

【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27年4月13日
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	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26年10月10日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格」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、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

1 投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

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

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

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

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

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

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

3 年2回決算を行います。

- 毎年1月、7月の各11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

運用プロセス

■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

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

■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 () 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

単位型投信・追加型投信

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

投資対象地域

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

投資対象資産

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり (一部ヘッジ)
不動産投信 その他資産 (投資信託証券(資 産複合(債券、株 式、不動産投信)資 産配分変更型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

投資対象資産

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

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

決算頻度

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

投資対象地域

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

投資形態

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

為替ヘッジ

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

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

（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26年7月31日現在）

（略）

大株主の状況

（平成26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	東京都千代田区大手町一丁目5番5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27年1月30日現在）

（略）

大株主の状況

（平成27年1月30日現在）

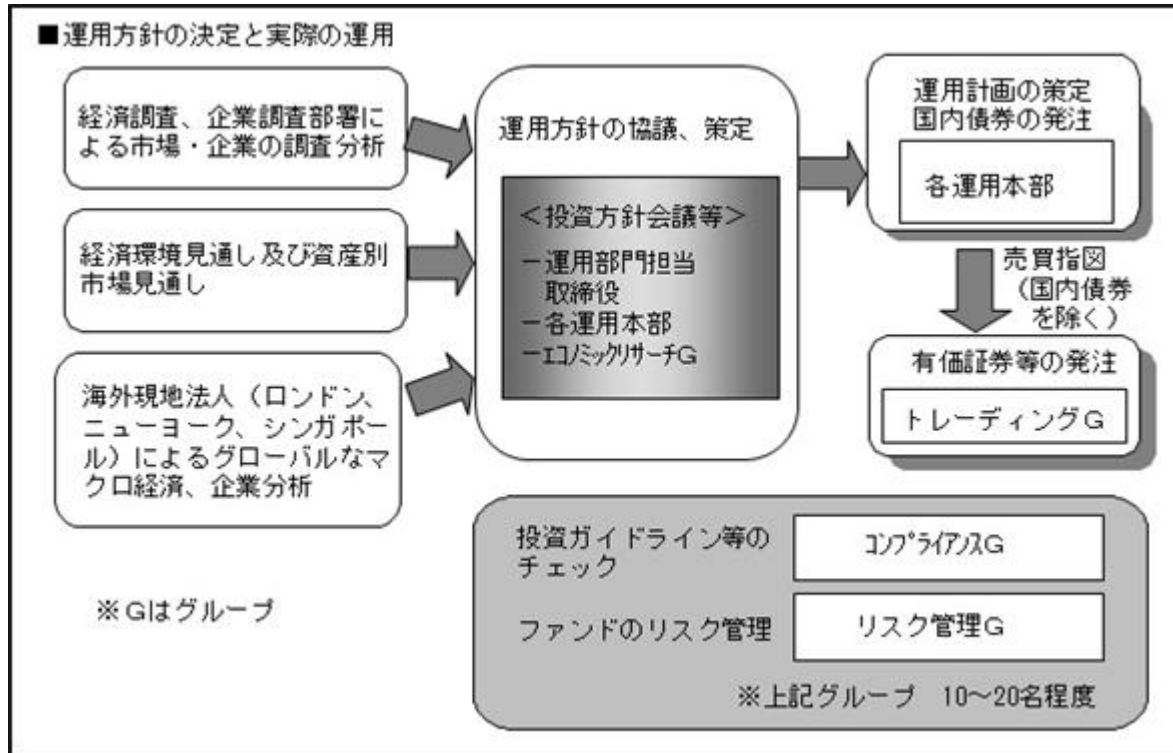
株主名	住所	所有株数	所有比率
第一生命保険株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	50.0%
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	12,000株	50.0%

2【投資方針】

（3）【運用体制】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針（3）運用体制」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>



マザーファンドを通じたファンドの実質的な運用体制を記載しております。

<運用方針の決定と実際の運用>

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

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

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

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

上記体制は平成27年4月13日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（5）【投資制限】

<訂正前>

（略）

__有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

(略)

__特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26条）

(略)

__外国為替予約取引の指図（約款第27条）

(略)

__資金の借入れ（約款第33条）

(略)

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

(略)

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

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

< 訂正後 >

(略)

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

__有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

(略)

__特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26条）

(略)

__外国為替予約取引の指図（約款第27条）

(略)

__資金の借入れ（約款第33条）

(略)

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

(略)

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

上記体制は平成26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>

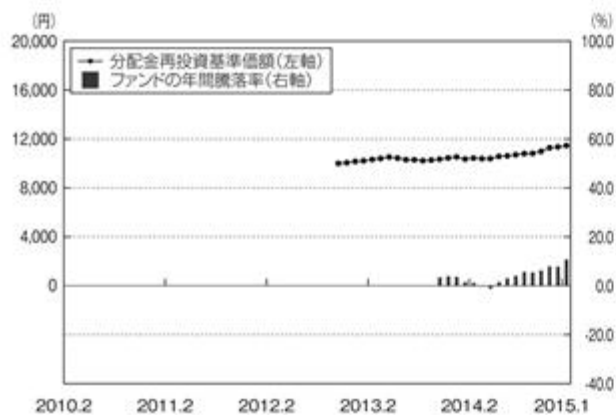
(略)

上記体制は平成27年1月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

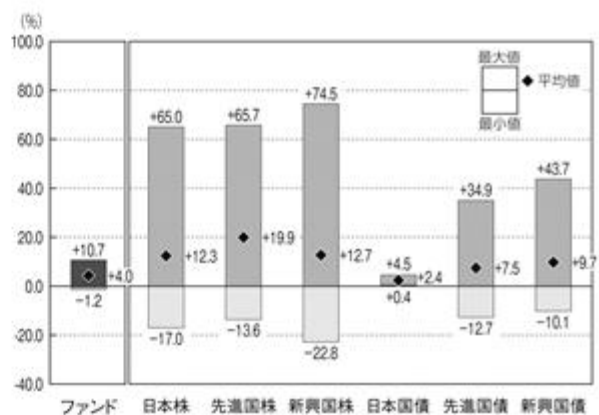
投資リスクの末尾に以下の内容が追加されます。

(参考情報)

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



ファンド:2013年10月~2015年1月

代表的な資産クラス:2010年2月~2015年1月

*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

<訂正前>

(略)

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<訂正後>

(略)

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

(略)

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

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

(略)

<訂正後>

(略)

信託報酬の配分（税抜）		主な役務
委託会社	年率0.65%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

(略)

(4)【その他の手数料等】

<訂正前>

(略)

- ・その他の費用

当ファンドから支払われる費用には以下のものがあります。

(略)

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

（略）

< 訂正後 >

（略）

・その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等がファンドから支払われます。

（略）

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

（略）

（ 5 ）【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

（略）

上記は、平成26年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

（略）

< 訂正後 >

（略）

上記は、平成27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。

（略）

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	12,456,965,899	97.89
内 日本	12,456,965,899	97.89
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	268,760,035	2.11
純資産総額	12,725,725,934	100.00

その他資産の投資状況

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	2,630,926,670	20.67
-	2,630,926,670	20.67
為替予約取引（売建）	5,413,792,610	42.54
-	5,413,792,610	42.54

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（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27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	319,242,018,260	97.72
内 日本	319,242,018,260	97.72
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,443,309,456	2.28
純資産総額	326,685,327,716	100.00

その他資産の投資状況

平成27年1月30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）	6,789,600,000	2.08
内 日本	6,789,600,000	2.08

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	352,630,045,000	81.18
内 日本	352,630,045,000	81.18
地方債証券	28,009,978,680	6.45
内 日本	28,009,978,680	6.45
特殊債券	27,861,599,662	6.41
内 日本	27,861,599,662	6.41
社債券	23,492,082,400	5.41
内 日本	23,183,202,400	5.34
内 アメリカ	308,880,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,390,249,650	0.55
純資産総額	434,383,955,392	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	29,632,192,000	94.81
内 日本	29,632,192,000	94.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,622,166,979	5.19
純資産総額	31,254,358,979	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	288,677,306,456	94.64
内 アメリカ	172,370,263,752	56.51
内 イギリス	24,482,311,351	8.03
内 スイス	12,244,593,390	4.01
内 カナダ	11,895,269,887	3.90
内 ドイツ	11,502,915,019	3.77
内 フランス	11,035,611,622	3.62
内 オーストラリア	8,243,081,049	2.70
内 オランダ	4,560,177,875	1.49
内 アイルランド	4,520,950,544	1.48
内 スペイン	4,221,840,571	1.38
内 スウェーデン	3,814,576,609	1.25
内 香港	3,637,248,129	1.19
内 イタリア	2,539,868,120	0.83
内 シンガポール	1,955,847,914	0.64
内 デンマーク	1,918,261,832	0.63
内 ジャージー	1,728,005,128	0.57
内 ベルギー	1,669,219,107	0.55

内	フィンランド	1,106,225,090	0.36
内	オランダ領キュラソー	1,031,543,788	0.34
内	パミュダ	984,182,779	0.32
内	イスラエル	715,604,529	0.23
内	ノルウェー	715,443,861	0.23
内	ルクセンブルグ	407,426,432	0.13
内	オーストリア	220,837,660	0.07
内	ケイマン諸島	205,600,620	0.07
内	ポルトガル	186,744,370	0.06
内	パナマ	172,330,852	0.06
内	ニュージーランド	166,191,335	0.05
内	イギリス領バージン諸島	142,115,463	0.05
内	リベリア	121,830,101	0.04
内	ガーンジィ	88,438,443	0.03
内	マン島	54,938,713	0.02
内	モーリシャス	17,810,521	0.01
投資信託受益証券		898,194,332	0.29
内	オーストラリア	763,457,150	0.25
内	シンガポール	134,737,182	0.04
投資証券		6,801,922,802	2.23
内	アメリカ	5,675,019,580	1.86
内	フランス	457,263,594	0.15
内	イギリス	444,505,987	0.15
内	香港	158,521,462	0.05
内	カナダ	66,612,179	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,656,797,544	2.84
純資産総額		305,034,221,134	100.00

その他資産の投資状況

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	2,074,183,000	0.68
-	2,074,183,000	0.68
株価指数先物取引（買建）	9,064,005,337	2.97
内 アメリカ	5,847,846,812	1.92
内 ドイツ	1,697,427,033	0.56
内 イギリス	794,752,635	0.26
内 カナダ	369,161,205	0.12
内 オーストラリア	354,817,652	0.12

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30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	3,073,148,068	10.44
内 オーストラリア	2,196,174,588	7.46
内 シンガポール	876,973,480	2.98
投資証券	25,463,851,559	86.54
内 アメリカ	20,430,174,591	69.43
内 イギリス	1,828,094,045	6.21
内 フランス	1,405,072,658	4.78
内 カナダ	610,328,409	2.07
内 香港	516,338,718	1.75
内 オランダ	154,303,868	0.52
内 ベルギー	139,901,759	0.48
内 ニューージーランド	122,687,995	0.42
内 スペイン	66,193,336	0.22
内 アイルランド	55,873,611	0.19
内 シンガポール	40,531,907	0.14
内 ドイツ	36,801,723	0.13
内 イタリア	26,905,595	0.09
内 マン島	20,401,706	0.07
内 イスラエル	10,241,638	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	888,323,509	3.02
純資産総額	29,425,323,136	100.00

その他資産の投資状況

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	677,783,200	2.30
-	677,783,200	2.30

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	170,362,474,188	94.01
内 アメリカ	70,973,854,516	39.17
内 フランス	16,746,422,984	9.24
内 イタリア	16,588,265,066	9.15
内 イギリス	14,736,371,032	8.13
内 ドイツ	13,832,117,013	7.63
内 スペイン	9,073,235,345	5.01
内 ベルギー	4,439,347,295	2.45
内 オランダ	4,430,047,272	2.44
内 カナダ	3,810,070,891	2.10
内 オーストラリア	2,841,112,029	1.57
内 オーストリア	2,707,351,610	1.49
内 メキシコ	1,853,349,170	1.02
内 アイルランド	1,304,288,265	0.72
内 デンマーク	1,241,904,173	0.69
内 ポーランド	1,064,669,821	0.59
内 フィンランド	1,010,928,182	0.56
内 南アフリカ	965,396,458	0.53
内 マレーシア	837,079,344	0.46
内 スウェーデン	818,104,221	0.45
内 シンガポール	648,863,482	0.36
内 ノルウェー	439,696,019	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,846,033,161	5.99
純資産総額	181,208,507,349	100.00

その他資産の投資状況

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（売建）	168,558,629,992	93.02
-	168,558,629,992	93.02

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	39,143,394,032	95.11
内 韓国	5,855,172,031	14.23
内 台湾	4,947,490,588	12.02
内 中国	4,680,155,056	11.37
内 ブラジル	3,374,588,969	8.20
内 南アフリカ	3,198,285,718	7.77
内 インド	3,065,270,261	7.45
内 ケイマン諸島	1,866,604,715	4.54
内 香港	1,865,110,803	4.53
内 メキシコ	1,510,048,604	3.67
内 マレーシア	1,369,168,301	3.33
内 ロシア	1,265,447,217	3.07
内 インドネシア	1,072,048,185	2.60
内 タイ	978,628,400	2.38
内 トルコ	668,830,019	1.63
内 ポーランド	594,581,676	1.44
内 チリ	525,503,597	1.28
内 フィリピン	519,267,709	1.26
内 バミューダ	480,981,409	1.17
内 カタール	330,118,719	0.80
内 コロンビア	286,233,144	0.70
内 アラブ首長国連邦	234,706,194	0.57
内 ギリシャ	130,928,049	0.32
内 エジプト	94,092,575	0.23
内 チェコ	75,370,739	0.18
内 ハンガリー	65,961,301	0.16
内 アメリカ	39,599,512	0.10
内 ペルー	26,216,060	0.06
内 マルタ	22,984,481	0.06
投資信託受益証券	288,626,054	0.70
内 メキシコ	288,626,054	0.70
投資証券	95,601,491	0.23
内 メキシコ	68,455,603	0.17
内 トルコ	27,145,888	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,630,276,346	3.96
純資産総額	41,157,897,923	100.00

その他資産の投資状況

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	1,591,630,218	3.87
内 アメリカ	1,591,630,218	3.87

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	43,959,832,857	93.95
内 トルコ	6,595,127,801	14.09
内 メキシコ	5,905,556,950	12.62
内 ブラジル	5,194,442,837	11.10
内 ロシア	5,054,269,938	10.80
内 インドネシア	4,231,370,786	9.04
内 フィリピン	3,691,302,002	7.89
内 コロンビア	3,342,358,715	7.14
内 ハンガリー	2,362,568,778	5.05
内 ベルギー	1,854,442,617	3.96
内 クロアチア	1,412,442,801	3.02
内 南アフリカ	1,398,953,313	2.99
内 パナマ	1,346,042,115	2.88
内 ルーマニア	971,924,064	2.08
内 リトアニア	599,030,140	1.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,831,972,648	6.05
純資産総額	46,791,805,505	100.00

その他資産の投資状況

平成27年1月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	41,384,000	0.09
-	41,384,000	0.09
為替予約取引（売建）	1,383,408,000	2.96
-	1,383,408,000	2.96

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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	4,130,268,308	1.2400 5,121,759,372	1.2332 5,093,446,877	- -	40.02%
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	1,910,078,602	1.3192 2,519,798,278	1.3336 2,547,280,823	- -	20.02%
3	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド 日本	親投資信 託受益証 券	709,688,794	1.7673 1,254,273,095	1.7986 1,276,446,264	- -	10.03%
4	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	366,735,962	2.7339 1,002,651,673	2.7700 1,015,858,614	- -	7.98%
5	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	737,487,395	1.1781 868,870,616	1.2070 890,147,285	- -	6.99%
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	313,154,688	1.9521 611,316,720	2.0097 629,346,976	- -	4.95%
7	J - R E I T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	359,625,316	1.8127 651,904,449	1.7471 628,301,389	- -	4.94%
8	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	357,036,233	1.0317 368,389,134	1.0535 376,137,671	- -	2.96%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.89%
合計	97.89%

(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27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	2,130,800	5,889.96 12,550,332,380	7,645.00 16,289,966,000	- -	4.99%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	12,229,600	601.46 7,355,713,784	632.30 7,732,776,080	- -	2.37%
3	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	806,100	7,414.96 5,977,204,468	6,963.00 5,612,874,300	- -	1.72%
4	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,389,800	3,674.33 5,106,594,428	3,581.00 4,976,873,800	- -	1.52%
5	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,152,700	4,745.66 5,470,333,499	3,990.50 4,599,849,350	- -	1.41%
6	K D D I 日本	株式 情報・通信業	516,200	5,790.62 2,989,122,888	8,363.00 4,316,980,600	- -	1.32%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	596,500	5,508.47 3,285,805,835	7,020.00 4,187,430,000	- -	1.28%
8	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	21,068,300	212.46 4,476,193,660	194.00 4,087,250,200	- -	1.25%
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	606,000	4,668.72 2,829,244,810	5,903.00 3,577,218,000	- -	1.10%
10	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,842,300	1,235.97 2,277,030,725	1,829.50 3,370,487,850	- -	1.03%
11	キヤノン 日本	株式 電気機器	895,400	2,991.60 2,678,678,990	3,740.50 3,349,243,700	- -	1.03%
12	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,708,000	780.10 2,892,640,600	897.30 3,327,188,400	- -	1.02%
13	ファナック 日本	株式 電気機器	160,800	16,408.24 2,638,445,224	19,890.00 3,198,312,000	- -	0.98%
14	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	959,100	3,190.09 3,059,624,710	3,232.50 3,100,290,750	- -	0.95%
15	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	138,300	10,965.22 1,516,490,510	20,320.00 2,810,256,000	- -	0.86%
16	ソニー 日本	株式 電気機器	999,000	1,751.85 1,750,100,094	2,774.00 2,771,226,000	- -	0.85%
17	セブン&アイ・ホールディン グス 日本	株式 小売業	637,600	3,851.07 2,455,445,979	4,337.50 2,765,590,000	- -	0.85%
18	三菱地所 日本	株式 不動産業	1,133,000	2,558.65 2,898,950,700	2,383.50 2,700,505,500	- -	0.83%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	627,300	3,016.70 1,892,380,170	4,140.00 2,597,022,000	- -	0.79%
20	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	283,000	7,586.98 2,147,116,128	9,130.00 2,583,790,000	- -	0.79%

21	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,882,100	1,196.12 2,251,231,779	1,352.00 2,544,599,200	- -	0.78%
22	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,256,000	1,608.47 2,020,250,756	2,005.00 2,518,280,000	- -	0.77%
23	三井不動産 日本	株式 不動産業	808,000	3,258.38 2,632,771,335	3,000.50 2,424,404,000	- -	0.74%
24	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,168,400	1,954.88 2,284,092,116	2,068.00 2,416,251,200	- -	0.74%
25	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	506,900	3,597.58 1,823,616,906	4,738.00 2,401,692,200	- -	0.74%
26	信越化学工業 日本	株式 化学	290,100	5,707.58 1,655,770,142	7,848.00 2,276,704,800	- -	0.70%
27	富士重工業 日本	株式 輸送用機器	525,600	2,700.56 1,419,416,241	4,296.50 2,258,240,400	- -	0.69%
28	花王 日本	株式 化学	434,900	3,235.38 1,407,070,869	5,181.00 2,253,216,900	- -	0.69%
29	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	2,167,900	883.96 1,916,339,610	1,016.50 2,203,670,350	- -	0.67%
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,544,000	1,189.88 1,837,174,910	1,376.50 2,125,316,000	- -	0.65%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
株式	97.72%
合計	97.72%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年1月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.48%
輸送用機器		11.62%
銀行業		8.43%
情報・通信業		6.84%
化学		6.11%
機械		5.03%
医薬品		4.84%
小売業		4.18%
陸運業		4.16%
食料品		4.11%
卸売業		3.88%
サービス業		2.94%
不動産業		2.79%
建設業		2.57%
保険業		2.35%
電気・ガス業		2.13%
鉄鋼		1.49%
精密機器		1.46%
その他製品		1.29%
証券、商品先物取引業		1.28%
その他金融業		1.11%
ゴム製品		0.98%
非鉄金属		0.91%
ガラス・土石製品		0.90%
繊維製品		0.79%
空運業		0.67%
金属製品		0.63%
石油・石炭製品		0.46%
鉱業		0.42%
海運業		0.34%
パルプ・紙	0.23%	
倉庫・運輸関連業	0.23%	
水産・農林業	0.08%	
合計		97.72%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	117回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	6,000,000,000	100.10 6,006,270,000	100.67 6,040,740,000	0.200000 2019/3/20	1.39%
2	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.90 5,550,020,000	103.25 5,678,915,000	0.600000 2024/6/20	1.31%

3	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.97 5,048,535,000	102.20 5,110,300,000	0.500000 2024/9/20	1.18%
4	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.19 5,009,520,000	100.72 5,036,000,000	0.200000 2019/6/20	1.16%
5	333回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.14 4,506,590,000	103.30 4,648,770,000	0.600000 2024/3/20	1.07%
6	114回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.58 4,526,410,000	100.99 4,544,820,000	0.300000 2018/9/20	1.05%
7	116回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.10 4,504,545,000	100.65 4,529,610,000	0.200000 2018/12/20	1.04%
8	103回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.59 4,526,955,000	100.61 4,527,675,000	0.300000 2017/3/20	1.04%
9	106回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.33 4,514,880,000	100.48 4,521,825,000	0.200000 2017/9/20	1.04%
10	105回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.28 4,512,690,000	100.43 4,519,755,000	0.200000 2017/6/20	1.04%
11	107回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.25 4,310,856,000	100.51 4,322,231,000	0.200000 2017/12/20	1.00%
12	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	106.20 4,248,344,000	106.10 4,244,240,000	1.300000 2019/12/20	0.98%
13	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	103.01 4,120,620,000	105.06 4,202,400,000	0.800000 2022/9/20	0.97%
14	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.13 4,005,440,000	103.35 4,134,120,000	0.600000 2023/12/20	0.95%
15	313回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	106.63 4,052,282,000	107.66 4,091,194,000	1.300000 2021/3/20	0.94%
16	289回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	105.22 4,103,892,000	104.27 4,066,530,000	1.500000 2017/12/20	0.94%
17	97回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.74 4,029,800,000	100.54 4,021,720,000	0.400000 2016/6/20	0.93%
18	310回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	104.74 3,770,956,000	105.36 3,792,960,000	1.000000 2020/9/20	0.87%
19	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	104.37 3,652,950,000	106.44 3,725,400,000	1.000000 2022/3/20	0.86%

20	296回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	106.10 3,713,500,000	105.34 3,687,075,000	1.500000 2018/9/20	0.85%
21	330回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	102.08 3,572,870,000	105.17 3,681,195,000	0.800000 2023/9/20	0.85%
22	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	106.97 3,637,116,000	106.40 3,617,600,000	1.500000 2019/6/20	0.83%
23	113回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.60 3,521,070,000	100.92 3,532,445,000	0.300000 2018/6/20	0.81%
24	102回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.58 3,520,305,000	100.55 3,519,355,000	0.300000 2016/12/20	0.81%
25	282回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	104.16 3,541,678,000	102.76 3,494,044,000	1.700000 2016/9/20	0.80%
26	297回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	105.87 3,493,809,000	105.30 3,475,032,000	1.400000 2018/12/20	0.80%
27	293回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	107.08 3,426,624,000	106.00 3,392,128,000	1.800000 2018/6/20	0.78%
28	286回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	105.61 3,274,034,000	104.25 3,231,750,000	1.800000 2017/6/20	0.74%
29	306回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	107.01 3,210,510,000	106.92 3,207,780,000	1.400000 2020/3/20	0.74%
30	150回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	3,000,000,000	103.44 3,103,335,000	106.56 3,196,860,000	1.400000 2034/9/20	0.74%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
国債証券	81.18%
地方債証券	6.45%
特殊債券	6.41%
社債券	5.41%
合計	99.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,962	590,013.24 2,337,632,462	580,000.00 2,297,960,000	- -	7.35%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,511	581,670.02 2,042,243,459	573,000.00 2,011,803,000	- -	6.44%
3	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,818	226,317.40 1,543,032,099	255,200.00 1,739,953,600	- -	5.57%
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,419	167,316.94 1,241,324,442	188,700.00 1,399,965,300	- -	4.48%
5	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,856	238,714.96 1,159,199,876	277,400.00 1,347,054,400	- -	4.31%
6	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,647	256,791.72 936,519,411	301,500.00 1,099,570,500	- -	3.52%
7	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,951	141,475.05 841,918,075	176,600.00 1,050,946,600	- -	3.36%
8	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,315	369,088.10 854,438,956	412,000.00 953,780,000	- -	3.05%
9	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	3,703	178,465.49 660,857,732	245,200.00 907,975,600	- -	2.91%
10	G L P 投資法人 日本	投資証券	6,708	116,788.93 783,420,204	133,800.00 897,530,400	- -	2.87%
11	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,237	530,272.87 655,947,549	683,000.00 844,871,000	- -	2.70%
12	アクティブア・プロパティーズ投資 法人 日本	投資証券	778	906,244.81 705,058,466	1,053,000.00 819,234,000	- -	2.62%
13	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,136	561,908.85 638,328,458	699,000.00 794,064,000	- -	2.54%
14	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,392	553,261.07 770,139,421	537,000.00 747,504,000	- -	2.39%
15	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,405	144,954.10 638,522,829	166,600.00 733,873,000	- -	2.35%
16	野村不動産マスターファンド投資法 人 日本	投資証券	4,672	125,077.53 584,362,261	147,700.00 690,054,400	- -	2.21%
17	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	8,393	58,166.96 488,195,300	77,600.00 651,296,800	- -	2.08%
18	日本アコモデーションファンド投資 法人 日本	投資証券	1,295	385,414.98 499,112,405	486,500.00 630,017,500	- -	2.02%
19	野村不動産オフィスファンド投資法 人 日本	投資証券	1,045	485,642.23 507,496,133	601,000.00 628,045,000	- -	2.01%

20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,329	239,012.89 556,661,023	252,300.00 587,606,700	- -	1.88%
21	大和ハウス・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,049	463,594.55 486,310,685	553,000.00 580,097,000	- -	1.86%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	929	471,182.72 437,728,751	594,000.00 551,826,000	- -	1.77%
23	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,403	140,482.76 478,062,842	151,300.00 514,873,900	- -	1.65%
24	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	823	458,629.69 377,452,242	571,000.00 469,933,000	- -	1.50%
25	プレミア投資法人 日本	投資証券	733	468,131.52 343,140,406	629,000.00 461,057,000	- -	1.48%
26	福岡リート投資法人 日本	投資証券	1,936	180,586.36 349,615,210	237,600.00 459,993,600	- -	1.47%
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	2,665	137,741.79 367,081,881	161,200.00 429,598,000	- -	1.37%
28	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,743	143,534.61 393,715,443	156,000.00 427,908,000	- -	1.37%
29	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	7,487	28,737.17 215,155,258	52,600.00 393,816,200	- -	1.26%
30	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	4,139	70,528.51 291,917,537	93,600.00 387,410,400	- -	1.24%

（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27年1月30日現在

種類	投資比率
投資証券	94.81%
合計	94.81%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺 機器	498,180	9,189.56 4,578,058,966	14,059.92 7,004,373,436	- -	2.30%
2	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃 料	352,875	11,128.50 3,926,972,084	10,356.33 3,654,491,713	- -	1.20%
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	649,006	4,448.56 2,887,145,376	4,967.68 3,224,055,748	- -	1.06%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	232,262	10,968.86 2,547,651,683	12,106.43 2,811,864,805	- -	0.92%
5	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 商業銀行	410,944	5,454.87 2,241,647,124	6,238.86 2,563,826,193	- -	0.84%
6	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	265,687	8,464.68 2,248,956,099	9,087.17 2,414,345,592	- -	0.79%
7	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 コングロマリット	828,561	3,043.75 2,521,936,686	2,847.45 2,359,294,305	- -	0.77%
8	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	222,546	9,389.04 2,089,495,521	10,130.47 2,254,497,245	- -	0.74%
9	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	189,407	9,485.06 1,796,537,706	11,679.84 2,212,245,348	- -	0.73%
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 商業銀行	312,049	6,876.23 2,145,723,035	6,582.97 2,054,211,545	- -	0.67%
11	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	521,082	3,776.90 1,968,077,211	3,763.89 1,961,299,237	- -	0.64%
12	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃 料	156,699	13,419.00 2,102,745,447	12,179.74 1,908,554,645	- -	0.63%
13	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	57,784	33,756.04 1,950,559,593	32,434.04 1,874,168,856	- -	0.61%
14	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービ ス	339,429	5,565.32 1,889,033,814	5,452.50 1,850,739,168	- -	0.61%
15	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	245,293	6,555.77 1,608,086,943	7,342.14 1,800,976,160	- -	0.59%
16	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 商業銀行	1,586,419	1,137.49 1,804,536,065	1,102.01 1,748,250,377	- -	0.57%
17	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造 装置	411,248	2,927.27 1,203,837,533	4,045.33 1,663,634,899	- -	0.55%
18	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービ ス	423,769	3,919.98 1,661,169,182	3,897.51 1,651,648,152	- -	0.54%
19	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	93,995	13,592.83 1,277,658,760	17,298.79 1,626,000,001	- -	0.53%

20	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	322,437	4,603.47 1,484,329,862	4,978.32 1,605,196,178	- -	0.53%
21	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 商業銀行	872,577	1,974.77 1,723,143,245	1,824.59 1,592,101,812	- -	0.52%
22	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	124,949	9,603.08 1,199,895,555	12,319.28 1,539,282,341	- -	0.50%
23	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 メディア	138,490	9,368.94 1,297,505,539	11,023.26 1,526,611,969	- -	0.50%
24	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフト ウェア・サービス	163,770	7,978.15 1,306,581,702	9,223.50 1,510,532,595	- -	0.50%
25	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	294,835	4,496.18 1,325,633,892	5,068.19 1,494,281,272	- -	0.49%
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	128,485	9,234.14 1,186,448,799	11,355.54 1,459,017,520	- -	0.48%
27	GOOGLE INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフト ウェア・サービス	24,123	70,963.26 1,711,846,794	60,385.54 1,456,680,502	- -	0.48%
28	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	114,093	9,215.22 1,051,392,380	12,726.06 1,451,954,934	- -	0.48%
29	INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ	株式 情報技術サービス	78,292	21,721.34 1,700,607,347	18,385.50 1,439,438,348	- -	0.47%
30	WAL-MART STORES INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小 売り	137,490	8,962.16 1,232,208,409	10,372.88 1,426,168,646	- -	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27年1月30日現在

種類	投資比率
株式	94.64%
投資信託受益証券	0.29%
投資証券	2.23%
合計	97.16%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成27年1月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	8.80%
医薬品		7.46%
石油・ガス・消耗燃料		7.00%
保険		4.11%
メディア		2.96%
コンピュータ・周辺機器		2.95%
化学		2.76%
各種電気通信サービス		2.68%
ソフトウェア		2.62%
食品		2.57%
食品・生活必需品小売り		2.24%

飲料	2.23%
情報技術サービス	2.13%
バイオテクノロジー	2.10%
航空宇宙・防衛	2.09%
資本市場	2.04%
インターネットソフトウェア・サービス	1.97%
専門小売り	1.89%
コングロマリット	1.84%
半導体・半導体製造装置	1.79%
電力	1.77%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.75%
ホテル・レストラン・レジャー	1.62%
ヘルスケア機器・用品	1.61%
家庭用品	1.52%
金属・鉱業	1.52%
機械	1.43%
タバコ	1.43%
総合公益事業	1.39%
各種金融サービス	1.25%
繊維・アパレル・贅沢品	1.21%
通信機器	1.19%
自動車	1.14%
陸運・鉄道	1.01%
エネルギー設備・サービス	0.92%
電気設備	0.74%
インターネット販売・カタログ販売	0.74%
不動産管理・開発	0.68%
航空貨物・物流サービス	0.59%
複合小売り	0.59%
自動車部品	0.56%
消費者金融	0.52%
無線通信サービス	0.47%
専門サービス	0.46%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.42%
商業サービス・用品	0.40%
電子装置・機器・部品	0.37%
家庭用耐久財	0.33%
商社・流通業	0.31%
建設・土木	0.29%
建設資材	0.29%
パーソナル用品	0.25%
容器・包装	0.21%
旅客航空輸送業	0.20%
建設関連製品	0.19%
運送インフラ	0.18%
ガス	0.16%
紙製品・林産品	0.12%
水道	0.10%
海運業	0.10%
販売	0.08%

独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08%
レジャー用品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.05%
各種消費者サービス	0.04%
合計	94.64%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	70,640	20,128.18 1,421,854,786	24,212.86 1,710,397,136	- -	5.81%
2	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	32,960	20,670.48 681,299,139	24,145.46 795,834,608	- -	2.70%
3	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	82,340	7,562.97 622,735,652	9,381.95 772,510,174	- -	2.63%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	22,280	28,158.60 627,373,822	33,650.73 749,738,442	- -	2.55%
5	HEALTH CARE REIT INC アメリカ	投資証券	74,460	7,754.52 577,401,786	9,902.25 737,321,907	- -	2.51%
6	VENTAS INC アメリカ	投資証券	72,710	7,904.07 574,705,150	9,572.33 696,004,659	- -	2.37%
7	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	113,600	4,895.39 556,117,233	5,467.88 621,151,168	- -	2.11%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	29,990	17,212.47 516,202,177	20,681.92 620,250,930	- -	2.11%
9	HCP INC アメリカ	投資証券	104,340	4,949.09 516,389,051	5,670.08 591,616,929	- -	2.01%
10	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	34,780	14,268.30 496,251,777	16,961.77 589,930,708	- -	2.00%
11	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	39,660	11,555.07 458,274,125	13,307.85 527,789,529	- -	1.79%
12	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	142,550	2,896.15 412,847,230	3,658.65 521,541,270	- -	1.77%
13	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	172,030	2,660.34 457,659,914	2,795.42 480,897,822	- -	1.63%
14	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託 受益証券	1,207,800	296.10 357,640,984	354.43 428,081,761	- -	1.45%
15	LINK REIT/THE 香港	投資証券	520,523	638.47 332,340,267	806.72 419,918,917	- -	1.43%
16	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	177,000	1,868.23 330,678,028	2,314.20 409,614,143	- -	1.39%
17	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託 受益証券	433,500	670.70 290,748,750	909.55 394,291,138	- -	1.34%
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	14,520	22,188.07 322,170,854	27,140.73 394,083,544	- -	1.34%
19	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	232,100	1,248.05 289,674,648	1,501.20 348,428,937	- -	1.18%

20	SL GREEN アメリカ	投資証券	21,910	13,250.47 290,317,908	15,326.38 335,801,040	- -	1.14%
21	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	50,560	5,367.48 271,380,175	6,520.30 329,666,620	- -	1.12%
22	THE MACERICH COMPANY アメリカ	投資証券	31,920	8,126.42 259,395,388	10,279.47 328,120,762	- -	1.12%
23	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	93,400	2,811.18 262,564,455	3,345.29 312,450,319	- -	1.06%
24	KLEPIERRE フランス	投資証券	48,500	5,092.42 246,982,714	5,615.59 272,356,435	- -	0.93%
25	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	30,760	7,069.24 217,449,863	8,762.32 269,529,117	- -	0.92%
26	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	15,460	14,515.37 224,407,712	17,430.05 269,468,573	- -	0.92%
27	UDR INC アメリカ	投資証券	57,900	3,396.97 196,684,753	4,016.95 232,581,549	- -	0.79%
28	AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	206,000	1,438.90 296,413,410	1,116.28 229,953,680	- -	0.78%
29	HAMMERSON PLC イギリス	投資証券	177,700	1,017.46 180,803,580	1,244.46 221,141,288	- -	0.75%
30	STOCKLAND オーストラリア	投資信託 受益証券	531,600	372.37 197,952,273	399.54 212,395,676	- -	0.72%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.44%
投資証券	86.54%
合計	96.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 3.625 08/15/19 アメリカ	国債証券	2,010,250,000	109.60 2,203,296,672	110.60 2,223,437,012	3.625000 2019/8/15	1.23%
2	US T N/B 0.375 04/30/16 アメリカ	国債証券	2,187,625,000	99.89 2,185,306,117	100.14 2,190,687,675	0.375000 2016/4/30	1.21%
3	US T N/B 8.125 08/15/19 アメリカ	国債証券	1,300,750,000	130.59 1,698,694,360	130.71 1,700,314,385	8.125000 2019/8/15	0.94%
4	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,488,767,500	101.41 1,509,770,005	106.57 1,586,698,626	2.500000 2024/5/15	0.88%
5	US T N/B 0.625 05/31/17 アメリカ	国債証券	1,454,475,000	99.32 1,444,629,032	99.99 1,454,416,821	0.625000 2017/5/31	0.80%
6	US T N/B 0.75 03/31/18 アメリカ	国債証券	1,371,700,000	98.16 1,346,556,739	99.45 1,364,251,669	0.750000 2018/3/31	0.75%
7	US T N/B 4.5 02/15/16 アメリカ	国債証券	1,300,750,000	106.83 1,389,708,292	104.45 1,358,672,397	4.500000 2016/2/15	0.75%
8	US T N/B 0.375 01/15/16 アメリカ	国債証券	1,336,225,000	100.08 1,337,414,240	100.19 1,338,830,638	0.375000 2016/1/15	0.74%
9	US T N/B 1.75 05/31/16 アメリカ	国債証券	1,300,750,000	102.48 1,333,008,600	101.92 1,325,789,437	1.750000 2016/5/31	0.73%
10	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,284,195,000	100.93 1,296,240,749	102.91 1,321,654,968	2.000000 2021/5/31	0.73%
11	US T N/B 3.125 10/31/16 アメリカ	国債証券	1,241,625,000	105.83 1,314,036,570	104.68 1,299,770,298	3.125000 2016/10/31	0.72%
12	US T N/B 2.375 07/31/17 アメリカ	国債証券	1,241,625,000	104.18 1,293,562,173	104.22 1,294,046,407	2.375000 2017/7/31	0.71%
13	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,051,242,500	109.63 1,152,506,892	111.42 1,171,389,005	3.625000 2020/2/15	0.65%
14	US T N/B 2.0 04/30/16 アメリカ	国債証券	1,123,375,000	102.89 1,155,930,407	102.14 1,147,415,225	2.000000 2016/4/30	0.63%
15	US T N/B 0.625 08/31/17 アメリカ	国債証券	1,099,725,000	98.65 1,084,900,707	99.73 1,096,843,720	0.625000 2017/8/31	0.61%
16	ITALY BTPS 4.0 02/01/17 イタリア	国債証券	978,662,800	107.89 1,055,879,950	107.14 1,048,598,043	4.000000 2017/2/1	0.58%
17	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	963,737,500	103.97 1,002,015,143	106.54 1,026,823,756	2.625000 2020/8/15	0.57%
18	US T N/B 4.875 08/15/16 アメリカ	国債証券	946,000,000	109.23 1,033,391,480	106.96 1,011,841,600	4.875000 2016/8/15	0.56%
19	US T N/B 3.25 12/31/16 アメリカ	国債証券	922,350,000	106.30 980,531,838	105.21 970,441,329	3.250000 2016/12/31	0.54%
20	ITALY BTPS 4.5 03/01/19 イタリア	国債証券	826,039,600	114.69 947,449,936	115.30 952,506,262	4.500000 2019/3/1	0.53%
21	US T N/B 0.875 04/30/17 アメリカ	国債証券	946,000,000	99.97 945,772,960	100.60 951,723,300	0.875000 2017/4/30	0.53%
22	FRANCE OAT 3.75 04/25/17 フランス	国債証券	852,815,600	109.92 937,439,447	108.57 925,910,425	3.750000 2017/4/25	0.51%
23	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	817,107,500	109.02 890,836,138	111.06 907,495,931	3.500000 2020/5/15	0.50%

24	US T N/B 4.625 11/15/16 アメリカ	国債証券	827,750,000	109.47 906,154,480	107.38 888,887,615	4.625000 2016/11/15	0.49%
25	ITALY BTPS 4.5 02/01/18 イタリア	国債証券	787,482,160	111.67 879,385,598	111.80 880,483,803	4.500000 2018/2/1	0.49%
26	US T N/B 3.25 03/31/17 アメリカ	国債証券	827,750,000	106.61 882,522,217	105.74 875,279,405	3.250000 2017/3/31	0.48%
27	US T N/B 3.0 02/28/17 アメリカ	国債証券	827,750,000	105.82 875,958,160	105.06 869,683,815	3.000000 2017/2/28	0.48%
28	US T N/B 3.25 06/30/16 アメリカ	国債証券	827,750,000	105.54 873,623,905	104.11 861,795,357	3.250000 2016/6/30	0.48%
29	US T N/B 1.5 08/31/18 アメリカ	国債証券	815,925,000	100.13 817,002,021	101.66 829,501,992	1.500000 2018/8/31	0.46%
30	ITALY BTPS 5.25 08/01/17 イタリア	国債証券	740,356,400	112.58 833,517,346	111.83 828,014,597	5.250000 2017/8/1	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
国債証券	94.01%
合計	94.01%

(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27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺 機器	9,533	147,240.13 1,403,640,191	146,880.00 1,400,207,040	- -	3.40%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造 装置	2,122,083	452.46 960,158,970	538.12 1,141,945,914	- -	2.77%
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インターネットソフ トウェア・サービス	445,400	1,616.41 719,949,360	2,052.65 914,250,310	- -	2.22%
4	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	528,000	1,113.31 587,830,641	1,590.57 839,823,600	- -	2.04%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	34,308	11,436.24 392,354,633	17,322.50 594,300,330	- -	1.44%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 商業銀行	6,182,530	83.58 516,751,250	95.31 589,272,390	- -	1.43%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 商業銀行	6,329,235	73.81 467,220,529	85.40 540,516,669	- -	1.31%
8	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 商業銀行	6,830,200	53.75 367,186,380	66.33 453,098,392	- -	1.10%

9	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,907,778	104.50 303,877,869	130.15 378,467,951	- -	0.92%
10	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 商業銀行	239,408	1,478.44 353,951,999	1,514.99 362,702,641	- -	0.88%
11	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部 品	1,081,781	297.11 321,418,549	325.12 351,714,047	- -	0.85%
12	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	80,206	3,095.49 248,277,007	4,140.81 332,118,207	- -	0.81%
13	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産 金融	130,203	1,731.18 225,405,088	2,539.01 330,586,914	- -	0.80%
14	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	408,195	786.16 320,907,179	802.21 327,461,376	- -	0.80%
15	MTN GROUP LTD 南アフリカ	株式 無線通信サービス	145,069	2,223.28 322,530,133	2,136.81 309,985,977	- -	0.75%
16	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	642,000	329.04 211,243,795	468.93 301,057,875	- -	0.73%
17	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 商業銀行	182,849	1,528.62 279,506,744	1,578.55 288,637,751	- -	0.70%
18	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	224,500	973.39 218,526,731	1,264.98 283,989,693	- -	0.69%
19	OAQ GAZPROM ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃 料	527,936	840.54 443,753,646	503.74 265,945,120	- -	0.65%
20	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造 装置	50,373	4,195.57 211,343,909	5,119.19 257,869,461	- -	0.63%
21	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車	13,336	25,581.40 341,153,673	18,036.00 240,528,096	- -	0.58%
22	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃 料	1,539,000	194.19 298,863,409	155.55 239,391,450	- -	0.58%
23	PETRO CHINA CO LTD 中国	株式 石油・ガス・消耗燃 料	1,818,000	133.75 243,161,392	128.40 233,440,290	- -	0.57%
24	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃 料	46,082	6,091.05 280,687,916	4,900.27 225,814,702	- -	0.55%
25	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造 装置	120,507	1,727.49 208,175,536	1,865.62 224,820,871	- -	0.55%
26	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺 機器	1,762	117,720.00 207,422,640	115,128.00 202,855,536	- -	0.49%
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	41,278	4,313.83 178,066,576	4,911.17 202,723,461	- -	0.49%

28	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式	2,117,200	106.75	94.09	-	0.48%
		石油・ガス・消耗燃料		226,011,100	199,212,641	-	
29	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式	110,265	1,853.35	1,793.74	-	0.48%
		石油・ガス・消耗燃料		204,359,939	197,786,961	-	
30	SASOL LTD 南アフリカ	株式	45,708	5,955.89	4,205.67	-	0.47%
		石油・ガス・消耗燃料		272,232,194	192,233,107	-	

（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27年1月30日現在

種類	投資比率
株式	95.11%
投資信託受益証券	0.70%
投資証券	0.23%
合計	96.04%

（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。

投資株式の業種別投資比率

平成27年1月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
商業銀行	外国	17.48%
石油・ガス・消耗燃料		7.43%
無線通信サービス		5.57%
コンピュータ・周辺機器		5.30%
半導体・半導体製造装置		5.11%
保険		4.05%
金属・鉱業		3.40%
インターネットソフトウェア・サービス		2.77%
自動車		2.51%
食品		2.48%
電子装置・機器・部品		2.35%
メディア		2.21%
情報技術サービス		2.20%
コングロマリット		1.88%
不動産管理・開発		1.85%
各種電気通信サービス		1.79%
化学		1.77%
食品・生活必需品小売り		1.76%
各種金融サービス		1.59%
医薬品		1.52%
電力		1.29%
飲料		1.27%
建設・土木		1.05%
運送インフラ		0.99%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.99%
建設資材		0.96%

資本市場	0.95%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.87%
複合小売り	0.78%
タバコ	0.73%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.73%
自動車部品	0.71%
機械	0.71%
パーソナル用品	0.70%
家庭用耐久財	0.65%
家庭用品	0.60%
専門小売り	0.57%
ガス	0.56%
ホテル・レストラン・レジャー	0.52%
繊維・アパレル・贅沢品	0.47%
紙製品・林産品	0.34%
電気設備	0.34%
旅客航空輸送業	0.31%
商社・流通業	0.29%
不動産投資信託	0.26%
水道	0.24%
航空宇宙・防衛	0.22%
海運業	0.21%
各種消費者サービス	0.21%
エネルギー設備・サービス	0.19%
消費者金融	0.19%
商業サービス・用品	0.16%
ソフトウェア	0.15%
容器・包装	0.13%
総合公益事業	0.11%
陸運・鉄道	0.11%
航空貨物・物流サービス	0.11%
建設関連製品	0.10%
レジャー用品	0.09%
販売	0.07%
ヘルスケア機器・用品	0.04%
通信機器	0.03%
インターネット販売・カタログ販売	0.03%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.02%
合計	95.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年1月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,742,709,375	112.25 1,956,308,848	101.21 1,763,831,012	7.500000 2030/3/31	3.77%

2	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	626,725,000	116.79 731,997,062	125.74 788,106,687	6.050000 2040/1/11	1.68%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	674,025,000	99.70 672,029,531	107.00 721,206,750	4.750000 2044/3/8	1.54%
4	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア	国債証券	543,950,000	129.60 704,959,200	112.00 609,224,000	11.000000 2018/7/24	1.30%
5	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	591,250,000	98.30 581,198,750	99.50 588,293,750	5.000000 2045/1/27	1.26%
6	PERU 8.75 11/21/33 ペルー	国債証券	366,575,000	150.54 551,862,107	157.80 578,492,007	8.750000 2033/11/21	1.24%
7	RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28 ロシア	国債証券	413,875,000	159.01 658,108,550	136.20 563,739,137	12.750000 2028/6/24	1.20%
8	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	437,525,000	119.58 523,197,125	128.00 560,032,000	7.375000 2025/2/5	1.20%
9	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	508,475,000	103.26 525,092,081	105.52 536,568,243	4.000000 2023/10/2	1.15%
10	TURKEY 6.0 01/14/41 トルコ	国債証券	437,525,000	104.81 458,585,325	120.74 528,311,437	6.000000 2041/1/14	1.13%
11	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	449,350,000	111.34 500,333,487	117.40 527,550,380	6.375000 2021/3/29	1.13%
12	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	366,575,000	127.48 467,324,000	142.00 520,536,500	6.375000 2034/10/23	1.11%
13	TURKEY 6.875 03/17/36 トルコ	国債証券	402,050,000	114.67 461,041,968	129.45 520,453,725	6.875000 2036/3/17	1.11%
14	BRAZIL 8.875 04/15/24 ブラジル	国債証券	378,400,000	136.99 518,403,270	135.93 514,359,120	8.875000 2024/4/15	1.10%
15	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	425,700,000	115.78 492,895,562	120.75 514,032,750	6.125000 2041/1/18	1.10%
16	BRAZIL 6.0 01/17/17 ブラジル	国債証券	473,000,000	110.98 524,961,415	108.59 513,654,350	6.000000 2017/1/17	1.10%
17	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	378,400,000	130.52 493,913,695	134.15 507,623,600	7.350000 2025/7/21	1.08%
18	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン	国債証券	319,275,000	139.54 445,521,656	152.24 486,096,187	7.750000 2031/1/14	1.04%
19	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	402,050,000	115.32 463,658,250	119.25 479,444,625	5.550000 2045/1/21	1.02%
20	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ	国債証券	461,175,000	102.34 471,988,962	103.20 475,932,600	3.625000 2022/3/15	1.02%
21	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 メキシコ	国債証券	354,750,000	126.02 447,080,782	134.00 475,365,000	6.750000 2034/9/27	1.02%
22	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	402,050,000	112.27 451,419,375	114.00 458,337,000	5.625000 2044/2/26	0.98%

23	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	402,050,000	103.05 414,348,000	112.00 450,296,000	5.750000 2110/10/12	0.96%
24	RUSSIAN FEDERATION 3.25 04/04/17 ロシア	国債証券	473,000,000	102.00 482,460,000	94.54 447,197,850	3.250000 2017/4/4	0.96%
25	BRAZIL 7.125 01/20/37 ブラジル	国債証券	342,925,000	123.83 424,659,400	127.74 438,086,687	7.125000 2037/1/20	0.94%
26	COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア	国債証券	366,575,000	121.17 444,206,125	118.34 433,841,512	7.375000 2019/3/18	0.93%
27	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	402,050,000	108.28 435,343,287	107.34 431,580,572	4.875000 2021/1/22	0.92%
28	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	248,325,000	156.87 389,559,843	170.12 422,462,906	9.500000 2030/2/2	0.90%
29	UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17 メキシコ	国債証券	390,225,000	110.47 431,087,470	108.08 421,755,180	5.625000 2017/1/15	0.90%
30	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	473,000,000	103.31 488,679,950	89.09 421,419,350	5.000000 2020/4/29	0.90%

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成27年1月30日現在

種類	投資比率
国債証券	93.95%
合計	93.95%

（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27年1月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	イギリス・ポンド買/ 円売2015年02月	買建	4,341,000	776,995,590	773,739,840	6.08%
		アメリカ・ドル買/ 円売2015年02月	買建	6,485,000	765,100,300	766,721,550	6.02%
		ユーロ買/ 円売2015年02月	買建	3,728,000	520,913,440	499,104,640	3.92%
		カナダ・ドル買/ 円売2015年02月	買建	3,295,000	324,458,650	308,675,600	2.43%
		オーストラリア・ドル 買/ 円売2015年02月	買建	3,074,000	294,765,860	282,685,040	2.22%
		イギリス・ポンド売/ 円買2015年02月	売建	10,019,000	1,788,846,160	1,785,786,560	14.03%
		アメリカ・ドル売/ 円買2015年02月	売建	12,939,000	1,524,526,310	1,529,777,970	12.02%
		カナダ・ドル売/ 円買2015年02月	売建	8,681,000	851,581,560	813,236,080	6.39%
		オーストラリア・ドル 売/ 円買2015年02月	売建	7,160,000	686,646,518	658,433,600	5.17%
		ユーロ売/ 円買2015年02月	売建	4,680,000	651,454,908	626,558,400	4.92%

