,983,730	1.35
内 イギリス	403,702,071	0.13
内 ユーロ	390,927,667	0.13
内 香港	111,766,122	0.04
内 カナダ	102,414,542	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,415,565,284	3.07
純資産総額	306,466,715,683	100.00

その他資産の投資状況

平成26年1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）	5,283,955,000	1.72
内 日本	5,283,955,000	1.72
株価指数先物取引（買建）	9,409,453,259	3.07
内 アメリカ	5,771,248,308	1.88
内 ユーロ	1,912,467,009	0.62
内 イギリス	935,607,036	0.31
内 カナダ	405,370,492	0.13
内 オーストラリア	384,760,414	0.13

（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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1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	3,475,850,476	12.94
内 オーストラリア	2,505,875,140	9.33
内 シンガポール	969,975,336	3.61
投資証券	23,205,030,260	86.38
内 アメリカ	18,051,405,557	67.20
内 ユーロ	1,953,625,887	7.27
内 イギリス	1,855,536,416	6.91
内 カナダ	749,983,155	2.79
内 香港	494,362,496	1.84
内 ニュージーランド	94,043,121	0.35
内 イスラエル	6,073,628	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	181,704,362	0.68
純資産総額	26,862,585,098	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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。

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26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	166,425,881,102	94.96
内 ユーロ	72,509,092,989	41.37
内 アメリカ	65,916,580,687	37.61
内 イギリス	13,464,277,332	7.68
内 カナダ	3,936,077,068	2.25
内 オーストラリア	2,551,223,551	1.46
内 メキシコ	1,595,642,699	0.91
内 デンマーク	1,410,044,320	0.80
内 ポーランド	1,324,060,786	0.76
内 スウェーデン	981,309,038	0.56
内 マレーシア	865,997,676	0.49
内 南アフリカ	702,164,567	0.40
内 シンガポール	631,829,147	0.36
内 ノルウェー	537,581,242	0.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,830,015,371	5.04
純資産総額	175,255,896,473	100.00

その他資産の投資状況

平成26年1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）	166,214,122,960	94.84
内 日本	166,214,122,960	94.84

（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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	34,724,119,959	94.40
内 香港	6,952,695,862	18.90
内 韓国	5,659,682,207	15.39
内 台湾	4,241,934,921	11.53
内 ブラジル	3,575,237,110	9.72
内 アメリカ	3,414,128,713	9.28
内 南アフリカ	2,494,253,487	6.78
内 インド	2,047,764,241	5.57
内 メキシコ	1,538,388,275	4.18
内 マレーシア	1,385,595,202	3.77
内 インドネシア	867,044,827	2.36
内 タイ	784,290,365	2.13
内 ポーランド	603,419,445	1.64
内 トルコ	476,652,890	1.30
内 フィリピン	330,404,742	0.90
内 ユーロ	172,807,577	0.47
内 ハンガリー	92,069,241	0.25
内 チェコ	87,750,854	0.24
投資信託受益証券	322,146,169	0.88
内 メキシコ	322,146,169	0.88
投資証券	69,523,817	0.19
内 メキシコ	48,146,505	0.13
内 トルコ	21,377,312	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,668,234,747	4.54
純資産総額	36,784,024,692	100.00

その他資産の投資状況

平成26年1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）	663,382,500	1.80
内 日本	663,382,500	1.80
株価指数先物取引（買建）	1,653,026,030	4.49
内 アメリカ	1,653,026,030	4.49

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	33,795,532,621	96.66
内 アメリカ	33,795,532,621	96.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,168,726,927	3.34
純資産総額	34,964,259,548	100.00

その他資産の投資状況

平成26年1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）	82,280,000	0.24
内 日本	82,280,000	0.24

（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。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成26年1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	493,394,621	1.1901 587,205,656	1.1921 588,175,727	- -	36.35%
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	210,989,854	1.2068 254,636,284	1.2124 255,804,098	- -	15.81%
3	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	9,816,921	0.8073 7,925,599	0.8048 7,900,658	- -	0.49%
4	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	1,728,375	1.4203 2,454,966	1.4026 2,424,218	- -	0.15%
5	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	731,767	2.2912 1,676,663	2.2265 1,629,279	- -	0.10%
6	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	861,016	1.7748 1,528,199	1.6991 1,462,952	- -	0.09%
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	1,228,783	0.9033 1,110,051	0.8621 1,059,333	- -	0.07%
8	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	520,403	1.3255 689,814	1.3432 699,005	- -	0.04%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	53.10%
合計	53.10%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成26年1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	2,484,000	4,905.54 12,185,384,654	5,922.00 14,710,248,000	- -	4.65%
2	三菱UFJフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	13,343,300	538.00 7,178,695,400	623.00 8,312,875,900	- -	2.63%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	865,000	3,478.23 3,008,672,733	7,563.00 6,541,995,000	- -	2.07%
4	三井住友フィナンシャルG 日本	株式 銀行業	1,332,100	3,790.00 5,048,659,000	4,824.00 6,426,050,400	- -	2.03%
5	本田技研 日本	株式 輸送用機器	1,606,200	3,596.09 5,776,043,464	3,893.00 6,252,936,600	- -	1.98%
6	みずほフィナンシャルG 日本	株式 銀行業	22,803,700	209.00 4,766,008,273	219.00 4,994,010,300	- -	1.58%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	692,100	4,050.00 2,803,005,000	5,561.00 3,848,768,100	- -	1.22%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	1,108,300	3,026.02 3,353,742,070	3,197.00 3,543,235,100	- -	1.12%
9	日立 日本	株式 電気機器	4,286,000	536.48 2,299,359,689	792.00 3,394,512,000	- -	1.07%
10	武田薬品 日本	株式 医薬品	700,200	4,700.00 3,290,940,000	4,793.00 3,356,058,600	- -	1.06%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	199,100	14,861.33 2,958,891,304	16,770.00 3,338,907,000	- -	1.06%
12	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,233,000	2,143.00 2,642,319,000	2,545.00 3,137,985,000	- -	0.99%
13	KDDI 日本	株式 情報・通信業	546,800	3,558.10 1,945,569,128	5,705.00 3,119,494,000	- -	0.99%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	1,034,600	3,310.00 3,424,526,000	3,006.00 3,110,007,600	- -	0.98%
15	セブン&アイ・HLDGS 日本	株式 小売業	736,800	2,817.00 2,075,565,600	4,102.00 3,022,353,600	- -	0.96%
16	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	430,500	4,779.86 2,057,732,202	6,398.00 2,754,339,000	- -	0.87%
17	三井不動産 日本	株式 不動産業	830,000	2,095.00 1,738,850,000	3,289.00 2,729,870,000	- -	0.86%
18	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,374,500	1,953.00 2,684,398,500	1,903.00 2,615,673,500	- -	0.83%
19	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物取引業	3,600,900	531.00 1,912,077,900	725.00 2,610,652,500	- -	0.83%

20	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	328,300	6,440.00 2,114,252,000	7,632.00 2,505,585,600	- -	0.79%
21	新日鐵住金 日本	株式 鉄鋼	7,899,000	272.57 2,153,085,547	315.00 2,488,185,000	- -	0.79%
22	パナソニック 日本	株式 電気機器	2,039,100	757.00 1,543,598,700	1,184.00 2,414,294,400	- -	0.76%
23	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,451,300	1,369.00 1,986,829,700	1,663.00 2,413,511,900	- -	0.76%
24	デンソー 日本	株式 輸送用機器	441,000	3,700.00 1,631,700,000	5,339.00 2,354,499,000	- -	0.75%
25	三井物産 日本	株式 卸売業	1,621,900	1,406.19 2,280,699,615	1,385.00 2,246,331,500	- -	0.71%
26	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,505,100	993.85 2,489,705,365	885.00 2,217,013,500	- -	0.70%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	585,800	2,473.00 1,448,683,400	3,734.00 2,187,377,200	- -	0.69%
28	三菱重工業 日本	株式 機械	3,178,000	526.30 1,672,600,300	670.00 2,129,260,000	- -	0.67%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,785,000	812.00 1,449,420,000	1,178.00 2,102,730,000	- -	0.67%
30	東京海上HD 日本	株式 保険業	682,300	2,713.00 1,851,079,900	3,034.00 2,070,098,200	- -	0.66%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

種類	投資比率
株式	97.90%
合計	97.90%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.85%
輸送用機器		11.62%
銀行業		9.57%
情報・通信業		7.00%
機械		5.27%
化学		5.25%
医薬品		4.43%
卸売業		4.41%
小売業		4.21%
食料品		3.73%
陸運業		3.57%
不動産業		3.40%
建設業		2.58%
サービス業		2.47%
保険業		2.16%
電気・ガス業		2.12%
証券、商品先物取引業		1.75%
鉄鋼		1.68%
その他製品		1.39%
その他金融業		1.34%
精密機器		1.33%
非鉄金属		1.05%
ガラス・土石製品		0.98%
ゴム製品		0.90%
繊維製品		0.69%
金属製品		0.68%
石油・石炭製品		0.58%
空運業		0.50%
鉱業		0.44%
海運業		0.38%
パルプ・紙	0.28%	
倉庫・運輸関連業	0.22%	
水産・農林業	0.07%	
合計	97.90%	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1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	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.96 5,553,060,000	102.00 5,610,000,000	0.800000 2023/6/20	1.25%
2	97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	100.72 5,036,100,000	0.400000 2016/6/20	1.12%
3	328回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	98.42 4,921,365,000	100.34 5,017,350,000	0.600000 2023/3/20	1.12%
4	106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	100.21 5,010,800,000	0.200000 2017/9/20	1.12%
5	306回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,600,000,000	106.70 4,908,290,000	106.96 4,920,344,000	1.400000 2020/3/20	1.10%
6	330回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,700,000,000	101.67 4,778,539,000	101.86 4,787,702,000	0.800000 2023/9/20	1.07%
7	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	102.69 4,621,170,000	104.14 4,686,525,000	1.000000 2022/3/20	1.05%
8	103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	100.57 4,525,875,000	0.300000 2017/3/20	1.01%
9	105回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.32 4,514,535,000	100.23 4,510,575,000	0.200000 2017/6/20	1.01%
10	293回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	108.42 4,553,894,000	107.07 4,497,108,000	1.800000 2018/6/20	1.00%
11	89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	100.43 4,318,834,000	0.400000 2015/6/20	0.96%
12	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	106.07 4,243,120,000	1.500000 2018/9/20	0.95%
13	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.45 4,258,300,000	105.84 4,233,720,000	1.400000 2018/12/20	0.95%
14	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	105.21 4,103,541,000	1.500000 2017/12/20	0.92%
15	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.49 4,019,680,000	102.35 4,094,120,000	0.800000 2022/9/20	0.91%

16	3 2 6 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.74 4,029,860,000	101.39 4,055,880,000	0.700000 2022/12/20	0.91%
17	3 1 3 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	105.84 4,021,992,000	106.48 4,046,582,000	1.300000 2021/3/20	0.90%
18	1 1 4 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.54 4,021,750,000	100.52 4,021,080,000	0.300000 2018/9/20	0.90%
19	9 2 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	100.35 4,014,240,000	0.300000 2015/9/20	0.90%
20	3 0 5 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	105.78 3,808,254,000	106.23 3,824,352,000	1.300000 2019/12/20	0.85%
21	3 1 5 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	105.76 3,701,810,000	1.200000 2021/6/20	0.83%
22	3 0 1 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	107.33 3,649,418,000	106.93 3,635,892,000	1.500000 2019/6/20	0.81%
23	2 8 2 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	104.18 3,542,392,000	1.700000 2016/9/20	0.79%
24	9 3 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	100.78 3,527,475,000	0.500000 2015/12/20	0.79%
25	1 1 3 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.26 3,509,380,000	100.54 3,518,970,000	0.300000 2018/6/20	0.79%
26	8 8 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	100.47 3,516,450,000	0.500000 2015/3/20	0.78%
27	1 0 7 回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.30 3,510,830,000	100.19 3,506,720,000	0.200000 2017/12/20	0.78%
28	3 2 6 回 利付国庫債券(2年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.04 3,501,580,000	100.02 3,500,770,000	0.100000 2015/3/15	0.78%
29	2 8 5 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	104.94 3,463,152,000	1.700000 2017/3/20	0.77%
30	3 1 0 回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	103.76 3,424,344,000	104.54 3,450,018,000	1.000000 2020/9/20	0.77%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	79.58%
地方債証券	6.58%
特殊債券	6.82%
社債券	6.32%
合計	99.29%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1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	5,158	566,751.32 2,923,303,349	583,000.00 3,007,114,000	- -	10.60%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	4,429	531,127.70 2,352,364,619	529,000.00 2,342,941,000	- -	8.26%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	8,603	198,270.09 1,705,717,595	205,700.00 1,769,637,100	- -	6.24%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	8,871	139,617.96 1,238,550,966	152,900.00 1,356,375,900	- -	4.78%
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	1,166	951,852.81 1,109,860,386	1,035,000.00 1,206,810,000	- -	4.25%
6	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	3,075	323,339.12 994,267,797	351,000.00 1,079,325,000	- -	3.80%
7	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	4,622	215,850.13 997,659,306	217,200.00 1,003,898,400	- -	3.54%
8	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,849	480,447.14 888,346,763	527,000.00 974,423,000	- -	3.44%
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,290	121,029.23 761,273,862	136,000.00 855,440,000	- -	3.02%
10	G L P投資法人 日本	投資証券	7,818	98,825.37 772,616,772	106,300.00 831,053,400	- -	2.93%
11	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	984	818,708.56 805,609,231	831,000.00 817,704,000	- -	2.88%
12	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	936	794,547.66 743,696,617	855,000.00 800,280,000	- -	2.82%
13	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,475	427,802.93 631,009,332	487,500.00 719,062,500	- -	2.53%
14	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	3,094	203,952.10 631,027,816	227,300.00 703,266,200	- -	2.48%
15	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	5,162	127,946.55 660,460,136	135,900.00 701,515,800	- -	2.47%
16	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	6,207	103,350.80 641,498,421	108,200.00 671,597,400	- -	2.37%
17	ケネディクス不動産投資法人 日本	投資証券	1,239	450,390.89 558,034,323	511,000.00 633,129,000	- -	2.23%

18	野村不動産オフィスファンド 投資法人 日本	投資証券	1,389	472,144.56 655,808,797	452,500.00 628,522,500	- -	2.22%
19	日本アコモデーションファンド 投資法人 日本	投資証券	860	675,021.94 580,518,875	710,000.00 610,600,000	- -	2.15%
20	大和ハウス・レジデンシャル 投資法人 日本	投資証券	1,393	401,166.00 558,824,249	427,500.00 595,507,500	- -	2.10%
21	ジャパンエクセレント投資法 人 日本	投資証券	4,490	117,974.93 529,707,445	122,200.00 548,678,000	- -	1.93%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	583	868,479.35 506,323,463	846,000.00 493,218,000	- -	1.74%
23	ジャパン・ホテル・リート投 資法人 日本	投資証券	9,770	44,166.80 431,509,666	49,500.00 483,615,000	- -	1.70%
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,541	136,922.10 484,841,160	132,300.00 468,474,300	- -	1.65%
25	東急リアル・エステート投資 法人 日本	投資証券	3,644	118,423.91 431,536,756	123,300.00 449,305,200	- -	1.58%
26	福岡リート投資法人 日本	投資証券	514	797,670.08 410,002,423	860,000.00 442,040,000	- -	1.56%
27	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	457	765,617.58 349,887,236	861,000.00 393,477,000	- -	1.39%
28	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	5,498	65,312.58 359,088,614	64,000.00 351,872,000	- -	1.24%
29	プレミア投資法人 日本	投資証券	815	386,856.25 315,287,846	398,000.00 324,370,000	- -	1.14%
30	野村不動産レジデンシャル投 資法人 日本	投資証券	599	524,053.65 313,908,139	534,000.00 319,866,000	- -	1.13%

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

種類	投資比率
投資証券	99.06%
合計	99.06%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1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	92,754	47,838.55 4,437,217,055	51,372.39 4,764,995,441	- -	1.55%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	449,640	9,108.11 4,095,374,462	9,667.81 4,347,034,717	- -	1.42%
3	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	27,917	81,594.68 2,277,878,715	116,592.83 3,254,922,275	- -	1.06%
4	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	807,386	2,922.81 2,359,840,340	3,792.44 3,061,969,582	- -	1.00%
5	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	1,039,570	2,407.64 2,502,919,220	2,622.92 2,726,719,340	- -	0.89%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	287,687	7,819.90 2,249,685,365	9,205.96 2,648,437,891	- -	0.86%
7	NESTLE SA- REGISTERED スイス	株式 食品	328,388	7,174.89 2,356,148,776	7,516.98 2,468,486,356	- -	0.81%
8	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	515,521	3,635.32 1,874,086,301	4,736.70 2,441,869,867	- -	0.80%
9	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	197,149	11,907.63 2,347,579,217	11,978.04 2,361,459,988	- -	0.77%
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	279,844	7,899.14 2,210,528,832	7,906.84 2,212,684,027	- -	0.72%
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融サービス	383,778	5,070.34 1,945,888,523	5,760.15 2,210,622,684	- -	0.72%
12	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	676,001	2,783.39 1,881,575,504	3,170.14 2,143,021,325	- -	0.70%
13	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,903,533	1,227.47 2,336,530,518	1,069.32 2,035,492,302	- -	0.66%
14	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	71,471	23,449.90 1,675,988,317	28,415.21 2,030,863,759	- -	0.66%
15	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	106,042	20,524.29 2,176,437,085	18,243.24 1,934,550,674	- -	0.63%
16	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	234,010	7,209.35 1,687,061,670	8,235.05 1,927,085,220	- -	0.63%
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融サービス	1,093,077	1,249.26 1,365,545,901	1,741.41 1,903,505,930	- -	0.62%

18	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 無線通信サービス	4,941,395	284.73 1,407,010,218	382.79 1,891,556,518	- -	0.62%
19	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	542,288	3,630.03 1,968,522,690	3,430.38 1,860,254,451	- -	0.61%
20	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	298,696	4,249.26 1,269,237,606	5,504.03 1,644,034,313	- -	0.54%
21	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	406,611	3,799.44 1,544,894,988	3,926.16 1,596,422,364	- -	0.52%
22	BP PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,922,200	763.76 1,468,105,465	810.90 1,558,713,363	- -	0.51%
23	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・ カタログ販売	37,169	27,703.71 1,029,719,520	41,416.57 1,539,412,824	- -	0.50%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 各種金融サービス	308,990	4,575.43 1,413,764,235	4,968.13 1,535,104,960	- -	0.50%
25	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	397,909	3,601.20 1,432,950,303	3,643.87 1,449,931,850	- -	0.47%
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	291,965	4,574.20 1,335,507,936	4,899.22 1,430,401,292	- -	0.47%
27	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	353,534	3,576.26 1,264,331,869	3,846.96 1,360,032,570	- -	0.44%
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 タバコ	164,815	9,251.95 1,524,861,545	8,135.19 1,340,802,559	- -	0.44%
29	GLAXOSMITHKLINE PLC イギリス	株式 医薬品	499,201	2,491.95 1,243,984,794	2,675.00 1,335,365,269	- -	0.44%
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	157,377	7,456.78 1,173,526,007	8,339.88 1,312,506,679	- -	0.43%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

種類	投資比率
株式	94.98%
投資信託受益証券	0.27%
投資証券	1.68%
合計	96.93%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年1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	8.36%
商業銀行		7.69%
医薬品		6.82%
保険		4.12%
各種金融サービス		3.13%
メディア		2.98%
化学		2.75%
各種電気通信サービス		2.57%
食品		2.49%
ソフトウェア		2.49%
情報技術サービス		2.20%
コンピュータ・周辺機器		2.16%
資本市場		2.15%
航空宇宙・防衛		2.15%
飲料		2.12%
食品・生活必需品小売り		2.11%
金属・鉱業		2.09%
コングロマリット		1.97%
インターネットソフトウェア・サービス		1.95%
バイオテクノロジー		1.73%
ホテル・レストラン・レジャー		1.67%
機械		1.63%
専門小売り		1.55%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.50%
電力		1.49%
家庭用品		1.49%
半導体・半導体製造装置		1.47%
ヘルスケア機器・用品		1.43%
エネルギー設備・サービス		1.36%
総合公益事業		1.27%
通信機器		1.26%
タバコ		1.26%
繊維・アパレル・贅沢品		1.15%
自動車		1.13%
陸運・鉄道		0.91%
電気設備		0.89%
インターネット販売・カタログ販売		0.88%
無線通信サービス		0.88%
自動車部品		0.59%
航空貨物・物流サービス		0.57%
消費者金融		0.57%
不動産管理・開発		0.55%
複合小売り		0.53%
専門サービス		0.47%

建設・土木	0.43%
商業サービス・用品	0.42%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.42%
電子装置・機器・部品	0.34%
建設資材	0.31%
家庭用耐久財	0.28%
パーソナル用品	0.27%
商社・流通業	0.26%
容器・包装	0.21%
建設関連製品	0.20%
ガス	0.19%
運送インフラ	0.17%
旅客航空輸送業	0.14%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.13%
紙製品・林産品	0.11%
レジャー用品	0.10%
海運業	0.10%
水道	0.08%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.08%
販売	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
事務用電子機器	0.05%
各種消費者サービス	0.03%
合計	94.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1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	104,182	16,041.46 1,671,232,215	15,732.43 1,639,036,751	- -	6.10%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE ユーロ	投資証券	32,658	23,622.97 771,479,057	24,883.06 812,631,234	- -	3.03%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	48,486	15,445.63 748,896,962	16,129.47 782,053,802	- -	2.91%
4	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	167,259	3,745.65 626,493,866	3,991.99 667,697,359	- -	2.49%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	112,426	5,619.83 631,815,907	5,671.70 637,646,589	- -	2.37%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	98,622	6,711.96 661,947,575	6,359.83 627,219,529	- -	2.33%
7	HCP INC アメリカ	投資証券	153,008	4,424.56 676,993,972	4,000.22 612,066,488	- -	2.28%
8	WESTFIELD GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	652,586	1,010.66 659,543,308	921.31 601,237,596	- -	2.24%
9	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	51,257	10,499.00 538,147,362	11,108.87 569,407,862	- -	2.12%
10	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	96,806	6,500.28 629,266,860	5,868.16 568,073,387	- -	2.11%
11	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	58,336	8,116.82 473,503,065	9,399.34 548,320,294	- -	2.04%
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	40,771	13,497.64 550,312,365	12,565.37 512,303,010	- -	1.91%
13	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	253,551	1,678.49 425,583,040	1,885.42 478,051,089	- -	1.78%
14	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	261,547	1,487.01 388,923,751	1,756.18 459,325,702	- -	1.71%
15	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	334,325	971.27 324,721,117	1,136.00 379,795,740	- -	1.41%
16	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	180,113	2,016.33 363,168,481	2,056.17 370,343,199	- -	1.38%
17	LINK REIT/THE 香港	投資証券	774,523	496.82 384,800,413	464.72 359,939,426	- -	1.34%
18	SL GREEN アメリカ	投資証券	31,763	8,815.64 280,011,258	9,642.09 306,261,907	- -	1.14%
19	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	137,168	2,140.89 293,661,863	2,143.60 294,033,654	- -	1.09%
20	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	69,005	4,177.45 288,265,122	4,193.60 289,379,519	- -	1.08%
21	WESTFIELD RETAIL TRUST オーストラリア	投資信託 受益証券	1,002,863	265.18 265,944,437	275.03 275,820,519	- -	1.03%

22	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	47,044	6,007.36 282,610,533	5,773.53 271,610,029	- -	1.01%
23	STOCKLAND オーストラリア	投資信託 受益証券	771,655	324.92 250,726,704	334.03 257,758,697	- -	0.96%
24	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	21,760	10,037.76 218,421,823	11,147.96 242,579,757	- -	0.90%
25	COLE REAL ESTATE INVESTMENT INC アメリカ	投資証券	141,075	1,268.42 178,943,562	1,566.55 221,002,141	- -	0.82%
26	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	42,961	5,955.76 255,865,570	5,137.85 220,727,474	- -	0.82%
27	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	505,808	428.15 216,565,045	422.98 213,950,815	- -	0.80%
28	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	238,342	827.16 197,148,777	897.60 213,937,495	- -	0.80%
29	UDR INC アメリカ	投資証券	83,825	2,457.74 206,020,206	2,509.78 210,382,643	- -	0.78%
30	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	12,844	15,668.23 201,242,793	16,084.21 206,585,698	- -	0.77%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	12.94%
投資証券	86.38%
合計	99.32%

（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。

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26年1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 2.5 04/30/15 アメリカ	国債証券	1,954,340,000	103.88 2,030,323,710	102.90 2,011,054,946	2.500000 2015/4/30	1.15%
2	US T N/B 0.25 05/15/15 アメリカ	国債証券	1,902,910,000	99.82 1,899,559,335	100.09 1,904,679,706	0.250000 2015/5/15	1.09%
3	US T N/B 0.375 03/15/15 アメリカ	国債証券	1,851,480,000	100.06 1,852,701,976	100.23 1,855,886,522	0.375000 2015/3/15	1.06%
4	US T N/B 0.375 01/15/16 アメリカ	国債証券	1,594,330,000	99.51 1,586,597,499	100.06 1,595,382,257	0.375000 2016/1/15	0.91%
5	US T N/B 0.375 06/15/15 アメリカ	国債証券	1,337,180,000	99.98 1,336,912,564	100.25 1,340,563,065	0.375000 2015/6/15	0.76%
6	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,193,176,000	111.35 1,328,661,134	110.15 1,314,402,681	3.625000 2020/2/15	0.75%
7	US T N/B 4.25 08/15/15 アメリカ	国債証券	1,234,320,000	108.14 1,334,892,393	106.18 1,310,687,378	4.250000 2015/8/15	0.75%
8	FRANCE OAT 3.0 10/25/15 ユーロ	国債証券	1,171,296,000	105.91 1,240,571,465	104.85 1,228,185,846	3.000000 2015/10/25	0.70%
9	US T N/B 4.5 02/15/16 アメリカ	国債証券	1,131,460,000	110.18 1,246,676,571	108.44 1,226,966,538	4.500000 2016/2/15	0.70%
10	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	1,131,460,000	103.17 1,167,367,397	102.96 1,164,951,216	1.750000 2016/5/31	0.66%
11	US T N/B 3.125 10/31/16 アメリカ	国債証券	1,080,030,000	107.50 1,161,129,452	106.78 1,153,266,834	3.125000 2016/10/31	0.66%
12	US T N/B 1.25 10/31/15 アメリカ	国債証券	1,131,460,000	101.74 1,151,215,291	101.68 1,150,502,471	1.250000 2015/10/31	0.66%
13	US T N/B 1.25 08/31/15 アメリカ	国債証券	1,131,460,000	101.76 1,151,378,839	101.59 1,149,484,157	1.250000 2015/8/31	0.66%
14	US T N/B 2.375 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,080,030,000	105.00 1,134,031,500	104.83 1,132,249,450	2.375000 2017/7/31	0.65%
15	FRANCE OAT 3.25 04/25/16 ユーロ	国債証券	1,045,800,000	107.38 1,123,000,956	106.66 1,115,502,570	3.250000 2016/4/25	0.64%
16	US T N/B 1.375 11/30/15 アメリカ	国債証券	1,080,030,000	102.05 1,102,170,615	101.95 1,101,166,187	1.375000 2015/11/30	0.63%
17	ITALY BTPS 3.75 08/01/15 ユーロ	国債証券	1,003,968,000	102.97 1,033,831,167	104.15 1,045,652,751	3.750000 2015/8/1	0.60%
18	US T N/B 2.0 04/30/16 アメリカ	国債証券	977,170,000	103.74 1,013,774,788	103.48 1,011,253,689	2.000000 2016/4/30	0.58%
19	ITALY BTPS 4.0 02/01/17 ユーロ	国債証券	920,304,000	103.71 954,464,150	106.73 982,332,489	4.000000 2017/2/1	0.56%
20	US T N/B 2.625 11/15/20 アメリカ	国債証券	936,026,000	103.80 971,631,709	103.42 968,047,449	2.625000 2020/11/15	0.55%
21	FRANCE OAT 4.25 10/25/17 ユーロ	国債証券	850,584,000	113.47 965,242,723	113.38 964,468,691	4.250000 2017/10/25	0.55%

22	US T N/B 4.0 02/15/15 アメリカ	国債証券	925,740,000	106.01 981,460,290	103.99 962,732,570	4.000000 2015/2/15	0.55%
23	ITALY BTPS 3.75 08/01/16 ユーロ	国債証券	906,360,000	103.58 938,894,838	105.70 958,022,520	3.750000 2016/8/1	0.55%
24	US T N/B 0.625 08/31/17 アメリカ	国債証券	956,598,000	97.70 934,624,943	98.65 943,703,058	0.625000 2017/8/31	0.54%
25	US T N/B 1.25 09/30/15 アメリカ	国債証券	925,740,000	101.78 942,227,429	101.63 940,885,106	1.250000 2015/9/30	0.54%
26	US T N/B 1.0 08/31/16 アメリカ	国債証券	905,168,000	100.65 911,142,108	101.10 915,170,106	1.000000 2016/8/31	0.52%
27	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	822,880,000	112.74 927,731,369	110.92 912,812,555	4.875000 2016/8/15	0.52%
28	US T N/B 3.125 04/30/17 アメリカ	国債証券	822,880,000	107.87 887,681,800	107.26 882,695,147	3.125000 2017/4/30	0.50%
29	FRANCE OAT 5.0 10/25/16 ユーロ	国債証券	766,920,000	113.83 872,992,705	112.68 864,234,478	5.000000 2016/10/25	0.49%
30	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 ユーロ	国債証券	752,976,000	110.53 832,318,754	110.48 831,955,652	3.750000 2017/4/25	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26年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	94.96%
合計	94.96%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年1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	10,629	142,323.99 1,512,761,695	122,112.00 1,297,928,448	- -	3.53%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,363,083	340.16 803,840,698	355.94 841,139,393	- -	2.29%
3	TENCENT HOLDINGS LTD 香港	株式 インターネットソフトウェア・ サービス	98,200	3,404.87 334,358,734	7,195.94 706,641,308	- -	1.92%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	579,000	1,067.85 618,288,964	980.42 567,664,338	- -	1.54%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 香港	株式 商業銀行	7,062,530	79.34 560,408,526	71.36 504,007,565	- -	1.37%
6	AO GAZPROM ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	568,232	776.24 441,086,865	863.50 490,673,843	- -	1.33%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H 香港	株式 商業銀行	6,980,235	67.17 468,865,862	63.68 444,532,077	- -	1.21%
8	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	37,891	5,422.69 205,471,442	10,247.21 388,277,322	- -	1.06%
9	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	3,386,078	94.95 321,527,871	110.42 373,919,175	- -	1.02%
10	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	14,863	18,759.82 278,827,301	22,371.29 332,504,631	- -	0.90%
11	BANK OF CHINA LTD 香港	株式 商業銀行	7,275,200	45.23 329,074,643	43.55 316,904,801	- -	0.86%
12	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,083,769	238.64 258,640,461	287.81 311,920,639	- -	0.85%
13	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	448,550	683.86 306,746,724	677.33 303,817,089	- -	0.83%
14	SBERBANK ADR アメリカ	株式 商業銀行	267,204	1,224.57 327,211,710	1,122.20 299,857,023	- -	0.82%
15	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信サービス	162,066	1,499.56 243,028,194	1,839.37 298,100,715	- -	0.81%
16	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	235,680	1,305.18 307,606,889	1,259.91 296,936,437	- -	0.81%
17	LUKOIL SPON ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	49,540	6,149.35 304,639,273	5,868.16 290,708,795	- -	0.79%
18	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,695,000	177.74 301,285,777	161.52 273,789,960	- -	0.74%

19	SASOL LTD 南アフリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	53,966	3,451.93 186,286,998	4,943.66 266,790,019	- -	0.73%
20	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	400,512	728.18 291,647,635	627.39 251,279,626	- -	0.68%
21	VALE SA-PREF A ブラジル	株式 金属・鉱業	176,496	1,302.39 229,866,653	1,270.15 224,177,594	- -	0.61%
22	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	195,749	1,363.02 266,810,767	1,097.72 214,879,471	- -	0.58%
23	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 香港	株式 保険	726,000	264.05 191,704,112	280.68 203,779,488	- -	0.55%
24	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,473,200	83.49 206,492,689	81.82 202,365,138	- -	0.55%
25	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	145,891	1,317.68 192,238,855	1,376.38 200,802,767	- -	0.55%
26	PETRO CHINA CO LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,978,000	122.17 241,659,371	99.43 196,677,287	- -	0.53%
27	HYUNDAI MOBIS 韓国	株式 自動車部品	6,448	25,713.58 165,801,176	29,574.00 190,693,152	- -	0.52%
28	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	51,520	2,748.95 141,626,136	3,610.88 186,033,052	- -	0.51%
29	ECOPETROL SA SP ADR アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	50,448	4,745.18 239,385,166	3,581.58 180,683,810	- -	0.49%
30	NAVER CORP 韓国	株式 インターネットソフトウェア・ サービス	2,756	36,252.65 99,912,323	64,395.00 177,472,620	- -	0.48%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

種類	投資比率
株式	94.40%
投資信託受益証券	0.88%
投資証券	0.19%
合計	95.46%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成26年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	16.89%
石油・ガス・消耗燃料		10.23%
半導体・半導体製造装置		8.20%
無線通信サービス		5.32%
金属・鉱業		4.82%
保険		3.19%
自動車		2.82%
化学		2.49%
インターネットソフトウェア・サービス		2.40%
食品		2.24%
食品・生活必需品小売り		2.08%
電子装置・機器・部品		1.97%
情報技術サービス		1.91%
コングロマリット		1.76%
メディア		1.75%
各種電気通信サービス		1.67%
不動産管理・開発		1.61%
各種金融サービス		1.56%
飲料		1.54%
電力		1.41%
コンピュータ・周辺機器		1.21%
建設資材		1.11%
医薬品		1.02%
建設・土木		1.02%
機械		0.98%
自動車部品		0.88%
運送インフラ		0.86%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.82%
複合小売り		0.75%
タバコ		0.72%
資本市場		0.64%
専門小売り		0.63%
ガス		0.62%
家庭用耐久財		0.58%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.57%
ホテル・レストラン・レジャー		0.53%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.53%
パーソナル用品		0.52%
家庭用品		0.46%
商社・流通業		0.34%
旅客航空輸送業		0.32%
紙製品・林産品		0.32%
エネルギー設備・サービス		0.29%
電気設備		0.27%

繊維・アパレル・贅沢品	0.25%
水道	0.23%
通信機器	0.19%
各種消費者サービス	0.19%
海運業	0.19%
消費者金融	0.17%
航空宇宙・防衛	0.16%
ソフトウェア	0.15%
不動産投資信託	0.14%
商業サービス・用品	0.14%
陸運・鉄道	0.12%
容器・包装	0.11%
総合公益事業	0.09%
レジャー用品	0.09%
販売	0.09%
建設関連製品	0.08%
航空貨物・物流サービス	0.07%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.01%
合計	94.40%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年1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	1,941,585,360	124.55 2,418,377,829	115.61 2,244,841,566	7.500000 2030/3/31	6.42%
2	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 アメリカ	国債証券	473,156,000	144.07 681,699,507	134.24 635,188,272	11.000000 2018/7/24	1.82%
3	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 アメリカ	国債証券	360,010,000	194.54 700,376,825	168.35 606,076,835	12.750000 2028/6/24	1.73%
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 アメリカ	国債証券	555,444,000	131.14 728,418,519	107.25 595,713,690	6.050000 2040/1/11	1.70%
5	PERU 8.75 11/21/33 アメリカ	国債証券	411,440,000	166.44 684,822,336	140.84 579,472,096	8.750000 2033/11/21	1.66%
6	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 アメリカ	国債証券	648,018,000	109.39 708,880,262	88.65 574,467,957	4.750000 2044/3/8	1.64%
7	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 アメリカ	国債証券	514,300,000	115.56 594,325,080	106.76 549,092,395	5.000000 2020/4/29	1.57%
8	PERU 7.35 07/21/25 アメリカ	国債証券	390,868,000	141.62 553,556,519	124.77 487,725,090	7.350000 2025/7/21	1.39%
9	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 アメリカ	国債証券	401,154,000	137.09 549,959,504	116.40 466,983,371	6.750000 2034/9/27	1.34%
10	BRAZIL 7.125 01/20/37 アメリカ	国債証券	411,440,000	143.51 590,493,545	112.00 460,812,800	7.125000 2037/1/20	1.32%
11	PANAMA 6.7 01/26/36 アメリカ	国債証券	411,440,000	137.92 567,483,763	111.56 459,002,464	6.700000 2036/1/26	1.31%
12	COLOMBIA 7.375 03/18/19 アメリカ	国債証券	370,296,000	129.27 478,684,725	119.50 442,503,720	7.375000 2019/3/18	1.27%
13	TURKEY 7.375 02/05/25 アメリカ	国債証券	401,154,000	133.65 536,142,321	108.75 436,254,975	7.375000 2025/2/5	1.25%
14	TURKEY 7.25 03/15/15 アメリカ	国債証券	411,440,000	110.36 454,081,641	105.37 433,559,014	7.250000 2015/3/15	1.24%
15	COLOMBIA 6.125 01/18/41 アメリカ	国債証券	411,440,000	133.28 548,372,375	105.25 433,040,600	6.125000 2041/1/18	1.24%
16	BRAZIL 4.875 01/22/21 アメリカ	国債証券	401,154,000	119.10 477,774,414	105.25 422,214,585	4.875000 2021/1/22	1.21%
17	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 アメリカ	国債証券	339,438,000	133.41 452,866,865	119.50 405,628,410	6.375000 2034/10/23	1.16%
18	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 アメリカ	国債証券	411,440,000	117.35 482,828,954	97.59 401,524,296	5.625000 2042/4/4	1.15%

19	RUSSIA FOREIGN BOND 3.625 04/29/15 アメリカ	国債証券	380,582,000	104.90 399,254,690	103.26 393,008,002	3.625000 2015/4/29	1.12%
20	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16 アメリカ	国債証券	308,580,000	134.00 413,497,200	126.56 390,538,848	11.375000 2016/9/15	1.12%
21	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19 アメリカ	国債証券	329,152,000	123.25 405,679,840	115.25 379,347,680	5.950000 2019/3/19	1.08%
22	BRAZIL 8.25 01/20/34 アメリカ	国債証券	298,294,000	158.75 473,571,554	125.65 374,806,411	8.250000 2034/1/20	1.07%
23	HUNGARY 6.375 03/29/21 アメリカ	国債証券	349,724,000	109.15 381,741,232	106.75 373,330,370	6.375000 2021/3/29	1.07%
24	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 アメリカ	国債証券	277,722,000	146.82 407,775,612	132.62 368,328,802	7.750000 2031/1/14	1.05%
25	COLOMBIA 7.375 09/18/37 アメリカ	国債証券	298,294,000	150.10 447,749,580	121.25 361,681,475	7.375000 2037/9/18	1.03%
26	PANAMA 5.2 01/30/20 アメリカ	国債証券	329,152,000	113.84 374,729,266	109.00 358,775,680	5.200000 2020/1/30	1.03%
27	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 アメリカ	国債証券	236,578,000	169.12 400,112,542	150.62 356,345,612	9.500000 2030/2/2	1.02%
28	COLOMBIA 4.375 07/12/21 アメリカ	国債証券	349,724,000	114.10 399,035,084	101.50 354,969,860	4.375000 2021/7/12	1.02%
29	BRAZIL 5.625 01/07/41 アメリカ	国債証券	370,296,000	121.22 448,906,755	94.75 350,855,460	5.625000 2041/1/7	1.00%
30	ROMANIA 6.75 02/07/22 アメリカ	国債証券	308,580,000	120.19 370,900,302	113.37 349,852,575	6.750000 2022/2/7	1.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成26年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.66%
合計	96.66%

（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26年1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	ユーロ買/円売2014年04月	買建	301,000	42,264,975	41,947,360	2.59%
		アメリカ・ドル買/円売2014年04月	買建	275,000	28,258,117	28,272,750	1.75%
		オーストラリア・ドル買/円売2014年04月	買建	157,600	14,137,557	14,228,128	0.88%
		イギリス・ポンド買/円売2014年04月	買建	83,000	14,127,481	14,068,500	0.87%
		カナダ・ドル買/円売2014年04月	買建	152,000	14,024,549	13,982,480	0.86%
		ユーロ売/円買2014年04月	売建	301,000	42,518,218	41,947,360	2.59%
		アメリカ・ドル売/円買2014年04月	売建	275,000	28,466,058	28,272,750	1.75%
		オーストラリア・ドル売/円買2014年04月	売建	157,600	14,539,276	14,228,128	0.88%
		イギリス・ポンド売/円買2014年04月	売建	83,000	14,095,536	14,068,500	0.87%
		カナダ・ドル売/円買2014年04月	売建	152,000	14,373,321	13,982,480	0.86%

(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)

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26年1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 2603月	買建	555	6,978,902,561	6,743,250,000	2.13%

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1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 2014年02月	買建	31,200,000	3,189,275,540	3,208,920,000	1.05%
		ユーロ買/円売2014 年02月	買建	7,700,000	1,074,489,920	1,073,611,000	0.35%
		イギリス・ポンド買/円 売2014年02月	買建	3,100,000	524,697,900	525,976,000	0.17%
		オーストラリア・ドル 買/円売2014年02 月	買建	2,700,000	241,397,550	244,998,000	0.08%
		カナダ・ドル買/円売2 014年02月	買建	2,500,000	228,400,500	230,450,000	0.08%
株価指数 先物取引	アメリカ	S & P 500 FUT URE Mar 14	買建	126	5,808,131,332	5,771,248,308	1.88%
	ユーロ	D J EURO STO XX 50 Mar 14	買建	454	1,921,162,488	1,912,467,009	0.62%
	イギリス	FTSE 100 IN DEX FUTURE Mar 14	買建	85	945,224,498	935,607,036	0.31%
	カナダ	S & P / TSE 60 IX FUT Mar 1 4	買建	28	402,215,751	405,370,492	0.13%
	オースト ラリア	S P I 200 FUT URES Mar 14	買建	33	392,353,325	384,760,414	0.13%

(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

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

平成26年1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2014年02月	売建	520,006,100	75,301,927,340	72,504,450,523	41.37%
		アメリカ・ドル売/円買2014年02月	売建	638,600,100	67,112,464,170	65,680,020,285	37.48%
		イギリス・ポンド売/円買2014年02月	売建	78,807,000	13,714,411,818	13,370,395,620	7.63%
		カナダ・ドル売/円買2014年02月	売建	42,096,500	4,160,321,321	3,880,034,405	2.21%
		オーストラリア・ドル売/円買2014年02月	売建	28,320,800	2,656,671,072	2,569,262,976	1.47%
		メキシコ・ペソ売/円買2014年02月	売建	211,160,600	1,689,770,469	1,621,713,408	0.93%
		ポーランド・ズロチ売/円買2014年02月	売建	43,032,600	1,495,240,842	1,415,342,214	0.81%
		デンマーク・クローネ売/円買2014年02月	売建	74,529,400	1,447,048,658	1,392,209,192	0.79%
		スウェーデン・クローナ売/円買2014年02月	売建	62,750,500	1,026,255,931	990,202,890	0.57%
		マレーシア・リングギット売/円買2014年02月	売建	28,100,000	896,019,080	866,042,000	0.49%
		南アフリカ・ランド売/円買2014年02月	売建	80,888,600	807,785,915	742,557,348	0.42%
		シンガポール・ドル売/円買2014年02月	売建	7,875,300	655,482,815	635,457,957	0.36%
		ノルウェー・クローネ売/円買2014年02月	売建	33,197,700	574,373,327	546,434,142	0.31%

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年1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 2 0 1 4 年 0 2 月	買建	6,450,000	659,184,840	663,382,500	1.80%
株価指数先物 取引	アメ リカ	MINI MSCI EMG MKT Ma r 1 4	買建	348	1,717,514,107	1,653,026,030	4.49%

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年1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 2 0 1 4 年 0 2 月	買建	800,000	81,759,360	82,280,000	0.24%

(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26年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記特定期間又は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
第4計算期間末 (平成26年1月14日)	880	880	1.0440	1.0440
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	-
8月末日	51	-	1.0221	-
9月末日	52	-	1.0264	-
10月末日	57	-	1.0339	-
11月末日	267	-	1.0445	-
12月末日	568	-	1.0522	-
平成26年1月末日	1,618	-	1.0350	-

【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
第4計算期間	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
第4計算期間	1.2

(注) 各特定期間又は計算期間の収益率は、特定期間又は計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間又は計算期間の分配金を加算し、当該特定期間又は計算期間の直前の特定期間又は計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1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。

(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
第4計算期間	844,538,323	50,979,041

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

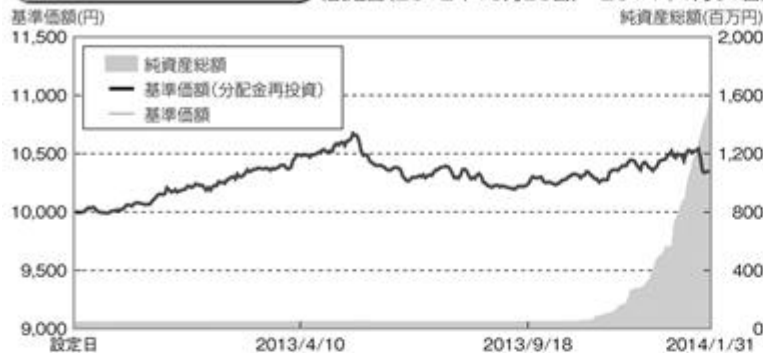
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2014年1月31日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2012年10月26日)~2014年1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として計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日: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
第4期	(2014.01.14)	0円
設定来累計		0円

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(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	36.35%
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	15.81%
3	外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド	0.49%
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	0.15%
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.10%
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	0.09%
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	0.07%
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.04%

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)	6.95
為替予約取引(売建)	△6.95

■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	79.58
内 日本	79.58
地方債証券	6.58
内 日本	6.58
特殊債券	6.82
内 日本	6.82
社債券	6.32
内 日本	6.32
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.71
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	329回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.800000	2023/6/20	1.25%
2	97回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.400000	2016/6/20	1.12%
3	328回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/3/20	1.12%
4	106回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2017/9/20	1.12%
5	306回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.400000	2020/3/20	1.10%

■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	97.90
内 日本	97.90
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.10
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	4.65%
2	三菱UFJフィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.63%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	2.07%
4	三井住友フィナンシャルG	株式	日本	銀行業	2.03%
5	本田技研	株式	日本	輸送用機器	1.98%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.85%
2	輸送用機器	11.62%
3	銀行業	9.57%
4	情報・通信業	7.00%
5	機械	5.27%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.13

○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:2014年1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	94.96
内 ユーロ	41.37
内 アメリカ	37.61
内 イギリス	7.68
内 カナダ	2.25
内 オーストラリア	1.46
内 その他	4.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5.04
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 2.5 04/30/15	国債証券	アメリカ	2.500000	2015/4/30	1.15%
2	US T N/B 0.25 05/15/15	国債証券	アメリカ	0.250000	2015/5/15	1.09%
3	US T N/B 0.375 03/15/15	国債証券	アメリカ	0.375000	2015/3/15	1.06%
4	US T N/B 0.375 01/15/16	国債証券	アメリカ	0.375000	2016/1/15	0.91%
5	US T N/B 0.375 06/15/15	国債証券	アメリカ	0.375000	2015/6/15	0.76%

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)	△94.84

■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	94.98
内 アメリカ	56.53
内 ユーロ	13.36
内 イギリス	9.47
内 カナダ	4.28
内 スイス	3.99
内 その他	7.35
投資信託受益証券	0.27
内 オーストラリア	0.23
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.68
内 アメリカ	1.35
内 イギリス	0.13
内 ユーロ	0.13
内 香港	0.04
内 カナダ	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.07
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	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	1.55%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.42%
3	GOOGLE INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェアサービス	1.06%
4	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.00%
5	GENERAL ELECTRIC CO	株式	アメリカ	コングロマリット	0.89%