(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27年1月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引 所	TOPIX 先物 2703月	買建	480	6,772,810,520	6,789,600,000	2.08%

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

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

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27年1月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2015年02月	買建	11,100,000	1,308,603,280	1,312,464,000	0.43%
		ユーロ買/円売201 5年02月	買建	2,700,000	359,635,000	361,476,000	0.12%
		イギリス・ポンド買/ 円売2015年02月	買建	1,100,000	196,251,240	196,097,000	0.06%
		オーストラリア・ドル 買/円売2015年0 2月	買建	1,200,000	111,510,560	110,436,000	0.04%
		カナダ・ドル買/円売 2015年02月	買建	1,000,000	93,998,000	93,710,000	0.03%
株価指数先物 取引	シカゴ商 品取引所	S & P 500 F U T U R E M a r 1 5	買建	98	5,971,923,581	5,847,846,812	1.92%
	E U R E X 取引所	D J E U R O S T O X X 5 0 M a r 1 5	買建	376	1,628,872,440	1,697,427,033	0.56%
	I C E - E U	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E M a r 1 5	買建	66	780,133,747	794,752,635	0.26%
	モントリ オール取 引所	S & P / T S E 6 0 I X F U T M a r 1 5	買建	23	368,049,686	369,161,205	0.12%
	シドニー 先物取引 所	S P I 2 0 0 F U T U R E S M a r 1 5	買建	28	350,599,002	354,817,652	0.12%

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2015年02月	売建	4,200,000	496,631,520	496,608,000	1.69%
		イギリス・ポンド売/ 円買2015年02月	売建	280,000	49,918,848	49,915,600	0.17%
		ユーロ売/円買201 5年02月	売建	330,000	44,179,905	44,180,400	0.15%
		オーストラリア・ドル 売/円買2015年0 2月	売建	450,000	41,412,960	41,413,500	0.14%
		シンガポール・ドル 売/円買2015年0 2月	売建	220,000	19,235,920	19,234,600	0.07%
		カナダ・ドル売/円買 2015年02月	売建	160,000	14,994,112	14,993,600	0.05%
		香港・ドル売/円買2 015年02月	売建	750,000	11,436,375	11,437,500	0.04%

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

(注2) 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。

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27年1月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2015年02月	売建	592,731,700	71,048,089,962	70,084,596,208	38.68%
		ユーロ売/円買2015年02月	売建	522,111,600	75,736,612,082	69,900,301,008	38.57%
		イギリス・ポンド売/円買2015年02月	売建	80,279,900	14,993,118,901	14,310,694,974	7.90%
		カナダ・ドル売/円買2015年02月	売建	39,561,000	4,089,956,545	3,706,865,700	2.05%
		オーストラリア・ドル売/円買2015年02月	売建	30,813,900	3,015,182,228	2,835,186,939	1.56%
		メキシコ・ペソ売/円買2015年02月	売建	223,973,700	1,816,986,641	1,787,310,126	0.99%
		デンマーク・クローネ売/円買2015年02月	売建	67,324,600	1,311,628,052	1,211,169,554	0.67%
		ポーランド・ズロチ売/円買2015年02月	売建	33,378,300	1,124,554,981	1,061,429,940	0.59%
		南アフリカ・ランド売/円買2015年02月	売建	90,337,200	931,304,271	924,149,556	0.51%
		マレーシア・リンギット売/円買2015年02月	売建	25,370,000	848,880,200	826,808,300	0.46%
		スウェーデン・クローナ売/円買2015年02月	売建	57,593,900	881,818,766	823,016,831	0.45%
		シンガポール・ドル売/円買2015年02月	売建	7,361,800	665,066,938	643,568,556	0.36%
		ノルウェー・クローネ売/円買2015年02月	売建	29,373,000	469,083,570	443,532,300	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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年1月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	ICE - US	MINI MSCI EMG MKT Ma r 1 5	買建	275	1,541,034,591	1,591,630,218	3.87%

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年1月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売 2 0 1 5 年 0 2 月	買建	350,000	41,218,975	41,384,000	0.09%
		アメリカ・ドル売/円 買 2 0 1 5 年 0 2 月	売建	11,700,000	1,383,473,520	1,383,408,000	2.96%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成27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
第5計算期間末 (平成26年7月11日)	4,155	4,155	1.0597	1.0597
第6計算期間末 (平成27年1月13日)	11,244	11,273	1.1340	1.1370
平成26年1月末日	1,618	-	1.0350	-
2月末日	2,400	-	1.0428	-
3月末日	3,260	-	1.0379	-
4月末日	3,595	-	1.0388	-
5月末日	3,855	-	1.0568	-
6月末日	4,132	-	1.0612	-
7月末日	4,302	-	1.0702	-
8月末日	4,737	-	1.0795	-
9月末日	5,349	-	1.0817	-
10月末日	5,650	-	1.0981	-
11月末日	6,758	-	1.1270	-
12月末日	9,947	-	1.1340	-
平成27年1月末日	12,725	-	1.1424	-

【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
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0030

【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
第5計算期間	1.5
第6計算期間	7.3

(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
第5計算期間	3,174,425,855	96,482,762
第6計算期間	6,639,205,080	645,472,921

(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:2015年1月30日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2012年10月26日)~2015年1月30日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日: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2期	(2013.04.11)	0円
第3期	(2013.07.11)	0円
第4期	(2014.01.14)	0円
第5期	(2014.07.11)	0円
第6期	(2015.01.13)	30円
設定来累計		30円

(注1)分配金は1万口当たりです。

(注2)2013年7月11日までの決算は年4回(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。)、2013年7月12日以降は決算を年2回(1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)に変更しています。

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	国内債券バシシブ・ファンド・マザー・ファンド	40.02%
2	為替フルヘッジ外国債券バシシブ・ファンド・マザー・ファンド	20.02%
3	エマージング債券バシシブ・マザー・ファンド	10.03%
4	外国株式バシシブ・ファンド・マザー・ファンド	7.98%
5	外国リートバシシブ・ファンド・マザー・ファンド	6.99%
6	国内株式バシシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド	4.95%
7	J-REITインデックスファンド・マザー・ファンド	4.94%
8	エマージング株式バシシブ・マザー・ファンド	2.96%

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)	20.67
為替予約取引(売建)	△42.54

■国内債券バシシブ・ファンド・マザー・ファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	81.18
内 日本	81.18
地方債証券	6.45
内 日本	6.45
特殊債証券	6.41
内 日本	6.41
社債券	5.41
内 日本	5.34
内 アメリカ	0.07
コールローン、その他の資産(負債控除後)	0.55
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	117回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.39%
2	334回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/6/20	1.31%
3	335回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.500000	2024/9/20	1.18%
4	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.16%
5	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2024/3/20	1.07%

■国内株式バシシブ・ファンド(最適化法)・マザー・ファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	97.72
内 日本	97.72
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.28
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.99%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.37%
3	ソフトバンク	株式	日本	情報・通信業	1.72%
4	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.52%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.41%

組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.48%
2	輸送用機器	11.62%
3	銀行業	8.43%
4	情報・通信業	6.84%
5	化学	6.11%

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)	2.08

○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:2015年1月30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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	94.01
内 アメリカ	39.17
内 フランス	9.24
内 イタリア	9.15
内 イギリス	8.13
内 ドイツ	7.63
内 その他	20.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5.99
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△93.02

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	US T N/B 3.625 08/15/19	国債証券	アメリカ	3.625000	2019/8/15	1.23%
2	US T N/B 0.375 04/30/16	国債証券	アメリカ	0.375000	2016/4/30	1.21%
3	US T N/B 8.125 08/15/19	国債証券	アメリカ	8.125000	2019/8/15	0.94%
4	US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	アメリカ	2.500000	2024/5/15	0.88%
5	US T N/B 0.625 05/31/17	国債証券	アメリカ	0.625000	2017/5/31	0.80%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	94.64
内 アメリカ	56.51
内 イギリス	8.03
内 スイス	4.01
内 カナダ	3.90
内 ドイツ	3.77
内 その他	18.42
投資信託受益証券	0.29
内 オーストラリア	0.25
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.23
内 アメリカ	1.86
内 フランス	0.15
内 イギリス	0.15
内 香港	0.05
内 カナダ	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.84
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.68
株価指数先物取引(買建)	2.97

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.30%
2	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	1.20%
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.06%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.92%
5	WELLS FARGO & CO	株式	アメリカ	商業銀行	0.84%

組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	8.80%
2	医薬品	7.46%
3	石油・ガス・消耗燃料	7.00%
4	保険	4.11%
5	メディア	2.96%

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資証券	94.81
内 日本	94.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5.19
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	7.35%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	6.44%
3	日本リテールファンド投資法人	日本	5.57%
4	ユナイテッドアーバン投資法人	日本	4.48%
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.31%

■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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.44
内 オーストラリア	7.46
内 シンガポール	2.98
投資証券	86.54
内 アメリカ	69.43
内 イギリス	6.21
内 フランス	4.78
内 カナダ	2.07
内 香港	1.75
内 その他	2.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.02
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	△2.30

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	発行体の国/地域	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	5.81%
2	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.70%
3	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.63%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.55%
5	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	2.51%

○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:2015年1月30日

■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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
国債証券	93.95
内 トルコ	14.09
内 メキシコ	12.62
内 ブラジル	11.10
内 ロシア	10.80
内 インドネシア	9.04
内 その他	36.30
コールローン、その他の資産(負債控除後)	6.05
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	利率(%)	償還日	投資比率
1	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	ロシア	7.500000	2030/3/31	3.77%
2	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.050000	2040/1/11	1.68%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.54%
4	RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	国債証券	ロシア	11.000000	2018/7/24	1.30%
5	BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	ブラジル	5.000000	2045/1/27	1.26%

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	0.09
為替予約取引(売建)	△2.96

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	95.11
内 韓国	14.23
内 台湾	12.02
内 中国	11.37
内 ブラジル	8.20
内 南アフリカ	7.77
内 その他	41.52
投資信託受益証券	0.70
内 メキシコ	0.70
投資証券	0.23
内 メキシコ	0.17
内 トルコ	0.07
コールローン、その他の資産(負債控除後)	3.96
純資産総額	100.00

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.40%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	2.77%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン/中国	インターネット/ソフトウェアサービス	2.22%
4	CHINA MOBILE LIMITED	株式	香港	無線通信サービス	2.04%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.44%

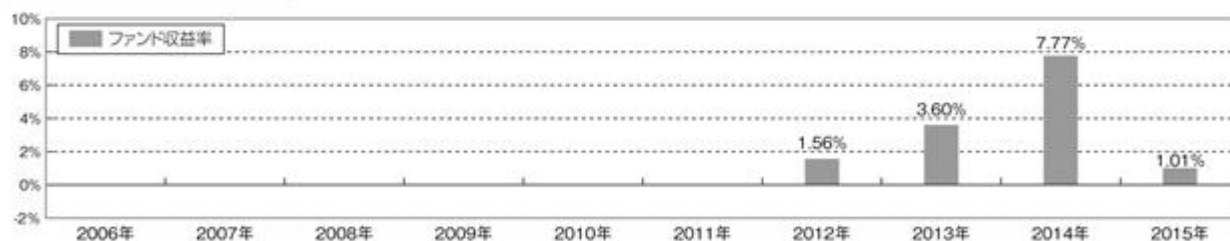
組入上位5業種(外国株式)

順位	業種	投資比率
1	商業銀行	17.48%
2	石油・ガス・消耗燃料	7.43%
3	無線通信サービス	5.57%
4	コンピュータ・周辺機器	5.30%
5	半導体・半導体製造装置	5.11%

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)	3.87

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2015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】

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

イ.償還規定

(略)

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

(略)

i.信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

ロ.信託約款の変更等

(略)

b.委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

(略)

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

(略)

i.重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

(略)

ホ.運用報告書

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

(略)

<訂正後>

イ.償還規定

(略)

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

(略)

i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

(略)

b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(略)

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

(略)

i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

(略)

ホ. 運用報告書

- ・ 委託会社は、毎年1月11日、7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・ 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

(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) 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ヵ月ごとに作成しております。

(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6期計算期間（平成26年7月12日から平成27年1月13日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

投資のソムリエ

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 平成26年7月11日現在	第6期 平成27年1月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	132,647,906	2,528,488,677
親投資信託受益証券	4,044,236,068	8,931,963,337
派生商品評価勘定	7,927,134	77,910,078
未収入金	7,424,815	-
流動資産合計	4,192,235,923	11,538,362,092
資産合計		
	4,192,235,923	11,538,362,092
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	572	114,808,711
未払金	12,967,048	-
未払収益分配金	-	29,745,703
未払解約金	1,030,564	103,366,420
未払受託者報酬	800,883	1,652,569
未払委託者報酬	21,624,861	44,620,646
その他未払費用	76,001	156,907
流動負債合計	36,499,929	294,350,956
負債合計		
	36,499,929	294,350,956
純資産の部		
元本等		
元本	1,392,502,375	1,915,234,534
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	234,233,619	1,328,776,602
(分配準備積立金)	69,792,241	438,124,546
元本等合計	4,155,735,994	11,244,011,136
純資産合計		
	4,155,735,994	11,244,011,136
負債純資産合計		
	4,192,235,923	11,538,362,092

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	平成26年1月15日 平成26年7月11日	自	平成26年7月12日 平成27年1月13日
営業収益				
受取利息		59,107		88,798
有価証券売買等損益		94,614,379		545,052,269
為替差損益		3,394,396		75,695,027
営業収益合計		91,279,090		469,446,040
営業費用				
受託者報酬		800,883		1,652,569
委託者報酬		21,624,861		44,620,646
その他費用		76,001		178,507
営業費用合計		22,501,745		46,451,722
営業利益又は営業損失（ ）		68,777,345		422,994,318
経常利益又は経常損失（ ）		68,777,345		422,994,318
当期純利益又は当期純損失（ ）		68,777,345		422,994,318
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（ ）		1,521,388		16,774,587
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		37,092,958		234,233,619
剰余金増加額又は欠損金減少額		133,928,219		763,248,975
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		133,928,219		763,248,975
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,043,515		45,180,020
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,043,515		45,180,020
分配金		1 -		1 29,745,703
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		234,233,619		1,328,776,602

(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	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27年1月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第5期 平成26年7月11日現在	第6期 平成27年1月13日現在
1 . 1 期首元本額	843,559,282円	3,921,502,375円
期中追加設定元本額	3,174,425,855円	6,639,205,080円
期中一部解約元本額	96,482,762円	645,472,921円
2 . 受益権の総数	3,921,502,375口	9,915,234,534口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期	第6期
	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13日
1 . 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（32,232,210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（34,166,690円）、信託約款に規定される収益調整金（207,687,511円）及び分配準備積立金（3,393,341円）より分配対象収益は277,479,752円（1万口当たり707.59円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（65,747,222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（340,472,509円）、信託約款に規定される収益調整金（890,652,056円）及び分配準備積立金（61,650,518円）より分配対象収益は1,358,522,305円（1万口当たり1,370.14円）であり、うち29,745,703円（1万口当たり30円）を分配金額としております。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5期 自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日	第6期 自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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5期 平成26年7月11日現在	第6期 平成27年1月13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5期 平成26年7月11日現在	第6期 平成27年1月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	90,735,337	181,727,197
合計	90,735,337	181,727,197

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第5期 平成26年7月11日 現在				第6期 平成27年1月13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	1,165,468,912	-	1,157,542,350	7,926,562	3,924,632,417	-	3,905,469,700	19,162,717
アメリカ・ドル	249,571,474	-	248,412,120	1,159,354	1,082,156,121	-	1,098,275,820	16,119,699
イギリス・ポンド	374,700,691	-	372,160,980	2,539,711	1,237,832,051	-	1,222,322,710	15,509,341
オーストラリア・ドル	124,312,665	-	123,029,260	1,283,405	467,402,928	-	463,148,700	4,254,228
カナダ・ドル	124,619,748	-	124,263,370	356,378	557,884,107	-	544,637,570	13,246,537
ユーロ	292,264,334	-	289,676,620	2,587,714	579,357,210	-	577,084,900	2,272,310
買 建	-	-	-	-	2,738,295,190	-	2,682,233,840	56,061,350
アメリカ・ドル	-	-	-	-	763,366,962	-	765,100,300	1,733,338
イギリス・ポンド	-	-	-	-	794,163,930	-	776,995,590	17,168,340
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	297,634,980	-	294,765,860	2,869,120
カナダ・ドル	-	-	-	-	334,800,678	-	324,458,650	10,342,028
ユーロ	-	-	-	-	548,328,640	-	520,913,440	27,415,200
合計	1,165,468,912	-	1,157,542,350	7,926,562	6,662,927,607	-	6,587,703,540	36,898,633

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 平成26年7月11日現在	第6期 平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.0597円	1.1340円
(1万口当たり純資産額)	(10,597円)	(11,340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27年1月13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	145,126,893	283,316,720	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	3,643,791,819	4,519,759,372	
	J-REITインデックスファンド・マ ザーファンド	160,194,756	289,904,449	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	161,486,875	442,651,673	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザー ファンド	344,186,772	402,870,616	
	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	1,718,229,481	2,264,798,278	
	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド	163,231,034	168,389,134	
	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド	317,759,242	560,273,095	
親投資信託受益証券 合計		6,654,006,872	8,931,963,337	
合計		6,654,006,872	8,931,963,337	

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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,199,176,940	9,144,078,193
株式	2	309,143,700,950	310,021,808,430
派生商品評価勘定		16,098,752	8,725,236
未収入金		7,059,808	-
未収配当金		249,042,165	360,610,366
前払金		-	263,403,000
流動資産合計		319,615,078,615	319,798,625,225
資産合計		319,615,078,615	319,798,625,225
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		39,234,836	287,544,680
前受金		46,140,000	-
未払金		-	28,653,456
未払解約金		626,151,000	134,159,000
流動負債合計		711,525,836	450,357,136
負債合計		711,525,836	450,357,136
純資産の部			
元本等			
元本	1	180,455,345,013	163,582,012,277
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		138,448,207,766	155,766,255,812
元本等合計		318,903,552,779	319,348,268,089
純資産合計		318,903,552,779	319,348,268,089
負債純資産合計		319,615,078,615	319,798,625,225

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26年7月11日現在	平成27年1月13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	184,628,470,006円	180,455,345,013円
同期中追加設定元本額	17,160,952,585円	11,165,178,087円
同期中一部解約元本額	21,334,077,578円	28,038,510,823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	4,070,156,401円	4,050,936,134円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,302,318,266円	1,668,247,005円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	37,227,116,028円	36,410,499,984円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	769,441,024円	761,856,710円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,906,864,162円	2,874,848,892円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,137,239,124円	3,083,858,969円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	425,486,727円	397,344,864円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,381,957,174円	1,320,795,677円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,174,087,366円	1,145,795,156円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	103,163,094円	79,034,540円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,323,196,990円	1,242,527,851円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	23,218,922円	28,285,705円

D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	8,940,477円	16,523,767円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	17,059,927円	31,567,277円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	41,988,924円	77,789,847円
投資のソムリエ	161,984,072円	145,126,893円
クルーズコントロール	504,644,758円	715,684,317円
投資のソムリエ<DC年金>	1,531,250円	2,119,892円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	9,053,863円	31,437,441円
D I A M D C バランス・F (成長型)	- 円	4,310,499円
クルーズコントロール<DC年 金>	- 円	156,681円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	147,964,428円	133,832,298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)	3,903,483,694円	2,351,220,226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)	811,007,040円	635,341,939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)	98,861,045円	72,672,077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)	380,247,936円	306,900,165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)	99,556,849円	63,142,007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)	158,327,505円	120,735,185円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	14,035,129,735円	10,603,997,795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)	4,616,697,657円	3,748,124,949円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,380,316,154円	3,017,936,362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)	2,267,500,550円	2,080,118,791円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	5,497,235,151円	5,208,226,785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)	567,314,766円	441,450,309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)	1,505,150,787円	1,193,777,005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)	1,438,450,480円	1,285,199,215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)	7,292,096,488円	5,670,823,408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)	87,280,606円	93,432,732円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	2,754,458,034円	2,000,498,285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)	7,082,264,454円	6,655,657,141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)	253,965,296円	212,459,752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)	26,836,929,960円	24,462,739,747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)	1,266,746,443円	1,039,739,874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)	3,133,081,306円	2,809,479,751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)	16,687,818,103円	15,371,060,815円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	40,833円	38,223円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	101,926,297円	91,866円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	56,698,735円	65,471,021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)	14,822,546,216円	13,766,293,963円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	143,743,419円	129,858,692円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	50,278,069円	45,696,398円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	73,514,460円	35,334円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	75,171,627円	110,635,704円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	126,984円	122,223円

	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定)	900,296,115円	818,354,088円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	2,273,472,480円	2,114,709,804円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	2,945,619,832円	2,751,007,520円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	120,576,930円	112,382,727円
	計	180,455,345,013円	163,582,012,277円
2 .	受益権の総数	180,455,345,013口	163,582,012,277口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 2,990,500,000円	株式 3,759,500,000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26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13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ぬ。	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つた場合、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26年7月11日現在	平成27年1月13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	16,156,134,562	41,054,501,257
合計	16,156,134,562	41,054,501,257

（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26年2月8日から平成26年7月11日まで及び平成26年2月8日から平成27年1月13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26年7月11日 現在				平成27年1月13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	9,318,741,000	-	9,295,845,000	22,896,000	8,951,710,000	-	8,673,095,000	278,615,000
合計	9,318,741,000	-	9,295,845,000	22,896,000	8,951,710,000	-	8,673,095,000	278,615,000

（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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.7672円	1.9522円
（1万口当たり純資産額）	(17,672円)	(19,522円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年1月13日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	75,000	273.00	20,475,000	
日本水産	212,700	366.00	77,848,200	
マルハニチロ	33,500	1,752.00	58,692,000	
ハウスイ	14,000	128.00	1,792,000	
サカタのタネ	25,600	2,066.00	52,889,600	
ホクト	19,400	2,014.00	39,071,600	
ショーボンドホールディングス	15,400	4,645.00	71,533,000	
ミライト・ホールディングス	53,300	1,286.00	68,543,800	
タマホーム	11,600	608.00	7,052,800	
サンヨーホームズ	1,900	620.00	1,178,000	
住石ホールディングス	48,300	117.00	5,651,100	
日鉄鉱業	48,000	423.00	20,304,000	
三井松島産業	114,000	125.00	14,250,000	
国際石油開発帝石	911,600	1,203.50	1,097,110,600	
日本海洋掘削	5,200	4,195.00	21,814,000	
石油資源開発	24,700	3,490.00	86,203,000	
K & Oエナジーグループ	11,700	1,462.00	17,105,400	
ダイセキ環境ソリューション	2,000	1,696.00	3,392,000	
安藤・間	115,500	761.00	87,895,500	
東急建設	61,500	547.00	33,640,500	
コムシスホールディングス	77,100	1,547.00	119,273,700	
ミサワホーム	20,500	1,020.00	20,910,000	
高松コンストラクショングループ	13,100	2,399.00	31,426,900	
東建コーポレーション	6,500	4,715.00	30,647,500	
ヤマウラ	8,400	386.00	3,242,400	
大成建設	875,000	684.00	598,500,000	
大林組	519,000	758.00	393,402,000	
清水建設	529,000	787.00	416,323,000	
飛鳥建設	112,700	262.00	29,527,400	
長谷工コーポレーション	216,300	955.00	206,566,500	
松井建設	2,000	634.00	1,268,000	
銭高組	25,000	365.00	9,125,000	
鹿島建設	761,000	462.00	351,582,000	
不動テトラ	131,100	243.00	31,857,300	
大末建設	6,700	827.00	5,540,900	
鉄建建設	105,000	452.00	47,460,000	
日鉄住金テックスエンジ	33,000	506.00	16,698,000	
西松建設	187,000	478.00	89,386,000	
三井住友建設	698,000	163.00	113,774,000	
大豊建設	47,000	540.00	25,380,000	
前田建設工業	115,000	936.00	107,640,000	
佐田建設	60,000	138.00	8,280,000	
ナカノフドー建設	13,400	394.00	5,279,600	

奥村組	164,000	524.00	85,936,000
大和小田急建設	9,400	769.00	7,228,600
東鉄工業	20,800	2,705.00	56,264,000
イチケン	19,000	317.00	6,023,000
浅沼組	56,000	154.00	8,624,000
戸田建設	217,000	446.00	96,782,000
熊谷組	217,000	370.00	80,290,000
青木あすなろ建設	10,600	799.00	8,469,400
北野建設	36,000	364.00	13,104,000
植木組	22,000	269.00	5,918,000
三井ホーム	23,000	492.00	11,316,000
矢作建設工業	21,500	893.00	19,199,500
ピーエス三菱	18,300	468.00	8,564,400
東日本ハウス	21,800	502.00	10,943,600
大東建託	65,700	13,485.00	885,964,500
新日本建設	20,700	445.00	9,211,500
N I P P O	40,000	1,864.00	74,560,000
東亜道路工業	33,000	439.00	14,487,000
前田道路	54,000	1,715.00	92,610,000
日本道路	52,000	563.00	29,276,000
東亜建設工業	130,000	196.00	25,480,000
若築建設	100,000	197.00	19,700,000
東洋建設	46,200	529.00	24,439,800
五洋建設	192,200	435.00	83,607,000
大林道路	20,000	735.00	14,700,000
世紀東急工業	25,300	585.00	14,800,500
福田組	26,000	950.00	24,700,000
日本ドライケミカル	2,300	2,272.00	5,225,600
住友林業	127,700	1,118.00	142,768,600
日本基礎技術	20,800	382.00	7,945,600
日成ビルド工業	48,000	291.00	13,968,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	80,000	95.00	7,600,000
巴コーポレーション	21,800	431.00	9,395,800
パナホーム	65,000	739.00	48,035,000
大和ハウス工業	506,700	2,213.50	1,121,580,450
ライト工業	27,800	1,030.00	28,634,000
積水ハウス	532,300	1,556.00	828,258,800
日特建設	23,200	520.00	12,064,000
北陸電気工事	9,000	652.00	5,868,000
ユアテック	27,000	655.00	17,685,000
西部電気工業	15,000	474.00	7,110,000
四電工	6,000	429.00	2,574,000
中電工	25,000	1,824.00	45,600,000
関電工	79,000	676.00	53,404,000
きんでん	115,000	1,240.00	142,600,000
東京エネシス	19,000	828.00	15,732,000
トーエネック	25,000	559.00	13,975,000
住友電設	13,700	1,467.00	20,097,900
日本電設工業	28,300	1,596.00	45,166,800
協和エクシオ	73,600	1,219.00	89,718,400

新日本空調	14,700	932.00	13,700,400
日本工営	54,000	457.00	24,678,000
N D S	30,000	303.00	9,090,000
九電工	32,000	1,310.00	41,920,000
三機工業	35,400	754.00	26,691,600
日揮	174,000	2,308.00	401,592,000
中外炉工業	53,000	281.00	14,893,000
ヤマト	16,000	421.00	6,736,000
太平電業	23,000	867.00	19,941,000
高砂熱学工業	48,300	1,464.00	70,711,200
三晃金属工業	18,000	242.00	4,356,000
N E C ネットズエスアイ	19,200	2,412.00	46,310,400
朝日工業社	20,000	406.00	8,120,000
明星工業	31,000	698.00	21,638,000
大気社	24,800	2,576.00	63,884,800
ダイダン	23,000	688.00	15,824,000
日比谷総合設備	22,400	1,535.00	34,384,000
東芝プラントシステム	28,100	1,795.00	50,439,500
日本製粉	107,000	514.00	54,998,000
日清製粉グループ本社	190,000	1,223.00	232,370,000
日東富士製粉	8,000	316.00	2,528,000
昭和産業	72,000	474.00	34,128,000
鳥越製粉	14,500	718.00	10,411,000
中部飼料	17,100	647.00	11,063,700
フィード・ワンホールディングス	106,800	109.00	11,641,200
東洋精糖	29,000	99.00	2,871,000
日本甜菜製糖	90,000	204.00	18,360,000
三井製糖	68,000	398.00	27,064,000
塩水港精糖	18,700	262.00	4,899,400
ネクスト	18,900	1,016.00	19,202,400
日本M & Aセンター	24,900	3,880.00	96,612,000
ノバレーゼ	4,200	871.00	3,658,200
アコーディア・ゴルフ	60,700	1,127.00	68,408,900
タケエイ	15,700	929.00	14,585,300
トラスト・テック	2,800	1,788.00	5,006,400
パソナグループ	12,000	576.00	6,912,000
C D S	3,700	954.00	3,529,800
リンクアンドモチベーション	21,800	156.00	3,400,800
G C A サヴィアン	12,600	1,195.00	15,057,000
エス・エム・エス	18,000	1,241.00	22,338,000
テンブホールディングス	31,700	3,885.00	123,154,500
リニカル	4,200	914.00	3,838,800
クックパッド	8,200	4,365.00	35,793,000
エスクリ	5,700	982.00	5,597,400
アイ・ケイ・ケイ	4,400	944.00	4,153,600
森永製菓	156,000	322.00	50,232,000
中村屋	41,000	463.00	18,983,000
江崎グリコ	40,000	4,480.00	179,200,000
名糖産業	8,000	1,159.00	9,272,000
不二家	100,000	196.00	19,600,000

山崎製パン	127,000	1,506.00	191,262,000	
第一屋製パン	25,000	131.00	3,275,000	
モロゾフ	28,000	372.00	10,416,000	
亀田製菓	9,700	3,590.00	34,823,000	
寿スピリッツ	4,200	2,454.00	10,306,800	
カルビー	64,100	4,265.00	273,386,500	
森永乳業	156,000	409.00	63,804,000	
六甲バター	7,900	1,034.00	8,168,600	
ヤクルト本社	92,800	6,440.00	597,632,000	
明治ホールディングス	51,300	11,610.00	595,593,000	
雪印メグミルク	41,000	1,438.00	58,958,000	
プリマハム	97,000	276.00	26,772,000	
日本ハム	127,000	2,786.00	353,822,000	
伊藤ハム	95,000	638.00	60,610,000	
林兼産業	58,000	83.00	4,814,000	
丸大食品	90,000	416.00	37,440,000	
米久	5,500	1,821.00	10,015,500	
S Foods	10,900	2,547.00	27,762,300	
学情	6,000	1,045.00	6,270,000	
スタジオアリス	7,400	1,713.00	12,676,200	
シミックホールディングス	6,100	1,998.00	12,187,800	
システナ	15,000	845.00	12,675,000	
デジタルアーツ	8,200	1,076.00	8,823,200	
新日鉄住金ソリューションズ	12,700	3,115.00	39,560,500	
総合警備保障	53,800	2,923.00	157,257,400	
キューブシステム	6,700	545.00	3,651,500	
日本駐車場開発	166,200	118.00	19,611,600	
コア	6,500	847.00	5,505,500	
カカクコム	107,300	1,653.00	177,366,900	
アイロムホールディングス	3,900	2,420.00	9,438,000	
ルネサンス	8,200	1,170.00	9,594,000	
ディップ	3,600	4,545.00	16,362,000	
SBSホールディングス	11,400	958.00	10,921,200	
オプト	7,300	713.00	5,204,900	
新日本科学	15,200	786.00	11,947,200	
ツクイ	19,100	1,045.00	19,959,500	
総合臨床ホールディングス	7,500	466.00	3,495,000	
キャリアデザインセンター	4,800	915.00	4,392,000	
エムスリー	139,600	2,079.00	290,228,400	
ツカダ・グローバルホールディング	11,700	768.00	8,985,600	
アウトソーシング	6,100	1,970.00	12,017,000	
ディー・エヌ・エー	79,500	1,515.00	120,442,500	
博報堂DYホールディングス	223,600	1,086.00	242,829,600	
ぐるなび	19,900	1,916.00	38,128,400	
一休	12,700	1,383.00	17,564,100	
ジャパンベストレスキューシステム	13,400	262.00	3,510,800	
ファンコミュニケーションズ	27,800	1,333.00	37,057,400	
ジェイコムホールディングス	3,500	786.00	2,751,000	
PGMホールディングス	22,900	1,150.00	26,335,000	
WDBホールディングス	5,800	886.00	5,138,800	

ティア	4,100	576.00	2,361,600
バリューコマース	13,200	561.00	7,405,200
サッポロホールディングス	283,000	476.00	134,708,000
アサヒグループホールディングス	347,900	3,592.50	1,249,830,750
キリンホールディングス	740,500	1,452.00	1,075,206,000
宝ホールディングス	135,800	721.00	97,911,800
オエノンホールディングス	46,000	217.00	9,982,000
養命酒製造	3,000	933.00	2,799,000
コカ・コーラウエスト	58,700	1,632.00	95,798,400
コカ・コーライーストジャパン	52,600	1,857.00	97,678,200
サントリー食品インターナショナル	103,800	3,980.00	413,124,000
ダイトードリンク	8,800	5,030.00	44,264,000
伊藤園	47,100	2,129.00	100,275,900
キーコーヒー	15,600	1,660.00	25,896,000
ユニカフェ	5,400	758.00	4,093,200
ジャパンフーズ	2,600	1,123.00	2,919,800
日清オイリオグループ	84,000	415.00	34,860,000
不二製油	46,200	1,432.00	66,158,400
J - オイルミルズ	73,000	383.00	27,959,000
ローソン	57,700	7,290.00	420,633,000
サンエー	11,500	3,835.00	44,102,500
ダイユーエイト	3,200	830.00	2,656,000
カワチ薬品	11,800	1,790.00	21,122,000
エービーシー・マート	21,600	5,680.00	122,688,000
ハードオフコーポレーション	7,500	1,020.00	7,650,000
高千穂交易	6,100	1,028.00	6,270,800
アスクル	15,800	2,104.00	33,243,200
ゲオホールディングス	28,700	993.00	28,499,100
アダストリアホールディングス	12,800	3,125.00	40,000,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	19,000	128.00	2,432,000
伊藤忠食品	3,900	3,770.00	14,703,000
くらコーポレーション	8,900	3,260.00	29,014,000
キャンドウ	7,300	1,557.00	11,366,100
エレマテック	7,100	2,758.00	19,581,800
パル	8,900	3,215.00	28,613,500
JALUX	4,500	1,940.00	8,730,000
エディオン	69,800	823.00	57,445,400
あらた	34,000	318.00	10,812,000
サーラコーポレーション	13,200	582.00	7,682,400
ワッツ	6,100	807.00	4,922,700
トーメンデバイス	2,400	1,807.00	4,336,800
J Pホールディングス	40,100	373.00	14,957,300
あみやき亭	2,600	3,805.00	9,893,000
東京エレクトロン デバイス	3,000	1,520.00	4,560,000
ひらまつ	21,100	645.00	13,609,500
双日	1,023,000	160.00	163,680,000
ゲンキー	1,500	7,700.00	11,550,000
アルフレッサ ホールディングス	180,300	1,375.00	247,912,500
大黒天物産	3,600	3,420.00	12,312,000
ハニーズ	12,100	991.00	11,991,100

キッコーマン	141,000	2,982.00	420,462,000
味の素	399,000	2,219.00	885,381,000
キュービー	88,100	2,264.00	199,458,400
ハウス食品グループ本社	64,100	2,091.00	134,033,100
カゴメ	67,100	1,781.00	119,505,100
焼津水産化学工業	8,700	1,022.00	8,891,400
アリアケジャパン	15,800	3,045.00	48,111,000
ニチレイ	185,000	553.00	102,305,000
横浜冷凍	38,100	797.00	30,365,700
東洋水産	90,400	3,880.00	350,752,000
イトアンド	2,000	1,800.00	3,600,000
日清食品ホールディングス	73,300	6,060.00	444,198,000
永谷園	7,000	1,112.00	7,784,000
フジッコ	17,000	2,028.00	34,476,000
ロック・フィールド	9,300	2,000.00	18,600,000
日本たばこ産業	959,100	3,211.00	3,079,670,100
ケンコーマヨネーズ	5,700	1,403.00	7,997,100
わらべや日洋	10,300	1,928.00	19,858,400
なとり	8,400	1,302.00	10,936,800
片倉工業	20,300	1,252.00	25,415,600
グンゼ	131,000	316.00	41,396,000
ヒューリック	257,200	1,114.00	286,520,800
神栄	23,000	195.00	4,485,000
山下医科器械	1,300	1,651.00	2,146,300
ラサ商事	8,100	537.00	4,349,700
アルペン	13,600	1,668.00	22,684,800
クオール	15,500	774.00	11,997,000
アルコニックス	8,600	1,902.00	16,357,200
神戸物産	2,500	9,000.00	22,500,000
ジェイアイエヌ	10,300	2,788.00	28,716,400
ビックカメラ	66,100	1,265.00	83,616,500
D C Mホールディングス	73,700	725.00	53,432,500
MonotaRO	29,700	2,315.00	68,755,500
あい ホールディングス	24,400	2,091.00	51,020,400
ディーブイエックス	4,500	1,049.00	4,720,500
きちり	3,000	678.00	2,034,000
アークランドサービス	1,800	3,535.00	6,363,000
J . フロント リテイリング	192,800	1,358.00	261,822,400
ドトール・日レスホールディングス	26,700	1,693.00	45,203,100
マツモトキヨシホールディングス	34,100	3,375.00	115,087,500
ブロンコビリー	2,700	3,025.00	8,167,500
スタートトゥデイ	47,400	2,584.00	122,481,600
物語コーポレーション	3,700	3,955.00	14,633,500
ココカラファイン	15,900	2,864.00	45,537,600
三越伊勢丹ホールディングス	303,000	1,496.00	453,288,000
東洋紡	640,000	159.00	101,760,000
ユニチカ	470,000	58.00	27,260,000
富士紡ホールディングス	79,000	335.00	26,465,000
日清紡ホールディングス	103,000	1,209.00	124,527,000
倉敷紡績	167,000	181.00	30,227,000

ダイワボウホールディングス	139,000	202.00	28,078,000
シキボウ	93,000	120.00	11,160,000
日東紡績	119,000	399.00	47,481,000
トヨタ紡織	54,000	1,535.00	82,890,000
ウエルシアホールディングス	13,700	3,710.00	50,827,000
クリエイトSDホールディングス	6,400	3,795.00	24,288,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,700	886.00	25,428,200
八洲電機	12,000	552.00	6,624,000
UKCホールディングス	9,800	1,809.00	17,728,200
丸善CHIホールディングス	17,800	350.00	6,230,000
TOKAIホールディングス	74,500	540.00	40,230,000
エー・ピーカンパニー	2,100	1,845.00	3,874,500
三洋貿易	9,200	1,305.00	12,006,000
チムニー	2,800	2,163.00	6,056,400
ウイン・パートナーズ	4,900	1,546.00	7,575,400
ネクステージ	1,500	687.00	1,030,500
ジョイフル本田	8,300	4,000.00	33,200,000
キリン堂ホールディングス	5,200	747.00	3,884,400
すかいらーく	55,800	1,218.00	67,964,400
日本毛織	51,000	752.00	38,352,000
大東紡織	27,000	74.00	1,998,000
トーア紡コーポレーション	73,000	73.00	5,329,000
ガイドーリミテッド	18,300	508.00	9,296,400
東京建物不動産販売	8,200	380.00	3,116,000
三栄建築設計	6,300	930.00	5,859,000
野村不動産ホールディングス	91,600	2,070.00	189,612,000
プレサンスコーポレーション	5,200	3,775.00	19,630,000
常和ホールディングス	6,300	3,600.00	22,680,000
日本管理センター	7,200	1,259.00	9,064,800
エストラスト	1,600	682.00	1,091,200
フージャースホールディングス	22,700	503.00	11,418,100
オープンハウス	9,600	2,222.00	21,331,200
東急不動産ホールディングス	399,400	809.00	323,114,600
飯田グループホールディングス	98,800	1,509.00	149,089,200
帝国繊維	16,900	2,520.00	42,588,000
ブックオフコーポレーション	8,800	828.00	7,286,400
日本コークス工業	145,800	110.00	16,038,000
ミタチ産業	3,600	709.00	2,552,400
あさひ	10,000	1,078.00	10,780,000
日本調剤	1,900	3,710.00	7,049,000
コスモス薬品	8,600	16,230.00	139,578,000
シップヘルスケアホールディングス	27,800	2,684.00	74,615,200
トーエル	8,200	638.00	5,231,600
一六堂	3,600	432.00	1,555,200
ソフトクリエイトホールディングス	5,100	902.00	4,600,200
セブン&アイ・ホールディングス	637,600	4,230.50	2,697,366,800
薬王堂	2,100	1,958.00	4,111,800
クリエイト・レストランツ・ホールディング	10,600	1,704.00	18,062,400

ツルハホールディングス	30,100	7,320.00	220,332,000	
スターティア	1,300	1,566.00	2,035,800	
サンマルクホールディングス	5,500	7,010.00	38,555,000	
フェリシモ	3,900	1,004.00	3,915,600	
トリドール	15,600	1,756.00	27,393,600	
クスリのアオキ	6,800	6,950.00	47,260,000	
帝人	661,000	322.00	212,842,000	
東レ	1,252,000	946.50	1,185,018,000	
クラレ	275,500	1,359.00	374,404,500	
旭化成	1,009,000	1,104.00	1,113,936,000	
サカイオーベックス	42,000	174.00	7,308,000	
稲葉製作所	6,900	1,323.00	9,128,700	
宮地エンジニアリンググループ	47,000	190.00	8,930,000	
トーカロ	10,600	1,992.00	21,115,200	
アルファ	5,600	1,186.00	6,641,600	
SUMCO	111,200	1,768.00	196,601,600	
川田テクノロジーズ	3,100	3,800.00	11,780,000	
住江織物	44,000	294.00	12,936,000	
日本フェルト	9,500	523.00	4,968,500	
イチカワ	11,000	279.00	3,069,000	
日本バイリーン	23,000	604.00	13,892,000	
エコナックホールディングス	54,000	51.00	2,754,000	
日東製網	19,000	159.00	3,021,000	
芦森工業	35,000	164.00	5,740,000	
アツギ	136,000	112.00	15,232,000	
ダイニック	31,000	174.00	5,394,000	
共和レザー	10,700	750.00	8,025,000	
セーレン	40,500	944.00	38,232,000	
東海染工	24,000	120.00	2,880,000	
小松精練	26,900	519.00	13,961,100	
ワコールホールディングス	96,000	1,153.00	110,688,000	
ホギメディカル	10,200	5,510.00	56,202,000	
レナウン	39,100	113.00	4,418,300	
クラウディア	2,000	1,340.00	2,680,000	
T S Iホールディングス	72,100	701.00	50,542,100	
I Tホールディングス	50,500	1,813.00	91,556,500	
ネオス	4,100	681.00	2,792,100	
電算システム	5,300	1,511.00	8,008,300	
グリー	92,200	710.00	65,462,000	
コーエーテクモホールディングス	34,400	1,688.00	58,067,200	
三菱総合研究所	5,900	2,987.00	17,623,300	
ボルテージ	2,700	1,267.00	3,420,900	
電算	1,600	2,284.00	3,654,400	
A G S	2,700	943.00	2,546,100	
ファインデックス	2,200	7,050.00	15,510,000	
ヒト・コミュニケーションズ	2,200	1,770.00	3,894,000	
ブレインパッド	1,600	1,296.00	2,073,600	
K L a b	16,100	1,302.00	20,962,200	
ポルトウウィン・ピットクルー ホールディングス	10,000	842.00	8,420,000	

イーブックイニシアティブジャパン	3,400	1,089.00	3,702,600	
ネクソン	144,400	1,114.00	160,861,600	
アイスタイル	5,000	521.00	2,605,000	
エムアップ	4,000	718.00	2,872,000	
エイチーム	1,900	4,650.00	8,835,000	
e n i s h	4,000	1,516.00	6,064,000	
コロプラ	26,600	2,607.00	69,346,200	
モバイルクリエイト	6,500	823.00	5,349,500	
オルトプラス	2,800	977.00	2,735,600	
ブロードリーフ	12,600	1,625.00	20,475,000	
ハーツユナイテッドグループ	4,600	1,979.00	9,103,400	
特種東海製紙	94,000	267.00	25,098,000	
ベリサーブ	1,800	1,051.00	1,891,800	
ティーガイア	15,200	1,230.00	18,696,000	
豆蔵ホールディングス	11,900	693.00	8,246,700	
テクマトリックス	6,600	614.00	4,052,400	
GMOペイメントゲートウェイ	13,200	2,187.00	28,868,400	
ザッパラス	8,700	580.00	5,046,000	
インターネットイニシアティブ	24,600	2,353.00	57,883,800	
GMOクラウド	2,600	1,019.00	2,649,400	
ビットアイル	17,100	507.00	8,669,700	
SRAホールディングス	8,100	1,417.00	11,477,700	
システムインテグレータ	1,800	477.00	858,600	
パイブドピッツ	1,400	1,749.00	2,448,600	
朝日ネット	16,000	505.00	8,080,000	
コムチュア	2,600	1,908.00	4,960,800	
王子ホールディングス	663,000	402.00	266,526,000	
日本製紙	78,000	1,647.00	128,466,000	
三菱製紙	247,000	86.00	21,242,000	
北越紀州製紙	100,300	491.00	49,247,300	
中越パルプ工業	62,000	175.00	10,850,000	
巴川製紙所	25,000	187.00	4,675,000	
大王製紙	72,000	943.00	67,896,000	
レンゴー	143,000	461.00	65,923,000	
トーモク	51,000	275.00	14,025,000	
ザ・バック	11,500	2,154.00	24,771,000	
コープケミカル	25,000	109.00	2,725,000	
昭和電工	1,077,000	144.00	155,088,000	
住友化学	1,191,000	459.00	546,669,000	
日本化成	31,000	139.00	4,309,000	
住友精化	34,000	793.00	26,962,000	
日産化学工業	108,100	2,158.00	233,279,800	
ラサ工業	61,000	133.00	8,113,000	
クレハ	114,000	505.00	57,570,000	
多木化学	8,000	726.00	5,808,000	
テイカ	27,000	422.00	11,394,000	
石原産業	271,000	106.00	28,726,000	
片倉チッカリン	12,000	273.00	3,276,000	
日本曹達	104,000	647.00	67,288,000	
東ソー	404,000	591.00	238,764,000	

トクヤマ	252,000	245.00	61,740,000
セントラル硝子	165,000	450.00	74,250,000
東亜合成	203,000	457.00	92,771,000
ダイソー	65,000	387.00	25,155,000
関東電化工業	39,000	606.00	23,634,000
電気化学工業	335,000	444.00	148,740,000
イビデン	101,300	1,791.00	181,428,300
信越化学工業	290,100	7,709.00	2,236,380,900
日本カーバイド工業	55,000	225.00	12,375,000
堺化学工業	66,000	398.00	26,268,000
エア・ウォーター	143,000	1,879.00	268,697,000
大陽日酸	208,000	1,242.00	258,336,000
日本化学工業	60,000	332.00	19,920,000
日本パーカライズニング	38,200	2,707.00	103,407,400
高压ガス工業	25,000	570.00	14,250,000
チタン工業	19,000	235.00	4,465,000
四国化成工業	24,000	807.00	19,368,000
戸田工業	32,000	433.00	13,856,000
ステラ ケミファ	8,300	1,299.00	10,781,700
保土谷化学工業	49,000	188.00	9,212,000
日本触媒	127,000	1,592.00	202,184,000
大日精化工業	67,000	636.00	42,612,000
カネカ	218,000	648.00	141,264,000
協和発酵キリン	194,000	1,155.00	224,070,000
三菱瓦斯化学	278,000	581.00	161,518,000
三井化学	735,000	341.00	250,635,000
J S R	159,800	2,059.00	329,028,200
東京応化工業	33,500	3,820.00	127,970,000
大阪有機化学工業	11,900	490.00	5,831,000
三菱ケミカルホールディングス	1,011,400	589.20	595,916,880
日本合成化学工業	38,000	692.00	26,296,000
ダイセル	228,000	1,385.00	315,780,000
住友ベークライト	152,000	463.00	70,376,000
積水化学工業	383,000	1,430.00	547,690,000
日本ゼオン	139,000	1,098.00	152,622,000
アイカ工業	48,700	2,499.00	121,701,300
宇部興産	815,000	181.00	147,515,000
積水樹脂	25,100	1,522.00	38,202,200
タキロン	34,000	532.00	18,088,000
旭有機材工業	57,000	280.00	15,960,000
日立化成	79,900	2,140.00	170,986,000
ニチバン	16,000	422.00	6,752,000
リケンテクノス	26,200	433.00	11,344,600
大倉工業	39,000	338.00	13,182,000
積水化成成品工業	46,000	486.00	22,356,000
群栄化学工業	43,000	343.00	14,749,000
タイガースポリマー	8,000	739.00	5,912,000
ミライアル	5,900	1,576.00	9,298,400
ダイキョーニシカワ	3,900	3,375.00	13,162,500
日本化薬	105,000	1,547.00	162,435,000

カーリットホールディングス	13,100	635.00	8,318,500	
E P Sホールディングス	19,100	1,507.00	28,783,700	
パナソニック インフォメーションシステムズ	3,300	3,010.00	9,933,000	
プレステージ・インターナショナル	12,300	980.00	12,054,000	
フェイス	4,700	1,134.00	5,329,800	
アミューズ	4,900	3,380.00	16,562,000	
野村総合研究所	86,300	3,660.00	315,858,000	
ドリームインキュベータ	5,200	2,604.00	13,540,800	
サイバネットシステム	12,500	461.00	5,762,500	
クイック	5,500	895.00	4,922,500	
T A C	8,100	228.00	1,846,800	
ケネディクス	229,200	500.00	114,600,000	
電通	179,800	4,745.00	853,151,000	
インテージホールディングス	8,700	1,680.00	14,616,000	
テイクアンドグヴ・ニーズ	6,200	977.00	6,057,400	
東邦システムサイエンス	4,500	583.00	2,623,500	
ぴあ	4,800	2,033.00	9,758,400	
イオンファンタジー	5,300	1,495.00	7,923,500	
ソースネクスト	7,600	766.00	5,821,600	
ネクシィーズ	5,800	577.00	3,346,600	
メディカルシステムネットワーク	13,800	357.00	4,926,600	
ティー・ワイ・オー	15,300	180.00	2,754,000	
日本精化	13,600	843.00	11,464,800	
A D E K A	74,700	1,362.00	101,741,400	
日油	135,000	750.00	101,250,000	
ミヨシ油脂	61,000	132.00	8,052,000	
新日本理化	26,000	211.00	5,486,000	
ハリマ化成グループ	14,000	456.00	6,384,000	
花王	445,400	4,788.50	2,132,797,900	
第一工業製薬	30,000	368.00	11,040,000	
三洋化成工業	51,000	869.00	44,319,000	
武田薬品工業	606,000	5,158.00	3,125,748,000	
アステラス製薬	1,842,300	1,756.50	3,235,999,950	
大日本住友製薬	114,500	1,185.00	135,682,500	
塩野義製薬	252,600	3,360.00	848,736,000	
田辺三菱製薬	188,500	1,780.00	335,530,000	
わかもと製薬	7,000	268.00	1,876,000	
あすか製薬	19,100	1,230.00	23,493,000	
日本新薬	37,000	3,835.00	141,895,000	
ピオフェルミン製薬	2,700	2,948.00	7,959,600	
中外製薬	161,000	3,175.00	511,175,000	
科研製薬	56,000	2,352.00	131,712,000	
エーザイ	213,400	4,976.50	1,061,985,100	
ロート製薬	73,600	1,484.00	109,222,400	
小野薬品工業	73,500	11,710.00	860,685,000	
久光製薬	45,600	3,620.00	165,072,000	
有機合成薬品工業	11,000	274.00	3,014,000	
持田製薬	11,600	6,350.00	73,660,000	
参天製薬	59,400	6,650.00	395,010,000	