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	8.36%
2	商業銀行	7.69%
3	医薬品	6.82%
4	保険	4.12%
5	各種金融サービス	3.13%

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)	1.72
株価指数先物取引(買建)	3.07

■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	99.06
内 日本	99.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	0.94
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	10.60%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	8.26%
3	日本リートファンド投資法人	日本	6.24%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.78%
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.25%

○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:2014年1月31日

■外国リート・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(%)
投資信託受益証券	12.94
内 オーストラリア	9.33
内 シンガポール	3.61
投資証券	86.38
内 アメリカ	67.20
内 ユーロ	7.27
内 イギリス	6.91
内 カナダ	2.79
内 香港	1.84
内 その他	0.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	0.68
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	6.10%
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	ユーロ	3.03%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.91%
4	PROLOGIS INC	アメリカ	2.49%
5	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.37%

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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	96.66
内 アメリカ	96.66
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.34
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	6.42%
2	RUSSIAN FEDERATION 11/07/24/18	国債証券	アメリカ	11.000000	2018/7/24	1.82%
3	RUSSIAN FEDERATION 12/75/06/24/28	国債証券	アメリカ	12.750000	2028/6/24	1.73%
4	UNITED MEXICAN STATES 6/05/01/11/40	国債証券	アメリカ	6.050000	2040/1/11	1.70%
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)	0.24

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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	94.40
内 香港	18.90
内 韓国	15.39
内 台湾	11.53
内 ブラジル	9.72
内 アメリカ	9.28
内 その他	29.58
投資信託受益証券	0.88
内 メキシコ	0.88
投資証券	0.19
内 メキシコ	0.13
内 トルコ	0.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.54
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	3.53%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	2.29%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	香港	インターネットソフトウェアサービス	1.92%
4	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	1.54%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	香港	商業銀行	1.37%

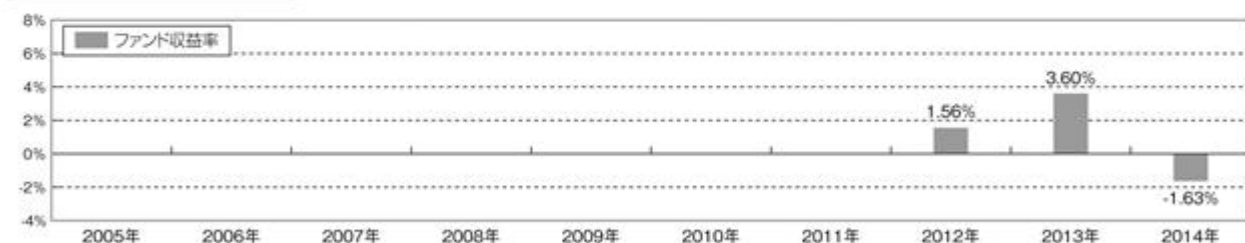
組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	16.89%
2	石油・ガス・消耗燃料	10.23%
3	半導体・半導体製造装置	8.20%
4	無線通信サービス	5.32%
5	金属・鉱業	4.82%

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)	1.80
株価指数先物取引(買建)	4.49

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2014年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（略）

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。

（略）

・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。

（略）

<訂正後>

（略）

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、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」という場合があります。）にはお申込みの受付を行いません。

（略）

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%(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。

（略）

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

- (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) 第2特定期間（平成25年1月12日から平成25年7月11日まで）については、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ヵ月で作成しております。
第4期計算期間（平成25年7月12日から平成26年1月14日まで）については、信託約款第36条の変更により、平成25年7月12日から当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月で作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（平成25年7月12日から平成26年1月14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。
- (4) 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)

	第2特定期間 平成25年7月11日現在	第4期 平成26年1月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,284,414	89,015,304
親投資信託受益証券	44,892,698	844,604,689
派生商品評価勘定	10,861	777,290
未収入金	3,600,000	-
流動資産合計	51,787,973	934,397,283
資産合計	51,787,973	934,397,283
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,454	6,465
未払解約金	-	52,440,000
未払受託者報酬	6,814	46,182
未払委託者報酬	208,515	1,248,062
その他未払費用	637	4,334
流動負債合計	230,420	53,745,043
負債合計	230,420	53,745,043
純資産の部		
元本等		
元本	1 50,000,000	1 843,559,282
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,557,553	37,092,958
（分配準備積立金）	2,513,778	3,482,592
元本等合計	51,557,553	880,652,240
純資産合計	51,557,553	880,652,240
負債純資産合計	51,787,973	934,397,283

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2特定期間 自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日	第4期 自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14日
営業収益		
受取利息	2,086	3,511
有価証券売買等損益	1,910,984	3,077,991
為替差損益	739,928	304,280
営業収益合計	1,173,142	2,777,222
営業費用		
受託者報酬	13,458	46,182
委託者報酬	448,579	1,248,062
その他費用	1,232	4,334
営業費用合計	463,269	1,298,578
営業利益又は営業損失（ ）	709,873	1,478,644
経常利益又は経常損失（ ）	709,873	1,478,644
当期純利益又は当期純損失（ ）	709,873	1,478,644
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（ ）	-	332,658
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	847,680	1,557,553
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	36,533,291
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	36,533,291
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,143,872
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,143,872
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,557,553	37,092,958

(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又は計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間又は計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日及び7月11日を特定期間又は計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を平成26年1月14日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2特定期間 平成25年7月11日現在	第4期 平成26年1月14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	844,538,323円
期中一部解約元本額	- 円	50,979,041円
2 . 受益権の総数	50,000,000口	843,559,282口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2特定期間 自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日	第4期 自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14日
1 . 1 分配金の計算過程	<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。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。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益 (1,131,081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 (41,048,113円) 及び分配準備積立金 (2,351,511円) より分配対象収益は44,530,705円 (1万口当たり527.89円) であります。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>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2特定期間 自 平成25年1月12日 至 平成25年7月11日	第4期 自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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	第2特定期間 平成25年7月11日現在	第4期 平成26年1月14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	第2特定期間 平成25年7月11日現在	第4期 平成26年1月14日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	254,891	3,402,113
合計	254,891	3,402,113

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第2特定期間 平成25年7月11日 現在				第4期 平成26年1月14日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	5,447,546	-	5,451,139	3,593	78,935,969	-	78,165,144	770,825
アメリカ・ドル	560,319	-	557,480	2,839	19,626,113	-	19,412,880	213,233
イギリス・ポンド	1,071,642	-	1,066,562	5,080	9,932,999	-	9,813,600	119,399
オーストラリア・ドル	1,066,813	-	1,067,274	461	9,788,443	-	9,793,344	4,901
カナダ・ドル	1,177,878	-	1,182,588	4,710	9,889,630	-	9,651,240	238,390
ユーロ	1,570,894	-	1,577,235	6,341	29,698,784	-	29,494,080	204,704
合計	5,447,546	-	5,451,139	3,593	78,935,969	-	78,165,144	770,825

(注) 時価の算定方法

1. 特定期間又は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。

特定期間又は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。

特定期間又は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。

- ・ 特定期間又は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。
- ・ 特定期間又は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. 特定期間又は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、特定期間
又は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第2特定期間 平成25年7月11日現在	第4期 平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.0312円	1.0440円
(1万口当たり純資産額)	(10,312円)	(10,440円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成26年1月14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	44,112,076	77,932,804	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	223,737,416	266,135,656	
	J・REITインデックスファンド・マザーファンド	26,829,709	35,399,118	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	41,909,527	95,604,012	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	54,642,091	43,904,920	
	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	95,937,477	115,566,284	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	58,142,043	52,449,936	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	111,323,605	157,611,959	
親投資信託受益証券 合計		656,633,944	844,604,689	
合計		656,633,944	844,604,689	

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7月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,305,997,660	5,895,360,972
株式	2	323,911,813,000	320,248,310,210
派生商品評価勘定		830,393,722	34,567,358
未収入金		10,750,287	1,288,606
未収配当金		256,560,240	273,846,443
流動資産合計		335,315,514,909	326,453,373,589
資産合計		335,315,514,909	326,453,373,589
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	51,798,776
前受金		837,615,000	117,119,000
未払解約金		302,718,000	110,521,000
流動負債合計		1,140,333,000	279,438,776
負債合計		1,140,333,000	279,438,776
純資産の部			
元本等			
元本	1	202,562,042,559	184,628,470,006
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		131,613,139,350	141,545,464,807
元本等合計		334,175,181,909	326,173,934,813
純資産合計		334,175,181,909	326,173,934,813
負債純資産合計		335,315,514,909	326,453,373,589

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7月11日現在	平成26年1月14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	237,448,868,793円 18,162,113,075円 53,048,939,309円	202,562,042,559円 15,070,850,798円 33,004,423,351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	3,855,023,340円	3,900,764,442円
D I A M国内株式パッシブ・ ファンド	1,293,638,430円	1,308,664,287円
D I A M国内株式インデック スファンド< D C 年金 >	37,845,908,406円	37,386,437,254円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 1 安定型	765,154,246円	726,842,761円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 2 安定・成長型	2,859,458,936円	2,805,437,849円
D I A Mバランス・ファンド < D C 年金 > 3 成長型	3,121,839,084円	3,003,831,153円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	394,168,833円	378,149,242円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,336,839,351円	1,257,889,028円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,110,011,421円	1,079,326,406円
マネックス資産設計ファンド < 隔月分配型 >	121,688,174円	109,772,183円
マネックス資産設計ファンド < 育成型 >	1,505,002,365円	1,356,765,982円

マネックス資産設計ファン ド エボリューション	19,921,906円	19,179,120円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国10)	447,178円	7,069,809円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国20)	938,056円	9,887,126円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国30)	1,909,405円	22,348,148円
投資のソムリエ	1,963,761円	44,112,076円
クルーズコントロール	731,997円	86,707,019円
投資のソムリエ<DC年金>	-円	508,660円
D I A M 8資産バランス ファンドN<DC年金>	-円	580,141円
D I A Mワールドバランス2 5VA(適格機関投資家限 定)	171,780,489円	147,803,854円
D I A Mグローバル・バラ ンスファンド25VA(適格機 関投資家限定)	6,634,581,043円	4,907,354,834円
D I A Mグローバル・バラ ンスファンド50VA(適格機 関投資家限定)	1,307,919,165円	978,877,750円
D I A M国際分散バランス ファンド30VA(適格機関 投資家限定)	160,569,000円	126,015,339円
D I A M国際分散バランス ファンド50VA(適格機関 投資家限定)	612,152,345円	419,728,031円
D I A M国内重視バランス ファンド30VA(適格機関 投資家限定)	147,490,509円	108,039,554円
D I A M国内重視バランス ファンド50VA(適格機関 投資家限定)	231,173,116円	179,391,499円
D I A M世界バランスファン ド40VA(適格機関投資家 限定)	16,058,829,754円	14,556,133,765円
D I A M世界バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	5,340,516,978円	4,839,311,271円
D I A Mバランスファンド2 5VA(適格機関投資家限 定)	3,846,338,105円	3,446,603,030円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家 限定)	2,590,147,425円	2,349,448,692円
D I A Mバランスファンド5 0VA(適格機関投資家限 定)	6,156,965,800円	5,676,930,412円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関 投資家限定)	856,350,813円	669,358,539円

D I A Mグローバル・アセ ット・バランスV A 2 (適格機 関投資家限定)	1,897,386,268円	1,678,633,192円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	1,812,507,661円	1,533,748,826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)	9,967,969,824円	7,967,750,812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)	113,023,493円	92,608,020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)	3,436,454,466円	2,965,892,961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)	7,511,813,682円	7,262,788,775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)	340,256,026円	280,901,694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)	30,814,423,202円	27,214,805,359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)	1,715,757,687円	1,420,545,223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)	3,648,045,066円	3,195,419,506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)	18,784,738,540円	16,799,282,422円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	89,536,768円	39,341円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	111,722,556円	111,634,058円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	149,141円	83,660,397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)	16,600,911,191円	14,880,840,688円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	211,148,382円	185,393,173円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	68,311,460円	55,660,343円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	143,194,770円	114,554,615円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	79,134円	4,903,437円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	125,386円	121,576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)	1,034,935,394円		952,190,469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)	2,563,890,274円		2,443,408,346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)	3,341,912,869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(130 9)(適格機関投資家限定)	4,289,888円		132,504,648円	
	計	202,562,042,559円		184,628,470,006円	
2 .	受益権の総数	202,562,042,559口		184,628,470,006口	
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,190,000,000円		株式 3,072,000,000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25年1月12日 至 平成25年7月11日	自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14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	60,857,375,899	74,092,922,661
合計	60,857,375,899	74,092,922,661

（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25年2月8日から平成25年7月11日まで及び平成25年2月8日から平成26年1月14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7月11日 現在				平成26年1月14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	9,287,980,000	-	10,118,875,000	830,895,000	5,812,732,000	-	5,795,760,000	16,972,000
合計	9,287,980,000	-	10,118,875,000	830,895,000	5,812,732,000	-	5,795,760,000	16,972,000

（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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.6497円	1.7667円
（1万口当たり純資産額）	（16,497円）	（17,667円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年1月14日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	81,000	266	21,546,000	
日本水産	246,700	230	56,741,000	
マルハニチロホールディングス	386,000	178	68,708,000	
ハウスイ	15,000	133	1,995,000	
サカタのタネ	29,700	1,317	39,114,900	
ホクト	22,400	1,929	43,209,600	
ショーボンドHD	17,800	4,830	85,974,000	
ミライト・ホールディングス	56,800	929	52,767,200	
タマホーム	8,500	957	8,134,500	
住石ホールディングス	56,800	141	8,008,800	
日鉄鉱業	51,000	495	25,245,000	
三井松島	132,000	164	21,648,000	
国際石油開発帝石	972,300	1,256	1,221,208,800	
日本海洋掘削	5,000	5,980	29,900,000	
石油資源開発	28,500	3,960	112,860,000	
K&Oエナジーグループ	10,500	1,472	15,456,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	2,007	3,411,900	
安藤・間	130,500	369	48,154,500	
東急建設	71,200	497	35,386,400	
コムシスホールディングス	97,200	1,528	148,521,600	
ミサワホーム	21,500	1,563	33,604,500	
高松コンストラクションGP	15,200	1,857	28,226,400	
東建コーポレーション	7,460	5,020	37,449,200	
ヤマウラ	10,100	290	2,929,000	
大成建設	1,011,000	462	467,082,000	
大林組	600,000	583	349,800,000	
清水建設	612,000	539	329,868,000	
飛鳥建設	123,300	173	21,330,900	
長谷工コーポレーション	266,900	812	216,722,800	
松井建設	2,000	435	870,000	
銭高組	22,000	281	6,182,000	
鹿島建設	879,000	390	342,810,000	
不動テトラ	142,400	178	25,347,200	
大末建設	77,000	124	9,548,000	
鉄建建設	122,000	304	37,088,000	
日鉄住金テックスエンジ	33,000	416	13,728,000	
西松建設	262,000	374	97,988,000	
三井住友建設	538,100	122	65,648,200	
大豊建設	57,000	423	24,111,000	
前田建設	123,000	669	82,287,000	
佐田建設	69,000	137	9,453,000	
ナカノフード建設	15,900	246	3,911,400	
奥村組	177,000	477	84,429,000	

大和小田急建設	11,500	268	3,082,000	
東鉄工業	24,100	1,962	47,284,200	
イチケン	23,000	181	4,163,000	
浅沼組	61,000	164	10,004,000	
戸田建設	233,000	368	85,744,000	
熊谷組	191,000	296	56,536,000	
青木あすなる建設	12,400	590	7,316,000	
北野建設	43,000	256	11,008,000	
植木組	25,000	214	5,350,000	
三井ホーム	26,000	504	13,104,000	
矢作建設	27,300	891	24,324,300	
ピーエス三菱	15,500	483	7,486,500	
大東建託	75,900	9,761	740,859,900	
新日本建設	24,100	328	7,904,800	
N I P P O	46,000	1,671	76,866,000	
東亜道路	38,000	511	19,418,000	
前田道路	63,000	1,737	109,431,000	
日本道路	54,000	565	30,510,000	
東亜建設	175,000	246	43,050,000	
若築建設	109,000	133	14,497,000	
東洋建設	62,300	357	22,241,100	
五洋建設	238,000	379	90,202,000	
大林道路	24,000	598	14,352,000	
世紀東急	104,000	140	14,560,000	
福田組	30,000	467	14,010,000	
住友林業	137,700	1,200	165,240,000	
日本基礎技術	22,400	367	8,220,800	
日成ビルド工業	52,000	246	12,792,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	91,000	138	12,558,000	
巴コーポレーション	25,300	481	12,169,300	
パナホーム	75,000	770	57,750,000	
大和ハウス	549,000	1,917	1,052,433,000	
ライト工業	41,900	746	31,257,400	
積水ハウス	525,200	1,484	779,396,800	
日特建設	24,600	396	9,741,600	
北陸電気工事	10,000	408	4,080,000	
ユアテック	32,000	332	10,624,000	
西部電気工業	17,000	466	7,922,000	
四電工	6,000	366	2,196,000	
中電工	29,000	1,846	53,534,000	
関電工	91,000	580	52,780,000	
きんでん	133,000	1,036	137,788,000	
東京エネシス	21,000	533	11,193,000	
トーエネック	29,000	653	18,937,000	
住友電設	13,900	1,536	21,350,400	
日本電設工業	33,000	1,386	45,738,000	
協和エクシオ	78,400	1,342	105,212,800	
新日本空調	17,300	635	10,985,500	
日本工営	63,000	452	28,476,000	
N D S	31,000	291	9,021,000	

九電工	37,000	809	29,933,000
三機工業	43,000	675	29,025,000
日 揮	201,000	4,011	806,211,000
中外炉工業	60,000	253	15,180,000
ヤマト	16,000	357	5,712,000
太平電業	29,000	622	18,038,000
高砂熱学	57,200	932	53,310,400
三晃金属	23,000	267	6,141,000
NEC ネットエスアイ	19,400	2,506	48,616,400
朝日工業社	24,000	387	9,288,000
明星工業	29,000	470	13,630,000
アタカ大機	12,000	524	6,288,000
大 気 社	26,600	2,258	60,062,800
ダイダン	25,000	573	14,325,000
日比谷総合設備	24,600	1,305	32,103,000
東芝プラントシステム	32,000	1,514	48,448,000
日本製粉	123,000	500	61,500,000
日清製粉G本社	199,500	1,034	206,283,000
日東富士製粉	8,000	318	2,544,000
昭和産業	83,000	325	26,975,000
鳥越製粉	16,800	663	11,138,400
協同飼料	73,000	113	8,249,000
中部飼料	19,700	574	11,307,800
日本配合飼料	65,000	121	7,865,000
東洋精糖	34,000	103	3,502,000
日本甜菜糖	105,000	189	19,845,000
三井製糖	79,000	433	34,207,000
ネクスト	15,700	1,085	17,034,500
日本M & Aセンター	9,600	7,370	70,752,000
ノバレーゼ	5,000	761	3,805,000
アコーディア・ゴルフ	76,000	1,428	108,528,000
タケエイ	12,900	1,266	16,331,400
パソナグループ	18,600	719	13,373,400
リンクアンドモチベーション	243	24,210	5,883,030
GCA サヴィアン	11,100	996	11,055,600
エス・エム・エス	10,500	2,298	24,129,000
テンプホールディングス	40,800	2,918	119,054,400
リニカル	3,600	1,158	4,168,800
クックパッド	11,000	3,145	34,595,000
エスクリ	6,500	964	6,266,000
アイ・ケイ・ケイ	4,400	795	3,498,000
森永製菓	197,000	219	43,143,000
中 村 屋	48,000	398	19,104,000
江崎グリコ	72,000	1,255	90,360,000
名糖産業	9,300	1,051	9,774,300
不 二 家	116,000	193	22,388,000
山崎製パン	147,000	1,086	159,642,000
第一屋製パン	29,000	141	4,089,000
モロゾフ	33,000	318	10,494,000
亀田製菓	11,200	2,841	31,819,200

カルビー	73,300	2,437	178,632,100	
森永乳業	170,000	308	52,360,000	
六甲バター	9,600	820	7,872,000	
ヤクルト	117,000	5,080	594,360,000	
明治ホールディングス	59,200	6,600	390,720,000	
雪印メグミルク	43,200	1,296	55,987,200	
プリマハム	101,000	193	19,493,000	
日本ハム	139,000	1,775	246,725,000	
伊藤ハム	110,000	462	50,820,000	
林兼産業	67,000	83	5,561,000	
丸大食品	97,000	305	29,585,000	
米 久	7,000	872	6,104,000	
S Foods	13,000	1,077	14,001,000	
学情	6,100	952	5,807,200	
スタジオアリス	7,700	1,382	10,641,400	
シミックホールディングス	7,100	1,281	9,095,100	
システナ	17,200	843	14,499,600	
NECフィールドディング	15,100	1,237	18,678,700	
デジタルアーツ	4,800	941	4,516,800	
新日鉄住金SOL	14,700	2,334	34,309,800	
総合警備保障	67,900	2,017	136,954,300	
日本駐車場開発	1,935	8,430	16,312,050	
コア	6,700	766	5,132,200	
カクコム	113,100	2,024	228,914,400	
アイロムホールディングス	4,200	1,020	4,284,000	
ルネサンス	8,600	800	6,880,000	
オプト	7,600	943	7,166,800	
新日本科学	13,600	1,267	17,231,200	
ツクイ	20,200	915	18,483,000	
総合臨床HLDGS	5,600	572	3,203,200	
キャリアデザインセンター	39	100,000	3,900,000	
エムスリー	617	265,600	163,875,200	
ベストブライダル	11,000	649	7,139,000	
アウトソーシング	5,900	1,275	7,522,500	
ディー・エヌ・エー	100,300	2,350	235,705,000	
博報堂DYHLDGS	258,400	812	209,820,800	
ぐるなび	13,000	3,110	40,430,000	
一休	133	146,400	19,471,200	
ジャパンベストレスキューS	118	64,700	7,634,600	
ジェイコムホールディングス	3,500	781	2,733,500	
PGMホールディングス	26,400	969	25,581,600	
バリューコマース	11,500	1,415	16,272,500	
サッポロホールディングス	328,000	402	131,856,000	
アサヒグループホールディン	402,100	2,769	1,113,414,900	
麒麟HD	856,000	1,402	1,200,112,000	
宝ホールディングス	157,000	885	138,945,000	
オエノンホールディングス	49,000	235	11,515,000	
養 命 酒	3,000	808	2,424,000	
コカ・コーラウエスト	61,700	2,071	127,780,700	
コカ・コーライーストジャパン	41,400	2,130	88,182,000	

サントリー食品インター	102,700	3,290	337,883,000	
ダイドードリンコ	9,300	4,360	40,548,000	
伊藤園	54,500	2,151	117,229,500	
キーコーヒー	19,200	1,580	30,336,000	
ユニカフェ	6,100	635	3,873,500	
ジャパンフーズ	2,800	1,258	3,522,400	
日清オイリオグループ	87,000	340	29,580,000	
不二製油	48,700	1,522	74,121,400	
J-オイルミルズ	85,000	288	24,480,000	
ローソン	72,200	7,920	571,824,000	
サンエー	13,300	3,105	41,296,500	
麒麟堂	6,600	698	4,606,800	
ダイユーエイト	3,600	733	2,638,800	
カワチ薬品	12,300	1,958	24,083,400	
エービーシー・マート	25,000	4,685	117,125,000	
ハードオフコーポレーション	8,600	895	7,697,000	
高千穂交易	7,600	1,010	7,676,000	
アスクル	15,100	3,115	47,036,500	
ゲオホールディングス	30,100	957	28,805,700	
アダストリアホールディング	13,500	3,610	48,735,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	23,000	271	6,233,000	
伊藤忠食品	4,500	3,450	15,525,000	
くらコーポレーション	10,400	1,739	18,085,600	
キャンドウ	8,500	1,510	12,835,000	
エレマテック	8,300	1,663	13,802,900	
パル	10,300	2,483	25,574,900	
JALUX	5,400	1,187	6,409,800	
エディオン	80,700	595	48,016,500	
あらた	39,000	330	12,870,000	
サーラコーポレーション	15,400	499	7,684,600	
トーマンデバイス	2,800	1,769	4,953,200	
J Pホールディングス	31,500	425	13,387,500	
あみやき亭	3,100	3,650	11,315,000	
東京エレクトロンデバイス	3,700	1,594	5,897,800	
ひらまつ	18,400	685	12,604,000	
双日	1,181,600	186	219,777,600	
ゲンキー	1,600	2,164	3,462,400	
アルフレッサホールディングス	52,100	5,650	294,365,000	
大黒天物産	3,600	2,784	10,022,400	
ハニーズ	13,930	955	13,303,150	
キッコーマン	163,000	1,853	302,039,000	
味の素	477,000	1,428	681,156,000	
キューピー	101,800	1,477	150,358,600	
ハウス食品G本社	70,500	1,550	109,275,000	
カゴメ	77,500	1,713	132,757,500	
焼津水産化工	10,000	908	9,080,000	
アリアケジャパン	18,300	2,591	47,415,300	
ニチレイ	213,000	491	104,583,000	
横浜冷凍	44,000	786	34,584,000	
東洋水産	98,000	3,145	308,210,000	

日清食品HD	78,200	4,380	342,516,000
永谷園	7,000	921	6,447,000
フジッコ	20,000	1,196	23,920,000
ロックフィールド	10,700	1,816	19,431,200
日本たばこ産業	1,108,300	3,172	3,515,527,600
ケンコーマヨネーズ	7,200	910	6,552,000
わらべや日洋	11,900	2,020	24,038,000
なとり	9,900	1,027	10,167,300
片倉工業	21,500	1,133	24,359,500
グンゼ	152,000	262	39,824,000
ヒューリック	297,000	1,365	405,405,000
神栄	25,000	252	6,300,000
山下医科器械	1,500	1,716	2,574,000
ラサ商事	8,900	489	4,352,100
アルベン	13,400	1,889	25,312,600
クオール	12,900	603	7,778,700
アルコニックス	5,400	2,294	12,387,600
神戸物産	1,800	2,425	4,365,000
ジェイアイエヌ	9,000	4,720	42,480,000
ビックカメラ	668	58,200	38,877,600
DCMホールディングス	86,800	709	61,541,200
MonotaRO	27,300	2,251	61,452,300
あいホールディングス	31,500	1,361	42,871,500
J. フロントリテイリング	416,000	706	293,696,000
ドトール・日レスHD	30,900	1,748	54,013,200
マツモトキヨシHLDGS	36,300	3,710	134,673,000
ブロンコピラー	2,900	1,901	5,512,900
スタートトゥデイ	54,900	2,441	134,010,900
物語コーポレーション	2,600	3,145	8,177,000
ココカラファイン	18,300	2,699	49,391,700
三越伊勢丹HD	350,100	1,365	477,886,500
東洋紡	790,000	186	146,940,000
ユニチカ	516,000	71	36,636,000
富士紡ホールディングス	98,000	233	22,834,000
日清紡ホールディングス	119,000	908	108,052,000
倉敷紡績	193,000	194	37,442,000
ダイワボウHD	160,000	211	33,760,000
シキボウ	109,000	136	14,824,000
日東紡績	137,000	489	66,993,000
トヨタ紡織	62,500	1,256	78,500,000
ウエルシアHD	6,400	5,810	37,184,000
クリエイトSDH	7,400	3,540	26,196,000
バイタルKSKHD	33,100	709	23,467,900
八洲電機	14,200	437	6,205,400
UKCホールディングス	11,300	1,742	19,684,600
丸善CHIHD	15,400	309	4,758,600
TOKAIホールディングス	86,100	346	29,790,600
エー・ピーカンパニー	1,600	1,999	3,198,400
三洋貿易	6,300	971	6,117,300
日本毛織	59,000	751	44,309,000

大東紡織	30,000	83	2,490,000
トーア紡コーポレーション	82,000	82	6,724,000
ダイドーリミテッド	21,300	687	14,633,100
東京建物不動産販	9,500	450	4,275,000
三栄建築設計	5,400	874	4,719,600
野村不動産HLDGS	116,300	2,271	264,117,300
プレサンスコーポレーション	3,200	2,923	9,353,600
常和ホールディングス	6,200	3,360	20,832,000
フージャースHD	26,300	712	18,725,600
オープンハウス	7,000	2,327	16,289,000
東急不動産HD	390,600	899	351,149,400
飯田GHD	77,200	1,960	151,312,000
帝国繊維	19,600	1,218	23,872,800
ブックオフコーポレーション	9,700	710	6,887,000
日本コークス工業	151,900	139	21,114,100
ミタチ産業	3,800	545	2,071,000
あさひ	10,200	1,487	15,167,400
日本調剤	2,260	2,763	6,244,380
コスモス薬品	8,900	12,270	109,203,000
シップヘルスケアHD	25,200	4,060	102,312,000
一六堂	2,800	476	1,332,800
ソフトクリエイトHD	5,800	1,032	5,985,600
セブン&アイ・HLDGS	736,800	4,267	3,143,925,600
クリエイト・レストランツ・ホール	2,200	2,975	6,545,000
ツルハホールディングス	17,300	9,770	169,021,000
サンマルクホールディングス	5,700	5,010	28,557,000
フェリシモ	5,000	1,030	5,150,000
トリドール	15,200	934	14,196,800
クスリのアオキ	2,600	5,880	15,288,000
帝人	765,000	235	179,775,000
東レ	1,356,000	691	936,996,000
クラレ	297,100	1,192	354,143,200
旭化成	1,166,000	830	967,780,000
サカイオーベックス	50,000	201	10,050,000
稲葉製作所	8,000	1,293	10,344,000
宮地エンジニアリングG	62,000	279	17,298,000
トーカロ	11,400	1,597	18,205,800
アルファCO	6,600	1,042	6,877,200
SUMCO	114,300	861	98,412,300
川田テクノロジーズ	3,900	2,690	10,491,000
住江織物	52,000	308	16,016,000
日本フェルト	11,000	464	5,104,000
イチカワ	13,000	318	4,134,000
日本バイリン	20,000	626	12,520,000
エコナックホールディングス	56,000	54	3,024,000
日東製網	23,000	184	4,232,000
芦森工業	42,000	140	5,880,000
アツギ	160,000	122	19,520,000
ダイニック	36,000	190	6,840,000
共和レザー	12,800	464	5,939,200

セーレン	50,300	836	42,050,800	
東海染工	28,000	125	3,500,000	
小松精練	32,000	548	17,536,000	
ワコールホールディングス	112,000	1,072	120,064,000	
ホギメディカル	11,800	5,530	65,254,000	
レナウン	46,600	141	6,570,600	
クラウディア	2,400	1,153	2,767,200	
T S Iホールディングス	90,000	675	60,750,000	
I Tホールディングス	63,200	1,572	99,350,400	
ネオス	3,500	1,426	4,991,000	
電算システム	4,200	1,372	5,762,400	
グリー	91,500	1,099	100,558,500	
コーエーテックモHD	34,800	1,212	42,177,600	
三菱総合研究所	6,800	2,124	14,443,200	
ボルテージ	2,600	1,221	3,174,600	
電算	1,300	2,070	2,691,000	
ヒト・コミュニケーションズ	1,900	1,881	3,573,900	
ブレインパッド	1,400	1,615	2,261,000	
K L a b	11,800	806	9,510,800	
ポルトゥウィン・ピットクル	10,800	1,933	20,876,400	
イーブックイニシアティブ	2,500	2,260	5,650,000	
ネクソン	146,000	934	136,364,000	
アイスタイル	5,000	602	3,010,000	
エムアップ	3,200	865	2,768,000	
エイチーム	1,600	6,210	9,936,000	
ブロードリーフ	17,400	1,910	33,234,000	
ハーツユナイテッドグループ	4,000	2,617	10,468,000	
特種東海製紙	108,000	212	22,896,000	
ドワンゴ	15,900	2,725	43,327,500	
ベリサーブ	1,100	1,779	1,956,900	
マクロミル	28,100	783	22,002,300	
ティーガイア	17,500	1,251	21,892,500	
豆蔵ホールディングス	10,400	474	4,929,600	
テクマトリックス	5,800	618	3,584,400	
G M Oペイメントゲートウェイ	6,700	4,670	31,289,000	
ザッパラス	9,900	790	7,821,000	
インターネットイニシアティブ	25,900	2,785	72,131,500	
ビットアイル	13,300	823	10,945,900	
S R Aホールディングス	8,500	1,356	11,526,000	
朝日ネット	16,300	564	9,193,200	
王子ホールディングス	826,000	511	422,086,000	
日本製紙	96,600	1,889	182,477,400	
三菱製紙	266,000	92	24,472,000	
北越紀州製紙	127,500	457	58,267,500	
中越パルプ	71,000	218	15,478,000	
巴川製紙	29,000	197	5,713,000	
大王製紙	64,000	1,001	64,064,000	
レンゴー	150,000	609	91,350,000	
トーモク	59,000	355	20,945,000	
ザ・パック	13,300	1,811	24,086,300	

コ - プケミカル	29,000	141	4,089,000	
昭和電工	1,245,000	148	184,260,000	
住友化学	1,376,000	428	588,928,000	
日本化成	37,000	149	5,513,000	
住友精化	39,000	911	35,529,000	
日産化学	128,200	1,553	199,094,600	
ラサ工業	71,000	195	13,845,000	
クレハ	131,000	513	67,203,000	
多木化学	8,000	755	6,040,000	
テイカ	32,000	307	9,824,000	
石原産業	337,000	127	42,799,000	
片倉チツカリン	13,000	268	3,484,000	
日本曹達	120,000	618	74,160,000	
東ソー	500,000	461	230,500,000	
トクヤマ	291,000	440	128,040,000	
セントラル硝子	179,000	335	59,965,000	
東亜合成	220,000	442	97,240,000	
ダイソー	75,000	363	27,225,000	
関東電化	45,000	263	11,835,000	
電気化学	374,000	406	151,844,000	
イビデン	108,700	2,000	217,400,000	
信越化学	335,200	5,750	1,927,400,000	
日本カ - バイド	55,000	302	16,610,000	
堺 化 学	76,000	325	24,700,000	
エア・ウォーター	154,000	1,443	222,222,000	
大陽日酸	240,000	723	173,520,000	
日本化学工業	70,000	144	10,080,000	
日本パ - カライジング	44,000	2,185	96,140,000	
高压ガス	28,000	594	16,632,000	
チタン工業	22,000	276	6,072,000	
四国化成	27,000	792	21,384,000	
戸田工業	34,000	290	9,860,000	
ステラ ケミファ	9,600	1,610	15,456,000	
保土谷化学	57,000	212	12,084,000	
日本触媒	158,000	1,165	184,070,000	
大日精化	72,000	492	35,424,000	
カネカ	233,000	674	157,042,000	
協和発酵キリン	224,000	1,076	241,024,000	
三菱瓦斯化学	295,000	779	229,805,000	
三井化学	850,000	240	204,000,000	
J S R	171,500	1,982	339,913,000	
東京応化工業	36,200	2,167	78,445,400	
大阪有機化学	12,700	456	5,791,200	
三菱ケミカルH L D G S	1,168,500	463	541,015,500	
日本合成化学	38,000	967	36,746,000	
ダイセル	243,000	843	204,849,000	
住友ベ - クライト	146,000	380	55,480,000	
積水化学	384,000	1,253	481,152,000	
日本ゼオン	148,000	955	141,340,000	
アイカ工業	52,600	2,108	110,880,800	

宇部興産	942,000	224	211,008,000
積水樹脂	26,400	1,415	37,356,000
タキロン	44,000	446	19,624,000
旭有機材	66,000	220	14,520,000
日立化成	80,800	1,584	127,987,200
ニチバン	19,000	366	6,954,000
リケンテクノス	30,000	578	17,340,000
大倉工業	45,000	357	16,065,000
積水化成品	53,000	280	14,840,000
群栄化学	50,000	473	23,650,000
タイガス ポリマー	9,400	455	4,277,000
ミライアル	4,700	1,664	7,820,800
日本化薬	132,000	1,405	185,460,000
カーリットホールディングス	15,100	492	7,429,200
イーピーエス	200	127,000	25,400,000
パナソニック インフォシス	3,600	3,180	11,448,000
フェイス	5,300	1,115	5,909,500
アミューズ	5,200	2,054	10,680,800
野村総合研究所	99,700	3,265	325,520,500
ドリームインキュベータ	49	165,800	8,124,200
サイバネットシステム	15,100	355	5,360,500
T A C	11,600	400	4,640,000
ケネディクス	220,100	489	107,628,900
電通	175,800	4,020	706,716,000
インテージホールディングス	9,600	1,319	12,662,400
テイクアンドグヴィーズ	8,000	2,190	17,520,000
ぴあ	5,600	1,840	10,304,000
イオンファンタジー	6,100	1,565	9,546,500
ソースネクスト	9,000	899	8,091,000
ネクシィーズ	6,800	820	5,576,000
メディカルシステムネットワーク	14,500	494	7,163,000
日本精化	15,800	641	10,127,800
A D E K A	80,600	1,149	92,609,400
日油	155,000	749	116,095,000
ミヨシ油脂	71,000	159	11,289,000
新日本理化	22,800	277	6,315,600
ハリマ化成グループ	16,200	475	7,695,000
花 王	486,100	3,207	1,558,922,700
第一工業製薬	35,000	251	8,785,000
三洋化成	59,000	739	43,601,000
武田薬品	700,200	4,782	3,348,356,400
アステラス製薬	430,500	6,027	2,594,623,500
大日本住友製薬	132,400	1,760	233,024,000
塩野義製薬	291,900	2,224	649,185,600
田辺三菱製薬	155,600	1,534	238,690,400
わかもと製薬	7,000	272	1,904,000
あすか製薬	22,000	787	17,314,000
日本新薬	43,000	2,032	87,376,000
バイオフェルミン製薬	3,100	2,508	7,774,800
中外製薬	186,100	2,225	414,072,500

科研製薬	68,000	1,580	107,440,000	
エーザイ	230,100	3,926	903,372,600	
ロート製薬	79,000	1,669	131,851,000	
小野薬品	84,900	9,790	831,171,000	
久光製薬	58,000	5,010	290,580,000	
有機合成薬品	13,000	285	3,705,000	
持田製薬	13,800	6,200	85,560,000	
参天製薬	68,700	4,780	328,386,000	
扶桑薬品	63,000	336	21,168,000	
日本ケミファ	26,000	474	12,324,000	
ツムラ	54,900	2,683	147,296,700	
日医工	43,800	1,548	67,802,400	
テルモ	136,800	4,785	654,588,000	
みらかホールディングス	49,000	5,000	245,000,000	
キッセイ薬品工業	34,700	2,538	88,068,600	
生化学工業	39,100	1,364	53,332,400	
栄研化学	14,600	1,910	27,886,000	
日水製薬	7,900	1,094	8,642,600	
鳥居薬品	12,800	3,075	39,360,000	
JCRファーマ	10,800	2,101	22,690,800	
東和薬品	9,500	4,245	40,327,500	
富士製薬工業	5,400	1,910	10,314,000	
沢井製薬	29,300	6,910	202,463,000	
ゼリア新薬工業	29,500	2,537	74,841,500	
第一三共	589,400	1,934	1,139,899,600	
キョーリン製薬HD	49,900	2,324	115,967,600	
大幸薬品	8,900	2,650	23,585,000	
ダイト	6,200	1,527	9,467,400	
大塚ホールディングス	370,900	3,105	1,151,644,500	
大正製薬HD	45,000	7,200	324,000,000	
大日本塗料	108,000	171	18,468,000	
日本ペイント	162,000	1,783	288,846,000	
関西ペイント	227,000	1,469	333,463,000	
神東塗料	11,000	230	2,530,000	
中国塗料	54,000	578	31,212,000	
日本特殊塗料	14,700	635	9,334,500	
藤倉化成	23,800	662	15,755,600	
太陽ホールディングス	15,300	3,340	51,102,000	
DIC	663,000	309	204,867,000	
サカタインクス	38,300	965	36,959,500	
東洋インキSCホールディン	168,000	514	86,352,000	
T&K TOKA	6,800	2,317	15,755,600	
アルプス技研	7,800	1,019	7,948,200	
サニックス	27,200	990	26,928,000	
ダイオーズ	3,600	893	3,214,800	
日本空調サービス	4,700	1,203	5,654,100	
オリエンタルランド	50,400	15,025	757,260,000	
ダスキン	50,500	2,003	101,151,500	
パーク24	92,000	2,073	190,716,000	
明光ネットワークジャパン	18,600	1,101	20,478,600	

ファルコSDホールディングス	9,600	1,227	11,779,200	
クレスコ	4,200	972	4,082,400	
フジ・メディア・HD	170,300	2,055	349,966,500	
秀英予備校	4,000	334	1,336,000	
田谷	3,700	765	2,830,500	
ラウンドワン	53,000	927	49,131,000	
リゾートトラスト	63,100	1,767	111,497,700	
オービック	60,700	2,971	180,339,700	
TDCソフトウェアエンジニア	4,100	826	3,386,600	
ヤフー	1,275,000	623	794,325,000	
ビー・エム・エル	12,200	3,580	43,676,000	
ワタベウェディング	6,400	685	4,384,000	
トレンドマイクロ	77,700	3,300	256,410,000	
もしもしホットライン	34,700	1,121	38,898,700	
リソー教育	21,000	591	12,411,000	
日本オラクル	35,200	3,760	132,352,000	
アルファシステムズ	5,800	1,433	8,311,400	
フューチャーアーキテクト	21,300	576	12,268,800	
シーエーシー	11,000	927	10,197,000	
ソフトバンク・テクノ	4,200	1,605	6,741,000	
トーセ	4,400	789	3,471,600	
ユー・エス・エス	225,800	1,437	324,474,600	
オービックビジネスC	8,900	3,385	30,126,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	19,900	4,165	82,883,500	
アイティフォー	19,800	490	9,702,000	
東京個別指導学院	9,700	247	2,395,900	
東計電算	3,300	1,514	4,996,200	
エクスネット	1,800	1,383	2,489,400	
テー・オー・ダブリュー	6,600	668	4,408,800	
大塚商会	15,800	12,460	196,868,000	
総合メディカル	4,300	4,100	17,630,000	
サイボウズ	26,500	462	12,243,000	
ソフトブレーン	24,700	143	3,532,100	
アグレックス	4,200	1,007	4,229,400	
セントラルスポーツ	5,900	1,538	9,074,200	
パラカ	4,600	788	3,624,800	
電通国際情報S	10,900	1,132	12,338,800	
イーエムシステムズ	2,400	2,044	4,905,600	
ウェザーニューズ	4,600	2,505	11,523,000	
C I J	16,800	419	7,039,200	
WOWOW	5,400	3,520	19,008,000	
フルキャストホールディングス	18,000	264	4,752,000	
富士フイルムHLDGS	427,800	2,969	1,270,138,200	
コニカミノルタ	471,500	1,086	512,049,000	
資生堂	332,500	1,613	536,322,500	
ライオン	216,000	570	123,120,000	
高砂香料	67,000	600	40,200,000	
マンダム	18,700	3,345	62,551,500	
ミルボン	11,900	4,140	49,266,000	
ファンケル	43,500	1,141	49,633,500	

コーセー	30,200	3,270	98,754,000
ドクターシーラボ	127	330,500	41,973,500
シーボン	1,800	2,245	4,041,000
ポーラ・オルビスHD	19,100	3,605	68,855,500
ノエビアホールディングス	12,500	1,911	23,887,500
エステー	11,600	989	11,472,400
コニシ	13,600	1,923	26,152,800
長谷川香料	23,800	1,441	34,295,800
星光PMC	8,200	528	4,329,600
小林製薬	30,600	5,700	174,420,000
荒川化学工業	15,800	928	14,662,400
メック	14,600	642	9,373,200
日本高純度化学	54	218,000	11,772,000
JCU	2,800	5,580	15,624,000
新田ゼラチン	11,300	1,000	11,300,000
アース製薬	13,500	3,565	48,127,500
イハラケミカル	29,000	764	22,156,000
北興化学	11,000	294	3,234,000
大成ラミック	4,900	2,624	12,857,600
クミアイ化学	39,000	670	26,130,000
日本農薬	43,000	1,515	65,145,000
昭和シェル石油	167,200	982	164,190,400
コスモ石油	516,000	198	102,168,000
富士興産	6,700	697	4,669,900
ニチレキ	23,000	990	22,770,000
東燃ゼネラル石油	282,000	927	261,414,000
ユシロ化学	10,200	1,017	10,373,400
ビービー・カストロール	8,400	471	3,956,400
富士石油	47,700	327	15,597,900
MORESCO	4,500	1,808	8,136,000
出光興産	88,600	2,379	210,779,400
JXホールディングス	2,073,500	522	1,082,367,000
横浜ゴム	209,000	976	203,984,000
東洋ゴム	155,000	614	95,170,000
ブリヂストン	585,800	3,846	2,252,986,800
住友ゴム	145,900	1,509	220,163,100
藤倉ゴム	11,800	1,437	16,956,600
オカモト	65,000	340	22,100,000
アキレス	148,000	151	22,348,000
フコク	8,100	1,045	8,464,500
ニッタ	18,500	2,291	42,383,500
クリエートメディック	6,100	961	5,862,100
東海ゴム工業	34,500	1,029	35,500,500
三ツ星ベルト	47,000	609	28,623,000
バンドー化学	68,000	435	29,580,000
鬼怒川ゴム	34,000	527	17,918,000
旭硝子	920,000	627	576,840,000
日本板硝子	902,000	149	134,398,000
石塚硝子	24,000	355	8,520,000
有沢製作所	31,200	633	19,749,600

日本山村硝子	74,000	183	13,542,000	
日本電気硝子	386,000	513	198,018,000	
オハラ	7,100	625	4,437,500	
住友大阪セメント	355,000	390	138,450,000	
太平洋セメント	1,098,000	401	440,298,000	
デイ・シイ	19,300	656	12,660,800	
リゾートソリューション	17,000	245	4,165,000	
日本ヒュ-ム	18,000	921	16,578,000	
日本コンクリ-ト	32,000	499	15,968,000	
三谷セキサン	9,400	1,381	12,981,400	
ジャパンパイル	15,300	1,027	15,713,100	
東海カーボン	175,000	337	58,975,000	
日本カーボン	99,000	197	19,503,000	
東洋炭素	10,300	2,132	21,959,600	
ノリタケ	106,000	268	28,408,000	
TOTO	275,000	1,660	456,500,000	
日本碍子	236,000	1,853	437,308,000	
日本特殊陶業	161,000	2,455	395,255,000	
ダントーホールディングス	26,000	145	3,770,000	
MARUWA	4,800	3,585	17,208,000	
品川リフラクトリーズ	47,000	226	10,622,000	
黒崎播磨	40,000	249	9,960,000	
ヨータイ	11,000	307	3,377,000	
イソライト	7,400	197	1,457,800	
東京窯業	23,000	231	5,313,000	
ニッカトー	6,700	417	2,793,900	
フジインコーポレーテッド	17,000	1,332	22,644,000	
エーアンドエーマテリアル	39,000	155	6,045,000	
ニチアス	90,000	723	65,070,000	
新日鐵住金	7,899,000	335	2,646,165,000	
神戸製鋼所	2,589,000	179	463,431,000	
中山製鋼所	105,000	94	9,870,000	
合同製鐵	95,000	181	17,195,000	
J F Eホールディングス	476,700	2,295	1,094,026,500	
日新製鋼HD	79,100	1,208	95,552,800	
東京製鐵	103,200	507	52,322,400	
共英製鋼	17,400	1,840	32,016,000	
大和工業	38,600	3,195	123,327,000	
東京鐵鋼	39,000	393	15,327,000	
大阪製鐵	9,400	1,759	16,534,600	
淀川製鋼所	133,000	450	59,850,000	
東洋鋼鈑	45,000	477	21,465,000	
丸一鋼管	62,500	2,629	164,312,500	
モリ工業	29,000	426	12,354,000	
大同特殊鋼	313,000	498	155,874,000	
日本高周波	74,000	113	8,362,000	
日本冶金工	146,500	331	48,491,500	
山陽特殊製鋼	102,000	492	50,184,000	
愛知製鋼	99,000	420	41,580,000	
日立金属	166,000	1,507	250,162,000	