扶桑薬品工業	55,000	294.00	16,170,000
日本ケミファ	21,000	541.00	11,361,000
ツムラ	50,900	2,643.00	134,528,700
日医工	37,900	1,979.00	75,004,100
テルモ	236,700	2,747.00	650,214,900
みらかホールディングス	42,500	5,330.00	226,525,000
キッセイ薬品工業	30,000	3,230.00	96,900,000
生化学工業	30,900	1,995.00	61,645,500
栄研化学	13,600	1,890.00	25,704,000
日水製薬	6,700	1,256.00	8,415,200
鳥居薬品	11,100	2,901.00	32,201,100
J C R ファーマ	12,500	2,291.00	28,637,500
東和薬品	8,200	5,140.00	42,148,000
富士製薬工業	4,700	2,000.00	9,400,000
沢井製薬	25,600	6,890.00	176,384,000
ゼリア新薬工業	33,100	1,971.00	65,240,100
第一三共	544,000	1,611.50	876,656,000
キョーリン製薬ホールディングス	43,200	2,182.00	94,262,400
大幸薬品	7,100	2,023.00	14,363,300
ダイト	6,100	1,965.00	11,986,500
大塚ホールディングス	321,000	3,739.50	1,200,379,500
大正製薬ホールディングス	38,900	7,230.00	281,247,000
大日本塗料	93,000	154.00	14,322,000
日本ペイントホールディングス	140,000	3,525.00	493,500,000
関西ペイント	196,000	1,860.00	364,560,000
神東塗料	11,000	214.00	2,354,000
中国塗料	46,000	959.00	44,114,000
日本特殊塗料	12,600	760.00	9,576,000
藤倉化成	22,300	575.00	12,822,500
太陽ホールディングス	13,200	4,135.00	54,582,000
D I C	648,000	278.00	180,144,000
サカタインクス	33,100	1,335.00	44,188,500
東洋インキ S C ホールディングス	160,000	563.00	90,080,000
T & K T O K A	5,500	2,215.00	12,182,500
アルプス技研	6,500	1,518.00	9,867,000
サニックス	18,700	421.00	7,872,700
ダイオーズ	3,600	909.00	3,272,400
日本空調サービス	8,000	827.00	6,616,000
オリエンタルランド	43,600	28,795.00	1,255,462,000
ダスキン	45,700	1,731.00	79,106,700
パーク 2 4	76,600	1,840.00	140,944,000
明光ネットワークジャパン	16,100	1,222.00	19,674,200
ファルコホールディングス	7,800	1,260.00	9,828,000
クレスコ	3,500	1,631.00	5,708,500
フジ・メディア・ホールディングス	158,700	1,434.00	227,575,800
秀英予備校	3,500	309.00	1,081,500
田谷	3,200	798.00	2,553,600
ラウンドワン	45,700	706.00	32,264,200
リゾートトラスト	59,500	2,794.00	166,243,000
オービック	52,500	3,875.00	203,437,500

ジャストシステム	20,800	739.00	15,371,200	
TDCソフトウェアエンジニアリング	3,500	956.00	3,346,000	
ヤフー	1,092,300	410.00	447,843,000	
ビー・エム・エル	9,500	3,125.00	29,687,500	
ワタベウェディング	5,400	507.00	2,737,800	
トレンドマイクロ	80,700	3,180.00	256,626,000	
もしもしホットライン	30,000	1,179.00	35,370,000	
インフォメーション・ディベロプメント	3,000	932.00	2,796,000	
リソー教育	24,800	250.00	6,200,000	
日本オラクル	24,400	4,860.00	118,584,000	
早稲田アカデミー	2,900	794.00	2,302,600	
アルファシステムズ	5,000	1,623.00	8,115,000	
フューチャーアーキテクト	16,200	659.00	10,675,800	
CAC Holdings	10,400	1,089.00	11,325,600	
ソフトバンク・テクノロジー	4,100	1,202.00	4,928,200	
トーセ	3,900	738.00	2,878,200	
ユー・エス・エス	195,300	1,785.00	348,610,500	
オービックビジネスコンサルタント	9,700	3,255.00	31,573,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	17,300	4,230.00	73,179,000	
アイティフォー	18,500	464.00	8,584,000	
東京個別指導学院	7,900	356.00	2,812,400	
東計電算	2,800	1,694.00	4,743,200	
サイバーエージェント	29,600	4,520.00	133,792,000	
楽天	700,400	1,673.00	1,171,769,200	
エクスネット	1,600	1,432.00	2,291,200	
テー・オー・ダブリュー	5,400	803.00	4,336,200	
大塚商会	41,000	3,805.00	156,005,000	
総合メディカル	3,700	5,950.00	22,015,000	
サイボウズ	20,400	362.00	7,384,800	
ソフトブレーン	20,700	190.00	3,933,000	
セントラルスポーツ	5,600	1,974.00	11,054,400	
パラカ	5,700	886.00	5,050,200	
電通国際情報サービス	9,400	1,154.00	10,847,600	
イーエムシステムズ	1,800	1,708.00	3,074,400	
ウェザーニューズ	4,600	2,873.00	13,215,800	
C I J	13,200	478.00	6,309,600	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,600	1,348.00	2,156,800	
日本エンタープライズ	9,700	393.00	3,812,100	
WOWOW	3,600	4,990.00	17,964,000	
フルキャストホールディングス	16,600	463.00	7,685,800	
富士フイルムホールディングス	370,200	3,734.00	1,382,326,800	
コニカミノルタ	368,000	1,256.00	462,208,000	
資生堂	287,700	1,695.00	487,651,500	
ライオン	187,000	615.00	115,005,000	
高砂香料工業	53,000	545.00	28,885,000	
マンダム	16,200	3,850.00	62,370,000	
ミルボン	9,600	3,085.00	29,616,000	
ファンケル	37,500	1,738.00	65,175,000	

コーセー	26,100	4,750.00	123,975,000
コタ	4,700	1,527.00	7,176,900
ドクターシーラボ	11,000	4,070.00	44,770,000
シーボン	1,600	2,517.00	4,027,200
ポーラ・オルビスホールディングス	19,200	5,120.00	98,304,000
ノエビアホールディングス	10,800	2,076.00	22,420,800
アジュバンコスメジャパン	3,100	920.00	2,852,000
エステー	11,300	1,005.00	11,356,500
アグロ カネショウ	4,400	1,096.00	4,822,400
コニシ	12,700	1,941.00	24,650,700
長谷川香料	20,600	1,626.00	33,495,600
星光P M C	8,900	925.00	8,232,500
小林製薬	26,500	7,010.00	185,765,000
荒川化学工業	13,700	1,210.00	16,577,000
メック	12,600	893.00	11,251,800
日本高純度化学	4,700	2,374.00	11,157,800
J C U	4,400	5,540.00	24,376,000
新田ゼラチン	9,900	748.00	7,405,200
アース製薬	11,600	3,920.00	45,472,000
イハラケミカル工業	24,900	1,245.00	31,000,500
北興化学工業	18,000	444.00	7,992,000
大成ラミック	4,600	2,705.00	12,443,000
クミアイ化学工業	34,000	898.00	30,532,000
日本農薬	37,000	1,416.00	52,392,000
昭和シェル石油	144,500	1,163.00	168,053,500
コスモ石油	447,000	160.00	71,520,000
富士興産	6,200	601.00	3,726,200
ニチレキ	20,000	872.00	17,440,000
東燃ゼネラル石油	244,000	996.00	243,024,000
ユシロ化学工業	9,500	1,764.00	16,758,000
ピーピー・カストロール	6,600	1,066.00	7,035,600
富士石油	37,500	337.00	12,637,500
M O R E S C O	4,200	1,964.00	8,248,800
出光興産	76,700	1,938.00	148,644,600
J Xホールディングス	1,794,900	437.80	785,807,220
横浜ゴム	181,000	1,099.00	198,919,000
東洋ゴム工業	73,200	2,496.00	182,707,200
ブリヂストン	506,900	4,276.50	2,167,757,850
住友ゴム工業	126,100	1,777.00	224,079,700
藤倉ゴム工業	13,500	790.00	10,665,000
オカモト	55,000	422.00	23,210,000
アキレス	138,000	148.00	20,424,000
フコク	6,800	1,269.00	8,629,200
ニッタ	16,000	2,692.00	43,072,000
クリエートメディック	5,300	1,012.00	5,363,600
住友理工	29,900	890.00	26,611,000
三ツ星ベルト	41,000	888.00	36,408,000
バンドー化学	59,000	425.00	25,075,000
鬼怒川ゴム工業	36,000	496.00	17,856,000
旭硝子	797,000	592.00	471,824,000

日本板硝子	780,000	110.00	85,800,000
石塚硝子	21,000	237.00	4,977,000
有沢製作所	27,100	848.00	22,980,800
日本山村硝子	65,000	173.00	11,245,000
日本電気硝子	310,000	518.00	160,580,000
オハラ	6,400	561.00	3,590,400
住友大阪セメント	300,000	338.00	101,400,000
太平洋セメント	1,009,000	365.00	368,285,000
デイ・シイ	16,600	468.00	7,768,800
リゾートソリューション	17,000	240.00	4,080,000
日本ヒューム	16,900	891.00	15,057,900
日本コンクリート工業	27,700	555.00	15,373,500
三谷セキサン	8,100	1,943.00	15,738,300
ジャパンパイル	21,600	731.00	15,789,600
東海カーボン	140,000	335.00	46,900,000
日本カーボン	85,000	229.00	19,465,000
東洋炭素	9,000	1,901.00	17,109,000
ノリタケカンパニーリミテド	91,000	269.00	24,479,000
TOTO	238,000	1,265.00	301,070,000
日本碍子	204,000	2,297.00	468,588,000
日本特殊陶業	139,400	3,510.00	489,294,000
ダントーホールディングス	22,000	162.00	3,564,000
MARUWA	4,700	3,240.00	15,228,000
品川リフラクトリーズ	41,000	253.00	10,373,000
黒崎播磨	35,000	238.00	8,330,000
ヨータイ	9,000	377.00	3,393,000
イソライト工業	7,400	208.00	1,539,200
東京窯業	20,000	215.00	4,300,000
ニッカトー	6,200	399.00	2,473,800
フジインコーポレーテッド	16,200	1,756.00	28,447,200
エーアンドエーマテリアル	34,000	110.00	3,740,000
ニチアス	72,000	664.00	47,808,000
新日鐵住金	6,835,000	291.10	1,989,668,500
神戸製鋼所	2,795,000	197.00	550,615,000
中山製鋼所	121,000	80.00	9,680,000
合同製鐵	82,000	179.00	14,678,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	412,500	2,573.50	1,061,568,750
日新製鋼	68,500	1,089.00	74,596,500
東京製鐵	81,800	773.00	63,231,400
共英製鋼	17,200	2,085.00	35,862,000
大和工業	36,800	3,315.00	121,992,000
東京鐵鋼	31,000	549.00	17,019,000
大阪製鐵	10,200	2,022.00	20,624,400
淀川製鋼所	115,000	447.00	51,405,000
東洋鋼板	39,000	615.00	23,985,000
丸一鋼管	49,600	2,591.00	128,513,600
モリ工業	26,000	411.00	10,686,000
大同特殊鋼	271,000	443.00	120,053,000
日本高周波鋼業	63,000	106.00	6,678,000

日本冶金工業	126,100	245.00	30,894,500
山陽特殊製鋼	96,000	378.00	36,288,000
愛知製鋼	95,000	451.00	42,845,000
日立金属	165,000	1,899.00	313,335,000
日本金属	42,000	143.00	6,006,000
大太平洋金属	103,000	348.00	35,844,000
新日本電工	98,500	285.00	28,072,500
栗本鐵工所	84,000	226.00	18,984,000
虹 技	23,000	206.00	4,738,000
日本鑄鉄管	16,000	230.00	3,680,000
日本製鋼所	231,000	414.00	95,634,000
三菱製鋼	105,000	242.00	25,410,000
日亜鋼業	22,000	321.00	7,062,000
日本精線	12,000	683.00	8,196,000
大紀アルミニウム工業所	27,000	312.00	8,424,000
日本軽金属ホールディングス	392,200	165.00	64,713,000
三井金属鉱業	440,000	275.00	121,000,000
東邦亜鉛	91,000	366.00	33,306,000
三菱マテリアル	1,009,000	380.00	383,420,000
住友金属鉱山	446,000	1,768.50	788,751,000
D O W Aホールディングス	193,000	902.00	174,086,000
古河機械金属	252,000	197.00	49,644,000
エス・サイエンス	78,300	46.00	3,601,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,900	2,275.00	36,172,500
東邦チタニウム	27,300	791.00	21,594,300
U A C J	185,000	313.00	57,905,000
古河電気工業	474,000	192.00	91,008,000
住友電気工業	609,200	1,496.50	911,667,800
フジクラ	225,000	486.00	109,350,000
昭和電線ホールディングス	178,000	101.00	17,978,000
東京特殊電線	2,300	1,369.00	3,148,700
タツタ電線	30,300	501.00	15,180,300
沖電線	17,000	324.00	5,508,000
カナレ電気	2,600	1,858.00	4,830,800
平河ヒューテック	3,800	1,136.00	4,316,800
リョービ	91,000	312.00	28,392,000
アーレスティ	14,100	687.00	9,686,700
アサヒホールディングス	24,400	1,826.00	44,554,400
東洋製罐グループホールディングス	114,800	1,359.00	156,013,200
ホッカンホールディングス	39,000	283.00	11,037,000
コロナ	8,500	1,162.00	9,877,000
横河ブリッジホールディングス	30,600	1,269.00	38,831,400
O S J Bホールディングス	23,500	279.00	6,556,500
駒井ハルテック	29,000	285.00	8,265,000
高田機工	14,000	270.00	3,780,000
三和ホールディングス	155,900	814.00	126,902,600
文化シャッター	45,000	921.00	41,445,000
三協立山	19,700	2,004.00	39,478,800
東洋シャッター	4,100	768.00	3,148,800
L I X I Lグループ	240,200	2,412.00	579,362,400

日本ファイルコン	11,900	463.00	5,509,700
ノーリツ	31,700	1,868.00	59,215,600
長府製作所	17,300	2,823.00	48,837,900
リンナイ	30,100	7,510.00	226,051,000
ユニプレス	29,700	1,927.00	57,231,900
ダイニチ工業	8,300	800.00	6,640,000
日東精工	23,000	365.00	8,395,000
三洋工業	21,000	207.00	4,347,000
岡部	31,900	1,088.00	34,707,200
中国工業	2,700	801.00	2,162,700
東プレ	31,100	1,613.00	50,164,300
高周波熱錬	27,900	780.00	21,762,000
東京製綱	109,000	226.00	24,634,000
モリテックスチール	8,500	320.00	2,720,000
パイオラックス	8,200	5,130.00	42,066,000
日本発条	140,400	1,018.00	142,927,200
中央発條	21,000	325.00	6,825,000
アドバネクス	30,000	188.00	5,640,000
三浦工業	72,100	1,200.00	86,520,000
タクマ	55,000	790.00	43,450,000
リブセンス	9,400	724.00	6,805,600
ジャパンマテリアル	6,500	1,745.00	11,342,500
ウチヤマホールディングス	7,100	597.00	4,238,700
サクセスホールディングス	1,300	1,295.00	1,683,500
アサンテ	4,000	1,258.00	5,032,000
E R Iホールディングス	3,900	1,010.00	3,939,000
リクルートホールディングス	183,000	3,620.00	662,460,000
ツガミ	47,000	619.00	29,093,000
オークマ	105,000	945.00	99,225,000
東芝機械	88,000	464.00	40,832,000
アマダ	240,900	1,012.00	243,790,800
アイダエンジニアリング	35,300	1,104.00	38,971,200
滝澤鉄工所	50,000	205.00	10,250,000
富士機械製造	52,800	1,073.00	56,654,400
牧野フライス製作所	80,000	975.00	78,000,000
オーエスジー	73,600	2,016.00	148,377,600
ダイジェット工業	19,000	226.00	4,294,000
旭ダイヤモンド工業	44,300	1,195.00	52,938,500
D M G 森精機	102,000	1,408.00	143,616,000
ディスコ	18,000	10,530.00	189,540,000
日東工器	9,400	2,219.00	20,858,600
パンチ工業	3,600	1,370.00	4,932,000
豊田自動織機	140,600	6,040.00	849,224,000
豊和工業	9,100	731.00	6,652,100
大阪機工	62,000	161.00	9,982,000
石川製作所	40,000	102.00	4,080,000
東洋機械金属	11,000	442.00	4,862,000
津田駒工業	39,000	155.00	6,045,000
エンシュウ	40,000	113.00	4,520,000
島精機製作所	22,800	2,159.00	49,225,200

日阪製作所	20,400	944.00	19,257,600	
やまびこ	6,300	5,130.00	32,319,000	
ペガサスミシン製造	14,100	583.00	8,220,300	
ナブテスコ	98,400	2,893.00	284,671,200	
三井海洋開発	16,200	1,949.00	31,573,800	
レオン自動機	12,000	503.00	6,036,000	
S M C	49,500	30,790.00	1,524,105,000	
新川	13,500	651.00	8,788,500	
ホソカワミクロン	27,000	721.00	19,467,000	
ユニオンツール	8,000	2,638.00	21,104,000	
オイレス工業	20,200	2,065.00	41,713,000	
日精エー・エス・ビー機械	5,100	2,770.00	14,127,000	
サトーホールディングス	20,100	2,584.00	51,938,400	
日本エアージェット	4,700	701.00	3,294,700	
日精樹脂工業	11,700	1,196.00	13,993,200	
ワイエイシイ	6,600	630.00	4,158,000	
小松製作所	801,500	2,515.00	2,015,772,500	
住友重機械工業	442,000	644.00	284,648,000	
日立建機	72,200	2,397.00	173,063,400	
日工	22,000	404.00	8,888,000	
巴工業	6,100	1,689.00	10,302,900	
井関農機	165,000	221.00	36,465,000	
T O W A	13,200	649.00	8,566,800	
丸山製作所	36,000	229.00	8,244,000	
北川鉄工所	74,000	219.00	16,206,000	
シンニッタン	16,700	525.00	8,767,500	
クボタ	779,000	1,665.00	1,297,035,000	
荏原実業	4,900	1,413.00	6,923,700	
東洋エンジニアリング	83,000	427.00	35,441,000	
三菱化工機	53,000	455.00	24,115,000	
月島機械	28,500	1,193.00	34,000,500	
帝国電機製作所	10,800	1,191.00	12,862,800	
東京機械製作所	61,000	73.00	4,453,000	
新東工業	38,000	804.00	30,552,000	
澁谷工業	13,500	2,293.00	30,955,500	
アイチコーポレーション	23,000	549.00	12,627,000	
小森コーポレーション	39,300	1,396.00	54,862,800	
鶴見製作所	12,000	1,835.00	22,020,000	
住友精密工業	26,000	475.00	12,350,000	
酒井重工業	31,000	307.00	9,517,000	
荏原製作所	335,000	459.00	153,765,000	
石井鐵工所	24,000	228.00	5,472,000	
西島製作所	15,800	879.00	13,888,200	
北越工業	11,900	1,020.00	12,138,000	
千代田化工建設	125,000	943.00	117,875,000	
ダイキン工業	224,900	7,839.00	1,762,991,100	
オルガノ	31,000	477.00	14,787,000	
トーヨーカネツ	93,000	243.00	22,599,000	
栗田工業	91,400	2,387.00	218,171,800	
椿本チエイン	83,000	955.00	79,265,000	

大同工業	32,000	256.00	8,192,000
日本コンベヤ	50,000	245.00	12,250,000
日機装	50,000	1,096.00	54,800,000
木村化工機	14,900	503.00	7,494,700
新興プランテック	35,600	819.00	29,156,400
アネスト岩田	24,200	797.00	19,287,400
ダイフク	76,300	1,279.00	97,587,700
サムコ	2,100	1,115.00	2,341,500
加藤製作所	34,000	936.00	31,824,000
油研工業	31,000	248.00	7,688,000
タダノ	75,000	1,406.00	105,450,000
フジテック	45,000	1,195.00	53,775,000
C K D	43,300	1,089.00	47,153,700
キトー	16,900	1,124.00	18,995,600
平和	33,500	2,312.00	77,452,000
理想科学工業	18,800	1,865.00	35,062,000
S A N K Y O	46,800	4,075.00	190,710,000
日本金銭機械	14,200	1,742.00	24,736,400
マースエンジニアリング	8,800	2,058.00	18,110,400
福島工業	8,500	1,774.00	15,079,000
オーイズミ	5,400	858.00	4,633,200
ダイコク電機	6,400	1,802.00	11,532,800
アマノ	51,500	1,217.00	62,675,500
J U K I	115,000	417.00	47,955,000
サンデン	94,000	587.00	55,178,000
蛇の目ミシン工業	150,000	128.00	19,200,000
ブラザー工業	199,600	2,131.00	425,347,600
マックス	24,000	1,225.00	29,400,000
モリタホールディングス	27,000	1,159.00	31,293,000
グローリー	49,400	3,205.00	158,327,000
新晃工業	10,800	1,228.00	13,262,400
大和冷機工業	22,400	748.00	16,755,200
セガサミーホールディングス	165,900	1,509.00	250,343,100
日本ピストンリング	60,000	245.00	14,700,000
リケン	67,000	454.00	30,418,000
T P R	17,200	2,962.00	50,946,400
ホシザキ電機	33,800	5,750.00	194,350,000
大豊工業	12,500	1,343.00	16,787,500
日本精工	317,000	1,367.00	433,339,000
N T N	357,000	514.00	183,498,000
ジェイテクト	164,600	1,939.00	319,159,400
不二越	143,000	708.00	101,244,000
ミネベア	230,000	1,807.00	415,610,000
日本トムソン	53,000	571.00	30,263,000
T H K	102,700	2,847.00	292,386,900
ユーシン精機	6,800	2,216.00	15,068,800
前澤給装工業	6,100	1,409.00	8,594,900
イーグル工業	21,500	2,125.00	45,687,500
前澤工業	11,500	323.00	3,714,500
日本ピラー工業	16,800	887.00	14,901,600

キッツ	69,200	489.00	33,838,800
日立製作所	3,708,000	884.70	3,280,467,600
東芝	3,251,000	477.20	1,551,377,200
三菱電機	1,544,000	1,385.50	2,139,212,000
富士電機	430,000	470.00	202,100,000
東洋電機製造	33,000	410.00	13,530,000
安川電機	181,500	1,476.00	267,894,000
シンフォニア テクノロジー	107,000	181.00	19,367,000
明電舎	142,000	360.00	51,120,000
オリジン電気	22,000	491.00	10,802,000
山洋電気	34,000	793.00	26,962,000
デンヨー	14,000	1,741.00	24,374,000
日立工機	41,300	885.00	36,550,500
三櫻工業	19,900	741.00	14,745,900
マキタ	100,700	5,210.00	524,647,000
東芝テック	111,000	805.00	89,355,000
芝浦メカトロニクス	25,000	336.00	8,400,000
マブチモーター	47,200	4,550.00	214,760,000
日本電産	167,000	7,913.00	1,321,471,000
東光高岳	7,800	1,716.00	13,384,800
宮越ホールディングス	5,200	487.00	2,532,400
ダイヘン	84,000	575.00	48,300,000
ヤーマン	2,100	1,519.00	3,189,900
JVCケンウッド	113,300	304.00	34,443,200
第一精工	5,600	2,285.00	12,796,000
日新電機	36,000	616.00	22,176,000
大崎電気工業	24,000	808.00	19,392,000
オムロン	174,200	5,050.00	879,710,000
日東工業	24,700	2,269.00	56,044,300
I D E C	18,400	1,013.00	18,639,200
不二電機工業	1,500	1,573.00	2,359,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	298,000	497.00	148,106,000
サクサホールディングス	39,000	246.00	9,594,000
メルコホールディングス	8,500	1,677.00	14,254,500
テクノメディカ	3,500	2,412.00	8,442,000
日本電気	1,998,000	347.00	693,306,000
富士通	1,489,000	589.40	877,616,600
沖電気工業	534,000	235.00	125,490,000
岩崎通信機	68,000	105.00	7,140,000
電気興業	44,000	538.00	23,672,000
サンケン電気	78,000	919.00	71,682,000
ナカヨ	15,000	380.00	5,700,000
アイホン	9,000	1,904.00	17,136,000
ルネサスエレクトロニクス	79,900	771.00	61,602,900
セイコーエプソン	105,400	4,985.00	525,419,000
ワコム	121,500	467.00	56,740,500
アルバック	28,400	1,787.00	50,750,800
アクセル	7,200	1,492.00	10,742,400
ピクセラ	7,100	97.00	688,700

E I Z O	14,200	2,246.00	31,893,200
ジャパンディスプレイ	237,800	373.00	88,699,400
日本信号	42,600	1,242.00	52,909,200
京三製作所	36,000	372.00	13,392,000
能美防災	20,400	1,532.00	31,252,800
ホーチキ	11,000	903.00	9,933,000
エレコム	4,800	2,557.00	12,273,600
日本無線	33,000	369.00	12,177,000
パナソニック	1,882,100	1,370.00	2,578,477,000
シャープ	1,305,000	259.00	337,995,000
アンリツ	96,500	806.00	77,779,000
富士通ゼネラル	47,000	1,130.00	53,110,000
日立国際電気	40,000	1,647.00	65,880,000
ソニー	992,400	2,520.00	2,500,848,000
T D K	93,200	7,260.00	676,632,000
帝国通信工業	37,000	238.00	8,806,000
ミツミ電機	54,500	929.00	50,630,500
タムラ製作所	60,000	419.00	25,140,000
アルプス電気	121,900	2,392.00	291,584,800
池上通信機	53,000	188.00	9,964,000
パイオニア	232,000	229.00	53,128,000
日本電波工業	14,000	982.00	13,748,000
鈴木	1,900	819.00	1,556,100
日本トリム	3,700	2,642.00	9,775,400
ローランド ディー . ジー .	6,200	3,535.00	21,917,000
日本コロムビア	5,300	400.00	2,120,000
フォスター電機	15,800	1,907.00	30,130,600
クラリオン	81,000	365.00	29,565,000
S M K	45,000	451.00	20,295,000
ヨコオ	12,100	633.00	7,659,300
東光	36,000	340.00	12,240,000
ティアック	83,000	58.00	4,814,000
ホシデン	48,800	660.00	32,208,000
ヒロセ電機	24,900	13,590.00	338,391,000
日本航空電子工業	44,000	2,789.00	122,716,000
T O A	16,600	1,151.00	19,106,600
日立マクセル	23,000	1,772.00	40,756,000
古野電気	18,400	927.00	17,056,800
ユニデン	42,000	224.00	9,408,000
アルパイン	36,800	1,894.00	69,699,200
スミダコーポレーション	13,800	822.00	11,343,600
アイコム	8,600	2,788.00	23,976,800
リオン	4,400	1,380.00	6,072,000
船井電機	15,600	1,531.00	23,883,600
横河電機	154,600	1,265.00	195,569,000
新電元工業	59,000	641.00	37,819,000
アズビル	50,400	2,779.00	140,061,600
東亜ディーケーケー	6,500	585.00	3,802,500
日本光電工業	32,900	5,820.00	191,478,000
チノー	5,500	1,177.00	6,473,500

共和電業	18,900	461.00	8,712,900
日本電子材料	6,600	642.00	4,237,200
堀場製作所	28,500	3,835.00	109,297,500
アドバンテスト	105,300	1,381.00	145,419,300
小野測器	7,800	973.00	7,589,400
エスペック	17,100	1,056.00	18,057,600
パナソニック デバイスSUNX	13,500	751.00	10,138,500
キーエンス	35,000	53,450.00	1,870,750,000
日置電機	8,100	1,683.00	13,632,300
シスメックス	119,500	5,200.00	621,400,000
メガチップス	16,200	1,380.00	22,356,000
O B A R A G R O U P	10,000	5,170.00	51,700,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	8,000	496.00	3,968,000
澤藤電機	10,000	236.00	2,360,000
デンソー	381,600	5,402.00	2,061,403,200
コーセル	22,500	1,194.00	26,865,000
新日本無線	11,000	500.00	5,500,000
オブテックス	10,600	1,914.00	20,288,400
千代田インテグレ	6,800	1,970.00	13,396,000
レーザーテック	15,800	1,405.00	22,199,000
スタンレー電気	111,200	2,550.00	283,560,000
岩崎電気	53,000	237.00	12,561,000
ウシオ電機	93,700	1,252.00	117,312,400
岡谷電機産業	8,700	406.00	3,532,200
ヘリオス テクノ ホールディング	14,200	446.00	6,333,200
日本セラミック	8,900	1,710.00	15,219,000
遠藤照明	7,100	1,301.00	9,237,100
日本デジタル研究所	13,100	1,626.00	21,300,600
古河電池	11,000	985.00	10,835,000
双信電機	7,700	409.00	3,149,300
山一電機	17,900	821.00	14,695,900
図研	11,200	1,166.00	13,059,200
日本電子	66,000	604.00	39,864,000
カシオ計算機	154,800	1,808.00	279,878,400
ファナック	160,800	19,225.00	3,091,380,000
日本シイエムケイ	39,400	341.00	13,435,400
エンプラス	7,000	4,280.00	29,960,000
大真空	28,000	381.00	10,668,000
ローム	76,100	7,380.00	561,618,000
浜松ホトニクス	64,300	5,670.00	364,581,000
三井ハイテック	20,400	818.00	16,687,200
新光電気工業	58,300	790.00	46,057,000
京セラ	253,500	5,305.00	1,344,817,500
協栄産業	19,000	220.00	4,180,000
太陽誘電	80,900	1,445.00	116,900,500
村田製作所	162,000	13,365.00	2,165,130,000
ユーシン	21,600	688.00	14,860,800
双葉電子工業	26,400	1,720.00	45,408,000
日東電工	125,000	6,827.00	853,375,000

北陸電気工業	67,000	176.00	11,792,000	
東海理化電機製作所	40,700	2,543.00	103,500,100	
ニチコン	48,600	903.00	43,885,800	
日本ケミコン	125,000	336.00	42,000,000	
K O A	21,300	1,130.00	24,069,000	
三井造船	598,000	204.00	121,992,000	
日立造船	120,700	651.00	78,575,700	
三菱重工業	2,588,000	669.00	1,731,372,000	
川崎重工業	1,122,000	550.00	617,100,000	
I H I	1,113,000	614.00	683,382,000	
名村造船所	43,000	1,295.00	55,685,000	
サノヤスホールディングス	18,800	346.00	6,504,800	
日本車輛製造	56,000	352.00	19,712,000	
ニチユ三菱フォークリフト	17,800	735.00	13,083,000	
近畿車輛	23,000	321.00	7,383,000	
F P G	13,100	1,478.00	19,361,800	
島根銀行	3,500	1,385.00	4,847,500	
じもとホールディングス	109,400	221.00	24,177,400	
全国保証	39,600	3,410.00	135,036,000	
足利ホールディングス	95,800	472.00	45,217,600	
東京T Yフィナンシャルグループ	19,600	3,310.00	64,876,000	
日産自動車	2,167,900	1,005.00	2,178,739,500	
いすゞ自動車	488,300	1,486.50	725,857,950	
トヨタ自動車	2,130,800	7,519.00	16,021,485,200	*
日野自動車	220,500	1,642.00	362,061,000	
三菱自動車工業	566,100	1,064.00	602,330,400	
エフテック	8,900	1,168.00	10,395,200	
レシップホールディングス	5,100	837.00	4,268,700	
G M B	2,400	1,327.00	3,184,800	
武蔵精密工業	16,500	2,217.00	36,580,500	
日産車体	67,900	1,349.00	91,597,100	
新明和工業	62,000	1,094.00	67,828,000	
極東開発工業	28,700	1,378.00	39,548,600	
日信工業	28,300	1,669.00	47,232,700	
トピー工業	127,000	239.00	30,353,000	
ティラド	60,000	241.00	14,460,000	
曙ブレーキ工業	65,500	407.00	26,658,500	
タチエス	24,500	1,614.00	39,543,000	
N O K	74,700	3,270.00	244,269,000	
フタバ産業	47,200	565.00	26,668,000	
カヤバ工業	173,000	492.00	85,116,000	
シロキ工業	35,000	310.00	10,850,000	
市光工業	37,000	266.00	9,842,000	
大同メタル工業	22,000	1,164.00	25,608,000	
プレス工業	77,000	404.00	31,108,000	
カルソニックカンセイ	118,000	626.00	73,868,000	
太平洋工業	31,600	894.00	28,250,400	
ケーヒン	35,500	1,793.00	63,651,500	
河西工業	19,000	1,061.00	20,159,000	
アイシン精機	141,300	4,115.00	581,449,500	

富士機工	18,000	543.00	9,774,000
マツダ	460,300	2,608.00	1,200,462,400
ダイハツ工業	184,400	1,517.00	279,734,800
今仙電機製作所	13,100	1,576.00	20,645,600
本田技研工業	1,389,800	3,530.50	4,906,688,900
スズキ	322,900	3,611.50	1,166,153,350
富士重工業	525,600	4,249.00	2,233,274,400
安永	5,300	584.00	3,095,200
ヤマハ発動機	234,900	2,410.00	566,109,000
ショーワ	36,500	1,087.00	39,675,500
小糸製作所	92,500	3,565.00	329,762,500
T B K	19,900	639.00	12,716,100
エクセディ	21,000	2,848.00	59,808,000
ミツバ	28,400	1,995.00	56,658,000
豊田合成	49,900	2,443.00	121,905,700
愛三工業	24,000	1,120.00	26,880,000
盟和産業	13,000	148.00	1,924,000
ヨロズ	14,400	2,054.00	29,577,600
エフ・シー・シー	22,800	2,063.00	47,036,400
新家工業	32,000	176.00	5,632,000
シマノ	66,700	15,230.00	1,015,841,000
タカタ	27,900	1,643.00	45,839,700
テイ・エス テック	32,600	2,671.00	87,074,600
小野建	13,200	970.00	12,804,000
はるやま商事	6,400	702.00	4,492,800
佐鳥電機	12,200	756.00	9,223,200
カップ・クリエイトホールディングス	24,700	1,135.00	28,034,500
エコートレーディング	4,000	658.00	2,632,000
伯東	10,500	1,197.00	12,568,500
コンドーテック	11,300	808.00	9,130,400
中山福	8,900	857.00	7,627,300
ライトオン	11,400	774.00	8,823,600
ナガイレーベン	22,000	1,827.00	40,194,000
ジーンズメイト	5,000	258.00	1,290,000
三菱食品	16,800	2,521.00	42,352,800
良品計画	18,800	12,890.00	242,332,000
三城ホールディングス	19,100	465.00	8,881,500
松田産業	11,400	1,278.00	14,569,200
メディカルホールディングス	152,400	1,337.00	203,758,800
アドヴァン	8,000	1,241.00	9,928,000
S P K	3,400	2,018.00	6,861,200
萩原電気	4,200	1,986.00	8,341,200
アズワン	10,900	3,145.00	34,280,500
スズデン	5,200	688.00	3,577,600
尾家産業	5,600	842.00	4,715,200
シモジマ	9,400	1,008.00	9,475,200
ドウシシャ	19,900	1,694.00	33,710,600
小津産業	3,100	1,830.00	5,673,000
コナカ	17,900	623.00	11,151,700

高速	9,200	890.00	8,188,000
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,401.00	2,661,900
G - 7ホールディングス	3,300	1,009.00	3,329,700
イオン北海道	9,700	715.00	6,935,500
コジマ	22,600	292.00	6,599,200
ヒマラヤ	3,600	995.00	3,582,000
コーナン商事	23,300	1,323.00	30,825,900
黒田電気	25,700	1,585.00	40,734,500
ネットワンシステムズ	61,900	710.00	43,949,000
エコス	5,400	991.00	5,351,400
ワタミ	18,000	1,142.00	20,556,000
マルシェ	4,100	877.00	3,595,700
ドンキホーテホールディングス	52,700	8,360.00	440,572,000
丸文	13,500	802.00	10,827,000
西松屋チェーン	30,000	936.00	28,080,000
ゼンショーホールディングス	78,400	998.00	78,243,200
ハビネット	9,200	1,397.00	12,852,400
幸楽苑	9,600	1,685.00	16,176,000
ハークスレイ	4,400	958.00	4,215,200
橋本総業	2,800	1,700.00	4,760,000
サイゼリヤ	22,500	1,663.00	37,417,500
エクセル	7,000	1,494.00	10,458,000
マルカキカイ	5,000	1,358.00	6,790,000
アルゴグラフィックス	6,300	1,780.00	11,214,000
ガリバーインターナショナル	46,200	857.00	39,593,400
日本エム・ディ・エム	12,700	602.00	7,645,400
ポブラ	4,200	555.00	2,331,000
ユナイテッドアローズ	19,900	3,135.00	62,386,500
進和	9,000	1,285.00	11,565,000
エスケイジャパン	3,900	236.00	920,400
ダイトエレクトロン	7,000	594.00	4,158,000
ハイデイ日高	9,600	3,795.00	36,432,000
シークス	9,700	2,471.00	23,968,700
京都きもの友禅	9,800	1,012.00	9,917,600
コロナイド	50,600	1,798.00	90,978,800
田中商事	5,000	667.00	3,335,000
オーハシテクニカ	9,400	1,484.00	13,949,600
壱番屋	6,100	5,070.00	30,927,000
マクニカ	7,800	3,320.00	25,896,000
白銅	5,000	1,142.00	5,710,000
トップカルチャー	6,200	495.00	3,069,000
P L A N T	3,900	1,297.00	5,058,300
スギホールディングス	27,300	4,930.00	134,589,000
島津製作所	185,000	1,259.00	232,915,000
J M S	29,000	286.00	8,294,000
クボテック	3,300	275.00	907,500
ショットモリテックス	3,600	255.00	918,000
長野計器	9,900	685.00	6,781,500
ブイ・テクノロジー	3,000	2,318.00	6,954,000
スター精密	29,300	1,478.00	43,305,400

東京計器	53,000	284.00	15,052,000
愛知時計電機	21,000	322.00	6,762,000
オーバル	11,300	335.00	3,785,500
東京精密	27,700	2,365.00	65,510,500
マニー	4,300	6,600.00	28,380,000
ニコン	288,300	1,491.00	429,855,300
トプコン	46,600	2,577.00	120,088,200
オリンパス	230,000	4,175.00	960,250,000
理研計器	13,700	1,243.00	17,029,100
S C R E E Nホールディングス	146,000	674.00	98,404,000
キヤノン電子	14,200	1,867.00	26,511,400
タムロン	11,900	2,342.00	27,869,800
H O Y A	367,500	4,069.50	1,495,541,250
ノーリツ鋼機	14,000	642.00	8,988,000
エー・アンド・デイ	14,000	496.00	6,944,000
キヤノン	895,400	3,752.50	3,359,988,500
リコー	464,400	1,175.00	545,670,000
シチズンホールディングス	190,100	890.00	169,189,000
リズム時計工業	68,000	159.00	10,812,000
大研医器	10,700	1,147.00	12,272,900
パラマウントベッドホールディングス	16,300	3,170.00	51,671,000
S H O B I	5,700	402.00	2,291,400
前田工織	15,300	1,187.00	18,161,100
永大産業	22,000	446.00	9,812,000
アートネイチャー	11,200	1,220.00	13,664,000
ダンロップスポーツ	9,800	1,296.00	12,700,800
バンダイナムコホールディングス	170,300	2,450.00	417,235,000
共立印刷	28,400	290.00	8,236,000
フランスベッドホールディングス	108,000	179.00	19,332,000
マーベラス	25,700	1,494.00	38,395,800
パイロットコーポレーション	13,500	6,730.00	90,855,000
萩原工業	3,300	1,775.00	5,857,500
エイベックス・グループ・ホールディングス	30,200	1,954.00	59,010,800
トッパン・フォームズ	27,600	1,188.00	32,788,800
フジシールインターナショナル	18,700	3,285.00	61,429,500
タカラトミー	55,500	671.00	37,240,500
廣済堂	14,500	451.00	6,539,500
アーク	48,700	135.00	6,574,500
レック	5,500	1,260.00	6,930,000
タカノ	6,900	591.00	4,077,900
プロネクサス	15,800	739.00	11,676,200
ホクシン	13,100	126.00	1,650,600
ウッドワン	27,000	275.00	7,425,000
大建工業	63,000	254.00	16,002,000
きもと	28,900	303.00	8,756,700
凸版印刷	436,000	758.00	330,488,000
大日本印刷	470,000	1,035.50	486,685,000
図書印刷	25,000	326.00	8,150,000

共同印刷	48,000	377.00	18,096,000
日本写真印刷	25,900	1,819.00	47,112,100
光村印刷	3,000	261.00	783,000
藤森工業	13,900	3,225.00	44,827,500
宝印刷	8,900	826.00	7,351,400
前澤化成工業	11,500	1,203.00	13,834,500
アシックス	153,400	2,805.00	430,287,000
ツツミ	7,700	2,353.00	18,118,100
J S P	12,100	2,090.00	25,289,000
ニチハ	21,500	1,177.00	25,305,500
エフピコ	14,300	3,805.00	54,411,500
小松ウオール工業	4,700	2,664.00	12,520,800
ヤマハ	113,500	1,724.00	195,674,000
河合楽器製作所	5,400	2,389.00	12,900,600
クリナップ	15,900	874.00	13,896,600
ピジョン	29,200	7,370.00	215,204,000
天馬	12,900	1,528.00	19,711,200
兼松日産農林	24,000	150.00	3,600,000
キングジム	13,100	734.00	9,615,400
リンテック	36,700	2,619.00	96,117,300
T A S A K I	2,900	1,880.00	5,452,000
信越ポリマー	31,800	494.00	15,709,200
東リ	43,000	244.00	10,492,000
イトーキ	32,500	579.00	18,817,500
任天堂	95,100	12,265.00	1,166,401,500
三菱鉛筆	12,700	3,425.00	43,497,500
松風	7,500	1,437.00	10,777,500
タカラスタANDARD	64,000	871.00	55,744,000
コクヨ	80,300	880.00	70,664,000
ナカバヤシ	34,000	206.00	7,004,000
ニフコ	36,100	3,920.00	141,512,000
グローブライド	75,000	200.00	15,000,000
岡村製作所	59,300	819.00	48,566,700
日本バルカー工業	67,000	312.00	20,904,000
M U T O Hホールディングス	21,000	459.00	9,639,000
伊藤忠商事	1,276,200	1,237.00	1,578,659,400
丸紅	1,334,100	685.60	914,658,960
スクロール	19,800	274.00	5,425,200
高島	29,000	246.00	7,134,000
ヨンドシーホールディングス	11,600	1,773.00	20,566,800
三陽商会	85,000	292.00	24,820,000
長瀬産業	93,000	1,406.00	130,758,000
ナイガイ	58,000	61.00	3,538,000
蝶理	9,800	1,879.00	18,414,200
豊田通商	169,900	2,632.00	447,176,800
オンワードホールディングス	116,000	697.00	80,852,000
三共生興	26,000	459.00	11,934,000
兼松	306,000	167.00	51,102,000
美津濃	83,000	565.00	46,895,000
ツカモトコーポレーション	28,000	133.00	3,724,000

ファミリーマート	51,500	4,585.00	236,127,500
ルック	28,000	230.00	6,440,000
三井物産	1,292,500	1,524.50	1,970,416,250
日本紙パルプ商事	79,000	321.00	25,359,000
東京エレクトロン	129,900	8,549.00	1,110,515,100
日立ハイテクノロジーズ	52,800	3,545.00	187,176,000
カメイ	20,000	745.00	14,900,000
東都水産	26,000	196.00	5,096,000
OUGホールディングス	26,000	225.00	5,850,000
スターゼン	59,000	415.00	24,485,000
セイコーホールディングス	109,000	680.00	74,120,000
山善	58,800	811.00	47,686,800
椿本興業	18,000	306.00	5,508,000
住友商事	899,900	1,174.00	1,056,482,600
日本ユニシス	42,100	1,043.00	43,910,300
内田洋行	37,000	371.00	13,727,000
三菱商事	1,168,400	2,088.50	2,440,203,400
第一実業	38,000	579.00	22,002,000
キヤノンマーケティングジャパン	43,500	1,994.00	86,739,000
西華産業	50,000	279.00	13,950,000
佐藤商事	13,800	727.00	10,032,600
菱洋エレクトロ	17,600	1,263.00	22,228,800
東京産業	15,300	450.00	6,885,000
ユアサ商事	13,400	2,361.00	31,637,400
神鋼商事	40,000	264.00	10,560,000
小林産業	11,400	253.00	2,884,200
阪和興業	153,000	408.00	62,424,000
カナデン	2,000	782.00	1,564,000
菱電商事	24,000	798.00	19,152,000
ニプロ	98,600	1,044.00	102,938,400
フルサト工業	8,400	1,591.00	13,364,400
岩谷産業	169,000	794.00	134,186,000
すてきナイスグループ	66,000	184.00	12,144,000
昭光通商	55,000	165.00	9,075,000
ニチモウ	25,000	198.00	4,950,000
極東貿易	18,000	219.00	3,942,000
イワキ	24,000	217.00	5,208,000
兼松エレクトロニクス	9,700	1,730.00	16,781,000
三愛石油	39,000	777.00	30,303,000
稲畑産業	36,900	1,026.00	37,859,400
G S Iクレオス	40,000	131.00	5,240,000
明和産業	12,300	457.00	5,621,100
キムラタン	716,000	9.00	6,444,000
ゴールドウイン	37,000	617.00	22,829,000
ユニ・チャーム	327,400	3,002.50	983,018,500
デサント	37,000	1,107.00	40,959,000
キング	8,300	429.00	3,560,700
ワキタ	32,500	1,117.00	36,302,500
ヤマトインターナショナル	10,800	422.00	4,557,600
東邦ホールディングス	52,500	1,737.00	91,192,500

サンゲツ	28,900	2,918.00	84,330,200	
ミツウロコグループホールディングス	24,700	534.00	13,189,800	
シナネン	33,000	448.00	14,784,000	
伊藤忠エネクス	33,700	875.00	29,487,500	
サンリオ	42,700	2,996.00	127,929,200	
サンワ テクノス	9,700	1,180.00	11,446,000	
リョーサン	25,700	2,524.00	64,866,800	
新光商事	17,900	1,198.00	21,444,200	
トーホー	36,000	448.00	16,128,000	
三信電気	21,100	811.00	17,112,100	
東陽テクニカ	22,300	1,008.00	22,478,400	
モスフードサービス	20,000	2,283.00	45,660,000	
加賀電子	13,800	1,456.00	20,092,800	
三益半導体工業	13,700	1,181.00	16,179,700	
ソーダニッカ	2,000	491.00	982,000	
立花エレテック	9,400	1,623.00	15,256,200	
木曽路	18,700	1,979.00	37,007,300	
サトレストランシステムズ	14,300	964.00	13,785,200	
千趣会	27,500	812.00	22,330,000	
タカキュー	10,700	218.00	2,332,600	
ケーヨー	28,800	537.00	15,465,600	
アデランス	17,900	1,069.00	19,135,100	
上新電機	33,000	955.00	31,515,000	
日本瓦斯	24,400	2,593.00	63,269,200	
ベスト電器	49,400	135.00	6,669,000	
マルエツ	37,000	525.00	19,425,000	
ロイヤルホールディングス	25,500	1,661.00	42,355,500	
東天紅	12,000	183.00	2,196,000	
いなげや	17,100	1,221.00	20,879,100	
島忠	36,900	2,807.00	103,578,300	
チヨダ	18,000	2,296.00	41,328,000	
ライフコーポレーション	9,600	1,700.00	16,320,000	
カスミ	31,300	1,026.00	32,113,800	
リンガーハット	14,900	2,058.00	30,664,200	
さが美	13,000	94.00	1,222,000	
MR MAX	15,500	279.00	4,324,500	
テンアライド	13,100	371.00	4,860,100	
AOKIホールディングス	35,000	1,201.00	42,035,000	
オークワ	24,000	903.00	21,672,000	
コメリ	26,100	2,418.00	63,109,800	
青山商事	38,300	2,694.00	103,180,200	
しまむら	17,700	10,070.00	178,239,000	
CFSコーポレーション	10,200	683.00	6,966,600	
はせがわ	5,500	566.00	3,113,000	
高島屋	222,000	940.00	208,680,000	
松屋	30,700	1,663.00	51,054,100	
エイチ・ツー・オー リテイリング	72,000	1,886.00	135,792,000	
近鉄百貨店	58,000	310.00	17,980,000	
丸栄	25,000	136.00	3,400,000	

ニッセンホールディングス	32,100	326.00	10,464,600	
パルコ	14,700	971.00	14,273,700	
丸井グループ	183,300	1,063.00	194,847,900	
クレディセゾン	124,500	2,044.00	254,478,000	
アクシアル リテイリング	11,800	2,473.00	29,181,400	
井筒屋	83,000	63.00	5,229,000	
イオン	628,500	1,143.50	718,689,750	
ユニーグループ・ホールディングス	146,200	614.00	89,766,800	
イズミ	34,000	4,260.00	144,840,000	
東武ストア	21,000	286.00	6,006,000	
フォーバル	3,000	1,193.00	3,579,000	
平和堂	30,900	2,357.00	72,831,300	
フジ	17,000	2,096.00	35,632,000	
ヤオコー	8,600	7,000.00	60,200,000	
ゼビオ	20,700	1,932.00	39,992,400	
ケーズホールディングス	35,100	3,020.00	106,002,000	
P a l t a c	24,400	1,364.00	33,281,600	
O l y m p i cグループ	9,100	816.00	7,425,600	
日産東京販売ホールディングス	25,700	268.00	6,887,600	
新生銀行	1,451,000	191.00	277,141,000	
あおぞら銀行	1,029,000	390.00	401,310,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,229,600	629.70	7,700,979,120	
りそなホールディングス	1,783,300	582.70	1,039,128,910	
三井住友トラスト・ホールディングス	3,369,000	423.70	1,427,445,300	
三井住友フィナンシャルグループ	1,152,700	4,051.00	4,669,587,700	
第四銀行	193,000	384.00	74,112,000	
北越銀行	165,000	211.00	34,815,000	
西日本シティ銀行	535,000	342.00	182,970,000	
千葉銀行	588,000	754.00	443,352,000	
横浜銀行	1,053,000	622.10	655,071,300	
常陽銀行	553,000	571.00	315,763,000	
群馬銀行	361,000	760.00	274,360,000	
武蔵野銀行	24,300	3,820.00	92,826,000	
千葉興業銀行	31,600	803.00	25,374,800	
筑波銀行	63,400	354.00	22,443,600	
七十七銀行	257,000	619.00	159,083,000	
青森銀行	119,000	339.00	40,341,000	
秋田銀行	101,000	322.00	32,522,000	
山形銀行	92,000	497.00	45,724,000	
岩手銀行	10,600	4,870.00	51,622,000	
東邦銀行	136,000	393.00	53,448,000	
東北銀行	83,000	153.00	12,699,000	
みちのく銀行	76,000	217.00	16,492,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	618,000	595.00	367,710,000	
静岡銀行	446,000	1,036.00	462,056,000	
十六銀行	191,000	397.00	75,827,000	
スルガ銀行	160,900	2,149.00	345,774,100	
八十二銀行	276,000	748.00	206,448,000	