日本金属	49,000	157	7,693,000
大平洋金属	130,000	369	47,970,000
日本電工	80,000	307	24,560,000
栗本鉄工所	97,000	251	24,347,000
虹 技	20,000	202	4,040,000
日本鑄鉄管	20,000	237	4,740,000
日本製鋼所	267,000	553	147,651,000
三菱製鋼	113,000	263	29,719,000
日亜鋼業	26,000	387	10,062,000
日本精線	14,000	457	6,398,000
大紀アルミニウム	29,000	278	8,062,000
日本軽金属HD	423,300	141	59,685,300
三井金属	476,000	308	146,608,000
東邦亜鉛	105,000	348	36,540,000
三菱マテリアル	1,166,000	357	416,262,000
住友鉱山	483,000	1,389	670,887,000
DOWAホールディングス	206,000	976	201,056,000
古河機金	314,000	208	65,312,000
エス・サイエンス	66,300	57	3,779,100
大阪チタニウム	20,400	1,701	34,700,400
東邦チタニウム	31,600	687	21,709,200
UACJ	237,000	399	94,563,000
古河電工	587,000	264	154,968,000
住友電工	704,000	1,707	1,201,728,000
フジクラ	300,000	474	142,200,000
昭和電線HLDGS	240,000	110	26,400,000
東京特殊電線	27,000	165	4,455,000
タツタ電線	27,300	629	17,171,700
沖 電 線	20,000	208	4,160,000
カナレ電気	2,800	1,483	4,152,400
平河ヒューテック	4,200	862	3,620,400
リョービ	114,000	421	47,994,000
アサヒHD	28,100	1,880	52,828,000
東洋製罐グループHD	132,700	2,020	268,054,000
ホッカンホールディングス	45,000	349	15,705,000
コロナ	9,800	1,130	11,074,000
横河ブリッジHLDGS	35,000	1,536	53,760,000
日本橋梁	41,400	202	8,362,800
駒井ハルテック	36,000	336	12,096,000
高田機工	17,000	221	3,757,000
三和ホールディングス	157,000	708	111,156,000
文化シャッター-	44,000	642	28,248,000
三協立山	24,500	2,243	54,953,500
東洋シャッター-	5,400	601	3,245,400
LIXILグループ	260,200	2,917	759,003,400
日本ファイルコン	12,500	429	5,362,500
ノーリツ	36,700	2,226	81,694,200
長府製作所	20,000	2,345	46,900,000
リンナイ	28,900	8,070	233,223,000
ユニプレス	28,900	2,101	60,718,900

ダイニチ工業	9,500	786	7,467,000	
日東精工	26,000	331	8,606,000	
三洋工業	24,000	194	4,656,000	
岡 部	36,900	1,217	44,907,300	
中国工業	3,000	781	2,343,000	
東 プ レ	36,000	1,534	55,224,000	
高周波熱錬	27,300	849	23,177,700	
東京製綱	127,000	162	20,574,000	
モリテックスチル	10,000	301	3,010,000	
パイオラックス	8,700	4,050	35,235,000	
日本発条	148,900	1,201	178,828,900	
中央発條	24,000	310	7,440,000	
アドバネクス	38,000	156	5,928,000	
三浦工業	27,700	2,618	72,518,600	
タ ク マ	58,000	901	52,258,000	
リブセンス	9,300	2,491	23,166,300	
E R Iホールディングス	3,700	1,189	4,399,300	
ツ ガ ミ	58,000	620	35,960,000	
オークマ	122,000	1,134	138,348,000	
東芝機械	102,000	630	64,260,000	
ア マ ダ	286,000	893	255,398,000	
アイダエンジニア	43,900	1,162	51,011,800	
滝澤鉄工所	47,000	160	7,520,000	
富士機械製造	56,800	885	50,268,000	
牧野フライス	93,000	924	85,932,000	
オーエスジー	76,800	1,908	146,534,400	
ダイジェット	22,000	158	3,476,000	
旭ダイヤモンド	48,000	1,109	53,232,000	
D M G森精機	98,500	1,992	196,212,000	
ディスコ	20,700	6,770	140,139,000	
日東工器	10,800	1,823	19,688,400	
豊田自動織機	162,500	4,675	759,687,500	
豊和工業	10,600	883	9,359,800	
大阪機工	73,000	144	10,512,000	
石川製作所	43,000	127	5,461,000	
東洋機械金属	14,100	425	5,992,500	
津田駒工業	45,000	172	7,740,000	
エンシュウ	46,000	161	7,406,000	
島精機製作所	24,300	1,781	43,278,300	
日阪製作所	24,000	1,002	24,048,000	
やまびこ	7,300	3,150	22,995,000	
ペガサスミシン製造	17,200	403	6,931,600	
ナプテスコ	85,300	2,520	214,956,000	
三井海洋開発	15,500	2,947	45,678,500	
レオン自動機	17,000	671	11,407,000	
S M C	53,400	27,210	1,453,014,000	
新川	15,700	686	10,770,200	
ホソカワミクロン	31,000	684	21,204,000	
ユニオンツール	8,100	2,407	19,496,700	
オイレス工業	17,700	2,131	37,718,700	

日精エーエスビー	5,100	2,741	13,979,100	
サト - ホールディングス	19,500	2,477	48,301,500	
日本エアーテック	5,800	530	3,074,000	
日精樹脂工業	13,600	648	8,812,800	
ワイエイシイ	7,800	564	4,399,200	
小松製作所	871,600	2,038	1,776,320,800	
住友重機械	511,000	459	234,549,000	
日立建機	95,300	2,088	198,986,400	
日 工	28,000	641	17,948,000	
巴工業	6,400	1,698	10,867,200	
井関農機	191,000	305	58,255,000	
T O W A	15,300	505	7,726,500	
丸山製作所	39,000	266	10,374,000	
北川鉄工所	86,000	203	17,458,000	
シンニッタン	17,700	402	7,115,400	
クボタ	975,000	1,703	1,660,425,000	
荏原実業	5,000	1,350	6,750,000	
東洋エンジニア	107,000	438	46,866,000	
三菱化工機	62,000	173	10,726,000	
月島機械	30,000	1,125	33,750,000	
帝国電機製作所	6,300	2,746	17,299,800	
東京機械	66,000	113	7,458,000	
新東工業	43,800	800	35,040,000	
渋谷工業	11,700	2,662	31,145,400	
アイチ コーポレーション	26,400	473	12,487,200	
小森コーポレーション	45,400	1,723	78,224,200	
鶴見製作所	14,000	1,101	15,414,000	
住友精密	29,000	462	13,398,000	
酒井重工業	36,000	392	14,112,000	
荏原製作所	413,000	686	283,318,000	
石井鉄工所	28,000	303	8,484,000	
西島製作所	19,900	1,145	22,785,500	
千代田化工建	159,000	1,529	243,111,000	
ダイキン工業	243,700	6,004	1,463,174,800	
オルガノ	29,000	482	13,978,000	
ト - ヨ - カネツ	100,000	302	30,200,000	
栗田工業	112,200	2,209	247,849,800	
椿本チエイン	95,000	809	76,855,000	
大同工業	37,000	331	12,247,000	
日本コンベヤ	59,000	146	8,614,000	
日 機 装	58,000	1,340	77,720,000	
木村化工機	17,200	468	8,049,600	
新興プランテック	41,100	768	31,564,800	
アネスト岩田	30,000	678	20,340,000	
ダイフク	75,500	1,271	95,960,500	
加藤製作所	42,000	631	26,502,000	
油研工業	35,000	260	9,100,000	
タダノ	79,000	1,395	110,205,000	
フジテック	52,000	1,349	70,148,000	
C K D	50,000	1,138	56,900,000	

キトー	10,500	2,038	21,399,000
平和	38,600	1,760	67,936,000
理想科学工業	13,800	2,105	29,049,000
SANKYO	54,100	4,980	269,418,000
日本金銭機械	16,500	2,019	33,313,500
マースエンジニアリング	10,100	1,971	19,907,100
福島工業	9,800	1,528	14,974,400
オーイズミ	6,300	1,168	7,358,400
ダイコク電機	7,400	2,192	16,220,800
アマノ	51,000	1,016	51,816,000
JUKI	115,000	239	27,485,000
サンデン	101,000	506	51,106,000
蛇の目ミシン	174,000	92	16,008,000
ブラザー工業	230,700	1,388	320,211,600
マックス	28,000	1,154	32,312,000
モリタホールディングス	31,000	870	26,970,000
グローリー	53,200	2,671	142,097,200
新晃工業	12,500	817	10,212,500
大和冷機工業	29,000	707	20,503,000
セガサミーホールディングス	191,800	2,666	511,338,800
日本ピストンリング	71,000	215	15,265,000
リケン	71,000	481	34,151,000
TPR	19,900	1,872	37,252,800
ホシザキ電機	39,000	3,740	145,860,000
大豊工業	12,900	1,158	14,938,200
日本精工	397,000	1,260	500,220,000
NTN	413,000	484	199,892,000
ジェイテクト	189,600	1,651	313,029,600
不二越	166,000	612	101,592,000
ミネベア	243,000	768	186,624,000
日本トムソン	57,000	553	31,521,000
THK	111,300	2,482	276,246,600
ユーシン精機	7,900	2,434	19,228,600
前澤給装工業	7,000	1,336	9,352,000
イーグル工業	22,000	1,741	38,302,000
前澤工業	13,500	344	4,644,000
日本ピラ - 工業	19,000	717	13,623,000
キッツ	80,000	523	41,840,000
日立	4,286,000	833	3,570,238,000
東芝	3,522,000	462	1,627,164,000
三菱電機	1,785,000	1,288	2,299,080,000
富士電機	497,000	494	245,518,000
東洋電機製造	35,000	340	11,900,000
安川電機	196,000	1,537	301,252,000
シンフォニアテクノロジー	107,000	173	18,511,000
明電舎	164,000	406	66,584,000
オリジン電気	26,000	333	8,658,000
山洋電気	27,000	669	18,063,000
デンヨー	17,600	1,481	26,065,600
日立工機	47,600	737	35,081,200

三桜工業	23,200	738	17,121,600
マキタ	116,400	5,440	633,216,000
東芝テック	112,000	719	80,528,000
芝浦メカトロニクス	32,000	266	8,512,000
マブチモーター	25,200	6,010	151,452,000
日本電産	96,500	10,415	1,005,047,500
東光高岳HD	9,900	1,930	19,107,000
宮越ホールディングス	6,200	284	1,760,800
ダイヘン	105,000	488	51,240,000
ヤーマン	2,400	1,393	3,343,200
JVCケンウッド	123,300	206	25,399,800
第一精工	7,400	1,228	9,087,200
日新電機	36,000	626	22,536,000
大崎電気	28,000	545	15,260,000
オムロン	201,400	4,570	920,398,000
日東工業	26,200	1,838	48,155,600
I D E C	23,300	942	21,948,600
ジーエス・ユアサ コーポ	344,000	586	201,584,000
サクサホールディングス	45,000	172	7,740,000
メルコホールディングス	8,600	1,550	13,330,000
テクノメディカ	4,100	2,160	8,856,000
日本電気	2,453,000	272	667,216,000
富士通	1,721,000	526	905,246,000
沖電気	689,000	262	180,518,000
岩崎通信機	85,000	102	8,670,000
電気興業	51,000	741	37,791,000
サンケン電気	97,000	758	73,526,000
ナカヨ通信機	17,000	349	5,933,000
アイホン	10,400	1,762	18,324,800
ルネサスエレクトロニクス	92,400	620	57,288,000
セイコーエプソン	121,800	2,944	358,579,200
ワコム	140,500	705	99,052,500
アルパック	30,100	1,559	46,925,900
アクセル	9,000	1,835	16,515,000
ピクセラ	7,400	165	1,221,000
E I Z O	16,400	2,781	45,608,400
日本信号	45,000	914	41,130,000
京三製作所	42,000	351	14,742,000
能美防災	24,000	1,047	25,128,000
ホーチキ	13,000	573	7,449,000
エレコム	6,400	1,362	8,716,800
日本無線	46,000	381	17,526,000
パナソニック	2,039,100	1,319	2,689,572,900
シャープ	1,287,000	334	429,858,000
アンリツ	103,800	1,146	118,954,800
富士通ゼネラル	42,000	1,066	44,772,000
日立国際電気	35,000	1,458	51,030,000
ソニー	978,500	1,793	1,754,450,500
T D K	107,700	4,680	504,036,000
帝国通信工業	44,000	184	8,096,000

ミツミ電機	68,000	799	54,332,000	
タムラ製作所	69,000	316	21,804,000	
アルプス電気	130,900	1,133	148,309,700	
池上通信機	57,000	112	6,384,000	
パイオニア	247,800	221	54,763,800	
日本電波工業	16,100	931	14,989,100	
日本トリム	3,900	8,100	31,590,000	
ローランド ディー . ジー .	7,900	3,650	28,835,000	
日本コロムビア	8,800	604	5,315,200	
フオスタ - 電機	18,300	1,883	34,458,900	
クラリオン	110,000	165	18,150,000	
S M K	53,000	686	36,358,000	
ヨコオ	15,300	549	8,399,700	
東 光	84,000	353	29,652,000	
ティアック	97,000	103	9,991,000	
ホシデン	52,400	577	30,234,800	
ヒロセ電機	31,000	14,350	444,850,000	
日本航空電子	46,000	1,404	64,584,000	
T O A	19,200	1,030	19,776,000	
古野電気	17,300	801	13,857,300	
ユニデン	56,000	358	20,048,000	
アルパイン	38,700	1,489	57,624,300	
スミダコーポレーション	14,800	554	8,199,200	
アイコム	9,900	2,468	24,433,200	
リオン	5,100	1,579	8,052,900	
船井電機	18,000	1,401	25,218,000	
横河電機	193,600	1,559	301,822,400	
新電元工業	57,000	633	36,081,000	
アズビル	54,100	2,505	135,520,500	
日本光電工業	38,100	3,810	145,161,000	
チ ノ ー	33,000	225	7,425,000	
共和電業	21,000	435	9,135,000	
日本電子材料	8,300	657	5,453,100	
堀場製作所	33,000	3,625	119,625,000	
アドバンテスト	121,700	1,171	142,510,700	
小野測器	19,000	445	8,455,000	
エスベック	18,500	874	16,169,000	
パナソニックデバイス	15,900	499	7,934,100	
キーエンス	40,400	43,680	1,764,672,000	
日置電機	9,400	1,392	13,084,800	
シスメックス	74,700	6,190	462,393,000	
メガチップス	16,000	1,551	24,816,000	
O B A R A G R O U P	11,600	3,355	38,918,000	
日本電産コパル電子	18,600	645	11,997,000	
澤藤電機	11,000	231	2,541,000	
デンソー	441,000	5,466	2,410,506,000	
コーセル	26,000	1,209	31,434,000	
新日本無線	13,000	385	5,005,000	
オプテックス	11,400	1,653	18,844,200	
千代田インテグレ	7,900	1,910	15,089,000	

レーザーテック	12,800	1,032	13,209,600
スタンレー電気	128,600	2,399	308,511,400
岩崎電気	65,000	219	14,235,000
ウシオ電機	108,300	1,355	146,746,500
岡谷電機	10,100	396	3,999,600
ヘリオステクノH	15,300	403	6,165,900
日本セラミック	10,300	1,660	17,098,000
遠藤照明	7,400	2,140	15,836,000
日本デジタル研究所	13,200	1,522	20,090,400
古河電池	13,000	930	12,090,000
双信電機	9,000	411	3,699,000
山一電機	19,900	421	8,377,900
図研	11,700	880	10,296,000
日本電子	62,000	524	32,488,000
カシオ	185,600	1,208	224,204,800
ファナック	199,100	17,270	3,438,457,000
日本シイエムケイ	42,000	302	12,684,000
エンプラス	6,700	7,410	49,647,000
大真空	25,000	434	10,850,000
ローム	94,300	5,250	495,075,000
浜松ホトニクス	69,600	4,425	307,980,000
三井ハイテック	23,600	786	18,549,600
新光電気工業	60,000	859	51,540,000
京セラ	318,000	4,921	1,564,878,000
協栄産業	22,000	191	4,202,000
太陽誘電	86,900	1,289	112,014,100
村田製作所	187,200	9,564	1,790,380,800
ユーシン	25,100	826	20,732,600
双葉電子工業	33,100	1,419	46,968,900
日東電工	154,100	4,244	654,000,400
北陸電気工業	72,000	165	11,880,000
東海理化電機	47,200	1,996	94,211,200
ニチコン	56,200	997	56,031,400
日本ケミコン	113,000	401	45,313,000
K O A	22,500	1,170	26,325,000
三井造船	691,000	213	147,183,000
日立造船	132,400	807	106,846,800
佐世保重工業	126,000	135	17,010,000
三菱重工業	3,178,000	671	2,132,438,000
川崎重工業	1,390,000	457	635,230,000
I H I	1,220,000	477	581,940,000
名村造船所	26,200	1,369	35,867,800
サノヤホールディングス	16,400	216	3,542,400
日本車輛	65,000	539	35,035,000
ニチユ三菱フォークリフト	21,000	719	15,099,000
近畿車輛	31,000	325	10,075,000
F P G	11,600	1,066	12,365,600
島根銀行	4,100	1,329	5,448,900
じもとホールディングス	126,200	220	27,764,000
全国保証	21,000	4,410	92,610,000

日産自動車	2,505,100	938	2,349,783,800	
いすゞ自動車	1,035,000	634	656,190,000	
トヨタ自動車	2,484,000	6,144	15,261,696,000	*
日野自動車	223,000	1,593	355,239,000	
三菱自動車工業	414,300	1,071	443,715,300	
エフテック	6,300	1,499	9,443,700	
G M B	1,900	1,386	2,633,400	
武蔵精密工業	19,100	2,240	42,784,000	
日産車体	87,000	1,482	128,934,000	
新明和工業	72,000	907	65,304,000	
極東開発工業	30,800	1,384	42,627,200	
日信工業	36,400	2,253	82,009,200	
トピー工業	147,000	187	27,489,000	
ティラド	70,000	282	19,740,000	
曙ブレーキ	83,200	448	37,273,600	
タチエス	26,400	1,451	38,306,400	
N O K	86,400	1,709	147,657,600	
フタバ産業	54,600	390	21,294,000	
カヤバ工業	152,000	518	78,736,000	
シロキ工業	41,000	227	9,307,000	
市光工業	44,000	167	7,348,000	
大同メタル工業	25,000	1,114	27,850,000	
プレス工業	70,000	431	30,170,000	
カルソニックカンセイ	121,000	510	61,710,000	
太平洋工業	36,600	708	25,912,800	
ケーヒン	41,200	1,628	67,073,600	
河西工業	24,000	724	17,376,000	
アイシン精機	163,300	4,080	666,264,000	
富士機工	21,000	360	7,560,000	
マ ッ ダ	2,660,000	551	1,465,660,000	
ダイハツ	189,400	1,724	326,525,600	
今仙電機製作所	13,300	1,521	20,229,300	
本田技研	1,606,200	4,115	6,609,513,000	
スズキ	373,100	2,893	1,079,378,300	
富士重工業	607,500	2,955	1,795,162,500	
ヤマハ発動機	271,500	1,510	409,965,000	
ショーワ	42,300	1,643	69,498,900	
小糸製作所	98,000	1,931	189,238,000	
T B K	20,000	586	11,720,000	
エクセディ	21,600	3,260	70,416,000	
ミツバ	32,900	1,815	59,713,500	
豊田合成	57,800	2,295	132,651,000	
愛三工業	22,000	972	21,384,000	
ヨ ロ ズ	13,200	1,983	26,175,600	
エフ・シー・シー	29,300	2,071	60,680,300	
新家工業	42,000	167	7,014,000	
シマノ	77,100	8,970	691,587,000	
タカタ	32,300	2,974	96,060,200	
テイ・エス テック	37,800	3,595	135,891,000	
小 野 建	15,400	1,373	21,144,200	

はるやま商事	7,400	746	5,520,400	
佐島電機	13,200	696	9,187,200	
カップ・クリエイイトHD	12,950	1,964	25,433,800	
エコートレーディング	4,700	731	3,435,700	
伯東	10,800	1,060	11,448,000	
コンドーテック	14,700	718	10,554,600	
中山福	10,200	824	8,404,800	
ライトオン	13,100	705	9,235,500	
ナガイレーベン	23,500	1,576	37,036,000	
ジーンズメイト	5,900	259	1,528,100	
三菱食品	19,400	2,509	48,674,600	
良品計画	18,700	10,250	191,675,000	
三城ホールディングス	21,700	474	10,285,800	
松田産業	13,200	1,380	18,216,000	
メディパルHD	176,200	1,475	259,895,000	
アドヴァン	9,100	1,204	10,956,400	
S P K	4,400	1,868	8,219,200	
アズワン	11,500	2,527	29,060,500	
スズデン	6,500	544	3,536,000	
尾家産業	6,400	826	5,286,400	
シモジマ	12,100	974	11,785,400	
ドウシシャ	19,100	1,485	28,363,500	
コナカ	22,500	891	20,047,500	
高速	10,500	930	9,765,000	
ハウス ローゼ	2,300	1,376	3,164,800	
G - 7ホールディングス	5,300	802	4,250,600	
イオン北海道	11,200	691	7,739,200	
コジマ	25,800	289	7,456,200	
ヒマラヤ	4,200	1,248	5,241,600	
コーナン商事	22,900	1,089	24,938,100	
黒田電気	25,400	1,588	40,335,200	
ネットワンシステムズ	69,000	679	46,851,000	
エコス	6,300	645	4,063,500	
ワタミ	20,700	1,420	29,394,000	
マルシェ	4,800	830	3,984,000	
ドンキホーテホールディング	52,000	6,080	316,160,000	
丸文	15,700	587	9,215,900	
西松屋チェーン	34,700	826	28,662,200	
ゼンショーホールディングス	67,000	1,136	76,112,000	
ハピネット	10,700	902	9,651,400	
幸楽苑	10,900	1,333	14,529,700	
トーマンエレクトロニクス	9,100	1,257	11,438,700	
ハークスレイ	5,100	782	3,988,200	
サイゼリヤ	26,000	1,291	33,566,000	
エクセル	8,200	1,287	10,553,400	
マルカキカイ	5,700	1,376	7,843,200	
アルゴグラフィックス	6,600	1,815	11,979,000	
ガリバーインターナショナル	59,700	698	41,670,600	
日本エム・ディ・エム	15,000	328	4,920,000	
ポブラ	4,900	532	2,606,800	

ユナイテッドアローズ	23,100	3,860	89,166,000
進和	10,400	1,238	12,875,200
エスケイジャパン	5,100	309	1,575,900
ダイトエレクトロン	8,400	398	3,343,200
ハイデイ日高	9,300	2,285	21,250,500
シークス	11,200	1,408	15,769,600
京都きもの友禅	11,800	1,100	12,980,000
コロワイド	58,500	1,059	61,951,500
田中商事	6,000	607	3,642,000
オーハシテクニカ	9,500	989	9,395,500
杏番屋	7,100	3,825	27,157,500
マクニカ	9,100	2,824	25,698,400
白銅	5,800	939	5,446,200
トップカルチャー	6,600	467	3,082,200
P L A N T	3,500	1,003	3,510,500
スギホールディングス	31,600	4,295	135,722,000
島津製作所	230,000	927	213,210,000
J M S	33,000	303	9,999,000
クボテック	4,600	298	1,370,800
ショットモリテックス	4,000	337	1,348,000
長野計器	11,500	691	7,946,500
ブイ・テクノロジー	37	269,600	9,975,200
スター精密	33,900	1,367	46,341,300
東京計器	62,000	314	19,468,000
愛知時計	24,000	302	7,248,000
東京精密	32,100	2,144	68,822,400
マニー	5,400	3,825	20,655,000
ニコン	333,200	1,909	636,078,800
トプコン	48,000	1,545	74,160,000
オリンパス	265,900	3,080	818,972,000
理研計器	15,900	885	14,071,500
大日本スクリーン	169,000	578	97,682,000
キャノン電子	16,400	1,951	31,996,400
タムロン	13,700	2,797	38,318,900
HOYA	433,900	2,990	1,297,361,000
ノーリツ鋼機	16,200	674	10,918,800
エー・アンド・デイ	16,300	681	11,100,300
キャノン	1,034,600	3,210	3,321,066,000
リコー	537,000	1,095	588,015,000
シチズンホールディングス	219,800	855	187,929,000
リズム時計	81,000	143	11,583,000
大研医器	6,200	1,747	10,831,400
パラマウントベッドHD	17,100	3,495	59,764,500
S H O B I	5,600	414	2,318,400
前田工織	13,100	1,181	15,471,100
永大産業	24,000	536	12,864,000
ダンロップスポーツ	9,900	1,264	12,513,600
バンダイナムコH L D G S	196,800	2,208	434,534,400
共立印刷	33,000	282	9,306,000
フランスベッドH L D G S	112,000	202	22,624,000

マーベラスAQL	26,800	783	20,984,400	
パイロットコーポレーション	15,600	3,470	54,132,000	
エイベックス・グループHD	32,500	2,484	80,730,000	
トップパン・フォームズ	31,900	942	30,049,800	
フジシールインターナショナル	21,700	3,130	67,921,000	
タカラトミー	58,600	473	27,717,800	
廣濟堂	16,700	601	10,036,700	
アーク	53,100	302	16,036,200	
レック	6,000	1,221	7,326,000	
タカノ	8,000	541	4,328,000	
プロネクサス	18,300	675	12,352,500	
ホクシン	13,500	154	2,079,000	
ウッドワン	30,000	316	9,480,000	
大建工業	73,000	275	20,075,000	
きもと	13,700	935	12,809,500	
凸版印刷	504,000	796	401,184,000	
大日本印刷	543,000	1,062	576,666,000	
図書印刷	29,000	395	11,455,000	
共同印刷	55,000	291	16,005,000	
日本写真印刷	30,000	1,578	47,340,000	
光村印刷	3,000	277	831,000	
藤森工業	16,000	2,510	40,160,000	
宝印刷	10,300	705	7,261,500	
前澤化成工業	13,300	1,065	14,164,500	
アシックス	177,300	1,839	326,054,700	
ツツミ	8,900	2,357	20,977,300	
ジェイエスピー	12,200	1,580	19,276,000	
ニチハ	22,800	1,492	34,017,600	
ローランド	17,200	1,449	24,922,800	
エフピコ	9,200	7,390	67,988,000	
小松ウオール工業	6,100	2,107	12,852,700	
ヤマハ	131,200	1,607	210,838,400	
河合楽器	62,000	189	11,718,000	
クリナップ	18,400	923	16,983,200	
ビジョン	29,200	5,050	147,460,000	
天馬	14,900	1,485	22,126,500	
兼松日産農林	28,000	167	4,676,000	
キングジム	15,000	682	10,230,000	
リンテック	42,400	1,855	78,652,000	
TASAKI	3,800	735	2,793,000	
信越ポリマー	37,000	390	14,430,000	
東リ	49,000	211	10,339,000	
イトーキ	37,600	592	22,259,200	
任天堂	109,900	15,500	1,703,450,000	
三菱鉛筆	14,700	2,400	35,280,000	
松風	9,000	882	7,938,000	
タカラスタンダ-ド	74,000	772	57,128,000	
コクヨ	92,700	745	69,061,500	
ナカバヤシ	38,000	205	7,790,000	
ニフコ	41,700	2,759	115,050,300	

グローブライド	94,000	158	14,852,000
岡村製作所	69,000	888	61,272,000
日本バルカー	78,000	287	22,386,000
MUTOHホールディングス	24,000	556	13,344,000
伊藤忠	1,405,500	1,312	1,844,016,000
丸紅	1,541,000	745	1,148,045,000
スクロール	22,900	333	7,625,700
高島	33,000	258	8,514,000
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,581	21,343,500
三陽商会	100,000	285	28,500,000
長瀬産業	99,700	1,272	126,818,400
ナイガイ	70,000	99	6,930,000
蝶理	11,400	1,202	13,702,800
豊田通商	196,300	2,411	473,279,300
オンワードホールディングス	125,000	777	97,125,000
三共生興	30,900	372	11,494,800
兼松	376,000	186	69,936,000
美津濃	88,000	529	46,552,000
ツカモトコーポレーション	32,000	162	5,184,000
ファミリーマート	59,500	4,890	290,955,000
ルック	34,000	287	9,758,000
三井物産	1,621,900	1,453	2,356,620,700
日本紙パルプ	91,000	331	30,121,000
東京エレクトロン	160,200	5,579	893,755,800
日立ハイテクノロジーズ	53,400	2,674	142,791,600
カメイ	22,900	798	18,274,200
東都水産	32,000	213	6,816,000
OUGホールディングス	28,000	194	5,432,000
スターゼン	65,000	274	17,810,000
セイコーHD	115,000	546	62,790,000
山善	68,100	646	43,992,600
椿本興業	20,000	296	5,920,000
住友商事	1,039,700	1,306	1,357,848,200
日本ユニシス	42,600	968	41,236,800
内田洋行	41,000	285	11,685,000
三菱商事	1,374,500	1,968	2,705,016,000
第一実業	41,000	471	19,311,000
キャノンマーケティングJPN	50,200	1,443	72,438,600
西華産業	61,000	248	15,128,000
佐藤商事	15,800	692	10,933,600
菱洋エレクトロ	20,900	1,091	22,801,900
東京産業	17,700	378	6,690,600
ユアサ商事	182,000	222	40,404,000
神鋼商事	46,000	232	10,672,000
小林産業	11,900	340	4,046,000
阪和興業	176,000	567	99,792,000
カナデン	2,000	730	1,460,000
菱電商事	26,000	741	19,266,000
ニプロ	95,100	933	88,728,300
フルサト工業	9,700	1,322	12,823,400

岩谷産業	196,000	538	105,448,000
すてきナイスグループ	75,000	239	17,925,000
昭光通商	60,000	162	9,720,000
ニチモウ	29,000	200	5,800,000
極東貿易	22,000	227	4,994,000
イワキ	28,000	217	6,076,000
兼松エレクトロニクス	11,200	1,391	15,579,200
三愛石油	41,000	492	20,172,000
稲畑産業	43,600	1,175	51,230,000
G S Iクレオス	48,000	163	7,824,000
明和産業	16,900	381	6,438,900
ゴ-ルドウイン	43,000	470	20,210,000
ユニ・チャ-ム	114,700	5,796	664,801,200
デザート	43,000	704	30,272,000
キング	10,000	438	4,380,000
ワキタ	26,000	1,168	30,368,000
ヤマトインタ-ナショナル	12,400	444	5,505,600
東邦ホールディングス	56,400	1,768	99,715,200
サンゲツ	31,200	2,596	80,995,200
ミツウロコグループ	28,400	553	15,705,200
シナネン	38,000	417	15,846,000
伊藤忠エネクス	39,000	590	23,010,000
サンリオ	44,400	4,585	203,574,000
サンワテクノス	8,800	882	7,761,600
リョ-サン	26,200	2,183	57,194,600
新光商事	19,400	884	17,149,600
トーホ-	38,000	381	14,478,000
三信電気	22,000	789	17,358,000
東陽テクニカ	24,200	1,102	26,668,400
モスフードサービス	23,100	2,119	48,948,900
加賀電子	16,000	1,271	20,336,000
三益半導体	15,900	911	14,484,900
ソーダニツカ	2,000	446	892,000
立花エレテック	10,700	1,317	14,091,900
木曽路	21,600	1,870	40,392,000
サトレストランシステムズ	16,600	719	11,935,400
千趣会	31,900	879	28,040,100
タカキユー	14,000	310	4,340,000
ケーヨー	29,600	470	13,912,000
アデランス	22,300	1,120	24,976,000
上新電機	38,000	825	31,350,000
日本瓦斯	26,300	1,094	28,772,200
ベスト電器	56,600	158	8,942,800
マルエツ	36,000	352	12,672,000
ロイヤルホールディングス	29,500	1,536	45,312,000
東天紅	13,000	196	2,548,000
いなげや	19,600	992	19,443,200
島忠	39,900	2,404	95,919,600
チヨダ	20,700	1,975	40,882,500
ライフコーポレーション	13,300	1,587	21,107,100

カスミ	36,200	678	24,543,600
リンガーハット	17,200	1,526	26,247,200
さが美	15,000	114	1,710,000
MR MAX	17,400	331	5,759,400
テンアライド	13,800	312	4,305,600
AOKIホールディングス	30,400	1,803	54,811,200
オークワ	27,000	894	24,138,000
コメリ	27,100	2,585	70,053,500
青山商事	44,200	2,754	121,726,800
しまむら	20,400	9,670	197,268,000
CFSコーポレーション	11,800	448	5,286,400
はせがわ	6,300	862	5,430,600
高島屋	238,000	984	234,192,000
松屋	35,400	1,148	40,639,200
エイチ・ツー・オーリテイリング	103,000	822	84,666,000
近鉄百貨店	68,000	368	25,024,000
丸栄	29,000	217	6,293,000
ニッセンHD	35,200	398	14,009,600
パルコ	16,900	987	16,680,300
丸井グループ	229,600	993	227,992,800
クレディセゾン	143,900	2,625	377,737,500
アクシアルリテイリング	9,700	1,519	14,734,300
井筒屋	97,000	89	8,633,000
ダイエー	109,000	317	34,553,000
イズミヤ	66,000	462	30,492,000
イオン	703,400	1,388	976,319,200
ユニーグループ・HD	168,500	631	106,323,500
イズミ	39,300	3,285	129,100,500
東武ストア	24,000	261	6,264,000
平和堂	35,700	1,475	52,657,500
フジ	19,500	1,756	34,242,000
ヤオコー	8,900	4,105	36,534,500
ゼビオ	21,200	1,976	41,891,200
ケーズホールディングス	37,200	3,000	111,600,000
Palta c	24,600	1,353	33,283,800
OLYMPICグループ	10,400	772	8,028,800
日産東京販売HD	26,000	447	11,622,000
新生銀行	1,525,000	241	367,525,000
あおぞら銀行	916,000	300	274,800,000
三菱UFJフィナンシャルG	13,343,300	667	8,899,981,100
りそなホールディングス	1,674,400	540	904,176,000
三井住友トラストHD	3,461,000	537	1,858,557,000
三井住友フィナンシャルG	1,332,100	5,249	6,992,192,900
第四銀行	224,000	363	81,312,000
北越銀行	192,000	211	40,512,000
西日本シティ銀行	618,000	282	174,276,000
千葉銀行	679,000	684	464,436,000
横浜銀行	1,162,000	576	669,312,000
常陽銀行	656,000	523	343,088,000
群馬銀行	395,000	591	233,445,000

武蔵野銀行	28,100	3,555	99,895,500
千葉興業銀行	36,500	787	28,725,500
筑波銀行	73,300	369	27,047,700
東京都民銀行	31,100	1,096	34,085,600
七十七銀行	276,000	518	142,968,000
青森銀行	129,000	276	35,604,000
秋田銀行	121,000	287	34,727,000
山形銀行	107,000	436	46,652,000
岩手銀行	11,500	5,130	58,995,000
東邦銀行	157,000	335	52,595,000
東北銀行	92,000	155	14,260,000
みちのく銀行	95,000	205	19,475,000
ふくおかフィナンシャルG	715,000	449	321,035,000
静岡銀行	516,000	1,079	556,764,000
十六銀行	221,000	386	85,306,000
スルガ銀行	172,000	1,866	320,952,000
八十二銀行	325,000	613	199,225,000
山梨中央銀行	112,000	466	52,192,000
大垣共立銀行	220,000	295	64,900,000
福井銀行	151,000	249	37,599,000
北國銀行	198,000	366	72,468,000
清水銀行	6,000	2,817	16,902,000
滋賀銀行	165,000	530	87,450,000
南都銀行	172,000	387	66,564,000
百五銀行	158,000	435	68,730,000
京都銀行	336,000	903	303,408,000
紀陽銀行	69,100	1,448	100,056,800
三重銀行	73,000	226	16,498,000
ほくほくフィナンシャルG	1,199,000	211	252,989,000
広島銀行	519,000	423	219,537,000
山陰合同銀行	109,000	757	82,513,000
中国銀行	130,900	1,319	172,657,100
鳥取銀行	57,000	191	10,887,000
伊予銀行	188,400	1,028	193,675,200
百十四銀行	193,000	361	69,673,000
四国銀行	126,000	236	29,736,000
阿波銀行	144,000	515	74,160,000
鹿児島銀行	122,000	653	79,666,000
大分銀行	111,000	408	45,288,000
宮崎銀行	118,000	307	36,226,000
肥後銀行	144,000	569	81,936,000
佐賀銀行	107,000	228	24,396,000
十八銀行	109,000	237	25,833,000
沖縄銀行	13,100	4,005	52,465,500
琉球銀行	34,200	1,420	48,564,000
八千代銀行	8,400	2,855	23,982,000
セブン銀行	660,100	413	272,621,300
みずほフィナンシャルG	22,803,700	232	5,290,458,400
高知銀行	69,000	166	11,454,000
山口フィナンシャルG	176,000	1,014	178,464,000

アクリーティブ	124	22,000	2,728,000	
芙蓉総合リース	18,500	3,910	72,335,000	
興銀リース	30,700	3,035	93,174,500	
東京センチュリーリース	41,400	3,230	133,722,000	
S B Iホールディングス	211,600	1,478	312,744,800	
日本証券金融	77,400	760	58,824,000	
アイフル	320,600	412	132,087,200	
日本アジア投資	120,000	116	13,920,000	
ポケットカード	17,700	848	15,009,600	
長野銀行	59,000	186	10,974,000	
名古屋銀行	159,000	355	56,445,000	
北洋銀行	265,400	441	117,041,400	
愛知銀行	6,400	5,160	33,024,000	
第三銀行	100,000	184	18,400,000	
中京銀行	73,000	183	13,359,000	
東日本銀行	77,000	260	20,020,000	
大光銀行	63,000	224	14,112,000	
愛媛銀行	103,000	220	22,660,000	
トマト銀行	69,000	176	12,144,000	
みなと銀行	160,000	177	28,320,000	
京葉銀行	145,000	495	71,775,000	
関西アーバン銀行	245,000	125	30,625,000	
栃木銀行	89,000	416	37,024,000	
北日本銀行	5,500	2,588	14,234,000	
東和銀行	209,000	106	22,154,000	
福島銀行	219,000	101	22,119,000	
大東銀行	114,000	129	14,706,000	
リコーリース	12,100	2,942	35,598,200	
イオンフィナンシャルサービス	102,100	2,673	272,913,300	
アコム	353,700	345	122,026,500	
ジャックス	107,000	513	54,891,000	
オリコ	393,300	253	99,504,900	
日立キャピタル	34,600	2,860	98,956,000	
アプラスフィナンシャル	63,100	143	9,023,300	
オリックス	1,085,100	1,733	1,880,478,300	
三菱UFJリース	446,800	610	272,548,000	
ジャフコ	24,100	5,200	125,320,000	
トモニホールディングス	135,000	415	56,025,000	
大和証券G本社	1,745,000	1,000	1,745,000,000	
野村ホールディングス	3,600,900	791	2,848,311,900	
岡三証券グループ	138,000	1,046	144,348,000	
丸三証券	52,300	981	51,306,300	
東洋証券	71,000	375	26,625,000	
東海東京HD	186,600	1,027	191,638,200	
光世証券	42,000	286	12,012,000	
水戸証券	52,000	498	25,896,000	
いちよし証券	34,500	1,699	58,615,500	
松井証券	89,500	1,246	111,517,000	
N K S Jホールディングス	391,300	2,838	1,110,509,400	
だいこう証券ビジ	8,600	938	8,066,800	

日本取引所グループ	258,700	2,712	701,594,400	
マネックスG	191,400	452	86,512,800	
カブドットコム証券	68,200	595	40,579,000	
極東証券	21,900	2,115	46,318,500	
岩井コスモホールディング	16,700	1,493	24,933,100	
フィデアホール	101,200	216	21,859,200	
池田泉州HD	131,800	483	63,659,400	
MS & AD	526,400	2,603	1,370,219,200	
SONY FH	168,700	1,865	314,625,500	
マネーパートナーズGP	13,600	272	3,699,200	
小林洋行	5,200	287	1,492,400	
第一生命	886,600	1,695	1,502,787,000	
東京海上HD	682,300	3,265	2,227,709,500	
イー・ギャランティ	5,100	2,508	12,790,800	
アサックス	3,100	1,394	4,321,400	
NECキャピタルソリューション	6,000	2,735	16,410,000	
T & Dホールディングス	604,200	1,421	858,568,200	
三井不動産	830,000	3,501	2,905,830,000	
三菱地所	1,233,000	2,869	3,537,477,000	
平和不動産	35,600	1,673	59,558,800	
東京建物	360,000	1,072	385,920,000	
ダイビル	51,800	1,229	63,662,200	
京阪神ビルディング	29,300	559	16,378,700	
住友不動産	422,000	4,809	2,029,398,000	
太平洋興発	66,000	117	7,722,000	
大京	296,000	288	85,248,000	
テーオーシー	60,700	792	48,074,400	
東京楽天地	27,000	495	13,365,000	
レオパレス21	202,500	569	115,222,500	
フジ住宅	22,600	723	16,339,800	
空港施設	21,500	816	17,544,000	
明和地所	8,700	507	4,410,900	
住友不動産販売	12,700	3,135	39,814,500	
ゴールドクレスト	13,900	2,670	37,113,000	
リロ・ホールディング	7,000	5,370	37,590,000	
日本エスリード	6,900	1,166	8,045,400	
日神不動産	23,600	416	9,817,600	
タカラレーベン	58,700	357	20,955,900	
サンヨーハウジ 名古屋	9,200	1,197	11,012,400	
イオンモール	113,600	2,954	335,574,400	
ファースト住建	5,000	1,461	7,305,000	
ランド	40,500	15	607,500	
トーセイ	24,200	851	20,594,200	
穴吹興産	12,000	312	3,744,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	109,400	1,095	119,793,000	
サンフロンティア不動産	16,600	1,563	25,945,800	
エフ・ジェー・ネクスト	7,300	563	4,109,900	
ランドビジネス	11,900	454	5,402,600	
グランディハウス	10,600	363	3,847,800	
東武鉄道	1,013,000	484	490,292,000	

相鉄ホールディングス	305,000	358	109,190,000	
東京急行	1,050,000	648	680,400,000	
京浜急行	458,000	824	377,392,000	
小田急電鉄	572,000	897	513,084,000	
京王電鉄	499,000	668	333,332,000	
京成電鉄	268,000	920	246,560,000	
富士急行	49,000	860	42,140,000	
新京成電鉄	24,000	367	8,808,000	
東日本旅客鉄道	328,300	7,940	2,606,702,000	
西日本旅客鉄道	161,100	4,411	710,612,100	
東海旅客鉄道	159,800	11,985	1,915,203,000	
鴻池運輸	9,500	1,556	14,782,000	
西日本鉄道	231,000	389	89,859,000	
ハマキョウレックス	5,100	2,833	14,448,300	
サカイ引越センター	2,900	3,230	9,367,000	
近畿日本鉄道	1,795,000	362	649,790,000	
阪急阪神HLDGS	1,197,000	546	653,562,000	
南海電鉄	372,000	363	135,036,000	
京阪電鉄	376,000	391	147,016,000	
神戸電鉄	44,000	335	14,740,000	
名糖運輸	7,600	676	5,137,600	
名古屋鉄道	623,000	304	189,392,000	
山陽電鉄	66,000	415	27,390,000	
トランコム	5,200	3,450	17,940,000	
日本通運	706,000	493	348,058,000	
ヤマトホールディングス	332,300	1,999	664,267,700	
山 九	217,000	402	87,234,000	
日 新	68,000	293	19,924,000	
丸 運	11,200	252	2,822,400	
丸全昭和運輸	60,000	353	21,180,000	
センコー	72,000	536	38,592,000	
トナミホールディングス	37,000	213	7,881,000	
日本梱包運輸	54,500	1,873	102,078,500	
日石輸送	21,000	235	4,935,000	
福山通運	108,000	565	61,020,000	
セイノーホールディングス	127,000	1,034	131,318,000	
神奈川中央交通	22,000	505	11,110,000	
日立物流	37,100	1,536	56,985,600	
日本郵船	1,508,000	316	476,528,000	
商船三井	1,003,000	450	451,350,000	
川崎汽船	781,000	253	197,593,000	
NSユニテッド海運	77,000	282	21,714,000	
乾 汽 船	21,700	369	8,007,300	
明治海運	16,100	457	7,357,700	
飯野海運	74,000	614	45,436,000	
共栄タンカー	15,000	245	3,675,000	
第一中央汽船	132,000	113	14,916,000	
日本航空	150,800	5,230	788,684,000	
ANAホールディングス	3,508,000	223	782,284,000	
スカイマーク	38,200	454	17,342,800	

パスコ	17,000	516	8,772,000	
三菱倉庫	117,000	1,461	170,937,000	
三井倉庫	90,000	468	42,120,000	
住友倉庫	119,000	565	67,235,000	
渋沢倉庫	42,000	397	16,674,000	
ヤマタネ	89,000	177	15,753,000	
東陽倉庫	31,000	255	7,905,000	
日本トランスシティ	37,000	345	12,765,000	
ケイヒン	33,000	177	5,841,000	
中央倉庫	10,500	920	9,660,000	
安田倉庫	14,000	1,089	15,246,000	
東洋埠頭	52,000	259	13,468,000	
宇徳	14,600	384	5,606,400	
上組	213,000	962	204,906,000	
サンリツ	1,700	563	957,100	
キムラユニティー	4,200	973	4,086,600	
キューソー流通システム	5,800	1,067	6,188,600	
郵船ロジスティクス	16,400	1,268	20,795,200	
近鉄エクスプレス	16,000	4,030	64,480,000	
東海運	9,900	287	2,841,300	
エーアイティー	6,600	774	5,108,400	
東京放送HD	94,900	1,261	119,668,900	
日本テレビHLD S	175,400	1,873	328,524,200	
テレビ朝日	44,600	2,241	99,948,600	
スカパーJ S A T H D	133,700	544	72,732,800	
テレビ東京HD	14,400	1,648	23,731,200	
コネクシオ	15,700	847	13,297,900	
日本電信電話	692,100	5,586	3,866,070,600	
K D D I	546,800	6,209	3,395,081,200	
光通信	16,400	8,560	140,384,000	
N T T ドコモ	1,451,300	1,733	2,515,102,900	
G M O インターネット	58,800	1,334	78,439,200	
学研ホールディングス	59,000	316	18,644,000	
ゼンリン	23,300	1,000	23,300,000	
昭文社	10,700	715	7,650,500	
K A D O K A W A	17,000	3,455	58,735,000	
インプレスホールディングス	13,000	173	2,249,000	
東京電力	1,514,000	491	743,374,000	
中部電力	588,000	1,270	746,760,000	
関西電力	728,300	1,139	829,533,700	
中国電力	246,700	1,472	363,142,400	
北陸電力	174,800	1,356	237,028,800	
東北電力	445,900	1,102	491,381,800	
四国電力	160,700	1,559	250,531,300	
九州電力	394,100	1,240	488,684,000	
北海道電力	167,000	1,105	184,535,000	
沖縄電力	11,700	3,315	38,785,500	
電源開発	110,800	2,869	317,885,200	
東京瓦斯	2,093,000	499	1,044,407,000	
大阪瓦斯	1,847,000	403	744,341,000	

東邦瓦斯	454,000	497	225,638,000	
北海道瓦斯	36,000	278	10,008,000	
西部瓦斯	201,000	243	48,843,000	
静岡瓦斯	46,600	611	28,472,600	
アイネット	7,600	855	6,498,000	
松竹	116,000	961	111,476,000	
東宝	125,700	2,227	279,933,900	
エイチ・アイ・エス	15,200	5,160	78,432,000	
東映	74,000	585	43,290,000	
AOI Pro.	7,500	683	5,122,500	
NTTデータ	124,300	3,555	441,886,500	
共立メンテナンス	9,300	3,700	34,410,000	
イチネンホールディングス	19,600	803	15,738,800	
建設技術研究所	11,100	1,087	12,065,700	
スペース	9,200	909	8,362,800	
アインファーマシーズ	10,600	5,300	56,180,000	
燦ホールディングス	3,900	1,408	5,491,200	
スバル興業	3,000	384	1,152,000	
東京テアトル	72,000	158	11,376,000	
よみうりランド	37,000	708	26,196,000	
東京都競馬	144,000	389	56,016,000	
常磐興産	60,000	167	10,020,000	
カナモト	24,000	2,612	62,688,000	
東京ドーム	138,000	648	89,424,000	
DTS	16,800	1,901	31,936,800	
スクウェア・エニックス・HD	64,100	1,751	112,239,100	
シーイーシー	10,700	697	7,457,900	
カプコン	45,000	1,855	83,475,000	
西尾レントオール	10,100	2,769	27,966,900	
アゴーラ・ホスピタリティーG	78,000	53	4,134,000	
日本空港ビルデング	60,900	2,182	132,883,800	
トランス・コスモス	24,400	2,173	53,021,200	
乃村工藝社	36,700	857	31,451,900	
ジャステック	11,500	822	9,453,000	
SCSK	41,900	2,720	113,968,000	
藤田観光	48,000	382	18,336,000	
KNT-CTホールディングス	60,000	191	11,460,000	
日本管財	8,000	1,968	15,744,000	
トーカイ	8,300	3,105	25,771,500	
白洋舎	5,000	239	1,195,000	
セコム	193,900	5,890	1,142,071,000	
日本システムウエア	6,800	498	3,386,400	
セントラル警備保障	8,500	972	8,262,000	
アイネス	24,000	732	17,568,000	
丹青社	18,000	699	12,582,000	
メイテック	25,600	2,849	72,934,400	
TKC	14,800	1,848	27,350,400	
アサツー ディ・ケイ	32,700	2,399	78,447,300	
富士ソフト	22,400	2,467	55,260,800	
応用地質	17,800	1,654	29,441,200	

船井総合研究所	19,500	823	16,048,500	
N S D	37,500	1,338	50,175,000	
進学会	8,100	433	3,507,300	
丸紅建材リース	16,000	219	3,504,000	
コナミ	79,500	2,398	190,641,000	
ベネッセホールディングス	62,400	4,220	263,328,000	
イオンディライト	18,000	2,110	37,980,000	
ナック	9,400	1,785	16,779,000	
福井コンピュータH L D S	2,600	922	2,397,200	
ニチイ学館	40,500	860	34,830,000	
ダイセキ	27,600	2,007	55,393,200	
ステップ	5,800	826	4,790,800	
日鉄住金物産	116,000	373	43,268,000	
元気寿司	5,500	1,459	8,024,500	
トラスコ中山	20,200	2,467	49,833,400	
ヤマダ電機	696,100	380	264,518,000	
オートバックスセブン	61,800	1,686	104,194,800	
アークランドサカモト	11,500	1,872	21,528,000	
ニトリホールディングス	34,850	9,790	341,181,500	
グルメ杵屋	13,000	714	9,282,000	
愛 眼	14,400	285	4,104,000	
ケーユーホールディングス	3,700	1,482	5,483,400	
吉野家ホールディングス	47,700	1,369	65,301,300	
加藤産業	25,500	1,936	49,368,000	
イノテック	16,400	499	8,183,600	
イエローハット	15,200	1,856	28,211,200	
富士エレクトロニクス	9,200	1,417	13,036,400	
松屋フーズ	8,500	1,787	15,189,500	
J B C Cホールディングス	14,800	796	11,780,800	
J Kホールディングス	15,300	575	8,797,500	
サガミチェーン	22,000	914	20,108,000	
日 伝	7,900	2,232	17,632,800	
関西スーパーマーケット	13,300	853	11,344,900	
ミロク情報サービス	12,000	423	5,076,000	
北沢産業	11,000	201	2,211,000	
杉本商事	9,500	1,006	9,557,000	
因幡電機産業	24,100	3,300	79,530,000	
王将フードサービス	8,700	3,390	29,493,000	
プレナス	19,700	2,251	44,344,700	
ミニストップ	13,100	1,625	21,287,500	
アークス	30,000	1,936	58,080,000	
バ ロ ー	37,900	1,411	53,476,900	
バイテック	6,200	940	5,828,000	
ミスミグループ本社	70,500	3,305	233,002,500	
江守商事	5,700	2,298	13,098,600	
アルテック	8,900	258	2,296,200	
ベ ル ク	8,800	1,869	16,447,200	
大 庄	8,300	1,330	11,039,000	
タキヒヨー	29,000	425	12,325,000	
ファーストリテイリング	41,100	39,015	1,603,516,500	

ソフトバンク	865,000	8,741	7,560,965,000	
スズケン	72,900	3,440	250,776,000	
サンドラッグ	37,200	4,685	174,282,000	
東京デリカ	8,900	1,513	13,465,700	
ジェコス	12,300	828	10,184,400	
ヤマザワ	4,200	1,548	6,501,600	
やまや	3,600	2,430	8,748,000	
ペルーナ	44,000	501	22,044,000	
合計	286,092,394		320,248,310,210	

*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。

「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7月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,008,631,797	1,326,472,089
国債証券		351,286,599,200	363,862,299,000
地方債証券		29,811,806,539	30,290,111,383
特殊債券		30,677,970,955	31,233,393,096
社債券		29,889,205,480	29,226,433,340
未収入金		2,346,344,000	-
未収利息		1,215,876,334	1,273,563,484
前払費用		53,775,022	41,158,715
流動資産合計		446,290,209,327	457,253,431,107
資産合計		446,290,209,327	457,253,431,107
負債の部			
流動負債			
未払解約金		449,588,000	127,301,000
流動負債合計		449,588,000	127,301,000
負債合計		449,588,000	127,301,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	381,744,908,581	384,301,757,056
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		64,095,712,746	72,824,373,051
元本等合計		445,840,621,327	457,126,130,107
純資産合計		445,840,621,327	457,126,130,107
負債純資産合計		446,290,209,327	457,253,431,107

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7月11日現在	平成26年1月14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	368,547,050,465円	381,744,908,581円
同期中追加設定元本額	52,235,681,787円	27,435,547,267円
同期中一部解約元本額	39,037,823,671円	24,878,698,792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	6,041,625,889円	6,688,627,446円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	9,584,300,613円	9,883,532,093円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	3,459,872,744円	3,738,906,961円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	5,536,825,211円	5,921,633,266円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,217,350,199円	2,490,067,683円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,320,114,855円	1,460,154,240円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,478,113,206円	1,597,267,216円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	204,711,146円	222,960,116円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	170,792,784円	153,559,854円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,117,734,243円	1,904,283,775円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,912,440円	5,003,057円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国1 0)	3,593,317円	61,780,972円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国2 0)	2,698,048円	31,092,320円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国3 0)	670,204円	8,500,512円
投資のソムリエ	16,276,477円	223,737,416円
クルーズコントロール	1,253,047円	152,229,038円
投資のソムリエ< D C年金>	- 円	2,575,074円
D I A M 8 資産バランスマ ファンドN< D C年金>	- 円	4,894,743円

みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
D I A M高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	13,991,244,497円	14,105,425,650円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	756,941,623円	744,486,049円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	10,682,521,021円	9,022,079,241円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	701,513,587円	599,365,688円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	502,326,175円	450,702,488円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,232,190,346円	964,855,359円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	494,415,878円	414,001,445円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	413,470,795円	366,538,877円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	32,291,705,733円	33,458,041,082円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,739,659,742円	11,123,880,558円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	13,767,285,744円	14,089,795,868円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	5,213,581,358円	5,401,245,203円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,260,686,736円	8,698,267,858円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	1,723,854,087円	1,538,935,431円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	6,368,010,036円	6,433,940,797円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,299,350,500円	7,054,769,081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)	13,379,912,347円	12,209,720,687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)	461,343,393円	507,069,889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)	13,843,432,679円	13,646,929,146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)	8,368,660,728円	8,472,967,585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)	1,549,003,873円	1,418,178,474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)	110,271,679,860円	111,231,367,099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)	2,302,038,182円	2,176,780,242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)	9,792,868,160円	9,797,400,827円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	33,606,955,408円	34,326,382,186円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	962,691,235円	483,433円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	375,042,348円	420,386,914円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	200,402円	124,094,157円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	37,131,289,980円	38,015,228,752円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	932,253,475円	933,930,861円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	213,806,786円	199,033,079円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	1,924,614,132円	1,748,356,268円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	372,357円	26,145,578円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	280,116円	304,583円
計	381,744,908,581円	384,301,757,056円
2 . 受益権の総数	381,744,908,581口	384,301,757,056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25年1月12日 至 平成25年7月11日	自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14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	476,332,700	4,779,705,100
地方債証券	247,033,930	147,909,892
特殊債券	241,164,548	181,654,816
社債券	89,944,780	90,495,920
合計	1,054,475,958	4,359,644,472

(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25年2月15日から平成25年7月11日まで及び平成25年2月15日から平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.1679円	1.1895円
（1万口当たり純資産額）	（11,679円）	（11,895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26年1月14日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 2 5 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,000,630,000	
	3 2 6 回 利付国庫債券(2年)	3,500,000,000	3,500,805,000	
	3 2 7 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,240,000	
	3 2 8 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,000,780,000	
	3 2 9 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,502,430,000	
	3 3 0 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,420,000	
	3 3 1 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,460,000	
	3 3 2 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,240,000	
	3 3 3 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,000,520,000	
	3 3 4 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,000,810,000	
	3 3 5 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,000,280,000	
	8 8 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,517,010,000	
	8 9 回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,319,264,000	
	9 1 回 利付国庫債券(5年)	2,400,000,000	2,412,648,000	
	9 2 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,014,360,000	
	9 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,527,895,000	
	9 5 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,022,100,000	
	9 6 回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,219,558,000	
	9 7 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,036,850,000	
	9 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,024,000,000	
	1 0 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,016,900,000	
	1 0 2 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,513,850,000	
	1 0 3 回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,525,560,000	
	1 0 5 回 利付国庫債券(5年)	5,500,000,000	5,514,025,000	
	1 0 6 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,011,850,000	
	1 0 7 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,010,700,000	
	1 0 9 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	2,992,530,000	
	1 1 0 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,400,000	
	1 1 2 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,515,150,000	
	1 1 3 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,519,950,000	
	1 1 4 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,022,240,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,000,480,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	681,786,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,136,170,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,476,644,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	1,400,000,000	1,512,980,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	525,985,000	
	2 6 9 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,521,435,000	
	2 7 0 回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,424,192,000	
	2 7 2 回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	919,809,000	
	2 7 4 回 利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,465,280,000	

277回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,581,850,000	
280回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,565,490,000	
282回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,545,214,000	
284回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,406,651,000	
285回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,465,330,000	
286回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,277,599,000	
288回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,749,344,000	
289回	利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	4,107,090,000	
290回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,103,220,000	
293回	利付国庫債券(10年)	4,200,000,000	4,501,602,000	
296回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,246,800,000	
297回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,237,240,000	
299回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,274,561,000	
301回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,633,274,000	
303回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,982,728,000	
305回	利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,879,174,000	
306回	利付国庫債券(10年)	4,600,000,000	4,912,570,000	
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,912,842,000	
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,100,180,000	
310回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,442,164,000	
312回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,380,480,000	
313回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,782,375,000	
315回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,693,900,000	
317回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,094,900,000	
318回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,288,088,000	
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,094,680,000	
320回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,078,600,000	
321回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,674,825,000	
324回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,065,310,000	
325回	利付国庫債券(10年)	5,000,000,000	5,103,500,000	
326回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,042,440,000	
328回	利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,502,795,000	
329回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,593,115,000	
330回	利付国庫債券(10年)	4,700,000,000	4,775,012,000	
332回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	995,330,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,141,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	118,100,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	233,078,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	250,624,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	228,378,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	233,556,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	344,427,000	
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	531,015,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	415,152,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	330,864,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	325,254,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	575,930,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	233,828,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	467,924,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	230,502,000	

18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	930,642,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	227,046,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	351,660,000	
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	567,870,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	551,408,700	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	704,226,000	
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	704,502,000	
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	681,882,000	
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,155,750,000	
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,059,093,000	
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	942,752,000	
29回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,509,352,000	
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,711,455,000	
31回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,345,728,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,828,528,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	1,941,876,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,683,195,000	
35回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,155,520,000	
36回	利付国庫債券(30年)	2,000,000,000	2,155,340,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,900,000,000	2,004,158,000	
38回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,444,198,000	
39回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,266,948,000	
40回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,546,350,000	
41回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	604,194,000	
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	665,082,000	
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	440,636,000	
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	791,150,400	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	898,520,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	988,939,800	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,016,694,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	560,105,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,066,099,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	572,720,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	862,539,600	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	668,280,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	617,589,500	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	793,443,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	906,495,300	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,257,373,600	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	668,184,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,060,686,000	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	828,536,000	
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,322,009,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	671,334,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,231,648,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,129,653,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,465,712,500	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,430,237,500	
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,351,126,000	
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,605,590,000	

7 8回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,633,193,000		
8 1回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,593,018,000		
8 3回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,840,480,000		
8 5回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,957,074,000		
8 8回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,115,882,000		
9 0回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,863,168,000		
9 2回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,958,893,000		
9 3回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	797,720,000		
9 4回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,267,387,000		
9 5回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,000,628,000		
9 7回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,095,164,000		
9 9回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,839,872,000		
1 0 0回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,323,880,000		
1 0 2回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,256,649,000		
1 0 5回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,407,965,000		
1 0 7回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,290,180,000		
1 0 9回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,119,678,000		
1 1 1回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,311,440,000		
1 1 3回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,507,560,000		
1 1 4回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,504,920,000		
1 1 6回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,877,575,000		
1 1 8回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,343,688,000		
1 1 9回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,416,727,000		
1 2 1回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,313,906,000		
1 2 3回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,485,538,000		
1 2 5回	利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,629,337,000		
1 2 8回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,312,536,000		
1 2 9回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,078,690,000		
1 3 0回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,364,890,000		
1 3 2回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,534,016,000		
1 3 4回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,282,536,000		
1 3 5回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,263,132,000		
1 3 7回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,310,198,000		
1 4 0回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,302,828,000		
1 4 1回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,608,300,000		
1 4 3回	利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,764,881,000		
1 4 5回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,594,700,000		
1 4 6回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,587,750,000		
国債証券 合計		343,820,000,000	363,862,299,000		
地方債証券	6 2 2回	東京都公募公債	106,800,000	108,541,908	
	6 2 3回	東京都公募公債	200,000,000	203,346,000	
	6 2 7回	東京都公募公債	100,000,000	102,309,000	
	6 2 8回	東京都公募公債	100,000,000	102,785,000	
	6 2 9回	東京都公募公債	494,000,000	506,429,040	
	6 3 2回	東京都公募公債	115,300,000	119,944,284	
	6 3 3回	東京都公募公債	100,000,000	103,963,000	
	6 3 4回	東京都公募公債	200,000,000	208,332,000	
	6 3 8回	東京都公募公債	200,000,000	209,382,000	
	6 4 0回	東京都公募公債	150,000,000	157,132,500	
	6 4 1回	東京都公募公債	100,000,000	104,843,000	

659回 東京都公募公債	203,500,000	216,092,580	
664回 東京都公募公債	300,000,000	317,115,000	
667回 東京都公募公債	300,000,000	320,322,000	
680回 東京都公募公債	200,000,000	212,896,000	
685回 東京都公募公債	500,000,000	524,365,000	
688回 東京都公募公債	200,000,000	207,162,000	
697回 東京都公募公債	500,000,000	522,595,000	
701回 東京都公募公債	700,000,000	724,318,000	
708回 東京都公募公債	500,000,000	512,230,000	
720回 東京都公募公債	300,000,000	305,454,000	
16年度11回 北海道公募公債	250,000,000	253,087,500	
18年度4回 北海道公募公債	190,500,000	198,838,185	
18年度6回 北海道公募公債	100,000,000	104,940,000	
19年度4回 北海道公募公債	300,000,000	317,991,000	
21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	213,876,000	
22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	210,842,000	
135回 神奈川県公募公債	200,000,000	205,202,000	
136回 神奈川県公募公債	100,000,000	102,649,000	
166回 神奈川県公募公債	300,000,000	318,030,000	
194回 神奈川県公募公債	300,000,000	303,837,000	
278回 大阪府公募公債	200,000,000	203,056,000	
285回 大阪府公募公債	100,000,000	102,538,000	
286回 大阪府公募公債	200,000,000	205,326,000	
289回 大阪府公募公債	200,000,000	207,294,000	
293回 大阪府公募公債	200,000,000	209,926,000	
301回 大阪府公募公債	100,000,000	105,248,000	
307回 大阪府公募公債	100,000,000	106,031,000	
310回 大阪府公募公債	240,000,000	253,209,600	
336回 大阪府公募公債	200,000,000	213,034,000	
345回 大阪府公募公債	300,000,000	315,831,000	
356回 大阪府公募公債	200,000,000	207,064,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	303,333,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	305,829,000	
83回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	300,849,000	
18年度1回 京都府公募公債	100,000,000	104,501,000	
17年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,138,000	
17年度9回 兵庫県公募公債	306,000,000	314,154,900	
17年度13回 兵庫県公募公債	105,000,000	108,475,500	
18年度1回 兵庫県公募公債	120,000,000	124,404,000	
19年度2回 兵庫県公募公債	200,000,000	210,586,000	
18年度5回 静岡県公募公債	129,800,000	135,892,812	
21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	208,764,840	
22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	208,694,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	207,622,000	
18年度2回 愛知県公募公債	160,300,000	167,558,384	
20年度4回 愛知県公募公債	100,000,000	106,436,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	210,256,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	520,245,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	304,779,000	
16年度2回 広島県公募公債	200,000,000	203,212,000	

2 2 年度 1 回	広島県公募公債	200,000,000	212,572,000	
1 7 年度 2 回	埼玉県公募公債	200,000,000	203,154,000	
1 8 年度 1 回	埼玉県公募公債	200,000,000	207,528,000	
2 1 年度 4 回	埼玉県公募公債	440,000,000	468,485,600	
2 3 年度 2 回	埼玉県公募公債	200,000,000	210,170,000	
1 7 年度 5 回	福岡県公募公債	100,000,000	102,750,000	
1 7 年度 1 回	福岡県公募公債	100,000,000	102,029,000	
1 8 年度 1 回	福岡県公募公債	104,000,000	109,304,000	
2 1 年度 3 回	福岡県公募公債	200,000,000	214,026,000	
1 7 年度 2 回	千葉県公募公債	200,000,000	203,342,000	
1 9 年度 5 回	千葉県公募公債	300,000,000	318,735,000	
2 1 年度 6 回	千葉県公募公債	200,000,000	212,608,000	
2 4 年度 7 回	千葉県公募公債	300,000,000	302,547,000	
2 5 年度 5 回	千葉県公募公債	200,000,000	202,698,000	
1 8 年度 2 回	新潟県公募公債	169,000,000	177,216,780	
2 5 回	共同発行市場公募地方債	304,000,000	308,876,160	
2 8 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,526,000	
2 9 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,050,000	
3 1 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,792,000	
3 2 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,406,000	
3 3 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,466,000	
3 5 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,134,000	
3 6 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,178,000	
3 7 回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,632,500	
3 8 回	共同発行市場公募地方債	170,000,000	177,413,700	
3 9 回	共同発行市場公募地方債	146,000,000	152,234,200	
4 0 回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,381,500	
4 7 回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	169,780,192	
5 4 回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	422,316,000	
5 5 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,490,000	
5 7 回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,390,000	
6 1 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	317,064,000	
6 5 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,402,000	
7 5 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	536,890,000	
8 0 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	749,763,000	
9 4 回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,503,000	
9 9 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	734,181,000	
1 0 6 回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,573,000	
1 0 9 回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,745,000	
1 1 1 回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	716,569,000	
1 2 6 回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	802,172,438	
1 7 年度 3 回	大阪市公募公債	100,000,000	101,721,000	
1 7 年度 7 回	大阪市公募公債	200,000,000	204,170,000	
1 7 年度 8 回	大阪市公募公債	200,000,000	205,068,000	
1 7 年度 1 1 回	大阪市公募公債	100,000,000	102,984,000	
1 8 年度 2 回	大阪市公募公債	100,000,000	104,401,000	
1 8 年度 3 回	大阪市公募公債	150,000,000	157,219,500	
1 9 年度 5 回	大阪市公募公債	135,000,000	143,345,700	
1 2 回ひ号	名古屋市公募公債	200,000,000	203,506,000	
1 2 回せ号	名古屋市公募公債	359,500,000	367,200,490	

	17年度1回 京都市公募公債	100,000,000	101,993,000	
	18年度3回 京都市公募公債	101,700,000	107,110,440	
	17年度13回 神戸市公募公債	103,000,000	106,095,150	
	17年度1回 横浜市公募公債	300,000,000	304,110,000	
	22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	210,058,000	
	22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	211,330,000	
	23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	467,253,000	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	407,412,000	
	16年度7回 札幌市公募公債	100,000,000	101,618,000	
	19年度7回 札幌市公募公債	300,000,000	315,777,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	107,988,000	
	21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	212,002,000	
	18年度4回 福岡市公募公債	100,000,000	104,517,000	
地方債証券 合計		29,155,900,000	30,290,111,383	
特殊債券	13回 政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	126,873,340	
	27回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	209,502,000	
	46回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	211,862,000	
	15回 高速道路機構債	400,000,000	419,640,000	
	25回 高速道路機構債	300,000,000	317,181,000	
	35回 高速道路機構債	400,000,000	422,712,000	
	48回 高速道路機構債	700,000,000	748,986,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	705,215,000	
	3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	308,397,000	
	5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	209,000,000	215,510,350	
	8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	111,477,600	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,213,000	
	16回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	315,222,250	
	17回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	127,975,560	
	18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	337,830,000	
	19回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,492,000	
	21回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	392,835,000	
	23回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	313,716,000	
	30回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,862,000	
	33回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	312,028,200	
	36回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	364,540,240	
	40回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	351,766,940	
	47回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,394,000	
	54回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	525,235,000	
	56回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,246,000	
	60回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	757,126,300	
	66回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	171,810,720	
	67回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	427,554,220	
	71回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	634,644,000	
	78回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	742,497,000	
	82回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,724,000	
	89回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,370,000	
	180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,009,700,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	495,005,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	337,421,700	
	41回 日本道路・機構承継債	300,000,000	304,689,000	

8 5 3 回	政保公営企業債券	204,000,000	207,333,360	
8 5 4 回	政保公営企業債券	304,000,000	310,156,000	
8 5 6 回	政保公営企業債券	200,000,000	204,860,000	
8 5 9 回	政保公営企業債券	207,000,000	212,762,880	
8 6 2 回	政保公営企業債券	239,000,000	248,034,200	
8 6 3 回	政保公営企業債券	200,000,000	208,840,000	
8 6 7 回	政保公営企業債券	200,000,000	208,912,000	
8 6 8 回	政保公営企業債券	101,000,000	105,636,910	
8 6 9 回	政保公営企業債券	102,000,000	106,810,320	
8 7 5 回	政保公営企業債券	482,000,000	506,876,020	
8 8 1 回	政保公営企業債券	500,000,000	526,470,000	
8 回	政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	694,317,540	
3 回	政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,912,440	
5 回	地方公共団体金融機構債券	500,000,000	529,775,000	
8 回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,754,000	
1 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	529,910,000	
1 5 回	政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,100,000	
2 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,978,000	
2 4 回	地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,316,000	
3 6 回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,899,000	
5 0 回	政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,200,000	
1 4 回	公営企業金融公庫債券	100,000,000	101,525,000	
1 5 回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	304,974,000	
1 7 回	公営企業金融公庫債券	100,000,000	102,372,000	
2 0 回	公営企業金融公庫債券	200,000,000	209,076,000	
2 4 回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	315,303,000	
1 4 8 回	政保阪神高速道路債	107,000,000	109,135,720	
1 8 6 回	政保中小企業債券	104,000,000	106,025,920	
1 9 回	都市再生機構債券	200,000,000	214,534,000	
1 1 回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,976,000	
3 7 回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	317,283,000	
6 回	貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	86,535,000	93,464,722	
8 回	貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	60,646,000	65,242,966	
9 回	貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	89,859,000	96,761,968	
2 回	貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	98,178,000	106,062,675	
1 3 回	貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	46,828,000	49,701,366	
1 4 回	貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	240,705,000	253,050,759	
4 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,933,000	60,767,082	
4 3 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,898,000	44,248,364	
4 4 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	155,460,000	168,419,145	
5 1 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	123,375,000	132,955,068	
1 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	213,535,000	228,681,037	
2 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	323,075,000	343,331,802	
3 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	615,264,000	649,854,142	
7 2 3 号	利付商工債	300,000,000	301,596,000	
7 3 2 号	利付商工債	400,000,000	404,004,000	
7 3 6 号	利付商工債	300,000,000	302,142,000	
7 4 0 号	利付商工債	300,000,000	302,307,000	
7 1 7 号	利附農林債	300,000,000	301,944,000	
7 2 1 号	利附農林債	120,000,000	120,735,600	

737号 利附農林債	300,000,000	302,496,000	
743号 利附農林債	300,000,000	302,169,000	
753号 利附農林債	300,000,000	299,694,000	
760号 利附農林債	300,000,000	301,530,000	
253回 利附信金中金債	300,000,000	302,529,000	
261回 利附信金中金債	300,000,000	302,151,000	
275回 利附信金中金債	400,000,000	401,200,000	
282回 利附信金中金債	300,000,000	300,630,000	
156号 利附商工債(3年)	500,000,000	500,300,000	
1回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	103,759,320	
2回 政保東日本高速道路債券	101,000,000	103,669,430	
8回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	178,139,600	
4回 政保中日本高速道路債券	170,000,000	175,453,600	
10回 政保中日本高速道路債券	215,000,000	225,079,200	
21回 政保中日本高速道路債券	300,000,000	319,440,000	
5回 中日本高速道路債券	200,000,000	214,350,000	
1回 政保西日本高速道路債券	201,000,000	206,491,320	
5回 政保西日本高速道路債券	259,000,000	271,887,840	
6回 政保西日本高速道路債券	117,000,000	122,976,360	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	505,865,000	
特殊債券 合計	30,016,291,000	31,233,393,096	
社債券			
12回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	101,712,000	
14回 GEキャピタル円貨債	100,000,000	102,837,000	
2回 JPMorgan・チェース劣後債	100,000,000	102,768,000	
12回 ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	106,089,000	
16回 シティグループ円貨社債	100,000,000	102,041,000	
7回 ウェストパック銀行円貨社債	100,000,000	101,314,000	
22回 中日本高速道路債券	300,000,000	310,197,000	
32回 アサヒビール社債	100,000,000	100,524,000	
7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	107,108,000	
3回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	107,254,000	
41回 住友化学社債	100,000,000	106,423,000	
37回 三菱化学社債	100,000,000	107,747,000	
34回 三井化学社債	100,000,000	103,225,000	
11回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,349,000	
12回 武田薬品工業社債	100,000,000	100,637,000	
24回 新日本石油社債	100,000,000	101,828,000	
29回 新日本製鐵社債	100,000,000	109,551,000	
64回 新日本製鐵社債	100,000,000	106,178,000	
15回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	100,427,000	
1回 日本電産社債	100,000,000	100,367,000	
10回 パナソニック社債	200,000,000	201,910,000	
11回 パナソニック社債	100,000,000	102,801,000	
17回 ソニー社債	100,000,000	101,638,000	
3回 パナソニック電工社債	100,000,000	101,966,000	
19回 三菱重工業社債	100,000,000	104,763,000	
51回 日産自動車社債	100,000,000	100,769,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,516,000	
49回 伊藤忠商事社債	100,000,000	108,574,000	

5 8回	伊藤忠商事社債	100,000,000	100,879,000	
6 6回	伊藤忠商事社債	200,000,000	200,554,000	
7 7回	丸紅社債	100,000,000	100,815,000	
9 1回	丸紅社債	100,000,000	100,620,000	
3 0回	住友商事社債	100,000,000	103,066,000	
6 9回	三菱商事社債	300,000,000	321,732,000	
7 7回	三菱商事社債	150,000,000	151,408,500	
7回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	319,191,000	
2 0回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,252,000	
2 4回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	201,502,000	
2 5回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	303,585,000	
2 7回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	302,346,000	
2 9回	みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	503,395,000	
3 1回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	300,741,000	
3 2回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	199,954,000	
7回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	110,703,000	
1 1 4回	三菱東京UFJ銀行社債	200,000,000	201,292,000	
1 2 6回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,799,000	
1 3 4回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	302,058,000	
1 4 0回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,120,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	219,168,000	
8回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	204,342,000	
1 1回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	211,180,000	
1 2回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	213,082,000	
2 5回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,560,000	
2 8回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	212,948,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	111,967,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,976,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	212,834,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	107,134,000	
1 0回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	211,996,000	
4回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	101,685,000	
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,257,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	105,110,000	
1 2回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	104,850,000	
1 0回	セブン銀行社債	100,000,000	100,956,000	
5 0回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,014,000	
5 1回	三井住友銀行社債	200,000,000	200,644,000	
5 4回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,590,000	
5 7回	三井住友銀行社債	300,000,000	300,735,000	
9回	三井住友銀行劣後社債	100,000,000	102,411,000	
1 0回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,132,000	
1 1回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	214,342,000	
2 0回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	219,020,000	
2 2回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,062,000	
2 3回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,410,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,365,000	
1 0回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	106,794,000	
1 4回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	218,254,000	
1 9回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	213,916,000	

38回	NTTファイナンス社債	200,000,000	200,918,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,672,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,711,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,657,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,995,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	217,162,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	104,002,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	314,172,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	104,393,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	205,684,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	103,276,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	200,844,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,484,000	
12回	三菱UFJリース社債	100,000,000	100,750,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	101,071,000	
20回	野村ホールディングス社債	100,000,000	100,854,000	
22回	野村ホールディングス社債	200,000,000	201,864,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	305,136,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	106,140,000	
24回	三井不動産社債	100,000,000	102,769,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	213,172,000	
79回	三菱地所社債	200,000,000	209,906,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	105,859,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	213,966,000	
73回	住友不動産社債	100,000,000	100,897,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,013,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	107,164,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	105,172,000	
3回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	215,908,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,052,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	343,005,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,734,000	
41回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,316,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,355,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	320,799,000	
3回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	218,974,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	335,922,000	
2回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	217,096,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,177,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,965,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	198,325,800	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,005,000	
3回	東京地下鉄社債	100,000,000	104,510,000	
5回	KDDI社債	100,000,000	109,627,000	
50回	日本電信電話社債	100,000,000	102,306,000	
51回	日本電信電話社債	200,000,000	208,972,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	212,848,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	316,785,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	214,776,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	187,746,000	

516回	東京電力社債	100,000,000	98,045,000	
519回	東京電力社債	372,000,000	361,517,040	
542回	東京電力社債	500,000,000	464,230,000	
407回	中部電力社債	100,000,000	104,708,000	
409回	中部電力社債	300,000,000	326,094,000	
468回	中部電力社債	100,000,000	101,267,000	
471回	中部電力社債	300,000,000	304,290,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	107,464,000	
478回	中部電力社債	100,000,000	104,134,000	
480回	中部電力社債	200,000,000	208,634,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	519,380,000	
410回	関西電力社債	300,000,000	317,715,000	
441回	関西電力社債	200,000,000	202,652,000	
446回	関西電力社債	200,000,000	205,810,000	
298回	中国電力社債	200,000,000	210,310,000	
310回	中国電力社債	200,000,000	220,216,000	
245回	北陸電力社債	200,000,000	209,986,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	110,765,000	
281回	北陸電力社債	200,000,000	213,174,000	
375回	東北電力社債	100,000,000	104,752,000	
380回	東北電力社債	300,000,000	326,610,000	
427回	東北電力社債	200,000,000	203,488,000	
432回	東北電力社債	500,000,000	519,625,000	
237回	四国電力社債	100,000,000	107,524,000	
257回	四国電力社債	200,000,000	202,400,000	
382回	九州電力社債	100,000,000	101,165,000	
383回	九州電力社債	100,000,000	101,352,000	
387回	九州電力社債	200,000,000	205,560,000	
257回	北海道電力社債	200,000,000	215,494,000	
284回	北海道電力社債	500,000,000	511,215,000	
14回	電源開発社債	100,000,000	102,014,000	
17回	電源開発社債	100,000,000	104,137,000	
17回	東京ガス社債	100,000,000	110,345,000	
9回	大阪ガス社債	100,000,000	110,695,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	101,500,000	
社債券 合計		28,112,000,000	29,226,433,340	
合計		431,104,191,000	454,612,236,819	

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。

「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7月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		36,916,662	1,481,571,982
投資証券		11,578,688,330	17,369,800,780
未収配当金		97,430,182	142,457,948
流動資産合計		11,713,035,174	18,993,830,710
資産合計		11,713,035,174	18,993,830,710
負債の部			
流動負債			
未払金		15,248,065	1,414,710,940
未払解約金		1,147,000	248,000
流動負債合計		16,395,065	1,414,958,940
負債合計		16,395,065	1,414,958,940
純資産の部			
元本等			
元本	1	9,575,572,422	13,323,636,866
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		2,121,067,687	4,255,234,904
元本等合計		11,696,640,109	17,578,871,770
純資産合計		11,696,640,109	17,578,871,770
負債純資産合計		11,713,035,174	18,993,830,710

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7月11日現在	平成26年1月14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	14,227,610,808円	9,575,572,422円
同期中追加設定元本額	4,876,166,095円	9,637,336,619円
同期中一部解約元本額	9,528,204,481円	5,889,272,175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>	45,593,563円	41,017,905円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	563,959,185円	506,890,177円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	1,906,824円	1,678,558円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	178,975円	2,914,314円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	499,022円	5,414,120円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	1,162,700円	13,767,469円
投資のソムリエ	726,559円	26,829,709円
投資のソムリエ<DC年金>	-円	301,687円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	-円	235,000円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201210(適格機関投資家限定)	2,529,503,354円	2,158,973,286円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	1,513,433,495円	1,167,041,128円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201301(適格機関投資家限定)	503,763,684円	-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)	3,956,284,754円	6,334,891,129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)	158,679,384円	140,888,123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)	299,880,923円	249,108,638円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	- 円	50,509,031円
D I A M リスクコントロールJ - R E I Tファンド(適格機関投資家限定)	- 円	2,623,176,592円
計	9,575,572,422円	13,323,636,866円
2 . 受益権の総数	9,575,572,422口	13,323,636,866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25年1月12日 至 平成25年7月11日	自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14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	903,480,853	1,095,382,568
合計	903,480,853	1,095,382,568

(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25年6月7日から平成25年7月11日まで及び平成25年6月7日から平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.2215円	1.3194円
(1万口当たり純資産額)	(12,215円)	(13,194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26年1月14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	4,918	494,750,800	
	MIDリート投資法人	431	100,293,700	
	SIA不動産投資法人	176	68,816,000	
	いちご不動産投資法人	2,386	151,033,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	582	468,510,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,907	650,295,900	
	イオンリート投資法人	2,227	286,614,900	
	インヴィンシブル投資法人	3,689	68,689,180	
	オリックス不動産投資法人	3,957	504,517,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	227	155,722,000	
	ケネディクスレジデンシャル投資法人	567	127,801,800	
	ケネディクス不動産投資法人	780	380,640,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	158	113,602,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,146	295,315,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,637	301,145,400	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,786	1,515,584,000	
	スターツプロシード投資法人	340	59,194,000	
	トップリート投資法人	413	194,729,500	
	フロンティア不動産投資法人	1,163	586,152,000	
	プレミアム投資法人	513	202,635,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,581	824,313,700	
	阪急リート投資法人	247	134,368,000	
	産業ファンド投資法人	367	316,721,000	
	森トラスト総合リート投資法人	619	508,199,000	
	森ヒルズリート投資法人	649	440,671,000	
	星野リゾート・リート投資法人	47	30,785,000	
	積水ハウス・SI投資法人	374	190,740,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	877	362,639,500	
	大和ハウスリート投資法人	287	226,156,000	
	大和証券オフィス投資法人	928	432,912,000	
	東急リアル・エステート投資法人	458	283,960,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	541	383,569,000	
	日本ビルファンド投資法人	3,245	1,885,345,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,934	654,659,000	
	日本プロロジスリート投資法人	733	742,529,000	
	日本リテールファンド投資法人	5,412	1,128,402,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	389	427,900,000	
	日本賃貸住宅投資法人	3,459	220,338,300	
	福岡リート投資法人	324	268,596,000	
	平和不動産リート投資法人	2,057	159,828,900	
野村不動産オフィスファンド投資法人	874	402,914,000		

	野村不動産マスターファンド投資法人	3,904	415,385,600	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	377	202,826,000	
投資証券	合計	70,686	17,369,800,780	
合計		70,686	17,369,800,780	

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。

「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7月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,607,514,372	4,172,666,831
コール・ローン		118,088,415	143,379,026
株式		305,289,685,731	298,535,209,958
投資信託受益証券		1,060,494,924	858,691,616
投資証券		5,837,908,298	5,115,634,900
派生商品評価勘定		71,967,377	38,917,107
未収入金		31,756,410	12,541,185
未収配当金		490,964,289	366,142,712
差入委託証拠金		951,211,272	883,876,270
流動資産合計		317,459,591,088	310,127,059,605
資産合計		317,459,591,088	310,127,059,605
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,713,777	14,954,691
未払解約金		215,771,000	65,294,000
流動負債合計		225,484,777	80,248,691
負債合計		225,484,777	80,248,691
純資産の部			
元本等			
元本	1	162,914,515,077	135,913,743,805
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		154,319,591,234	174,133,067,109
元本等合計		317,234,106,311	310,046,810,914
純資産合計		317,234,106,311	310,046,810,914
負債純資産合計		317,459,591,088	310,127,059,605

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成25年7月11日現在	平成26年1月14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	192,607,329,918円	162,914,515,077円
	同期中追加設定元本額	7,382,673,103円	4,575,229,410円
	同期中一部解約元本額	37,075,487,944円	31,576,000,682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	1,090,611,135円	1,159,121,996円
	D I A M外国株式インデック スファンド< D C 年金>	33,484,443,583円	33,296,459,708円
	D I A Mバランス・ファンド < D C 年金> 1 安定型	169,039,370円	150,534,125円
	D I A Mバランス・ファンド < D C 年金> 2 安定・成長型	959,945,405円	890,329,376円
	D I A Mバランス・ファンド < D C 年金> 3 成長型	1,192,609,487円	1,112,032,575円
	D I A M D C バランス3 0インデックスファンド	161,057,872円	148,892,745円
	D I A M D C バランス5 0インデックスファンド	462,569,742円	423,004,157円
	D I A M D C バランス7 0インデックスファンド	357,715,615円	337,783,336円
	マネックス資産設計ファンド < 隔月分配型>	84,946,212円	76,219,172円
	マネックス資産設計ファンド < 育成型>	1,052,118,798円	947,808,800円
	マネックス資産設計ファン ド エボリューション	171,585,133円	163,376,187円
	D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国10）	382,707円	5,540,548円
	D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国20）	786,588円	7,687,612円
	D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国30）	1,608,717円	17,375,983円
	投資のソムリエ	1,899,357円	41,909,527円
	クルーズコントロール	304,242円	35,598,562円
	投資のソムリエ< D C 年金>	- 円	483,907円
	D I A M 8 資産バランス ファンドN< D C 年金>	- 円	452,734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）	485,807,416円	446,333,455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）	4,344,869,700円	4,223,297,292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）	6,279,907,342円	- 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)	61,294,403円	48,987,699円
D I A Mグローバル・ balan スファンド 2 5 V A (適格機 関投資家限定)	5,535,761,423円	3,797,958,766円
D I A Mグローバル・ balan スファンド 5 0 V A (適格機 関投資家限定)	1,091,106,449円	757,583,234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)	133,793,785円	97,541,633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)	766,286,772円	487,450,822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)	61,414,183円	41,788,110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)	128,453,130円	92,550,138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)	13,388,967,448円	11,265,455,225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)	6,679,116,242円	5,618,861,756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)	2,138,870,999円	1,777,730,776円
D I A Mバランスファンド 3 7 . 5 V A (適格機関投資家 限定)	1,890,982,843円	1,590,948,161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)	5,137,309,190円	4,393,683,480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)	3,543,461,737円	2,616,588,063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)	4,707,369,523円	3,936,646,960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)	3,025,703,036円	2,375,066,041円
D I A M世界アセット balan スファンド V A (適格機関投 資家向け)	2,765,696,311円	2,049,442,154円
D I A Mグローバル 私募 ファンド (適格機関投資家向 け)	28,820,733円	29,321,084円

D I A M世界バランスファン ド55VA(適格機関投資家 限定)	12,818,966,404円	10,441,316,927円
D I A Mアイエヌジー世界バ ランスファンド35VA(適 格機関投資家限定)	2,511,237,330円	2,275,077,315円
D I A Mグローバル分散ファ ンドVA(適格機関投資家限 定)	96,477,347円	73,011,333円
D I A M世界アセット balan スファンド2VA(適格機関 投資家限定)	17,138,219,774円	14,039,586,099円
D I A M世界アセット balan スファンド40VA(適格機 関投資家限定)	1,432,702,227円	1,099,526,644円
D I A M世界アセット balan スファンド25VA(適格機 関投資家限定)	3,043,917,210円	2,473,239,583円
D I A M世界アセット balan スファンド3VA(適格機関 投資家限定)	10,447,574,735円	8,666,421,148円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	- 円	155,731円
D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)	186,590,586円	347,414,773円
D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)	249,410円	238,514,023円
D I A M世界アセット balan スファンド4VA(適格機関 投資家限定)	13,851,758,852円	11,517,045,938円
D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	- 円	268,844,682円
D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	65,769円	11,460,038円
D I A Mバランス60VA (適格機関投資家限定)	138,805円	283,672円
計	162,914,515,077円	135,913,743,805円
2 . 受益権の総数	162,914,515,077口	135,913,743,805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25年1月12日 至 平成25年7月11日	自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14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	15,942,727,630	42,184,166,839
投資信託受益証券	7,876,267	28,406,461
投資証券	41,283,351	226,080,969
合計	15,893,568,012	41,929,679,409

（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25年2月16日から平成25年7月11日まで及び平成25年2月16日から平成26年1月14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7月11日 現在				平成26年1月14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	37,729,980	-	37,728,000	1,980
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	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	9,488,400	-	9,488,000	400
ユーロ	64,948,910	-	65,185,000	236,090	28,241,580	-	28,240,000	1,580
買 建	-	-	-	-	53,340,050	-	52,691,000	649,050
アメリカ・ドル	-	-	-	-	10,494,800	-	10,331,000	163,800
ユーロ	-	-	-	-	42,845,250	-	42,360,000	485,250
合計	205,624,370	-	204,823,000	801,370	91,070,030	-	90,419,000	647,070

（注）時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成25年7月11日 現在				平成26年1月14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	4,802,474,476	-	4,863,926,706	61,452,230	5,361,842,494	-	5,386,451,980	24,609,486
合計	4,802,474,476	-	4,863,926,706	61,452,230	5,361,842,494	-	5,386,451,980	24,609,486

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成25年7月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.9472円	2.2812円
(1万口当たり純資産額)	(19,472円)	(22,812円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年1月14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	37,169	390.980	14,532,335.620	
	ABBOTT LABORATORIES	157,441	39.110	6,157,517.510	
	AES CORP	75,129	14.260	1,071,339.540	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	106,042	184.160	19,528,694.720	
	ADOBE SYSTEMS INC	47,588	58.600	2,788,656.800	
	ACE LTD	35,827	96.920	3,472,352.840	
	AGCO CORP	11,661	56.480	658,613.280	
	AIRGAS INC	6,292	110.000	692,120.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,869	108.580	2,265,956.020	
	ENERGEN CORP	8,985	65.640	589,775.400	
	ALLEGHANY CORP	1,956	391.020	764,835.120	
	ALLERGAN INC	30,222	114.420	3,458,001.240	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	93,314	62.660	5,847,055.240	
	RALPH LAUREN CORP	5,290	167.500	886,075.000	
	ALLSTATE CORP	48,737	53.460	2,605,480.020	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	77,010	88.870	6,843,878.700	
	ALTERA CORPORATION	28,796	31.380	903,618.480	
	ALCOA INC	102,779	10.100	1,038,067.900	
	AMGEN INC	76,489	116.400	8,903,319.600	
	HESS CORP	30,613	78.870	2,414,447.310	
	BEAM INC	14,795	83.420	1,234,198.900	
	AMERICAN EXPRESS CO	98,830	86.990	8,597,221.700	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	48,454	46.670	2,261,348.180	
	AFLAC INC	47,249	64.100	3,028,660.900	
	AMERICAN INTL GROUP	144,852	51.460	7,454,083.920	
	ANALOG DEVICES	32,150	48.850	1,570,527.500	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	51,454	78.370	4,032,449.980	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,920	130.590	2,601,352.800	
	NABORS INDUSTRIES LTD	36,022	16.530	595,443.660	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	50,231	40.340	2,026,318.540	
	TIME WARNER	95,165	65.470	6,230,452.550	
	VALERO ENERGY CORP	56,486	51.490	2,908,464.140	
	APACHE CORP	40,751	84.290	3,434,901.790	
ANSYS INC	9,305	83.400	776,037.000		
APPLE INC	92,754	535.730	49,691,100.420		
APPLIED MATERIALS INC	128,032	17.320	2,217,514.240		
ALBEMARLE CORP	7,690	65.750	505,617.500		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65,752	41.530	2,730,680.560	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	13,584	52.970	719,544.480	
AMEREN CORP	25,297	36.230	916,510.310	
ARROW ELECTRONICS INC	11,621	52.210	606,732.410	
ASHLAND INC	6,333	98.330	622,723.890	
AUTOLIV INC	10,829	90.200	976,775.800	
AUTODESK INC	20,701	51.570	1,067,550.570	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	48,043	79.050	3,797,799.150	
AUTOZONE INC	3,337	486.380	1,623,050.060	
AVERY DENNISON CORP	8,865	50.360	446,441.400	
AVNET INC	15,099	42.120	635,969.880	
AVON PRODUCTS INC	41,317	16.490	681,317.330	
BAKER HUGHES INC	44,146	52.550	2,319,872.300	
BALL CORP	12,188	50.780	618,906.640	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	112,890	114.010	12,870,588.900	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	115,464	33.500	3,868,044.000	
CR BARD INC	6,949	133.690	929,011.810	
BAXTER INTERNATIONAL INC	55,596	70.100	3,897,279.600	
BED BATH & BEYOND INC	20,557	68.300	1,404,043.100	
BECTON DICKINSON & CO	19,000	111.060	2,110,140.000	
AMETEK INC	25,338	51.660	1,308,961.080	
BE AEROSPACE INC	10,265	82.920	851,173.800	
VERIZON COMM INC	291,965	47.030	13,731,113.950	
WR BERKLEY CORP	11,053	41.510	458,810.030	
BEST BUY CO INC	26,686	36.860	983,645.960	
YUM! BRANDS INC	46,751	73.410	3,431,990.910	
FIRSTENERGY CORP	45,992	31.960	1,469,904.320	
SLM CORP	49,666	26.950	1,338,498.700	
H&R BLOCK INC	26,590	29.410	782,011.900	
ENSCO PLC-CL A	22,819	55.290	1,261,662.510	
BOEING CO	72,809	140.700	10,244,226.300	
ROBERT HALF INTL INC	14,807	40.370	597,758.590	
BORGWARNER INC	20,836	55.570	1,157,856.520	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131,498	12.920	1,698,954.160	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,632	57.450	1,012,958.400	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,922	247.270	722,522.940	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	167,571	55.420	9,286,784.820	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,422	208.920	1,132,764.240	
ONEOK INC	20,139	63.310	1,275,000.090	
SEMPRA ENERGY	22,909	90.860	2,081,511.740	
FEDEX CORP	31,403	140.490	4,411,807.470	