山梨中央銀行	97,000	456.00	44,232,000	
大垣共立銀行	191,000	363.00	69,333,000	
福井銀行	131,000	260.00	34,060,000	
北國銀行	170,000	373.00	63,410,000	
清水銀行	5,200	2,888.00	15,017,600	
滋賀銀行	153,000	622.00	95,166,000	
南都銀行	147,000	403.00	59,241,000	
百五銀行	146,000	472.00	68,912,000	
京都銀行	291,000	939.00	273,249,000	
紀陽銀行	59,800	1,478.00	88,384,400	
三重銀行	68,000	263.00	17,884,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,036,000	233.00	241,388,000	
広島銀行	450,000	570.00	256,500,000	
山陰合同銀行	93,000	873.00	81,189,000	
中国銀行	109,600	1,616.00	177,113,600	
鳥取銀行	49,000	228.00	11,172,000	
伊予銀行	163,000	1,258.00	205,054,000	
百十四銀行	167,000	384.00	64,128,000	
四国銀行	118,000	246.00	29,028,000	
阿波銀行	125,000	624.00	78,000,000	
鹿児島銀行	106,000	715.00	75,790,000	
大分銀行	93,000	414.00	38,502,000	
宮崎銀行	101,000	384.00	38,784,000	
肥後銀行	124,000	625.00	77,500,000	
佐賀銀行	93,000	265.00	24,645,000	
十八銀行	94,000	333.00	31,302,000	
沖縄銀行	12,100	4,595.00	55,599,500	
琉球銀行	31,400	1,615.00	50,711,000	
セブン銀行	513,900	496.00	254,894,400	
みずほフィナンシャルグループ	21,068,300	196.30	4,135,707,290	
高知銀行	59,000	154.00	9,086,000	
山口フィナンシャルグループ	152,000	1,226.00	186,352,000	
アクリーティブ	10,700	212.00	2,268,400	
芙蓉総合リース	16,000	3,895.00	62,320,000	
興銀リース	28,600	2,279.00	65,179,400	
東京センチュリーリース	35,800	2,832.00	101,385,600	
SBIホールディングス	183,000	1,297.00	237,351,000	
日本証券金融	72,100	598.00	43,115,800	
アイフル	254,900	366.00	93,293,400	
日本アジア投資	104,000	74.00	7,696,000	
ポケットカード	11,400	556.00	6,338,400	
長野銀行	51,000	211.00	10,761,000	
名古屋銀行	138,000	420.00	57,960,000	
北洋銀行	229,500	438.00	100,521,000	
愛知銀行	5,500	5,640.00	31,020,000	
第三銀行	86,000	192.00	16,512,000	
中京銀行	63,000	207.00	13,041,000	
東日本銀行	66,000	325.00	21,450,000	
大光銀行	54,000	215.00	11,610,000	
愛媛銀行	90,000	247.00	22,230,000	

トマト銀行	60,000	174.00	10,440,000
みなと銀行	138,000	211.00	29,118,000
京葉銀行	125,000	626.00	78,250,000
関西アーバン銀行	21,200	1,207.00	25,588,400
栃木銀行	77,000	521.00	40,117,000
北日本銀行	4,800	2,908.00	13,958,400
東和銀行	208,000	98.00	20,384,000
福島銀行	188,000	90.00	16,920,000
大東銀行	98,000	140.00	13,720,000
リコーリース	12,000	2,937.00	35,244,000
イオンフィナンシャルサービス	99,900	2,264.00	226,173,600
アコム	306,100	334.00	102,237,400
ジャックス	84,000	583.00	48,972,000
オリエントコーポレーション	352,000	187.00	65,824,000
日立キャピタル	29,900	2,461.00	73,583,900
アプラスフィナンシャル	73,000	126.00	9,198,000
オリックス	1,078,900	1,388.50	1,498,052,650
三菱UFJリース	386,600	525.00	202,965,000
ジャフコ	20,800	4,120.00	85,696,000
トモニホールディングス	117,000	491.00	57,447,000
大和証券グループ本社	1,426,000	892.00	1,271,992,000
野村ホールディングス	3,116,000	646.10	2,013,247,600
岡三証券グループ	130,000	875.00	113,750,000
丸三証券	48,500	799.00	38,751,500
東洋証券	61,000	339.00	20,679,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	174,900	779.00	136,247,100
光世証券	36,000	233.00	8,388,000
水戸証券	47,300	418.00	19,771,400
いちよし証券	32,000	1,233.00	39,456,000
松井証券	77,500	992.00	76,880,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	338,600	2,904.00	983,294,400
だいこう証券ビジネス	7,400	746.00	5,520,400
日本取引所グループ	223,800	2,748.00	615,002,400
マネックスグループ	179,100	269.00	48,177,900
カブドットコム証券	67,500	586.00	39,555,000
極東証券	20,500	1,849.00	37,904,500
岩井コスモホールディングス	15,600	1,327.00	20,701,200
フィデアホールディングス	87,600	212.00	18,571,200
池田泉州ホールディングス	125,800	539.00	67,806,200
アニコムホールディングス	6,300	1,365.00	8,599,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	485,800	2,807.00	1,363,640,600
マネースクウェアHD	4,700	1,368.00	6,429,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	146,000	1,690.00	246,740,000
マネーパートナーズグループ	15,500	411.00	6,370,500
小林洋行	5,200	265.00	1,378,000
第一生命保険	976,500	1,678.50	1,639,055,250

東京海上ホールディングス	627,300	3,886.00	2,437,687,800
イー・ギャランティ	4,500	1,683.00	7,573,500
アサックス	2,700	1,402.00	3,785,400
NECキャピタルソリューション	6,200	1,874.00	11,618,800
T&Dホールディングス	555,600	1,353.00	751,726,800
三井不動産	808,000	3,149.50	2,544,796,000
三菱地所	1,133,000	2,426.00	2,748,658,000
平和不動産	28,800	1,748.00	50,342,400
東京建物	332,000	883.00	293,156,000
ダイビル	39,300	1,097.00	43,112,100
京阪神ビルディング	25,600	643.00	16,460,800
住友不動産	365,000	3,987.50	1,455,437,500
太平洋興発	61,000	96.00	5,856,000
大京	243,000	181.00	43,983,000
テーオーシー	52,600	692.00	36,399,200
東京楽天地	26,000	506.00	13,156,000
レオパレス21	166,700	733.00	122,191,100
スタートコーポレーション	17,500	1,646.00	28,805,000
フジ住宅	19,700	679.00	13,376,300
空港施設	18,500	699.00	12,931,500
明和地所	8,900	498.00	4,432,200
住友不動産販売	11,000	2,747.00	30,217,000
ゴールドクレスト	13,700	2,154.00	29,509,800
リロ・ホールディング	5,500	8,420.00	46,310,000
日本エスリード	6,000	1,232.00	7,392,000
日神不動産	20,400	475.00	9,690,000
タカラレーベン	68,500	508.00	34,798,000
サンヨーハウジング名古屋	8,700	1,223.00	10,640,100
イオンモール	98,300	2,143.00	210,656,900
ファースト住建	5,800	1,217.00	7,058,600
ランド	59,000	18.00	1,062,000
東祥	3,500	2,724.00	9,534,000
トーセイ	20,800	677.00	14,081,600
穴吹興産	14,000	254.00	3,556,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	94,700	1,232.00	116,670,400
サンフロンティア不動産	16,400	939.00	15,399,600
エフ・ジェー・ネクスト	11,700	553.00	6,470,100
ランドビジネス	7,800	400.00	3,120,000
グランディハウス	13,600	301.00	4,093,600
東武鉄道	825,000	505.00	416,625,000
相鉄ホールディングス	265,000	510.00	135,150,000
東京急行電鉄	839,000	740.00	620,860,000
京浜急行電鉄	423,000	867.00	366,741,000
小田急電鉄	495,000	1,051.00	520,245,000
京王電鉄	431,000	872.00	375,832,000
京成電鉄	231,000	1,498.00	346,038,000
富士急行	42,000	1,135.00	47,670,000
新京成電鉄	21,000	384.00	8,064,000
東日本旅客鉄道	283,000	8,901.00	2,518,983,000
西日本旅客鉄道	148,600	5,664.00	841,670,400

東海旅客鉄道	138,300	17,660.00	2,442,378,000
西武ホールディングス	123,000	2,601.00	319,923,000
鴻池運輸	9,500	2,475.00	23,512,500
西日本鉄道	200,000	492.00	98,400,000
ハマキョウレックス	4,800	3,605.00	17,304,000
サカイ引越センター	2,600	3,600.00	9,360,000
近畿日本鉄道	1,554,000	396.00	615,384,000
阪急阪神ホールディングス	1,036,000	635.00	657,860,000
南海電気鉄道	346,000	459.00	158,814,000
京阪電気鉄道	346,000	657.00	227,322,000
神戸電鉄	38,000	345.00	13,110,000
名糖運輸	6,700	690.00	4,623,000
名古屋鉄道	555,000	446.00	247,530,000
山陽電気鉄道	57,000	444.00	25,308,000
トランコム	4,500	4,600.00	20,700,000
日本通運	611,000	630.00	384,930,000
ヤマトホールディングス	271,500	2,449.50	665,039,250
山九	188,000	471.00	88,548,000
日新	59,000	283.00	16,697,000
丸運	9,100	257.00	2,338,700
丸全昭和運輸	52,000	379.00	19,708,000
センコー	62,000	593.00	36,766,000
トナミホールディングス	32,000	360.00	11,520,000
日本梱包運輸倉庫	50,500	1,741.00	87,920,500
日本石油輸送	19,000	231.00	4,389,000
福山通運	94,000	640.00	60,160,000
セイノーホールディングス	119,000	1,202.00	143,038,000
神奈川中央交通	18,000	573.00	10,314,000
日立物流	32,100	1,435.00	46,063,500
日本郵船	1,304,000	355.00	462,920,000
商船三井	809,000	379.00	306,611,000
川崎汽船	675,000	336.00	226,800,000
N S ユナイテッド海運	66,000	369.00	24,354,000
明治海運	13,900	358.00	4,976,200
飯野海運	79,900	680.00	54,332,000
共栄タンカー	13,000	230.00	2,990,000
第一中央汽船	113,000	47.00	5,311,000
日本航空	295,600	3,780.00	1,117,368,000
A N Aホールディングス	3,035,000	303.80	922,033,000
スカイマーク	39,200	363.00	14,229,600
パスコ	14,000	348.00	4,872,000
三菱倉庫	101,000	1,711.00	172,811,000
三井倉庫ホールディングス	89,000	401.00	35,689,000
住友倉庫	113,000	641.00	72,433,000
澁澤倉庫	40,000	338.00	13,520,000
ヤマタネ	77,000	169.00	13,013,000
東陽倉庫	27,000	292.00	7,884,000
乾汽船	10,400	936.00	9,734,400
日本トランスシティ	35,000	373.00	13,055,000
ケイヒン	28,000	167.00	4,676,000

中央倉庫	9,000	903.00	8,127,000
安田倉庫	12,100	1,003.00	12,136,300
東洋埠頭	48,000	195.00	9,360,000
宇徳	12,500	553.00	6,912,500
上組	184,000	1,062.00	195,408,000
サンリツ	1,700	535.00	909,500
キムラユニティー	4,200	992.00	4,166,400
キューソー流通システム	4,300	1,451.00	6,239,300
郵船ロジスティクス	14,200	1,303.00	18,502,600
近鉄エクスプレス	13,800	4,535.00	62,583,000
東海運	8,800	276.00	2,428,800
エーアイティー	7,200	850.00	6,120,000
東京放送ホールディングス	91,300	1,354.00	123,620,200
日本テレビホールディングス	139,200	1,740.00	242,208,000
朝日放送	15,100	919.00	13,876,900
テレビ朝日ホールディングス	41,600	1,815.00	75,504,000
スカパーJ S A Tホールディングス	115,800	697.00	80,712,600
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,578.00	31,967,200
コネクシオ	10,800	1,096.00	11,836,800
クロップス	1,400	529.00	740,600
日本電信電話	596,500	6,320.00	3,769,880,000
K D D I	516,200	7,513.00	3,878,210,600
光通信	13,700	6,620.00	90,694,000
N T T ドコモ	1,256,000	1,839.50	2,310,412,000
G M O インターネット	50,800	1,001.00	50,850,800
K A D O K A W A ・ D W A N G O	39,700	1,793.00	71,182,100
学研ホールディングス	51,000	251.00	12,801,000
ゼンリン	20,200	1,374.00	27,754,800
昭文社	9,300	863.00	8,025,900
インプレスホールディングス	11,500	123.00	1,414,500
東京電力	1,309,900	484.00	633,991,600
中部電力	472,500	1,369.00	646,852,500
関西電力	630,200	1,095.00	690,069,000
中国電力	213,500	1,481.00	316,193,500
北陸電力	151,300	1,494.00	226,042,200
東北電力	385,800	1,378.00	531,632,400
四国電力	139,000	1,347.00	187,233,000
九州電力	341,000	1,123.00	382,943,000
北海道電力	144,500	889.00	128,460,500
沖縄電力	10,100	3,690.00	37,269,000
電源開発	103,800	4,085.00	424,023,000
東京瓦斯	1,877,000	636.90	1,195,461,300
大阪瓦斯	1,599,000	434.20	694,285,800
東邦瓦斯	393,000	580.00	227,940,000
北海道瓦斯	31,000	284.00	8,804,000
西部瓦斯	174,000	256.00	44,544,000
静岡瓦斯	43,900	728.00	31,959,200
アイネット	7,800	897.00	6,996,600
松竹	100,000	1,165.00	116,500,000
東宝	108,800	2,660.00	289,408,000

エイチ・アイ・エス	26,300	3,630.00	95,469,000
東映	57,000	701.00	39,957,000
AOI Pro.	7,200	769.00	5,536,800
エヌ・ティ・ティ・データ	94,200	4,345.00	409,299,000
共立メンテナンス	8,000	6,130.00	49,040,000
イチネンホールディングス	17,000	1,083.00	18,411,000
建設技術研究所	9,500	1,496.00	14,212,000
スペース	8,900	1,148.00	10,217,200
インファーマシーズ	16,800	3,630.00	60,984,000
燦ホールディングス	3,300	1,706.00	5,629,800
スバル興業	3,000	455.00	1,365,000
東京テアトル	62,000	139.00	8,618,000
よみうりランド	32,000	485.00	15,520,000
東京都競馬	110,000	291.00	32,010,000
常磐興産	60,000	152.00	9,120,000
カナモト	22,500	3,265.00	73,462,500
東京ドーム	110,000	513.00	56,430,000
D T S	15,700	2,480.00	38,936,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,400	2,425.00	134,345,000
シーイーシー	9,900	1,039.00	10,286,100
カブコン	39,000	1,774.00	69,186,000
西尾レントオール	13,000	3,680.00	47,840,000
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	66,000	45.00	2,970,000
日本空港ビルデング	52,700	4,935.00	260,074,500
トランス・コスモス	21,100	1,881.00	39,689,100
乃村工藝社	31,600	1,060.00	33,496,000
ジャステック	8,900	860.00	7,654,000
S C S K	36,200	3,025.00	109,505,000
藤田観光	59,000	356.00	21,004,000
K N T - C Tホールディングス	78,000	146.00	11,388,000
日本管財	7,900	2,633.00	20,800,700
トーカイ	7,100	3,415.00	24,246,500
白洋舎	5,000	243.00	1,215,000
セコム	156,600	6,683.00	1,046,557,800
日本システムウエア	5,800	865.00	5,017,000
セントラル警備保障	7,200	1,159.00	8,344,800
アイネス	20,800	890.00	18,512,000
丹青社	18,600	830.00	15,438,000
メイテック	21,800	3,485.00	75,973,000
T K C	12,800	1,969.00	25,203,200
アサツー ディ・ケイ	30,300	2,759.00	83,597,700
富士ソフト	21,000	2,347.00	49,287,000
応用地質	16,900	1,697.00	28,679,300
船井総研ホールディングス	18,200	933.00	16,980,600
N S D	32,400	1,766.00	57,218,400
進学会	7,000	475.00	3,325,000
丸紅建材リース	13,000	300.00	3,900,000
コナミ	61,900	2,046.00	126,647,400

ベネッセホールディングス	59,000	3,500.00	206,500,000
イオンディライト	15,600	2,653.00	41,386,800
ナック	10,800	1,061.00	11,458,800
福井コンピュータホールディングス	4,200	777.00	3,263,400
ニチイ学館	31,600	1,024.00	32,358,400
ダイセキ	26,000	2,049.00	53,274,000
ステップ	5,700	824.00	4,696,800
日鉄住金物産	100,000	396.00	39,600,000
元気寿司	4,700	2,549.00	11,980,300
トラスコ中山	19,000	3,000.00	57,000,000
ヤマダ電機	602,300	388.00	233,692,400
オートバックスセブン	56,100	1,669.00	93,630,900
アークランドサカモト	10,900	2,148.00	23,413,200
ニトリホールディングス	65,800	6,530.00	429,674,000
グルメ杵屋	11,000	896.00	9,856,000
愛眼	12,800	250.00	3,200,000
ケーユーホールディングス	8,200	616.00	5,051,200
吉野家ホールディングス	42,900	1,401.00	60,102,900
加藤産業	22,000	2,156.00	47,432,000
イノテック	14,000	493.00	6,902,000
イエローハット	14,400	2,342.00	33,724,800
富士エレクトロニクス	7,900	1,370.00	10,823,000
松屋フーズ	7,400	2,542.00	18,810,800
J B C Cホールディングス	12,900	747.00	9,636,300
J Kホールディングス	15,800	567.00	8,958,600
サガミチェーン	19,000	1,096.00	20,824,000
日伝	6,300	2,390.00	15,057,000
関西スーパーマーケット	11,600	796.00	9,233,600
ミロク情報サービス	10,100	596.00	6,019,600
北沢産業	11,000	176.00	1,936,000
杉本商事	8,300	1,215.00	10,084,500
因幡電機産業	22,500	3,875.00	87,187,500
王将フードサービス	11,200	4,265.00	47,768,000
プレナス	17,000	2,112.00	35,904,000
ミニストップ	11,400	1,586.00	18,080,400
アークス	26,500	2,377.00	62,990,500
パロー	32,800	2,082.00	68,289,600
バイテック	5,200	984.00	5,116,800
ミスミグループ本社	56,900	4,010.00	228,169,000
江守グループホールディングス	6,500	1,046.00	6,799,000
アルテック	11,200	210.00	2,352,000
ベルク	6,800	3,160.00	21,488,000
大 庄	8,200	1,376.00	11,283,200
タキヒヨー	26,000	405.00	10,530,000
ファーストリテイリング	30,500	43,575.00	1,329,037,500
ソフトバンク	806,100	7,148.00	5,762,002,800
スズケン	63,100	3,215.00	202,866,500
サンドラッグ	32,200	4,845.00	156,009,000
サックスパー ホールディングス	11,400	1,561.00	17,795,400
ジェコス	10,500	1,698.00	17,829,000

ヤマザワ	3,300	1,664.00	5,491,200	
やまや	2,600	1,545.00	4,017,000	
ルネサスイーストン	6,900	702.00	4,843,800	
ペルーナ	38,100	503.00	19,164,300	
合計	256,418,200		310,021,808,430	

*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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,562,386,247	2,634,847,374
国債証券		351,066,587,400	356,864,761,900
地方債証券		28,835,295,237	28,477,614,128
特殊債券		28,899,480,991	28,012,463,691
社債券		24,825,672,160	24,240,352,600
未収入金		2,597,624,000	-
未収利息		1,167,959,260	1,166,808,153
前払費用		26,537,829	33,009,293
流動資産合計		438,981,543,124	441,429,857,139
資産合計		438,981,543,124	441,429,857,139
負債の部			
流動負債			
未払解約金		481,101,000	219,016,000
流動負債合計		481,101,000	219,016,000
負債合計		481,101,000	219,016,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	364,816,328,000	355,706,109,986
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		73,684,114,124	85,504,731,153
元本等合計		438,500,442,124	441,210,841,139
純資産合計		438,500,442,124	441,210,841,139
負債純資産合計		438,981,543,124	441,429,857,139

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26年7月11日現在	平成27年1月13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	384,301,757,056円 17,777,928,783円 37,263,357,839円	364,816,328,000円 28,609,940,707円 37,720,158,721円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券バッシブ・ファンド	7,756,287,865円	8,382,784,644円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	10,182,259,605円	10,855,812,915円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	3,914,092,599円	4,226,550,798円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	6,192,757,632円	6,556,972,539円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,517,171,139円	2,709,546,666円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,641,113,671円	1,654,448,516円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,758,831,071円	1,773,518,243円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	244,645,589円	258,526,847円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	161,281,285円	121,943,264円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,066,952,819円	1,935,623,071円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,783,141円	7,965,036円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	76,306,122円	153,360,119円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	52,629,594円	106,659,104円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	15,623,275円	30,926,406円
投資のソムリエ クルーズコントロール 投資のソムリエ<DC年金> D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	864,950,322円 936,246,874円 8,175,485円 76,861,910円	3,643,791,819円 1,274,868,230円 55,337,003円 290,351,381円

D I A M D C バランス・F (成長型)	- 円	3,715,649円
クルーズコントロール< D C 年金>	- 円	279,469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国内債券バッシブファンド (適格機関投資家向け)	12,474,154,955円	12,736,663,724円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	720,115,552円	713,490,099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)	6,935,592,166円	4,576,994,987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)	479,899,497円	411,769,532円
D I A M国際分散バランスファンド3 0VA (適格機関投資家限定)	341,568,974円	275,098,932円
D I A M国際分散バランスファンド5 0VA (適格機関投資家限定)	844,575,756円	746,440,714円
D I A M国内重視バランスファンド3 0VA (適格機関投資家限定)	368,590,027円	255,985,978円
D I A M国内重視バランスファンド5 0VA (適格機関投資家限定)	312,565,963円	261,050,260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)	31,169,757,470円	25,790,521,333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)	10,254,053,433円	9,115,933,857円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	13,350,867,008円	13,055,910,431円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	5,036,303,536円	5,059,949,119円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	8,138,535,860円	8,443,676,938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)	1,260,636,240円	1,075,116,553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)	5,578,068,754円	4,837,898,699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)	6,392,961,406円	6,251,610,037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)	10,794,357,014円	9,193,418,931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)	508,585,424円	492,774,489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)	12,282,364,696円	9,735,911,951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）	8,330,542,690円	8,722,859,092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）	1,267,326,367円	1,163,837,203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）	105,975,107,147円	105,848,232,159円
D I A M世界アセットバランスファン ド40VA（適格機関投資家限定）	1,875,098,981円	1,685,556,270円
D I A M世界アセットバランスファン ド25VA（適格機関投資家限定）	9,280,699,535円	9,113,269,251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）	32,944,458,192円	33,245,672,660円
D I A Mバランス30VA（適格機関 投資家限定）	487,284円	496,271円
D I A Mバランス50VA（適格機関 投資家限定）	377,180,600円	372,604円
D I A Mバランス70VA（適格機関 投資家限定）	83,354,529円	106,141,365円
D I A M世界アセットバランスファン ド4VA（適格機関投資家限定）	36,582,413,492円	37,214,558,363円
D I A M世界バランス25VA（適格 機関投資家限定）	700,952,715円	699,496,865円
D I A M国内バランス30VA（適格 機関投資家限定）	173,684,857円	172,879,508円
D I A Mバランス20VA（適格機関 投資家限定）	1,092,651,739円	575,601円
D I A Mバランス40VA（適格機関 投資家限定）	389,671,541円	628,772,729円
D I A Mバランス60VA（適格機関 投資家限定）	313,763円	330,923円
計	364,816,328,000円	355,706,109,986円
2. 受益権の総数	364,816,328,000口	355,706,109,986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26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13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	559,019,100	11,180,843,600
地方債証券	29,237,277	236,727,508
特殊債証券	23,720,140	37,489,733
社債証券	14,304,600	37,778,400
合計	578,840,837	11,417,282,441

(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26年2月15日から平成26年7月11日まで及び平成26年2月15日から平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	1,2020円	1,2404円
（1万口当たり純資産額）	（12,020円）	（12,404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27年1月13日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	337回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,002,820,000	
	340回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,580,000	
	341回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,003,800,000	
	342回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,004,040,000	
	343回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,503,195,000	
	344回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,004,500,000	
	345回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,004,720,000	
	95回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,007,400,000	
	96回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,213,706,000	
	97回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,024,840,000	
	99回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,021,900,000	
	101回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,016,780,000	
	102回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,522,610,000	
	103回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,532,805,000	
	105回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,524,570,000	
	106回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,527,135,000	
	107回 利付国庫債券(5年)	4,300,000,000	4,327,692,000	
	109回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,007,620,000	
	110回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,020,320,000	
	112回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,521,345,000	
	113回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,537,800,000	
	114回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,552,155,000	
	116回 利付国庫債券(5年)	4,500,000,000	4,538,025,000	
	117回 利付国庫債券(5年)	6,000,000,000	6,053,880,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,046,500,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,028,050,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,507,005,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	770,628,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,285,500,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,287,980,000	
	5回 利付国庫債券(40年)	1,100,000,000	1,354,067,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,080,495,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	568,890,000	
	277回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,547,900,000	
	280回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,541,445,000	
	282回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,499,110,000	
	284回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,343,524,000	
	285回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,283,094,000	
	286回 利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,238,198,000	
	288回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,569,585,000	

289回	利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	4,074,876,000
290回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,045,280,000
293回	利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,399,744,000
296回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,695,195,000
297回	利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,483,546,000
299回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,742,844,000
301回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,626,576,000
303回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,450,673,000
305回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,255,240,000
306回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,216,510,000
308回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,926,468,000
309回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,118,820,000
310回	利付国庫債券(10年)	3,600,000,000	3,804,444,000
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,356,508,000
313回	利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	4,103,772,000
315回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,905,443,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,606,980,000
318回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,342,252,000
319回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,145,000,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,598,385,000
321回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,732,365,000
324回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,157,140,000
325回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,211,760,000
326回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,135,420,000
328回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,110,280,000
329回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,422,383,000
330回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,687,005,000
332回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,143,960,000
333回	利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,660,065,000
334回	利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,690,355,000
335回	利付国庫債券(10年)	6,000,000,000	6,147,540,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	131,454,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	125,966,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	249,342,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,116,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,890,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,528,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	375,102,000
8回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	583,575,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	459,288,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	364,563,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	359,475,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	633,000,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	256,736,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	513,432,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,044,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,022,999,200
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	249,822,000
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	386,379,000
21回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	625,480,000

22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	606,441,000
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	774,534,000
24回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	774,846,000
25回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	751,770,000
26回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,273,750,000
27回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,166,823,000
28回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,039,464,000
29回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,665,989,000
30回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,894,380,000
31回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,492,416,000
32回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	2,028,528,000
33回	利付国庫債券(30年)	1,800,000,000	2,165,562,000
34回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,875,345,000
35回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	2,051,543,000
36回	利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	2,054,467,000
37回	利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,897,776,000
38回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,163,070,000
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	949,904,000
40回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,162,750,000
41回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,251,701,000
42回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,137,540,000
43回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,137,170,000
44回	利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,705,185,000
37回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	650,358,000
39回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	433,364,000
40回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	781,502,400
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	887,584,000
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	976,925,600
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,012,041,000
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	560,065,000
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,069,054,000
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	574,140,000
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	871,595,400
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	676,944,000
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	626,131,000
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	804,195,000
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	921,982,500
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,281,374,800
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	682,302,000
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,089,524,700
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	855,608,000
62回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,369,173,000
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	689,076,000
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,266,815,000
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,191,992,000
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,504,450,000
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,472,025,000
73回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,393,097,300
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,656,172,000
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,690,555,000

8 1 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,649,690,000	
8 3 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,668,422,000	
8 5 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,030,871,000	
8 8 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,829,430,000	
9 0 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,937,568,000	
9 2 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,802,640,000	
9 3 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	833,903,000	
9 4 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,324,015,000	
9 5 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,845,045,000	
9 7 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,951,072,000	
9 9 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,934,368,000	
1 0 0 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,079,066,000	
1 0 2 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,125,136,000	
1 0 5 回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,182,716,000	
1 0 7 回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,426,160,000	
1 0 9 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,253,590,000	
1 1 1 回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,455,860,000	
1 1 3 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,309,412,000	
1 1 4 回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,431,020,000	
1 1 6 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,708,420,000	
1 1 8 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,443,336,000	
1 1 9 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,172,750,000	
1 2 1 回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,494,800,000	
1 2 3 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,314,352,000	
1 2 5 回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,466,360,000	
1 2 8 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,187,290,000	
1 2 9 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,171,550,000	
1 3 0 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,576,816,000	
1 3 2 回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,425,164,000	
1 3 4 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,052,586,000	
1 3 5 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,383,984,000	
1 3 7 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,535,808,000	
1 4 0 回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,186,862,000	
1 4 1 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,530,286,000	
1 4 3 回	利付国庫債券(20年)	2,400,000,000	2,715,432,000	
1 4 5 回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,407,377,000	
1 4 6 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,519,704,000	
1 4 7 回	利付国庫債券(20年)	2,200,000,000	2,479,136,000	
1 4 8 回	利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	2,214,340,000	
1 4 9 回	利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,761,725,000	
1 5 0 回	利付国庫債券(20年)	3,000,000,000	3,253,470,000	
国債証券 合計		325,820,000,000	356,864,761,900	
地方債証券	6 3 2 回	東京都公募公債	115,300,000	117,956,512
	6 3 3 回	東京都公募公債	100,000,000	102,269,000
	6 3 4 回	東京都公募公債	200,000,000	205,202,000
	6 3 8 回	東京都公募公債	200,000,000	206,232,000
	6 4 0 回	東京都公募公債	150,000,000	155,029,500
	6 4 1 回	東京都公募公債	100,000,000	103,411,000
	6 5 9 回	東京都公募公債	203,500,000	214,452,370
	6 6 4 回	東京都公募公債	300,000,000	315,783,000

6 6 7 回	東京都公募公債	300,000,000	318,963,000	
6 8 0 回	東京都公募公債	200,000,000	213,950,000	
6 8 5 回	東京都公募公債	500,000,000	529,525,000	
6 8 8 回	東京都公募公債	200,000,000	210,140,000	
6 9 7 回	東京都公募公債	500,000,000	533,775,000	
7 0 1 回	東京都公募公債	700,000,000	742,805,000	
7 0 8 回	東京都公募公債	500,000,000	528,160,000	
7 2 0 回	東京都公募公債	300,000,000	316,821,000	
7 2 6 回	東京都公募公債	400,000,000	417,684,000	
1 8 年度 4 回	北海道公募公債	190,500,000	195,780,660	
1 8 年度 6 回	北海道公募公債	100,000,000	103,248,000	
1 9 年度 4 回	北海道公募公債	300,000,000	313,794,000	
2 1 年度 6 回	北海道公募公債	200,000,000	213,838,000	
2 2 年度 1 2 回	北海道公募公債	200,000,000	214,380,000	
1 6 6 回	神奈川県公募公債	300,000,000	318,369,000	
1 9 4 回	神奈川県公募公債	300,000,000	314,703,000	
2 0 8 回	神奈川県公募公債	200,000,000	205,168,000	
2 8 9 回	大阪府公募公債	200,000,000	204,426,000	
2 9 3 回	大阪府公募公債	200,000,000	206,552,000	
3 0 1 回	大阪府公募公債	100,000,000	103,964,000	
3 0 7 回	大阪府公募公債	100,000,000	104,879,000	
3 1 0 回	大阪府公募公債	240,000,000	251,176,800	
3 1 9 回	大阪府公募公債	200,000,000	212,104,000	
3 3 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	214,368,000	
3 4 5 回	大阪府公募公債	300,000,000	320,958,000	
3 5 6 回	大阪府公募公債	200,000,000	212,966,000	
3 6 4 回	大阪府公募公債	300,000,000	314,019,000	
3 7 4 回	大阪府公募公債	300,000,000	317,799,000	
8 3 回	大阪府公募公債 5 年	300,000,000	301,503,000	
1 8 年度 1 回	京都府公募公債	100,000,000	103,178,000	
1 7 年度 1 3 回	兵庫県公募公債	105,000,000	107,033,850	
1 8 年度 1 回	兵庫県公募公債	120,000,000	122,664,000	
1 9 年度 2 回	兵庫県公募公債	200,000,000	208,076,000	
1 8 年度 5 回	静岡県公募公債	129,800,000	133,952,302	
2 1 年度 5 回	静岡県公募公債	197,000,000	209,129,290	
2 2 年度 8 回	静岡県公募公債	200,000,000	211,312,000	
2 3 年度 9 回	静岡県公募公債	200,000,000	213,108,000	
1 8 年度 2 回	愛知県公募公債	160,300,000	164,826,872	
2 0 年度 4 回	愛知県公募公債	100,000,000	105,685,000	
2 2 年度 6 回	愛知県公募公債	200,000,000	212,500,000	
2 3 年度 2 0 回	愛知県公募公債	500,000,000	534,555,000	
2 5 年度 4 回	愛知県公募公債	300,000,000	316,224,000	
2 2 年度 1 回	広島県公募公債	200,000,000	214,072,000	
1 8 年度 1 回	埼玉県公募公債	200,000,000	204,506,000	
2 1 年度 4 回	埼玉県公募公債	440,000,000	468,036,800	
2 3 年度 2 回	埼玉県公募公債	200,000,000	214,318,000	
2 6 年度 5 回	埼玉県公募公債	400,000,000	412,492,000	
1 8 年度 1 回	福岡県公募公債	104,000,000	107,459,040	
2 1 年度 3 回	福岡県公募公債	200,000,000	213,812,000	
1 9 年度 5 回	千葉県公募公債	300,000,000	314,913,000	

21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	212,752,000	
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	313,515,000	
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	210,668,000	
18年度2回	新潟県公募公債	169,000,000	174,686,850	
35回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,488,000	
36回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,857,000	
37回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,364,500	
38回	共同発行市場公募地方債	170,000,000	174,516,900	
39回	共同発行市場公募地方債	146,000,000	149,899,660	
40回	共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,687,500	
47回	共同発行市場公募地方債	161,600,000	167,535,568	
54回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	417,680,000	
55回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,942,000	
57回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,362,000	
61回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,655,000	
65回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,641,000	
75回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	535,280,000	
80回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	750,568,000	
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	535,680,000	
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	749,882,000	
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	318,231,000	
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	533,555,000	
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	739,207,000	
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	524,785,000	
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,290,000	
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	834,277,754	
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	519,680,000	
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,301,000	
17年度11回	大阪市公募公債	100,000,000	101,708,000	
18年度2回	大阪市公募公債	100,000,000	102,760,000	
18年度3回	大阪市公募公債	150,000,000	154,645,500	
19年度5回	大阪市公募公債	135,000,000	141,454,350	
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	463,270,500	
18年度3回	京都市公募公債	101,700,000	105,666,300	
17年度13回	神戸市公募公債	103,000,000	104,776,750	
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	212,664,000	
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	214,310,000	
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	479,340,000	
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	422,844,000	
19年度7回	札幌市公募公債	300,000,000	313,479,000	
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	209,878,000	
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	108,597,000	
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	212,764,000	
18年度4回	福岡市公募公債	100,000,000	103,106,000	
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	216,356,000	
地方債証券 合計		27,085,600,000	28,477,614,128	
特殊債券	13回	政保日本政策投資銀行債券	121,000,000	124,816,340
	27回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,292,000
	46回	日本政策投資銀行債券	200,000,000	209,986,000
	15回	高速道路機構債	400,000,000	413,056,000

25回 高速道路機構債	300,000,000	313,695,000	
35回 高速道路機構債	400,000,000	419,528,000	
48回 高速道路機構債	700,000,000	746,466,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	730,737,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	103,751,000	
8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	108,000,000	109,946,160	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,495,000	
16回政保日本高速道路保有・債務返済機構	301,000,000	310,042,040	
17回政保日本高速道路保有・債務返済機構	122,000,000	125,886,920	
18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	342,375,000	
19回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,999,000	
21回政保日本高速道路保有・債務返済機構	375,000,000	387,326,250	
23回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	309,678,000	
30回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,929,000	
33回政保日本高速道路保有・債務返済機構	297,000,000	308,193,930	
36回政保日本高速道路保有・債務返済機構	344,000,000	359,466,240	
40回政保日本高速道路保有・債務返済機構	331,000,000	347,079,980	
47回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,526,000	
54回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	521,500,000	
56回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,816,000	
60回政保日本高速道路保有・債務返済機構	707,000,000	749,844,200	
66回政保日本高速道路保有・債務返済機構	162,000,000	170,692,920	
67回政保日本高速道路保有・債務返済機構	401,000,000	424,562,760	
71回政保日本高速道路保有・債務返済機構	600,000,000	631,806,000	
78回政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	740,628,000	
82回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,471,000	
89回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,787,000	
180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,045,080,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,540,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	528,840,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	349,875,900	
862回 政保公営企業債券	239,000,000	244,174,350	
863回 政保公営企業債券	200,000,000	205,348,000	
867回 政保公営企業債券	200,000,000	205,904,000	
868回 政保公営企業債券	101,000,000	104,136,050	
869回 政保公営企業債券	102,000,000	105,318,060	
875回 政保公営企業債券	482,000,000	500,696,780	
881回 政保公営企業債券	500,000,000	521,950,000	
8回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	692,123,670	
3回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,744,780	
5回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	530,785,000	
8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,930,000	
10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	532,585,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,718,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	320,829,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	320,829,000	

36回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,178,000	
50回	政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	529,955,000	
64回	政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,596,000	
20回	公営企業金融公庫債券	200,000,000	205,554,000	
24回	公営企業金融公庫債券	300,000,000	310,569,000	
19回	都市再生機構債券	200,000,000	212,238,000	
11回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	209,038,000	
37回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	318,111,000	
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	75,660,000	82,436,109	
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	52,762,000	57,329,606	
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	78,528,000	85,449,457	
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	85,203,000	93,137,103	
13回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	39,470,000	41,992,133	
14回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	201,725,000	212,777,512	
4回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,455,000	51,745,755	
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,758,000	38,154,899	
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	128,580,000	141,224,557	
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	102,711,000	112,370,969	
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,040,000	193,084,380	
29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	282,515,000	305,701,006	
36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	550,056,000	591,359,705	
732号	利付商工債	400,000,000	402,496,000	
736号	利付商工債	300,000,000	301,530,000	
740号	利付商工債	300,000,000	301,809,000	
737号	利附農林債	300,000,000	301,710,000	
743号	利附農林債	300,000,000	301,809,000	
753号	利附農林債	300,000,000	300,498,000	
760号	利附農林債	300,000,000	302,259,000	
764号	利附農林債	500,000,000	503,040,000	
261回	利附信金中金債	300,000,000	301,503,000	
275回	利附信金中金債	400,000,000	401,720,000	
282回	利附信金中金債	300,000,000	301,488,000	
171号	利附商工債（3年）	200,000,000	200,204,000	
8回	政保中日本高速道路債券	170,000,000	175,242,800	
10回	政保中日本高速道路債券	215,000,000	221,942,350	
21回	政保中日本高速道路債券	300,000,000	316,599,000	
5回	中日本高速道路債券	200,000,000	212,730,000	
5回	政保西日本高速道路債券	259,000,000	268,189,320	
6回	政保西日本高速道路債券	117,000,000	121,340,700	
55回	鉄道建設運輸施設債	500,000,000	524,565,000	
特殊債券 合計		26,795,463,000	28,012,463,691	
社債券				
9回	J Pモルガン・チェース円貨債	200,000,000	204,280,000	
12回	ゴールドマン・サックス円貨債	100,000,000	104,754,000	
22回	中日本高速道路債券	300,000,000	315,414,000	
7回	キリンホールディングス社債	100,000,000	107,166,000	
3回	セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	106,209,000	
41回	住友化学社債	100,000,000	106,468,000	
37回	三菱化学社債	100,000,000	106,666,000	

34回	三井化学社債	100,000,000	101,915,000	
11回	武田薬品工業社債	100,000,000	100,342,000	
12回	武田薬品工業社債	100,000,000	100,732,000	
8回	ブリヂストン社債	200,000,000	201,114,000	
29回	新日本製鐵社債	100,000,000	106,851,000	
64回	新日本製鐵社債	100,000,000	106,792,000	
1回	日本電産社債	100,000,000	100,664,000	
10回	パナソニック社債	200,000,000	201,492,000	
11回	パナソニック社債	100,000,000	102,921,000	
19回	三菱重工業社債	100,000,000	103,179,000	
56回	日産自動車社債	100,000,000	101,921,000	
14回	トヨタ自動車社債	200,000,000	211,598,000	
49回	伊藤忠商事社債	100,000,000	107,261,000	
58回	伊藤忠商事社債	100,000,000	100,684,000	
66回	伊藤忠商事社債	200,000,000	201,136,000	
91回	丸紅社債	100,000,000	100,758,000	
30回	住友商事社債	100,000,000	101,820,000	
69回	三菱商事社債	300,000,000	318,489,000	
7回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	314,517,000	
25回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	302,307,000	
27回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,920,000	
29回	みずほコーポレート銀行社債	500,000,000	503,365,000	
31回	みずほコーポレート銀行社債	300,000,000	301,347,000	
32回	みずほコーポレート銀行社債	200,000,000	200,616,000	
7回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	109,622,000	
126回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,773,000	
134回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	301,725,000	
140回	三菱東京UFJ銀行社債	300,000,000	300,783,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	218,448,000	
11回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	207,414,000	
12回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	209,854,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	212,278,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	215,684,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	325,995,000	
4回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	110,912,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,029,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	214,288,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	108,793,000	
5回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,605,000	
7回	住友信託銀行劣後社債	100,000,000	103,976,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	106,151,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	103,705,000	
54回	三井住友銀行社債	200,000,000	201,128,000	
57回	三井住友銀行社債	300,000,000	301,218,000	
10回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	208,040,000	
11回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	211,444,000	
20回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	217,792,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	213,290,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	431,668,000	
6回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	103,624,000	

10回	みずほ銀行劣後特約付社債	100,000,000	105,396,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	217,226,000	
41回	NTTファイナンス社債	100,000,000	100,778,000	
20回	日産フィナンシャルサービス社債	100,000,000	100,890,000	
17回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,730,000	
23回	ホンダファイナンス社債	100,000,000	100,474,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	218,474,000	
19回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	102,303,000	
23回	トヨタファイナンス社債	300,000,000	309,492,000	
144回	オリックス社債	100,000,000	103,865,000	
148回	オリックス社債	200,000,000	204,606,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	104,116,000	
167回	オリックス社債	200,000,000	201,906,000	
5回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	201,210,000	
15回	三菱UFJリース社債	100,000,000	101,039,000	
39回	野村ホールディングス社債	300,000,000	305,619,000	
8回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,901,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	213,960,000	
79回	三菱地所社債	200,000,000	207,384,000	
90回	三菱地所社債	100,000,000	105,017,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	213,502,000	
84回	住友不動産社債	100,000,000	100,637,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	103,208,000	
8回	エヌ・ティ・ティ都市開発社債	100,000,000	106,027,000	
41回	小田急電鉄社債	100,000,000	103,394,000	
7回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,312,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	342,348,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,400,000	
52回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,505,000	
56回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	318,378,000	
3回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	212,896,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	344,766,000	
2回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	209,838,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,425,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	115,552,000	
10回	東海旅客鉄道社債	190,000,000	196,638,600	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	217,136,000	
23回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,572,000	
3回	東京地下鉄社債	100,000,000	103,011,000	
5回	KDDI社債	100,000,000	107,033,000	
51回	日本電信電話社債	200,000,000	205,582,000	
54回	日本電信電話社債	200,000,000	210,710,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	320,916,000	
15回	NTTドコモ社債	200,000,000	212,700,000	
455回	東京電力社債	200,000,000	203,342,000	
542回	東京電力社債	500,000,000	500,600,000	
409回	中部電力社債	300,000,000	316,170,000	
476回	中部電力社債	100,000,000	106,537,000	
478回	中部電力社債	100,000,000	102,914,000	
480回	中部電力社債	200,000,000	206,594,000	

4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	527,290,000	
4 1 0 回	関西電力社債	300,000,000	318,237,000	
4 4 6 回	関西電力社債	200,000,000	203,600,000	
3 1 0 回	中国電力社債	200,000,000	215,290,000	
3 7 7 回	中国電力社債	200,000,000	211,488,000	
2 6 0 回	北陸電力社債	100,000,000	111,239,000	
2 8 1 回	北陸電力社債	200,000,000	211,412,000	
3 8 0 回	東北電力社債	300,000,000	318,687,000	
4 3 2 回	東北電力社債	500,000,000	512,885,000	
2 3 7 回	四国電力社債	100,000,000	106,981,000	
3 8 7 回	九州電力社債	200,000,000	203,576,000	
4 2 3 回	九州電力社債	200,000,000	206,156,000	
2 5 7 回	北海道電力社債	200,000,000	209,180,000	
2 8 4 回	北海道電力社債	500,000,000	506,890,000	
1 7 回	電源開発社債	100,000,000	102,750,000	
1 7 回	東京ガス社債	100,000,000	108,466,000	
9 回	大阪ガス社債	100,000,000	108,399,000	
1 8 回	大阪ガス社債	100,000,000	109,702,000	
2 7 回	NTTデータ社債	100,000,000	105,158,000	
社債券 合計		23,190,000,000	24,240,352,600	
合計		402,891,063,000	437,595,192,319	

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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		560,089,264	90,967,370
投資証券		30,790,917,250	29,378,877,000
未収入金		40,042,340	201,772,800
未収配当金		220,750,335	220,408,007
流動資産合計		31,611,799,189	29,892,025,177
資産合計		31,611,799,189	29,892,025,177
負債の部			
流動負債			
未払金		494,250,610	-
未払解約金		1,091,000	202,740,000
流動負債合計		495,341,610	202,740,000
負債合計		495,341,610	202,740,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	21,574,800,459	16,405,369,329
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		9,541,657,120	13,283,915,848
元本等合計		31,116,457,579	29,689,285,177
純資産合計		31,116,457,579	29,689,285,177
負債純資産合計		31,611,799,189	29,892,025,177

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26年7月11日現在	平成27年1月13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	13,323,636,866円	21,574,800,459円
同期中追加設定元本額	34,618,843,798円	4,941,270,166円
同期中一部解約元本額	26,367,680,205円	10,110,701,296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>	41,484,123円	31,580,500円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	531,488,485円	498,552,758円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	3,274,109円	4,134,070円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	3,325,877円	5,774,762円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	8,400,189円	14,676,677円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	23,379,905円	39,950,229円
投資のソムリエ	86,261,425円	160,194,756円
投資のソムリエ<DC年金>	815,168円	2,357,889円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,341,854円	10,739,939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）	2,120,719,175円	2,085,521,517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）	1,145,882,682円	1,126,860,320円
D I A M J - R E I T インデックス私募ファンド201401（適格機関投資家限定）	3,107,027,079円	2,196,070,750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）	10,294,411,927円	9,195,588,058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）	138,473,210円	133,968,705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)	210,074,712円	164,822,352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)	218,038,011円	270,176,885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I I (適格機関投資家限 定)	82,356,264円	138,455,191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)	3,556,046,264円	325,943,971円
	計	21,574,800,459円	16,405,369,329円
2 .	受益権の総数	21,574,800,459口	16,405,369,329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26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13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	524,815,072	5,589,717,470
合計	524,815,072	5,589,717,470

(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26年6月7日から平成26年7月11日まで及び平成26年6月7日から平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.4423円	1.8097円
(1万口当たり純資産額)	(14,423円)	(18,097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27年1月13日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	G L P 投資法人	6,487	890,016,400	
	M I D リート投資法人	498	154,380,000	
	S I A 不動産投資法人	204	102,000,000	
	いちご不動産投資法人	3,067	290,751,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	747	800,037,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,528	1,113,084,000	
	イオンリート投資法人	2,578	445,220,600	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,174	145,576,000	
	インヴィンシブル投資法人	7,241	398,255,000	
	オリックス不動産投資法人	5,755	1,022,088,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	526	255,636,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,099	749,518,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	757	291,445,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,093	308,881,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,574	621,825,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,291	541,369,500	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,396	2,153,064,000	
	スターツプロシード投資法人	472	103,368,000	
	トーセイ・リート投資法人	260	36,660,000	
	トップリート投資法人	478	250,950,000	
	ヒューリックリート投資法人	2,119	375,063,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,346	751,068,000	
	プレミアム投資法人	593	370,032,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	7,143	1,370,741,700	
	阪急リート投資法人	1,621	265,033,500	
	産業ファンド投資法人	898	527,126,000	
	森トラスト総合リート投資法人	3,582	918,783,000	
	森ヒルズリート投資法人	4,260	753,168,000	
	星野リゾート・リート投資法人	117	148,005,000	
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	2,763	370,794,600	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,014	597,246,000	
	大和ハウスリート投資法人	796	493,520,000	
	大和証券オフィス投資法人	1,197	831,915,000	
	東急リアル・エステート投資法人	2,653	435,092,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,252	610,976,000		
日本ビルファンド投資法人	3,831	2,428,854,000		
日本プライムリアルティ投資法人	2,239	940,380,000		
日本プロロジスリート投資法人	4,696	1,245,848,800		
日本ヘルスケア投資法人	165	44,137,500		

日本リート投資法人	412	147,908,000	
日本リテールファンド投資法人	6,594	1,726,309,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,252	615,021,200	
日本賃貸住宅投資法人	4,003	397,898,200	
福岡リート投資法人	1,872	435,052,800	
平和不動産リート投資法人	2,581	256,809,500	
野村不動産オフィスファンド投資法人	1,011	606,600,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	4,519	724,395,700	
野村不動産レジデンシャル投資法人	436	316,972,000	
投資証券 合計	116,190	29,378,877,000	
合計	116,190	29,378,877,000	

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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,833,337,961	5,318,013,164
コール・ローン		220,039,182	108,708,644
株式		292,121,965,503	286,112,610,214
投資信託受益証券		887,593,981	905,249,900
投資証券		5,699,560,140	6,475,558,260
派生商品評価勘定		40,168,128	1,509,601
未収入金		26,050,626	-
未収配当金		425,315,276	310,992,682
差入委託証拠金		1,199,093,671	1,478,157,835
流動資産合計		306,453,124,468	300,710,800,300
資産合計		306,453,124,468	300,710,800,300
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		58,686,748	197,368,051
未払解約金		252,450,000	103,764,000
流動負債合計		311,136,748	301,132,051
負債合計		311,136,748	301,132,051
純資産の部			
元本等			
元本	1	127,193,032,969	109,595,049,033
剰余金			
剰余金又は欠損金()		178,948,954,751	190,814,619,216
元本等合計		306,141,987,720	300,409,668,249
純資産合計		306,141,987,720	300,409,668,249
負債純資産合計		306,453,124,468	300,710,800,300

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26年7月11日現在	平成27年1月13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	135,913,743,805円	127,193,032,969円
同期中追加設定元本額	6,364,362,756円	4,209,083,697円
同期中一部解約元本額	15,085,073,592円	21,807,067,633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	887,020,842円	967,569,789円
D I A M外国株式インデックス ファンド< D C年金>	33,841,068,565円	34,130,353,349円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	149,610,480円	142,401,445円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	856,618,886円	826,694,029円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,078,718,512円	1,036,116,296円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	156,524,275円	141,615,188円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	434,961,342円	404,789,618円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	344,717,137円	322,188,869円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	65,941,071円	51,106,864円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	845,784,211円	795,210,482円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	177,605,873円	212,134,966円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国1 0）	6,583,756円	11,580,508円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国2 0）	12,614,143円	22,293,003円
D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国3 0）	31,047,635円	55,218,896円
投資のソムリエ	119,082,512円	161,486,875円
クルーズコントロール	195,372,699円	259,259,955円
投資のソムリエ< D C年金>	1,126,108円	2,415,761円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C年金>	6,695,719円	22,120,203円
D I A M D C バランス・F （成長型）	- 円	1,434,718円
クルーズコントロール< D C年 金>	- 円	56,934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）	422,931,683円	359,550,244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）	3,901,253,297円	3,395,213,038円

D I A Mワールドバランス25 V A (適格機関投資家限定)	46,620,553円	39,602,290円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	2,872,315,713円	1,627,167,742円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50V A (適格機関投 資家限定)	596,806,716円	439,590,284円
D I A M国際分散バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	72,748,351円	50,186,746円
D I A M国際分散バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	419,742,948円	317,924,792円
D I A M国内重視バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	36,609,441円	21,792,015円
D I A M国内重視バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	77,651,441円	55,688,057円
D I A M世界バランスファンド 40V A (適格機関投資家限 定)	10,327,702,881円	7,323,098,894円
D I A M世界バランスファンド 50V A (適格機関投資家限 定)	5,096,353,739円	3,883,246,591円
D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	1,657,611,459円	1,390,488,703円
D I A Mバランスファンド3 7.5V A (適格機関投資家限 定)	1,459,782,085円	1,258,021,391円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	4,044,870,931円	3,600,959,018円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	2,097,912,960円	1,545,547,137円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	3,327,945,690円	2,485,691,766円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	2,117,765,913円	1,778,266,700円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	1,780,746,848円	1,305,107,887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)	27,678,338円	28,088,225円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	9,157,206,481円	6,278,827,547円