VERISIGN INC	16,877	60.330	1,018,189.410	
AMPHENOL CORP	15,769	89.190	1,406,437.110	
BROWN-FORMAN CORP	14,456	78.220	1,130,748.320	
QUANTA SERVICES INC	25,480	31.150	793,702.000	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	18,492	33.130	612,639.960	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	345,664	3.670	1,268,586.880	
CSX CORP	105,721	28.430	3,005,648.030	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	20,538	16.710	343,189.980	
CABOT OIL & GAS CORP	46,124	36.440	1,680,758.560	
CAMPBELL SOUP CO	22,764	42.250	961,779.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	32,204	58.540	1,885,222.160	
WHITING PETROLEUM CORP	13,133	58.710	771,038.430	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,362	80.060	1,309,941.720	
CARDINAL HEALTH INC	33,720	67.950	2,291,274.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	37,957	41.420	1,572,178.940	
CATERPILLAR INC	65,969	89.890	5,929,953.410	
CELGENE CORP	42,543	164.900	7,015,340.700	
CORE LABORATORIES N.V.	4,891	187.210	915,644.110	
CITRIX SYSTEMS INC	19,857	58.790	1,167,393.030	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	58,295	25.150	1,466,119.250	
CENTURYLINK INC	63,731	30.870	1,967,375.970	
CERNER CORP	33,863	53.830	1,822,845.290	
JPMORGAN CHASE & CO	383,778	57.700	22,143,990.600	
CHUBB CORP	26,934	90.110	2,427,022.740	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,581	65.260	821,036.060	
CIGNA CORP	29,425	88.780	2,612,351.500	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16,516	50.510	834,223.160	
CINTAS CORP	8,876	58.480	519,068.480	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	134,501	4.700	632,154.700	
CISCO SYSTEMS INC	543,117	22.190	12,051,766.230	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	9,607	80.450	772,883.150	
CLOROX COMPANY	15,155	89.100	1,350,310.500	
EQUINIX INC	5,159	174.920	902,412.280	
COCA-COLA CO/THE	406,611	39.530	16,073,332.830	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	24,325	43.910	1,068,110.750	
COLGATE-PALMOLIVE CO	94,230	64.690	6,095,738.700	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	21,321	48.750	1,039,398.750	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	48,067	50.240	2,414,886.080	
COMERICA INC	18,671	47.220	881,644.620	
NRG ENERGY, INC.	33,814	27.460	928,532.440	

COMCAST CORP-CL A	217,413	52.160	11,340,262.080	
CA INC	30,767	33.440	1,028,848.480	
COMPUTER SCIENCES CORP	16,463	54.750	901,349.250	
CONAGRA FOODS INC	45,240	33.570	1,518,706.800	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,579	53.920	1,540,979.680	
CMS ENERGY CORP	20,017	26.730	535,054.410	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	26,380	57.650	1,520,807.000	
MOLSON COORS BREWING CO	17,190	55.940	961,608.600	
CORNING INC	155,504	18.020	2,802,182.080	
DIRECTV	54,604	70.710	3,861,048.840	
CREE INC	13,242	61.060	808,556.520	
SEALED AIR CORP	20,323	33.270	676,146.210	
BROADCOM CORP-CL A	55,671	28.720	1,598,871.120	
CUMMINS INC	18,380	136.150	2,502,437.000	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	8,350	105.660	882,261.000	
DR HORTON INC	34,671	21.550	747,160.050	
DANAHER CORP	59,746	76.150	4,549,657.900	
MOODY'S CORP	19,691	75.080	1,478,400.280	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	30,639	98.210	3,009,056.190	
TARGET CORP	63,175	61.500	3,885,262.500	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,668	54.570	363,872.760	
DEERE & CO	37,524	89.510	3,358,773.240	
MORGAN STANLEY	147,597	30.870	4,556,319.390	
REPUBLIC SERVICES INC	29,354	32.040	940,502.160	
THE WALT DISNEY CO	172,342	73.270	12,627,498.340	
DOLLAR TREE INC	24,068	55.130	1,326,868.840	
DOVER CORP	18,750	93.150	1,746,562.500	
DOW CHEMICAL	121,961	41.890	5,108,946.290	
OMNICOM GROUP	27,703	71.510	1,981,041.530	
DTE ENERGY CO	19,035	66.050	1,257,261.750	
XL GROUP PLC	26,332	29.860	786,273.520	
DUKE ENERGY CORP	71,547	67.770	4,848,740.190	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL COR	32,561	71.600	2,331,367.600	
FLOWSERVE CORP	12,469	75.400	940,162.600	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,828	50.830	702,877.240	
EBAY INC	119,842	52.540	6,296,498.680	
EMC CORP/MASS	210,363	25.140	5,288,525.820	
BANK OF AMERICA CORP	1,093,077	16.430	17,959,255.110	
CITIGROUP INC	308,990	53.720	16,598,942.800	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,731	78.170	1,307,862.270	
EATON CORP PLC	48,113	74.070	3,563,729.910	
EATON VANCE CORP	12,917	40.430	522,234.310	
DISH NETWORK CORP	23,833	55.950	1,333,456.350	
ECOLAB INC	27,290	103.100	2,813,599.000	

ELECTRONIC ARTS INC	35,610	22.380	796,951.800	
SALESFORCE.COM INC	59,007	56.210	3,316,783.470	
EMERSON ELECTRIC CO	72,168	68.050	4,911,032.400	
WEATHERFORD INTL LTD	73,546	14.290	1,050,972.340	
ENERGY CORP	16,359	60.620	991,682.580	
EOG RESOURCES INC	27,383	163.460	4,476,025.180	
EQUIFAX INC	11,487	67.450	774,798.150	
EQT CORP	14,624	84.350	1,233,534.400	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	23,912	73.840	1,765,662.080	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	20,066	44.220	887,318.520	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	82,264	72.620	5,974,011.680	
EXXON MOBIL CORP	449,640	98.550	44,312,022.000	
FMC CORP	12,155	72.850	885,491.750	
NEXTERA ENERGY INC	42,705	86.680	3,701,669.400	
FAMILY DOLLAR STORES	10,460	65.000	679,900.000	
ASSURANT INC	8,352	66.630	556,493.760	
FASTENAL CO	30,809	47.430	1,461,270.870	
FIFTH THIRD BANCORP	87,505	21.250	1,859,481.250	
M&T BANK CORP	11,528	114.350	1,318,226.800	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	11,007	72.220	794,925.540	
FISERV INC	26,258	57.390	1,506,946.620	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	32.460	468,138.120	
MACY'S INC	40,826	55.260	2,256,044.760	
FORD MOTOR CO	371,524	16.110	5,985,251.640	
FOREST LABORATORIES INC	24,901	67.730	1,686,544.730	
FOSSIL GROUP INC	5,086	114.580	582,753.880	
FRANKLIN RESOURCES INC	39,798	56.780	2,259,730.440	
FREEMPORT-MCMORAN COPPER&GOLD	105,847	35.630	3,771,328.610	
FLEXTRONICS INTL LTD	74,709	7.620	569,282.580	
GAP INC/THE	34,421	38.250	1,316,603.250	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	15,658	48.310	756,437.980	
GENERAL DYNAMICS CORP	29,851	95.010	2,836,143.510	
GENERAL MILLS INC	65,106	48.810	3,177,823.860	
GENUINE PARTS CO	14,679	81.630	1,198,246.770	
GILEAD SCIENCES INC	155,525	73.140	11,375,098.500	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	17,970	77.240	1,388,002.800	
MCKESSON CORP	23,752	167.140	3,969,909.280	
NVIDIA CORP	51,123	15.360	785,249.280	
GENERAL ELECTRIC CO	1,039,570	26.730	27,787,706.100	
WW GRAINGER INC	5,965	261.660	1,560,801.900	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	12,666	79.410	1,005,807.060	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	16,876	75.850	1,280,044.600	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	14.820	329,537.520	

HALLIBURTON CO	88,400	49.580	4,382,872.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,686	69.720	1,163,347.920	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	43,162	175.880	7,591,332.560	
HARLEY-DAVIDSON INC	21,132	67.190	1,419,859.080	
HARRIS CORP	10,776	67.950	732,229.200	
CONSOL ENERGY INC	22,051	36.410	802,876.910	
HASBRO INC	11,176	52.250	583,946.000	
HENRY SCHEIN INC	7,142	114.310	816,402.020	
DENBURY RESOURCES INC	28,517	16.070	458,268.190	
HELMERICH & PAYNE INC	9,929	83.700	831,057.300	
HERSHEY FOODS CORP	16,263	97.850	1,591,334.550	
HEWLETT-PACKARD CO	197,600	28.120	5,556,512.000	
F5 NETWORKS INC	7,198	92.010	662,287.980	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	43.130	557,196.470	
REYNOLDS AMERICAN INC	32,398	48.110	1,558,667.780	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	14,788	89.120	1,317,906.560	
JUNIPER NETWORKS INC	48,236	25.320	1,221,335.520	
HOLLYFRONTIER CORP	19,247	48.730	937,906.310	
HOLOGIC INC	24,876	21.800	542,296.800	
UNUM GROUP	30,372	33.960	1,031,433.120	
HOME DEPOT INC	147,644	80.970	11,954,734.680	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,878	68.640	952,585.920	
HORMEL FOODS CORP	14,878	45.110	671,146.580	
HUDSON CITY BANCORP INC	61,279	9.250	566,830.750	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,422	23.040	1,000,442.880	
HUMANA INC	15,524	96.030	1,490,769.720	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,635	77.800	749,603.000	
RED HAT INC	20,247	57.560	1,165,417.320	
BIOGEN IDEC INC	24,030	283.670	6,816,590.100	
ILLINOIS TOOL WORKS	42,995	81.110	3,487,324.450	
INTUIT INC	27,600	75.010	2,070,276.000	
INGERSOLL-RAND PLC	28,100	61.730	1,734,613.000	
INTEL CORP	506,921	25.500	12,926,485.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,998	84.790	847,730.420	
INTL GAME TECH	20,749	16.950	351,695.550	
INTERNATIONAL PAPER CO	43,061	48.130	2,072,525.930	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,872	17.410	641,941.520	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,497	64.340	932,736.980	
JOHNSON & JOHNSON	287,687	94.500	27,186,421.500	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	41,564	34.770	1,445,180.280	
JOHNSON CONTROLS INC	69,702	51.190	3,568,045.380	
KLA-TENCOR CORP	16,662	62.310	1,038,209.220	

DEVON ENERGY CORP	38,601	59.180	2,284,407.180	
KELLOGG CO	28,361	60.430	1,713,855.230	
KEYCORP	86,740	13.470	1,168,387.800	
KIMBERLY-CLARK CORP	38,888	104.730	4,072,740.240	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,098	306.470	4,320,614.060	
KOHL'S CORP	23,092	53.460	1,234,498.320	
KROGER CO	48,049	38.610	1,855,171.890	
LSI CORP	55,560	10.970	609,493.200	
LAM RESEARCH CORP	14,133	54.580	771,379.140	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,064	46.300	790,063.200	
LEGG MASON INC	13,165	43.260	569,517.900	
LEGGETT & PLATT INC	8,522	29.790	253,870.380	
LENNAR CORP	18,341	38.180	700,259.380	
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,049	27.370	986,661.130	
ELI LILLY & CO	102,969	52.070	5,361,595.830	
L BRANDS INC	26,970	56.610	1,526,771.700	
LINCOLN NATIONAL CORP	28,925	51.060	1,476,910.500	
LINEAR TECH CORP	23,086	44.490	1,027,096.140	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	73,308	100.230	7,347,660.840	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34,061	58.930	2,007,214.730	
LOCKHEED MARTIN CORP	27,544	150.920	4,156,940.480	
LOEWS CORP	33,738	46.330	1,563,081.540	
RANGE RESOURCES CORP	17,434	79.670	1,388,966.780	
LOWE'S COS INC	106,220	48.660	5,168,665.200	
DOMINION RESOURCES INC/VA	60,588	67.170	4,069,695.960	
IRON MOUNTAIN INC	12,968	27.690	359,083.920	
SCANA CORP	9,574	46.400	444,233.600	
MDU RESOURCES GROUP INC	21,313	30.470	649,407.110	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,258	25.250	1,041,764.500	
MCCORMICK & CO INC	14,416	69.230	998,019.680	
MCDONALD'S CORPORATION	102,385	94.830	9,709,169.550	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	26,382	76.630	2,021,652.660	
EVEREST RE GROUP LTD	5,049	147.010	742,253.490	
MANPOWERGROUP INC	7,953	84.260	670,119.780	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	12,156	68.740	835,603.440	
MARSH & MCLENNAN COS	56,000	47.390	2,653,840.000	
ENERGIZER HOLDINGS INC	7,466	104.990	783,855.340	
MASCO CORP	37,719	22.700	856,221.300	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	105.250	536,985.500	
MATTEL INC	37,311	44.660	1,666,309.260	
METLIFE INC	93,799	52.970	4,968,533.030	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	34,242	27.960	957,406.320	

MEDTRONIC INC	103,783	59.250	6,149,142.750	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,156	17.870	967,767.720	
CVS CAREMARK CORP	127,599	68.550	8,746,911.450	
MERCK & CO. INC.	298,696	53.120	15,866,731.520	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,600	90.700	961,420.000	
MICROSOFT CORP	807,386	34.990	28,250,436.140	
MICRON TECH INC	103,537	23.330	2,415,518.210	
RACKSPACE HOSTING INC	13,630	35.830	488,362.900	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,985	45.150	857,172.750	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	50,668	15.230	771,673.640	
3M CO	66,174	134.680	8,912,314.320	
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,039	146.690	1,032,550.910	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,610	65.490	1,611,708.900	
KANSAS CITY SOUTHERN	10,506	116.010	1,218,801.060	
MURPHY OIL CORPORATION	17,184	62.340	1,071,250.560	
MYLAN LABORATORIES	37,298	45.240	1,687,361.520	
ILLUMINA INC	13,717	113.930	1,562,777.810	
XCEL ENERGY INC	48,810	28.040	1,368,632.400	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	45,346	76.740	3,479,852.040	
NETAPP INC	33,354	39.700	1,324,153.800	
SEARS HOLDINGS CORP	4,862	35.460	172,406.520	
NEWELL RUBBERMAID INC	29,362	31.680	930,188.160	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	119.380	438,960.260	
NEWMONT MINING CORP	49,529	23.880	1,182,752.520	
NIKE INC-CL B	72,273	75.180	5,433,484.140	
NOBLE ENERGY INC	35,626	63.170	2,250,494.420	
NORDSTROM INC	13,411	59.490	797,820.390	
NORFOLK SOUTHERN CORP	32,257	90.190	2,909,258.830	
NORTHEAST UTILITIES	34,447	42.330	1,458,141.510	
NISOURCE INC	33,928	33.240	1,127,766.720	
COACH INC	30,955	54.300	1,680,856.500	
TOWERS WATSON & COMPANY	6,639	127.070	843,617.730	
NORTHERN TRUST CORP	22,009	60.430	1,330,003.870	
NORTHROP GRUMMAN CORP	21,819	115.630	2,522,930.970	
WELLS FARGO & CO	515,521	45.560	23,487,136.760	
NUCOR CORP	35,421	51.540	1,825,598.340	
MONSANTO CO	54,120	111.400	6,028,968.000	
CHENIERE ENERGY INC	23,885	45.060	1,076,258.100	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	61,482	76.370	4,695,380.340	
OCWEN FINANCIAL CORP	12,196	55.200	673,219.200	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	82,883	91.540	7,587,109.820	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	74.030	672,266.430	
OGE ENERGY CORP	22,050	33.580	740,439.000	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,078	130.220	1,572,797.160	
OMNICARE INC	12,226	62.210	760,579.460	
ORACLE CORP	353,534	37.750	13,345,908.500	
OWENS-ILLINOIS INC	19,173	33.870	649,389.510	
PACCAR INC	34,453	58.400	2,012,055.200	
PALL CORP	10,048	83.190	835,893.120	
EXELON CORP	85,567	26.980	2,308,597.660	
PARKER HANNIFIN CORP	16,001	125.620	2,010,045.620	
PARTNERRE LTD	3,890	99.900	388,611.000	
PATTERSON COS INC	4,032	40.510	163,336.320	
PAYCHEX INC	32,595	43.580	1,420,490.100	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,943	45.770	638,171.110	
PPL CORPORATION	64,994	30.140	1,958,919.160	
PEPSICO INC	157,377	82.370	12,963,143.490	
PENTAIR LTD	19,696	75.080	1,478,775.680	
PFIZER INC	676,001	30.540	20,645,070.540	
CONOCOPHILLIPS	118,436	67.740	8,022,854.640	
PVH CORP	7,894	129.550	1,022,667.700	
PETSMART INC	8,567	66.780	572,104.260	
PG&E CORP	44,930	40.290	1,810,229.700	
PHARMACYCLICS INC	5,559	130.530	725,616.270	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,788	164.780	2,436,766.640	
ALTRIA GROUP INC	208,659	37.090	7,739,162.310	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	56,300	77.370	4,355,931.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	6,387	138.970	887,601.390	
GARMIN LTD	13,579	45.410	616,622.390	
AETNA INC	38,540	71.040	2,737,881.600	
FLUOR CORP (NEW)	17,508	78.040	1,366,324.320	
PPG INDUSTRIES INC	14,182	187.760	2,662,812.320	
PRAXAIR INC	30,530	130.800	3,993,324.000	
PRECISION CASTPARTS CORP	15,193	269.000	4,086,917.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	45,160	114.770	5,183,013.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,682	82.350	2,279,612.700	
QUEST DIAGNOSTICS	14,594	53.750	784,427.500	
PROCTER & GAMBLE CO	279,844	80.010	22,390,318.440	
PROGRESSIVE CORP	63,937	25.700	1,643,180.900	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,488	31.570	1,562,336.160	
PULTE GROUP INC	40,688	19.400	789,347.200	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	47,010	16.940	796,349.400	
QUALCOMM INC	174,034	73.220	12,742,769.480	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	52.580	545,464.920	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,570	90.200	502,414.000	

REGENERON PHARMACEUTICALS	7,865	268.680	2,113,168.200	
RESMED INC	16,867	46.830	789,881.610	
US BANCORP	187,987	40.780	7,666,109.860	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,613	55.140	805,760.820	
ROSS STORES INC	21,400	73.290	1,568,406.000	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,374	99.660	834,552.840	
ROPER INDUSTRIES INC	9,399	137.980	1,296,874.020	
ROWAN COMPANIES PLC-A	13,327	32.830	437,525.410	
PEABODY ENERGY CORP	33,467	17.360	580,987.120	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,791	115.070	1,702,000.370	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,326	48.760	796,055.760	
RAYTHEON COMPANY	33,183	89.930	2,984,147.190	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,615	75.100	872,286.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,580	251.010	1,149,625.800	
FMC TECHNOLOGIES INC	22,653	51.050	1,156,435.650	
ACCENTURE PLC-CL A	65,120	81.060	5,278,627.200	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	170,829	35.200	6,013,180.800	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	18,347	44.070	808,552.290	
SANDISK CORP	24,773	71.180	1,763,342.140	
SAFEWAY INC	23,620	31.670	748,045.400	
ROCKWELL COLLINS INC	13,494	75.140	1,013,939.160	
ST JUDE MEDICAL INC	30,560	66.380	2,028,572.800	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	39,444	86.340	3,405,594.960	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	29,320	52.040	1,525,812.800	
PRICELINE.COM INC	5,196	1,139.720	5,921,985.120	
SCHLUMBERGER LTD	134,571	87.460	11,769,579.660	
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,670	24.830	2,921,746.100	
JOY GLOBAL INC	12,702	54.890	697,212.780	
ZIMMER HOLDINGS INC	17,978	95.650	1,719,595.700	
SPX CORP	3,361	99.480	334,352.280	
BUNGE LTD	13,535	81.060	1,097,147.100	
SEI INVESTMENTS CO	15,882	33.740	535,858.680	
WELLPOINT INC	31,319	90.840	2,845,017.960	
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,772	70.610	1,607,930.920	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	32,264	47.720	1,539,638.080	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8,538	191.190	1,632,380.220	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,617	24.820	412,433.940	
SIGMA-ALDRICH	11,301	91.470	1,033,702.470	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	46,269	88.530	4,096,194.570	

ADVANCE AUTO PARTS	7,875	114.290	900,033.750	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	34,348	38.070	1,307,628.360	
EDISON INTERNATIONAL	34,152	45.480	1,553,232.960	
SOUTHERN CO	87,757	41.270	3,621,731.390	
BB&T CORP	73,195	38.540	2,820,935.300	
SOUTHWEST AIRLINES	17,528	20.720	363,180.160	
AT&T INC	542,288	33.300	18,058,190.400	
CHEVRON CORP	197,149	119.250	23,510,018.250	
MEADWESTVACO CORP	16,496	35.020	577,689.920	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,726	80.150	1,180,288.900	
STAPLES INC	72,899	14.500	1,057,035.500	
STATE STREET CORP	47,154	72.930	3,438,941.220	
STARBUCKS CORP	78,597	75.120	5,904,206.640	
STRYKER CORP	29,747	77.430	2,303,310.210	
NETFLIX INC	5,640	336.810	1,899,608.400	
STERICYCLE INC	7,859	115.020	903,942.180	
SUNTRUST BANKS INC	54,576	38.150	2,082,074.400	
SYMANTEC CORP	76,489	22.200	1,698,055.800	
SYNOPSYS INC	14,312	40.640	581,639.680	
SYSCO CORP	59,058	36.280	2,142,624.240	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,432	393.350	1,743,327.200	
TESORO CORP	15,352	54.810	841,443.120	
TEXAS INSTRUMENTS INC	110,530	42.240	4,668,787.200	
TEXTRON INC	25,116	34.750	872,781.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,264	112.990	4,210,459.360	
TIFFANY & CO	12,040	87.440	1,052,777.600	
TOLL BROTHERS INC	17,142	36.070	618,311.940	
TORCHMARK CORP	9,110	77.170	703,018.700	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	32.030	436,793.110	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	17,040	64.470	1,098,568.800	
TRACTOR SUPPLY CO	15,159	73.400	1,112,670.600	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,388	33.670	787,473.960	
TYSON FOODS INC	28,867	33.900	978,591.300	
MARATHON OIL CORP	70,393	34.110	2,401,105.230	
UNION PACIFIC CORP	47,799	168.050	8,032,621.950	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	88,532	112.800	9,986,409.600	
UNITEDHEALTH GROUP INC	105,909	73.940	7,830,911.460	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,035	83.990	758,849.650	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,927	79.500	868,696.500	
VF CORP	37,944	60.230	2,285,367.120	
CBS CORP	57,668	60.940	3,514,287.920	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23,298	77.040	1,794,877.920	

VULCAN MATERIALS CO	15,610	58.660	915,682.600	
URBAN OUTFITTERS INC	13,462	36.890	496,613.180	
WALGREEN CO	91,195	60.200	5,489,939.000	
WAL-MART STORES INC	167,855	77.490	13,007,083.950	
WASTE MANAGEMENT INC	46,499	43.030	2,000,851.970	
WATERS CORP	8,002	100.510	804,281.020	
ACTAVIS PLC	18,272	181.290	3,312,530.880	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,083	97.390	981,983.370	
WESTERN DIGITAL CORP	23,595	84.610	1,996,372.950	
WHIRLPOOL CORP	7,676	153.500	1,178,266.000	
WYNN RESORTS LTD	7,511	203.470	1,528,263.170	
WHOLE FOODS MARKET INC	34,963	52.500	1,835,557.500	
NASDAQ OMX GROUP	10,282	39.150	402,540.300	
CME GROUP INC	33,607	74.020	2,487,590.140	
WILLIAMS COS INC	69,554	39.040	2,715,388.160	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	54.260	472,930.160	
LKQ CORP	28,289	32.260	912,603.140	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	18.790	341,884.050	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	51.350	544,772.150	
WISCONSIN ENERGY CORP	20,446	40.990	838,081.540	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,824	53.610	419,444.640	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	30.570	759,664.500	
CARMAX INC	24,979	45.220	1,129,550.380	
XEROX CORP	127,501	12.210	1,556,787.210	
XILINX INC	24,251	45.180	1,095,660.180	
YAHOO! INC	99,997	39.990	3,998,880.030	
CIMAREX ENERGY CO	9,368	92.730	868,694.640	
TJX COMPANIES INC	71,898	62.910	4,523,103.180	
HOSPIRA INC	15,624	41.690	651,364.560	
CBRE GROUP INC	28,979	26.200	759,249.800	
LIBERTY GLOBAL PLC	24,021	89.760	2,156,124.960	
REGIONS FINANCIAL CORP	138,567	10.310	1,428,625.770	
GOOGLE INC	27,917	1,122.980	31,350,232.660	
T-MOBILE US INC	19,051	32.490	618,966.990	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,336	79.170	3,351,741.120	
MOSAIC CO/THE	29,078	46.150	1,341,949.700	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	46,732	31.930	1,492,152.760	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	150,198	32.350	4,858,905.300	
HERBALIFE LTD	7,528	79.840	601,035.520	
CELANESE CORP	14,767	53.860	795,350.620	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	73,694	7.910	582,919.540	
IHS INC-CLASS A	5,758	119.700	689,232.600	
DISCOVERY COMMNUCATIONS- A	13,414	81.440	1,092,436.160	

EXPEDIA INC	10,399	67.870	705,780.130	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,285	244.640	1,537,562.400	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,034	113.180	2,154,268.120	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	15,627	84.920	1,327,044.840	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	21,690	30.860	669,353.400	
GAMESTOP CORP. - CL. A	14,066	45.320	637,471.120	
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	11,889	220.510	2,621,643.390	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	7,718	84.930	655,489.740	
VIACOM INC-CLASS B	44,238	84.420	3,734,571.960	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,447	529.800	1,826,220.600	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	10,239	44.600	456,659.400	
TRANSDIGM GROUP INC	4,774	167.420	799,263.080	
MASTERCARD INC	10,780	810.000	8,731,800.000	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	46,990	27.750	1,303,972.500	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	12,025	71.480	859,547.000	
WESTERN UNION CO	61,119	16.380	1,001,129.220	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,629	46.510	401,334.790	
KBR INC	15,988	31.920	510,336.960	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	45,731	27.150	1,241,596.650	
SPECTRA ENERGY CORP	67,253	34.560	2,324,263.680	
TIME WARNER CABLE INC	28,718	132.400	3,802,263.200	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	35,585	15.410	548,364.850	
DELTA AIR LINES INC	22,701	30.920	701,914.920	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,877	104.680	405,844.360	
DISCOVER FINANCIAL	51,410	53.660	2,758,660.600	
COVIDIEN PLC	47,677	68.770	3,278,747.290	
TE CONNECTIVITY LTD	40,997	55.550	2,277,383.350	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	95.630	963,663.510	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,339	49.700	613,248.300	
VMWARE INC	10,086	93.010	938,098.860	
TERADATA CORP	19,646	44.030	865,013.380	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	7,107	88.890	631,741.230	
INVESCO LTD	43,479	35.050	1,523,938.950	
NETSUITE INC	3,281	103.000	337,943.000	
CALPINE CORP NPR	42,931	19.140	821,699.340	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	164,815	82.450	13,588,996.750	
VISA INC	52,252	218.900	11,437,962.800	

DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	22,285	47.430	1,056,977.550	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,289	41.590	677,459.510	
LORILLARD INC	38,414	49.270	1,892,657.780	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	7,259	76.310	553,934.290	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,733	75.210	732,018.930	
MARATHON PETROLEUM CORP	33,263	88.160	2,932,466.080	
CAREFUSION CORP	20,958	40.750	854,038.500	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	67,126	35.460	2,380,287.960	
XYLEM INC	22,549	35.020	789,665.980	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	42,755	79.820	3,412,704.100	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	26,085	52.640	1,373,114.400	
LINKEDIN CORP	10,629	213.540	2,269,716.660	
HCA HOLDINGS INC	28,526	50.960	1,453,684.960	
NIELSEN HOLDINGS NV	26,310	43.680	1,149,220.800	
VERISK ANALYTICS INC	16,556	62.450	1,033,922.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,162	113.500	812,887.000	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	20,925	82.900	1,734,682.500	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	7,892	51.570	406,990.440	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	32,899	15.900	523,094.100	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	7,245	134.220	972,423.900	
CIT GROUP INC	20,577	50.200	1,032,965.400	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	713,000	0.675	481,275.000	
DOLLAR GENERAL CORP	30,790	60.690	1,868,645.100	
AON PLC	29,492	80.920	2,386,492.640	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	48.000	550,272.000	
QEP RESOURCES INC	18,552	29.330	544,130.160	
TESLA MOTORS INC	9,661	139.340	1,346,163.740	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	37.980	584,626.140	
GENERAL MOTORS CO	101,523	39.580	4,018,280.340	
VANTIV INC	12,141	31.590	383,534.190	
TRIPADVISOR INC	12,944	84.450	1,093,120.800	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	19,210	76.670	1,472,830.700	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	29,892	60.200	1,799,498.400	
PHILLIPS 66	58,928	75.810	4,467,331.680	
LIBERTY MEDIA CORP	9,165	135.200	1,239,108.000	

	FACEBOOK INC	175,797	55.910	9,828,810.270	
	ADT CORP	23,368	39.010	911,585.680	
	SERVICENOW INC	12,789	57.090	730,124.010	
	WORKDAY INC	6,561	87.880	576,580.680	
	KRAFT FOODS GROUP INC	59,385	53.490	3,176,503.650	
	ABBVIE INC	161,206	49.830	8,032,894.980	
	ZOETIS INC	51,278	31.780	1,629,614.840	
	NEWS CORP/NEW-CL A	43,948	17.150	753,708.200	
	SPRINT CORP	97,357	9.090	884,975.130	
	NOBLE CORP PLC	24,088	35.170	847,174.960	
	PERRIGO CO PLC	14,130	160.880	2,273,234.400	
アメリカ・ドル	小計	31,599,855		1,707,967,174.270 (176,467,168,446)	
イギリス・ポンド	ABERDEEN ASSET MGMT	92,697	4.599	426,313.500	
	AMEC PLC	28,599	11.050	316,018.950	
	ANTOFAGASTA PLC	44,020	7.840	345,116.800	
	SEVERN TRENT PLC	28,908	16.550	478,427.400	
	BHP BILLITON PLC	214,510	17.970	3,854,744.700	
	BARCLAYS PLC	1,567,569	2.917	4,572,598.770	
	BT GROUP PLC	800,927	3.847	3,081,166.160	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	104,248	8.395	875,161.960	
	AGGREKO PLC	27,635	17.140	473,663.900	
	TULLOW OIL PLC	97,933	8.780	859,851.740	
	BUNZL PLC	34,501	14.170	488,879.170	
	EASYJET PLC	13,628	16.910	230,449.480	
	CAPITA PLC	64,410	10.370	667,931.700	
	AVIVA PLC	295,997	4.762	1,409,537.710	
	CRODA INTERNATIONAL	12,849	23.520	302,208.480	
	DIAGEO PLC	258,978	19.960	5,169,200.880	
	SCHRODERS PLC	12,609	25.900	326,573.100	
	NATIONAL GRID PLC	375,807	7.770	2,920,020.390	
	GKN PLC	182,053	3.897	709,460.540	
	KINGFISHER PLC	234,699	3.850	903,591.150	
	BAE SYSTEMS PLC	323,539	4.297	1,390,247.080	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	193,252	30.425	5,879,692.100	
	COBHAM PLC	88,449	2.889	255,529.160	
	NEXT PLC	15,179	61.950	940,339.050	
	REXAM PLC	94,964	5.035	478,143.740	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	100,666	22.240	2,238,811.840	
	IMI PLC	37,027	15.640	579,102.280	
	JOHNSON MATTHEY PLC	21,473	33.760	724,928.480	
	SABMILLER PLC	96,580	30.205	2,917,198.900	
	ANGLO AMERICAN PLC	140,108	12.730	1,783,574.840	
	COMPASS GROUP PLC	184,252	9.585	1,766,055.420	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,903,533	6.770	12,886,918.410	

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	574,217	2.281	1,309,788.970	
ARM HOLDINGS PLC	141,802	9.780	1,386,823.560	
CENTRICA PLC	543,390	3.262	1,772,538.180	
UNILEVER PLC	128,821	24.020	3,094,280.420	
MEGGITT PLC	71,707	5.350	383,632.450	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	202,760	2.513	509,535.880	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82,325	6.595	542,933.370	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	411,297	0.987	405,950.130	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	38,784	26.600	1,031,654.400	
PEARSON PLC	89,377	13.180	1,177,988.860	
PERSIMMON PLC	29,923	13.460	402,763.580	
PRUDENTIAL PLC	257,589	13.700	3,528,969.300	
RIO TINTO PLC	129,113	31.770	4,101,920.010	
VODAFONE GROUP PLC	4,941,395	2.337	11,548,040.110	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	65,566	46.490	3,048,163.340	
REED ELSEVIER PLC	127,990	9.070	1,160,869.300	
OLD MUTUAL PLC	538,950	1.955	1,053,647.250	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	194,037	12.450	2,415,760.650	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	234,054	3.680	861,318.720	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	18.800	374,026.000	
SSE PLC	99,390	13.440	1,335,801.600	
SERCO GROUP PLC	50,772	5.145	261,221.940	
BP PLC	1,922,200	4.958	9,530,267.600	
SHIRE PLC	57,161	29.110	1,663,956.710	
SAGE GROUP PLC(THE)	98,062	4.017	393,915.050	
INVENSYS PLC	71,055	5.090	361,669.950	
SMITHS GROUP PLC	36,935	15.050	555,871.750	
STANDARD CHARTERED PLC	245,267	12.920	3,168,849.640	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,053,661	0.840	4,245,075.240	
TATE & LYLE PLC	36,876	7.755	285,973.380	
BG GROUP PLC	350,815	13.150	4,613,217.250	
TESCO PLC	818,585	3.265	2,672,680.020	
3I GROUP PLC	119,685	3.940	471,558.900	
SMITH & NEPHEW PLC	93,652	8.745	818,986.740	
GLAXOSMITHKLINE PLC	499,201	15.910	7,942,287.910	
WEIR GROUP	18,336	21.030	385,606.080	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	17,421	18.000	313,578.000	
BABCOCK INT'L GROUP	43,025	13.920	598,908.000	
WPP PLC	130,749	13.590	1,776,878.910	
WOLSELEY PLC	27,936	34.660	968,261.760	
ASTRAZENECA PLC	130,210	36.635	4,770,243.350	

	WHITBREAD PLC	19,002	38.910	739,367.820	
	CARNIVAL PLC	17,669	25.990	459,217.310	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	158,973	4.744	754,167.910	
	INTERTEK GROUP PLC	19,178	30.690	588,572.820	
	WILLIAM HILL PLC	104,797	3.807	398,962.170	
	BURBERRY GROUP PLC	41,539	14.610	606,884.790	
	INVESTEC PLC	50,655	4.390	222,375.450	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	25,287	19.930	503,969.910	
	ICAP PLC	52,823	4.519	238,707.130	
	ITV PLC	345,353	2.028	700,375.880	
	SAINSBURY (J) PLC	147,222	3.512	517,043.660	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	10,689	38.350	409,923.150	
	G4S PLC	171,953	2.510	431,602.030	
	ADMIRAL GROUP PLC	22,361	13.350	298,519.350	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	397,909	21.900	8,714,207.100	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	248,943	23.030	5,733,157.290	
	INMARSAT PLC	46,334	7.500	347,505.000	
	PETROFAC LTD	29,942	12.580	376,670.360	
	STANDARD LIFE PLC	223,263	3.770	841,701.510	
	EXPERIAN PLC	98,499	11.310	1,114,023.690	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	14.850	385,015.950	
	TUI TRAVEL PLC	52,043	4.213	219,257.150	
	MELROSE PLC	106,965	3.047	325,922.350	
	FRESNILLO PLC NPR	23,779	7.035	167,285.260	
	RESOLUTION LTD	122,660	3.587	439,981.420	
	GLENCORE XSTRATA PLC	1,079,568	3.189	3,442,742.350	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	107,350	2.491	267,408.850	
	COCA-COLA HBC AG	25,293	17.980	454,768.140	
イギリス・ポンド	小計	30,211,561		177,196,207.840 (30,020,581,532)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	133,450	19.230	2,566,243.500	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	181,502	14.010	2,542,843.020	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.890	1,108,674.700	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	66,569	28.800	1,917,187.200	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	89,826	146.200	13,132,561.200	
イスラエル・シュケル	小計	659,577		21,267,509.620 (630,156,310)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	43.950	562,340.250	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	283,459	31.330	8,880,770.470	

AMCOR LTD	123,722	10.360	1,281,759.920	
WESTPAC BANKING CORPORATION	321,420	32.010	10,288,654.200	
BANK OF QUEENSLAND LTD	30,216	12.300	371,656.800	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	5.140	766,918.840	
TELSTRA CORP LTD	448,020	5.250	2,352,105.000	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	11.890	378,981.860	
AMP LTD	324,183	4.450	1,442,614.350	
ASX LTD	22,288	36.500	813,512.000	
BHP BILLITON LTD	328,942	36.560	12,026,119.520	
CALTEX AUSTRALIA LTD	14,149	19.340	273,641.660	
ALS LTD	34,895	8.880	309,867.600	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	101,749	3.310	336,789.190	
COMPUTERSHARE LT	50,472	11.350	572,857.200	
CSL LIMITED	50,259	67.800	3,407,560.200	
TRANSURBAN GROUP	160,451	6.820	1,094,275.820	
COCA-COLA AMATIL LTD	60,500	12.170	736,285.000	
COCHLEAR LTD	5,226	59.880	312,932.880	
ORIGIN ENERGY LTD	107,742	13.810	1,487,917.020	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	163,026	77.000	12,553,002.000	
BORAL LIMITED	84,744	4.790	405,923.760	
RIO TINTO LIMITED	42,941	63.510	2,727,182.910	
APA GROUP	86,227	6.070	523,397.890	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	223,859	5.790	1,296,143.610	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,423	46.000	203,458.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	12.940	463,122.600	
ORICA LTD	34,301	23.900	819,793.900	
LEIGHTON HLDGS LTD	21,757	16.200	352,463.400	
SYDNEY AIRPORT	115,539	3.730	430,960.470	
MACQUARIE GROUP LTD	30,846	53.980	1,665,067.080	
WORLEYPARSONS LTD	23,411	16.840	394,241.240	
SUNCORP GROUP LTD	140,404	13.150	1,846,312.600	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	236,120	34.240	8,084,748.800	
NEWCREST MINING LTD	92,633	8.870	821,654.710	
INCITEC PIVOT LTD	165,148	2.850	470,671.800	
TOLL HOLDINGS LTD	72,011	5.730	412,623.030	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	127,737	1.120	143,065.440	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	121,525	11.890	1,444,932.250	
SANTOS LTD	104,285	14.260	1,487,104.100	
SONIC HEALTHCARE	45,868	17.050	782,049.400	

TABCORP HOLDINGS LTD	30,088	3.560	107,113.280	
WESFARMERS LTD	103,161	43.620	4,499,882.820	
ALUMINA LIMITED	388,179	1.155	448,346.740	
ILUKA RESOURCES LIMI	55,637	8.280	460,674.360	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	64,556	37.570	2,425,368.920	
WOOLWORTHS LTD	124,027	34.210	4,242,963.670	
METCASH LTD	79,084	3.100	245,160.400	
SEEK LTD	29,830	13.190	393,457.700	
TATTS GROUP LTD	141,350	3.050	431,117.500	
SP AUSNET	234,780	1.250	293,475.000	
AGL ENERGY LTD	57,550	15.050	866,127.500	
BRAMBLES LTD	152,289	9.070	1,381,261.230	
ASCIANO LTD	108,957	5.640	614,517.480	
CROWN RESORTS LTD	46,332	17.210	797,373.720	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	109,246	2.550	278,577.300	
AURIZON HOLDINGS LTD	210,167	4.860	1,021,411.620	
TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	4.860	274,113.720	
オーストラリア・ドル 小計	6,625,798		103,806,421.730 (9,691,367,533)	
カナダ・ドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	17,334	31.030	537,874.020	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	15,943	77.420	1,234,307.060	
BARRICK GOLD CORP	120,690	19.730	2,381,213.700	
ATCO LTD	7,193	47.250	339,869.250	
TALISMAN ENERGY INC	100,146	12.170	1,218,776.820	
BANK OF MONTREAL	65,347	71.700	4,685,379.900	
BANK OF NOVA SCOTIA	124,468	64.270	7,999,558.360	
NATIONAL BANK OF CANADA	17,129	88.100	1,509,064.900	
BCE INC	26,643	46.410	1,236,501.630	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	55,291	40.590	2,244,261.690	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	32,566	141.820	4,618,510.120	
BOMBARDIER INC 'B'	155,097	4.490	696,385.530	
SAPUTO INC	15,632	50.190	784,570.080	
BLACKBERRY LTD	56,591	9.110	515,544.010	
CGI GROUP INC	22,652	34.360	778,322.720	
CAE INC	31,436	14.010	440,418.360	
CAMECO CORP	45,703	21.780	995,411.340	
ROGERS COMM-CL B	35,628	47.040	1,675,941.120	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	40,469	88.650	3,587,576.850	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	111,566	35.850	3,999,641.100	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,877	99.170	681,992.090	
CANADIAN UTILITIES LTD	15,036	36.760	552,723.360	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,758	58.830	4,927,483.140	

AGRIUM INC	16,162	99.260	1,604,240.120	
YAMANA GOLD INC	67,520	10.130	683,977.600	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,491	59.020	678,198.820	
OPEN TEXT CORP	7,329	96.500	707,248.500	
ELDORADO GOLD CORP	78,309	6.820	534,067.380	
EMPIRE CO LTD	5,031	72.420	364,345.020	
KINROSS GOLD CORP	125,461	4.970	623,541.170	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	26.220	449,935.200	
FORTIS INC	20,884	30.300	632,785.200	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	60,600	18.660	1,130,796.000	
TELUS CORP	26,152	36.810	962,655.120	
GREAT WEST LIFECO INC	32,106	31.690	1,017,439.140	
IMPERIAL OIL LTD	32,537	45.360	1,475,878.320	
ENBRIDGE INC	80,635	46.710	3,766,460.850	
IGM FINANCIAL INC	6,816	55.150	375,902.400	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	49,079	3.610	177,175.190	
MANULIFE FINANCIAL CORP	190,370	21.590	4,110,088.300	
LOBLAW CO LTD	12,181	44.000	535,964.000	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	35,435	17.780	630,034.300	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	45.690	439,994.700	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,217	90.750	2,106,942.750	
SUN LIFE FINANCIAL INC	61,535	37.740	2,322,330.900	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,025	417.500	427,937.500	
METRO INC	10,154	66.000	670,164.000	
HUSKY ENERGY INC	35,673	33.280	1,187,197.440	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	37,273	39.630	1,477,128.990	
METHANEX CORP	9,418	63.090	594,181.620	
ONEX CORP	10,676	58.200	621,343.200	
GOLDCORP INC	75,826	25.040	1,898,683.040	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	88,758	36.420	3,232,566.360	
POWER CORP OF CANADA	39,841	30.660	1,221,525.060	
POWER FINANCIAL CORP	23,521	34.670	815,473.070	
ROYAL BANK OF CANADA	146,553	71.210	10,436,039.130	
SNC-LAVALIN GROUP INC	16,326	49.430	806,994.180	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	17,692	163.440	2,891,580.480	
SHAW COMM INC-B	39,522	25.310	1,000,301.820	
SHOPPERS DRUG MART CORP	22,208	59.080	1,312,048.640	
NEW GOLD INC	51,627	5.950	307,180.650	
SUNCOR ENERGY INC	150,001	37.270	5,590,537.270	

ENCANA CORP	71,646	18.770	1,344,795.420	
TECK RESOURCES LTD-CL B	60,753	26.060	1,583,223.180	
THOMSON REUTERS CORP	41,062	40.700	1,671,223.400	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	93,830	97.800	9,176,574.000	
TRANSCANADA CORP	73,427	48.200	3,539,181.400	
TRANSALTA CORP	34,014	13.960	474,835.440	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	78.540	372,515.220	
INTACT FINANCIAL CORP	12,288	69.490	853,893.120	
SILVER WHEATON CORP	41,308	23.580	974,042.640	
CATAMARAN CORP	20,272	54.540	1,105,634.880	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,024	46.940	752,166.560	
CI FINANCIAL CORP	16,122	35.250	568,300.500	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	45.500	717,944.500	
KEYERA CORP	8,738	65.770	574,698.260	
ALTAGAS LTD	12,358	40.670	502,599.860	
PEMBINA PIPELINE CORP	28,565	37.250	1,064,046.250	
TIM HORTONS INC	14,007	59.980	840,139.860	
DOLLARAMA INC	6,908	82.490	569,840.920	
BAYTEX ENERGY CORP	11,962	39.990	478,360.380	
MEG ENERGY CORP	17,794	30.960	550,902.240	
ATHABASCA OIL CORP	42,987	6.790	291,881.730	
CENOVUS ENERGY INC W/I	72,925	29.760	2,170,248.000	
ENERPLUS CORP	20,814	18.940	394,217.160	
VERMILION ENERGY INC	8,291	60.800	504,092.800	
PENN WEST PETROLEUM LTD	52,457	9.040	474,211.280	
ARC RESOURCES LTD	30,599	28.150	861,361.850	
CANADIAN OIL SANDS LTD	53,022	20.000	1,060,440.000	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	33.200	370,777.600	
PENGROWTH ENERGY CORP	36,505	6.550	239,107.750	
カナダ・ドル 小計	3,879,297		141,543,466.780 (13,431,059,562)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.870	483,750.000	
SEMBCORP INDUSTRIES	139,000	5.310	738,090.000	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	169,000	4.030	681,070.000	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,640	0.530	435,469.200	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	174,000	17.250	3,001,500.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	9.510	351,870.000	
SEMBCORP MARINE	108,000	4.280	462,240.000	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	36.630	476,190.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	7.060	614,220.000	
CAPITALAND LTD	276,000	2.950	814,200.000	
GENTING SINGAPORE PLC	584,400	1.495	873,678.000	
KEPPEL CORP LTD	137,500	10.980	1,509,750.000	