D I A Mアイエヌジー世界バ ランスファンド3 5 V A (適格機 関投資家限定)	2,106,792,977円	1,865,824,960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)	61,756,573円	49,556,839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)	13,161,968,876円	11,272,588,735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)	932,195,945円	718,334,219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)	2,305,317,728円	1,940,746,945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)	8,184,393,863円	7,083,202,420円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	151,532円	132,536円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	299,835,388円	254,447円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	151,789,349円	165,877,353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)	10,906,396,585円	9,518,527,609円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	162,988,126円	73,879円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	165,814,913円	229,568,347円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	279,880円	253,929円
計	127,193,032,969円	109,595,049,033円
2 . 受益権の総数	127,193,032,969口	109,595,049,033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26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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	<p>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。</p> <p>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。</p>	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26年7月11日現在	平成27年1月13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ぬ。	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つた場合、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26年7月11日現在	平成27年1月13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	12,487,548,269	16,547,641,933
投資信託受益証券	69,258,120	164,999,404
投資証券	411,746,900	1,164,217,058
合計	12,968,553,289	17,876,858,395

（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26年2月18日から平成26年7月11日まで及び平成26年2月18日から平成27年1月13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26年7月11日 現在				平成27年1月13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	351,633,505	-	351,514,100	119,405	432,311,540	-	432,108,000	203,540
アメリカ・ドル	233,244,560	-	233,128,000	116,560	271,602,040	-	271,400,000	202,040
イギリス・ポンド	27,771,280	-	27,769,600	1,680	71,625,200	-	71,624,000	1,200
オーストラリア・ドル	27,570,445	-	27,570,300	145	19,224,600	-	19,224,000	600
カナダ・ドル	16,181,960	-	16,180,600	1,360	-	-	-	-
ユーロ	46,865,260	-	46,865,600	340	69,859,700	-	69,860,000	300
合計	351,633,505	-	351,514,100	119,405	432,311,540	-	432,108,000	203,540

（注）時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成26年7月11日 現在				平成27年1月13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	7,017,878,673	-	6,999,240,648	18,638,025	6,635,183,872	-	6,439,121,882	196,061,990
合計	7,017,878,673	-	6,999,240,648	18,638,025	6,635,183,872	-	6,439,121,882	196,061,990

(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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	2.4069円	2.7411円
(1万口当たり純資産額)	(24,069円)	(27,411円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年1月13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	32,541	291.410	9,482,772.810	
	ABBOTT LABORATORIES	120,464	45.580	5,490,749.120	
	AES CORP	45,320	12.880	583,721.600	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,292	156.440	12,248,000.480	
	ADOBE SYSTEMS INC	39,348	71.120	2,798,429.760	
	ACE LTD	29,077	112.000	3,256,624.000	
	AGCO CORP	9,937	43.230	429,576.510	
	AIRGAS INC	6,292	113.040	711,247.680	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,935	142.370	2,411,035.950	
	ENERGEN CORP	7,454	59.800	445,749.200	
	ALLEGHANY CORP	1,575	451.910	711,758.250	
	ALLERGAN INC	25,734	219.580	5,650,671.720	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	77,004	74.410	5,729,867.640	
	RALPH LAUREN CORP	5,290	174.420	922,681.800	
	ALLSTATE CORP	32,138	69.700	2,240,018.600	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	62,671	98.450	6,169,959.950	
	ALTERA CORPORATION	23,108	36.130	834,892.040	
	ALCOA INC	102,779	16.170	1,661,936.430	
	AMGEN INC	62,407	156.220	9,749,221.540	
	HESS CORP	22,783	68.430	1,559,040.690	
	AMERICAN EXPRESS CO	76,404	89.500	6,838,158.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	40,601	61.560	2,499,397.560	
	AFLAC INC	33,588	58.290	1,957,844.520	
	AMERICAN INTL GROUP	115,953	52.360	6,071,299.080	
	JARDEN CORP	14,140	46.430	656,520.200	
	ANALOG DEVICES	25,145	54.170	1,362,104.650	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	43,179	75.050	3,240,583.950	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,523	183.360	3,029,657.280	
	NABORS INDUSTRIES LTD	19,674	10.450	205,593.300	
	TYCO INTERNATIONAL PLC	35,093	43.270	1,518,474.110	
	TIME WARNER	74,128	84.050	6,230,458.400	
	VALERO ENERGY CORP	44,783	47.370	2,121,370.710	
	APACHE CORP	32,414	58.460	1,894,922.440	
ANSYS INC	9,305	79.920	743,655.600		
APPLE INC	498,180	109.250	54,426,165.000		
APPLIED MATERIALS INC	99,730	23.660	2,359,611.800		
ALBEMARLE CORP	7,690	59.700	459,093.000		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,879	48.210	2,645,716.590	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,360	69.080	646,588.800	
AMEREN CORP	19,716	44.820	883,671.120	
ARROW ELECTRONICS INC	7,767	55.440	430,602.480	
ASHLAND INC	6,333	119.750	758,376.750	
AUTOLIV INC	7,264	102.810	746,811.840	
AUTODESK INC	20,701	57.290	1,185,960.290	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	40,602	84.145	3,416,455.290	
AUTOZONE INC	3,006	597.360	1,795,664.160	
AVERY DENNISON CORP	8,865	53.390	473,302.350	
AVNET INC	10,288	41.790	429,935.520	
AVON PRODUCTS INC	41,317	7.970	329,296.490	
BAKER HUGHES INC	36,553	55.090	2,013,704.770	
BALL CORP	12,188	65.790	801,848.520	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	93,995	148.280	13,937,578.600	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	97,048	38.470	3,733,436.560	
CR BARD INC	6,949	174.070	1,209,612.430	
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,911	72.720	3,484,087.920	
BED BATH & BEYOND INC	16,743	73.420	1,229,271.060	
BECTON DICKINSON & CO	16,624	143.560	2,386,541.440	
AMETEK INC	21,508	49.720	1,069,377.760	
BE AEROSPACE INC	7,540	60.320	454,812.800	
VERIZON COMM INC	339,429	47.080	15,980,317.320	
WR BERKLEY CORP	11,053	50.250	555,413.250	
BEST BUY CO INC	23,778	39.090	929,482.020	
YUM! BRANDS INC	37,350	72.910	2,723,188.500	
FIRSTENERGY CORP	38,598	38.460	1,484,479.080	
H&R BLOCK INC	26,590	32.940	875,874.600	
ENSCO PLC-CL A	16,993	28.370	482,091.410	
BOEING CO	55,977	130.870	7,325,709.990	
ROBERT HALF INTL INC	10,846	57.640	625,163.440	
BORGWARNER INC	17,824	52.120	928,986.880	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,190	14.580	1,723,210.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,679	72.900	997,199.100	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,203	296.320	652,792.960	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	135,665	62.180	8,435,649.700	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	4,276	201.590	861,998.840	
ONEOK INC	20,139	41.100	827,712.900	
UNITED RENTALS INC	7,795	85.780	668,655.100	
SEMPRA ENERGY	21,423	110.150	2,359,743.450	
FEDEX CORP	22,088	172.570	3,811,726.160	

VERISIGN INC	12,278	56.770	697,022.060	
AMPHENOL CORP	28,176	52.950	1,491,919.200	
BROWN-FORMAN CORP	9,803	89.560	877,956.680	
QUANTA SERVICES INC	20,095	26.680	536,134.600	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,584	47.180	1,207,053.120	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	209,556	3.570	748,114.920	
CSX CORP	81,336	33.910	2,758,103.760	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	12,039	19.770	238,011.030	
CABOT OIL & GAS CORP	38,134	29.360	1,119,614.240	
CAMPBELL SOUP CO	18,846	45.550	858,435.300	
SEAGATE TECHNOLOGY	26,728	65.040	1,738,389.120	
WHITING PETROLEUM CORP	10,428	27.350	285,205.800	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,019	106.970	1,499,612.430	
CARDINAL HEALTH INC	27,919	82.810	2,311,972.390	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	32,472	46.290	1,503,128.880	
CATERPILLAR INC	48,649	86.890	4,227,111.610	
CELGENE CORP	65,797	117.000	7,698,249.000	
CORE LABORATORIES N.V.	3,159	103.910	328,251.690	
CITRIX SYSTEMS INC	14,671	61.150	897,131.650	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,606	17.690	789,080.140	
CENTURYLINK INC	48,563	38.650	1,876,959.950	
CERNER CORP	24,936	64.790	1,615,603.440	
JPMORGAN CHASE & CO	312,049	58.830	18,357,842.670	
CHUBB CORP	20,125	101.790	2,048,523.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,581	79.490	1,000,063.690	
CIGNA CORP	22,520	106.180	2,391,173.600	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,832	51.390	608,046.480	
CINTAS CORP	8,876	76.630	680,167.880	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	103,027	6.745	694,917.110	
CISCO SYSTEMS INC	422,964	28.050	11,864,140.200	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	9,607	39.560	380,052.920	
CLOROX COMPANY	9,288	106.360	987,871.680	
EQUINIX INC	4,580	216.880	993,310.400	
COCA-COLA CO/THE	322,437	42.640	13,748,713.680	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	18,074	43.420	784,773.080	
COLGATE-PALMOLIVE CO	79,446	68.260	5,422,983.960	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	18,147	77.905	1,413,742.030	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	34,035	55.660	1,894,388.100	
COMERICA INC	13,912	42.240	587,642.880	
NRG ENERGY, INC.	23,703	26.690	632,633.070	

COMCAST CORP-CL A	177,601	56.170	9,975,848.170	
CA INC	30,767	31.265	961,930.250	
COMPUTER SCIENCES CORP	12,846	63.190	811,738.740	
CONAGRA FOODS INC	38,836	35.680	1,385,668.480	
CONSOLIDATED EDISON INC	24,429	66.900	1,634,300.100	
CMS ENERGY CORP	20,017	35.170	703,997.890	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	18,288	44.450	812,901.600	
COOPER COS INC	3,794	161.110	611,251.340	
MOLSON COORS BREWING CO	12,219	76.960	940,374.240	
CORNING INC	109,097	23.280	2,539,778.160	
DIRECTV	41,243	84.720	3,494,106.960	
CREE INC	12,621	31.870	402,231.270	
SEALED AIR CORP	14,883	42.960	639,373.680	
BROADCOM CORP-CL A	45,367	41.720	1,892,711.240	
CUMMINS INC	14,022	142.560	1,998,976.320	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,619	126.810	839,355.390	
DR HORTON INC	30,691	26.080	800,421.280	
DANAHER CORP	53,997	84.470	4,561,126.590	
MOODY'S CORP	15,654	93.010	1,455,978.540	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,125	54.150	2,714,268.750	
TARGET CORP	50,249	76.630	3,850,580.870	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	6,668	32.180	214,576.240	
DEERE & CO	28,677	85.450	2,450,449.650	
MORGAN STANLEY	120,873	36.370	4,396,151.010	
REPUBLIC SERVICES INC	23,767	40.150	954,245.050	
THE WALT DISNEY CO	138,490	94.460	13,081,765.400	
DOLLAR TREE INC	18,189	69.430	1,262,862.270	
DOVER CORP	13,192	68.740	906,818.080	
DOW CHEMICAL	97,954	44.150	4,324,669.100	
OMNICOM GROUP	21,059	74.400	1,566,789.600	
DTE ENERGY CO	16,432	86.730	1,425,147.360	
XL GROUP PLC	19,925	35.540	708,134.500	
DUKE ENERGY CORP	61,631	85.010	5,239,251.310	
FLOWSERVE CORP	12,469	56.100	699,510.900	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,714	59.840	401,765.760	
EBAY INC	91,630	55.200	5,057,976.000	
EMC CORP/MASS	174,011	28.940	5,035,878.340	
BANK OF AMERICA CORP	872,577	16.680	14,554,584.360	
CITIGROUP INC	252,192	50.380	12,705,432.960	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,209	72.580	958,709.220	
EATON CORP PLC	39,957	65.480	2,616,384.360	
EATON VANCE CORP	12,917	38.790	501,050.430	
DISH NETWORK CORP	16,800	71.280	1,197,504.000	
ECOLAB INC	22,668	100.760	2,284,027.680	
ELECTRONIC ARTS INC	25,957	47.060	1,221,536.420	

SALESFORCE.COM INC	48,957	57.730	2,826,287.610	
EMERSON ELECTRIC CO	55,561	60.170	3,343,105.370	
WEATHERFORD INTL PLC	73,546	10.040	738,401.840	
ENERGY CORP	16,359	87.040	1,423,887.360	
EOG RESOURCES INC	45,477	84.510	3,843,261.270	
EQUIFAX INC	11,487	82.620	949,055.940	
EQT CORP	12,314	72.590	893,873.260	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	21,214	74.260	1,575,351.640	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,279	43.610	622,707.190	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	64,253	83.080	5,338,139.240	
EXXON MOBIL CORP	352,875	90.330	31,875,198.750	
FMC CORP	9,724	59.200	575,660.800	
NEXTERA ENERGY INC	37,916	106.370	4,033,124.920	
FAMILY DOLLAR STORES	10,460	76.690	802,177.400	
ASSURANT INC	6,227	66.020	411,106.540	
FASTENAL CO	24,749	45.660	1,130,039.340	
FIFTH THIRD BANCORP	64,871	18.640	1,209,195.440	
M&T BANK CORP	9,572	118.070	1,130,166.040	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	8,764	102.760	900,588.640	
FISERV INC	23,093	71.970	1,662,003.210	
FLIR SYSTEMS INC	14,422	30.440	439,005.680	
MACY'S INC	27,089	66.040	1,788,957.560	
FORD MOTOR CO	297,897	15.220	4,533,992.340	
FOSSIL GROUP INC	3,149	102.820	323,780.180	
FRANKLIN RESOURCES INC	34,352	52.780	1,813,098.560	
FREEMONT-MCMORAN INC	85,535	23.070	1,973,292.450	
FLEXTRONICS INTL LTD	44,363	10.810	479,564.030	
GAP INC/THE	16,693	42.250	705,279.250	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,729	52.260	560,697.540	
GENERAL DYNAMICS CORP	24,091	137.900	3,322,148.900	
GENERAL MILLS INC	51,206	52.650	2,695,995.900	
GENUINE PARTS CO	12,396	97.520	1,208,857.920	
GILEAD SCIENCES INC	124,949	101.210	12,646,088.290	
STARWOOD HOTELS&RESORTS	14,991	74.180	1,112,032.380	
MCKESSON CORP	19,523	214.660	4,190,807.180	
NVIDIA CORP	43,024	19.690	847,142.560	
GENERAL ELECTRIC CO	828,561	23.980	19,868,892.780	
WW GRAINGER INC	4,603	245.150	1,128,425.450	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	11,113	133.910	1,488,141.830	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	13.610	302,631.960	
HALLIBURTON CO	68,949	38.540	2,657,294.460	
MONSTER BEVERAGE CORP	12,900	111.960	1,444,284.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,262	185.070	5,970,728.340	
HARLEY-DAVIDSON INC	17,507	64.660	1,132,002.620	

HARRIS CORP	7,832	68.880	539,468.160	
CONSOL ENERGY INC	22,051	30.370	669,688.870	
HASBRO INC	11,176	52.610	587,969.360	
HENRY SCHEIN INC	7,142	139.860	998,880.120	
DENBURY RESOURCES INC	28,517	6.890	196,482.130	
HELMERICH & PAYNE INC	9,929	59.370	589,484.730	
HERSHEY FOODS CORP	13,846	105.430	1,459,783.780	
HEWLETT-PACKARD CO	154,487	39.920	6,167,121.040	
F5 NETWORKS INC	5,817	127.920	744,110.640	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,919	47.660	615,719.540	
REYNOLDS AMERICAN INC	29,054	65.640	1,907,104.560	
SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A	10,369	110.500	1,145,774.500	
JUNIPER NETWORKS INC	37,815	22.450	848,946.750	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	34.210	475,108.480	
HOLOGIC INC	12,273	28.730	352,603.290	
UNUM GROUP	24,833	32.650	810,797.450	
HOME DEPOT INC	114,093	104.420	11,913,591.060	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,549	96.580	1,115,402.420	
HORMEL FOODS CORP	14,878	50.520	751,636.560	
HUDSON CITY BANCORP INC	43,137	9.460	408,076.020	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	22.760	727,227.520	
HUMANA INC	14,243	145.510	2,072,498.930	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,637	79.870	530,097.190	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,060	10.010	601,200.600	
RED HAT INC	14,283	67.620	965,816.460	
BIOGEN IDEC INC	20,368	347.840	7,084,805.120	
ILLINOIS TOOL WORKS	31,641	93.140	2,947,042.740	
INTUIT INC	22,782	86.720	1,975,655.040	
INGERSOLL-RAND PLC	24,217	62.200	1,506,297.400	
INTEL CORP	411,248	36.600	15,051,676.800	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,632	101.100	569,395.200	
INTERNATIONAL PAPER CO	34,978	53.210	1,861,179.380	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,872	20.180	744,076.960	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,297	40.760	378,945.720	
INCYTE CORP	12,683	73.300	929,663.900	
JOHNSON & JOHNSON	232,262	104.580	24,289,959.960	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,070	40.310	1,413,671.700	
JOHNSON CONTROLS INC	54,401	46.090	2,507,342.090	
KLA-TENCOR CORP	12,621	67.090	846,742.890	
DEVON ENERGY CORP	32,345	59.130	1,912,559.850	
KELLOGG CO	22,425	65.480	1,468,389.000	

KEYCORP	66,833	12.860	859,472.380	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,564	115.760	3,769,608.640	
BLACKROCK INC/NEW YORK	11,407	346.930	3,957,430.510	
KOHL'S CORP	18,627	60.630	1,129,355.010	
KROGER CO	36,321	66.000	2,397,186.000	
LAM RESEARCH CORP	14,133	77.310	1,092,622.230	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,367	60.750	872,795.250	
LEGG MASON INC	9,375	53.070	497,531.250	
LEGGETT & PLATT INC	8,522	44.400	378,376.800	
LENNAR CORP	12,932	47.070	608,709.240	
LEUCADIA NATIONAL CORP	30,186	22.110	667,412.460	
ELI LILLY & CO	80,805	69.420	5,609,483.100	
L BRANDS INC	20,969	85.710	1,797,252.990	
LINCOLN NATIONAL CORP	21,084	53.880	1,136,005.920	
LINEAR TECH CORP	18,324	45.450	832,825.800	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60,830	109.640	6,669,401.200	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	30,573	40.110	1,226,283.030	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,541	194.470	4,189,078.270	
LOEWS CORP	33,738	39.670	1,338,386.460	
RANGE RESOURCES CORP	12,431	47.620	591,964.220	
LOWE'S COS INC	84,815	67.850	5,754,697.750	
DOMINION RESOURCES INC/VA	49,181	76.500	3,762,346.500	
SCANA CORP	9,574	60.940	583,439.560	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,355	23.180	193,668.900	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,729	20.220	682,000.380	
MCCORMICK & CO INC	9,163	73.660	674,946.580	
MCDONALD'S CORPORATION	84,886	93.010	7,895,246.860	
MCGRAW-HILL FINANCIAL INC	22,594	85.760	1,937,661.440	
EVEREST RE GROUP LTD	2,661	169.710	451,598.310	
MANPOWERGROUP INC	7,953	66.370	527,840.610	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	8,263	135.290	1,117,901.270	
MARSH & MCLENNAN COS	47,833	56.100	2,683,431.300	
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,542	131.760	730,213.920	
MASCO CORP	30,441	25.190	766,808.790	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,102	110.090	561,679.180	
MATTEL INC	25,152	28.910	727,144.320	
METLIFE INC	80,053	50.430	4,037,072.790	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,714	32.760	809,630.640	
MEDTRONIC INC	84,272	74.470	6,275,735.840	
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,499	18.860	763,811.140	
CVS HEALTH CORP	93,997	97.200	9,136,508.400	
MERCK & CO. INC.	245,293	62.300	15,281,753.900	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,509	115.840	754,002.560	
MICROSOFT CORP	649,006	46.600	30,243,679.600	
MICRON TECH INC	89,717	31.660	2,840,440.220	
RACKSPACE HOSTING INC	10,000	46.750	467,500.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,985	44.030	835,909.550	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	30,888	15.920	491,736.960	
3M CO	50,172	160.740	8,064,647.280	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,675	157.760	737,528.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,814	64.350	1,339,380.900	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,699	113.300	985,596.700	
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	46.740	581,585.820	
ENDO INTERNATIONAL PLC	12,378	77.960	964,988.880	
MYLAN LABORATORIES	33,530	55.270	1,853,203.100	
ILLUMINA INC	11,266	190.100	2,141,666.600	
XCEL ENERGY INC	41,914	35.860	1,503,036.040	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	35,727	58.600	2,093,602.200	
NETAPP INC	29,487	39.870	1,175,646.690	
NEWELL RUBBERMAID INC	24,567	37.280	915,857.760	
DUN & BRADSTREET CORP	3,677	116.460	428,223.420	
NEWMONT MINING CORP	37,881	21.190	802,698.390	
NIKE INC-CL B	56,049	95.860	5,372,857.140	
NOBLE ENERGY INC	28,642	41.520	1,189,215.840	
NORDSTROM INC	13,411	78.380	1,051,154.180	
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,247	101.970	2,676,406.590	
NORTHEAST UTILITIES	29,591	53.330	1,578,088.030	
NISOURCE INC	28,988	42.310	1,226,482.280	
COACH INC	21,436	38.570	826,786.520	
TOWERS WATSON & COMPANY	6,639	113.780	755,385.420	
NORTHERN TRUST CORP	17,989	63.340	1,139,423.260	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,654	151.970	2,530,908.380	
WELLS FARGO & CO	410,944	52.050	21,389,635.200	
NUCOR CORP	24,612	46.000	1,132,152.000	
MONSANTO CO	44,026	119.560	5,263,748.560	
CHENIERE ENERGY INC	19,714	68.480	1,350,014.720	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,823	79.060	3,701,826.380	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	63,476	74.950	4,757,526.200	
OCEANEERING INTERNATIONAL INC	9,081	53.670	487,377.270	
OGE ENERGY CORP	16,028	34.010	545,112.280	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,409	185.580	1,560,542.220	
OMNICARE INC	8,889	74.010	657,874.890	
ORACLE CORP	294,835	43.270	12,757,510.450	
OWENS-ILLINOIS INC	9,767	24.580	240,072.860	
PACCAR INC	27,939	65.830	1,839,224.370	

PALL CORP	10,048	100.530	1,010,125.440	
EXELON CORP	72,135	36.630	2,642,305.050	
PARKER HANNIFIN CORP	13,401	125.790	1,685,711.790	
PARTNERRE LTD	3,890	112.420	437,313.800	
PATTERSON COS INC	4,032	50.060	201,841.920	
PAYCHEX INC	25,896	47.080	1,219,183.680	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,519	48.790	415,642.010	
PPL CORPORATION	58,534	35.170	2,058,640.780	
PEPSICO INC	128,485	96.420	12,388,523.700	
PENTAIR PLC	15,841	64.630	1,023,803.830	
PFIZER INC	521,082	32.770	17,075,857.140	
CONOCOPHILLIPS	100,443	63.070	6,334,940.010	
PVH CORP	7,894	117.740	929,439.560	
PETSMART INC	8,567	81.040	694,269.680	
PG&E CORP	40,294	55.430	2,233,496.420	
PHARMACYCLICS INC	5,559	123.710	687,703.890	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,237	134.930	1,651,138.410	
ALTRIA GROUP INC	160,112	50.920	8,152,903.040	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	45,489	86.160	3,919,332.240	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,980	142.450	709,401.000	
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	4,923	119.870	590,120.010	
GARMIN LTD	9,959	51.450	512,390.550	
AETNA INC	30,133	89.520	2,697,506.160	
FLUOR CORP (NEW)	14,048	56.180	789,216.640	
PPG INDUSTRIES INC	11,246	226.250	2,544,407.500	
PRAXAIR INC	24,869	126.370	3,142,695.530	
PRECISION CASTPARTS CORP	12,001	225.750	2,709,225.750	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,539	142.520	5,350,058.280	
T ROWE PRICE GROUP INC	23,241	82.930	1,927,376.130	
QUEST DIAGNOSTICS	11,056	68.100	752,913.600	
PROCTER & GAMBLE CO	222,546	89.920	20,011,336.320	
PROGRESSIVE CORP	45,883	26.540	1,217,734.820	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,038	41.390	1,739,952.820	
PULTE GROUP INC	25,477	22.690	578,073.130	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	37,710	15.740	593,555.400	
QUALCOMM INC	138,305	73.570	10,175,098.850	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,374	53.890	559,054.860	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	94.910	335,506.850	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,463	413.330	2,671,351.790	
AUTONATION INC	3,445	58.120	200,223.400	

RESMED INC	11,376	58.690	667,657.440	
US BANCORP	146,773	42.560	6,246,658.880	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,613	58.930	861,144.090	
ROSS STORES INC	18,937	95.830	1,814,732.710	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	10,795	62.100	670,369.500	
ROPER INDUSTRIES INC	9,399	149.170	1,402,048.830	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,943	106.000	1,159,958.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,330	83.260	1,109,855.800	
RAYTHEON COMPANY	24,336	106.650	2,595,434.400	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,580	291.360	1,334,428.800	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,739	40.910	766,612.490	
ACCENTURE PLC-CL A	52,942	89.510	4,738,838.420	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	136,094	36.870	5,017,785.780	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	13,685	44.350	606,929.750	
SANDISK CORP	18,229	83.570	1,523,397.530	
SAFEWAY INC	23,620	35.260	832,841.200	
ROCKWELL COLLINS INC	11,510	84.150	968,566.500	
ST JUDE MEDICAL INC	21,273	65.350	1,390,190.550	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	25,685	105.200	2,702,062.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,091	62.730	1,636,688.430	
PRICELINE GROUP INC	4,305	1,039.980	4,477,113.900	
SCHLUMBERGER LTD	106,513	78.050	8,313,339.650	
SCHWAB (CHARLES) CORP	99,789	28.170	2,811,056.130	
JOY GLOBAL INC	7,485	43.340	324,399.900	
ZIMMER HOLDINGS INC	14,008	118.490	1,659,807.920	
SPX CORP	3,361	80.630	270,997.430	
BUNGE LTD	10,172	88.840	903,680.480	
SEI INVESTMENTS CO	10,402	39.770	413,687.540	
ANTHEM INC	22,872	128.830	2,946,599.760	
AMERISOURCEBERGEN CORP	20,248	90.930	1,841,150.640	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,351	50.230	1,172,920.730	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,870	271.100	1,862,457.000	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,617	17.940	298,108.980	
SIGMA-ALDRICH	9,766	137.220	1,340,090.520	
SNAP-ON INC	4,354	134.000	583,436.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	38,713	84.210	3,260,021.730	
ADVANCE AUTO PARTS	6,001	158.930	953,738.930	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	28,328	24.070	681,854.960	
EDISON INTERNATIONAL	26,497	66.880	1,772,119.360	
SOUTHERN CO	77,354	49.710	3,845,267.340	
BB&T CORP	59,553	36.490	2,173,088.970	

SOUTHWEST AIRLINES	13,746	40.250	553,276.500	
AT&T INC	423,769	33.490	14,192,023.810	
CHEVRON CORP	156,699	105.880	16,591,290.120	
MEADWESTVACO CORP	16,496	44.940	741,330.240	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,011	94.010	1,129,154.110	
STAPLES INC	50,301	17.240	867,189.240	
STATE STREET CORP	35,980	75.370	2,711,812.600	
STARBUCKS CORP	64,100	80.230	5,142,743.000	
STRYKER CORP	29,747	94.020	2,796,812.940	
NETFLIX INC	4,820	318.830	1,536,760.600	
STERICYCLE INC	7,859	132.325	1,039,942.170	
SUNTRUST BANKS INC	42,848	38.410	1,645,791.680	
SYMANTEC CORP	62,503	25.290	1,580,700.870	
SYNOPSIS INC	14,312	42.500	608,260.000	
SYSCO CORP	47,889	40.870	1,957,223.430	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,314	525.510	1,741,540.140	
TESORO CORP	10,250	70.000	717,500.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	88,001	53.120	4,674,613.120	
TEXTRON INC	25,116	42.140	1,058,388.240	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,397	128.500	4,420,014.500	
TIFFANY & CO	12,040	89.010	1,071,680.400	
TOLL BROTHERS INC	12,654	35.010	443,016.540	
TORCHMARK CORP	13,665	52.100	711,946.500	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,637	33.660	459,021.420	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,946	74.420	1,037,861.320	
TRACTOR SUPPLY CO	11,181	79.260	886,206.060	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	23,388	25.660	600,136.080	
TYSON FOODS INC	25,091	39.100	981,058.100	
MARATHON OIL CORP	60,801	26.240	1,595,418.240	
UNION PACIFIC CORP	74,051	113.970	8,439,592.470	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,953	114.450	8,120,570.850	
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,492	102.550	8,049,354.600	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,035	106.240	959,878.400	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,296	87.390	724,987.440	
VF CORP	31,132	75.310	2,344,550.920	
CBS CORP	40,761	54.850	2,235,740.850	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,936	118.310	2,358,628.160	
VULCAN MATERIALS CO	10,233	68.250	698,402.250	
URBAN OUTFITTERS INC	8,777	36.420	319,658.340	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	78,365	75.700	5,932,230.500	
WAL-MART STORES INC	137,490	90.020	12,376,849.800	

WASTE MANAGEMENT INC	37,795	51.470	1,945,308.650	
WATERS CORP	8,002	116.460	931,912.920	
ACTAVIS PLC	22,848	272.280	6,221,053.440	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,059	100.340	808,640.060	
WESTERN DIGITAL CORP	18,200	110.320	2,007,824.000	
WABTEC CORP	7,250	83.900	608,275.000	
WHIRLPOOL CORP	6,288	198.960	1,251,060.480	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,330	72.320	1,108,665.600	
WYNN RESORTS LTD	6,279	148.460	932,180.340	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,055	51.815	1,505,484.820	
NASDAQ OMX GROUP	6,550	47.350	310,142.500	
CME GROUP INC	26,453	87.610	2,317,547.330	
WILLIAMS COS INC	57,448	41.280	2,371,453.440	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,716	53.930	470,053.880	
LKQ CORP	22,850	26.900	614,665.000	
PEPCO HOLDINGS INC	18,195	27.030	491,810.850	
ALLIANT ENERGY CORP	10,609	66.470	705,180.230	
WISCONSIN ENERGY CORP	20,446	53.460	1,093,043.160	
FOOT LOCKER INC	11,034	56.790	626,620.860	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,824	77.500	606,360.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24,850	33.920	842,912.000	
CARMAX INC	17,598	64.350	1,132,431.300	
XEROX CORP	88,088	13.590	1,197,115.920	
XILINX INC	22,098	42.470	938,502.060	
YAHOO! INC	77,695	48.800	3,791,516.000	
CIMAREX ENERGY CO	6,901	96.120	663,324.120	
TJX COMPANIES INC	59,133	67.400	3,985,564.200	
HOSPIRA INC	15,624	61.550	961,657.200	
GENWORTH FINANCIAL INC	36,757	7.660	281,558.620	
CBRE GROUP INC	20,788	34.500	717,186.000	
LIBERTY GLOBAL PLC	20,004	47.610	952,390.440	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,419	9.540	1,024,777.260	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,276	57.830	73,791.080	
GOOGLE INC-CL A	23,260	497.060	11,561,615.600	
T-MOBILE US INC	19,411	29.270	568,159.970	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,776	55.010	1,858,017.760	
MEDIVATION INC	6,237	104.390	651,080.430	
MOSAIC CO/THE	25,355	46.360	1,175,457.800	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	42,294	33.810	1,429,960.140	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	115,375	35.380	4,081,967.500	
HERBALIFE LTD	7,528	32.730	246,391.440	
CELANESE CORP	11,777	57.870	681,534.990	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	53,093	8.315	441,468.290	
IHS INC-CLASS A	5,758	110.130	634,128.540	

DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	13,414	31.640	424,418.960	
EXPEDIA INC	8,139	85.170	693,198.630	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,691	297.620	1,396,135.420	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,496	126.380	1,958,384.480	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	55,860	46.175	2,579,335.500	
GAMESTOP CORP. - CL. A	11,417	33.770	385,552.090	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,715	215.830	2,096,788.450	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,436	67.130	1,036,218.680	
VIACOM INC-CLASS B	29,086	72.400	2,105,826.400	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,613	711.700	1,859,672.100	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,961	65.920	458,869.120	
TRANSDIGM GROUP INC	4,774	201.250	960,767.500	
MASTERCARD INC	82,552	83.360	6,881,534.720	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	35,147	28.480	1,000,986.560	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	12,025	85.430	1,027,295.750	
HANESBRANDS INC	8,241	110.840	913,432.440	
WESTERN UNION CO	48,136	17.820	857,783.520	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	35,460	23.120	819,835.200	
SPECTRA ENERGY CORP	56,039	33.700	1,888,514.300	
TIME WARNER CABLE INC	23,556	145.740	3,433,051.440	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,191	14.560	279,420.960	
DELTA AIR LINES INC	17,405	46.060	801,674.300	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,164	34.970	180,585.080	
DISCOVER FINANCIAL	39,467	63.020	2,487,210.340	
COVIDIEN PLC	36,776	105.290	3,872,145.040	
TE CONNECTIVITY LTD	33,444	62.960	2,105,634.240	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,077	95.080	958,121.160	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,680	62.590	480,691.200	
VMWARE INC	8,753	80.740	706,717.220	
TERADATA CORP	12,117	42.630	516,547.710	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,907	129.840	637,124.880	
INVESCO LTD	39,506	37.430	1,478,709.580	
NETSUITE INC	3,281	105.370	345,718.970	
CALPINE CORP NPR	26,738	21.810	583,155.780	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	132,841	83.050	11,032,445.050	
VISA INC	40,853	260.020	10,622,597.060	

DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,483	73.230	1,133,820.090	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,289	54.130	881,723.570	
LORILLARD INC	30,497	63.920	1,949,368.240	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	7,259	74.920	543,844.280	
SIGNET JEWELERS LTD	6,095	124.420	758,339.900	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	21,028	30.880	649,344.640	
MARATHON PETROLEUM CORP	24,146	85.420	2,062,551.320	
CAREFUSION CORP	16,819	59.790	1,005,608.010	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	155,188	41.610	6,457,372.680	
XYLEM INC	11,028	34.600	381,568.800	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	36,179	76.150	2,755,030.850	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	20,996	103.160	2,165,947.360	
LINKEDIN CORP	8,789	223.130	1,961,089.570	
HCA HOLDINGS INC	23,874	72.200	1,723,702.800	
NIELSEN NV	26,310	42.800	1,126,068.000	
VERISK ANALYTICS INC	13,285	62.965	836,490.020	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,874	162.110	790,124.140	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,162	141.410	1,012,778.420	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	16,743	100.090	1,675,806.870	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	7,892	49.080	387,339.360	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY INC	30,557	8.240	251,789.680	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	6,012	163.850	985,066.200	
CIT GROUP INC	13,340	45.250	603,635.000	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	330,000	0.685	226,050.000	
DOLLAR GENERAL CORP	24,796	67.110	1,664,059.560	
AON PLC	23,296	93.440	2,176,778.240	
REALOGY HOLDINGS CORP	11,464	45.350	519,892.400	
QEP RESOURCES INC	18,552	19.420	360,279.840	
TESLA MOTORS INC	7,149	202.210	1,445,599.290	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	15,393	49.490	761,799.570	
GENERAL MOTORS CO	106,094	35.840	3,802,408.960	
VANTIV INC	12,141	33.970	412,429.770	
TRIPADVISOR INC	9,263	71.450	661,841.350	
ALLY FINANCIAL INC	29,357	22.570	662,587.490	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	16,570	69.330	1,148,798.100	

VOYA FINANCIAL INC	16,634	40.000	665,360.000	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	24,272	68.890	1,672,098.080	
PHILLIPS 66	46,816	64.240	3,007,459.840	
LIBERTY MEDIA CORP	9,165	35.225	322,837.120	
FACEBOOK INC	163,770	76.720	12,564,434.400	
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	5,356	59.060	316,325.360	
ADT CORP	15,211	34.560	525,692.160	
SERVICENOW INC	10,829	68.190	738,429.510	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,339	127.280	679,547.920	
WORKDAY INC	7,948	83.490	663,578.520	
KRAFT FOODS GROUP INC	49,163	63.540	3,123,817.020	
ABBVIE INC	131,385	65.760	8,639,877.600	
ZOETIS INC	41,066	43.420	1,783,085.720	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	6,507	45.320	294,897.240	
NEWS CORP/NEW-CL A	33,106	15.275	505,694.150	
MALLINCKRODT PLC	10,923	102.460	1,119,170.580	
SPRINT CORP	84,196	4.130	347,729.480	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,766	49.580	732,098.280	
FIREEYE INC	5,217	35.290	184,107.930	
ANTERO RESOURCES CORP	1,568	36.530	57,279.040	
NOBLE CORP PLC	24,088	15.890	382,758.320	
TWITTER INC	28,920	39.370	1,138,580.400	
PERRIGO CO PLC	11,364	169.320	1,924,152.480	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,195	25.450	666,662.750	
GOOGLE INC-CL C	24,123	492.550	11,881,783.650	
NAVIENT CORP	28,699	20.170	578,858.830	
FNF GROUP	21,690	34.960	758,282.400	
LIBERTY MEDIA CORP-C	18,330	35.250	646,132.500	
SYNCHRONY FINANCIAL	14,261	29.530	421,127.330	
QORVO INC	12,235	65.520	801,637.200	
アメリカ・ドル 小計	26,218,236		1,540,770,133.110 (181,826,283,409)	
イギリス・ポンド				
ABERDEEN ASSET MGMT	92,697	4.175	387,009.970	
AMEC FOSTER WHEELER PLC	28,599	7.955	227,505.040	
ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.275	188,458.870	
ASHTED GROUP	38,160	11.170	426,247.200	
SEVERN TRENT PLC	23,162	20.710	479,685.020	
BHP BILLITON PLC	180,741	13.510	2,441,810.910	
BARCLAYS PLC	1,410,749	2.314	3,264,473.180	
BT GROUP PLC	657,931	3.979	2,617,907.440	
SKY PLC	92,843	8.900	826,302.700	
AGGREKO PLC	18,550	15.130	280,661.500	
TULLOW OIL PLC	92,627	3.869	358,373.860	
BUNZL PLC	26,929	18.290	492,531.410	
EASYJET PLC	13,628	16.310	222,272.680	

CAPITA PLC	50,523	10.720	541,606.560	
AVIVA PLC	239,823	4.841	1,160,983.140	
CRODA INTERNATIONAL	9,774	26.520	259,206.480	
DIAGEO PLC	210,873	18.435	3,887,443.750	
SCHRODERS PLC	12,609	26.210	330,481.890	
NATIONAL GRID PLC	325,001	9.206	2,991,959.200	
GKN PLC	134,097	3.485	467,328.040	
KINGFISHER PLC	189,315	3.244	614,137.860	
BAE SYSTEMS PLC	257,944	4.702	1,212,852.680	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	151,954	35.220	5,351,819.880	
COBHAM PLC	88,449	3.310	292,766.190	
NEXT PLC	12,582	69.450	873,819.900	
REXAM PLC	54,770	4.442	243,288.340	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	83,655	29.670	2,482,043.850	
IMI PLC	22,272	12.040	268,154.880	
JOHNSON MATTHEY PLC	18,203	34.910	635,466.730	
SABMILLER PLC	79,110	33.525	2,652,162.750	
ANGLO AMERICAN PLC	120,088	11.400	1,369,003.200	
COMPASS GROUP PLC	148,870	11.090	1,650,968.300	
HSBC HOLDINGS PLC	1,586,419	6.027	9,561,347.310	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	462,703	2.447	1,132,234.240	
ARM HOLDINGS PLC	117,450	9.980	1,172,151.000	
CENTRICA PLC	406,663	2.610	1,061,390.430	
UNILEVER PLC	109,550	26.780	2,933,749.000	
MEGGITT PLC	71,707	5.190	372,159.330	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	128,338	1.769	227,029.920	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	53,266	9.500	506,027.000	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	73,187	4.360	319,095.320	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,107	31.070	935,424.490	
PEARSON PLC	73,025	11.850	865,346.250	
PERSIMMON PLC	23,150	14.680	339,842.000	
PRUDENTIAL PLC	210,454	14.785	3,111,562.390	
RIO TINTO PLC	104,384	29.245	3,052,710.080	
VODAFONE GROUP PLC	2,285,158	2.268	5,182,738.340	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,210	53.300	2,995,993.000	
REED ELSEVIER PLC	91,200	11.000	1,003,200.000	
OLD MUTUAL PLC	422,993	1.908	807,070.640	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	154,737	8.685	1,343,890.840	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	210,422	3.685	775,405.070	
TRAVIS PERKINS PLC	19,895	17.970	357,513.150	

SSE PLC	83,923	15.030	1,261,362.690	
BP PLC	1,516,898	3.965	6,014,500.570	
SHIRE PLC	48,674	47.010	2,288,164.740	
SAGE GROUP PLC(THE)	98,062	4.650	455,988.300	
SMITHS GROUP PLC	27,324	10.670	291,547.080	
STANDARD CHARTERED PLC	212,238	9.212	1,955,136.450	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,802,206	0.735	3,529,621.410	
TATE & LYLE PLC	20,845	6.430	134,033.350	
BG GROUP PLC	281,725	8.000	2,253,800.000	
TESCO PLC	658,849	2.045	1,347,346.200	
3I GROUP PLC	88,649	4.298	381,013.400	
SMITH & NEPHEW PLC	80,528	11.800	950,230.400	
GLAXOSMITHKLINE PLC	409,687	14.125	5,786,828.870	
WEIR GROUP	18,336	17.230	315,929.280	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	15,672	21.930	343,686.960	
BABCOCK INT'L GROUP	24,605	10.200	250,971.000	
WPP PLC	105,982	13.800	1,462,551.600	
WOLSELEY PLC	20,425	36.640	748,372.000	
ASTRAZENECA PLC	103,616	46.725	4,841,457.600	
WHITBREAD PLC	13,806	47.740	659,098.440	
CARNIVAL PLC	14,275	30.630	437,243.250	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	131,038	4.483	587,443.350	
INTERTEK GROUP PLC	13,446	23.930	321,762.780	
WILLIAM HILL PLC	60,095	3.545	213,036.770	
BURBERRY GROUP PLC	41,539	16.630	690,793.570	
INVESTEC PLC	50,655	5.330	269,991.150	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,882	26.360	471,369.520	
ICAP PLC	52,823	4.395	232,157.080	
ITV PLC	345,353	2.125	733,875.120	
SAINSBURY (J) PLC	89,174	2.403	214,285.120	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	8,673	50.200	435,384.600	
G4S PLC	124,374	2.750	342,028.500	
ADMIRAL GROUP PLC	22,361	13.680	305,898.480	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	322,829	20.785	6,710,000.760	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	204,595	21.265	4,350,712.670	
INMARSAT PLC	46,334	8.170	378,548.780	
PETROFAC LTD	28,374	6.080	172,513.920	
STANDARD LIFE PLC	187,787	3.894	731,242.570	
EXPERIAN PLC	77,318	10.900	842,766.200	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC	17,067	6.940	118,444.980	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	25,927	9.365	242,806.350	
MELROSE INDUSTRIES PLC	90,508	2.663	241,022.800	
FRESNILLO PLC NPR	10,457	8.255	86,322.530	

	FRIENDS LIFE GROUP LTD	122,660	3.650	447,709.000	
	GLENCORE PLC	915,457	2.794	2,557,786.850	
	DIXONS CARPHONE PLC	72,841	4.500	327,784.500	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	107,350	3.021	324,304.350	
	COCA-COLA HBC AG	18,432	11.250	207,360.000	
	ROYAL MAIL PLC	64,647	4.211	272,228.510	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	39,861	3.899	155,418.030	
	TUI AG-NEW	19,394	10.930	211,976.420	
イギリス・ボンド	小計	23,579,027		136,460,472.050 (24,435,976,729)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	133,450	18.300	2,442,135.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	13.150	1,634,150.500	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	6.709	1,262,835.070	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	59,178	28.640	1,694,857.920	
	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	75,781	225.700	17,103,771.700	
イスラエル・シュケル	小計	580,909		24,137,750.190 (724,615,261)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,795	58.410	747,355.950	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	225,661	32.230	7,273,054.030	
	AMCOR LTD	84,976	13.150	1,117,434.400	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	254,695	33.340	8,491,531.300	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	33,702	11.950	402,738.900	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	149,206	2.690	401,364.140	
	TELSTRA CORP LTD	346,377	6.040	2,092,117.080	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	31,874	12.900	411,174.600	
	AMP LTD	240,810	5.540	1,334,087.400	
	ASX LTD	18,724	36.950	691,851.800	
	BHP BILLITON LTD	275,670	28.510	7,859,351.700	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	14,149	34.930	494,224.570	
	ALS LTD	34,895	5.040	175,870.800	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	47,699	3.440	164,084.560	
	COMPUTERSHARE LT	50,472	12.210	616,263.120	
	CSL LIMITED	40,309	86.670	3,493,581.030	
	REA GROUP LTD	5,318	45.770	243,404.860	
	TRANSURBAN GROUP	159,479	8.800	1,403,415.200	
	COCA-COLA AMATIL LTD	60,500	9.250	559,625.000	
	COCHLEAR LTD	5,226	81.160	424,142.160	
ORIGIN ENERGY LTD	84,610	11.130	941,709.300		

COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	132,986	85.650	11,390,250.900		
BORAL LIMITED	43,430	5.460	237,127.800		
RIO TINTO LIMITED	34,809	58.500	2,036,326.500		
APA GROUP	114,969	7.750	891,009.750		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	174,456	6.460	1,126,985.760		
TPG TELECOM LTD	12,142	6.500	78,923.000		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,423	34.530	152,726.190		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	12.850	459,901.500		
ORICA LTD	34,301	18.430	632,167.430		
LEIGHTON HLDGS LTD	11,538	21.420	247,143.960		
SYDNEY AIRPORT	115,539	4.900	566,141.100		
MACQUARIE GROUP LTD	25,913	57.200	1,482,223.600		
WORLEYPARSONS LTD	23,411	9.030	211,401.330		
SUNCORP GROUP LTD	114,181	14.250	1,627,079.250		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	201,492	33.920	6,834,608.640		
NEWCREST MINING LTD	74,849	12.480	934,115.520		
INCITEC PIVOT LTD	165,148	3.440	568,109.120		
TOLL HOLDINGS LTD	72,011	6.110	439,987.210		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	43,622	2.430	106,001.460		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	106,137	11.070	1,174,936.590		
SANTOS LTD	84,284	7.290	614,430.360		
SONIC HEALTHCARE	33,734	18.380	620,030.920		
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.180	295,843.680		
WESFARMERS LTD	101,292	42.430	4,297,819.560		
ALUMINA LIMITED	184,613	1.885	347,995.500		
ILUKA RESOURCES LIM I	45,912	6.200	284,654.400		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	57,923	36.350	2,105,501.050		
WOOLWORTHS LTD	105,245	30.070	3,164,717.150		
METCASH LTD	79,084	1.625	128,511.500		
SEEK LTD	29,830	17.290	515,760.700		
TATTS GROUP LTD	141,350	3.560	503,206.000		
AGL ENERGY LTD	48,662	13.710	667,156.020		
BRAMBLES LTD	123,431	10.600	1,308,368.600		
ASCIANO LTD	74,924	6.010	450,293.240		
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.230	401,890.030		
AURIZON HOLDINGS LTD	142,831	4.610	658,450.910		
TREASURY WINE ESTATES LTD	56,402	4.640	261,705.280		
MEDIBANK PVT LTD	234,849	2.400	563,637.600		
オーストラリア・ドル 小計	5,366,297		87,725,521.010 (8,433,931,590)		
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,334	37.000	641,358.000	

ALIMENTATION COUCHE TARD INC	38,448	45.350	1,743,616.800	
BARRICK GOLD CORP	89,708	13.580	1,218,234.640	
ATCO LTD	7,193	47.720	343,249.960	
TALISMAN ENERGY INC	100,146	8.990	900,312.540	
BANK OF MONTREAL	49,807	77.520	3,861,038.640	
BANK OF NOVA SCOTIA	96,454	62.070	5,986,899.780	
NATIONAL BANK OF CANADA	29,276	45.840	1,342,011.840	
BCE INC	21,413	54.880	1,175,145.440	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	46,731	61.340	2,866,479.540	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	27,472	186.190	5,115,011.680	
BOMBARDIER INC 'B'	97,503	3.930	383,186.790	
SAPUTO INC	25,590	34.300	877,737.000	
BLACKBERRY LTD	38,780	12.110	469,625.800	
CGI GROUP INC	17,094	44.050	752,990.700	
CAE INC	31,436	14.840	466,510.240	
CAMECO CORP	29,078	18.540	539,106.120	
ROGERS COMM-CL B	29,459	46.200	1,361,005.800	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,423	93.150	3,113,352.450	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,278	31.810	2,967,173.180	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,877	120.490	828,609.730	
CANADIAN UTILITIES LTD	8,537	41.340	352,919.580	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	65,516	78.990	5,175,108.840	
AGRIUM INC	11,307	120.420	1,361,588.940	
YAMANA GOLD INC	67,520	5.680	383,513.600	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,491	66.550	764,726.050	
OPEN TEXT CORP	12,014	67.080	805,899.120	
ELDORADO GOLD CORP	46,790	8.400	393,036.000	
EMPIRE CO LTD	5,031	87.450	439,960.950	
KINROSS GOLD CORP	125,461	4.140	519,408.540	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,160	22.320	383,011.200	
FORTIS INC	20,884	39.490	824,709.160	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,435	15.820	750,421.700	
TELUS CORP	18,945	41.850	792,848.250	
GREAT WEST LIFECO INC	24,837	32.400	804,718.800	
IMPERIAL OIL LTD	22,883	45.340	1,037,515.220	
ENBRIDGE INC	73,421	54.630	4,010,989.230	
IGM FINANCIAL INC	3,211	44.380	142,504.180	
MANULIFE FINANCIAL CORP	155,082	21.330	3,307,899.060	
LOBLAW CO LTD	17,936	59.750	1,071,676.000	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	33,447	5.010	167,569.470	

INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	9,630	42.230	406,674.900	
MAGNA INTERNATIONAL INC	17,322	124.540	2,157,281.880	
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,112	40.050	1,966,935.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,940	598.500	1,161,090.000	
METRO INC	7,620	91.550	697,611.000	
HUSKY ENERGY INC	26,989	25.080	676,884.120	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,920	27.230	1,005,331.600	
METHANEX CORP	9,418	54.550	513,751.900	
ONEX CORP	10,676	65.470	698,957.720	
GOLDCORP INC	75,826	25.720	1,950,244.720	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	69,901	43.170	3,017,626.170	
POWER CORP OF CANADA	32,563	30.430	990,892.090	
POWER FINANCIAL CORP	23,521	34.710	816,413.910	
ROYAL BANK OF CANADA	122,071	76.810	9,376,273.510	
SNC-LAVALIN GROUP INC	16,326	41.050	670,182.300	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	14,033	212.160	2,977,241.280	
SHAW COMM INC-B	30,249	31.320	947,398.680	
NEW GOLD INC	51,627	5.640	291,176.280	
SUNCOR ENERGY INC	120,968	34.320	4,151,621.760	
ENCANA CORP	59,596	15.140	902,283.440	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,683	15.590	681,017.970	
THOMSON REUTERS CORP	29,905	46.340	1,385,797.700	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	159,434	52.090	8,304,917.060	
TRANSCANADA CORP	58,122	53.510	3,110,108.220	
TRANSALTA CORP	34,014	10.900	370,752.600	
WESTON (GEORGE) LTD	4,743	95.960	455,138.280	
INTACT FINANCIAL CORP	12,288	82.500	1,013,760.000	
SILVER WHEATON CORP	28,408	27.260	774,402.080	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,344	340.450	457,564.800	
CATAMARAN CORP	16,398	59.100	969,121.800	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	11,057	64.930	717,931.010	
CI FINANCIAL CORP	16,122	31.350	505,424.700	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	35.780	564,572.620	
KEYERA CORP	8,738	76.900	671,952.200	
ALTAGAS LTD	12,358	38.720	478,501.760	
PEMBINA PIPELINE CORP	23,194	38.820	900,391.080	
DOLLARAMA INC	9,286	57.900	537,659.400	
BAYTEX ENERGY CORP	11,962	16.340	195,459.080	
MEG ENERGY CORP	14,673	15.170	222,589.410	
CENOVUS ENERGY INC W/I	61,276	23.010	1,409,960.760	
ENERPLUS CORP	20,814	9.850	205,017.900	

	VERMILION ENERGY INC	8,291	46.550	385,946.050	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	52,457	1.930	101,242.010	
	ARC RESOURCES LTD	20,372	20.960	426,997.120	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	47,227	7.370	348,062.990	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	11,168	29.990	334,928.320	
	INTER PIPELINE LTD	29,717	31.510	936,382.670	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,330	26.260	245,005.800	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	16,471	47.570	783,525.470	
カナダ・ドル 小計		3,290,347		123,312,684.280 (12,154,931,289)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.380	422,500.000	
	SEBFCORP INDUSTRIES	92,000	4.170	383,640.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	169,000	4.130	697,970.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	473,640	0.460	217,874.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	147,000	20.030	2,944,410.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	10.120	374,440.000	
	SEBFCORP MARINE	108,000	3.040	328,320.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,000	39.770	517,010.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,000	7.930	689,910.000	
	CAPITALAND LTD	276,000	3.220	888,720.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	584,400	1.020	596,088.000	
	KEPPEL CORP LTD	106,500	8.290	882,885.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	202,000	2.530	511,060.000	
	NOBLE GROUP LTD/SINGAPORE	411,763	1.100	452,939.300	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	208,725	10.430	2,177,001.750	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	631,867	3.900	2,464,281.300	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,400	12.500	817,500.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,000	23.480	2,207,120.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.240	648,000.000	
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	231,000	1.290	297,990.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	285,000	2.480	706,800.000		
シンガポール・ドル 小計		4,548,295		19,226,459.750 (1,699,619,042)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	130,323	23.500	3,062,590.500	
	SYNGENTA AG	7,554	333.000	2,515,482.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	265,687	73.250	19,461,572.750	
	CIE FINANC RICHEMONT	44,464	89.900	3,997,313.600	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	57,784	282.600	16,329,758.400	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,842	145.900	706,447.800	
	SIKA INHABER	188	2,998.000	563,624.000	
	SGS SA-REG	458	2,027.000	928,366.000	
	SULZER AG-REG	1,118	100.300	112,135.400	
	NOVARTIS AG-REG SHS	189,407	97.300	18,429,301.100	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,687	127.500	470,092.500	
	SWISSCOM AG-REG	2,309	515.000	1,189,135.000	
	ABB LTD	188,239	20.250	3,811,839.750	
	ADECCO SA-REG	12,185	68.900	839,546.500	
	GEBERIT AG	3,062	357.300	1,094,052.600	
	LONZA GROUP AG-REG	3,997	121.100	484,036.700	
	LINDT & SPRUENGLI PART	91	5,025.000	457,275.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	58,145.000	523,305.000	
	GIVAUDAN-REG	758	1,925.000	1,459,150.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,931	316.100	3,771,389.100	
	HOLCIM LTD-REG	20,064	71.200	1,428,556.800	
	ACTELION	9,776	120.400	1,177,030.400	
	SONOVA HOLDING AG	4,519	146.200	660,677.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,453	137.000	610,061.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,189	445.700	975,637.300	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,552	85.150	472,752.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,785	236.200	657,817.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	808	410.250	331,482.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,477	75.450	413,239.650	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,010	290.750	584,407.500	
	ARYZTA AG	8,596	75.500	648,998.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,352	45.190	919,706.880	
	SWISS RE LTD	31,693	84.600	2,681,227.800	
	TRANSOCEAN LTD	26,823	15.590	418,170.570	
	UBS GROUP AG	308,288	16.670	5,139,160.960	
スイス・フラン	小計	1,381,478		97,325,340.160 (11,321,856,820)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,851	220.000	11,627,220.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,459	201.300	8,546,996.700	
	ELEKTA AB	18,233	85.100	1,551,628.300	
	ERICSSON LM-B SHS	249,528	98.500	24,578,508.000	
	GETINGE AB-B SHS	14,684	169.100	2,483,064.400	
	SKF AB-B SHS	40,686	167.500	6,814,905.000	
	SANDVIK AB	77,917	73.800	5,750,274.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	125,807	93.700	11,788,115.900	
	SKANSKA AB-B SHS	25,753	173.900	4,478,446.700	
	SWEDBANK AB	80,565	185.000	14,904,525.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	43,424	170.000	7,382,080.000	

	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	42,643	356.000	15,180,908.000	
	VOLVO AB-B SHS	118,487	89.000	10,545,343.000	
	SWEDISH MATCH AB	21,596	256.000	5,528,576.000	
	TELE2 AB-B SHS	24,305	93.300	2,267,656.500	
	NORDEA AB	274,104	88.100	24,148,562.400	
	INDUSTRIVARDEN C	18,353	135.000	2,477,655.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,296	225.900	3,907,166.400	
	SECURITAS AB-B SHS	27,261	95.150	2,593,884.150	
	INVESTOR AB-B SHS	35,865	275.400	9,877,221.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	77,198	325.300	25,112,509.400	
	ASSA ABLOY AB-B	26,496	428.200	11,345,587.200	
	TELIASONERA AB	194,938	50.900	9,922,344.200	
	LUNDIN PETROLEUM AB	17,555	104.700	1,838,008.500	
	BOLIDEN AB	17,761	131.400	2,333,795.400	
	ALFA LAVAL AB	31,389	138.600	4,350,515.400	
	KINNEVIK INVESTMENT B	23,218	246.200	5,716,271.600	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,145	528.500	2,719,132.500	
	ICA GRUPPEN AB	5,738	314.600	1,805,174.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	31,087	58.550	1,820,143.850	
	HEXAGON AB	21,871	252.800	5,528,988.800	
スウェーデン・クローナ 小計		1,804,213		248,925,208.700 (3,644,265,055)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,563	473.100	3,578,055.300	
	A P MOLLER A/S	620	12,400.000	7,688,000.000	
	AP MOLLER MAERSK A	310	11,940.000	3,701,400.000	
	DANSKE BANK A/S	56,971	160.000	9,115,360.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,620	270.700	5,311,134.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	169,532	274.500	46,536,534.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	22,090	234.600	5,182,314.000	
	TDC A/S	84,208	48.000	4,041,984.000	
	COLOPLAST-B	10,474	528.000	5,530,272.000	
	DSV A/S	15,918	196.000	3,119,928.000	
	WILLIAM DEMANT	2,595	474.100	1,230,289.500	
	PANDORA A/S	9,254	467.100	4,322,543.400	
デンマーク・クローネ 小計		399,155		99,357,814.200 (1,865,939,751)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	137,108	4.250	582,709.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	73,992	8.390	620,792.880	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	209,231	3.160	661,169.960	
ニュージーランド・ドル 小計		420,331		1,864,671.840 (170,953,114)	
ノルウェー・クローネ	DNB ASA	88,892	103.000	9,155,876.000	
	NORSK HYDRO ASA	107,062	41.340	4,425,943.080	
	TELENOR ASA	65,096	158.200	10,298,187.200	

	SUBSEA 7 SA	22,609	69.200	1,564,542.800	
	ORKLA ASA	43,472	51.600	2,243,155.200	
	STATOIL ASA	94,525	125.800	11,891,245.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,544	394.800	5,347,171.200	
	SEADRILL LTD	38,772	73.650	2,855,557.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,655	123.300	1,437,061.500	
	ノルウェー・クローネ 小計	485,627		49,218,739.780 (753,046,718)	
ユーロ	CRH PLC	62,226	19.490	1,212,784.740	
	KERRY GROUP PLC-A	14,215	57.450	816,651.750	
	BANK OF IRELAND	2,422,842	0.292	707,469.860	
	UMICORE	10,008	32.055	320,806.440	
	AIR LIQUIDE	28,580	101.450	2,899,441.000	
	AIRBUS GROUP NV	49,675	44.950	2,232,891.250	
	AXA	156,101	18.740	2,925,332.740	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,430	14.605	415,220.150	
	ADIDAS AG	18,603	56.590	1,052,743.770	
	ASSICURAZIONI GENERALI	96,101	16.950	1,628,911.950	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	28,481	16.810	478,765.610	
	DANONE	45,362	54.210	2,459,074.020	
	SAFRAN SA	24,711	54.010	1,334,641.110	
	INTESA SANPAOLO	945,546	2.326	2,199,339.990	
	INTESA SANPAOLO-RNC	113,165	2.074	234,704.210	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,991	88.650	2,481,402.150	
	ACCOR SA	12,175	37.315	454,310.120	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	5,933	40.560	240,642.480	
	BOUYGUES	12,132	30.580	370,996.560	
	BNP PARIBAS	90,026	45.295	4,077,727.670	
	REED ELSEVIER NV	58,088	19.785	1,149,271.080	
	THALES SA	8,128	46.215	375,635.520	
	CAP GEMINI SA	12,883	59.960	772,464.680	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,109	74.130	304,600.170	
	CHRISTIAN DIOR	4,128	143.650	592,987.200	
	ALCATEL-LUCENT	250,589	2.859	716,433.950	
	UNICREDIT SPA	376,340	4.968	1,869,657.120	
	NATIXIS	70,166	5.264	369,353.820	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,718	46.485	637,681.230	
	DELHAIZE GROUP	10,182	63.750	649,102.500	
	COMMERZBANK AG	80,064	10.500	840,672.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	27,811	44.995	1,251,355.940	
	UNITED INTERNET	9,768	38.980	380,756.640	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	4,800	32.895	157,896.000	
	PUBLICIS GROUPE	14,367	59.730	858,140.910	
	MAN SE	3,396	92.740	314,945.040	
	IBERDROLA SA	433,586	5.509	2,388,625.270	

ENI SPA	216,606	13.690	2,965,336.140	
JERONIMO MARTINS	19,517	8.153	159,122.100	
KBC GROUPE	20,590	44.800	922,432.000	
LAFARGE SA	17,314	57.840	1,001,441.760	
HANNOVER RUECK SE	2,391	75.410	180,305.310	
WARTSILA OYJ	13,904	35.100	488,030.400	
L'OREAL	20,721	140.900	2,919,588.900	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	23,740	131.950	3,132,493.000	
LAGARDERE S.C.A.	7,114	22.300	158,642.200	
GEA GROUP AG	16,205	36.405	589,943.020	
BOLLORE	19,700	3.740	73,678.000	
MEDIOBANCA SPA	55,752	6.540	364,618.080	
MICHELIN(CGDE)-B	16,223	75.760	1,229,054.480	
CONTINENTAL AG	9,083	176.050	1,599,062.150	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,250	26.615	2,162,468.750	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	20.310	190,893.690	
AXEL SPRINGER SE	6,021	51.120	307,793.520	
OMV AG	15,010	21.415	321,439.150	
PERNOD-RICARD	17,525	96.750	1,695,543.750	
PEUGEOT SA	38,593	10.600	409,085.800	
PIRELLI & C	14,123	11.090	156,624.070	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	14,295	67.150	959,909.250	
RENAULT SA	15,554	59.380	923,596.520	
REPSOL SA	91,718	14.410	1,321,656.380	
REMY COINTREAU	905	56.460	51,096.300	
MERCK KGAA	9,627	83.210	801,062.670	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	66,077	96.210	6,357,268.170	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	40,143	33.990	1,364,460.570	
SAIPEM	28,190	7.205	203,108.950	
RWE AG	41,149	23.100	950,541.900	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV VVPR	39,408	0.001	39.400	
LUXOTTICA GROUP SPA	16,499	47.590	785,187.410	
SOCIETE GENERALE-A	60,206	33.445	2,013,589.670	
VINCI S.A.	39,349	47.635	1,874,389.610	
SODEXO	7,368	81.220	598,428.960	
SOLVAY SA	5,034	106.900	538,134.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,801	59.560	2,608,787.560	
VIVENDI SA	100,016	20.365	2,036,825.840	
SAP SE	76,018	57.050	4,336,826.900	
TECHNIP-COFLEXIP S.A.	9,593	45.870	440,030.910	
TELEFONICA S.A	354,795	11.470	4,069,498.650	
TOTAL SA	180,345	41.280	7,444,641.600	
VALLOUREC	11,847	19.380	229,594.860	
VALEO	6,764	109.800	742,687.200	
E.ON SE	157,708	13.065	2,060,455.020	

VOEST-ALPINE AG	9,875	30.050	296,743.750	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	28.720	438,899.040	
HENKEL AG & CO KGAA	8,614	83.200	716,684.800	
METRO AG	11,655	25.560	297,901.800	
SIEMENS AG-REG	67,294	93.440	6,287,951.360	
UPM-KYMMENE OYJ	46,308	14.060	651,090.480	
ING GROEP NV-CVA	322,508	10.425	3,362,145.900	
BAYER AG	68,336	115.300	7,879,140.800	
STORA ENSO OYJ-R SHS	44,611	7.575	337,928.320	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,659	93.140	1,365,339.260	
DAIMLER AG	81,250	71.000	5,768,750.000	
BASF SE	77,500	68.810	5,332,775.000	
BEIERSDORF AG	7,979	69.880	557,572.520	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,234	59.560	788,217.040	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,505	62.790	1,161,928.950	
ORANGE	156,256	14.390	2,248,523.840	
SAMPO OYJ-A SHS	36,337	39.020	1,417,869.740	
RANDSTAD HOLDINGS	8,678	40.685	353,064.430	
ALLIANZ SE	38,893	136.600	5,312,783.800	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.150	601,946.100	
KONINKLIJKE AHOLD NV	71,470	15.045	1,075,266.150	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG	16,917	35.785	605,374.840	
HERMES INTL	1,446	285.000	412,110.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,299	14.300	390,375.700	
ERSTE GROUP BANK AG	22,063	19.500	430,228.500	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	14,486	163.050	2,361,942.300	
ARCELOR MITTAL (NL)	89,645	8.527	764,402.910	
SOCIETE BIC SA	3,322	109.750	364,589.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,074	50.040	554,142.960	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,337	28.320	377,703.840	
HEINEKEN NV	21,379	58.930	1,259,864.470	
AKZO NOBEL	20,652	59.480	1,228,380.960	
ASML HOLDING NV	30,604	87.890	2,689,785.560	
AEGON NV	167,051	5.993	1,001,136.640	
BANKINTER S.A.	52,241	6.423	335,543.940	
VOLKSWAGEN AG	3,700	178.150	659,155.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	12,808	181.750	2,327,854.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	510,073	7.377	3,762,808.520	
KERING	6,033	162.150	978,250.950	
CNP ASSURANCES	22,463	14.395	323,354.880	
FORTUM OYJ	27,087	17.460	472,939.020	
AGEAS	19,877	28.885	574,147.140	
UCB SA	10,367	64.840	672,196.280	
THYSSENKRUPP AG	36,583	20.940	766,048.020	

UNILEVER NV-CVA	133,150	33.160	4,415,254.000	
CARREFOUR SA	50,201	24.445	1,227,163.440	
GAS NATURAL SDG SA	34,711	19.175	665,583.420	
ATOS	6,025	64.630	389,395.750	
NOKIA OYJ	317,729	6.410	2,036,642.890	
TUI AG	19,196	14.405	276,518.380	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	78,582	23.785	1,869,072.870	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,671	25.570	630,837.470	
SANOFI	98,091	75.930	7,448,049.630	
IMMOFINANZ AG	131,110	2.151	282,017.610	
STMICROELECTRONICS NV	59,010	6.451	380,673.510	
ELISA OYJ	13,898	23.050	320,348.900	
BANCO SANTANDER SA	1,046,843	6.050	6,333,400.150	
METSO OYJ	10,879	24.740	269,146.460	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	6,801	71.840	488,583.840	
QIAGEN N.V.	19,737	19.425	383,391.220	
LINDE AG	15,570	154.300	2,402,451.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	116,699	23.910	2,790,273.090	
BMW VORZUG	4,116	67.180	276,512.880	
K & S	18,588	24.170	449,271.960	
ENEL SPA	523,816	3.446	1,805,069.930	
COLRUYT NV	4,076	39.530	161,124.280	
VOPAK (KON.)	5,364	49.805	267,154.020	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,385,733	0.067	226,844.110	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	269,083	13.605	3,660,874.210	
BANCO POPULAR ESPANOL	155,650	3.991	621,199.150	
FINMECCANICA SPA	34,431	7.785	268,045.330	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	103,908	8.858	920,417.060	
KONINKLIJKE KPN NV	257,686	2.530	651,945.580	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.120	195,023.040	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,063	62.000	1,057,906.000	
BANCO SABADELL	269,488	2.105	567,272.240	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,333	69.640	371,390.120	
GROUPE BRUX LAMBERT-STR VVPR	516	0.001	0.510	
FRAPORT AG	3,149	49.980	157,387.020	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	52.740	422,658.360	
INDITEX	93,857	23.620	2,216,902.340	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	269,372	0.463	124,719.230	
ANDRITZ AG	4,704	46.275	217,677.600	
MAPFRE SA	80,219	2.770	222,206.630	
ESSILOR INTL	18,032	93.710	1,689,778.720	
SNAM SPA	126,865	3.966	503,146.590	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	9.995	855,422.070	
ENAGAS	16,043	25.000	401,075.000	

WENDEL	1,994	89.990	179,440.060	
TENARIS SA	33,458	11.400	381,421.200	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	74,954	5.315	398,380.510	
TELECOM ITALIA SPA	873,707	0.866	756,630.260	
TELECOM ITALIA-RNC	432,141	0.692	299,041.570	
ATLANTIA SPA	33,870	20.600	697,722.000	
ILIAD SA	2,821	200.250	564,905.250	
BELGACOM SA	13,498	30.100	406,289.800	
SES FDR	28,786	31.685	912,084.410	
TERNA SPA	138,625	3.594	498,218.250	
GRIFOLS SA	13,410	32.330	433,545.300	
FERROVIAL SA	33,893	16.645	564,148.980	
LANXESS MANUFACTURES POLYMERS	6,856	34.540	236,806.240	
EXOR SPA	9,585	34.150	327,327.750	
NESTE OIL OYJ	10,692	20.750	221,859.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,099	10.840	98,633.160	
KONE OYJ	25,273	37.210	940,408.330	
GDF SUEZ	119,536	18.280	2,185,118.080	
ALSTOM	17,252	26.975	465,372.700	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,025	45.220	227,230.500	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	17,450	29.345	512,070.250	
ELECTRICITE DE FRANCE	16,174	21.490	347,579.260	
DEUTSCHE WOHNEN AG	19,531	20.380	398,041.780	
ARKEMA SA	5,658	54.650	309,209.700	
LEGRAND SA	23,768	41.680	990,650.240	
ADP	1,609	103.200	166,048.800	
ORION OYJ	8,051	26.670	214,720.170	
RTL GROUP SA	1,270	79.360	100,787.200	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	34,018	7.999	272,109.980	
SYMRISE AG	9,463	52.800	499,646.400	
SCOR SE	14,425	24.700	356,297.500	
REXEL SA	20,799	14.500	301,585.500	
PRYSMIAN SPA	14,445	14.850	214,508.250	
BANCO POPOLARE SC	34,687	8.915	309,234.600	
CAIXABANK	163,859	4.174	683,947.460	
BUREAU VERITAS SA	23,255	17.550	408,125.250	
GROUPE EUROTUNNEL SA	46,533	11.170	519,773.610	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	22,673	14.575	330,458.970	
GDF SUEZ-STRIP VVPR	3,318	0.001	3.310	
AMADEUS IT HOLDING SA	37,149	33.765	1,254,335.980	
TNT EXPRESS NV W/I	26,687	5.444	145,284.020	
ENEL GREEN POWER SPA	71,844	1.675	120,338.700	
BRENNTAG AG	15,483	44.880	694,877.040	

	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	91,411	5.990	547,551.890	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	58,607	5.282	309,562.170	
	DELTA LLOYD NV	19,898	17.430	346,822.140	
	EDENRED	18,682	22.525	420,812.050	
	BANKIA SA	431,169	1.195	515,246.950	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	63,554	4.512	286,755.640	
	HUGO BOSS AG -ORD	2,985	102.000	304,470.000	
	OSRAM LICHT AG	9,503	34.425	327,140.770	
	GEMALTO	5,952	68.240	406,164.480	
	DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN SE	14,979	27.650	414,169.350	
	OCI NV	6,901	28.405	196,022.900	
	CNH INDUSTRIAL NV	84,201	6.480	545,622.480	
	NUMERICABLE-SFR	9,058	40.195	364,086.310	
	ALTICE SA	5,487	61.840	339,316.080	
	NN GROUP NV	12,746	23.905	304,693.130	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	77,674	10.170	789,944.580	
	REPSOL SA-RTS	91,698	0.443	40,622.210	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA-RTS	510,048	0.075	38,253.600	
	BANCO POPULAR ESPANOL SA-RTS	155,650	0.017	2,646.050	
ユーロ	小計	22,304,874		252,841,658.530 (35,327,036,530)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	218,000	21.200	4,621,600.000	
	BANK OF EAST ASIA	111,660	31.200	3,483,792.000	
	CLP HOLDINGS LTD	177,000	67.150	11,885,550.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	7.220	3,843,928.000	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	119,000	143.200	17,040,800.000	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	59.550	2,917,950.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	95,500	178.600	17,056,300.000	
	MTR CORP	133,500	32.900	4,392,150.000	
	HANG SENG BANK LTD	74,200	128.100	9,505,020.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	97,870	53.450	5,231,151.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	130,500	76.050	9,924,525.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	142,750	61.000	8,707,750.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	621,214	17.520	10,883,669.280	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	185,000	98.350	18,194,750.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,000	38.950	7,361,550.000	

BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	381,500	26.100	9,957,150.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	574,266	9.150	5,254,533.900	
SINO LAND CO	355,400	12.360	4,392,744.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	153,000	119.500	18,283,500.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	57,500	101.300	5,824,750.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	90,500	25.600	2,316,800.000	
WHEELLOCK & CO LTD	107,000	40.200	4,301,400.000	
SJM HOLDINGS LTD	196,000	11.660	2,285,360.000	
WYNN MACAU LTD	169,600	20.400	3,459,840.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	42,000	18.000	756,000.000	
AIA GROUP LTD	1,008,600	43.000	43,369,800.000	
HKT TRUST / HKT LTD	98,000	9.530	933,940.000	
SANDS CHINA LTD	179,600	36.550	6,564,380.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	163,200	23.950	3,908,640.000	
香港・ドル 小計	6,452,760		246,659,323.680 (3,754,154,906)	
合計	96,831,549		286,112,610,214 (286,112,610,214)	

(2) 株式以外の有価証券

平成27年1月13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	DEXUS PROPERTY GROUP	87,929.000	633,088.800	
		FEDERATION CENTRES	146,114.000	428,114.020	
		GOODMAN GROUP	155,160.000	909,237.600	
		GPT GROUP	73,257.000	324,528.510	
		LEND LEASE GROUP	46,860.000	774,127.200	
		MIRVAC GROUP	235,066.000	433,696.770	
		NOVION PROPERTY GROUP	235,579.000	511,206.430	
		SCENTRE GROUP	412,770.000	1,514,865.900	
		STOCKLAND	210,736.000	882,983.840	
		WESTFIELD CORP	166,693.000	1,590,251.220	
	オーストラリア・ドル 小計		1,770,164.000	8,002,100.290 (769,321,921)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	127,906.000	315,927.820	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	211,000.000	379,800.000	
		CAPITAMALL TRUST	294,800.000	613,184.000	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		117,000.000	228,735.000		
シンガポール・ドル 小計		750,706.000	1,537,646.820 (135,927,979)		
投資信託受益証券 合計			2,520,870	905,249,900 (905,249,900)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	26,719.000	585,146.100	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	65,404.000	617,413.760	
		AMERICAN TOWER CORP	33,235.000	3,289,600.300	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	88,038.000	951,690.780	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,610.000	2,029,195.800	
	BOSTON PROPERTIES INC	12,785.000	1,768,676.900	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	494,755.200	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	27,842.000	2,269,679.840	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	10,854.000	746,972.280	
	DUKE REALTY TRUST	28,754.000	615,048.060	
	EQUITY RESIDENTIAL	29,194.000	2,273,920.660	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,825.000	1,071,343.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,741.000	818,953.650	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,720.000	1,419,820.800	
	HCP INC	39,145.000	1,851,558.500	
	HEALTH CARE REIT INC	23,302.000	1,880,238.380	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	58,146.000	1,383,293.340	
	IRON MOUNTAIN INC	13,906.000	546,783.920	
	KIMCO REALTY	32,980.000	880,566.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	10,299.000	411,033.090	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,352.000	583,482.400	
	PROLOGIS INC	40,935.000	1,825,701.000	
	PUBLIC STORAGE	13,351.000	2,645,500.650	
	RAYONIER INC	10,834.000	311,910.860	
	REALTY INCOME CORP	16,761.000	855,313.830	
	REGENCY CENTERS CORP	6,286.000	429,648.100	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	26,810.000	5,275,135.600	
	SL GREEN	8,526.000	1,088,940.720	
	THE MACERICH COMPANY	12,185.000	1,074,595.150	
	UDR INC	21,797.000	705,786.860	
	VENTAS INC	24,040.000	1,849,637.600	
	VORNADO REALTY TRUST	14,028.000	1,745,223.480	
	WEYERHAEUSER CO	47,879.000	1,750,935.030	
	アメリカ・ドル 小計	832,568.000	46,047,501.640 (5,434,065,669)	
イギリス・債券	BRITISH LAND CO PLC	82,388.000	645,921.920	
	HAMMERSON PLC	68,046.000	424,607.040	
	INTU PROPERTIES PLC	89,110.000	299,231.380	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	63,231.000	754,345.830	
	SEGRO PLC	42,345.000	169,252.960	
	イギリス・債券 小計	345,120.000	2,293,359.130 (410,671,819)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	9,731.000	228,191.950	

		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	15,764.000	454,003.200	
カナダ・ドル 小計			25,495.000	682,195.150 (67,243,976)	
ユーロ		CORIO NV	4,425.000	193,372.500	
		FONCIERE DES REGIONS	2,592.000	205,079.040	
		GECINA SA	1,083.000	116,964.000	
		ICADE	3,001.000	207,069.000	
		KLEPIERRE	9,740.000	374,016.000	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	8,582.000	1,891,472.800	
ユーロ 小計			29,423.000	2,987,973.340 (417,479,635)	
香港・ドル		LINK REIT/THE	196,500.000	9,599,025.000	
香港・ドル 小計			196,500.000	9,599,025.000 (146,097,161)	
投資証券 合計			1,429,106	6,475,558,260 (6,475,558,260)	
合計				7,380,808,160 (7,380,808,160)	

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 600銘柄	60.53%	-%	-%	63.80%
	投資証券 33銘柄	-%	-%	1.81%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	8.13%	-%	-%	8.47%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
イスラエル・シェケル	株式 5銘柄	0.24%	-%	-%	0.25%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.81%	-%	-%	3.14%
	投資信託				
	受益証券 10銘柄	-%	0.26%	-%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	4.05%	-%	-%	4.16%
	投資証券 2銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.57%	-%	-%	0.63%
	投資信託				
	受益証券 4銘柄	-%	0.05%	-%	
スイス・フラン	株式 35銘柄	3.77%	-%	-%	3.86%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.21%	-%	-%	1.24%
デンマーク・クローネ	株式 12銘柄	0.62%	-%	-%	0.64%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.25%	-%	-%	0.26%
ユーロ	株式 232銘柄	11.76%	-%	-%	12.18%
	投資証券 6銘柄	-%	-%	0.14%	
香港・ドル	株式 29銘柄	1.25%	-%	-%	1.33%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		27,140,085	73,657,853
コール・ローン		61,440,840	24,814,092
投資信託受益証券		3,595,593,671	3,018,423,263
投資証券		24,159,330,317	24,057,181,834
派生商品評価勘定		62,575	265,350
未収入金		-	92,334
未収配当金		141,956,888	129,103,083
流動資産合計		27,985,524,376	27,303,537,809
資産合計		27,985,524,376	27,303,537,809
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	138
未払金		-	1,895,291
未払解約金		63,293,000	23,000,000
流動負債合計		63,293,000	24,895,429
負債合計		63,293,000	24,895,429
純資産の部			
元本等			
元本	1	30,616,773,967	23,304,470,195
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	2,694,542,591	3,974,172,185
元本等合計		27,922,231,376	27,278,642,380
純資産合計		27,922,231,376	27,278,642,380
負債純資産合計		27,985,524,376	27,303,537,809

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26年7月11日現在	平成27年1月13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	33,767,135,662円	30,616,773,967円
	同期中追加設定元本額	3,477,307,558円	5,410,754,528円
	同期中一部解約元本額	6,627,669,253円	12,723,058,300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）	5,279,693円	8,682,165円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	13,415,911円	22,069,713円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	37,205,215円	60,330,993円
	投資のソムリエ	274,351,753円	344,186,772円
	投資のソムリエ＜DC年金＞	2,593,099円	5,011,319円
	D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	5,349,089円	16,231,936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）	1,155,468,823円	919,073,809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）	9,493,830,800円	6,503,520,422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）	17,460,413,302円	14,024,325,538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）	1,163,737,871円	553,358,537円
	D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII（適格機関投資家限定）	439,563,468円	282,799,528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）	565,564,943円	564,879,463円
	計	30,616,773,967円	23,304,470,195円
2 .	受益権の総数	30,616,773,967口	23,304,470,195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2,694,542,591円でありま す。	

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13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ぬ。	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つた場合、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26年7月11日現在	平成27年1月13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	32,954,254	266,131,774
投資証券	95,302,829	2,703,475,616
合計	128,257,083	2,969,607,390

（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26年6月24日から平成26年7月11日まで及び平成26年6月24日から平成27年1月13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26年7月11日 現在				平成27年1月13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	24,711,535	-	24,648,960	62,575	31,010,112	-	30,744,900	265,212
アメリカ・ドル	13,696,572	-	13,683,600	12,972	-	-	-	-
イギリス・ポンド	3,660,510	-	3,644,970	15,540	5,371,890	-	5,371,800	90
オーストラリア・ドル	7,354,453	-	7,320,390	34,063	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	5,068,150	-	4,928,000	140,150
シンガポール・ドル	-	-	-	-	6,187,790	-	6,187,300	490
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	5,624,820	-	5,500,200	124,620
ユーロ	-	-	-	-	4,191,582	-	4,191,600	18
香港・ドル	-	-	-	-	4,565,880	-	4,566,000	120
合計	24,711,535	-	24,648,960	62,575	31,010,112	-	30,744,900	265,212

（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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	0.9120円	1.1705円
(1万口当たり純資産額)	(9,120円)	(11,705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27年1月13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	360 CAPITAL GROUP LTD	52,000.000	53,560.000	
		360 CAPITAL OFFICE FUND	17,000.000	35,190.000	
		ABACUS PROPERTY GROUP	56,000.000	176,400.000	
		ALE PROPERTY GROUP	43,300.000	143,323.000	
		ARENA REIT	50,161.000	81,511.620	
		ASPEN GROUP	31,613.000	39,674.310	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	13,000.000	64,480.000	
		AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	26,000.000	56,680.000	
		BWP TRUST	104,528.000	297,904.800	
		CHARTER HALL GROUP	59,243.000	271,332.940	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	66,027.000	281,275.020	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	291,000.000	314,280.000	
		DEXUS PROPERTY GROUP	200,151.000	1,441,087.200	
		FEDERATION CENTRES	314,448.000	921,332.640	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	46,000.000	88,320.000	
		GALILEO JAPAN TRUST	25,000.000	41,750.000	
		GDI PROPERTY GROUP	112,000.000	95,200.000	
		GOODMAN GROUP	340,452.000	1,995,048.720	
		GPT GROUP	374,933.000	1,660,953.190	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	37,000.000	102,490.000	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	34,000.000	87,380.000	
		INDUSTRIA REIT	30,000.000	60,300.000	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	216,898.000	94,350.630	
		INVESTA OFFICE FUND	140,900.000	522,739.000	
		MIRVAC GROUP	807,369.000	1,489,595.800	
		NATIONAL STORAGE REIT	66,000.000	92,730.000	
		NOVION PROPERTY GROUP	525,118.000	1,139,506.060	
		SCENTRE GROUP	1,187,000.000	4,356,290.000	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	138,544.000	259,770.000	
		STOCKLAND	520,173.000	2,179,524.870	
WESTFIELD CORP	426,400.000	4,067,856.000			
	オーストラリア・ドル 小計		6,352,258.000	22,511,835.800	

		(2,164,287,894)	
シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	120,195.000	173,080.800
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	185,000.000	125,800.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	456,361.000	1,127,211.670
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	194,800.000	247,396.000
	CACHE LOGISTICS TRUST	151,000.000	173,650.000
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	267,405.000	183,172.420
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	458,806.000	825,850.800
	CAPITAMALL TRUST	572,064.000	1,189,893.120
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	143,080.000	238,228.200
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	142,000.000	244,950.000
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	193,000.000	160,190.000
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	134,000.000	170,850.000
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	128,000.000	245,760.000
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	109,280.000	155,177.600
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	103,000.000	91,155.000
	KEPPEL REIT	350,900.000	422,834.500
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	411,000.000	141,795.000
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	307,000.000	442,080.000
	MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	408,000.000	387,600.000
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	255,120.000	386,506.800
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	337,920.000	405,504.000
	QUE COMMERCIAL REIT	88,000.000	70,840.000
	QUE HOSPITALITY TRUST	160,000.000	144,800.000
	PARKWAY LIFE REIT	82,000.000	192,700.000
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	151,000.000	140,430.000
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	107,000.000	83,995.000
	SPH REIT	156,000.000	162,240.000
STARHILL GLOBAL REIT	292,000.000	235,060.000	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	559,291.000	1,093,413.900	
シンガポール・ドル 小計	7,023,222.000	9,662,164.810 (854,135,369)	

投資信託受益証券 合計			13,375,480	3,018,423,263 (3,018,423,263)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,953.000	514,981.320	
		AGREE REALTY CORP	3,664.000	117,577.760	
		ALEXANDER'S INC.	732.000	342,759.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,980.000	1,501,640.600	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,181.000	349,983.180	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,310.000	1,012,586.400	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	31,353.000	548,050.440	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	201,567.000	1,902,792.480	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	7,600.000	136,116.000	
		AMREIT INC	4,310.000	114,344.300	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	32,437.000	1,307,535.470	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,800.000	48,480.000	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	5,510.000	97,031.100	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,060.000	176,400.400	
		ASSOCIATED ESTATES RLTY CORP	13,400.000	335,134.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	29,440.000	5,145,523.200	
		AVIV REIT INC	5,680.000	214,192.800	
		BIOMED REALTY TRUST INC	43,781.000	1,042,425.610	
		BOSTON PROPERTIES INC	34,150.000	4,724,311.000	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	39,632.000	640,453.120	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,208.000	800,209.920	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,174.000	1,509,377.280	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	15,300.000	110,619.000	
		CARETRUST REIT INC	8,489.000	100,424.870	
		CBL & ASSOCIATES	37,728.000	776,442.240	
		CEDAR REALTY TRUST INC	16,391.000	125,718.970	
		CHAMBERS STREET PROPERTIES	52,366.000	425,735.580	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,474.000	227,583.300	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	12,133.000	449,527.650	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	27,685.000	696,277.750	
		CORESITE REALTY CORP	4,765.000	199,081.700	

CORPORATE OFFICE PROPERTIES	20,482.000	598,688.860	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	25,826.000	975,448.020	
COUSINS PROPERTIES INC	45,504.000	515,105.280	
CUBESMART	36,096.000	870,635.520	
CYRUSONE INC	7,729.000	219,271.730	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	19,509.000	710,712.870	
DDR CORP	66,376.000	1,272,427.920	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	43,337.000	655,688.810	
DIGITAL REALTY TRUST INC	30,290.000	2,084,557.800	
DOUGLAS EMMETT INC	30,179.000	893,901.980	
DUKE REALTY TRUST	75,844.000	1,622,303.160	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	14,566.000	511,266.600	
EAST GROUP	7,059.000	462,435.090	
EDUCATION REALTY TRUST INC	10,493.000	413,738.990	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	22,610.000	407,658.300	
EPR PROPERTIES	12,662.000	776,307.220	
EQUITY COMMONWEALTH	28,559.000	757,099.090	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,673.000	982,442.070	
EQUITY ONE INC	16,971.000	456,180.480	
EQUITY RESIDENTIAL	80,790.000	6,292,733.100	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,270.000	3,168,510.800	
EXCEL TRUST INC	13,401.000	185,201.820	
EXTRA SPACE STORAGE INC	24,527.000	1,570,709.080	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15,220.000	2,171,133.000	
FELCOR LODGING TR INC	25,650.000	271,377.000	
FIRST INDUSTRIAL RT	24,457.000	539,276.850	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	12,875.000	162,997.500	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	19,625.000	249,630.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	19,912.000	621,851.760	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	140,000.000	4,254,600.000	
GEO GROUP INC	16,423.000	676,299.140	
GETTY REALTY CORP	6,120.000	113,832.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,808.000	83,370.720	
GLIMCHER REALTY TRUST	32,212.000	446,780.440	

GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	15,532.000	360,497.720	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	36,490.000	257,619.400	
HCP INC	102,440.000	4,845,412.000	
HEALTH CARE REIT INC	73,060.000	5,895,211.400	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	21,736.000	621,432.240	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	26,473.000	757,657.260	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	44,100.000	306,936.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,234.000	939,666.960	
HOME PROPERTIES INC	12,716.000	892,917.520	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	33,244.000	1,066,135.080	
HOST HOTELS & RESORTS INC	168,980.000	4,020,034.200	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	12,640.000	410,926.400	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	4,700.000	44,039.000	
INLAND REAL ESTATE CORP	19,361.000	213,745.440	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	26,430.000	227,033.700	
IRON MOUNTAIN INC	41,388.000	1,627,376.160	
KILROY REALTY CORP	18,630.000	1,353,655.800	
KIMCO REALTY	91,900.000	2,453,730.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	18,471.000	549,696.960	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	24,763.000	1,025,931.090	
LEXINGTON REALTY TRUST	46,241.000	522,985.710	
LIBERTY PROPERTY TRUST	32,958.000	1,315,353.780	
LTC PROPERTIES INC	8,000.000	369,600.000	
MACK CALI	19,230.000	371,523.600	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	38,164.000	565,208.840	
MID AMERICA	16,697.000	1,350,119.420	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	12,200.000	143,350.000	
NATIONAL HEALTH INVS INC	7,268.000	543,937.120	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	29,258.000	1,240,246.620	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	15,390.000	260,706.600	
NEW YORK REIT INC	35,817.000	386,107.260	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	28,268.000	1,202,238.040	

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,080.000	74,382.000	
PARKWAY PROPERTIES INC	19,330.000	346,393.600	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,825.000	766,088.250	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	15,188.000	367,701.480	
PHYSICIANS REALTY TRUST	10,385.000	179,037.400	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	34,177.000	658,590.790	
POST PROPERTIES, INC	12,065.000	756,596.150	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	4,000.000	37,920.000	
PROLOGIS INC	111,520.000	4,973,792.000	
PS BUSINESS PARKS	4,450.000	365,300.500	
PUBLIC STORAGE	32,350.000	6,410,152.500	
QTS REALTY TRUST INC	2,650.000	98,129.500	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	17,790.000	341,745.900	
REALTY INCOME CORP	49,730.000	2,537,721.900	
REGENCY CENTERS CORP	20,691.000	1,414,229.850	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	20,520.000	359,920.800	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	52,363.000	923,159.690	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	9,230.000	149,433.700	
RLJ LODGING TRUST	29,276.000	1,019,390.320	
ROUSE PROPERTIES INC	8,210.000	167,484.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,295.000	615,351.600	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	12,540.000	408,302.400	
SAUL CENTERS INC	2,660.000	150,715.600	
SELECT INCOME REIT	8,166.000	211,581.060	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	45,215.000	1,031,354.150	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	8,800.000	145,200.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	69,240.000	13,623,662.400	
SL GREEN	21,550.000	2,752,366.000	
SOVRAN SELF STORAGE INC	7,477.000	682,425.790	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	88,397.000	1,094,354.860	
STAG INDUSTRIAL INC	14,224.000	372,242.080	
STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL TRUST	8,800.000	230,208.000	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS	59,254.000	802,891.700	

	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	18,917.000	239,110.880	
	SUN COMMUNITIES INC	9,993.000	675,826.590	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,514.000	788,302.480	
	TANGER FACTORY OUTLET	21,252.000	832,228.320	
	TAUBMAN CENTERS INC	14,045.000	1,160,397.900	
	TERRENO REALTY CORP	9,680.000	214,412.000	
	THE MACERICH COMPANY	31,253.000	2,756,202.070	
	TRADE STREET RESIDENTIAL INC	3,000.000	23,160.000	
	UDR INC	56,659.000	1,834,618.420	
	UMH PROPERTIES INC	4,200.000	40,782.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,824.000	146,452.640	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	6,520.000	145,982.800	
	VENTAS INC	65,640.000	5,050,341.600	
	VORNADO REALTY TRUST	38,940.000	4,844,525.400	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	34,352.000	611,465.600	
	WASHINGTON REIT	14,640.000	415,483.200	
	WEINGARTEN REALTY INVST	24,939.000	904,288.140	
	WHITESTONE REIT	4,912.000	74,760.640	
	WP CAREY INC	21,470.000	1,543,478.300	
	アメリカ・ドル 小計	4,113,285.000	164,198,165.710 (19,377,025,535)	
イギリス・ポンド	ASSURA GROUP LTD	210,000.000	110,250.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	32,408.000	193,637.800	
	BRITISH LAND CO PLC	227,010.000	1,779,758.400	
	DERWENT LONDON PLC	22,550.000	688,451.500	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	75,978.000	562,617.090	
	HAMMERSON PLC	173,764.000	1,084,287.360	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	156,700.000	170,959.700	
	INTU PROPERTIES PLC	208,820.000	701,217.560	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	174,100.000	2,077,013.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	135,500.000	204,740.500	
	MCKAY SECURITIES PLC	22,000.000	52,580.000	
	MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	14,220.000	63,990.000	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	26,300.000	97,178.500	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	206,180.000	113,605.180	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	46,500.000	108,345.000	
	SEGRO PLC	164,028.000	655,619.910	

	SHAFTESBURY PLC	61,312.000	486,817.280	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	101,000.000	110,292.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	25,681.000	196,459.650	
イギリス・ボンド 小計		2,084,051.000	9,457,820.430 (1,693,611,904)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	35,000.000	336,840.000	
イスラエル・シュケル 小計		35,000.000	336,840.000 (10,111,937)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	8,330.000	330,784.300	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,300.000	216,359.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,530.000	356,076.700	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	3,420.000	95,520.600	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVT TR	14,500.000	433,550.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	12,500.000	340,625.000	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	7,700.000	367,675.000	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCE	18,400.000	227,240.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	10,200.000	107,304.000	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	17,600.000	337,920.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	13,600.000	177,616.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,771.000	93,096.580	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,400.000	108,004.000	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	8,455.000	74,234.900	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	12,100.000	324,038.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,200.000	229,736.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	29,500.000	691,775.000	
	INNVEST REAL ESTATE INVT TR	12,000.000	72,000.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,926.000	48,744.900	
	MILESTONE APARTMENTS REIT	6,700.000	81,070.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,477.000	56,248.790	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	6,300.000	115,983.000	
	NORTHERN PROPERTY RE INV TR	3,760.000	91,706.400	

	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,200.000	39,564.000	
	PLAZA RETAIL REIT	12,000.000	48,960.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	22,961.000	104,702.160	
	RETROCOM REIT	9,828.000	39,705.120	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	33,800.000	973,440.000	
カナダ・ドル 小計		326,458.000	6,183,679.450 (609,525,284)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	178,000.000	200,250.000	
	DNZ PROPERTY FUND LTD	64,000.000	124,160.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	219,000.000	254,040.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	224,900.000	293,494.500	
	PRECINCT PROPERTIES	196,000.000	245,980.000	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	89,000.000	136,170.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	65,000.000	103,675.000	
ニュージーランド・ドル 小計		1,035,900.000	1,357,769.500 (124,480,308)	
ユーロ	AEDIFICA	2,280.000	130,644.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	17,200.000	183,696.000	
	ALTAREA	510.000	69,870.000	
	ANF IMMOBILIER	2,270.000	48,578.000	
	AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA	8,570.000	88,828.050	
	BEFIMMO	4,111.000	256,403.070	
	BENI STABILI SPA	210,563.000	123,179.350	
	COFINIMMO SA	3,818.000	392,681.300	
	CORIO NV	22,400.000	978,880.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	9,500.000	352,117.500	
	FONCIERE DES REGIONS	10,050.000	795,156.000	
	GECINA SA	7,960.000	859,680.000	
	GREEN REIT PLC	144,000.000	182,160.000	
	HAMBORNER REIT AG	8,600.000	75,594.000	
	HIBERNIA REIT PLC	151,600.000	162,970.000	
	ICADE	7,200.000	496,800.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	71,000.000	46,150.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	36,500.000	38,507.500	
	KLEPIERRE	22,100.000	848,640.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	8,300.000	75,613.000	
MERCIALYS	12,600.000	238,455.000		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	28,200.000	293,703.000		

	NSI NV	20,800.000	79,040.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	21,850.000	4,815,740.000	
	VASTNED RETAIL	4,230.000	172,097.550	
	WAREHOUSES DE PAUW	2,820.000	179,690.400	
	WERELDHAVE NV	7,780.000	462,209.800	
	ユーロ 小計	846,812.000	12,447,083.520 (1,739,106,510)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	555,000.000	1,992,450.000	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	291,000.000	2,290,170.000	
	LINK REIT/THE	510,523.000	24,939,048.550	
	NEW CENTURY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	70,000.000	231,700.000	
	PROSPERITY REIT	271,000.000	723,570.000	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	220,000.000	457,600.000	
	SPRING REIT	190,000.000	697,300.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	222,000.000	785,880.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	241,000.000	951,950.000	
	香港・ドル 小計	2,570,523.000	33,069,668.550 (503,320,356)	
	投資証券 合計	11,012,029	24,057,181,834 (24,057,181,834)	
	合計		27,075,605,097 (27,075,605,097)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 149銘柄	-%	71.03%	71.57%
イギリス・ポンド	投資証券 19銘柄	-%	6.21%	6.26%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.04%	0.04%
オーストラリア・ドル	投資信託 受益証券 31銘柄	7.93%	-%	7.99%
カナダ・ドル	投資証券 28銘柄	-%	2.23%	2.25%
シンガポール・ドル	投資信託 受益証券 29銘柄	3.13%	-%	3.15%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	0.46%	0.46%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	6.38%	6.42%
香港・ドル	投資証券 9銘柄	-%	1.85%	1.86%

(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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		280,345,191	216,222,920
コール・ローン		1,556,917,230	3,461,441,716
国債証券		169,978,201,254	171,826,023,987
派生商品評価勘定		514,618,126	4,970,010,497
未収入金		-	105,852,152
未収利息		1,763,945,349	1,627,037,030
前払費用		94,447,056	214,805,656
流動資産合計		174,188,474,206	182,421,393,958
資産合計		174,188,474,206	182,421,393,958
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		95,817,440	9,510,156
未払金		-	1,130,169,048
未払解約金		118,834,000	64,665,000
流動負債合計		214,651,440	1,204,344,204
負債合計		214,651,440	1,204,344,204
純資産の部			
元本等			
元本	1	139,254,883,317	137,483,212,002
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		34,718,939,449	43,733,837,752
元本等合計		173,973,822,766	181,217,049,754
純資産合計		173,973,822,766	181,217,049,754
負債純資産合計		174,188,474,206	182,421,393,958

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26年7月11日現在	平成27年1月13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	148,344,483,263円	139,254,883,317円
同期中追加設定元本額	3,858,247,838円	9,471,586,382円
同期中一部解約元本額	12,947,847,784円	11,243,257,697円
元本の内訳		
ファンド名		
投資のソムリエ	832,989,647円	1,718,229,481円
投資のソムリエ＜DC年金＞	7,873,826円	26,109,948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）	244,508,411円	220,536,998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）	25,465,967,407円	25,054,429,260円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,803,039,853円	1,595,857,498円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	8,924,360,981円	8,628,334,289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）	39,601,656,245円	39,351,743,584円
D I A Mバランス30VA（適格機関投資家限定）	175,645円	176,330円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	35,176,498,269円	35,234,770,299円

D I A Mバランス２０VA(適格機関投資家限定)	314,774,137円	162,720円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	3,879,137,532円	3,614,869,323円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	9,794,715,234円	9,364,739,804円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	12,689,398,577円	12,174,963,687円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	519,787,553円	498,288,781円
計	139,254,883,317円	137,483,212,002円
2. 受益権の総数	139,254,883,317口	137,483,212,002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26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13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ぬ。	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つた場合、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26年7月11日現在	平成27年1月13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	802,257,601	7,217,539,600
合計	802,257,601	7,217,539,600

（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26年6月24日から平成26年7月11日まで及び平成26年6月24日から平成27年1月13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26年7月11日 現在				平成27年1月13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	172,598,142,283	-	172,179,341,597	418,800,686	176,932,283,137	-	171,962,272,640	4,970,010,497
アメリカ・ドル	65,006,743,988	-	65,054,163,005	47,419,017	71,048,089,962	-	69,930,485,966	1,117,603,996
イギリス・ポンド	14,038,705,992	-	14,070,307,622	31,601,630	14,993,118,901	-	14,370,904,899	622,214,002
オーストラリア・ドル	2,924,112,725	-	2,910,355,240	13,757,485	3,015,182,228	-	2,956,593,705	58,588,523
カナダ・ドル	4,005,262,499	-	4,010,477,976	5,215,477	4,089,956,545	-	3,896,362,890	193,593,655
シンガポール・ドル	615,905,139	-	618,498,770	2,593,631	665,066,938	-	650,415,030	14,651,908
スウェーデン・クローナ	979,490,447	-	966,473,082	13,017,365	881,818,766	-	843,174,696	38,644,070
デンマーク・クローネ	1,456,502,937	-	1,447,707,832	8,795,105	1,311,628,052	-	1,264,355,988	47,272,064
ノルウェー・クローネ	488,792,813	-	486,386,280	2,406,533	469,083,570	-	449,113,170	19,970,400
ポーランド・ズロチ	1,198,469,515	-	1,198,312,206	157,309	1,124,554,981	-	1,089,467,712	35,087,269