	COMFORTDELGRO CORP LTD	90,000	2.030	182,700.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	1.040	428,233.520	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	280,200	9.730	2,726,346.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	819,867	3.550	2,910,527.850	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	10.070	658,578.000	
	KEPPEL LAND LTD	95,000	3.150	299,250.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	125,000	20.990	2,623,750.000	
	STARHUB LTD	65,000	4.250	276,250.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.310	662,000.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.240	286,440.000	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	120,000	1.930	231,600.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	2.920	832,200.000	
	シンガポール・ドル 小計	5,459,770		22,559,902.570 (1,841,339,248)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	157,904	29.770	4,700,802.080	
	SYNGENTA AG	9,713	351.900	3,418,004.700	
	NESTLE SA-REGISTERED	328,388	66.350	21,788,543.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	52,226	88.150	4,603,721.900	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	71,471	256.600	18,339,458.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,842	130.900	633,817.800	
	SIKA INHABER	188	3,145.000	591,260.000	
	SGS SA-REG	576	2,069.000	1,191,744.000	
	SULZER AG-REG	3,187	138.900	442,674.300	
	NOVARTIS AG-REG SHS	234,010	73.150	17,117,831.500	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,702	113.700	648,317.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	69	1,108.000	76,452.000	
	SWISSCOM AG-REG	2,309	478.200	1,104,163.800	
	ABB LTD	220,149	23.700	5,217,531.300	
	ADECCO SA-REG	11,879	71.850	853,506.150	
	GEBERIT AG	4,109	275.200	1,130,796.800	
	LONZA GROUP AG-REG	5,846	92.700	541,924.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	4,036.000	367,276.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	49,045.000	637,585.000	
	UBS AG-REGISTERED	372,228	18.760	6,982,997.280	
	GIVAUDAN-REG	909	1,249.000	1,135,341.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	15,295	265.300	4,057,763.500	
	HOLCIM LTD-REG	22,704	68.750	1,560,900.000	
	ACTELION	12,017	83.250	1,000,415.250	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	122.700	554,481.300	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,445	125.000	805,625.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,715	565.500	1,535,332.500	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	97.850	543,263.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,824	132.400	241,497.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,553	196.700	698,875.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,280	315.750	404,160.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,477	70.700	387,223.900	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	239.000	480,390.000	
	ARYZTA AG	8,596	71.800	617,192.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,855	43.400	1,035,307.000	
	SWISS RE LTD	36,822	80.000	2,945,760.000	
	TRANSOCEAN LTD	39,921	43.480	1,735,765.080	
スイス・フラン	小計	1,678,394		110,127,701.840 (12,648,166,557)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	66,188	177.900	11,774,845.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,459	164.300	6,976,013.700	
	ELEKTA AB	32,078	99.450	3,190,157.100	
	ERICSSON LM-B SHS	319,794	78.150	24,991,901.100	
	GETINGE AB-B SHS	22,760	217.100	4,941,196.000	
	SKF AB-B SHS	43,481	171.600	7,461,339.600	
	SANDVIK AB	108,906	88.500	9,638,181.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	162,348	85.550	13,888,871.400	
	SKANSKA AB-B SHS	39,626	130.200	5,159,305.200	
	SWEDBANK AB	88,783	182.300	16,185,140.900	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	63,427	197.000	12,495,119.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	48,233	321.400	15,502,086.200	
	VOLVO AB-B SHS	144,477	88.100	12,728,423.700	
	SCANIA AB	35,390	125.400	4,437,906.000	
	SWEDISH MATCH AB	24,727	194.200	4,801,983.400	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	75.550	1,836,242.750	
	NORDEA AB	312,909	88.200	27,598,573.800	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	126.200	2,316,148.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	28,642	163.600	4,685,831.200	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	69.800	1,902,817.800	
	INVESTOR AB-B SHS	44,529	220.200	9,805,285.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	94,656	286.200	27,090,547.200	
	ASSA ABLOY AB-B	32,006	337.600	10,805,225.600	
	TELIASONERA AB	243,599	52.600	12,813,307.400	
	LUNDIN PETROLEUM AB	28,131	121.000	3,403,851.000	
	BOLIDEN AB	17,761	98.450	1,748,570.450	
	ALFA LAVAL AB	31,389	160.100	5,025,378.900	
	KINNEVIK INVESTMENT B	23,218	303.500	7,046,663.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,723	656.000	5,066,288.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	54,633	39.940	2,182,042.020	
	HEXAGON AB	21,871	213.400	4,667,271.400	

スウェーデン・クローナ 小計		2,253,663		282,166,514.420 (4,483,625,914)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,483	581.000	6,090,623.000	
	A P MOLLER A/S	124	65,250.000	8,091,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	62	62,450.000	3,871,900.000	
	DANSKE BANK A/S	74,115	129.900	9,627,538.500	
	NOVOZYMES-B SHS	24,240	235.100	5,698,824.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	206,880	211.300	43,713,744.000	
	TDC A/S	84,208	50.000	4,210,400.000	
	COLOPLAST-B	12,458	371.200	4,624,409.600	
	DSV A/S	15,918	182.300	2,901,851.400	
WILLIAM DEMANT	2,595	510.500	1,324,747.500		
デンマーク・クローネ 小計		431,083		90,155,038.000 (1,705,733,318)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	118,545	3.600	426,762.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	41,674	8.120	338,392.880	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	9.000	665,928.000	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	209,231	2.330	487,508.230	
ニュージーランド・ドル 小計		443,442		1,918,591.110 (166,034,875)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	98,819	111.000	10,968,909.000	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	27.700	2,965,617.400	
	TELENOR ASA	65,096	145.000	9,438,920.000	
	SUBSEA 7 SA	22,609	120.000	2,713,080.000	
	ORKLA ASA	86,098	46.260	3,982,893.480	
	STATOIL ASA	117,819	152.000	17,908,488.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	21,131	262.000	5,536,322.000	
	AKER SOLUTIONS ASA	18,936	106.400	2,014,790.400	
	SEADRILL LTD	38,772	245.800	9,530,157.600	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	21,678	115.800	2,510,312.400		
ノルウェー・クローネ 小計		598,020		67,569,490.280 (1,140,572,996)	
ユーロ	CRH PLC	73,961	19.775	1,462,578.770	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	50.510	717,999.650	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.314	760,772.380	
	UMICORE	13,643	32.565	444,284.290	
	AIR LIQUIDE	32,433	98.570	3,196,920.810	
	AIRBUS GROUP NV	62,297	55.780	3,474,926.660	
	AXA	177,702	20.150	3,580,695.300	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,954	12.285	478,549.890	
	ADIDAS AG	20,732	89.040	1,845,977.280	
	ASSICURAZIONI GENERALI	112,448	17.080	1,920,611.840	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	157,125	1.234	193,892.250	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	40,778	16.720	681,808.160	

DANONE	57,035	51.320	2,927,036.200	
SAFRAN SA	28,086	51.530	1,447,271.580	
INTESA SANPAOLO	1,125,068	1.932	2,173,631.370	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,402	84.150	2,894,928.300	
ACCOR SA	17,313	34.575	598,596.970	
BOSKALIS WESTMINSTER CT	9,683	37.905	367,034.110	
BOUYGUES	22,659	28.970	656,431.230	
BNP PARIBAS	99,978	57.950	5,793,725.100	
REED ELSEVIER NV	68,686	15.435	1,060,168.410	
THALES SA	8,128	47.195	383,600.960	
CAP GEMINI SA	15,406	51.550	794,179.300	
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,567	83.920	551,102.640	
CHRISTIAN DIOR	5,133	131.250	673,706.250	
CGG	16,618	12.665	210,466.970	
ALCATEL-LUCENT	298,978	3.271	977,957.030	
UNICREDIT SPA	437,673	6.005	2,628,226.360	
NATIXIS	102,266	4.734	484,127.240	
KONINKLIJKE DSM NV	15,919	56.910	905,950.290	
DELHAIZE GROUP	12,505	45.155	564,663.270	
COMMERZBANK AG	96,311	13.685	1,318,016.030	
FRESENIUS SE & CO KGAA	13,555	114.400	1,550,692.000	
UNITED INTERNET	9,260	32.005	296,366.300	
FUCHS PETROLUB SE PREF	4,411	73.610	324,693.710	
PUBLICIS GROUPE	17,067	65.130	1,111,573.710	
MAN SE	3,396	89.550	304,111.800	
IBERDROLA SA	492,622	4.636	2,283,795.590	
ENI SPA	253,048	17.330	4,385,321.840	
IMERYS SA	4,401	63.000	277,263.000	
JERONIMO MARTINS	33,291	14.000	466,074.000	
KBC GROUPE	24,972	45.200	1,128,734.400	
LAFARGE SA	19,853	56.120	1,114,150.360	
HANNOVER RUECK SE	5,730	60.220	345,060.600	
WARTSILA OYJ	21,069	38.940	820,426.860	
L'OREAL	25,480	122.850	3,130,218.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	25,343	126.350	3,202,088.050	
LAGARDERE S.C.A.	13,927	27.070	377,003.890	
GEA GROUP AG	20,171	34.650	698,925.150	
MEDIOBANCA SPA	55,752	6.900	384,688.800	
MICHELIN(CGDE)-B	20,134	78.770	1,585,955.180	
CONTINENTAL AG	10,728	159.950	1,715,943.600	
DEUTSCHE POST AG-REG	90,507	25.990	2,352,276.930	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	34.030	319,847.970	
AXEL SPRINGER SE	6,021	49.320	296,955.720	
OMV AG	15,010	35.670	535,406.700	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	67,989	3.529	239,933.180	

PERNOD-RICARD	20,773	81.510	1,693,207.230	
PIRELLI & C	30,073	11.660	350,651.180	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	14,295	77.990	1,114,867.050	
RENAULT SA	21,020	64.770	1,361,465.400	
REPSOL SA	86,855	18.910	1,642,428.050	
REMY COINTREAU	3,877	59.050	228,936.850	
MERCK KGAA	6,349	130.000	825,370.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	82,955	76.090	6,312,045.950	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,154	41.130	1,816,054.020	
SAIPEM	35,323	16.380	578,590.740	
RWE AG	50,913	25.525	1,299,554.320	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	19,633	38.220	750,373.260	
SOCIETE GENERALE-A	73,735	44.945	3,314,019.570	
VINCI S.A.	47,191	48.200	2,274,606.200	
SODEXO	9,625	75.260	724,377.500	
SOLVAY SA	5,471	108.200	591,962.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	55,445	63.250	3,506,896.250	
VIVENDI SA	123,403	19.020	2,347,125.060	
SAP AG	95,146	61.210	5,823,886.660	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	9,593	69.160	663,451.880	
TELEFONICA S.A	419,237	12.260	5,139,845.620	
TOTAL SA	217,116	43.055	9,347,929.380	
VALLOUREC	11,847	40.345	477,967.210	
VALEO	8,400	85.000	714,000.000	
E.ON SE	185,310	13.130	2,433,120.300	
VOEST-ALPINE AG	9,875	35.610	351,648.750	
ZODIAC AEROSPACE	3,509	129.800	455,468.200	
HENKEL AG & CO KGAA	14,673	74.160	1,088,149.680	
METRO AG	11,655	35.850	417,831.750	
SIEMENS AG-REG	80,638	98.520	7,944,455.760	
UPM-KYMMENE OYJ	46,308	12.880	596,447.040	
ING GROEP NV-CVA	388,916	10.595	4,120,565.020	
BAYER AG	84,009	98.220	8,251,363.980	
STORA ENSO OYJ-R SHS	67,549	7.585	512,359.160	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,679	81.450	1,358,504.550	
DAIMLER AG	97,645	62.870	6,138,941.150	
BASF SE	94,899	77.490	7,353,723.510	
CELESIO AG	8,447	24.165	204,121.750	
BEIERSDORF AG	10,562	73.530	776,623.860	
HOCHTIEF AG	1,935	63.930	123,704.550	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,234	57.800	764,925.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	21,622	51.600	1,115,695.200	
ORANGE	192,070	9.526	1,829,658.820	

SAMPO OYJ-A SHS	46,036	35.450	1,631,976.200	
RANDSTAD HOLDINGS	13,985	48.550	678,971.750	
ALLIANZ SE	46,088	128.500	5,922,308.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	203,441	2.852	580,213.730	
KONINKLIJKE AHOLD NV	101,654	13.120	1,333,700.480	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	19,236	34.150	656,909.400	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	17.600	480,462.400	
ERSTE GROUP BANK AG	30,671	29.000	889,459.000	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	18,428	152.600	2,812,112.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	102,748	12.700	1,304,899.600	
SOCIETE BIC SA	3,322	84.930	282,137.460	
DASSAULT SYSTEMES SA	5,838	86.310	503,877.780	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,046	26.855	538,335.330	
HEINEKEN NV	21,379	47.120	1,007,378.480	
AKZO NOBEL	24,058	56.030	1,347,969.740	
ASML HOLDING NV	37,808	66.440	2,511,963.520	
AEGON NV	167,051	6.807	1,137,116.150	
VOLKSWAGEN AG	3,623	196.800	713,006.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,120	202.600	2,860,712.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	592,047	9.492	5,619,710.120	
KERING	7,231	145.350	1,051,025.850	
CNP ASSURANCES	22,463	15.350	344,807.050	
FORTUM OYJ	43,978	16.500	725,637.000	
AGEAS	19,877	32.780	651,568.060	
UCB SA	10,367	52.090	540,017.030	
THYSSENKRUPP AG	44,483	18.210	810,035.430	
UNILEVER NV-CVA	166,176	28.475	4,731,861.600	
CARREFOUR SA	61,756	28.500	1,760,046.000	
GAS NATURAL SDG SA	36,738	18.240	670,101.120	
ATOS	6,025	66.480	400,542.000	
NOKIA OYJ	391,422	5.960	2,332,875.120	
POHJOLA BANK PLC	9,831	15.000	147,465.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	100,900	27.670	2,791,903.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,008	21.260	723,010.080	
SANOFI	121,234	73.200	8,874,328.800	
IMMOFINANZ AG	131,110	3.474	455,476.140	
STMICROELECTRONICS NV	80,884	5.763	466,134.490	
ELISA OYJ	13,898	19.500	271,011.000	
BANCO SANTANDER SA	1,164,908	6.809	7,931,858.570	
METSO OYJ	10,879	24.400	265,447.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	11,690	52.680	615,829.200	
QIAGEN N.V.	27,019	17.825	481,613.670	
LINDE AG	19,271	147.400	2,840,545.400	
FIAT SPA	92,315	6.790	626,818.850	
DEUTSCHE BANK AG-REG	102,711	38.565	3,961,049.710	

BMW VORZUG	6,146	62.850	386,276.100	
K & S	18,738	23.220	435,096.360	
SUEDZUCKER AG	11,866	21.590	256,186.940	
ENEL SPA	672,106	3.304	2,220,638.220	
COLRUYT NV	7,116	40.715	289,727.940	
VOPAK (KON.)	8,976	41.300	370,708.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	297,815	12.205	3,634,832.070	
BANCO POPULAR ESPANOL	144,093	5.559	801,012.980	
FINMECCANICA SPA	55,583	5.765	320,435.990	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	103,908	7.667	796,662.630	
KONINKLIJKE KPN NV	366,685	2.638	967,315.030	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.288	210,477.690	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,044	61.790	1,238,518.760	
BANCO SABADELL	344,219	2.132	733,874.900	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,358	67.450	631,197.100	
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VPR	516	0.001	0.510	
FRAPORT AG	3,149	55.100	173,509.900	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	44.420	355,981.880	
INDITEX	22,630	117.900	2,668,077.000	
JC DECAUX INTERNATIONAL	8,589	31.135	267,418.510	
ANDRITZ AG	9,129	43.400	396,198.600	
MAPFRE SA	80,219	3.416	274,028.100	
ESSILOR INTL	19,980	81.400	1,626,372.000	
SNAM SPA	225,511	4.042	911,515.460	
CREDIT AGRICOLE SA	111,051	10.200	1,132,720.200	
ENAGAS	15,332	19.710	302,193.720	
WENDEL	4,087	106.000	433,222.000	
TENARIS SA	46,257	15.810	731,323.170	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	5.530	414,495.620	
TELECOM ITALIA SPA	1,035,863	0.806	834,905.570	
TELECOM ITALIA-RNC	792,074	0.630	499,006.620	
ATLANTIA SPA	38,919	17.180	668,628.420	
ILIAD SA	2,821	162.100	457,284.100	
BELGACOM SA	13,498	21.280	287,237.440	
SES FDR	28,786	23.470	675,607.420	
TERNA SPA	179,290	3.636	651,898.440	
GRIFOLS SA	17,550	37.935	665,759.250	
FERROVIAL SA	45,760	14.515	664,206.400	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	47.390	324,905.840	
SKY DEUTSCHLAND AG	45,911	7.502	344,424.320	
EXOR SPA	9,585	29.600	283,716.000	
NESTE OIL OYJ	10,692	14.620	156,317.040	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	26.600	242,033.400	

IRISH BANK RESOLUTION CORP	91,316	0.000	0.000	
FUGRO CERT	7,283	42.605	310,292.210	
KONE OYJ	31,230	32.230	1,006,542.900	
GDF SUEZ	136,591	16.770	2,290,631.070	
ALSTOM	22,916	26.195	600,284.620	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	43.295	217,557.370	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	22.035	384,510.750	
ELECTRICITE DE FRANCE	23,911	24.980	597,296.780	
DEUTSCHE WOHNEN AG	32,216	14.410	464,232.560	
ARKEMA SA	5,658	80.540	455,695.320	
LEGRAND SA	27,260	38.550	1,050,873.000	
ADP	2,540	82.810	210,337.400	
ORION OYJ	8,051	20.530	165,287.030	
RTL GROUP SA	3,848	96.930	372,986.640	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	11.955	406,685.190	
SCOR SE	14,425	25.640	369,857.000	
REXEL SA	20,799	19.965	415,252.030	
PRYSMIAN SPA	14,445	18.620	268,965.900	
CAIXABANK	156,629	4.313	675,540.870	
BUREAU VERITAS SA	24,211	21.045	509,520.490	
GROUPE EUROTUNNEL SA	46,533	8.400	390,877.200	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	13.320	302,004.360	
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	42,576	30.560	1,301,122.560	
TNT EXPRESS NV W/I	34,234	6.849	234,468.660	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	2,019	96.010	193,844.190	
ENEL GREEN POWER SPA	224,723	1.885	423,602.850	
BRENNTAG AG	5,161	128.450	662,930.450	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	119,317	5.166	616,391.620	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	6.575	385,341.020	
DELTA LLOYD NV	19,898	18.940	376,868.120	
EDENRED	18,682	23.700	442,763.400	
ZIGGO NV	16,833	33.800	568,955.400	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	31,777	6.145	195,269.660	
HUGO BOSS AG -ORD	4,016	97.740	392,523.840	
OSRAM LICHT AG	9,503	44.000	418,132.000	
GEMALTO	8,626	80.200	691,805.200	
OCI NV	10,713	33.400	357,814.200	
CNH INDUSTRIAL NV	109,614	8.420	922,949.880	
REPSOL SA - RTS	95,127	0.506	48,134.260	
IBERDROLA SA - RTS	492,622	0.129	63,548.230	

ユーロ 小計		21,101,265		300,936,179.530 (42,495,197,912)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	36,200	70.000	2,534,000.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	23.950	5,221,100.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	31.600	3,528,456.000	
	CLP HOLDINGS LTD	204,000	60.200	12,280,800.000	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	114,000	17.080	1,947,120.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	10.600	5,643,440.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	136,000	120.100	16,333,600.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	47.200	2,312,800.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	108,200	126.900	13,730,580.000	
	MTR CORP	165,500	28.550	4,725,025.000	
	FIRST PACIFIC CO	223,500	8.300	1,855,050.000	
	HANG SENG BANK LTD	85,500	122.500	10,473,750.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	111,700	44.500	4,970,650.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	130,500	59.150	7,719,075.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	163,750	59.600	9,759,500.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	564,740	17.160	9,690,938.400	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	222,000	106.400	23,620,800.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	88,000	33.300	2,930,400.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	208,000	77.050	16,026,400.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	88,000	26.150	2,301,200.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	451,500	24.300	10,971,450.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	86,000	24.500	2,107,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	430,700	9.920	4,272,544.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	14.960	3,440,800.000	
	SINO LAND CO	257,400	10.700	2,754,180.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	164,000	96.900	15,891,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	73,500	88.150	6,479,025.000	
	WHEELOCK & CO LTD	107,000	36.100	3,862,700.000	
	SJM HOLDINGS LTD	196,000	25.350	4,968,600.000	
	WYNN MACAU LTD	169,600	36.700	6,224,320.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	89,600	33.850	3,032,960.000		
AIA GROUP LTD	1,241,200	37.200	46,172,640.000		
SANDS CHINA LTD	240,000	63.500	15,240,000.000		
SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	20.400	3,329,280.000		
香港・ドル 小計		7,460,350		286,351,783.400 (3,814,205,755)	
合計		112,402,075		298,535,209,958 (298,535,209,958)	

(2) 株式以外の有価証券

平成26年1月14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	467,624.310	
		DEXUS PROPERTY GROUP	553,747.000	575,896.880	
		FEDERATION CENTRES	146,114.000	346,290.180	
		GOODMAN GROUP	155,160.000	740,113.200	
		GPT GROUP	198,416.000	714,297.600	
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	520,614.600	
		MIRVAC GROUP	399,690.000	689,465.250	
		STOCKLAND	210,736.000	796,582.080	
		WESTFIELD GROUP	201,312.000	2,039,290.560	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	326,593.000	996,108.650	
	オーストラリア・ドル 小計		2,474,207.000	7,886,283.310 (736,263,410)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	295,906.000	642,116.020	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	308,060.000	
		CAPITAMALL TRUST	294,800.000	549,802.000	
シンガポール・ドル 小計		801,706.000	1,499,978.020 (122,428,206)		
投資信託受益証券 合計			3,275,913	858,691,616 (858,691,616)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	45,817.000	936,957.650	
		AMERICAN TOWER CORP	40,012.000	3,286,585.680	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	88,038.000	914,714.820	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,610.000	1,402,836.300	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,442.000	1,703,391.200	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	369,872.250	
		COLE REAL ESTATE INVESTMENT INC	50,958.000	725,641.920	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,517.000	779,108.570	
		DUKE REALTY TRUST	38,117.000	568,705.640	
		EQUITY RESIDENTIAL	37,715.000	2,007,192.300	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,764.000	809,552.280	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,720.000	951,686.400	
		HCP INC	44,698.000	1,703,440.780	
		HEALTH CARE REIT INC	30,578.000	1,710,839.100	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	80,629.000	1,538,401.320	
		KIMCO REALTY	32,980.000	667,515.200	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	16,250.000	557,700.000	
		PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	586,419.840	
PROLOGIS INC	53,944.000	1,982,442.000			

	PUBLIC STORAGE	14,278.000	2,198,240.880	
	RAYONIER INC	10,834.000	449,936.020	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	641,778.690	
	REGENCY CENTERS CORP	10,144.000	476,260.800	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,510.000	4,889,406.700	
	SL GREEN	10,737.000	989,414.550	
	THE MACERICH COMPANY	15,776.000	922,264.960	
	UDR INC	28,307.000	661,251.520	
	VENTAS INC	31,176.000	1,867,442.400	
	VORNADO REALTY TRUST	16,326.000	1,484,686.440	
	WEYERHAEUSER CO	60,041.000	1,836,053.780	
アメリカ・ドル 小計		923,316.000	39,619,739.990 (4,093,511,536)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	82,388.000	531,814.540	
	HAMMERSON PLC	68,046.000	344,993.220	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	279,359.850	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	85,101.000	847,180.450	
	SEGRO PLC	87,111.000	298,529.390	
イギリス・ポンド 小計		411,756.000	2,301,877.450 (389,984,078)	
カナダ・ドル	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	24,845.000	502,117.450	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	209,119.190	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	399,932.680	
カナダ・ドル 小計		50,340.000	1,111,169.320 (105,438,857)	
ユーロ	CORIO NV	7,710.000	252,309.750	
	GECINA SA	2,977.000	286,566.020	
	ICADE	3,001.000	198,066.000	
	KLEPIERRE	13,172.000	443,896.400	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	9,344.000	1,748,262.400	
ユーロ 小計		36,204.000	2,929,100.570 (413,618,291)	
香港・ドル	LINK REIT/THE	240,500.000	8,489,650.000	
香港・ドル 小計		240,500.000	8,489,650.000 (113,082,138)	
投資証券 合計		1,662,116	5,115,634,900 (5,115,634,900)	
合計			5,974,326,516 (5,974,326,516)	

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、内数で表示してあります。

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	581銘柄	56.92%	-%	59.30%
	投資証券	30銘柄	-%	1.32%	
イギリス・ポンド	株式	101銘柄	9.68%	-%	9.99%
	投資証券	5銘柄	-%	0.13%	
イスラエル・シケル	株式	5銘柄	0.20%	-%	0.21%
オーストラリア・ドル	株式	58銘柄	3.13%	-%	3.42%
	投資信託 受益証券	10銘柄	-%	0.24%	
カナダ・ドル	株式	91銘柄	4.33%	-%	4.45%
	投資証券	3銘柄	-%	0.03%	
シンガポール・ドル	株式	24銘柄	0.59%	-%	0.64%
	投資信託 受益証券	3銘柄	-%	0.04%	
スイス・フラン	株式	37銘柄	4.08%	-%	4.15%
スウェーデン・クローナ	株式	31銘柄	1.45%	-%	1.47%
デンマーク・クローネ	株式	10銘柄	0.55%	-%	0.56%
ニュージーランド・ドル	株式	4銘柄	0.05%	-%	0.05%
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.37%	-%	0.37%
ユーロ	株式	230銘柄	13.71%	-%	14.09%
	投資証券	5銘柄	-%	0.13%	
香港・ドル	株式	34銘柄	1.23%	-%	1.29%
	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。

「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7月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,324,618	97,742,205
コール・ローン		31,643,738	39,224,638
投資信託受益証券		3,945,506,632	3,637,199,986
投資証券		23,987,440,316	23,258,633,556
派生商品評価勘定		338,580	36,897
未収入金		79,722,216	-
未収配当金		118,116,832	139,256,249
流動資産合計		28,166,092,932	27,172,093,531
資産合計		28,166,092,932	27,172,093,531
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	20
未払金		-	12,861,521
未払解約金		41,018,000	28,596,000
流動負債合計		41,018,000	41,457,541
負債合計		41,018,000	41,457,541
純資産の部			
元本等			
元本	1	35,700,508,547	33,767,135,662
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	7,575,433,615	6,636,499,672
元本等合計		28,125,074,932	27,130,635,990
純資産合計		28,125,074,932	27,130,635,990
負債純資産合計		28,166,092,932	27,172,093,531

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7月11日現在	平成26年1月14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	41,124,927,128円	35,700,508,547円
	同期中追加設定元本額	2,983,053,798円	3,061,646,164円
	同期中一部解約元本額	8,407,472,379円	4,995,019,049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）	280,570円	4,761,816円
	D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国20）	770,321円	8,818,658円
	D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国30）	1,788,834円	22,426,848円
	投資のソムリエ	53,459円	54,642,091円
	投資のソムリエ＜DC年金＞	- 円	628,414円
	D I A M 8資産バランスファ ンドN＜DC年金＞	- 円	386,582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）	513,836,995円	601,140,054円
	D I A M世界アセットバラン スファンドVA（適格機関投資家 向け）	13,549,802,224円	11,911,759,183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）	20,950,223,722円	20,347,077,372円
	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド（適格機関投資家限定）	- 円	132,635,704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）	683,752,422円	682,858,940円
	計	35,700,508,547円	33,767,135,662円
2 .	受益権の総数	35,700,508,547口	33,767,135,662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7,575,433,615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6,636,499,672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25年1月12日 至 平成25年7月11日	自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年7月11日現在	平成26年1月14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	70,422,141	47,609,246
投資証券	1,227,725,316	240,727,022
合計	1,298,147,457	193,117,776

（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25年6月25日から平成25年7月11日まで及び平成25年6月25日から平成26年1月14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7月11日 現在				平成26年1月14日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	22,250,580	-	21,912,000	338,580	13,157,267	-	13,120,370	36,897
アメリカ・ドル	22,250,580	-	21,912,000	338,580	13,157,267	-	13,120,370	36,897
買 建	-	-	-	-	474,420	-	474,400	20
カナダ・ドル	-	-	-	-	474,420	-	474,400	20
合計	22,250,580	-	21,912,000	338,580	13,631,687	-	13,594,770	36,877

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	0.7878円	0.8035円
（1万口当たり純資産額）	（7,878円）	（8,035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26年1月14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	96,706.000	228,226.160	
		ALE PROPERTY GROUP	63,506.000	176,546.680	
		ASPEN GROUP	45,418.000	68,808.270	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	23,734.000	83,069.000	
		AUSTRALAND PROPERTY GROUP	121,273.000	470,539.240	
		BWP TRUST	164,131.000	366,012.130	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	837,301.000	1,662,042.480	
		CHALLENGER DIVERSIFIED PRPT	41,006.000	104,565.300	
		CHARTER HALL GROUP	76,050.000	285,187.500	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	107,111.000	396,310.700	
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	668,922.000	829,463.280	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	424,552.000	418,183.720	
		DEXUS PROPERTY GROUP	1,584,656.000	1,648,042.240	
		FEDERATION CENTRES	479,471.000	1,136,346.270	
		GOODMAN GROUP	510,909.000	2,437,035.930	
		GPT GROUP	527,129.000	1,897,664.400	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	45,400.000	111,230.000	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	245,500.000	123,977.500	
		INVESTA OFFICE FUND	209,032.000	662,631.440	
		MIRVAC GROUP	1,231,789.000	2,124,836.020	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	224,759.000	349,500.240		
	STOCKLAND	779,160.000	2,945,224.800		
	WESTFIELD GROUP	657,855.000	6,664,071.150		
WESTFIELD RETAIL TRUST	1,012,265.000	3,087,408.250			
	オーストラリア・ドル	小計	10,177,635.000	28,276,922.700 (2,639,933,503)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	147,400.000	205,623.000	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	222,000.000	160,950.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INVT	686,361.000	1,489,403.370	

		ASCOTT RESIDENCE TRUST	285,800.000	348,676.000	
		CACHE LOGISTICS TRUST	242,000.000	262,570.000	
		CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	386,405.000	268,551.470	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	752,806.000	1,099,096.760	
		CAPITAMALL TRUST	873,064.000	1,628,264.360	
		CAPITARETAIL CHINA TRUST	218,080.000	283,504.000	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	228,000.000	376,200.000	
		CROESUS RETAIL TRUST	141,000.000	124,080.000	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	286,000.000	238,810.000	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	187,000.000	197,285.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	171,000.000	299,250.000	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	162,280.000	205,284.200	
		KEPPEL REIT	238,900.000	275,929.500	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	617,000.000	256,055.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	441,000.000	520,380.000	
		MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	597,000.000	486,555.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	395,120.000	523,534.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	500,920.000	518,452.200	
		PARKWAY LIFE REIT	115,000.000	269,100.000	
		RELIGARE HEALTH TRUST	189,000.000	141,750.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	208,000.000	221,520.000	
		SAIZEN REIT	104,400.000	97,614.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	231,000.000	176,715.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	465,000.000	353,400.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	760,291.000	1,189,855.410	
		シンガポール・ドル 小計	9,851,827.000	12,218,408.270 (997,266,483)	
		投資信託受益証券 合計	20,029,462	3,637,199,986 (3,637,199,986)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	19,061.000	475,000.120	
		AGREE REALTY CORP	5,201.000	148,280.510	
		ALEXANDER'S INC.	738.000	238,506.840	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,170.000	1,557,031.400	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	11,964.000	378,421.320	

AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	35,261.000	1,192,527.020	
AMERICAN HOMES 4 RENT	16,476.000	277,291.080	
AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	63,754.000	830,077.080	
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	5,010.000	89,679.000	
AMREIT INC	6,600.000	106,260.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	49,896.000	1,311,765.840	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	7,000.000	68,040.000	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	5,014.000	90,151.720	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25,074.000	207,612.720	
ASSOCIATED ESTATES RLTY CORP	19,260.000	301,804.200	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	41,131.000	4,969,858.730	
AVIV REIT INC	5,600.000	133,560.000	
BIOMED REALTY TRUST INC	64,753.000	1,189,512.610	
BOSTON PROPERTIES INC	51,697.000	5,355,809.200	
BRANDYWINE REALTY TRUST	52,577.000	727,665.680	
BRE PROPERTIES -CL A	26,040.000	1,489,748.400	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13,820.000	280,269.600	
CAMDEN PROPERTY TRUST	28,794.000	1,694,526.900	
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	21,271.000	195,267.780	
CBL & ASSOCIATES	57,227.000	1,022,646.490	
CEDAR REALTY TRUST INC	21,069.000	135,262.980	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	81,769.000	636,980.510	
CHATHAM LODGING TRUST	9,362.000	185,835.700	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	16,911.000	426,833.640	
COLE REAL ESTATE INVESTMENT INC	141,075.000	2,008,908.000	
COMMONWEALTH REIT	37,339.000	847,221.910	
CORESITE REALTY CORP	7,548.000	237,082.680	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	29,799.000	728,585.550	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	39,012.000	1,305,731.640	
COUSINS PROPERTIES INC	60,085.000	627,287.400	
CUBESMART	44,550.000	706,117.500	
CYRUSONE INC	6,900.000	148,143.000	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	108,021.000	748,585.530	

DDR CORP	98,184.000	1,522,833.840	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	67,350.000	773,851.500	
DIGITAL REALTY TRUST INC	43,384.000	2,178,310.640	
DOUGLAS EMMETT INC	43,708.000	1,054,236.960	
DUKE REALTY TRUST	109,959.000	1,640,588.280	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	21,557.000	525,344.090	
EAST GROUP	10,250.000	583,430.000	
EDUCATION REALTY TRUST INC	39,885.000	360,161.550	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	27,470.000	410,676.500	
EPR PROPERTIES	17,335.000	850,281.750	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,593.000	976,494.960	
EQUITY ONE INC	21,089.000	471,760.930	
EQUITY RESIDENTIAL	113,413.000	6,035,839.860	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,844.000	1,944,196.280	
EXCEL TRUST INC	16,987.000	187,026.870	
EXTRA SPACE STORAGE INC	37,108.000	1,606,776.400	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,973.000	2,291,124.710	
FELCOR LODGING TR INC	38,035.000	316,451.200	
FIRST INDUSTRIAL RT	34,020.000	564,732.000	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	20,967.000	257,684.430	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	30,337.000	364,650.740	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	181,713.000	3,701,493.810	
GEO GROUP INC	24,135.000	786,801.000	
GETTY REALTY CORP	9,123.000	169,505.340	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,808.000	88,515.280	
GLIMCHER REALTY TRUST	48,358.000	441,508.540	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	18,759.000	458,845.140	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	14,000.000	79,380.000	
HCP INC	154,378.000	5,883,345.580	
HEALTH CARE REIT INC	97,663.000	5,464,244.850	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	33,014.000	719,705.200	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	59,854.000	624,875.760	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	66,959.000	373,631.220	

HIGHWOODS PROPERTIES INC	30,219.000	1,084,862.100	
HOME PROPERTIES INC	19,141.000	1,056,583.200	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	49,914.000	1,321,722.720	
HOST HOTELS & RESORTS INC	255,851.000	4,881,637.080	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	14,932.000	329,250.600	
INLAND REAL ESTATE CORP	28,989.000	306,123.840	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	35,355.000	299,810.400	
KILROY REALTY CORP	27,681.000	1,403,426.700	
KIMCO REALTY	138,373.000	2,800,669.520	
KITE REALTY GROUP TRUST	44,988.000	282,974.520	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	34,945.000	1,060,930.200	
LEXINGTON REALTY TRUST	69,859.000	702,781.540	
LIBERTY PROPERTY TRUST	49,483.000	1,698,256.560	
LTC PROPERTIES INC	12,122.000	431,543.200	
MACK CALI	30,007.000	609,442.170	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	55,633.000	694,299.840	
MID AMERICA	25,204.000	1,547,777.640	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	16,023.000	141,803.550	
NATIONAL HEALTH INVS INC	9,505.000	552,620.700	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	41,017.000	1,284,242.270	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	41,308.000	1,267,329.440	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,912.000	80,626.320	
PARKWAY PROPERTIES INC	20,925.000	371,418.750	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,952.000	641,759.760	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	23,747.000	459,266.980	
PHYSICIANS REALTY TRUST	6,991.000	89,764.440	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	56,853.000	936,368.910	
POST PROPERTIES, INC	18,175.000	842,774.750	
PROLOGIS INC	168,759.000	6,201,893.250	
PS BUSINESS PARKS	6,781.000	517,729.350	
PUBLIC STORAGE	48,915.000	7,530,953.400	
QTS REALTY TRUST INC	4,440.000	114,152.400	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	22,457.000	348,532.640	
REALTY INCOME CORP	69,622.000	2,665,826.380	
REGENCY CENTERS CORP	31,103.000	1,460,285.850	

RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	21,663.000	315,196.650	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	64,278.000	794,476.080	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	5,800.000	76,502.000	
RLJ LODGING TRUST	41,228.000	1,027,814.040	
ROUSE PROPERTIES INC	8,644.000	173,830.840	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,195.000	734,914.300	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	12,957.000	350,357.280	
SAUL CENTERS INC	4,438.000	210,716.240	
SELECT INCOME REIT	9,626.000	260,768.340	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	63,406.000	1,387,957.340	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	12,248.000	201,602.080	
SIMON PROPERTY GROUP INC	105,062.000	16,302,470.540	
SL GREEN	32,042.000	2,952,670.300	
SOVRAN SELF STORAGE INC	10,883.000	715,013.100	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	118,575.000	1,210,650.750	
STAG INDUSTRIAL INC	15,066.000	301,771.980	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS	61,512.000	575,137.200	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	28,964.000	256,910.680	
SUN COMMUNITIES INC	11,177.000	473,569.490	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	61,301.000	803,656.110	
TANGER FACTORY OUTLET	31,791.000	1,051,964.190	
TAUBMAN CENTERS INC	21,423.000	1,408,990.710	
TERRENO REALTY CORP	7,815.000	137,700.300	
THE MACERICH COMPANY	47,486.000	2,776,031.560	
UDR INC	84,678.000	1,978,078.080	
UMH PROPERTIES INC	6,837.000	63,447.360	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,492.000	185,968.800	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	8,258.000	152,360.100	
VENTAS INC	99,502.000	5,960,169.800	
VORNADO REALTY TRUST	58,853.000	5,352,091.820	
WASHINGTON REIT	22,260.000	509,531.400	
WEINGARTEN REALTY INVST	37,791.000	1,056,258.450	
WHITESTONE REIT	7,606.000	101,692.220	
WINTHROP REALTY TRUST	11,616.000	128,937.600	
WP CAREY INC	18,864.000	1,161,833.760	
アメリカ・ドル 小計	5,535,559.000	173,952,677.950	

			(17,972,790,685)	
イギリス・ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	42,348.000	208,309.810	
	BRITISH LAND CO PLC	337,325.000	2,177,432.870	
	DERWENT LONDON PLC	28,802.000	743,091.600	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	117,499.000	720,856.360	
	HAMMERSON PLC	240,720.000	1,220,450.400	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	222,074.000	250,943.620	
	INTU PROPERTIES PLC	228,165.000	715,297.270	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	263,847.000	2,626,596.880	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	207,787.000	285,914.910	
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	20,776.000	97,647.200	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	33,848.000	121,074.290	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	120,500.000	65,913.500	
	SEGRO PLC	250,053.000	856,931.630	
	SHAFTESBURY PLC	84,321.000	540,497.610	
WORKSPACE GROUP PLC	35,543.000	197,796.790		
イギリス・ポンド 小計		2,233,608.000	10,828,754.740 (1,834,607,627)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	24,303.000	206,186.650	
イスラエル・シュケル 小計		24,303.000	206,186.650 (6,109,310)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	11,113.000	364,061.880	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,393.000	323,462.160	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,779.000	525,335.360	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	5,419.000	144,795.680	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	21,928.000	560,260.400	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	18,112.000	388,864.640	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	11,352.000	488,590.080	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCE	28,956.000	294,772.080	
	CHOICE PROPERTIES REIT	14,471.000	155,852.670	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	20,518.000	378,762.280	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,743.000	256,591.670	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,860.000	220,446.000	
	DUNDEE INDUSTRIAL REIT	9,855.000	87,808.050	

	DUNDEE INTL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,569.000	162,664.440	
	DUNDEE REAL ESTATE INV TRUST	17,549.000	522,082.750	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,699.000	291,022.200	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	44,288.000	951,749.120	
	HEALTHLEASE PROPERTIES REIT	4,662.000	46,107.180	
	INNVEST REAL ESTATE INV TR	17,528.000	82,732.160	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,826.000	58,785.180	
	MILESTONE APARTMENTS REIT	6,642.000	62,434.800	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,277.000	51,978.450	
	MORGUARD REAL ESTATE INV TR	10,688.000	176,779.520	
	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	5,791.000	165,217.230	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,385.000	68,447.200	
	PLAZA RETAIL REIT	6,000.000	26,340.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	21,961.000	99,922.550	
	RETROCOM REIT	9,828.000	46,388.160	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	49,597.000	1,258,275.890	
	カナダ・ドル 小計	453,789.000	8,260,529.780 (783,841,671)	
ニュージーランド・ドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	96,983.000	148,383.990	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	336,432.000	331,385.520	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	319,348.000	351,282.800	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	141,764.000	182,875.560	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	88,438.000	114,085.020	
	ニュージーランド・ドル 小計	982,965.000	1,128,012.890 (97,618,236)	
ユーロ	AEDIFICA	3,311.000	171,509.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	24,700.000	234,971.100	
	ALTAREA	1,197.000	154,891.800	
	ANF IMMOBILIER	3,251.000	74,642.960	
	BEFIMMO	6,120.000	310,100.400	
	BENI STABILI SPA	289,156.000	152,963.520	

	COFINIMMO SA	5,333.000	465,570.900	
	CORIO NV	33,146.000	1,084,702.850	
	EUROBANK PROPERTIES REAL ESTAT	5,385.000	44,910.900	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,515.000	377,953.000	
	FONCIERE DES REGIONS	14,869.000	917,565.990	
	GECINA SA	8,993.000	865,666.180	
	GREEN REIT PLC	53,300.000	72,488.000	
	HAMBORNER REIT AG	14,244.000	105,277.400	
	ICADE	11,441.000	755,106.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	48,247.000	43,132.810	
	KLEPIERRE	32,954.000	1,110,549.800	
	MERCIALYS	18,907.000	285,212.090	
	NIEUWE STEEN INVS	40,013.000	184,860.060	
	PRIME OFFICE REIT-AG	19,106.000	59,610.720	
	SOCIETE TOUR EIFFEL	1,929.000	95,774.850	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	32,898.000	6,155,215.800	
	VASTNED RETAIL	6,264.000	220,806.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	3,647.000	195,661.550	
	WERELDHAVE NV	7,332.000	421,443.360	
	ユーロ 小計	698,258.000	14,560,587.840 (2,056,100,609)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	874,000.000	2,971,600.000	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	435,000.000	2,666,550.000	
	LINK REIT/THE	781,023.000	27,570,111.900	
	PROSPERITY REIT	422,000.000	957,940.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	313,000.000	679,210.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	334,000.000	985,300.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	605,000.000	2,274,800.000	
	香港・ドル 小計	3,764,023.000	38,105,511.900 (507,565,418)	
	投資証券 合計	13,692,505	23,258,633,556 (23,258,633,556)	
	合計		26,895,833,542 (26,895,833,542)	

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、内数で表示してあります。
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 141銘柄	-%	66.25%	66.82%
イギリス・ポンド	投資証券 15銘柄	-%	6.76%	6.82%
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 24銘柄	9.73%	-%	9.82%
カナダ・ドル	投資証券 29銘柄	-%	2.89%	2.91%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 28銘柄	3.68%	-%	3.71%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	0.36%	0.36%
ユーロ	投資証券 25銘柄	-%	7.58%	7.64%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	-%	1.87%	1.89%

(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。

「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7月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
預金		377,715,907	318,885,865
コール・ローン		3,016,499,153	2,557,257,884
国債証券		170,119,201,964	169,967,119,076
派生商品評価勘定		25,758,139	3,865,119,885
未収利息		1,776,283,152	1,954,887,215
前払費用		142,713,556	66,718,971
流動資産合計		175,458,171,871	178,729,988,896
資産合計		175,458,171,871	178,729,988,896
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,082,773,223	651
未払金		1,035,767,598	-
未払解約金		160,462,000	30,510,000
流動負債合計		2,279,002,821	30,510,651
負債合計		2,279,002,821	30,510,651
純資産の部			
元本等			
元本	1	145,461,934,158	148,344,483,263
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		27,717,234,892	30,354,994,982
元本等合計		173,179,169,050	178,699,478,245
純資産合計		173,179,169,050	178,699,478,245
負債純資産合計		175,458,171,871	178,729,988,896

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7月11日現在	平成26年1月14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	116,679,461,522円 37,534,757,836円 8,752,285,200円	145,461,934,158円 8,507,520,287円 5,624,971,182円
元本の内訳 ファンド名		
投資のソムリエ	12,928,166円	95,937,477円
投資のソムリエ＜DC年金＞	- 円	1,102,236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）	303,806,430円	280,655,548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）	27,021,200,634円	27,556,382,270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）	2,257,645,021円	2,157,895,232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）	9,604,108,727円	9,712,459,659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)	41,200,995,833円	42,537,990,522円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家 限定)	353,904,877円	181,667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)	36,415,603,213円	37,685,620,097円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家 限定)	565,990,869円	522,752,256円
D I A M世界アセット バランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格 機関投資家限定)	4,132,593,753円	4,048,995,692円
D I A M世界アセット バランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格 機関投資家限定)	10,205,726,638円	10,205,726,638円
D I A M世界アセット バランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格 機関投資家限定)	13,369,811,068円	13,010,148,282円
D I A M世界アセット バランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格 機関投資家限定)	17,618,929円	528,635,687円
計	145,461,934,158円	148,344,483,263円
2 . 受益権の総数	145,461,934,158口	148,344,483,263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25年1月12日 至 平成25年7月11日	自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年7月11日現在	平成26年1月14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	85,738,154	145,139,774
合計	85,738,154	145,139,774

(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25年6月25日から平成25年7月11日まで及び平成25年6月25日から平成26年1月14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7月11日 現在				平成26年1月14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	171,218,813,420	-	172,277,016,590	1,058,203,170	174,944,374,180	-	171,079,254,946	3,865,119,234
アメリカ ・ドル	70,344,535,854	-	70,531,072,096	186,536,242	68,536,580,768	-	67,367,208,630	1,169,372,138
イギリス ・ポンド	12,677,980,922	-	12,653,411,397	24,569,525	13,875,002,364	-	13,503,038,928	371,963,436
オースト ラリア ・ドル	2,475,165,095	-	2,501,729,302	26,564,207	2,656,671,072	-	2,639,215,352	17,455,720
カナダ ・ドル	4,299,879,627	-	4,367,531,576	67,651,949	4,160,321,321	-	3,991,169,165	169,152,156
シンガ ポール ・ドル	648,926,524	-	652,672,466	3,745,942	655,482,815	-	642,545,727	12,937,088
スウェー デン・ク ローナ デンマー ク・ク	908,010,497	-	924,304,686	16,294,189	1,026,255,931	-	996,477,940	29,777,991
ローネ ノル ウェー・ クローネ ポーラン ド ・ズロチ	1,430,802,264	-	1,444,311,220	13,508,956	1,447,048,658	-	1,410,096,248	36,952,410
	502,826,015	-	510,319,328	7,493,313	574,373,327	-	559,713,222	14,660,105
	1,253,448,821	-	1,272,004,327	18,555,506	1,495,240,842	-	1,457,944,488	37,296,354

マレーシ ア・リン ギット	659,864,840	-	667,588,000	7,723,160	896,019,080	-	887,960,000	8,059,080
メキシコ ・ペソ	1,735,255,617	-	1,770,889,424	35,633,807	1,689,770,469	-	1,663,945,528	25,824,941
ユーロ 南アフリ カ	73,364,741,128	-	74,059,966,768	695,225,640	77,123,821,618	-	75,190,689,132	1,933,132,486
・ランド	917,376,216	-	921,216,000	3,839,784	807,785,915	-	769,250,586	38,535,329
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	171,948,560,546	-	173,007,951,802	1,057,015,084	174,944,374,180	-	171,079,254,946	3,865,119,234