マレーシ ア ・リン ギット メキシ コ・ペソ	886,119,450	-	894,423,000	8,303,550	848,880,200	-	837,971,100	10,909,100
ユーロ	78,239,427,796	-	77,765,923,352	473,504,444	75,736,612,082	-	72,949,432,752	2,787,179,330
南アフリ カ ・ランド	862,976,711	-	860,048,062	2,928,649	931,304,271	-	923,246,184	8,058,087
買 建	-	-	-	-	833,455,118	-	823,944,962	9,510,156
アメリ カ・ドル	-	-	-	-	328,175,352	-	323,839,200	4,336,152
イギリ ス・ボン ド	-	-	-	-	161,773,308	-	160,509,384	1,263,924
オースト ラリア・ ドル	-	-	-	-	18,434,560	-	18,216,635	217,925
カナダ・ ドル	-	-	-	-	28,990,935	-	28,237,440	753,495
ユーロ	-	-	-	-	276,267,436	-	273,487,928	2,779,508
南アフリ カ ・ランド	-	-	-	-	19,813,527	-	19,654,375	159,152
合計	172,598,142,283	-	172,179,341,597	418,800,686	177,765,738,255	-	172,786,217,602	4,960,500,341

(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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.2493円	1.3181円
(1万口当たり純資産額)	(12,493円)	(13,181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27年1月13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 0.375 01/15/16	11,300,000.000	11,319,775.000	
		US T N/B 0.375 04/30/16	18,500,000.000	18,520,165.000	
		US T N/B 0.625 05/31/17	12,300,000.000	12,272,571.000	
		US T N/B 0.625 08/31/17	9,300,000.000	9,252,384.000	
		US T N/B 0.75 02/28/18	5,000,000.000	4,963,050.000	
		US T N/B 0.75 03/31/18	11,600,000.000	11,503,024.000	
		US T N/B 0.75 12/31/17	3,000,000.000	2,985,090.000	
		US T N/B 0.875 01/31/18	4,200,000.000	4,190,802.000	
		US T N/B 0.875 04/30/17	8,000,000.000	8,034,320.000	
		US T N/B 0.875 11/30/16	4,500,000.000	4,528,800.000	
		US T N/B 1.0 06/30/19	5,000,000.000	4,932,800.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,680,000.000	6,559,960.400	
		US T N/B 1.25 01/31/19	2,600,000.000	2,600,806.000	
		US T N/B 1.25 11/30/18	1,000,000.000	1,001,950.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	6,660,000.000	6,625,634.400	
		US T N/B 1.5 02/28/19	5,000,000.000	5,051,950.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	6,300,000.000	6,362,748.000	
		US T N/B 1.5 08/31/18	6,900,000.000	6,989,976.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	5,600,000.000	5,661,208.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	1,500,000.000	1,487,460.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	5,180,000.000	5,127,785.600	
		US T N/B 1.75 05/15/22	2,470,000.000	2,474,618.900	
		US T N/B 1.75 05/15/23	6,400,000.000	6,363,712.000	
		US T N/B 1.75 05/31/16	11,000,000.000	11,211,750.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	2,960,000.000	2,992,116.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	1,720,000.000	1,756,670.400	
		US T N/B 1.875 09/30/17	6,000,000.000	6,165,420.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	2,710,000.000	2,765,040.100	
		US T N/B 2.0 02/15/23	5,900,000.000	5,995,875.000	
		US T N/B 2.0 02/28/21	1,480,000.000	1,513,758.800	
		US T N/B 2.0 04/30/16	9,500,000.000	9,706,625.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	10,860,000.000	11,091,535.200	
		US T N/B 2.0 08/31/21	2,700,000.000	2,754,837.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	2,960,000.000	3,034,680.800	
US T N/B 2.0 11/15/21	5,000,000.000	5,103,700.000			
US T N/B 2.125 08/15/21	5,430,000.000	5,585,895.300			
US T N/B 2.125 08/31/20	1,480,000.000	1,528,440.400			
US T N/B 2.25 03/31/21	5,920,000.000	6,140,105.600			
US T N/B 2.25 07/31/18	4,000,000.000	4,158,120.000			
US T N/B 2.25 11/30/17	5,500,000.000	5,712,025.000			

US T N/B 2.375 03/31/16	6,000,000.000	6,152,760.000	
US T N/B 2.375 06/30/18	4,300,000.000	4,487,781.000	
US T N/B 2.375 07/31/17	10,500,000.000	10,923,255.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	3,510,000.000	3,655,314.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	3,450,000.000	3,605,250.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	12,590,000.000	13,251,856.300	
US T N/B 2.5 06/30/17	6,500,000.000	6,779,760.000	
US T N/B 2.625 04/30/18	4,300,000.000	4,521,364.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	8,150,000.000	8,627,508.500	
US T N/B 2.625 11/15/20	2,960,000.000	3,135,380.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	3,700,000.000	3,925,034.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,430,000.000	5,834,263.500	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,920,000.000	2,021,683.200	
US T N/B 2.75 11/15/23	6,100,000.000	6,552,254.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	2,550,000.000	2,684,053.500	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,480,000.000	1,594,922.000	
US T N/B 3.0 02/28/17	7,000,000.000	7,351,610.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,610,000.000	1,780,048.200	
US T N/B 3.0 09/30/16	6,000,000.000	6,259,680.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	900,000.000	995,904.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,110,000.000	2,386,768.700	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,140,000.000	4,675,260.600	
US T N/B 3.125 04/30/17	4,000,000.000	4,221,840.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,849,965.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	5,430,000.000	5,918,700.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,690,000.000	5,311,753.300	
US T N/B 3.125 10/31/16	10,500,000.000	10,989,300.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,020,000.000	2,288,902.400	
US T N/B 3.25 03/31/17	7,000,000.000	7,398,930.000	
US T N/B 3.25 06/30/16	7,000,000.000	7,291,690.000	
US T N/B 3.25 12/31/16	7,800,000.000	8,206,692.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	4,240,000.000	5,022,407.200	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,500,000.000	4,927,500.000	
US T N/B 3.5 02/15/18	2,500,000.000	2,692,475.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,472,000.000	1,767,194.880	
US T N/B 3.5 05/15/20	6,910,000.000	7,631,196.700	
US T N/B 3.625 02/15/20	8,890,000.000	9,866,477.600	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,180,000.000	5,790,670.200	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,850,000.000	5,998,043.500	
US T N/B 3.625 08/15/19	17,000,000.000	18,741,140.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,484,000.000	5,545,766.360	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,680,000.000	2,121,772.800	
US T N/B 3.75 11/15/18	6,000,000.000	6,583,800.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	3,700,000.000	4,677,318.000	
US T N/B 3.875 05/15/18	5,800,000.000	6,341,894.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,480,000.000	1,889,190.400	
US T N/B 4.25 05/15/39	790,000.000	1,059,832.400	
US T N/B 4.25 11/15/17	3,000,000.000	3,283,110.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,920,000.000	2,598,144.000	

US T N/B 4.375 02/15/38	710,000.000	967,041.300	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,110,000.000	2,896,460.300	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,180,000.000	1,637,061.200	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,500,000.000	2,052,885.000	
US T N/B 4.5 02/15/16	11,000,000.000	11,508,750.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,680,000.000	2,323,641.600	
US T N/B 4.5 05/15/17	4,000,000.000	4,351,400.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	690,000.000	957,478.500	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,080,000.000	1,501,113.600	
US T N/B 4.625 02/15/17	6,000,000.000	6,496,620.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,820,000.000	2,580,559.800	
US T N/B 4.625 11/15/16	7,000,000.000	7,528,500.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,480,000.000	2,158,594.800	
US T N/B 4.75 08/15/17	3,700,000.000	4,074,477.000	
US T N/B 4.875 08/15/16	8,000,000.000	8,568,080.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	690,000.000	1,021,358.700	
US T N/B 5.125 05/15/16	5,000,000.000	5,320,850.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,144,810.700	
US T N/B 5.25 11/15/28	740,000.000	1,018,077.200	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,400,000.000	2,007,250.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	880,000.000	1,231,586.400	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,280,000.000	1,792,588.800	
US T N/B 6.125 11/15/27	950,000.000	1,383,399.500	
US T N/B 6.25 05/15/30	900,000.000	1,380,087.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,000,000.000	2,711,240.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,964,759.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	11,000,000.000	14,345,540.000	
アメリカ・ドル 小計	556,366,000.000 (65,656,751,660)	596,168,811.540 (70,353,881,450)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 1.0 09/07/17	1,970,000.000	1,991,079.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/18	3,060,000.000	3,104,982.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/17	1,670,000.000	1,713,587.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	2,470,000.000	2,550,200.900	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,120,000.000	2,177,240.000	
UK TREASURY 2.0 01/22/16	30,000.000	30,501.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,370,000.000	2,518,053.900	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,280,000.000	2,518,875.600	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,370,000.000	2,835,942.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	90,000.000	112,797.000	

UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,450,000.000	1,979,975.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,530,000.000	2,083,554.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	1,870,000.000	2,104,124.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,200,000.000	2,513,940.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,720,000.000	1,995,303.200	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,430,000.000	2,116,400.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,720,000.000	2,038,716.000	
UK TREASURY 4.0 09/07/16	3,850,000.000	4,077,920.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,950,000.000	2,628,210.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,950,000.000	2,576,145.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,250,000.000	1,723,375.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,280,000.000	1,643,648.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,630,000.000	2,259,506.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,480,000.000	2,133,272.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,480,000.000	2,177,524.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,630,000.000	2,483,957.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	2,710,000.000	3,107,828.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,900,000.000	2,617,250.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,880,000.000	2,743,108.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	2,420,000.000	2,865,522.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,780,000.000	2,456,044.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,600,000.000	2,350,720.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/18	880,000.000	998,360.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,780,000.000	2,353,160.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,020,000.000	1,546,626.000	

	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,720,000.000	2,441,024.000	
	UK TREASURY 8.75 08/25/17	1,230,000.000	1,493,712.000	
イギリス・ボンド 小計		65,770,000.000 (11,777,433,900)	81,062,181.600 (14,515,804,859)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	2,170,000.000	2,408,548.100	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,750,000.000	3,085,362.500	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	2,370,000.000	2,837,838.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,860,000.000	1,878,451.200	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,300,000.000	1,364,350.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	850,000.000	883,728.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	660,000.000	720,502.200	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,280,000.000	1,465,868.800	
	AUSTRALIAN 4.25 07/21/17	540,000.000	567,799.200	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	740,000.000	891,137.600	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,230,000.000	1,478,238.600	
	AUSTRALIAN 4.75 06/15/16	400,000.000	413,832.000	
	AUSTRALIAN 5.5 01/21/18	3,260,000.000	3,579,610.400	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,300,000.000	2,803,033.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	1,910,000.000	2,334,688.500	
	AUSTRALIAN 6.0 02/15/17	3,540,000.000	3,814,739.400	
オーストラリア・ドル 小計		27,160,000.000 (2,611,162,400)	30,527,727.500 (2,934,935,722)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	500,000.000	844,150.000	
	CANADA 1.25 03/01/18	830,000.000	835,984.300	
	CANADA 1.25 09/01/18	1,010,000.000	1,017,958.800	
	CANADA 1.5 03/01/17	980,000.000	992,612.600	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,400,000.000	1,399,104.000	
	CANADA 1.5 09/01/17	2,170,000.000	2,199,989.400	
	CANADA 2.25 06/01/25	800,000.000	840,776.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,530,000.000	1,648,957.500	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,180,000.000	1,289,893.400	
	CANADA 2.75 09/01/16	4,100,000.000	4,220,786.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	270,000.000	318,159.900	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,180,000.000	1,320,844.800	
	CANADA 3.5 06/01/20	1,580,000.000	1,768,035.800	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,950,000.000	2,529,345.000	

	CANADA 3.75 06/01/19	3,550,000.000	3,954,735.500	
	CANADA 4.0 06/01/16	4,190,000.000	4,366,273.300	
	CANADA 4.0 06/01/17	1,280,000.000	1,373,670.400	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,540,000.000	2,104,333.000	
	CANADA 4.25 06/01/18	1,200,000.000	1,328,544.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,300,000.000	1,960,257.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,060,000.000	1,569,658.600	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,230,000.000	1,924,359.600	
カナダ・ドル	小計	34,830,000.000 (3,433,193,100)	39,808,428.900 (3,923,916,837)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 04/01/18	690,000.000	680,974.800	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	300,000.000	307,848.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	211,576.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	270,000.000	285,538.500	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	340,000.000	367,356.400	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	890,000.000	966,264.100	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	980,000.000	1,063,192.200	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	270,000.000	303,804.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	540,000.000	612,981.000	
	SINGAPORE 3.75 09/01/16	1,000,000.000	1,049,880.000	
	SINGAPORE 4.0 09/01/18	1,380,000.000	1,522,788.600	
シンガポール・ドル	小計	6,860,000.000 (606,424,000)	7,372,203.600 (651,702,798)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.5 11/13/23	7,400,000.000	7,908,528.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	4,500,000.000	5,277,285.000	
	SWEDEN 3.0 07/12/16	5,650,000.000	5,901,764.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,210,000.000	5,983,715.100	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	8,080,000.000	9,826,734.400	
	SWEDEN 3.75 08/12/17	6,060,000.000	6,653,031.600	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,080,000.000	9,473,557.600	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	4,640,000.000	5,897,857.600	
スウェーデン・クローナ	小計	48,620,000.000 (711,796,800)	56,922,473.300 (833,345,009)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 1.5 11/15/23	6,570,000.000	7,129,698.300	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,800,000.000	4,205,346.000	
	DENMARK 2.5 11/15/16	3,240,000.000	3,391,113.600	
	DENMARK 3.0 11/15/21	8,830,000.000	10,420,724.500	
	DENMARK 4.0 11/15/17	6,060,000.000	6,752,658.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	10,110,000.000	12,008,658.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	11,730,000.000	20,037,420.600	
	DENMARK 7.0 11/10/24	2,300,000.000	3,734,855.000	
デンマーク・クローネ	小計	52,640,000.000 (988,579,200)	67,680,474.000 (1,271,039,302)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 2.0 05/24/23	4,290,000.000	4,518,399.600	
	NORWAY 3.0 03/14/24	4,140,000.000	4,697,658.000	

	NORWAY 3.75 05/25/21	6,360,000.000	7,393,182.000	
	NORWAY 4.25 05/19/17	5,430,000.000	5,874,717.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	5,560,000.000	6,425,136.000	
ノルウェー・クローネ 小計		25,780,000.000 (394,434,000)	28,909,092.600 (442,309,117)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 3.25 07/25/19	1,480,000.000	1,567,542.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,050,000.000	1,143,870.000	
	POLAND 3.75 04/25/18	3,530,000.000	3,753,096.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,570,000.000	2,943,035.500	
	POLAND 4.75 04/25/17	1,780,000.000	1,900,328.000	
	POLAND 4.75 10/25/16	6,060,000.000	6,383,301.000	
	POLAND 5.0 04/25/16	980,000.000	1,020,523.000	
	POLAND 5.25 10/25/17	3,430,000.000	3,757,599.300	
	POLAND 5.25 10/25/20	1,880,000.000	2,215,956.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,110,000.000	2,457,833.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	800,000.000	1,118,080.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	2,180,000.000	2,739,627.800	
	POLAND 5.75 10/25/21	1,780,000.000	2,194,295.000	
ポーランド・ズロチ 小計		29,630,000.000 (968,604,700)	33,195,087.100 (1,085,147,397)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.172 07/15/16	2,200,000.000	2,186,690.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	590,000.000	569,291.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,580,000.000	1,451,451.200	
	MALAYSIA 3.58 09/28/18	2,170,000.000	2,148,668.900	
	MALAYSIA 3.814 02/15/17	2,670,000.000	2,676,247.800	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	340,000.000	310,161.600	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,118,038.200	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	3,960,000.000	3,975,721.200	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	690,000.000	693,505.200	
	MALAYSIA 4.24 02/07/18	2,970,000.000	3,005,699.400	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,960,000.000	4,039,398.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,480,414.400	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	100,000.000	103,551.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,601,374.800	
マレーシア・リングgit 小計		25,370,000.000 (837,971,100)	25,360,212.700 (837,647,825)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	9,880,000.000	14,153,396.400	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	23,220,000.000	30,846,609.000	
	MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18	3,450,000.000	3,468,526.500	
	MEXICAN BONDS 6.25 06/16/16	9,630,000.000	10,020,689.100	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	10,860,000.000	11,613,032.400	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/15/16	24,700,000.000	26,410,722.000	

	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	4,940,000.000	5,759,052.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	9,880,000.000	11,601,491.200	
	MEXICAN BONDS 7.75 12/14/17	34,580,000.000	38,035,233.600	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	24,610,000.000	28,077,056.800	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	21,730,000.000	26,988,660.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	14,320,000.000	18,041,624.800	
	メキシコ・ペソ 小計	191,800,000.000 (1,545,908,000)	225,016,093.800 (1,813,629,716)	
ユーロ	AUSTRIA 1.65 10/21/24	460,000.000	505,668.800	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	740,000.000	816,960.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	540,000.000	586,342.800	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	380,000.000	465,268.200	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	544,000.000	788,185.280	
	AUSTRIA 3.2 02/20/17	830,000.000	886,606.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,000,000.000	1,233,400.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,280,000.000	1,553,920.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	790,000.000	976,835.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	340,000.000	627,667.200	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,247,000.000	1,502,635.000	
	AUSTRIA 4.0 09/15/16	930,000.000	993,240.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,220,000.000	1,915,400.000	
	AUSTRIA 4.3 09/15/17	1,130,000.000	1,260,515.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,820,000.000	2,149,511.000	
	AUSTRIA 4.65 01/15/18	1,130,000.000	1,288,765.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	930,000.000	1,344,501.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	660,000.000	1,094,280.000	
	BELGIUM 1.25 06/22/18	1,300,000.000	1,356,745.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,370,000.000	1,560,265.600	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	1,250,000.000	1,463,775.000	
	BELGIUM 2.75 03/28/16	110,000.000	113,768.600	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	600,000.000	758,820.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	1,230,000.000	1,399,211.100	
	BELGIUM 3.25 09/28/16	1,670,000.000	1,766,609.500	
	BELGIUM 3.5 06/28/17	980,000.000	1,065,583.400	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	530,000.000	783,191.600	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	1,920,000.000	2,311,891.200	
	BELGIUM 4.0 03/28/17	1,820,000.000	1,983,290.400	
	BELGIUM 4.0 03/28/18	290,000.000	327,337.500	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	1,300,000.000	1,516,749.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	1,450,000.000	1,824,970.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	830,000.000	1,171,760.800	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	1,340,000.000	2,094,379.800	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	1,400,000.000	1,769,936.000	

BELGIUM 4.25 09/28/22	1,280,000.000	1,648,960.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	900,000.000	1,244,349.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,870,000.000	3,037,590.600	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,614,000.000	2,496,970.980	
BELGIUM 5.5 09/28/17	880,000.000	1,011,868.000	
BUNDESABL 0.25 04/13/18	400,000.000	404,388.000	
BUNDESABL 0.5 02/23/18	2,000,000.000	2,037,160.000	
BUNDESABL 0.5 04/07/17	2,020,000.000	2,046,967.000	
BUNDESABL 0.5 04/12/19	2,300,000.000	2,353,360.000	
BUNDESABL 0.5 10/13/17	1,230,000.000	1,250,381.100	
BUNDESABL 1.0 10/12/18	900,000.000	936,360.000	
BUNDESABL 2.75 04/08/16	4,000,000.000	4,141,160.000	
BUNDESSCHAT 0.25 06/10/16	790,000.000	794,021.100	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	620,000.000	650,206.400	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	490,000.000	538,475.700	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,870,000.000	2,055,653.600	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,610,000.000	2,861,734.500	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,900,000.000	2,085,649.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,600,000.000	1,790,400.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,510,000.000	2,801,586.700	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	1,720,000.000	1,941,450.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,308,059.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	1,900,000.000	2,137,120.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,400,000.000	1,597,470.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,000,000.000	2,290,600.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,540,000.000	2,039,576.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	680,000.000	907,494.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	2,710,000.000	3,149,426.500	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,672,485.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,000,000.000	2,406,600.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,430,000.000	2,129,985.000	

DEUTSCHLAND 3.5 01/04/16	2,690,000.000	2,785,172.200	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	2,910,000.000	3,372,108.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/17	2,940,000.000	3,164,175.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	3,000,000.000	3,456,900.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18	3,550,000.000	3,984,875.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,230,000.000	3,504,846.400	
DEUTSCHLAND 4.0 07/04/16	3,450,000.000	3,658,483.500	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/17	3,200,000.000	3,544,640.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18	2,960,000.000	3,406,812.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,320,000.000	2,197,800.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,790,178.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,890,000.000	3,150,630.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,570,000.000	2,822,232.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,630,000.000	2,757,308.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,300,000.000	2,097,290.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,796,196.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	910,000.000	1,616,615.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,090,000.000	1,857,578.000	
FINLAND 1.125 09/15/18	540,000.000	562,707.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	500,000.000	543,350.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	550,000.000	600,820.000	
FINLAND 1.75 04/15/16	600,000.000	613,920.000	
FINLAND 1.875 04/15/17	500,000.000	521,800.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	390,000.000	441,218.700	
FINLAND 2.625 07/04/42	330,000.000	437,200.500	
FINLAND 2.75 07/04/28	430,000.000	531,501.500	
FINLAND 3.375 04/15/20	650,000.000	761,832.500	
FINLAND 3.5 04/15/21	490,000.000	590,401.000	
FINLAND 3.875 09/15/17	500,000.000	552,250.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	640,000.000	851,552.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	400,000.000	477,520.000	

FR TREASURY 1.0 07/25/17	1,480,000.000	1,518,983.200	
FR TREASURY 2.5 07/25/16	3,310,000.000	3,441,804.200	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,442,118.400	
FRANCE OAT 1.0 05/25/18	1,720,000.000	1,777,000.800	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,720,000.000	1,788,284.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	240,000.000	248,911.200	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,470,000.000	2,715,122.800	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,450,000.000	2,681,231.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,450,000.000	2,798,488.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,320,000.000	2,634,081.600	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	1,600,000.000	1,875,840.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,290,000.000	4,848,987.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,180,000.000	3,812,025.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	2,700,000.000	3,200,418.000	
FRANCE OAT 3.25 04/25/16	3,950,000.000	4,119,297.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,090,000.000	1,482,062.100	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	3,600,000.000	4,303,260.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,628,000.000	4,259,453.400	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,070,000.000	3,917,013.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/17	6,370,000.000	6,923,680.400	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	3,450,000.000	4,194,786.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	3,260,000.000	3,825,121.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/18	3,450,000.000	3,904,054.500	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,570,000.000	2,554,076.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	980,000.000	1,631,964.600	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,420,000.000	3,570,831.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	4,690,000.000	5,527,165.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/17	3,350,000.000	3,749,454.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	3,400,000.000	3,941,960.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,310,000.000	4,351,226.700	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,400,000.000	3,875,880.000	

FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,020,000.000	3,182,308.000	
FRANCE OAT 5.0 10/25/16	4,440,000.000	4,841,464.800	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,700,000.000	4,245,237.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,560,000.000	4,343,142.400	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,980,000.000	3,030,231.600	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,480,000.000	2,071,482.000	
IRISH 2.4 05/15/30	333,000.000	361,085.220	
IRISH 3.4 03/18/24	690,000.000	821,548.500	
IRISH 3.9 03/20/23	500,000.000	610,685.000	
IRISH 4.4 06/18/19	690,000.000	808,818.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,090,000.000	1,307,367.800	
IRISH 4.5 10/18/18	980,000.000	1,131,508.000	
IRISH 4.6 04/18/16	430,000.000	454,720.700	
IRISH 5.0 10/18/20	880,000.000	1,094,632.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,071,000.000	1,479,468.690	
IRISH 5.5 10/18/17	590,000.000	674,600.100	
IRISH 5.9 10/18/19	740,000.000	927,405.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,100,000.000	1,235,520.000	
ITALY BTPS 3.5 12/01/18	1,030,000.000	1,136,203.300	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,800,000.000	3,224,340.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	1,100,000.000	1,265,440.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/16	3,700,000.000	3,890,217.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,000,000.000	3,459,000.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,850,000.000	3,343,962.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/17	7,310,000.000	7,829,010.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,550,000.000	2,963,355.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	2,660,000.000	3,080,812.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	1,920,000.000	2,180,544.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,810,000.000	3,266,063.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	3,600,000.000	4,144,680.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/18	5,882,000.000	6,557,841.800	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,220,000.000	2,603,394.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	6,170,000.000	7,088,096.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,200,000.000	2,715,636.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,908,000.000	2,374,696.800	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,720,000.000	2,106,294.800	
ITALY BTPS 4.5 08/01/18	3,450,000.000	3,903,330.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,480,000.000	1,846,892.000	

ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,960,000.000	3,608,240.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,710,000.000	2,175,205.500	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,380,000.000	1,795,380.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,620,000.000	2,014,956.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	3,092,928.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,100,000.000	2,774,310.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,880,000.000	2,507,732.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,970,000.000	2,617,736.000	
ITALY BTPS 5.25 08/01/17	5,530,000.000	6,180,328.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,910,000.000	3,887,760.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,360,000.000	3,038,382.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,170,000.000	2,798,931.100	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,530,000.000	2,182,239.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,900,000.000	4,211,960.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,710,000.000	3,973,944.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	950,000.000	1,455,590.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,970,000.000	3,147,863.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	300,000.000	302,784.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/18	1,990,000.000	2,066,714.500	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	1,290,000.000	1,354,629.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,490,000.000	1,649,608.800	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,240,000.000	1,403,432.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,640,000.000	1,871,404.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/17	1,980,000.000	2,082,108.600	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	950,000.000	1,183,709.500	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	500,000.000	694,010.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,790,000.000	2,135,470.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,590,000.000	1,884,706.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,540,000.000	1,942,864.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,450,000.000	2,309,908.000	

	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,300,000.000	2,039,050.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/16	2,279,000.000	2,418,246.900	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/18	1,290,000.000	1,471,116.000	
	NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,490,000.000	1,756,188.500	
	NETHERLANDS 4.5 07/15/17	2,000,000.000	2,226,800.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,250,000.000	1,975,125.000	
	SPAIN 2.75 04/30/19	980,000.000	1,059,468.200	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,000,000.000	2,200,440.000	
	SPAIN 3.25 04/30/16	3,750,000.000	3,893,625.000	
	SPAIN 3.75 10/31/18	1,500,000.000	1,667,655.000	
	SPAIN 3.8 01/31/17	3,950,000.000	4,210,700.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	2,070,000.000	2,471,787.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,220,000.000	2,568,429.000	
	SPAIN 4.1 07/30/18	2,120,000.000	2,372,280.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,550,000.000	1,945,792.500	
	SPAIN 4.25 10/31/16	2,870,000.000	3,069,579.800	
	SPAIN 4.3 10/31/19	2,120,000.000	2,465,560.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,500,000.000	1,860,225.000	
	SPAIN 4.5 01/31/18	2,120,000.000	2,367,192.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	3,110,000.000	3,633,724.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,400,000.000	1,785,420.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,189,000.000	1,597,718.750	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,580,000.000	2,019,240.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,460,000.000	2,990,622.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,300,000.000	1,762,930.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,200,000.000	1,594,800.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	650,000.000	915,811.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,000,000.000	2,610,380.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	2,310,000.000	2,925,384.000	
	SPAIN 5.5 07/30/17	2,960,000.000	3,332,575.200	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,530,000.000	2,224,467.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,120,000.000	2,768,126.400	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,350,000.000	1,893,105.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,750,000.000	2,537,867.500	
	ユーロ 小計	425,345,000.000 (59,429,203,400)	516,967,280.920 (72,230,668,490)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	16,940,000.000	20,793,003.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,410,000.000	5,999,210.100	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,780,000.000	6,331,908.600	

	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	14,150,000.000	13,909,167.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	8,690,000.000	7,815,786.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	2,520,000.000	2,531,869.200	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	18,200,000.000	19,000,436.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	2,500,000.000	2,520,225.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 09/15/17	2,200,000.000	2,293,852.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	3,300,000.000	3,394,380.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	5,960,000.000	6,247,927.600	
	南アフリカ・ランド 小計	89,650,000.000 (919,809,000)	90,837,764.500 (931,995,464)	
国債証券 合計		149,881,271,260 (149,881,271,260)	171,826,023,987 (171,826,023,987)	
合計		149,881,271,260 (149,881,271,260)	171,826,023,987 (171,826,023,987)	

- (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 116銘柄	38.82%	40.94%
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	8.01%	8.45%
オーストラリア・ドル	国債証券 16銘柄	1.62%	1.71%
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	2.17%	2.28%
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.36%	0.38%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.46%	0.48%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.70%	0.74%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.24%	0.26%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.60%	0.63%
マレーシア・リングgit	国債証券 14銘柄	0.46%	0.49%
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	1.00%	1.06%
ユーロ	国債証券 230銘柄	39.86%	42.04%
南アフリカ・ランド	国債証券 11銘柄	0.51%	0.54%

(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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,083,098,878	1,428,844,217
コール・ローン		56,894,491	44,695,119
株式		37,495,144,475	38,353,170,787
投資信託受益証券		595,605,690	297,864,319
投資証券		88,222,026	91,615,781
派生商品評価勘定		29,252,203	20,925,632
未収入金		1,843,031	76,392
未収配当金		201,788,648	24,764,588
差入委託証拠金		477,571,203	421,436,133
流動資産合計		40,029,420,645	40,683,392,968
資産合計		40,029,420,645	40,683,392,968
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		130,767	2,359,020
未払金		1,746	57,551,435
未払解約金		34,147,000	11,211,000
流動負債合計		34,279,513	71,121,455
負債合計		34,279,513	71,121,455
純資産の部			
元本等			
元本	1	40,840,815,210	39,367,301,761
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	845,674,078	1,244,969,752
元本等合計		39,995,141,132	40,612,271,513
純資産合計		39,995,141,132	40,612,271,513
負債純資産合計		40,029,420,645	40,683,392,968

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,097,535,766円	40,840,815,210円
	同期中追加設定元本額	3,848,230,800円	4,190,227,870円
	同期中一部解約元本額	5,104,951,356円	5,663,741,319円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	295,499,458円	425,843,375円
	マネックス資産設計ファンドエボリューション	311,445,375円	352,069,381円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国10）	8,267,924円	15,920,298円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国20）	20,869,332円	40,474,103円
	D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国30）	57,345,068円	110,434,511円
	投資のソムリエ	190,670,032円	163,231,034円
	クルーズコントロール	493,622,712円	635,058,506円
	投資のソムリエ< D C 年金 >	1,794,298円	2,424,454円
	D I A M 8 資産バランスファンドN< D C 年金 >	8,385,551円	29,770,153円
	クルーズコントロール< D C 年金 >	- 円	139,333円
	エマージング株式パッシブファンドV A（適格機関投資家専用）	7,458,945,137円	7,257,789,094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）	3,081,962,508円	3,074,267,724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）	2,174,923,438円	2,127,223,667円
	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	16,479,892,484円	15,436,504,597円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	10,257,191,893円	9,696,151,531円
	計	40,840,815,210円	39,367,301,761円
2 .	受益権の総数	40,840,815,210口	39,367,301,761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845,674,078円であります。	

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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	<p>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。</p> <p>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。</p>	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26年7月11日現在	平成27年1月13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ぬ。	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つた場合、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26年7月11日現在	平成27年1月13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	1,721,868,000	188,136,370
投資信託受益証券	16,227,819	11,347,956
投資証券	3,610,721	1,496,459
合計	1,709,250,902	178,284,873

（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26年4月19日から平成26年7月11日まで及び平成26年4月19日から平成27年1月13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26年7月11日 現在				平成27年1月13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	162,187,520	-	162,176,000	11,520	330,420,160	-	330,400,000	20,160
アメリカ・ドル	162,187,520	-	162,176,000	11,520	330,420,160	-	330,400,000	20,160
合計	162,187,520	-	162,176,000	11,520	330,420,160	-	330,400,000	20,160

（注）時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成26年7月11日 現在				平成27年1月13日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	1,553,268,181	-	1,582,378,097	29,109,916	1,504,858,799	-	1,523,405,251	18,546,452
合計	1,553,268,181	-	1,582,378,097	29,109,916	1,504,858,799	-	1,523,405,251	18,546,452

(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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	0.9793円	1.0316円
(1万口当たり純資産額)	(9,793円)	(10,316円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成27年1月13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	26,780	45.580	1,220,632.400	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,973	11.570	231,087.610	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	66,300	5.170	342,771.000	
	CREDICORP LTD	5,949	151.550	901,570.950	
	MOBILE TELESYSTEMS OJSC ADR	45,825	7.950	364,308.750	
	SOUTHERN COPPER CORP	12,580	27.890	350,856.200	
	LUKOIL SPON ADR	46,082	39.050	1,799,502.100	
	GLOBAL TELECOM HOLDING GDR	56,215	2.660	149,531.900	
	OAO GAZPROM ADR	527,936	4.498	2,374,656.120	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	83,374	6.720	560,273.280	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	84,200	1.472	123,942.400	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	61,746	3.950	243,896.700	
	SISTEMA JSFC GDR	15,837	4.490	71,108.130	
	NOVATEK OAO GDR	8,046	77.000	619,542.000	
	TELECOM EGYPT -GDR REG S	7,251	7.010	50,829.510	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	50,364	15.475	779,382.900	
	ROSTELECOM SPON ADR	13,980	8.450	118,131.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	124,998	3.280	409,993.440	
	URALKALI -SPON GDR	21,153	10.590	224,010.270	
	SEVERSTAL GDR	21,786	8.900	193,895.400	
	TATNEFT GDR	20,240	21.600	437,184.000	
	VTB BANK OJSC GDR	252,902	1.978	500,240.150	
	DP WORLD LTD	14,237	20.600	293,282.200	
	MAGNIT PJSC GDR	23,022	42.435	976,938.570	
ECOPETROL SA SP ADR	70,948	15.430	1,094,727.640		
FEDERAL HYDROGENERATING ADR	135,146	0.900	121,631.400		
SBERBANK ADR	239,409	4.262	1,020,361.150		
MEGAFON OAO GDR	9,723	15.500	150,706.500		
アメリカ・ドル 小計		2,066,002		15,724,993.670 (1,855,706,502)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	FIRST GULF BANK PJSC	65,317	16.950	1,107,123.150	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	77,215	6.480	500,353.200	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	95,969	6.850	657,387.650	

	NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC	55,835	13.400	748,189.000	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	294,258	7.390	2,174,566.620	
	ARABTEC HOLDING CO	94,034	2.950	277,400.300	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	274,447	2.450	672,395.150	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	190,449	2.010	382,802.490	
	アラブ首長国連邦・ディルハム 小計	1,147,524		6,520,217.560 (209,820,601)	
インド・ルビー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	110,265	850.300	93,758,329.500	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,876	676.400	11,414,926.400	
	ASIAN PAINTS LTD	27,790	807.750	22,447,372.500	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,318	485.050	3,549,595.900	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	27,577	1,233.000	34,002,441.000	
	ICICI BANK LTD	91,290	346.550	31,636,549.500	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	2,701	1,718.050	4,640,453.050	
	STATE BANK OF INDIA LTD	123,530	307.100	37,936,063.000	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	30,247	459.100	13,886,397.700	
	TATA STEEL LTD	25,639	396.750	10,172,273.250	
	TATA MOTORS LTD	62,103	522.300	32,436,396.900	
	JSW STEEL LTD	6,621	1,000.700	6,625,634.700	
	TATA POWER CO LTD	97,018	80.300	7,790,545.400	
	NESTLE INDIA LTD	1,704	6,462.750	11,012,526.000	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	51,907	257.650	13,373,838.550	
	GAIL INDIA LTD	31,444	430.250	13,528,781.000	
	SESA STERLITE LTD	104,288	206.250	21,509,400.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	68,260	347.700	23,734,002.000	
	GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEALTHCARE LTD	1,065	5,717.550	6,089,190.750	
	ACC LTD	3,257	1,404.600	4,574,782.200	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	130,203	1,128.550	146,940,595.650	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	42,398	360.900	15,301,438.200	
	INFOSYS LTD	80,206	2,115.950	169,711,885.700	
	WIPRO LTD	51,864	556.050	28,838,977.200	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	64,597	896.600	57,917,670.200	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,049	1,118.450	6,765,504.050	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	20,738	1,575.550	32,673,755.900	
	DABUR INDIA LTD	44,319	234.750	10,403,885.250	
	HERO MOTOCORP LTD	3,176	2,937.150	9,328,388.400	
	DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,141	3,207.250	32,524,722.250	
	BHARTI AIRTEL LTD	48,922	348.950	17,071,331.900	
	UNITED SPIRITS LTD	4,650	3,044.750	14,158,087.500	

	SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	61,817	835.300	51,635,740.100	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	2,562	1,706.300	4,371,540.600	
	AUROBINDO PHARMA LTD	11,358	1,177.600	13,375,180.800	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	32,302	149.400	4,825,918.800	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	14,995	435.500	6,530,322.500	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,445	1,040.850	13,994,228.250	
	CIPLA LTD/INDIA	26,995	630.750	17,027,096.250	
	LARSEN & TOUBRO LTD	28,917	1,534.200	44,364,461.400	
	ULTRATECH CEMENT LTD	2,562	2,700.300	6,918,168.600	
	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	41,278	2,509.700	103,595,396.600	
	ADANI ENTERPRISES LTD	8,706	514.550	4,479,672.300	
	NTPC LTD	143,909	140.000	20,147,260.000	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	6,088	831.750	5,063,694.000	
	AMBUJA CEMENTS LTD	55,970	228.000	12,761,160.000	
	RANBAXY LABORATORIES LTD	12,995	635.150	8,253,774.250	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	85,994	151.100	12,993,693.400	
	ITC LTD	190,224	357.850	68,071,658.400	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	84,596	78.000	6,598,488.000	
	SIEMENS INDIA LTD	5,734	926.200	5,310,830.800	
	UNITED BREWERIES LTD	5,209	912.950	4,755,556.550	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	8,780	1,058.850	9,296,703.000	
	TECH MAHINDRA LTD	4,815	2,754.000	13,260,510.000	
	CAIRN INDIA LTD	32,844	235.550	7,736,404.200	
	IDEA CELLULAR LTD	81,695	146.100	11,935,639.500	
	POWER FINANCE CORP LTD	25,765	283.450	7,303,089.250	
	DLF LTD	45,392	136.500	6,196,008.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	49,557	328.450	16,276,996.650	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	25,236	315.150	7,953,125.400	
	BAJAJ AUTO LTD	8,032	2,334.000	18,746,688.000	
	OIL INDIA LTD	12,465	550.850	6,866,345.250	
	COAL INDIA LTD	43,852	357.850	15,692,438.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	20,882	308.550	6,443,141.100	
	インド・ルピー 小計	2,593,134		1,488,536,671.650 (2,857,990,409)	
インドネシア・ルピア	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	35,000	25,800.000	903,000,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	151,501	17,075.000	2,586,879,575.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	372,500	7,425.000	2,765,812,500.000	

	UNILEVER INDONESIA TBK PT	120,900	32,100.000	3,880,890,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,658,300	7,000.000	11,608,100,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,190,000	2,835.000	11,878,650,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	687,000	3,825.000	2,627,775,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	49,500	60,100.000	2,974,950,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	141,000	24,200.000	3,412,200,000.000	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM TBK PT	93,500	11,525.000	1,077,587,500.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	4,615.000	1,340,269,840.000	
	BANK MANDIRI	817,700	10,825.000	8,851,602,500.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	143,000	14,450.000	2,066,350,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	927,400	11,750.000	10,896,950,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	883,900	5,800.000	5,126,620,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	602,600	6,075.000	3,660,795,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,328,500	1,785.000	4,156,372,500.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	238,200	15,950.000	3,799,290,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,025,700	13,000.000	13,334,100,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	188,000	4,325.000	813,100,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,601,200	1,040.000	1,665,248,000.000	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	674,500	1,730.000	1,166,885,000.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	2,675.000	1,253,237,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	187,500	6,975.000	1,307,812,500.000	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	44,000	14,625.000	643,500,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	808,500	1,935.000	1,564,447,500.000	
	ADARO ENERGY PT	1,090,500	995.000	1,085,047,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	123,000	12,500.000	1,537,500,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	151,500	9,400.000	1,424,100,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	393,500	3,290.000	1,294,615,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	20,487,317		110,703,687,415.000 (1,040,614,661)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	14,709	210.000	3,088,890.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	9,488	67.400	639,491.200	
	OOREDOO QSC	6,867	115.300	791,765.100	
	DOHA BANK QSC	2,652	55.000	145,860.000	

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,479	185.400	459,606.600	
	INDUSTRIES QATAR QSC	12,939	148.100	1,916,265.900	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	6,811	105.100	715,836.100	
	MASRAF AL RAYAN	32,101	43.250	1,388,368.250	
	BARWA REAL ESTATE CO	8,004	42.000	336,168.000	
	GULF INTERNATIONAL SERVICES	3,626	98.600	357,523.600	
	VODAFONE QATAR	26,910	15.100	406,341.000	
カタール・リアル	小計	126,586		10,246,115.750 (332,588,917)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	24,800	188.000	4,662,400.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	49.750	4,288,450.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	298,500	22.400	6,686,400.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	133,800	181.500	24,284,700.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	873,025	12.300	10,738,207.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	59,200	227.000	13,438,400.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	904,300	3.000	2,712,900.000	
	IRPC PCL NVDR	532,300	3.380	1,799,174.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	115,000	25.000	2,875,000.000	
	BANGKOK BANK PCL NVDR	25,500	188.000	4,794,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	268,400	27.000	7,246,800.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	93,900	247.000	23,193,300.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	339,300	8.150	2,765,295.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	32,100	71.000	2,279,100.000	
	PTT PCL	81,200	333.000	27,039,600.000	
	THAI UNION FROZEN PROD-NVDR	112,400	21.100	2,371,640.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	12,700	454.000	5,765,800.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	38,900	291.000	11,319,900.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	26,400	460.000	12,144,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	98,500	227.000	22,359,500.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	165,800	45.500	7,543,900.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	268,400	18.300	4,911,720.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	139.500	4,226,850.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	114,100	31.750	3,622,675.000	
	THAI OIL PCL NVDR	35,300	45.000	1,588,500.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	41,600	92.500	3,848,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	391,200	42.750	16,723,800.000	

	BTS GROUP HOLDINGS PCL	515,300	10.200	5,256,060.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	117,045	110.500	12,933,472.500	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	21,422	19.600	419,871.200	
	INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN	54,933	19.600	1,076,686.800	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	141,208	54.000	7,625,232.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	78,800	25.000	1,970,000.000	
タイ・パーツ 小計		6,131,833		264,511,334.000 (949,595,689)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,339	4,590.000	6,146,010.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	6,377	230.200	1,467,985.400	
	CEZ	13,038	571.000	7,444,698.000	
チェコ・コルナ 小計		20,754		15,058,693.400 (74,389,945)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,675,918	30.200	171,412,723.600	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,604	27,738.000	72,229,752.000	
	BANCO DE CHILE	1,692,507	69.490	117,612,311.430	
	CAP SA	4,555	2,601.100	11,848,010.500	
	EMPRESAS CMPC SA	102,347	1,484.600	151,944,356.200	
	EMPRESAS COPEC SA	37,593	6,795.000	255,444,435.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,190	5,617.000	74,088,230.000	
	ENTEL CHILE SA	8,743	6,111.100	53,429,347.300	
	ENDESA CHILE	275,334	917.570	252,638,218.380	
	ENERSIS SA	1,722,553	192.390	331,401,971.670	
	COLBUN SA	719,239	164.790	118,523,394.810	
	AGUAS ANDINAS SA	251,845	348.710	87,820,869.950	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	21,380	1,675.700	35,826,466.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	28,932	6,873.500	198,864,102.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	7,931	14,587.000	115,689,497.000	
	SACI FALABELLA	85,666	4,000.500	342,706,833.000	
	CORPBANCA	11,078,151	6.930	76,771,586.430	
VINA CONCHA Y TORO SA	39,636	1,150.100	45,585,363.600		
CENCOSUD SA	105,760	1,391.800	147,196,768.000		
AES GENER SA	209,506	322.050	67,471,407.300		
チリ・ペソ 小計		22,083,390		2,728,505,644.170 (523,054,532)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	148,107	8.920	1,321,114.440	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	20,878	21.650	452,008.700	
	ARCELIK	15,880	15.350	243,758.000	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	43,887	5.240	229,967.880	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,611	4.640	582,835.040	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	31.500	175,896.000	

	KOC HOLDING AS	54,466	12.400	675,378.400	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	32,248	3.980	128,347.040	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	47,162	3.860	182,045.320	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	12,826	16.000	205,216.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,435	9.910	440,350.850	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	72,920	14.350	1,046,402.000	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	212,483	9.580	2,035,587.140	
	TURKIYE IS BANKASI	135,648	6.700	908,841.600	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,970	54.450	597,316.500	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	11,216	18.850	211,421.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	76,848	5.070	389,619.360	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	80,353	10.250	823,618.250	
	COCA-COLA ICECEK AS	5,353	50.750	271,664.750	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	17,380	52.050	904,629.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	57,549	5.450	313,642.050	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	16,685	19.250	321,186.250	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	48,926	14.750	721,658.500	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	52,652	7.090	373,302.680	
	トルコ・リラ 小計	1,350,067		13,555,807.350 (699,615,218)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	15,067	3,390.000	51,077,130.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	2,102	11,500.000	24,173,000.000	
	OTP BANK NYRT	19,837	3,621.000	71,829,777.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	37,006		147,079,907.000 (64,788,699)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	608,100	34.000	20,675,400.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	163,780	54.200	8,876,876.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	75,426	93.000	7,014,618.000	
	AYALA CORP	20,133	710.000	14,294,430.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	212,800	24.100	5,128,480.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	15.560	5,474,786.000	
	GLOBE TELECOM INC	3,520	1,712.000	6,026,240.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	114.500	4,657,860.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	219,380	67.500	14,808,150.000	

	JOLLIBEE FOODS CORP	37,710	210.000	7,919,100.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	4,541	88.000	399,608.000	
	BDO UNIBANK INC	124,238	106.200	13,194,075.600	
	MEGAWORLD CORP	887,000	5.190	4,603,530.000	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO	7,870	2,946.000	23,185,020.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	522,075	17.440	9,104,988.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	74,950	194.000	14,540,300.000	
	SM INVESTMENTS CORP	12,462	850.000	10,592,700.000	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	748,500	8.710	6,519,435.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,289,200	5.130	6,613,596.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	42.550	5,229,395.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,527,115		188,858,587.600 (496,698,086)	
ブラジル・リアル	BRF SA	58,392	62.290	3,637,237.680	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA	26,730	10.550	282,001.500	
	VALE SA	113,827	22.640	2,577,043.280	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	31.780	254,812.040	
	VALE SA-PREF A	163,496	19.780	3,233,950.880	
	RAIA DROGASIL SA	21,900	26.300	575,970.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	73,200	11.700	856,440.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,250	7.750	180,187.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,749	5.570	115,571.930	
	BANCO DO BRASIL SA	72,100	22.150	1,597,015.000	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA	37,962	4.380	166,273.560	
	AES TIETE SA	7,100	17.170	121,907.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	286,297	9.220	2,639,658.340	
	LOJAS AMERICANAS SA	47,795	16.100	769,499.500	
	LOJAS AMERICANAS SA	5,725	12.490	71,505.250	
	GERDAU SA	71,130	9.430	670,755.900	
	METALURGICA GERDAU SA	24,400	10.950	267,180.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	11,806	93.410	1,102,798.460	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	247,510	8.770	2,170,662.700	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	353,312	8.910	3,148,009.920	
	SOUZA CRUZ SA	33,700	19.410	654,117.000	
	KROTON EDUCACIONAL SA	113,368	12.220	1,385,356.960	
	CCR SA	70,720	15.400	1,089,088.000	
	WEG SA	22,170	30.400	673,968.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	182,849	34.840	6,370,459.160	
	BANCO BRADESCO SA	54,260	34.400	1,866,544.000	
	NATURA COSMETICOS SA	14,400	30.290	436,176.000	

CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	66,706	5.350	356,877.100	
BRADSPAR SA	22,300	14.340	319,782.000	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	36,300	10.880	394,944.000	
CPFL ENERGIA SA	22,140	17.590	389,442.600	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	239,408	33.930	8,123,113.440	
PORTO SEGURO SA	9,400	29.250	274,950.000	
FIBRIA CELULOSE SA	19,990	31.390	627,486.100	
B2W CIA DIGITAL	10,300	19.900	204,970.000	
BRASKEM SA	14,130	15.990	225,938.700	
TRACTEBEL ENERGIA SA	12,870	30.950	398,326.500	
LOCALIZA RENT A CAR	10,205	34.560	352,684.800	
TELEFONICA BRASIL S.A.	24,328	46.890	1,140,739.920	
LOJAS RENNER SA	11,700	74.300	869,310.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,100	8.690	157,289.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,552	49.000	1,546,048.000	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	6,800	23.440	159,392.000	
TOTVS SA	9,900	34.210	338,679.000	
EMBRAER SA	59,460	22.910	1,362,228.600	
CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	17,900	24.610	440,519.000	
M DIAS BRANCO SA	3,600	88.500	318,600.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	6,800	18.680	127,024.000	
ODONTOPREV SA	22,600	9.800	221,480.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	37,600	15.700	590,320.000	
JBS SA	62,600	10.500	657,300.000	
OI SA-PREFERENCE	25,192	5.700	143,594.400	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	68,449	11.440	783,056.560	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,898	16.530	461,153.940	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	7,900	47.300	373,670.000	
BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL	18,300	13.050	238,815.000	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,200	17.080	413,336.000	
DURATEX SA	34,037	7.660	260,723.420	
SUL AMERICA SA	15,448	11.290	174,407.920	
HYPERMARCAS SA	31,100	16.410	510,351.000	
BM&FBOVESPA SA	148,900	9.060	1,349,034.000	
QUALICORP SA	17,800	27.000	480,600.000	

	BANCO SANTANDER BRASIL SA	32,900	12.660	416,514.000	
	CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO	20,152	32.750	659,978.000	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	17,300	10.070	174,211.000	
	CIELO SA	61,314	38.830	2,380,822.620	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	57,500	30.000	1,725,000.000	
	AMBEV SA	408,195	16.780	6,849,512.100	
	VIA VAREJO SA	9,300	18.790	174,747.000	
	KLABIN SA	44,800	14.570	652,736.000	
ブラジル・リアル	小計	4,013,540		74,733,897.280 (3,298,006,887)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	43,979	8.240	362,386.960	
	MBANK	1,699	505.000	857,995.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	3,518	107.750	379,064.500	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,689	109.000	1,383,101.000	
	BANK PEKAO SA	10,821	175.000	1,893,675.000	
	ORANGE POLSKA SA	55,813	7.950	443,713.350	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	28,514	51.450	1,467,045.300	
	LPP SA	79	7,370.000	582,230.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,841	370.300	1,052,022.300	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	74,418	36.180	2,692,443.240	
	CCC SA	1,709	146.000	249,514.000	
	SYNTHOS SA	60,398	4.170	251,859.660	
	EUROCASH SA	7,580	35.600	269,848.000	
	GRUPA LOTOS SA	7,977	26.470	211,151.190	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	147,281	4.530	667,182.930	
	CYFROWY POLSAT SA	14,022	23.400	328,114.800	
	GRUPA AZOTY SA	4,565	70.000	319,550.000	
	ENEA SA	18,176	16.230	294,996.480	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	72,561	19.140	1,388,817.540	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	82,524	5.140	424,173.360	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	4,742	479.000	2,271,418.000	
	GETIN NOBLE BANK SA	89,202	2.390	213,192.780	
	ALIOR BANK SA	4,463	81.120	362,038.560	
	ENERGA SA	16,509	21.630	357,089.670	
ポーランド・ズロチ	小計	766,080		18,722,623.620 (612,042,566)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	135,100	6.440	870,044.000	