(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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.1905円	1.2046円
(1万口当たり純資産額)	(11,905円)	(12,046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26年1月14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	18,512,210.000	
		US T N/B 0.25 12/15/15	4,000,000.000	3,992,960.000	
		US T N/B 0.375 01/15/16	15,500,000.000	15,502,325.000	
		US T N/B 0.375 03/15/15	18,000,000.000	18,041,400.000	
		US T N/B 0.375 06/15/15	13,000,000.000	13,029,900.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	6,000,000.000	5,939,280.000	
		US T N/B 0.625 08/31/17	9,300,000.000	9,157,524.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	7,000,000.000	6,851,740.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	12,300,000.000	12,122,142.000	
		US T N/B 1.0 06/30/19	5,000,000.000	4,795,300.000	
		US T N/B 1.0 08/31/16	8,800,000.000	8,893,104.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	5,500,000.000	5,216,805.000	
		US T N/B 1.125 03/31/20	3,500,000.000	3,314,185.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	5,000,000.000	4,768,350.000	
		US T N/B 1.25 01/31/19	6,400,000.000	6,287,744.000	
		US T N/B 1.25 08/31/15	11,000,000.000	11,176,990.000	
		US T N/B 1.25 09/30/15	9,000,000.000	9,147,960.000	
		US T N/B 1.25 10/31/15	11,000,000.000	11,184,250.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	2,500,000.000	2,484,550.000	
		US T N/B 1.375 11/30/15	10,500,000.000	10,703,805.000	
		US T N/B 1.375 11/30/18	2,000,000.000	1,983,660.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	6,300,000.000	6,245,064.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	4,000,000.000	4,003,400.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	5,000,000.000	4,609,750.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	2,500,000.000	2,291,400.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	6,000,000.000	5,625,000.000	
US T N/B 1.75 05/15/23	7,700,000.000	7,053,277.000			
US T N/B 1.75 05/31/16	11,000,000.000	11,325,270.000			

US T N/B 1.875 09/30/17	6,000,000.000	6,172,500.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	5,000,000.000	4,809,350.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	10,000,000.000	9,417,900.000	
US T N/B 2.0 04/30/16	9,500,000.000	9,832,500.000	
US T N/B 2.0 07/31/20	2,500,000.000	2,482,400.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	5,000,000.000	4,834,750.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	4,500,000.000	4,418,055.000	
US T N/B 2.25 01/31/15	8,000,000.000	8,174,960.000	
US T N/B 2.25 07/31/18	4,000,000.000	4,145,000.000	
US T N/B 2.25 11/30/17	7,000,000.000	7,288,750.000	
US T N/B 2.375 03/31/16	6,000,000.000	6,257,100.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	4,000,000.000	4,168,400.000	
US T N/B 2.375 07/31/17	10,500,000.000	10,997,070.000	
US T N/B 2.5 03/31/15	7,000,000.000	7,194,950.000	
US T N/B 2.5 04/30/15	19,000,000.000	19,565,440.000	
US T N/B 2.5 06/30/17	6,500,000.000	6,840,210.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,500,000.000	4,389,930.000	
US T N/B 2.625 04/30/18	3,000,000.000	3,163,350.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	5,500,000.000	5,673,140.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	7,000,000.000	7,194,670.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	7,500,000.000	7,912,500.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,900,000.000	3,196,440.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,500,000.000	3,679,785.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,500,000.000	1,256,475.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	7,000,000.000	7,471,380.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,600,000.000	1,387,248.000	
US T N/B 3.0 09/30/16	6,000,000.000	6,382,920.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,900,000.000	2,583,929.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	7,700,000.000	6,812,036.000	
US T N/B 3.125 04/30/17	8,000,000.000	8,580,560.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,828,860.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	6,500,000.000	6,856,980.000	
US T N/B 3.125 10/31/16	10,500,000.000	11,215,680.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,300,000.000	2,052,014.000	

US T N/B 3.25 03/31/17	7,000,000.000	7,534,800.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	7,000,000.000	7,468,930.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	7,000,000.000	7,520,310.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,500,000.000	4,882,815.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	9,800,000.000	10,681,216.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,100,000.000	2,037,651.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	5,000,000.000	5,446,050.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	11,600,000.000	12,736,336.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	4,500,000.000	4,910,625.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	3,000,000.000	3,295,410.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	6,100,000.000	5,943,169.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,700,000.000	2,714,121.000	
US T N/B 3.75 11/15/18	6,000,000.000	6,623,880.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	9,000,000.000	9,971,010.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,500,000.000	2,577,725.000	
US T N/B 4.0 02/15/15	9,000,000.000	9,374,400.000	
US T N/B 4.125 05/15/15	3,000,000.000	3,156,540.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,500,000.000	1,646,475.000	
US T N/B 4.25 08/15/15	12,000,000.000	12,759,840.000	
US T N/B 4.25 11/15/17	3,000,000.000	3,351,300.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,900,000.000	2,083,464.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,200,000.000	1,342,116.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	3,000,000.000	3,356,250.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,200,000.000	2,458,566.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,400,000.000	1,566,348.000	
US T N/B 4.5 02/15/16	11,000,000.000	11,941,380.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,283,120.000	
US T N/B 4.5 05/15/17	4,000,000.000	4,470,280.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,500,000.000	1,709,880.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,500,000.000	1,711,170.000	
US T N/B 4.625 02/15/17	6,000,000.000	6,699,840.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,500,000.000	2,906,325.000	
US T N/B 4.625 11/15/16	7,000,000.000	7,775,180.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,000,000.000	2,369,360.000	
US T N/B 4.75 08/15/17	3,700,000.000	4,190,250.000	

	US T N/B 4.875 08/15/16	8,000,000.000	8,885,920.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	700,000.000	854,924.000	
	US T N/B 5.125 05/15/16	5,000,000.000	5,538,450.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	1,200,000.000	1,473,468.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,200,000.000	1,473,000.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,879,680.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	500,000.000	628,590.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,000,000.000	2,595,920.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	2,000,000.000	2,651,240.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,000,000.000	1,363,430.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	2,000,000.000	2,603,200.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	2,000,000.000	2,807,340.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	1,000,000.000	1,341,480.000	
	アメリカ・ドル 小計	630,500,000.000 (65,143,260,000)	651,089,351.000 (67,270,551,745)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 1.0 09/07/17	3,000,000.000	2,965,200.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/18	2,700,000.000	2,649,510.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/17	2,100,000.000	2,144,100.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,500,000.000	2,323,000.000	
	UK TREASURY 2.0 01/22/16	2,700,000.000	2,773,170.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,400,000.000	1,332,044.000	
	UK TREASURY 2.75 01/22/15	3,000,000.000	3,071,100.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,500,000.000	1,414,650.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	400,000.000	399,760.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,700,000.000	1,783,980.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,000,000.000	2,185,000.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,300,000.000	2,512,980.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,400,000.000	2,615,976.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,000,000.000	2,238,800.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,000,000.000	2,215,800.000	

UK TREASURY 4.0 09/07/16	2,900,000.000	3,140,700.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,100,000.000	2,351,370.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,300,000.000	2,573,240.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,500,000.000	1,687,350.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,500,000.000	1,676,550.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,700,000.000	1,915,560.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,000,000.000	2,283,600.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,600,000.000	1,844,640.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,900,000.000	2,222,620.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,000,000.000	2,258,200.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,900,000.000	2,197,350.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,200,000.000	2,595,120.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	2,200,000.000	2,531,980.000	
UK TREASURY 4.75 09/07/15	2,500,000.000	2,674,500.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,100,000.000	2,483,460.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,000,000.000	2,420,400.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/18	2,250,000.000	2,567,025.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,000,000.000	2,385,600.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,500,000.000	1,992,900.000	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,500,000.000	2,068,950.000	
UK TREASURY 8.0 12/07/15	500,000.000	571,050.000	
UK TREASURY 8.75 08/25/17	600,000.000	757,860.000	
イギリス・ボンド 小計	72,450,000.000 (12,274,479,000)	79,825,095.000 (13,523,967,595)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,000,000.000	2,089,060.000
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,000,000.000	2,165,280.000

	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	2,150,000.000	2,406,151.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,300,000.000	1,141,296.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	600,000.000	543,840.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,400,000.000	1,190,854.000	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	1,500,000.000	1,556,730.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,500,000.000	1,543,620.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	2,000,000.000	2,090,260.000	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/15	1,800,000.000	1,864,620.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	2,000,000.000	2,169,020.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,300,000.000	2,541,661.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,000,000.000	2,243,520.000	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	2,500,000.000	2,721,350.000	
	AUSTRALIAN 6.25 04/15/15	1,500,000.000	1,568,670.000	
オーストラリア・ドル 小計		26,550,000.000 (2,478,708,000)	27,835,932.000 (2,598,762,612)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	500,000.000	792,045.000	
	CANADA 1.0 08/01/16	1,000,000.000	997,230.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	2,700,000.000	2,665,035.000	
	CANADA 1.5 03/01/17	1,500,000.000	1,512,135.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,650,000.000	1,507,687.500	
	CANADA 1.5 09/01/17	800,000.000	802,336.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,500,000.000	1,539,285.000	
	CANADA 2.75 09/01/16	1,500,000.000	1,562,040.000	
	CANADA 3.0 12/01/15	5,100,000.000	5,287,221.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,300,000.000	1,396,239.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	1,500,000.000	1,634,220.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,550,000.000	1,675,782.500	
	CANADA 3.75 06/01/19	2,700,000.000	2,963,682.000	
	CANADA 4.0 06/01/16	2,300,000.000	2,458,907.000	
	CANADA 4.0 06/01/17	1,500,000.000	1,634,910.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,700,000.000	1,985,260.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	1,200,000.000	1,334,808.000	
	CANADA 4.5 06/01/15	4,150,000.000	4,350,196.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,600,000.000	2,120,480.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,500,000.000	2,034,960.000	
CANADA 5.75 06/01/33	1,500,000.000	2,104,560.000		
カナダ・ドル 小計		38,750,000.000	42,359,019.000	

		(3,676,987,500)	(4,019,447,313)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	700,000.000	684,775.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	350,000.000	333,105.500	
	SINGAPORE 2.875 07/01/15	700,000.000	725,865.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	500,000.000	492,840.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	200,000.000	206,694.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,000,000.000	1,059,210.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,000,000.000	1,077,030.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	550,000.000	587,460.500	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	1,000,000.000	1,086,950.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,400,000.000	1,574,146.000	
シンガポール・ドル 小計		7,400,000.000 (603,988,000)	7,828,076.000 (638,927,563)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,500,000.000	8,777,525.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	6,200,000.000	6,501,010.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	5,000,000.000	5,348,550.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	8,000,000.000	8,788,160.000	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	6,000,000.000	6,509,160.000	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,000,000.000	9,010,320.000	
	SWEDEN 4.5 08/12/15	8,000,000.000	8,463,120.000	
SWEDEN 5.0 12/01/20	7,000,000.000	8,342,600.000		
スウェーデン・クローナ 小計		57,700,000.000 (916,853,000)	61,740,445.000 (981,055,671)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	7,100,000.000	6,858,600.000	
	DENMARK 2.5 11/15/16	3,300,000.000	3,507,075.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	11,100,000.000	12,255,510.000	
	DENMARK 4.0 11/15/15	10,000,000.000	10,714,600.000	
	DENMARK 4.0 11/15/17	6,000,000.000	6,790,800.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	10,000,000.000	11,638,000.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	13,550,000.000	18,157,000.000	
DENMARK 7.0 11/10/24	3,000,000.000	4,494,900.000		
デンマーク・クローネ 小計		64,050,000.000 (1,211,826,000)	74,416,485.000 (1,407,959,896)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 2.0 05/24/23	4,300,000.000	3,985,584.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	6,300,000.000	6,752,340.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	7,000,000.000	7,559,300.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	5,500,000.000	6,114,625.000	
	NORWAY 5.0 05/15/15	7,700,000.000	8,067,675.000	
ノルウェー・クローネ 小計		30,800,000.000 (519,904,000)	32,479,524.000 (548,254,365)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.75 04/25/18	3,700,000.000	3,740,145.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	1,700,000.000	1,651,465.000	

	POLAND 4.75 04/25/17	800,000.000	837,400.000	
	POLAND 4.75 10/25/16	3,000,000.000	3,132,300.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	1,000,000.000	1,044,350.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	4,900,000.000	5,232,661.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	3,500,000.000	3,749,900.000	
	POLAND 5.5 04/25/15	4,000,000.000	4,139,200.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	3,000,000.000	3,259,800.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,200,000.000	1,334,856.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,529,632.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,500,000.000	2,749,200.000	
	POLAND 6.25 10/24/15	6,000,000.000	6,361,200.000	
ポーランド・ズロチ 小計		38,500,000.000 (1,306,690,000)	40,762,109.000 (1,383,465,979)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.172 07/15/16	3,000,000.000	2,998,020.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,600,000.000	1,441,536.000	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	2,300,000.000	2,287,051.000	
	MALAYSIA 3.741 02/27/15	4,000,000.000	4,031,760.000	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	3,000,000.000	3,029,130.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	500,000.000	468,805.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,039,280.000	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	3,000,000.000	3,058,500.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	4,000,000.000	4,123,080.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,500,000.000	1,501,050.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,200,000.000	1,283,496.000	
	マレーシア・リングギット 小計		28,100,000.000 (887,960,000)	28,261,708.000 (893,069,973)
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	24,500,000.000	31,396,260.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 06/15/17	13,000,000.000	13,108,680.000	
	MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16	12,500,000.000	13,148,250.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	20,000,000.000	20,371,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,498,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	7,000,000.000	7,195,790.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	30,000,000.000	32,913,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	25,000,000.000	28,028,500.000	

	MEXICAN BONDS 8.0 12/17/15	16,000,000.000	17,206,400.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	18,000,000.000	20,559,780.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	14,000,000.000	15,634,360.000	
メキシコ・ペソ 小計		190,000,000.000 (1,501,000,000)	210,060,520.000 (1,659,478,108)	
ユーロ	AUSTRIA 1.15 10/19/18	400,000.000	401,880.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	400,000.000	384,400.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	700,000.000	727,930.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	500,000.000	518,925.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	1,200,000.000	1,300,200.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,250,000.000	1,389,975.000	
	AUSTRIA 3.5 07/15/15	700,000.000	734,300.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,700,000.000	1,903,660.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	900,000.000	1,017,000.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	350,000.000	421,648.500	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,800,000.000	2,062,800.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	1,500,000.000	1,643,250.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,400,000.000	1,679,300.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	800,000.000	903,600.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,150,000.000	1,334,632.500	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	1,600,000.000	1,840,800.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	850,000.000	1,063,392.500	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	900,000.000	1,277,145.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	800,000.000	785,464.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	1,100,000.000	1,158,564.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	800,000.000	865,192.000	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	1,300,000.000	1,395,030.000	
	BELGIUM 3.5 03/28/15	50,000.000	51,996.500	
	BELGIUM 3.5 06/28/17	1,500,000.000	1,640,670.000	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	250,000.000	260,152.500	
	BELGIUM 3.75 09/28/15	1,600,000.000	1,696,352.000	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	2,000,000.000	2,254,200.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	1,600,000.000	1,769,744.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	2,600,000.000	2,920,320.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	1,500,000.000	1,702,875.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	1,700,000.000	1,936,249.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	900,000.000	994,482.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,600,000.000	1,833,120.000		
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,800,000.000	2,087,730.000		
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,200,000.000	2,540,318.000		
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,405,920.000		
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,750,000.000	2,197,737.500		
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,800,000.000	2,319,894.000		
BELGIUM 5.5 09/28/17	1,000,000.000	1,168,200.000		
BELGIUM 8.0 03/28/15	400,000.000	437,332.000		

BUNDESUBL 0.25 04/13/18	1,400,000.000	1,374,744.000	
BUNDESUBL 0.5 02/23/18	2,000,000.000	1,989,420.000	
BUNDESUBL 0.5 10/13/17	800,000.000	799,632.000	
BUNDESUBL 1.75 10/09/15	1,000,000.000	1,027,770.000	
BUNDESUBL 2.0 02/26/16	2,000,000.000	2,076,960.000	
BUNDESUBL 2.5 02/27/15	4,000,000.000	4,106,520.000	
BUNDESUBL 2.75 04/08/16	2,500,000.000	2,642,125.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	4,700,000.000	4,607,363.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	900,000.000	878,319.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	2,200,000.000	2,173,248.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,100,000.000	3,136,301.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,500,000.000	2,595,750.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	2,300,000.000	2,455,204.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,000,000.000	2,121,000.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,000,000.000	2,163,100.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,700,000.000	1,628,430.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	2,500,000.000	2,787,250.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,500,000.000	2,817,625.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/15	5,200,000.000	5,437,744.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,000,000.000	2,266,800.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,800,000.000	1,994,940.000	
DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	4,000,000.000	4,262,520.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	3,000,000.000	3,410,100.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/15	2,700,000.000	2,795,769.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	4,800,000.000	5,287,824.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	2,500,000.000	2,857,125.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,000,000.000	3,405,990.000	

DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,350,000.000	2,871,582.500	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	4,700,000.000	5,135,690.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	4,000,000.000	4,525,920.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	3,100,000.000	3,587,010.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,700,000.000	2,181,610.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	774,420.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,400,000.000	3,198,240.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,750,000.000	2,423,225.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,000,000.000	2,814,600.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,800,000.000	2,506,500.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,300,000.000	1,821,820.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,647,030.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,500,000.000	2,240,400.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	500,000.000	476,950.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	800,000.000	780,520.000	
FINLAND 1.75 04/15/16	700,000.000	722,960.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	300,000.000	288,030.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	400,000.000	407,940.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	900,000.000	1,005,660.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	800,000.000	901,040.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	900,000.000	1,003,050.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	500,000.000	583,200.000	
FINLAND 4.25 07/04/15	700,000.000	741,601.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	600,000.000	700,800.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,000,000.000	1,529,220.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/15	4,500,000.000	4,688,190.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	2,400,000.000	2,402,088.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	800,000.000	764,616.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,800,000.000	2,823,436.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,300,000.000	4,537,360.000	

FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,000,000.000	1,967,500.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	3,900,000.000	4,192,500.000	
FRANCE OAT 3.0 10/25/15	8,400,000.000	8,812,440.000	
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	7,500,000.000	7,995,750.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	500,000.000	482,620.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,300,000.000	4,723,034.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	4,500,000.000	5,035,005.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,700,000.000	3,982,310.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	5,400,000.000	5,948,046.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,300,000.000	4,883,510.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	4,400,000.000	4,979,744.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	2,900,000.000	3,273,346.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,900,000.000	2,099,310.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,100,000.000	1,222,705.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,400,000.000	2,678,640.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	4,200,000.000	4,846,548.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	6,100,000.000	6,891,475.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	3,300,000.000	3,785,760.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	4,200,000.000	4,894,470.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,600,000.000	3,129,360.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,500,000.000	3,087,725.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	5,500,000.000	6,191,900.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,200,000.000	4,190,272.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,900,000.000	3,989,385.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,000,000.000	2,679,480.000	

FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,000,000.000	1,394,800.000	
IRISH 3.9 03/20/23	600,000.000	630,732.000	
IRISH 4.4 06/18/19	700,000.000	779,415.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,100,000.000	1,223,706.000	
IRISH 4.5 10/18/18	900,000.000	1,007,910.000	
IRISH 4.6 04/18/16	1,400,000.000	1,518,230.000	
IRISH 5.0 10/18/20	800,000.000	912,960.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,300,000.000	1,496,079.000	
IRISH 5.5 10/18/17	1,000,000.000	1,144,000.000	
IRISH 5.9 10/18/19	1,000,000.000	1,191,950.000	
ITALY BTPS 3.0 04/15/15	6,800,000.000	6,983,192.000	
ITALY BTPS 3.5 11/01/17	2,000,000.000	2,108,120.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,800,000.000	2,908,080.000	
ITALY BTPS 3.75 04/15/16	4,000,000.000	4,220,800.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/15	7,200,000.000	7,504,056.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	5,000,000.000	5,294,000.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,000,000.000	3,106,800.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	7,600,000.000	8,124,400.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,600,000.000	2,431,000.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,000,000.000	3,189,300.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/15	700,000.000	725,228.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,000,000.000	3,253,800.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	1,600,000.000	1,723,520.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	3,000,000.000	3,248,100.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	5,000,000.000	5,455,000.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,700,000.000	2,944,890.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	2,700,000.000	2,960,280.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,400,000.000	1,474,354.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,500,000.000	2,620,500.000	

ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,755,402.000	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	3,400,000.000	3,725,720.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,600,000.000	1,732,480.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,400,000.000	3,736,600.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,700,000.000	1,792,684.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	900,000.000	910,476.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,000,000.000	2,214,800.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,200,000.000	3,485,632.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,500,000.000	2,649,250.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,200,000.000	2,316,820.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,200,000.000	2,308,900.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	3,100,000.000	3,451,230.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,400,000.000	3,735,580.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,400,000.000	2,735,400.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,700,000.000	3,076,677.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,900,000.000	2,200,580.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,500,000.000	4,149,250.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,900,000.000	3,576,570.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,100,000.000	1,431,430.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,400,000.000	1,995,280.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	2,000,000.000	2,036,580.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,300,000.000	1,256,931.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,800,000.000	1,844,658.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	2,000,000.000	2,119,200.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,250,000.000	1,198,362.500	

NETHERLANDS 2.75 01/15/15	2,500,000.000	2,565,075.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/15	2,600,000.000	2,718,040.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,800,000.000	1,990,620.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,600,000.000	1,798,720.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,900,000.000	2,171,320.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,550,000.000	1,819,808.500	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,500,000.000	1,789,050.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/16	2,900,000.000	3,160,710.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/18	1,800,000.000	2,039,940.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,500,000.000	1,718,775.000	
NETHERLANDS 4.5 07/15/17	1,700,000.000	1,924,740.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,151,520.000	
SPAIN 3.0 04/30/15	4,800,000.000	4,933,440.000	
SPAIN 3.15 01/31/16	2,500,000.000	2,599,750.000	
SPAIN 3.25 04/30/16	2,800,000.000	2,924,320.000	
SPAIN 3.75 10/31/15	1,100,000.000	1,153,889.000	
SPAIN 3.8 01/31/17	3,000,000.000	3,199,500.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	2,700,000.000	2,872,935.000	
SPAIN 4.0 07/30/15	2,500,000.000	2,618,875.000	
SPAIN 4.1 07/30/18	2,800,000.000	3,031,700.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,700,000.000	1,599,003.000	
SPAIN 4.25 10/31/16	2,500,000.000	2,689,400.000	
SPAIN 4.3 10/31/19	2,000,000.000	2,176,700.000	
SPAIN 4.4 01/31/15	200,000.000	207,382.000	
SPAIN 4.5 01/31/18	2,300,000.000	2,517,350.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	3,000,000.000	3,314,400.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,800,000.000	1,905,120.000	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,400,000.000	1,401,120.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	3,300,000.000	3,558,720.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	2,800,000.000	3,105,060.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,300,000.000	1,342,510.000	
SPAIN 5.4 01/31/23	1,700,000.000	1,914,166.000	
SPAIN 5.5 04/30/21	2,300,000.000	2,633,270.000	
SPAIN 5.5 07/30/17	2,000,000.000	2,255,080.000	
SPAIN 5.75 07/30/32	1,500,000.000	1,753,650.000	
SPAIN 5.85 01/31/22	2,500,000.000	2,908,675.000	
SPAIN 5.9 07/30/26	1,100,000.000	1,293,160.000	

	SPAIN 6.0 01/31/29	2,600,000.000	3,084,562.000	
ユーロ 小計		475,550,000.000 (67,152,415,500)	526,027,247.500 (74,280,307,619)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	29,617,250.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,500,000.000	10,744,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	2,000,000.000	1,485,300.000	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	14,000,000.000	13,324,640.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	18,000,000.000	18,594,540.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	3,000,000.000	3,127,950.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	3,000,000.000	2,882,850.000	
南アフリカ・ランド 小計		79,500,000.000 (759,225,000)	79,777,030.000 (761,870,637)	
国債証券 合計		158,433,296,000 (158,433,296,000)	169,967,119,076 (169,967,119,076)	
合計		158,433,296,000 (158,433,296,000)	169,967,119,076 (169,967,119,076)	

(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 110銘柄	37.64%	39.58%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	7.57%	7.96%
オーストラリア・ドル	国債証券 15銘柄	1.45%	1.53%
カナダ・ドル	国債証券 21銘柄	2.25%	2.36%
シンガポール・ドル	国債証券 10銘柄	0.36%	0.38%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.55%	0.58%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.79%	0.83%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.31%	0.32%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.77%	0.81%
マレーシア・リングギット	国債証券 11銘柄	0.50%	0.53%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	0.93%	0.98%
ユーロ	国債証券 214銘柄	41.57%	43.70%
南アフリカ・ランド	国債証券 7銘柄	0.43%	0.45%

(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。

「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7月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
預金		992,664,393	898,020,599
コール・ローン		46,958,165	36,843,254
株式		36,199,479,112	36,394,271,057
投資信託受益証券		338,155,005	330,187,525
投資証券		57,640,197	73,394,633
派生商品評価勘定		1,383,096	11,310
未収入金		316,708	-
未収配当金		210,596,664	20,722,573
差入委託証拠金		330,446,115	259,191,756
流動資産合計		38,177,639,455	38,012,642,707
資産合計		38,177,639,455	38,012,642,707
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		53,988,210	28,813,882
未払金		-	3,752
未払解約金		28,032,000	8,519,000
流動負債合計		82,020,210	37,336,634
負債合計		82,020,210	37,336,634
純資産の部			
元本等			
元本	1	46,837,683,733	42,097,535,766
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	8,742,064,488	4,122,229,693
元本等合計		38,095,619,245	37,975,306,073
純資産合計		38,095,619,245	37,975,306,073
負債純資産合計		38,177,639,455	38,012,642,707

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成25年7月11日現在	平成26年1月14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	46,090,797,565円	46,837,683,733円
	同期中追加設定元本額	5,659,718,503円	2,089,361,059円
	同期中一部解約元本額	4,912,832,335円	6,829,509,026円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	205,402,668円	213,583,763円
	マネックス資産設計ファンドエボリューション	251,571,533円	241,045,504円
	D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	447,018円	7,051,114円
	D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,229,400円	13,044,378円
	D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	2,885,753円	33,166,784円
	投資のソムリエ	742,983円	58,142,043円
	クルーズコントロール	631,162円	80,753,967円
	投資のソムリエ<DC年金>	-円	660,890円
	D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	-円	550,917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)	8,849,633,854円	7,930,699,430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)	3,098,812,860円	3,090,291,212円
	エマージング株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,208,777,825円	2,166,543,481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)	20,017,056,544円	17,474,957,918円
	D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	12,200,492,133円	10,787,044,365円
	計	46,837,683,733円	42,097,535,766円
2 .	受益権の総数	46,837,683,733口	42,097,535,766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8,742,064,488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4,122,229,693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25年1月12日 至 平成25年7月11日	自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年7月11日現在	平成26年1月14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	1,607,778,540	1,205,838,994
投資信託受益証券	28,837,558	14,444,172
投資証券	2,592,131	5,032,148
合計	1,639,208,229	1,186,362,674

（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25年4月19日から平成25年7月11日まで及び平成25年4月19日から平成26年1月14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7月11日 現在				平成26年1月14日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	12,517,026	-	12,515,022	2,004	10,268,310	-	10,257,000	11,310
アメリカ・ドル	10,006,026	-	10,005,022	1,004	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	10,268,310	-	10,257,000	11,310
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	10,268,310	-	10,257,000	11,310

（注）時価の算定方法

- 1．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- 2．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	平成25年7月11日 現在				平成26年1月14日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	1,531,982,874	-	1,479,391,782	52,591,092	1,167,675,113	-	1,138,861,231	28,813,882
合計	1,531,982,874	-	1,479,391,782	52,591,092	1,167,675,113	-	1,138,861,231	28,813,882

(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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	0.8134円	0.9021円
(1万口当たり純資産額)	(8,134円)	(9,021円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成26年1月14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	32,513	47.960	1,559,323.480	
	LATAM AIRLINES GROUP SP ADR	41,450	15.540	644,133.000	
	BANCO SANTANDER CHILE ADR	26,392	22.260	587,485.920	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	22,773	11.970	272,592.810	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS ADR	16,368	22.570	369,425.760	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	73,600	7.570	557,152.000	
	CREDICORP LTD	6,949	130.930	909,832.570	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA ADR	11,900	26.000	309,400.000	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHILE SP ADR	15,816	42.660	674,710.560	
	ENERSIS SA SPONS ADR	53,208	15.100	803,440.800	
	CORPBANCA SA ADR	22,265	20.920	465,783.800	
	INFOSYS LTD ADR	17,222	59.410	1,023,159.020	
	MOBILE TELESYSTEMS OJSC ADR	52,325	20.040	1,048,593.000	
	WIPRO LTD ADR	23,281	12.860	299,393.660	
	DR REDDYS LABORATORIES LTD ADR	634	43.100	27,325.400	
	QUIMICA Y MINERA DE CHIL-SP ADR	16,146	25.790	416,405.340	
	HDFC BANK LTD ADR	4,830	34.090	164,654.700	
	SOUTHERN COPPER CORP	14,980	27.820	416,743.600	
	BANCO DE CHILE-ADR	5,578	80.730	450,311.940	
	VINA CONCHA Y TORO SA SP ADR	9,100	36.220	329,602.000	
LUKOIL SPON ADR	49,540	60.000	2,972,400.000		
GAIL INDIA LTD GDR	2,630	33.500	88,105.000		
GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	56,215	3.350	188,320.250		
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD GDR	1,342	19.000	25,498.000		
OAO GAZPROM ADR	568,232	8.320	4,727,690.240		

COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	84,283	4.484	377,924.970	
INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	84,200	1.610	135,562.000	
SURGUTNEFTEGAZ ADR	72,932	8.360	609,711.520	
SISTEMA JSFC GDR	14,202	32.000	454,464.000	
NOVATEK OAO GDR	9,029	131.400	1,186,410.600	
TELECOM EGYPT -GDR REG S	13,015	9.510	123,772.650	
MMC NORILSK NICKEL ADR	57,374	16.600	952,408.400	
ROSTELECOM SPON ADR	17,771	20.140	357,907.940	
LARSEN & TOUBRO LTD GDR	3,461	16.040	55,514.440	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD GDR	12,251	14.380	176,169.380	
RANBAXY LABORATORIES LTD GDR	4,433	7.375	32,693.370	
RELIANCE INDUSTRIES LTD GDR	19,260	28.360	546,213.600	
ROSNEFT OIL CO GDR	121,035	7.130	862,979.550	
URALKALI -SPON GDR	26,381	25.500	672,715.500	
SEVERSTAL GDR	21,786	9.275	202,065.150	
TATNEFT GDR	23,880	36.050	860,874.000	
VTB BANK OJSC GDR	241,425	2.881	695,545.420	
MAGNIT OJSC GDR	26,398	57.700	1,523,164.600	
ECOPETROL SA SP ADR	50,448	35.310	1,781,318.880	
FEDERAL HYDROGENERATING ADR	135,146	1.700	229,748.200	
SBERBANK ADR	267,204	12.050	3,219,808.200	
CENCOSUD SA ADR	56,420	9.630	543,324.600	
MEGAFON OAO GDR	9,723	30.900	300,440.700	
アメリカ・ドル 小計	2,517,346		35,232,220.520 (3,640,193,025)	
インド・ルピー				
RELIANCE INDUSTRIES LTD	91,051	880.400	80,161,300.400	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,876	331.500	5,594,394.000	
ASIAN PAINTS LTD	27,790	494.050	13,729,649.500	
BANK OF BARODA	3,799	617.600	2,346,262.400	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	3,292	402.500	1,325,030.000	
HDFC BANK LTD	134,154	672.850	90,265,518.900	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	20,857	888.250	18,526,230.250	
ICICI BANK LTD	15,840	1,054.900	16,709,616.000	
ADITYA BIRLA NUVO LTD	4,900	1,148.450	5,627,405.000	

STATE BANK OF INDIA LTD	9,859	1,641.250	16,181,083.750	
LIC HOUSING FINANCE LTD	29,705	204.600	6,077,643.000	
RELIANCE CAPITAL LTD	8,069	344.200	2,777,349.800	
TATA STEEL LTD	34,054	385.950	13,143,141.300	
TATA MOTORS LTD	76,718	376.150	28,857,475.700	
JSW STEEL LTD	9,507	1,019.300	9,690,485.100	
TATA POWER CO LTD	116,490	78.850	9,185,236.500	
NESTLE INDIA LTD	587	5,426.900	3,185,590.300	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	65,796	163.850	10,780,674.600	
GAIL INDIA LTD	15,664	344.750	5,400,164.000	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	32,029	716.900	22,961,590.100	
SESA STERLITE LTD	110,959	195.900	21,736,868.100	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	80,421	292.900	23,555,310.900	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	1,065	4,313.750	4,594,143.750	
LUPIN LTD	1,485	919.950	1,366,125.750	
ACC LTD	6,455	1,037.150	6,694,803.250	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	145,891	818.650	119,433,667.150	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	28,113	295.950	8,320,042.350	
INFOSYS LTD	26,400	3,665.000	96,756,000.000	
WIPRO LTD	28,934	561.450	16,244,994.300	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,246	545.700	32,330,542.200	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	8,687	899.100	7,810,481.700	
HCL TECHNOLOGIES LTD	21,929	1,343.350	29,458,322.150	
DABUR INDIA LTD	14,377	169.950	2,443,371.150	
HERO MOTOCORP LTD	5,264	2,037.000	10,722,768.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	8,411	2,626.550	22,091,912.050	
BHARTI AIRTEL LTD	50,224	331.000	16,624,144.000	
UNITED SPIRITS LTD	7,850	2,759.600	21,662,860.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	56,175	602.350	33,837,011.250	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,562	1,261.650	3,232,347.300	
JINDAL STEEL & POWER LTD	43,566	260.200	11,335,873.200	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,445	608.750	8,184,643.750	
CIPLA LTD/INDIA	36,885	402.250	14,836,991.250	
LARSEN & TOUBRO LTD	24,901	980.550	24,416,675.550	

	JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	87,706	47.650	4,179,190.900	
	ULTRATECH CEMENT LTD	5,608	1,669.550	9,362,836.400	
	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	48,041	2,368.750	113,797,118.750	
	ADANI ENTERPRISES LTD	16,748	235.300	3,940,804.400	
	NTPC LTD	109,910	132.750	14,590,552.500	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,088	549.950	3,348,095.600	
	YES BANK LTD	9,775	338.750	3,311,281.250	
	AMBUJA CEMENTS LTD	77,639	170.100	13,206,393.900	
	RANBAXY LABORATORIES LTD	8,562	438.800	3,757,005.600	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	112,300	110.000	12,353,000.000	
	ITC LTD	211,620	325.450	68,871,729.000	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	55,596	123.150	6,846,647.400	
	SIEMENS INDIA LTD	5,734	593.850	3,405,135.900	
	UNITED BREWERIES LTD	5,209	778.150	4,053,383.350	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,583	803.050	10,104,778.150	
	TECH MAHINDRA LTD	9,089	1,884.500	17,128,220.500	
	CAIRN INDIA LTD	34,782	324.000	11,269,368.000	
	IDEA CELLULAR LTD	57,695	161.900	9,340,820.500	
	POWER FINANCE CORP LTD	25,765	153.050	3,943,333.250	
	DLF LTD	45,392	161.050	7,310,381.600	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	127,192	98.000	12,464,816.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	34,730	143.750	4,992,437.500	
	RELIANCE POWER LTD	63,381	67.250	4,262,372.250	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	34,322	203.700	6,991,391.400	
	BAJAJ AUTO LTD	8,032	1,895.800	15,227,065.600	
	OIL INDIA LTD	12,465	482.250	6,011,246.250	
	COAL INDIA LTD	43,852	290.250	12,728,043.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	20,882	280.500	5,857,401.000	
	インド・ルピー 小計	2,790,980		1,292,870,589.650 (2,184,951,297)	
インドネシア・ルピア	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	21,175.000	741,125,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	185,201	19,000.000	3,518,819,000.000	

INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	372,000	6,725.000	2,501,700,000.000	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	152,500	27,025.000	4,121,312,500.000	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,893,000	7,000.000	13,251,000,000.000	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,366,500	2,220.000	9,693,630,000.000	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	687,000	3,805.000	2,614,035,000.000	
GUDANG GARAM TBK PT	49,500	42,600.000	2,108,700,000.000	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	141,000	21,950.000	3,094,950,000.000	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT	93,500	9,150.000	855,525,000.000	
BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	4,000.000	1,161,664,000.000	
BANK MANDIRI	848,000	8,800.000	7,462,400,000.000	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	143,000	11,200.000	1,601,600,000.000	
BANK RAKYAT INDONESIA	1,044,500	8,375.000	8,747,687,500.000	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,019,500	4,420.000	4,506,190,000.000	
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	732,500	4,225.000	3,094,812,500.000	
KALBE FARMA TBK PT	2,111,000	1,430.000	3,018,730,000.000	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	340,500	15,525.000	5,286,262,500.000	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,198,000	9,800.000	11,740,400,000.000	
XL AXIATA TBK PT	188,000	5,225.000	982,300,000.000	
LIPPO KARAWACI TBK PT	2,169,500	940.000	2,039,330,000.000	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	674,500	1,860.000	1,254,570,000.000	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,505.000	1,173,592,500.000	
JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	4,950.000	928,125,000.000	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	44,000	25,650.000	1,128,600,000.000	
BUMI SERPONG DAMAI PT	808,500	1,525.000	1,232,962,500.000	
ADARO ENERGY PT	1,090,500	955.000	1,041,427,500.000	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	123,000	10,150.000	1,248,450,000.000	

	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	151,500	5,850.000	886,275,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	393,500	2,630.000	1,034,905,000.000	
インドネシア・ルピア 小計		22,001,617		102,071,080,500.000 (877,811,292)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	76,400	182.000	13,904,800.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	48.500	4,180,700.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	342,500	16.500	5,651,250.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	178,700	147.000	26,268,900.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	462,600	7.150	3,307,590.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	71,200	164.000	11,676,800.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	904,300	2.020	1,826,686.000	
	IRPC PCL NVDR	1,080,200	3.220	3,478,244.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	115,000	27.250	3,133,750.000	
	BANGKOK BANK PCL NVDR	49,900	181.500	9,056,850.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	203,000	30.000	6,090,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	99,700	209.000	20,837,300.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	263,900	8.400	2,216,760.000	
	PTT PCL	79,300	292.000	23,155,600.000	
	SIAM CEMENT PCL	7,800	397.000	3,096,600.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	7,600	397.000	3,017,200.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	38,900	153.000	5,951,700.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	31,300	404.000	12,645,200.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	115,100	166.000	19,106,600.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	154,000	40.250	6,198,500.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	35,800	121.500	4,349,700.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	177,700	22.000	3,909,400.000	
THAI OIL PCL NVDR	87,000	54.500	4,741,500.000		
GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	68.000	2,828,800.000		
CP ALL PCL NVDR	443,000	40.750	18,052,250.000		
BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	8.350	4,302,755.000		

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	130,145	165.000	21,473,925.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	21,422	21.400	458,430.800	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	128,333	21.400	2,746,326.200	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	141,008	75.750	10,681,356.000	
タイ・パーツ 小計		6,088,908		258,345,473.000 (808,621,330)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,669	4,470.000	7,460,430.000	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	10,953	294.600	3,226,753.800	
	CEZ	13,572	517.900	7,028,938.800	
チェコ・コルナ 小計		26,194		17,716,122.600 (91,415,193)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	170,308	6.690	1,139,360.520	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,760	20.850	453,696.000	
	ARCELIK	27,213	12.900	351,047.700	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	39,011	6.620	258,252.820	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	166,902	2.770	462,318.540	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	22.300	124,523.200	
	KOC HOLDING AS	68,796	8.760	602,652.960	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	26,304	2.730	71,809.920	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	12,826	12.400	159,042.400	
	TURK HAVA YOLLARI	44,435	7.170	318,598.950	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	72,222	11.480	829,108.560	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	221,127	6.770	1,497,029.790	
	TURKIYE IS BANKASI	154,675	4.700	726,972.500	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,304	42.100	560,098.400	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	11,216	14.650	164,314.400	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	76,848	3.740	287,411.520	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	80,353	8.560	687,821.680	
	COCA-COLA ICECEK AS	5,353	49.000	262,297.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,743	40.500	799,591.500	

	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	57,549	3.950	227,318.550	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	16,685	16.750	279,473.750	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	57,669	13.050	752,580.450	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	52,652	5.900	310,646.800	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	4,261	22.800	97,150.800	
トルコ・リラ 小計		1,426,796		11,423,118.710 (541,455,827)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	15,067	4,759.000	71,703,853.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,754	14,390.000	54,020,060.000	
	OTP BANK NYRT	19,837	4,460.000	88,473,020.000	
ハンガリー・フォロント 小計		38,658		214,196,933.000 (101,208,050)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	476,600	26.100	12,439,260.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	163,780	52.350	8,573,883.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	76,309	84.000	6,409,956.000	
	AYALA CORP	17,403	525.000	9,136,575.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	212,800	25.500	5,426,400.000	
	DMCI HOLDINGS INC	70,370	57.350	4,035,719.500	
	GLOBE TELECOM INC	3,520	1,670.000	5,878,400.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	72,710	98.950	7,194,654.500	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	162,900	38.600	6,287,940.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	48,790	167.500	8,172,325.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	18,851	73.750	1,390,261.250	
	BDO UNIBANK INC	124,238	71.800	8,920,288.400	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	4,575	2,710.000	12,398,250.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	672,475	14.680	9,871,933.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	87,930	119.500	10,507,635.000	
	SM INVESTMENTS CORP	12,462	710.000	8,848,020.000	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	949,200	5.480	5,201,616.000		
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,289,200	4.230	5,453,316.000		

	ABOITIZ POWER CORP	221,200	35.450	7,841,540.000	
フィリピン・ペソ	小計	4,685,313		143,987,972.650 (332,612,217)	
ブラジル・リアル	BRF SA	61,192	44.440	2,719,372.480	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA	26,730	14.470	386,783.100	
	VALE SA	127,727	32.040	4,092,373.080	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	30.340	243,266.120	
	VALE SA-PREF A	176,496	29.800	5,259,580.800	
	RAIA DROGASIL SA	21,900	14.300	313,170.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	83,200	13.300	1,106,560.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	9.720	225,990.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,749	5.780	119,929.220	
	BANCO DO BRASIL SA	48,300	22.700	1,096,410.000	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	37,962	13.660	518,560.920	
	AES TIETE SA	12,300	18.570	228,411.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	276,879	8.620	2,386,696.980	
	LOJAS AMERICANAS SA	38,236	15.180	580,422.480	
	LOJAS AMERICANAS SA	16,100	13.010	209,461.000	
	MARCOPOLO SA	40,800	5.040	205,632.000	
	GERDAU SA	91,130	17.650	1,608,444.500	
	METALURGICA GERDAU SA	24,400	22.130	539,972.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	12,606	97.110	1,224,168.660	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	284,210	14.710	4,180,729.100	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	400,512	15.770	6,316,074.240	
	ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTICIPACOES SA	36,300	14.250	517,275.000	
	KLABIN SA	42,400	12.370	524,488.000	
	SOUZA CRUZ SA	33,700	22.880	771,056.000	
	KROTON EDUCACIONAL SA	20,900	39.050	816,145.000	
	CCR SA	81,420	16.110	1,311,676.200	
	WEG SA	22,900	28.600	654,940.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	195,749	27.420	5,367,437.580	
	BANCO BRADESCO SA	63,560	29.600	1,881,376.000	
	CIA HERING	16,000	27.300	436,800.000	
	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	45,400	7.000	317,800.000	

NATURA COSMETICOS SA	17,600	38.710	681,296.000	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	66,706	13.910	927,880.460	
BRADSPAR SA	22,300	22.370	498,851.000	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	36,300	9.210	334,323.000	
CPFL ENERGIA SA	27,640	18.250	504,430.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	235,680	30.780	7,254,230.400	
PORTO SEGURO SA	9,400	27.790	261,226.000	
FIBRIA CELULOSE SA	30,690	26.450	811,750.500	
BRASKEM SA	14,130	19.920	281,469.600	
TRACTEBEL ENERGIA SA	19,770	35.040	692,740.800	
LOCALIZA RENT A CAR	14,805	31.150	461,175.750	
TELEFONICA BRASIL S.A.	28,028	46.070	1,291,249.960	
LOJAS RENNER SA	14,400	57.450	827,280.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,100	10.230	185,163.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,552	53.500	1,688,032.000	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	11,900	37.530	446,607.000	
CIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA	6,000	33.000	198,000.000	
TOTVS SA	13,000	35.230	457,990.000	
EMBRAER SA	51,560	19.300	995,108.000	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,900	21.150	378,585.000	
BR PROPERTIES SA	19,400	17.850	346,290.000	
M DIAS BRANCO SA	3,600	98.040	352,944.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	11,700	17.900	209,430.000	
ODONTOPREV SA	22,600	9.230	208,598.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	37,600	16.910	635,816.000	
JBS SA	77,800	8.600	669,080.000	
OI SA-PREFERENCE	61,924	4.280	265,034.720	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	64,949	13.230	859,275.270	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	33,198	23.130	767,869.740	
MRV ENGENHARIA E PARTICIPACOES SA	34,600	8.510	294,446.000	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,900	46.850	370,115.000	

	BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL	18,300	11.540	211,182.000	
	ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,200	19.200	464,640.000	
	DURATEX SA	30,943	11.890	367,912.270	
	SUL AMERICA SA	15,448	14.000	216,272.000	
	HYPERMARCAS SA	31,100	16.750	520,925.000	
	BM&FBOVESPA SA	190,000	10.090	1,917,100.000	
	QUALICORP SA	22,700	20.200	458,540.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	88,600	14.020	1,242,172.000	
	CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,138	23.060	464,382.280	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	17,300	13.210	228,533.000	
	CIELO SA	33,757	67.370	2,274,209.090	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	61,900	23.140	1,432,366.000	
	AMBEV SA	448,550	17.040	7,643,292.000	
ブラジル・リアル	小計	4,456,694		87,758,814.300 (3,846,468,831)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	23,631	7.430	175,578.330	
	MBANK	1,540	490.000	754,600.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	3,518	102.700	361,298.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,689	114.100	1,447,814.900	
	BANK PEKAO SA	11,647	179.350	2,088,889.450	
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	69,255	10.050	696,012.750	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	34,308	42.550	1,459,805.400	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,841	377.000	1,071,057.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	87,802	38.650	3,393,547.300	
	SYNTHOS SA	60,398	5.290	319,505.420	
	EUROCASH SA	7,580	43.200	327,456.000	
	GRUPA LOTOS SA	5,604	35.500	198,942.000	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	147,281	5.000	736,405.000	
	KERNEL HOLDING SA	4,994	41.610	207,800.340	
	CYFROWY POLSAT SA	21,501	19.200	412,819.200	
	GRUPA AZOTY SA	4,565	62.260	284,216.900	
	ENEA SA	18,176	14.380	261,370.880	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	68,539	16.290	1,116,500.310	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	4.350	358,979.400	

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	5,301	431.000	2,284,731.000	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,528	50.250	227,532.000	
	ALIOR BANK SA	4,463	78.930	352,264.590	
ポーランド・ズロチ	小計	682,685		18,537,126.770 (629,150,082)	
マレーシア・ リンギット	PARKSON HOLDINGS BHD	83,339	2.780	231,682.420	
	AMMB HOLDINGS BHD	164,700	7.300	1,202,310.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	10,100	10.840	109,484.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	441,700	7.300	3,224,410.000	
	DIGI.COM BHD	343,500	4.850	1,665,975.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	57,600	8.930	514,368.000	
	RHB CAPITAL BHD	64,500	8.000	516,000.000	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	79,878	4.000	319,512.000	
	GAMUDA BHD	108,300	4.490	486,267.000	
	GENTING BHD	187,400	10.280	1,926,472.000	
	YTL CORP BHD	389,810	1.580	615,899.800	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,400	15.400	283,360.000	
	HONG LEONG BANK BHD	63,200	14.140	893,648.000	
	IJM CORP BHD	102,980	5.790	596,254.200	
	IOI CORP BHD	275,213	5.750	1,582,474.750	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	48,000	24.000	1,152,000.000	
	MALAYAN BANKING BHD	428,975	9.900	4,246,852.500	
	LAFARGE MALAYSIA BHD	43,000	8.100	348,300.000	
	MMC CORP BHD	51,000	2.940	149,940.000	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	85,100	4.830	411,033.000	
	MISC BHD	86,780	5.700	494,646.000	
	PPB GROUP BHD	38,000	15.780	599,640.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	24,900	30.640	762,936.000	
	PETRONAS GAS BHD	59,300	23.380	1,386,434.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	280,200	4.360	1,221,672.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	62.640	714,096.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	105,000	5.520	579,600.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	281,150	11.700	3,289,455.000	
	UMW HOLDINGS BHD	57,900	11.700	677,430.000	
	DIALOG GROUP BHD	139,700	3.400	474,980.000	
	PUBLIC BANK BHD (LOCAL)	3,600	19.220	69,192.000	
	PUBLIC BANK BHD	109,200	19.240	2,101,008.000	

	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	268,632	1.890	507,714.480	
	AIRASIA BHD	83,400	2.390	199,326.000	
	SIME DARBY BERHAD	276,400	9.300	2,570,520.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	241,000	6.740	1,624,340.000	
	UEM SUNRISE BHD	145,600	2.290	333,424.000	
	BUMI ARMADA BHD	120,700	4.000	482,800.000	
	MAXIS BHD	248,700	7.100	1,765,770.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	257,900	6.790	1,751,141.000	
	SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	337,800	4.670	1,577,526.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	207,400	3.010	624,274.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	233,800	3.850	900,130.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	83,700	4.500	376,650.000	
	マレーシア・リンギット 小計	6,748,857		45,560,947.150 (1,439,725,929)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	274,300	37.410	10,261,563.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,400	153.800	6,059,720.000	
	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV	34,700	51.420	1,784,274.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	26,300	143.680	3,778,784.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	167,100	33.560	5,607,876.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	241,200	82.010	19,780,812.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	149,800	36.660	5,491,668.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	23,200	162.360	3,766,752.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	64,800	66.650	4,318,920.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	239,400	94.300	22,575,420.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	105,088	54.420	5,718,888.960	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	11,645	331.390	3,859,036.550	
	INDUSTRIAS CH SAB DE CV	14,800	81.810	1,210,788.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	140,100	37.390	5,238,339.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	20,200	152.070	3,071,814.000	

	GRUPO MEXICO SAB DE CV	373,752	42.930	16,045,173.360	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,386,078	14.280	48,353,193.840	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	207,900	34.940	7,264,026.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	27,100	78.180	2,118,678.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	518,900	33.090	17,170,401.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	26,200	70.480	1,846,576.000	
	GENOMMA LAB INTERNACIONAL SAB DE CV	69,800	34.500	2,408,100.000	
	OHL MEXICO SAB DE CV	71,500	33.680	2,408,120.000	
	MINERA FRISCO SAB DE CV	74,900	24.660	1,847,034.000	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	130,900	23.740	3,107,566.000	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	37,900	40.960	1,552,384.000	
メキシコ・ペソ 小計		6,476,963		206,645,907.710 (1,632,502,671)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	95,279	1.740	165,785.460	
	ALPHA BANK A.E.	140,087	0.730	102,263.510	
	NATIONAL BANK OF GREECE	29,998	4.170	125,091.660	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,332	21.800	116,237.600	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	22,982	11.670	268,199.940	
	FOLLI FOLLIE SA	3,130	26.700	83,571.000	
	HELLENIC PETRO	7,123	7.720	54,989.560	
	OPAP SA	21,122	10.640	224,738.080	
	JUMBO SA	10,130	12.680	128,448.400	
	PUBLIC POWER CORP	10,857	11.380	123,552.660	
ユーロ 小計		346,040		1,392,877.870 (196,688,284)	
韓国・ウォン	CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,830	27,700.000	272,291,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,555	127,000.000	451,485,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,463	247,500.000	857,092,500.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,728	56,600.000	267,604,800.000	
	COWAY CO LTD	5,520	64,400.000	355,488,000.000	
	KT&G CORP	10,938	75,100.000	821,443,800.000	

S-1 CORPORATION	1,432	76,700.000	109,834,400.000	
KOREA GAS CORP	2,355	68,500.000	161,317,500.000	
CJ CORP	893	114,000.000	101,802,000.000	
CHEIL INDUSTRIES INC	5,177	79,800.000	413,124,600.000	
DOOSAN INFRACORE CO.,LTD	14,640	12,600.000	184,464,000.000	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	9,480	35,350.000	335,118,000.000	
SK TELECOM CO LTD	864	226,000.000	195,264,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	3,097	84,500.000	261,696,500.000	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	20,370	8,760.000	178,441,200.000	
NCSOFT CORPORATION	1,442	218,000.000	314,356,000.000	
LG UPLUS CORP	19,290	11,000.000	212,190,000.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	5,440	35,250.000	191,760,000.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	12,500	6,620.000	82,750,000.000	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	4,351	41,250.000	179,478,750.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	883	538,000.000	475,054,000.000	
LG CHEM LTD	4,396	270,000.000	1,186,920,000.000	
LG CHEM LTD	480	138,500.000	66,480,000.000	
LS CORP	2,059	84,500.000	173,985,500.000	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	1,800	69,400.000	124,920,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	39,141	44,650.000	1,747,645,650.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	6,713	24,350.000	163,461,550.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	5,812	12,250.000	71,197,000.000	
S-OIL CORP	3,908	70,600.000	275,904,800.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,951	22,050.000	197,369,550.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,278	43,950.000	275,918,100.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,767	205,500.000	363,118,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	4,230	231,500.000	979,245,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,448	279,500.000	1,802,216,000.000	
SK HYNIX INC	51,520	38,150.000	1,965,488,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,782	60,800.000	412,345,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,884	120,000.000	226,080,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	14,863	228,000.000	3,388,764,000.000	

HYUNDAI MIPO DOCKYARD	987	175,500.000	173,218,500.000	
HYUNDAI HYSKO	3,580	41,500.000	148,570,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	4,970	79,400.000	394,618,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	8,700	12,200.000	106,140,000.000	
KCC CORP	490	487,000.000	238,630,000.000	
KIA MOTORS CORP	24,696	52,500.000	1,296,540,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	824	316,500.000	260,796,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,417	35,300.000	861,920,100.000	
HANWHA CORP	2,636	37,500.000	98,850,000.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,851	32,600.000	92,942,600.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	201,500.000	302,250,000.000	
HYUNDAI SECURITIES CO	15,940	5,870.000	93,567,800.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,472	86,200.000	126,886,400.000	
KT CORP	3,668	31,600.000	115,908,800.000	
LG ELECTRONICS INC	9,874	65,900.000	650,696,600.000	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO LTD	29,427	12,600.000	370,780,200.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	71	1,866,000.000	132,486,000.000	
LG CORP	9,046	60,800.000	549,996,800.000	
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,973	9,340.000	149,187,820.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,132	35,700.000	147,512,400.000	
NAVER CORP	2,756	670,000.000	1,846,520,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,551	153,000.000	237,303,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,730	39,100.000	145,843,000.000	
DOOSAN CORP	1,014	131,000.000	132,834,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	314	471,500.000	148,051,000.000	
KANGWON LAND INC	9,140	33,050.000	302,077,000.000	
POSCO	6,118	310,500.000	1,899,639,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,927	69,700.000	134,311,900.000	
SAMSUNG C&T CORP	12,023	57,600.000	692,524,800.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,424	151,000.000	517,024,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	6,038	67,600.000	408,168,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,629	1,295,000.000	13,764,555,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	16,170	35,100.000	567,567,000.000	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	4,103	52,300.000	214,586,900.000	

SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,936	960,000.000	1,858,560,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	882	244,000.000	215,208,000.000	
HYOSUNG CORP	2,374	71,700.000	170,215,800.000	
ORION CORP	274	858,000.000	235,092,000.000	
YUHAN CORP	952	197,000.000	187,544,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,331	181,500.000	423,076,500.000	
HALLA CLIMATE CONTROL	4,350	36,000.000	156,600,000.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	31,950.000	182,434,500.000	
GS HOLDINGS CORP	5,448	53,400.000	290,923,200.000	
LG DISPLAY CO LTD	21,078	25,800.000	543,812,400.000	
SK NETWORKS CO LTD	16,150	8,070.000	130,330,500.000	
HITE JINRO CO LTD	1,580	21,950.000	34,681,000.000	
CELLTRION INC	5,987	46,450.000	278,096,150.000	
HANA FINANCIAL GROUP	24,886	41,300.000	1,027,791,800.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,245	223,000.000	277,635,000.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	2,981	37,800.000	112,681,800.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,217	402,500.000	489,842,500.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,717	100,500.000	574,558,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	322	982,000.000	316,204,000.000	
SAMSUNG CARD CO	4,488	35,200.000	157,977,600.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,016	131,500.000	791,104,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	703	267,000.000	187,701,000.000	
LG INNOTEK CO LTD	945	85,500.000	80,797,500.000	
SK C&C CO LTD	2,582	127,000.000	327,914,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	37,974	39,850.000	1,513,263,900.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,471	173,000.000	254,483,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	2,980	28,800.000	85,824,000.000	
BS FINANCIAL GROUP INC	13,320	15,550.000	207,126,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	18,670	7,200.000	134,424,000.000	
E-MART CO LTD	1,958	258,500.000	506,143,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	14,590	16,350.000	238,546,500.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,765	63,600.000	430,254,000.000	
NHN ENTERTAINMENT CORP	1,403	80,500.000	112,941,500.000	
韓国・ウォン 小計	770,756		59,699,406,370.000 (5,838,601,943)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	95,000	13.620	1,293,900.000

JIANGSU EXPRESS	136,000	9.090	1,236,240.000	
YANTAI CHANGYU PIONEER WINE CO	24,400	23.280	568,032.000	
CHINA MOBILE LIMITED	579,000	77.800	45,046,200.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	135,000	27.150	3,665,250.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	280,000	3.470	971,600.000	
BEIJING ENTERPRISES	55,500	70.700	3,923,850.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	292,000	7.580	2,213,360.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	126,000	6.200	781,200.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	71,500	89.950	6,431,425.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	80,800	15.410	1,245,128.000	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	84,000	4.030	338,520.000	
CNOOC LTD	1,695,000	13.900	23,560,500.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	282,000	12.580	3,547,560.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	377,120	22.100	8,334,352.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	192,000	19.520	3,747,840.000	
CITIC PACIFIC	133,000	10.200	1,356,600.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	212,000	6.160	1,305,920.000	
LENOVO GROUP LTD	630,000	9.540	6,010,200.000	
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	217,000	4.100	889,700.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,978,000	8.030	15,883,340.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	450,742	10.960	4,940,132.320	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	68,800	14.020	964,576.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,473,200	5.870	14,517,684.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	72,000	53.500	3,852,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	292,000	13.500	3,942,000.000	
COSCO PACIFIC LTD	176,000	10.420	1,833,920.000	
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LTD	316,000	2.510	793,160.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	564,000	1.820	1,026,480.000	

CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	122,000	26.650	3,251,300.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	446,000	2.770	1,235,420.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	11.760	917,280.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	188,000	11.240	2,113,120.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	54,900	19.800	1,087,020.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	470,000	3.410	1,602,700.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	112,000	25.350	2,839,200.000	
BYD CO LTD	56,500	37.250	2,104,625.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,318,000	3.710	4,889,780.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	136,000	21.800	2,964,800.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	290,000	10.520	3,050,800.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	197,000	5.110	1,006,670.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	288,158	10.420	3,002,606.360	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	176,000	4.560	802,560.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	189,200	19.540	3,696,968.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	96,500	39.250	3,787,625.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	726,000	22.050	16,008,300.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	661,000	1.700	1,123,700.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	148,000	10.000	1,480,000.000	
WEICHAI POWER CO LTD	57,360	28.500	1,634,760.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	363,000	2.080	755,040.000	
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS GROUP LTD	79,000	7.210	569,590.000	
CHINA VANKE CO LTD	112,261	11.880	1,333,660.680	
SHANGHAI INDUSTRIAL	38,000	27.300	1,037,400.000	
TINGYI HOLDING CORP	176,000	22.150	3,898,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	32,000	60.550	1,937,600.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	302,000	7.320	2,210,640.000	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	110,000	24.900	2,739,000.000	

ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	164,000	7.240	1,187,360.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	324,000	6.700	2,170,800.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	1.900	537,700.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	142,000	37.000	5,254,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	98,200	496.600	48,766,120.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	172,500	67.300	11,609,250.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	302,000	4.590	1,386,180.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	1,220,240	1.390	1,696,133.600	
AIR CHINA / HONG KONG	168,000	5.290	888,720.000	
ZTE CORP	50,240	15.260	766,662.400	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	340,000	2.600	884,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	331,000	22.200	7,348,200.000	
COSCO HOLDINGS	304,000	3.420	1,039,680.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	851,205	5.200	4,426,266.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	196,000	14.320	2,806,720.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	67,000	36.300	2,432,100.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,062,530	5.580	39,408,917.400	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	60,000	27.300	1,638,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	286,000	11.640	3,329,040.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	104,000	7.910	822,640.000	
WUMART STORES INC	51,000	12.020	613,020.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	190,000	6.530	1,240,700.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	298,000	7.650	2,279,700.000	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD	69,000	11.080	764,520.000	
BANK OF CHINA LTD	7,275,200	3.440	25,026,688.000	
SHUI ON LAND LTD	345,600	2.350	812,160.000	

SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	151,500	18.100	2,742,150.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	11.800	708,000.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	102,000	11.120	1,134,240.000	
CHINA BLUECHEMICAL LTD	184,000	4.660	857,440.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	462,470	14.960	6,918,551.200	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,980,235	4.950	34,552,163.250	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	297,600	4.470	1,330,272.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	417,000	5.800	2,418,600.000	
CHINA COAL ENERGY CO	308,000	4.210	1,296,680.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	27,000	17.400	469,800.000	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC CO LTD	46,000	25.900	1,191,400.000	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	120,000	8.050	966,000.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	82,000	22.450	1,840,900.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	215,800	3.650	787,670.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	459,509	4.660	2,141,311.940	
CHINA CITIC BANK-H	629,800	3.970	2,500,306.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	435,000	9.610	4,180,350.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	78,000	11.000	858,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	117,500	7.640	897,700.000	
FRANSHION PROPERTIES CHINA LTD	402,000	2.630	1,057,260.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	4.780	1,371,860.000	
SOHO CHINA LTD	154,000	6.350	977,900.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	839,000	2.780	2,332,420.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	396,000	3.700	1,465,200.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	105,000	7.540	791,700.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	202,000	6.970	1,407,940.000	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	573,000	10.780	6,176,940.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	263,800	28.100	7,412,780.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	662,000	2.860	1,893,320.000	
CSR CORP LTD - H	227,000	6.040	1,371,080.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	230,500	11.260	2,595,430.000	
BBMG CORP	131,000	5.880	770,280.000	
SINOPHARM GROUP CO	97,200	22.750	2,211,300.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	258,000	5.040	1,300,320.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	229,805	7.940	1,824,651.700	
YINGDE GASES	83,000	7.680	637,440.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	139,000	3.510	487,890.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	243,000	9.590	2,330,370.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	54,500	18.120	987,540.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	198,000	7.910	1,566,180.000	
BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	15,500	71.550	1,109,025.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	44,280	7.040	311,731.200	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	135,500	11.300	1,531,150.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	59,200	24.650	1,459,280.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	484,900	8.080	3,917,992.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,998,000	3.600	7,192,800.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	49,500	11.540	571,230.000	
FAR EAST HORIZON LTD	190,000	6.140	1,166,600.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	109,000	18.600	2,027,400.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	126,000	12.100	1,524,600.000	

	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	74,400	18.700	1,391,280.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	405,000	3.580	1,449,900.000	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	82,500	10.900	899,250.000	
	HANERGY SOLAR GROUP LTD	1,056,000	1.200	1,267,200.000	
香港・ドル	小計	61,643,655		541,017,286.050 (7,206,350,250)	
台湾・ドル	ACER INC	203,069	18.450	3,746,623.050	
	ASUSTEK COMPUTER INC	61,554	289.000	17,789,106.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	48,616	79.500	3,864,972.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	634,729	27.450	17,423,311.050	
	ASIA CEMENT CORP	235,891	37.300	8,798,734.300	
	TAIWAN BUSINESS BANK	261,498	9.180	2,400,551.640	
	FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS CORP	1,914	335.000	641,190.000	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	85,000	65.500	5,567,500.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	34.350	2,679,300.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	138,210	23.950	3,310,129.500	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	51,596	77.000	3,972,892.000	
	QUANTA COMPUTER INC	249,858	72.100	18,014,761.800	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	16,600	60.500	1,004,300.000	
	CHENG UEI PRECISION INDUSTRY CO LTD	42,286	60.900	2,575,217.400	
	EVA AIRWAYS CORP	158,227	16.600	2,626,568.200	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	61,760	204.000	12,599,040.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	446,357	18.500	8,257,604.500	
	CHINA AIRLINES	232,156	10.800	2,507,284.800	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	169,169	77.700	13,144,431.300	
	CHINA STEEL CORP	1,104,155	26.250	28,984,068.750	
	CHINA MOTORS CO	15,000	29.000	435,000.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	238,344	31.350	7,472,084.400	

ADVANTECH CO LTD	32,251	201.000	6,482,451.000	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO LTD	23,460	49.800	1,168,308.000	
CLEVO CO	35,424	64.100	2,270,678.400	
CHINA PETROCHEMICAL DEVELOPMENT CORP	93,200	13.800	1,286,160.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	306,304	22.500	6,891,840.000	
CTCI CORP	39,000	44.700	1,743,300.000	
DELTA ELECTRONICS INC	177,448	165.500	29,367,644.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	372,327	92.000	34,254,084.000	
AU OPTRONICS CORP	873,194	9.550	8,339,002.700	
TAIWAN MOBILE CO LTD	160,800	94.900	15,259,920.000	
EVERGREEN MARINE CORP	206,399	17.750	3,663,582.250	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORES CO LTD	108,781	28.450	3,094,819.450	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	323,807	33.800	10,944,676.600	
FENG HSIN IRON & STEEL CO	39,150	54.000	2,114,100.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	16,000	330.000	5,280,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,285	130.000	7,577,050.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	400,633	79.000	31,650,007.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	89,000	33.800	3,008,200.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	303,594	81.600	24,773,270.400	
TRANSCEND INFORMATION INC	22,897	88.200	2,019,515.400	
EPISTAR CORP	90,149	61.500	5,544,163.500	
GIANT MANUFACTURING	32,151	195.000	6,269,445.000	
MEDIATEK INC	118,570	415.500	49,265,835.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	676,936	43.350	29,345,175.600	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	483,782	17.400	8,417,806.800	
HOTAI MOTOR CO LTD	23,000	377.000	8,671,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	180,000	62.000	11,160,000.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	29,088	141.000	4,101,408.000	

YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	893,600	17.350	15,503,960.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	752,067	47.400	35,647,975.800	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,449,403	9.200	13,334,507.600	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	422,026	19.350	8,166,203.100	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,083,769	81.800	88,652,304.200	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	939,075	24.650	23,148,198.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	1,150.000	10,603,000.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	462,526	14.600	6,752,879.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	460,213	10.400	4,786,215.200	
INVENTEC CO LTD	211,005	26.450	5,581,082.250	
LCY CHEMICAL CORP	30,250	40.700	1,231,175.000	
HTC CORPORATION	66,832	131.000	8,754,992.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	192,014	46.400	8,909,449.600	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	43,496	125.000	5,437,000.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	667,967	14.450	9,652,123.150	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,255,943	20.050	25,181,657.150	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	709,975	18.350	13,028,041.250	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	19,000	212.000	4,028,000.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	82,560	46.100	3,806,016.000	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	76,119	36.650	2,789,761.350	
NAN YA PLASTICS CORP	458,828	67.400	30,925,007.200	
WISTRON CORP	240,481	25.300	6,084,169.300	
KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP	31,020	97.600	3,027,552.000	
POU CHEN CORP	130,990	42.500	5,567,075.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	453,841	52.200	23,690,500.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	62,392	197.000	12,291,224.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	113,480	83.100	9,430,188.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	14,658	192.500	2,821,665.000	

RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	45,569	53.600	2,442,498.400	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	52,715	75.000	3,953,625.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	84,886	68.200	5,789,225.200	
SILICONWARE PRECISION INDS	314,743	37.500	11,802,862.500	
STANDARD FOODS CORP	14,628	90.500	1,323,834.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	106,666	48.350	5,157,301.100	
TAIWAN CEMENT CORP	330,874	43.800	14,492,281.200	
TAIWAN GLASS INDUSTRIAL CORP	61,301	33.100	2,029,063.100	
TSRC CORP	67,790	45.000	3,050,550.000	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	143,000	33.400	4,776,200.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,363,083	103.000	243,397,549.000	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	22,000	52.500	1,155,000.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,109,525	12.650	14,035,491.250	
WAN HAI LINES LTD	122,587	15.300	1,875,581.100	
WALSIN LIHWA CORP	378,000	9.610	3,632,580.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	86,668	13.800	1,196,018.400	
YULON MOTOR CO	93,149	54.400	5,067,305.600	
INNOLUX CORPORATION	571,410	11.350	6,485,503.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	111,526	35.250	3,931,291.500	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	18,936	252.000	4,771,872.000	
HERMES MICROVISION INC	3,000	908.000	2,724,000.000	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	15,035	330.500	4,969,067.500	
PEGATRON CORP	122,554	39.050	4,785,733.700	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	71,500	79.000	5,648,500.000	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	13,520	89.300	1,207,336.000	
TPK HOLDING CO LTD	24,494	172.500	4,225,215.000	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	141,000	15.500	2,185,500.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	14,385	77.300	1,111,960.500	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	420,666	16.350	6,877,889.100	
台湾・ドル 小計	28,107,579		1,254,710,871.140 (4,316,205,397)	

南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	11.340	1,276,158.240	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	11,263	195.340	2,200,114.420	
	BARLOWORLD LTD	23,384	97.420	2,278,069.280	
	BIDVEST GROUP LTD	27,457	269.980	7,412,840.860	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	42,285	78.600	3,323,601.000	
	STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	114,872	47.250	5,427,702.000	
	ASSORE LTD	3,722	343.000	1,276,646.000	
	DISCOVERY LTD	27,542	82.300	2,266,706.600	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	207,686	9.570	1,987,555.020	
	MASSMART HOLDINGS LTD	10,432	124.430	1,298,053.760	
	GOLD FIELDS LTD	63,646	33.410	2,126,412.860	
	REMGRO LTD	50,492	208.960	10,550,808.320	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	19,461	96.300	1,874,094.300	
	NORTHAM PLATINUM LTD	35,773	42.500	1,520,352.500	
	MMI HOLDINGS LTD	113,466	26.100	2,961,462.600	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	173,761	24.200	4,205,016.200	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,073	27.750	1,112,025.750	
	EXXARO RESOURCES LTD	12,410	148.090	1,837,796.900	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	7,868	125.200	985,073.600	
	MTN GROUP LTD	162,066	215.000	34,844,190.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	33,492	130.150	4,358,983.800	
	FIRSTRAND LTD	315,942	34.320	10,843,129.440	
	NASPERS LTD	37,891	1,093.780	41,444,417.980	
	NEDBANK GROUP LTD	16,600	207.170	3,439,022.000	
	NETCARE LTD	95,948	25.800	2,475,458.400	
	PICK 'N PAY STORES LTD	27,363	51.550	1,410,562.650	
	REUNERT LTD	16,315	66.400	1,083,316.000	
	RMB HOLDINGS LTD	78,470	47.950	3,762,636.500	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,114	380.010	2,323,381.140	
	SAPPI LTD	65,224	32.850	2,142,608.400	
	SASOL LTD	53,966	520.000	28,062,320.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,558	160.700	6,517,670.600	
MR PRICE GROUP LTD	23,912	165.850	3,965,805.200		
STANDARD BANK GROUP LTD	117,987	130.250	15,367,806.750		

SPAR GROUP LTD/THE	19,656	126.050	2,477,638.800	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,570	74.590	5,785,946.300	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	19,114	203.810	3,895,624.340	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	31,288	265.000	8,291,320.000	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	29,034	131.600	3,820,874.400	
TIGER BRANDS LTD	14,014	264.510	3,706,843.140	
NAMPAK LTD	60,915	39.330	2,395,786.950	
SANLAM LTD	168,975	53.700	9,073,957.500	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	26,330	75.980	2,000,553.400	
INVESTEC LTD	29,615	77.280	2,288,647.200	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	55,032	116.150	6,391,966.800	
KUMBA IRON ORE LTD	7,833	422.820	3,311,949.060	
PPC LTD	69,881	29.400	2,054,501.400	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	103,090	40.410	4,165,866.900	
RMI HOLDINGS	60,982	26.700	1,628,219.400	
VODACOM GROUP PTY LTD	34,684	131.200	4,550,540.800	
南アフリカ・ランド 小計	2,997,990		283,802,035.460 (2,710,309,439)	
合計	151,807,031		36,394,271,057 (36,394,271,057)	

(2) 株式以外の有価証券

平成26年1月14日現在

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,148,621.000	18,171,184.220	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	188,500.000	23,624,705.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,337,121.000	41,795,889.220 (330,187,525)	
投資信託受益証券	合計		1,337,121	330,187,525 (330,187,525)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	219,394.000	476,084.980	
		トルコ・リラ	小計	219,394.000	476,084.980 (22,566,428)
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	145,400.000	6,433,950.000	
	メキシコ・ペソ	小計	145,400.000	6,433,950.000 (50,828,205)	
投資証券	合計		364,794	73,394,633 (73,394,633)	
合計				403,582,158 (403,582,158)	

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 48銘柄	9.59%	-%	-%	9.89%
インド・ルピー	株式 71銘柄	5.75%	-%	-%	5.94%
インドネシア・ルピア	株式 30銘柄	2.31%	-%	-%	2.39%
タイ・バーツ	株式 30銘柄	2.13%	-%	-%	2.20%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.24%	-%	-%	0.25%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.43% -%	-% -%	-% 0.06%	1.53%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.27%	-%	-%	0.28%
フィリピン・ペソ	株式 19銘柄	0.88%	-%	-%	0.90%
ブラジル・リアル	株式 75銘柄	10.13%	-%	-%	10.45%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.66%	-%	-%	1.71%
マレーシア・リンギット	株式 44銘柄	3.79%	-%	-%	3.91%
メキシコ・ペソ	株式 26銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	4.30% -% -%	-% 0.87% -%	-% -% 0.13%	5.47%
ユーロ	株式 10銘柄	0.52%	-%	-%	0.53%
韓国・ウォン	株式 105銘柄	15.37%	-%	-%	15.87%
香港・ドル	株式 137銘柄	18.98%	-%	-%	19.58%
台湾・ドル	株式 107銘柄	11.37%	-%	-%	11.73%
南アフリカ・ランド	株式 50銘柄	7.14%	-%	-%	7.37%

(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。

「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7月11日現在	平成26年1月14日現在
資産の部			
流動資産			
預金		993,288,048	935,551,132
コール・ローン		26,655,503	155,668,597
国債証券		33,069,651,653	33,982,851,042
派生商品評価勘定		200,070	-
未収利息		625,185,201	654,823,508
前払費用		31,963,416	14,320,492
流動資産合計		34,746,943,891	35,743,214,771
資産合計		34,746,943,891	35,743,214,771
負債の部			
流動負債			
未払解約金		23,650,000	4,583,000
流動負債合計		23,650,000	4,583,000
負債合計		23,650,000	4,583,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	25,952,878,514	25,243,130,380
剰余金			
剰余金又は欠損金()		8,770,415,377	10,495,501,391
元本等合計		34,723,293,891	35,738,631,771
純資産合計		34,723,293,891	35,738,631,771
負債純資産合計		34,746,943,891	35,743,214,771

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成25年7月11日現在	平成26年1月14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	28,309,027,227円	25,952,878,514円
	同期中追加設定元本額	2,361,571,124円	1,615,904,533円
	同期中一部解約元本額	4,717,719,837円	2,325,652,667円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	マネックス資産設計ファンド	33,962,135円	33,290,175円
	エボリューション		
	D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国10）	267,612円	4,487,571円
	D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国20）	737,069円	8,312,309円
	D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国30）	1,723,423円	21,137,131円
	投資のソムリエ	1,510,150円	111,323,605円
	クルーズコントロール	382,873円	53,525,426円
	投資のソムリエ＜DC年金＞	- 円	1,280,751円
	D I A M 8 資産バラン スファンドN＜DC年金＞	- 円	358,267円
	グローバル債券ファンド（適格 機関投資家限定）	321,885,428円	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）	885,794,406円	835,800,885円
	エマージング債券パッシブファ ンドVA（適格機関投資家専 用）	5,256,993,244円	5,153,890,667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）	12,084,180,790円	11,458,441,241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）	7,365,441,384円	7,073,097,903円
	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド（適格機関投資家限定）	- 円	166,299,021円
	計	25,952,878,514円	25,243,130,380円
2 .	受益権の総数	25,952,878,514口	25,243,130,380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25年1月12日 至 平成25年7月11日	自 平成25年7月12日 至 平成26年1月14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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成25年7月11日現在	平成26年1月14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	3,935,186,226	4,187,953,904
合計	3,935,186,226	4,187,953,904

（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25年4月19日から平成25年7月11日まで及び平成25年4月19日から平成26年1月14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7月11日 現在				平成26年1月14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	13,148,070	-	12,948,000	200,070	-	-	-	-
アメリカ・ドル	13,148,070	-	12,948,000	200,070	-	-	-	-
合計	13,148,070	-	12,948,000	200,070	-	-	-	-

（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7月11日現在	平成26年1月14日現在
1口当たり純資産額	1.3379円	1.4158円
(1万口当たり純資産額)	(13,379円)	(14,158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26年1月14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	1,800,000.000	2,625,480.000	
		BRAZIL 11.0 08/17/40	1,800,000.000	2,052,000.000	
		BRAZIL 12.25 03/06/30	800,000.000	1,352,800.000	
		BRAZIL 2.625 01/05/23	2,500,000.000	2,137,500.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	3,900,000.000	4,085,250.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	3,600,000.000	3,477,600.000	
		BRAZIL 5.875 01/15/19	2,100,000.000	2,352,000.000	
		BRAZIL 6.0 01/17/17	2,400,000.000	2,667,600.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	4,000,000.000	4,530,000.000	
		BRAZIL 7.875 03/07/15	2,100,000.000	2,260,650.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	2,900,000.000	3,619,200.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,000,000.000	2,632,000.000	
		BRAZIL 8.875 04/15/24	2,500,000.000	3,298,500.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	2,200,000.000	2,808,300.000	
		COLOMBIA 11.75 02/25/20	900,000.000	1,281,555.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,100,000.000	965,250.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	3,400,000.000	3,497,750.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	4,000,000.000	4,330,000.000	
		COLOMBIA 7.375 01/27/17	2,650,000.000	3,087,250.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	3,600,000.000	4,338,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	2,900,000.000	3,588,750.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	1,800,000.000	2,284,920.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	1,700,000.000	1,687,250.000	
		CROATIA 6.25 04/27/17	1,900,000.000	2,048,200.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	1,700,000.000	1,791,800.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	2,000,000.000	2,176,900.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	1,600,000.000	1,756,160.000	
		HUNGARY 4.125 02/19/18	1,500,000.000	1,527,750.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	2,500,000.000	2,512,350.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	2,700,000.000	2,949,750.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	3,400,000.000	3,715,180.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	1,600,000.000	1,824,800.000	

INDONESIA 11.625 03/04/19	2,300,000.000	3,050,950.000	
INDONESIA 3.75 04/25/22	2,300,000.000	2,081,500.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	2,700,000.000	2,659,500.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	2,600,000.000	2,193,750.000	
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,200,000.000	2,329,140.000	
INDONESIA 6.625 02/17/37	1,700,000.000	1,693,795.000	
INDONESIA 6.875 01/17/18	2,600,000.000	2,917,980.000	
INDONESIA 6.875 03/09/17	1,250,000.000	1,395,375.000	
INDONESIA 7.25 04/20/15	1,000,000.000	1,067,500.000	
INDONESIA 7.5 01/15/16	1,000,000.000	1,102,500.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,300,000.000	2,555,070.000	
INDONESIA 8.5 10/12/35	1,900,000.000	2,267,365.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	3,200,000.000	3,507,200.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	4,000,000.000	4,488,000.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,900,000.000	2,296,625.000	
PANAMA 8.875 09/30/27	1,800,000.000	2,415,510.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	1,900,000.000	2,633,400.000	
PERU 5.625 11/18/50	2,500,000.000	2,534,775.000	
PERU 6.55 03/14/37	2,100,000.000	2,450,910.000	
PERU 7.125 03/30/19	1,700,000.000	2,069,750.000	
PERU 7.35 07/21/25	3,800,000.000	4,806,240.000	
PERU 8.375 05/03/16	1,200,000.000	1,378,140.000	
PERU 8.75 11/21/33	4,000,000.000	5,722,400.000	
PHILIPPINES 10.625 03/16/25	1,800,000.000	2,799,000.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	2,400,000.000	2,497,848.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	1,500,000.000	1,560,000.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	1,900,000.000	2,120,875.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	1,600,000.000	1,894,000.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,300,000.000	3,935,250.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	1,000,000.000	1,188,750.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	2,700,000.000	3,591,000.000	

PHILIPPINES 8.375 06/17/19	1,200,000.000	1,536,000.000	
PHILIPPINES 9.375 01/18/17	500,000.000	611,980.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	2,300,000.000	3,473,000.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	1,500,000.000	1,995,000.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	3,000,000.000	3,423,750.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 3.625 04/29/15	3,700,000.000	3,829,685.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	5,000,000.000	5,381,250.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	18,876,000.000	22,127,202.240	
RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	4,600,000.000	6,186,540.000	
RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	3,500,000.000	5,940,200.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.25 04/04/17	2,000,000.000	2,092,100.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	1,600,000.000	1,636,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	4,000,000.000	4,032,600.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	1,900,000.000	1,843,000.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	2,600,000.000	2,789,020.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,000,000.000	1,080,000.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	800,000.000	836,000.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	2,300,000.000	2,633,500.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	1,700,000.000	2,589,100.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	2,000,000.000	1,689,200.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	1,900,000.000	1,505,750.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	1,500,000.000	1,457,040.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	2,700,000.000	2,765,880.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	3,400,000.000	3,120,350.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,200,000.000	2,304,060.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	2,000,000.000	2,196,500.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	2,100,000.000	2,113,125.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	2,900,000.000	2,958,870.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	2,300,000.000	2,538,625.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	2,300,000.000	2,526,550.000	
TURKEY 7.0 09/26/16	3,000,000.000	3,304,230.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	1,300,000.000	1,387,100.000	
TURKEY 7.25 03/15/15	4,000,000.000	4,228,200.000	

	TURKEY 7.375 02/05/25	3,900,000.000	4,299,750.000	
	TURKEY 7.5 07/14/17	2,200,000.000	2,465,650.000	
	TURKEY 7.5 11/07/19	1,800,000.000	2,027,700.000	
	TURKEY 8.0 02/14/34	1,900,000.000	2,185,950.000	
	UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16	3,000,000.000	3,800,700.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	3,400,000.000	3,376,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	6,300,000.000	5,733,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	2,300,000.000	2,553,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17	2,300,000.000	2,560,360.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	3,200,000.000	2,982,400.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	3,200,000.000	3,696,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,400,000.000	5,894,100.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.625 03/03/15	2,500,000.000	2,665,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	3,900,000.000	4,559,490.000	
	UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	1,400,000.000	1,773,940.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.0 09/24/22	900,000.000	1,147,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.125 12/30/19	1,700,000.000	2,269,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	1,700,000.000	2,320,500.000	
	アメリカ・ドル 小計	290,376,000.000 (30,001,648,320)	328,908,740.240 (33,982,851,042)	
国債証券	合計	30,001,648,320 (30,001,648,320)	33,982,851,042 (33,982,851,042)	
合計		30,001,648,320 (30,001,648,320)	33,982,851,042 (33,982,851,042)	

(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 114銘柄	95.09%	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

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成26年1月31日現在

資産総額	1,619,518,816円
負債総額	1,478,704円
純資産総額（ - ）	1,618,040,112円
発行済数量	1,563,279,025口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0350円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	318,437,334,268円
負債総額	2,411,107,153円
純資産総額（ - ）	316,026,227,115円
発行済数量	185,996,176,970口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6991円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	453,458,509,854円
負債総額	5,497,887,000円
純資産総額（ - ）	447,960,622,854円
発行済数量	375,765,680,884口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1921円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	29,167,686,961円
負債総額	800,441,890円
純資産総額（ - ）	28,367,245,071円
発行済数量	21,119,255,647口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3432円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	306,801,481,481円
負債総額	334,765,798円
純資産総額（ - ）	306,466,715,683円
発行済数量	137,643,547,397口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2265円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	27,060,224,198円
負債総額	197,639,100円
純資産総額（ - ）	26,862,585,098円
発行済数量	33,377,717,657口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8048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26年1月31日現在

資産総額	175,720,910,473円
負債総額	465,014,000円
純資産総額（ - ）	175,255,896,473円
発行済数量	144,551,811,459口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2124円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	36,865,262,955円
負債総額	81,238,263円
純資産総額（ - ）	36,784,024,692円
発行済数量	42,670,407,050口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8621円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成26年1月31日現在

資産総額	34,988,613,548円
負債総額	24,354,000円
純資産総額（ - ）	34,964,259,548円
発行済数量	24,928,985,772口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4026円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1) 資本金の額

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

直近5カ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

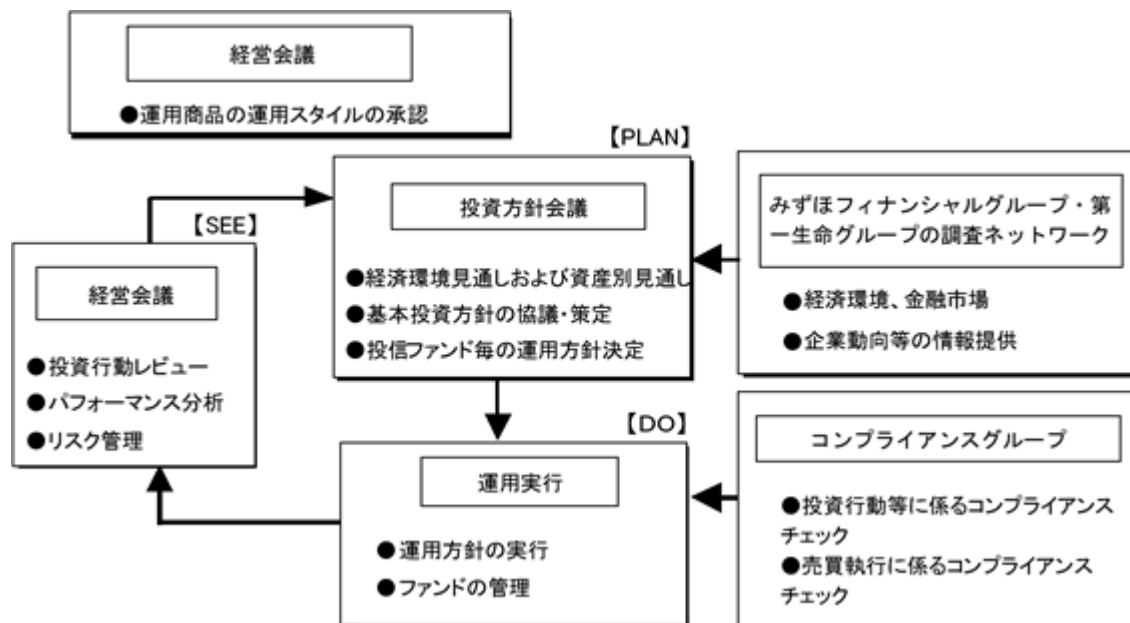
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成26年1月31日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

<更新・訂正後>

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

平成26年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は313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	9	21,961,797,499
追加型株式投資信託	294	4,918,644,239,908
単位型公社債投資信託	9	89,747,666,936
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	102,550,316
合計	313	5,030,456,254,659

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57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. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、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、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、第29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間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	第28期
	(自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	(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

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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p> <p>(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。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当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。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

第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）

（1）概要

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

（2）適用予定日

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。

（3）当該会計基準等の適用による影響

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。

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 其他有価証券」には含めておりません。

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

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			
株式	359,540	146,101	213,438
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			
株式	307,639	146,101	161,537
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,005	3,000	1,005
小計	311,644	149,101	162,543
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	8,688	10,000	1,312
小計	8,688	10,000	1,312
合計	320,332	159,101	161,231

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

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せん。

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 預金の引出 (純額) 受取利息	1,548,354 91,135 104	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	122,786 433,779 -
	株式会社 みずほ コーポ レート銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設 定投資 信託の 販売、 預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料 預金の預入 (純額) 受取利息	450,766 392,267 3,654	未払 手数料 現金・ 預金 未収 収益	83,446 11,440,025 -
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	-	当社預 り資産 の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	237,031 15,140	未払 費用 未払 費用	127,757 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) 信託報酬の 支払	1,000,000 5,087	金銭の 信託	6,548,577

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

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。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第29期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,422,331
金銭の信託		9,988,674
前払費用		81,570
未収委託者報酬		3,539,476
未収運用受託報酬		1,927,231
未収投資助言報酬		233,557
未収収益		265,944
繰延税金資産		365,930
その他		77,287
	流動資産計	25,902,003
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	131,728
車両運搬具	1	2,193
器具備品	1	192,157
建設仮勘定		6,839
無形固定資産		
商標権	1	242
ソフトウェア	1	1,141,508
ソフトウェア仮勘定		292,572
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	258
投資その他の資産		
投資有価証券		4,022,411
関係会社株式		409,446
関係会社株式		2,119,074
繰延税金資産		675,426
差入保証金		731,197
その他		87,266
	固定資産計	5,797,060
資産合計		31,699,064

（単位：千円）

	第29期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	915,630
未払金	1,777,659
未払収益分配金	48
未払償還金	51,109
未払手数料	1,403,573
その他未払金	322,928
未払費用	1,320,067
未払法人税等	1,362,916
未払消費税等	149,912
賞与引当金	592,328
	流動負債計
	6,118,515
固定負債	
退職給付引当金	870,468
役員退職慰労引当金	121,100
	固定負債計
	991,568
負債合計	7,110,084
（純資産の部）	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	2,428,478
資本準備金	2,428,478
利益剰余金	20,051,026
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	19,927,733
別途積立金	17,130,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	2,297,733
	株主資本計
	24,479,504
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	109,475
	評価・換算差額等計
	109,475
純資産合計	24,588,979
負債・純資産合計	31,699,064

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	12,617,519	
運用受託報酬	3,032,543	
投資助言報酬	455,315	
その他営業収益	409,599	
	営業収益計	16,514,977
営業費用		
支払手数料	5,584,176	
広告宣伝費	113,543	
調査費	2,650,938	
調査費	1,833,878	
委託調査費	817,060	
委託計算費	178,138	
営業雑経費	239,279	
通信費	16,255	
印刷費	206,531	
協会費	12,524	
諸会費	15	
支払販売手数料	3,952	
	営業費用計	8,766,076
一般管理費		
給料	2,201,917	
役員報酬	125,877	
給料・手当	2,076,040	
交際費	17,522	
寄付金	2,515	
旅費交通費	97,277	
租税公課	53,858	
不動産賃借料	341,829	
退職給付費用	110,074	
固定資産減価償却費	1 279,285	
福利厚生費	11,941	
修繕費	5,939	
賞与引当金繰入額	592,328	
役員退職慰労引当金繰入額	26,388	
役員退職慰労金	528	
機器リース料	23	
事務委託費	105,422	
事務用消耗品費	32,711	
器具備品費	2,550	
諸経費	56,566	
	一般管理費計	3,938,680
営業利益		3,810,221

（単位：千円）

	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日至平成25年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,371	
受取利息	1,297	
時効成立分配金・償還金	33,823	
雑収入	3,864	
		営業外収益計 45,357
営業外費用		
為替差損	5,352	
金銭の信託運用損	205,313	
		営業外費用計 210,666
経常利益		3,644,913
特別損失		
固定資産除却損	22	
固定資産売却損	1,448	
		特別損失計 1,470
税引前中間純利益		3,643,442
法人税、住民税及び事業税		1,351,622
法人税等調整額		43,490
法人税等合計		1,395,112
中間純利益		2,248,329

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)
株主資本		
	資本金	
	当期首残高	2,000,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,000,000
	資本剰余金	
	資本準備金	
	当期首残高	2,428,478
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	2,428,478
	利益剰余金	
	利益準備金	
	当期首残高	123,293
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	123,293
	その他利益剰余金	
	別途積立金	
	当期首残高	16,330,000
	当中間期変動額	800,000
	当中間期末残高	17,130,000
	研究開発積立金	
	当期首残高	300,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	300,000
	運用責任準備積立金	
	当期首残高	200,000
	当中間期変動額	-
	当中間期末残高	200,000
	繰越利益剰余金	
	当期首残高	3,945,403
	当中間期変動額	
	剰余金の配当	3,096,000
	別途積立金の積立	800,000
	中間純利益	2,248,329
	当中間期末残高	2,297,733
	利益剰余金合計	
	当期首残高	20,898,697
	当中間期変動額	847,670
	当中間期末残高	20,051,026
	株主資本合計	
	当期首残高	25,327,175
	当中間期変動額	847,670
	当中間期末残高	24,479,504
評価・換算差額等		
	その他有価証券評価差額金	
	当期首残高	103,768
	当中間期変動額(純額)	5,706
	当中間期末残高	109,475
純資産合計		
	当期首残高	25,430,943
	当中間期変動額	841,963
	当中間期末残高	24,588,979

重要な会計方針

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30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：中間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. デリバティブ取引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 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 なお、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）に基づく定額法を採用しております。
5. 引当金の計上基準	(1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、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：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：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、数理計算上の差異及び過去勤務債務の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務債務：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく中間会計期間末要支給額を計上しております。

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)	
	6. 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、中間決算日の直物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。
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理：消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。	

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第29期中間会計期間末 (平成25年9月30日現在)	
	1. 固定資産の減価償却累計額	建物
	車両運搬具	2,730千円
	器具備品	610,752千円
	商標権	696千円
	ソフトウェア	1,285,419千円
	電信電話専用施設利用権	1,338千円

(中間損益計算書関係)

項目	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産
	無形固定資産	214,609千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日 至平成25年9月30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)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 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

配当金支払額

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

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、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）。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	9,422,331	9,422,331	-
(2) 金銭の信託	9,988,674	9,988,674	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	329,200	329,200	-
資産計	19,740,206	19,740,206	-
(1) 未払法人税等	1,362,916	1,362,916	-
負債計	1,362,916	1,362,916	-

(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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	80,246
関係会社株式	2,119,074
差入保証金	731,197

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

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

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。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

1．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額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。

3．その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	315,920	146,101	169,818
債券	-	-	-
その他（投資信託）	4,263	3,000	1,263
小計	320,184	149,101	171,082
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	9,016	10,000	984
小計	9,016	10,000	984
合計	329,200	159,101	170,098

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額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。

（金銭の信託関係）

第29期中間会計期間末（平成25年9月30日現在）

1．満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

2．その他の金銭の信託（運用目的及び満期保有目的以外）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

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

（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	12,617,519	3,487,859	409,599	16,514,977

（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中間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中間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中間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。

（1株当たり情報）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

1株当たり純資産額 1,024,540円 82銭

1株当たり中間純利益金額 93,680円 39銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期中間会計期間 （自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
中間純利益	2,248,329千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,248,329千円
期中平均株式数	24,000株

（重要な後発事象）

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）
該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1 名称、資本金の額及び事業の内容」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成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	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。
マネックス証券株式会社	7,425	「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。
株式会社北越銀行	24,538	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社南都銀行	29,249	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京都銀行	42,103	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	210,200	日本において保険業務を営んでおります。
静岡東海証券株式会社	600	「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。
株式会社みずほ銀行	(1) 1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北洋銀行	121,101	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社証券ジャパン	3,000	「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) 平成25年7月1日現在

独立監査人の監査報告書

平成26年2月26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7月12日から平成26年1月14日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエの平成26年1月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

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1) 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。

(注2) 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A Mアセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）中間財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。