GENTING PLANTATIONS BHD	10,100	9.990	100,899.000	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	406,200	5.180	2,104,116.000	
DIGI.COM BHD	285,000	6.180	1,761,300.000	
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	57,600	6.330	364,608.000	
RHB CAPITAL BHD	62,600	7.730	483,898.000	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	81,735	3.450	281,985.750	
GAMUDA BHD	165,800	5.030	833,974.000	
GENTING BHD	161,800	8.690	1,406,042.000	
YTL CORP BHD	303,210	1.690	512,424.900	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,400	16.520	303,968.000	
HONG LEONG BANK BHD	68,500	13.980	957,630.000	
IJM CORP BHD	102,980	6.600	679,668.000	
IOI CORP BHD	245,913	4.720	1,160,709.360	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	39,900	22.300	889,770.000	
MALAYAN BANKING BHD	392,275	8.580	3,365,719.500	
LAFARGE MALAYSIA BHD	60,500	10.000	605,000.000	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	85,100	4.720	401,672.000	
MISC BHD	109,680	7.450	817,116.000	
PPB GROUP BHD	38,000	14.240	541,120.000	
PETRONAS DAGANGAN BHD	14,600	16.560	241,776.000	
PETRONAS GAS BHD	59,300	21.820	1,293,926.000	
GENTING MALAYSIA BHD	280,200	3.950	1,106,790.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	11,400	64.800	738,720.000	
TELEKOM MALAYSIA BHD	105,000	6.780	711,900.000	
TENAGA NASIONAL BHD	239,950	14.200	3,407,290.000	
UMW HOLDINGS BHD	40,300	10.620	427,986.000	
DIALOG GROUP BHD	228,444	1.520	347,234.880	
PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	233,730	17.520	4,094,949.600	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	264,763	1.500	397,144.500	
AIRASIA BHD	83,400	2.620	218,508.000	
SIME DARBY BERHAD	247,900	9.150	2,268,285.000	
AXIATA GROUP BERHAD	201,000	7.050	1,417,050.000	
UEM SUNRISE BHD	145,600	1.260	183,456.000	
BUMI ARMADA BHD	195,350	1.200	234,420.000	
MAXIS BHD	175,900	6.950	1,222,505.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	218,900	5.180	1,133,902.000	
SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD	324,300	2.490	807,507.000	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	142,900	3.020	431,558.000	
IHH HEALTHCARE BHD	249,600	4.900	1,223,040.000	
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	119,200	2.170	258,664.000	

	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	137,605	2.220	305,483.100	
マレーシア・リンギット 小計		6,549,735		40,913,759.590 (1,351,381,479)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	232,400	31.250	7,262,500.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	31,200	129.760	4,048,512.000	
	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV	52,500	50.320	2,641,800.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	18,300	145.460	2,661,918.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	167,100	28.770	4,807,467.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	227,500	95.210	21,660,275.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	154,600	39.730	6,142,258.000	
	GRUMA SAB DE CV	13,800	151.730	2,093,874.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	24,700	171.720	4,241,484.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	53,300	69.050	3,680,365.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	213,900	75.570	16,164,423.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	80,088	43.660	3,496,642.080	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,610	286.010	3,892,596.100	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	139,700	31.620	4,417,314.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	16,200	189.920	3,076,704.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	343,652	41.230	14,168,771.960	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,907,778	16.500	47,978,337.000	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	189,500	39.140	7,417,030.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	33,800	91.710	3,099,798.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	454,800	29.150	13,257,420.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	26,200	94.030	2,463,586.000	
	GENOMMA LAB INTERNACIONAL SAB DE CV	69,800	24.270	1,694,046.000	
OHL MEXICO SAB DE CV	51,600	26.300	1,357,080.000		
MINERA FRISCO SAB DE CV	51,700	20.660	1,068,122.000		
COMPARTAMOS SAB DE CV	90,100	27.740	2,499,374.000		
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA DE CV	29,000	40.710	1,180,590.000		
GRUPO LALA SAB DE CV	43,400	28.210	1,224,314.000		
メキシコ・ペソ 小計		5,730,228		187,696,601.140 (1,512,834,604)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	174,804	0.955	166,937.820	
	ALPHA BANK A.E.	302,978	0.470	142,399.660	

	NATIONAL BANK OF GREECE	139,891	1.360	190,251.760	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,332	19.600	104,507.200	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	19,004	8.510	161,724.040	
	FF GROUP	3,130	26.600	83,258.000	
	EUROBANK ERGASIAS	715,082	0.189	135,150.490	
	OPAP SA	19,320	8.800	170,016.000	
	JUMBO SA	5,623	8.370	47,064.510	
	PUBLIC POWER CORP	10,857	5.200	56,456.400	
ユーロ 小計		1,396,021		1,257,765.880 (175,735,049)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,090	16,850.000	119,466,500.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,067	135,500.000	415,578,500.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,864	292,000.000	836,288,000.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	3,798	52,900.000	200,914,200.000	
	COWAY CO LTD	4,858	80,700.000	392,040,600.000	
	KT&G CORP	9,009	84,000.000	756,756,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,432	68,300.000	97,805,600.000	
	KOREA GAS CORP	2,355	46,950.000	110,567,250.000	
	CJ CORP	1,359	167,500.000	227,632,500.000	
	DAUM KAKAO CORP	2,079	145,400.000	302,286,600.000	
	DOOSAN INFRACORE CO.,LTD	10,180	9,820.000	99,967,600.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	9,480	17,200.000	163,056,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	864	267,000.000	230,688,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,426	59,300.000	143,861,800.000	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	20,370	9,820.000	200,033,400.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,442	196,500.000	283,353,000.000	
	LG UPLUS CORP	19,290	12,350.000	238,231,500.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	22,700.000	91,935,000.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	12,500	5,360.000	67,000,000.000	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	4,351	29,200.000	127,049,200.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	797	613,000.000	488,561,000.000	
	LG CHEM LTD	4,005	180,500.000	722,902,500.000	
	LG CHEM LTD	480	134,500.000	64,560,000.000	
	LS CORP	1,350	52,200.000	70,470,000.000	
	LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	2,503	59,800.000	149,679,400.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	35,208	43,500.000	1,531,548,000.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	5,023	42,050.000	211,217,150.000		
HYUNDAI MERCHANT MARINE	5,812	10,250.000	59,573,000.000		
S-OIL CORP	2,721	48,850.000	132,920,850.000		

HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,261	11,550.000	95,414,550.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,278	44,600.000	279,998,800.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,258	148,000.000	186,184,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,976	100,500.000	299,088,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,377	100,000.000	337,700,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,876	238,000.000	1,398,488,000.000	
SK HYNIX INC	50,373	50,300.000	2,533,761,900.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,979	39,350.000	235,273,650.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,167	127,000.000	275,209,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,336	177,500.000	2,367,140,000.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	987	70,200.000	69,287,400.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,364	67,800.000	431,479,200.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	20,219	13,500.000	272,956,500.000	
KCC CORP	577	522,000.000	301,194,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,405	53,000.000	1,187,465,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	662	426,500.000	282,343,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,979	41,750.000	917,623,250.000	
HANWHA CORP	4,116	30,950.000	127,390,200.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,851	44,900.000	128,009,900.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	73,500.000	110,250,000.000	
KOREA EXPRESS CO LTD	533	190,500.000	101,536,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,472	85,700.000	126,150,400.000	
KT CORP	5,458	29,950.000	163,467,100.000	
LG ELECTRONICS INC	8,994	62,100.000	558,527,400.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	71	1,793,000.000	127,303,000.000	
LG CORP	7,708	62,500.000	481,750,000.000	
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	18,102	10,700.000	193,691,400.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,945	21,200.000	83,634,000.000	
NAVER CORP	2,412	750,000.000	1,809,000,000.000	
PARADISE CO LTD	3,271	23,300.000	76,214,300.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,551	119,000.000	184,569,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,730	48,150.000	179,599,500.000	
DOOSAN CORP	404	102,000.000	41,208,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	247	985,000.000	243,295,000.000	
KANGWON LAND INC	9,398	31,150.000	292,747,700.000	
POSCO	5,407	290,500.000	1,570,733,500.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,891	32,850.000	94,969,350.000	

SAMSUNG C&T CORP	11,482	59,400.000	682,030,800.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,318	116,000.000	500,888,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,014	62,600.000	313,876,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	9,533	1,316,000.000	12,545,428,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	14,050	18,800.000	264,140,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,762	1,025,000.000	1,806,050,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	463	174,500.000	80,793,500.000	
HYOSUNG CORP	1,783	69,600.000	124,096,800.000	
ORION CORP	312	975,000.000	304,200,000.000	
YUHAN CORP	699	169,000.000	118,131,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,331	161,500.000	376,456,500.000	
HALLA CLIMATE CONTROL	3,292	46,900.000	154,394,800.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,710	26,550.000	151,600,500.000	
GS HOLDINGS CORP	4,288	38,200.000	163,801,600.000	
LG DISPLAY CO LTD	19,621	35,100.000	688,697,100.000	
SK NETWORKS CO LTD	10,280	8,970.000	92,211,600.000	
HITE JINRO CO LTD	3,513	23,000.000	80,799,000.000	
CELLTRION INC	6,286	38,500.000	242,011,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	23,143	32,150.000	744,047,450.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,245	300,000.000	373,500,000.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	3,130	44,250.000	138,502,500.000	
LOTTE SHOPPING CO	850	256,500.000	218,025,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,157	116,000.000	598,212,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	270	2,223,000.000	600,210,000.000	
SAMSUNG CARD CO	3,858	39,350.000	151,812,300.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,744	84,500.000	400,868,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	703	335,500.000	235,856,500.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,528	84,000.000	128,352,000.000	
LG INNOTEK CO LTD	945	117,000.000	110,565,000.000	
SK C&C CO LTD	1,712	234,500.000	401,464,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	31,397	35,750.000	1,122,442,750.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,471	191,500.000	281,696,500.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,381	39,300.000	132,873,300.000	
BS FINANCIAL GROUP INC	18,744	13,950.000	261,478,800.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	18,670	8,000.000	149,360,000.000	
E-MART CO LTD	1,845	211,000.000	389,295,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	11,200	11,000.000	123,200,000.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,765	50,500.000	341,632,500.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,190	289,000.000	632,910,000.000	
WOORI BANK	23,019	9,380.000	215,918,220.000	

	CHEIL INDUSTRIES INC	1,703	147,500.000	251,192,500.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC-RTS	2,339	1,740.000	4,069,860.000	
韓国・ウォン 小計		712,644		53,397,686,430.000 (5,825,687,589)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	103,000	13.700	1,411,100.000	
	JIANGSU EXPRESS	110,000	9.350	1,028,500.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	528,000	94.850	50,080,800.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	107,500	29.300	3,149,750.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	280,000	4.310	1,206,800.000	
	BEIJING ENTERPRISES	40,500	61.000	2,470,500.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	320,000	10.620	3,398,400.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	230,000	4.980	1,145,400.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	118,000	6.570	775,260.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	65,500	80.450	5,269,475.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	128,000	6.160	788,480.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	80,800	19.380	1,565,904.000	
	NEW WORLD CHINA LAND LTD	286,000	4.820	1,378,520.000	
	CNOOC LTD	1,539,000	10.640	16,374,960.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	242,000	13.700	3,315,400.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	232,000	6.780	1,572,960.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	357,120	24.250	8,660,160.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	166,000	21.950	3,643,700.000	
	CITIC LTD	186,000	13.700	2,548,200.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	130,000	7.200	936,000.000	
	LENOVO GROUP LTD	590,000	10.760	6,348,400.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,818,000	8.770	15,943,860.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	486,742	11.100	5,402,836.200	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	95,590	22.100	2,112,539.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,117,200	6.210	13,147,812.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,000	47.200	3,020,800.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	280,000	7.570	2,119,600.000	
COSCO PACIFIC LTD	138,000	11.020	1,520,760.000		
YUEXIU PROPERTY CO LTD	460,180	1.570	722,482.600		

CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTL	106,000	25.950	2,750,700.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	414,000	3.950	1,635,300.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	17.980	1,402,440.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	188,000	12.320	2,316,160.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	54,900	13.140	721,386.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	470,000	2.910	1,367,700.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	88,000	19.900	1,751,200.000	
BYD CO LTD	48,000	29.650	1,423,200.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,214,000	4.430	5,378,020.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	154,000	13.720	2,112,880.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	470,000	1.460	686,200.000	
SINOTRANS LTD	147,000	5.600	823,200.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	212,000	11.800	2,501,600.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	197,000	4.140	815,580.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	303,192	15.080	4,572,135.360	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	176,000	5.100	897,600.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	20.050	3,191,960.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	85,000	41.950	3,565,750.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	642,000	30.400	19,516,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	661,000	2.410	1,593,010.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	5.780	924,800.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,973,000	0.720	1,420,560.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	42,360	31.950	1,353,402.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	363,000	2.280	827,640.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	38,000	23.500	893,000.000	
TINGYI HOLDING CORP	180,000	17.780	3,200,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	32,000	53.250	1,704,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	206,000	10.720	2,208,320.000	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	100,000	15.780	1,578,000.000	

ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	164,000	9.430	1,546,520.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	260,000	7.910	2,056,600.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	283,000	2.520	713,160.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	109,000	33.700	3,673,300.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	445,400	127.100	56,610,340.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	224,500	82.550	18,532,475.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	382,000	5.260	2,009,320.000	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD	953,240	1.170	1,115,290.800	
AIR CHINA / HONG KONG	168,000	7.080	1,189,440.000	
ZTE CORP	50,240	17.700	889,248.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	224,000	4.190	938,560.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	280,000	22.500	6,300,000.000	
COSCO HOLDINGS	174,500	4.070	710,215.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	686,205	6.740	4,625,021.700	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	162,000	11.160	1,807,920.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	62,000	44.900	2,783,800.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,182,530	6.400	39,568,192.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	60,000	26.350	1,581,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	248,000	11.520	2,856,960.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	190,000	6.070	1,153,300.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	206,000	7.810	1,608,860.000	
BANK OF CHINA LTD	6,830,200	4.390	29,984,578.000	
SHUI ON LAND LTD	345,600	1.870	646,272.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	123,000	18.360	2,258,280.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	68,400	9.580	655,272.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	381,970	18.540	7,081,723.800	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,329,235	5.680	35,950,054.800	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	209,600	3.660	767,136.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	338,000	9.770	3,302,260.000	
CHINA COAL ENERGY CO	308,000	4.720	1,453,760.000	

HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	69,000	14.820	1,022,580.000	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC CO LTD	46,000	44.700	2,056,200.000	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	120,000	5.660	679,200.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	82,000	20.150	1,652,300.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	215,800	3.040	656,032.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	490,142	3.200	1,568,454.400	
CHINA CITIC BANK-H	653,800	5.910	3,863,958.000	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	392,000	8.890	3,484,880.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	78,000	13.300	1,037,400.000	
FOSUN INTERNATIONAL	164,000	10.640	1,744,960.000	
FRANSHION PROPERTIES CHINA LTD	178,000	2.380	423,640.000	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS LTD	287,000	4.960	1,423,520.000	
SOHO CHINA LTD	208,500	5.680	1,184,280.000	
KINGSOFT CORP LTD	56,000	15.980	894,880.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	937,000	1.820	1,705,340.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	298,000	6.190	1,844,620.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	126,000	6.980	879,480.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	148,000	9.670	1,431,160.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	522,000	10.000	5,220,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	230,200	38.300	8,816,660.000	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP LTD	559,000	3.400	1,900,600.000	
CSR CORP LTD - H	194,000	9.570	1,856,580.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	88,000	13.160	1,158,080.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	230,500	7.910	1,823,255.000	
BBMG CORP	131,000	7.140	935,340.000	
SINOPHARM GROUP CO	106,800	29.500	3,150,600.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	230,000	5.010	1,152,300.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	161,805	7.180	1,161,759.900	
CHINA SOUTH CITY HOLDINGS LTD	184,000	3.000	552,000.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	272,000	4.850	1,319,200.000	

	CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	280,000	8.520	2,385,600.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	74,500	17.720	1,320,140.000	
	SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	396,000	5.490	2,174,040.000	
	LONGFOR PROPERTIES CO LTD	90,500	11.040	999,120.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	69,200	40.700	2,816,440.000	
	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	515,880	10.320	5,323,881.600	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	172,000	4.330	744,760.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,785,000	4.010	7,157,850.000	
	FAR EAST HORIZON LTD	146,000	7.260	1,059,960.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	109,000	28.800	3,139,200.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD	117,200	18.780	2,201,016.000	
	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	49,400	17.040	841,776.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	514,000	3.810	1,958,340.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	33,500	28.300	948,050.000	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	82,500	5.680	468,600.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	148,500	9.660	1,434,510.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	1,056,000	2.750	2,904,000.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	404,000	1.380	557,520.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	449,000	3.820	1,715,180.000	
	CHINA CNR CORP LTD	185,500	9.890	1,834,595.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	112,261	17.700	1,987,019.700	
	CGN POWER CO LTD	450,000	3.360	1,512,000.000	
香港・ドル	小計	61,407,892		570,644,018.860 (8,685,201,967)	
台湾・ドル	ACER INC	203,069	20.650	4,193,374.850	
	ASUSTEK COMPUTER INC	61,554	333.000	20,497,482.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,616	102.000	3,632,832.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	522,729	37.700	19,706,883.300	
	ASIA CEMENT CORP	173,928	38.000	6,609,264.000	

TAIWAN BUSINESS BANK	271,957	9.110	2,477,528.270	
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS CORP	2,105	326.000	686,230.000	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	98,000	54.300	5,321,400.000	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	51.600	4,024,800.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	80,210	23.250	1,864,882.500	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	51,853	86.300	4,474,913.900	
QUANTA COMPUTER INC	230,858	77.600	17,914,580.800	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	53,900	65.200	3,514,280.000	
EVA AIRWAYS CORP	179,227	24.200	4,337,293.400	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	253.000	14,107,280.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	480,284	17.800	8,549,055.200	
CHINA AIRLINES	232,156	15.800	3,668,064.800	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	148,169	73.700	10,920,055.300	
CHINA STEEL CORP	968,058	26.450	25,605,134.100	
CHINA MOTORS CO	57,000	27.250	1,553,250.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	262,178	26.000	6,816,628.000	
ADVANTECH CO LTD	32,264	230.000	7,420,720.000	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO LTD	23,460	37.500	879,750.000	
CLEVO CO	48,424	47.600	2,304,982.400	
COMPAL ELECTRONICS INC	349,304	23.150	8,086,387.600	
CTCI CORP	39,000	50.200	1,957,800.000	
DELTA ELECTRONICS INC	155,448	178.500	27,747,468.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	320,327	93.700	30,014,639.900	
AU OPTRONICS CORP	707,194	18.350	12,977,009.900	
TAIWAN MOBILE CO LTD	133,800	108.000	14,450,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	215,399	24.100	5,191,115.900	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORES CO LTD	60,576	27.200	1,647,667.200	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	268,063	31.000	8,309,953.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	16,640	306.500	5,100,160.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,285	179.500	8,487,657.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	347,633	74.000	25,724,842.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	89,000	31.000	2,759,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	279,594	65.900	18,425,244.600	
TRANSCEND INFORMATION INC	22,897	98.900	2,264,513.300	
EPISTAR CORP	69,149	63.500	4,390,961.500	

GIANT MANUFACTURING	21,151	274.000	5,795,374.000	
MEDIATEK INC	120,507	488.000	58,807,416.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	561,936	49.150	27,619,154.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	498,295	17.350	8,645,418.250	
HOTAI MOTOR CO LTD	23,000	442.500	10,177,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	151,000	76.600	11,566,600.000	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	29,088	155.000	4,508,640.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	836,940	15.250	12,763,335.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	676,920	45.250	30,630,630.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,166,403	10.150	11,838,990.450	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	501,528	19.300	9,679,490.400	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,081,781	85.700	92,708,631.700	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	833,075	23.700	19,743,877.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	2,320.000	19,070,400.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	624,751	12.700	7,934,337.700	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	623,276	8.870	5,528,458.120	
INVENTEC CO LTD	211,005	21.300	4,494,406.500	
HTC CORPORATION	66,832	152.000	10,158,464.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	192,974	37.300	7,197,930.200	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS CORP	43,496	98.700	4,293,055.200	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	591,214	12.800	7,567,539.200	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,163,450	20.300	23,618,035.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	669,793	18.350	12,290,701.550	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	19,950	217.000	4,329,150.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	47,560	52.500	2,496,900.000	
NAN YA PLASTICS CORP	400,828	63.800	25,572,826.400	
WISTRON CORP	181,035	28.800	5,213,808.000	
KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP	31,020	103.500	3,210,570.000	
POU CHEN CORP	158,990	39.500	6,280,105.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	412,171	49.250	20,299,421.750	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	46,392	237.500	11,018,100.000	

	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	64,480	65.200	4,204,096.000	
	PHISON ELECTRONICS CORP	14,658	228.000	3,342,024.000	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	81,569	49.250	4,017,273.250	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	52,715	66.300	3,495,004.500	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	89,130	84.500	7,531,485.000	
	SILICONWARE PRECISION INDS	268,743	47.600	12,792,166.800	
	STANDARD FOODS CORP	35,564	66.400	2,361,449.600	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	127,666	46.150	5,891,785.900	
	TAIWAN CEMENT CORP	276,874	40.750	11,282,615.500	
	TAIWAN GLASS INDUSTRIAL CORP	61,301	23.150	1,419,118.150	
	TSRC CORP	77,179	32.750	2,527,612.250	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	181,000	29.300	5,303,300.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,122,083	132.000	280,114,956.000	
	U-MING MARINE TRANSPORT CORP	51,000	48.650	2,481,150.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	996,525	15.750	15,695,268.750	
	WALSIN LIHWA CORP	243,000	9.730	2,364,390.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	86,668	17.000	1,473,356.000	
	YULON MOTOR CO	108,149	46.200	4,996,483.800	
	INOTERA MEMORIES INC	200,000	49.450	9,890,000.000	
	INNOLUX CORPORATION	614,345	16.750	10,290,278.750	
	WPG HOLDINGS CO LTD	111,526	36.900	4,115,309.400	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,504	256.500	5,002,776.000	
	HERMES MICROVISION INC	3,000	1,420.000	4,260,000.000	
	PEGATRON CORP	149,554	74.800	11,186,639.200	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	95,150	76.600	7,288,490.000	
	SCINOPHARM TAIWAN LTD	28,620	53.500	1,531,170.000	
	TPK HOLDING CO LTD	24,494	211.000	5,168,234.000	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	141,000	16.950	2,389,950.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	14,385	87.800	1,263,003.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	510,999	16.100	8,227,083.900	
台湾・ドル	小計	26,317,530		1,285,581,221.290 (4,756,650,519)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	112,536	0.310	34,886.160	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	8,785	121.050	1,063,424.250	
	BARLOWORLD LTD	18,561	96.540	1,791,878.940	

BIDVEST GROUP LTD	27,094	288.270	7,810,387.380	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	28,862	79.030	2,280,963.860	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	182,977	58.550	10,713,303.350	
ASSORE LTD	3,722	135.000	502,470.000	
DISCOVERY LTD	27,542	110.000	3,029,620.000	
REDEFINE PROPERTIES LTD	299,835	10.850	3,253,209.750	
MASSMART HOLDINGS LTD	10,432	147.220	1,535,799.040	
GOLD FIELDS LTD	63,646	67.450	4,292,922.700	
REMGRO LTD	42,953	245.520	10,545,820.560	
THE FOSCHINI GROUP LTD	19,461	140.000	2,724,540.000	
MMI HOLDINGS LTD	91,004	29.290	2,665,507.160	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	181,468	27.520	4,993,999.360	
EXXARO RESOURCES LTD	12,410	105.780	1,312,729.800	
LIBERTY HOLDINGS LTD	11,685	120.800	1,411,548.000	
MTN GROUP LTD	145,069	199.880	28,996,391.720	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	36,495	119.390	4,357,138.050	
TELKOM SA SOC LTD	19,140	68.800	1,316,832.000	
FIRSTRAND LTD	262,641	48.210	12,661,922.610	
NASPERS LTD	34,308	1,612.570	55,324,051.560	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	22,337	108.530	2,424,234.610	
NEDBANK GROUP LTD	20,550	238.000	4,890,900.000	
NETCARE LTD	76,295	36.230	2,764,167.850	
PICK'N PAY STORES LTD	27,363	52.050	1,424,244.150	
RMB HOLDINGS LTD	64,710	61.200	3,960,252.000	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,361	345.520	1,506,812.720	
SAPPI LTD	47,232	41.560	1,962,961.920	
SASOL LTD	45,708	381.800	17,451,314.400	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,558	172.200	6,984,087.600	
MR PRICE GROUP LTD	19,601	235.540	4,616,819.540	
BRAIT SE	29,274	77.300	2,262,880.200	
STANDARD BANK GROUP LTD	99,866	141.750	14,156,005.500	
SPAR GROUP LTD/THE	13,119	166.490	2,184,182.310	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	77,173	76.000	5,865,148.000	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	14,898	184.680	2,751,362.640	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	26,189	411.810	10,784,892.090	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	29,034	178.000	5,168,052.000	
TIGER BRANDS LTD	13,021	350.730	4,566,855.330	
NAMPAK LTD	60,915	41.000	2,497,515.000	
SANLAM LTD	153,886	63.900	9,833,315.400	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	33,048	104.580	3,456,159.840	
INVESTEC LTD	18,814	93.660	1,762,119.240	

IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	49,265	73.850	3,638,220.250	
KUMBA IRON ORE LTD	4,785	240.130	1,149,022.050	
PPC LTD	53,682	23.540	1,263,674.280	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	85,791	40.360	3,462,524.760	
RMI HOLDINGS	60,982	41.190	2,511,848.580	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	71,154	28.450	2,024,331.300	
VODACOM GROUP PTY LTD	30,070	126.550	3,805,358.500	
RESILIENT PROPERTY INCOME FUND LTD	19,381	85.020	1,647,772.620	
南アフリカ・ランド 小計	2,953,688		295,396,380.930 (3,030,766,868)	
合計	171,418,086		38,353,170,787 (38,353,170,787)	

(2) 株式以外の有価証券

平成27年1月13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	1,082,066.000	15,982,114.820	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	166,300.000	20,973,756.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,248,366.000	36,955,870.820 (297,864,319)	
投資信託受益証券 合計			1,248,366	297,864,319 (297,864,319)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	173,951.000	516,634.470	
		トルコ・リラ 小計	173,951.000	516,634.470 (26,663,505)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	192,100.000	8,058,595.000	
		メキシコ・ペソ 小計	192,100.000	8,058,595.000 (64,952,276)	
投資証券 合計			366,051	91,615,781 (91,615,781)	
合計				389,480,100 (389,480,100)	

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 28銘柄	4.57%	-%	-%	4.79%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 8銘柄	0.52%	-%	-%	0.54%
インド・ルピー	株式 64銘柄	7.04%	-%	-%	7.38%
インドネシア・ルピア	株式 30銘柄	2.56%	-%	-%	2.69%
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.82%	-%	-%	0.86%
タイ・バーツ	株式 33銘柄	2.34%	-%	-%	2.45%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.18%	-%	-%	0.19%
チリ・ペソ	株式 20銘柄	1.29%	-%	-%	1.35%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	1.72% -%	-% -%	-% 0.07%	1.87%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.16%	-%	-%	0.17%
フィリピン・ペソ	株式 20銘柄	1.22%	-%	-%	1.28%
ブラジル・レアル	株式 70銘柄	8.12%	-%	-%	8.51%
ポーランド・ズロチ	株式 24銘柄	1.51%	-%	-%	1.58%
マレーシア・リンギット	株式 42銘柄	3.33%	-%	-%	3.49%
メキシコ・ペソ	株式 27銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	3.73% -% -%	-% 0.73% -%	-% -% 0.16%	4.84%
ユーロ	株式 10銘柄	0.43%	-%	-%	0.45%
韓国・ウォン	株式 108銘柄	14.34%	-%	-%	15.04%
香港・ドル	株式 140銘柄	21.39%	-%	-%	22.42%
台湾・ドル	株式 101銘柄	11.71%	-%	-%	12.28%
南アフリカ・ランド	株式 52銘柄	7.46%	-%	-%	7.82%

(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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
資産の部			
流動資産			
預金		695,144,472	685,209,686
コール・ローン		32,310,039	443,812,212
国債証券		38,125,585,732	40,303,011,312
派生商品評価勘定		14,400	22,176
未収入金		263,792,617	-
未収利息		664,145,508	686,705,887
前払費用		57,080,161	72,571,702
流動資産合計		39,838,072,929	42,191,332,975
資産合計		39,838,072,929	42,191,332,975
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	6,423,900
未払解約金		19,209,000	9,628,000
流動負債合計		19,209,000	16,051,900
負債合計		19,209,000	16,051,900
純資産の部			
元本等			
元本	1	26,672,684,439	23,920,411,405
剰余金			
剰余金又は欠損金()		13,146,179,490	18,254,869,670
元本等合計		39,818,863,929	42,175,281,075
純資産合計		39,818,863,929	42,175,281,075
負債純資産合計		39,838,072,929	42,191,332,975

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26年7月11日現在	平成27年1月13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	25,243,130,380円 4,740,786,516円 3,311,232,457円	26,672,684,439円 7,947,613,154円 10,699,886,188円
元本の内訳 ファンド名 マネックス資産設計ファンド エボリューション D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国10） D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国20） D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国30） 投資のソムリエ クルーズコントロール 投資のソムリエ＜DC年金＞ D I A M 8資産バランスファ ンドN＜DC年金＞ クルーズコントロール＜DC年 金＞ グローバル債券ファンド（適格 機関投資家限定） エマージング債券リスク抑制型 （適格機関投資家限定）	49,967,584円 5,374,082円 13,607,019円 37,700,639円 555,755,277円 314,530,561円 5,253,529円 5,416,583円 - 円	57,510,133円 9,269,550円 23,576,273円 64,534,061円 317,759,242円 388,706,635円 4,658,413円 17,435,324円 85,282円 321,885,428円 2,179,089,966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)	861,528,632円	717,844,856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)	4,776,036,590円	4,168,767,002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)	10,633,051,837円	9,023,579,707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)	6,611,007,867円	5,668,623,377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)	1,061,729,208円	633,964,361円
D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	401,032,608円	323,121,795円
計	26,672,684,439円	23,920,411,405円
2 . 受益権の総数	26,672,684,439口	23,920,411,405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26年1月15日 至 平成26年7月11日	自 平成26年7月12日 至 平成27年1月13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26年7月11日現在	平成27年1月13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ぬ。	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つた場合、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26年7月11日現在	平成27年1月13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	828,917,082	165,254,919
合計	828,917,082	165,254,919

（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26年4月19日から平成26年7月11日まで及び平成26年4月19日から平成27年1月13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26年7月11日 現在				平成27年1月13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	202,734,400	-	202,720,000	14,400	363,462,176	-	363,440,000	22,176
アメリカ・ドル	202,734,400	-	202,720,000	14,400	363,462,176	-	363,440,000	22,176
買 建	-	-	-	-	413,523,900	-	407,100,000	6,423,900
アメリカ・ドル	-	-	-	-	413,523,900	-	407,100,000	6,423,900
合計	202,734,400	-	202,720,000	14,400	776,986,076	-	770,540,000	6,401,724

（注）時価の算定方法

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

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

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

 - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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26年7月11日現在	平成27年1月13日現在
1口当たり純資産額	1.4929円	1.7632円
（1万口当たり純資産額）	（14,929円）	（17,632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27年1月13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	1,600,000.000	2,433,440.000		
		BRAZIL 11.0 08/17/40	1,200,000.000	1,270,680.000		
		BRAZIL 2.625 01/05/23	2,200,000.000	1,994,300.000		
		BRAZIL 4.25 01/07/25	3,800,000.000	3,804,750.000		
		BRAZIL 4.875 01/22/21	3,300,000.000	3,514,500.000		
		BRAZIL 5.0 01/27/45	4,500,000.000	4,410,000.000		
		BRAZIL 5.625 01/07/41	3,400,000.000	3,638,000.000		
		BRAZIL 5.875 01/15/19	2,000,000.000	2,234,000.000		
		BRAZIL 6.0 01/17/17	4,000,000.000	4,314,800.000		
		BRAZIL 7.125 01/20/37	2,900,000.000	3,654,000.000		
		BRAZIL 8.25 01/20/34	1,900,000.000	2,619,720.000		
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,400,000.000	3,244,320.000		
		BRAZIL 8.875 04/15/24	1,700,000.000	2,285,820.000		
		BRAZIL 8.875 10/14/19	1,200,000.000	1,464,000.000		
		COLOMBIA 11.75 02/25/20	900,000.000	1,254,510.000		
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,800,000.000	1,669,500.000		
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	2,300,000.000	2,346,000.000		
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	2,200,000.000	2,324,300.000		
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	3,400,000.000	3,842,000.000		
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	3,300,000.000	3,918,750.000		
		COLOMBIA 7.375 01/27/17	2,650,000.000	2,937,525.000		
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	3,100,000.000	3,650,250.000		
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	2,400,000.000	3,210,000.000		
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	1,400,000.000	1,834,280.000		
		CROATIA 5.5 04/04/23	1,300,000.000	1,358,500.000		
		CROATIA 6.0 01/26/24	2,000,000.000	2,160,000.000		
		CROATIA 6.25 04/27/17	1,900,000.000	2,019,358.000		
		CROATIA 6.375 03/24/21	1,700,000.000	1,804,550.000		
		CROATIA 6.625 07/14/20	1,200,000.000	1,323,720.000		
		CROATIA 6.75 11/05/19	1,500,000.000	1,660,350.000		
		HUNGARY 4.0 03/25/19	1,000,000.000	1,029,370.000		
		HUNGARY 4.125 02/19/18	1,500,000.000	1,559,370.000		
		HUNGARY 5.375 02/21/23	2,200,000.000	2,406,250.000		
		HUNGARY 5.375 03/25/24	2,200,000.000	2,412,410.000		
		HUNGARY 5.75 11/22/23	2,000,000.000	2,249,000.000		
		HUNGARY 6.25 01/29/20	1,900,000.000	2,144,625.000		
		HUNGARY 6.375 03/29/21	3,500,000.000	4,025,000.000		
		HUNGARY 7.625 03/29/41	1,200,000.000	1,646,856.000		
		INDONESIA 11.625 03/04/19		1,700,000.000	2,257,600.000	

INDONESIA 3.375 04/15/23	1,000,000.000	956,250.000	
INDONESIA 3.75 04/25/22	1,600,000.000	1,586,000.000	
INDONESIA 4.625 04/15/43	2,000,000.000	1,877,500.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	2,700,000.000	2,875,500.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	2,200,000.000	2,246,750.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,600,000.000	1,754,000.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	2,300,000.000	2,610,500.000	
INDONESIA 5.875 03/13/20	2,100,000.000	2,341,185.000	
INDONESIA 6.625 02/17/37	1,500,000.000	1,775,175.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	2,000,000.000	2,480,000.000	
INDONESIA 6.875 01/17/18	2,600,000.000	2,932,800.000	
INDONESIA 6.875 03/09/17	1,250,000.000	1,381,250.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	2,000,000.000	2,661,500.000	
INDONESIA 8.5 10/12/35	1,900,000.000	2,680,995.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	2,000,000.000	2,220,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	2,600,000.000	3,341,520.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,400,000.000	1,806,000.000	
PANAMA 8.875 09/30/27	1,000,000.000	1,445,250.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	1,300,000.000	1,972,750.000	
PERU 5.625 11/18/50	2,500,000.000	2,967,125.000	
PERU 6.55 03/14/37	1,300,000.000	1,690,650.000	
PERU 7.125 03/30/19	800,000.000	950,800.000	
PERU 7.35 07/21/25	2,900,000.000	3,840,180.000	
PERU 8.75 11/21/33	2,800,000.000	4,366,320.000	
PHILIPPINES 10.625 03/16/25	1,400,000.000	2,271,500.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	1,900,000.000	2,066,934.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	1,800,000.000	1,977,750.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	1,500,000.000	1,775,625.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	1,600,000.000	1,920,000.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	1,300,000.000	1,722,500.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,100,000.000	4,216,000.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	800,000.000	963,000.000	

PHILIPPINES 7.75 01/14/31	2,700,000.000	3,962,250.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	600,000.000	763,500.000	
PHILIPPINES 9.375 01/18/17	790,000.000	918,201.200	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	2,100,000.000	3,454,500.000	
PHILIPPINES 9.875 01/15/19	1,500,000.000	1,963,125.000	
REPUBLIC OF LITHUANIA 6.625 02/01/22	1,600,000.000	1,945,120.000	
REPUBLIC OF LITHUANIA 7.375 02/11/20	2,300,000.000	2,797,375.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	1,300,000.000	1,391,910.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	1,200,000.000	1,331,040.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	1,000,000.000	1,266,880.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	2,600,000.000	3,145,688.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	4,000,000.000	3,603,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	14,279,000.000	14,379,238.580	
RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18	4,600,000.000	5,227,900.000	
RUSSIAN FEDERATION 12.75 06/24/28	3,000,000.000	4,094,700.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.25 04/04/17	4,000,000.000	3,762,600.000	
RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	1,000,000.000	873,670.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	2,000,000.000	1,699,920.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	3,000,000.000	2,570,880.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	3,600,000.000	2,911,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	1,600,000.000	1,343,200.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	1,500,000.000	1,567,500.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	2,000,000.000	2,197,500.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	1,200,000.000	1,359,000.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	2,000,000.000	2,268,500.000	
SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41	800,000.000	960,000.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	2,300,000.000	2,639,250.000	

TURKEY 11.875 01/15/30	1,700,000.000	3,003,900.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	2,700,000.000	2,588,625.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	1,700,000.000	1,691,364.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	1,500,000.000	1,608,615.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	1,700,000.000	1,879,027.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	2,700,000.000	3,051,000.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	3,200,000.000	3,675,104.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	2,800,000.000	3,210,788.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	1,400,000.000	1,738,520.000	
TURKEY 6.75 04/03/18	1,600,000.000	1,779,520.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	2,100,000.000	2,617,167.000	
TURKEY 6.875 03/17/36	2,900,000.000	3,589,330.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	2,100,000.000	2,408,385.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	1,300,000.000	1,515,904.000	
TURKEY 7.0 09/26/16	3,000,000.000	3,255,000.000	
TURKEY 7.25 03/05/38	1,000,000.000	1,305,000.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	2,700,000.000	3,366,900.000	
TURKEY 7.5 07/14/17	2,800,000.000	3,132,500.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	2,200,000.000	2,587,750.000	
TURKEY 8.0 02/14/34	1,700,000.000	2,346,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 11.375 09/15/16	3,000,000.000	3,505,620.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	500,000.000	513,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	3,900,000.000	4,007,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	4,300,000.000	4,493,801.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	5,200,000.000	5,460,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20	1,800,000.000	1,998,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	2,400,000.000	2,808,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.625 01/15/17	3,300,000.000	3,560,370.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	4,600,000.000	5,031,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19	2,800,000.000	3,185,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	4,800,000.000	5,952,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	2,500,000.000	3,292,750.000	
UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33	1,000,000.000	1,393,900.000	
UNITED MEXICAN STATES 8.3 08/15/31	1,300,000.000	1,972,750.000	
アメリカ・ドル 小計	297,869,000.000	341,522,000.780	

		(35,151,520,690)	(40,303,011,312)	
国債証券 合計		35,151,520,690	40,303,011,312	
		(35,151,520,690)	(40,303,011,312)	
合計		35,151,520,690	40,303,011,312	
		(35,151,520,690)	(40,303,011,312)	

- (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 132銘柄	95.56%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成27年1月30日現在

資産総額	12,898,790,183円
負債総額	173,064,249円
純資産総額（ - ）	12,725,725,934円
発行済数量	11,139,244,253口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1424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27年1月30日現在

資産総額	327,791,204,388円
負債総額	1,105,876,672円
純資産総額（ - ）	326,685,327,716円
発行済数量	162,555,798,176口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0097円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	437,480,010,392円
負債総額	3,096,055,000円
純資産総額（ - ）	434,383,955,392円
発行済数量	352,234,545,489口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2332円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	32,036,252,854円
負債総額	781,893,875円
純資産総額（ - ）	31,254,358,979円
発行済数量	17,889,003,525口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7471円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	305,621,621,119円
負債総額	587,399,985円
純資産総額（ - ）	305,034,221,134円
発行済数量	110,118,685,955口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7700円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	29,426,820,296円
負債総額	1,497,160円
純資産総額（ - ）	29,425,323,136円
発行済数量	24,378,440,176口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2070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27年1月30日現在

資産総額	181,212,514,349円
負債総額	4,007,000円
純資産総額（ - ）	181,208,507,349円
発行済数量	135,881,351,975口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3336円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	41,361,298,167円
負債総額	203,400,244円
純資産総額（ - ）	41,157,897,923円
発行済数量	39,066,497,470口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0535円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成27年1月30日現在

資産総額	48,317,280,672円
負債総額	1,525,475,167円
純資産総額（ - ）	46,791,805,505円
発行済数量	26,015,320,698口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7986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ヵ年の資本金の変動

該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

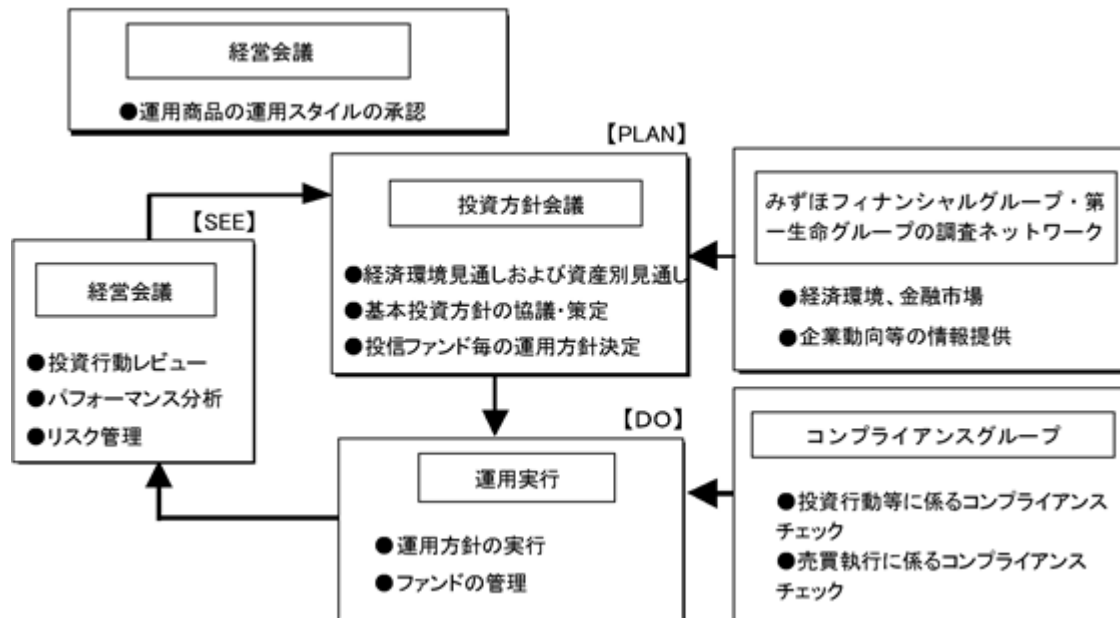
投資運用の意思決定機構

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

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

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

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



上記体制は平成27年1月30日現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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27年1月30日現在、委託会社の運用する投資信託は350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	7	20,649,628,063
追加型株式投資信託	321	5,650,277,005,369
単位型公社債投資信託	22	194,242,819,636
追加型公社債投資信託	0	0
合計	350	5,865,169,453,068

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29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26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28期 (平成25年3月31日現在)	第29期 (平成26年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	10,806,745	11,487,360
金銭の信託	10,214,440	10,952,459
前払費用	69,143	64,554
未収委託者報酬	3,073,481	3,854,410
未収運用受託報酬	1,173,744	1,415,502
未収投資助言報酬	2 245,819	2 255,218
未収収益	244,974	275,082
繰延税金資産	426,229	401,327
その他	25,354	23,246
流動資産計	26,279,933	28,729,163
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 142,820	1 122,181
車両運搬具	1 2,770	1 1,615
器具備品	1 231,732	1 140,023
建設仮勘定	1,207	29,509
無形固定資産		
商標権	1 289	1 195
ソフトウェア	1 1,261,335	1 1,188,444
ソフトウェア仮勘定	68,920	642,834
電話加入権	7,148	7,148
電信電話専用施設利用権	1 292	1 231
投資その他の資産		
投資有価証券	4,002,042	4,178,284
関係会社株式	400,579	617,159
関係会社株式	2,119,074	2,119,074
繰延税金資産	661,777	622,698
差入保証金	731,564	731,197
その他	89,047	88,154
固定資産計	5,718,557	6,310,469
資産合計	31,998,491	35,039,633

（単位：千円）

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

（ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：千円 ）

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

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

（単位：千円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第29期（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

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

（3）当該会計基準等の適用による影響

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第28期(自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第28期（平成25年3月31日現在）

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第28期(平成25年3月31日現在)

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

第29期(平成26年3月31日現在)

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

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第28期（平成25年3月31日現在）

（千円）

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

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

第29期（平成26年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券

該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

該当事項はありません。

7. 減損処理を行った有価証券

該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第28期（平成25年3月31日現在）

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

第29期（平成26年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託

該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（退職給付関係）

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

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

3. 退職給付費用に関する事項

(千円)

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 割引率

1.5%

(2) 退職給付見込額の期間配分方法

期間定額基準

(3) 数理計算上の差異の処理年数

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	1.5%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、41,536千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%になります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は30,397千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は同額増加しております。

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

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

2．関連情報

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(3)兄弟会社等

第28期（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

第29期（自平成25年4月1日 至平成26年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

（注5）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注6）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

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

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第30期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		9,723,059
金銭の信託		12,434,692
前払費用		41,958
未収委託者報酬		4,115,165
未収運用受託報酬		2,110,505
未収投資助言報酬		291,921
未収収益		276,092
繰延税金資産		381,830
その他		19,665
	流動資産計	29,394,891
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	112,415
車両運搬具	1	1,278
器具備品	1	155,618
無形固定資産		
商標権	1	148
ソフトウェア	1	1,293,646
ソフトウェア仮勘定		671,614
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権	1	210
投資その他の資産		
投資有価証券		569,502
関係会社株式		1,916,596
繰延税金資産		632,938
差入保証金		731,858
その他		98,609
	固定資産計	6,191,588
資産合計		35,586,479

（単位：千円）

	第30期中間会計期間末 （平成26年9月30日現在）
（負債の部）	
流動負債	
預り金	1,166,764
未払金	1,957,162
未払償還金	51,109
未払手数料	1,643,563
その他未払金	262,489
未払費用	1,591,500
未払法人税等	1,472,835
未払消費税等	371,933
賞与引当金	654,870
その他	20,000
	流動負債計
	7,235,067
固定負債	
退職給付引当金	812,666
役員退職慰労引当金	83,180
	固定負債計
	895,847
負債合計	8,130,914
（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	22,814,599
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	
別途積立金	19,480,000
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	2,711,306
	株主資本計
	27,243,077
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	212,487
	評価・換算差額等計
	212,487
純資産合計	27,455,565
負債・純資産合計	35,586,479

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日至平成26年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	13,286,051	
運用受託報酬	3,381,064	
投資助言報酬	490,761	
その他営業収益	421,279	
	営業収益計	17,579,156
営業費用		
支払手数料	5,909,864	
広告宣伝費	92,826	
公告費	159	
調査費	2,887,318	
調査費	2,043,582	
委託調査費	843,735	
委託計算費	190,750	
営業雑経費	236,536	
通信費	17,081	
印刷費	205,572	
協会費	12,088	
諸会費	15	
支払販売手数料	1,778	
	営業費用計	9,317,455
一般管理費		
給料	2,293,163	
役員報酬	121,968	
給料・手当	2,171,195	
交際費	15,267	
寄付金	2,697	
旅費交通費	108,306	
租税公課	63,009	
不動産賃借料	344,346	
退職給付費用	109,300	
固定資産減価償却費	1 271,644	
福利厚生費	11,154	
修繕費	4,020	
賞与引当金繰入額	654,870	
役員退職慰労引当金繰入額	23,042	
役員退職慰労金	25,501	
機器リース料	23	
事務委託費	102,506	
事務用消耗品費	33,911	
器具備品費	1,141	
諸経費	73,631	
	一般管理費計	4,137,538
営業利益		4,124,161

（単位：千円）

	第30期中間会計期間 （自平成26年4月1日至平成26年9月30日）	
営業外収益		
受取配当金	6,686	
受取利息	1,115	
雑収入	1,165	
営業外収益計		8,967
営業外費用		
為替差損	896	
金銭の信託運用損	2,943	
営業外費用計		3,839
経常利益		4,129,289
特別損失		
関係会社株式評価損	202,477	
特別損失計		202,477
税引前中間純利益		3,926,811
法人税、住民税及び事業税		1,450,315
法人税等調整額		46,321
法人税等合計		1,403,993
中間純利益		2,522,818

(3) 中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金	利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,735,451	22,488,744	26,917,222
会計方針の変更による累積的影響額							131,037	131,037	131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	17,130,000	300,000	200,000	4,866,488	22,619,781	27,048,259
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,328,000	2,328,000	2,328,000
別途積立金の積立				2,350,000			2,350,000	-	-
中間純利益							2,522,818	2,522,818	2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	2,350,000	-	-	2,155,181	194,818	194,818
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	2,711,306	22,814,599	27,243,077

	評価・換算差額等	純資産 合計
	その他有価証券 評価差額金	
当期首残高	243,159	27,160,381
会計方針の変更による累積的影響額		131,037
会計方針の変更を反映した当期首残高	243,159	27,291,419
当中間期変動額		
剰余金の配当		2,328,000
別途積立金の積立		-
中間純利益		2,522,818
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	30,671	30,671
当中間期変動額合計	30,671	164,146
当中間期末残高	212,487	27,455,565

重要な会計方針

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26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、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の際会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)役員退職慰労引当金：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。
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。

会計方針の変更

第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)	
<p>「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。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を従業員の平均残存勤務期間に近似した年数に基づく割引率を使用する方法から、退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従い、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が203,600千円減少し、繰越利益剰余金が131,037千円増加しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ4,584千円増加しております。なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。</p>	

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第30期中間会計期間末 (平成26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	3,645千円
	器具備品	690,539千円
	商標権	789千円
	ソフトウェア	1,737,240千円
	電信電話専用施設利用権	1,386千円

(中間損益計算書関係)

項目	第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26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	235,019千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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26年6月30日 定時株主総会	普通株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成26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	9,723,059	9,723,059	-
(2) 金銭の信託	12,434,692	12,434,692	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	489,256	489,256	-
資産計	22,647,008	22,647,008	-
(1) 未払法人税等	1,472,835	1,472,835	-
負債計	1,472,835	1,472,835	-

（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	1,916,596
差入保証金	731,858

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

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

なお、当中間会計期間において、関係会社株式について202,477千円減損処理を行っております。

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、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

第30期中間会計期間末（平成26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1,916,596千円）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	474,395	146,101	328,293
債券	-	-	-
その他（投資信託）	14,861	13,000	1,861
小計	489,256	159,101	330,154
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）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	489,256	159,101	330,154

（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30期中間会計期間末（平成26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30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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	13,286,051	3,871,825	421,279	17,579,156

（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

顧客の名称又は氏名	営業収益 （千円）
第一生命グループ	1,799,530

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）		
1株当たり純資産額	1,143,981円	89銭
1株当たり中間純利益金額	105,117円	43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）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30期中間会計期間 （自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）
中間純利益	2,522,818千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,522,818千円
期中平均株式数	24,000株

（注2）「会計方針の変更」に記載の通り、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額が5,582円81銭増加し、1株当たり中間純利益金額が122円93銭増加しております。

（重要な後発事象）

第30期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）
該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成27年2月25日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木 貴司 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエの平成26年7月12日から平成27年1月13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27年1月13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26年6月6日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月5日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているD I A Mアセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26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）X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。