

【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29年4月11日 |
| 【発行者名】 | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 西 恵正 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 上野 圭子 |
| 【電話番号】 | 03-6774-5100 |
| 【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28年10月11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】

<訂正前>

（略）

機動的配分戦略

（日次戦略）

安定資産とリスク性資産に対して、市場環境を「安定局面」「警戒局面」「危機局面」の3つの局面に分類し、「警戒局面」「危機局面」ではそれぞれの局面に応じて組入資産を安定資産や現金等[※]へ入れ替えます。

※現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等です。

投資行動

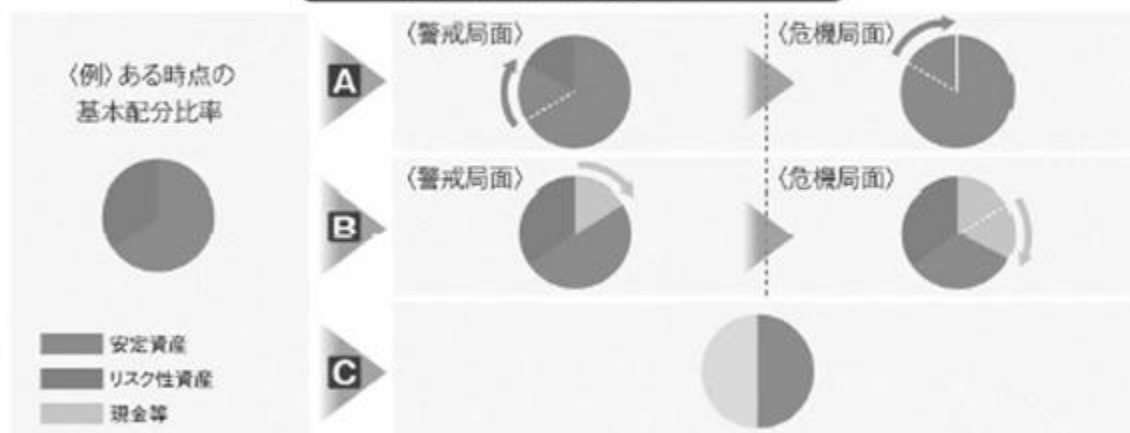
| | 警戒局面 | 危機局面 |
|--------------------------------|---|-----------------------------------|
| A リスク性資産の下落時 | リスク性資産を 半分売却 | リスク性資産を 全て売却 (安定資産比率最大100%) |
| B 安定資産の下落時 [*] | 安定資産を 4分の1売却 | 安定資産を 半分売却 |
| C 安定資産、 リスク性資産の下落時 | リスク性資産を全て売却し、基本配分比率の8資産の 合計額のうち半分を現金等 [*] に入れ替えます。 ※現金等の比率は50%を超える場合があります。 | |

※2016年4月末時点

※各投資行動は基本配分比率に対するものです。

※安定資産の下落時には、国内債券、為替ヘッジ先進国債券それぞれにおいて局面を判断して投資行動を決定します。

（ご参考）配分比率変更のイメージ



※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

（略）

<訂正後>

(略)

機動的配分戦略

(日次戦略)

安定資産とリスク性資産に対して、市場環境を「安定局面」「警戒局面」「危機局面」の3つの局面に分類し、「警戒局面」「危機局面」ではそれぞれの局面に応じて組入資産を安定資産や現金等[※]へ入れ替えます。

※現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等です。

投資行動

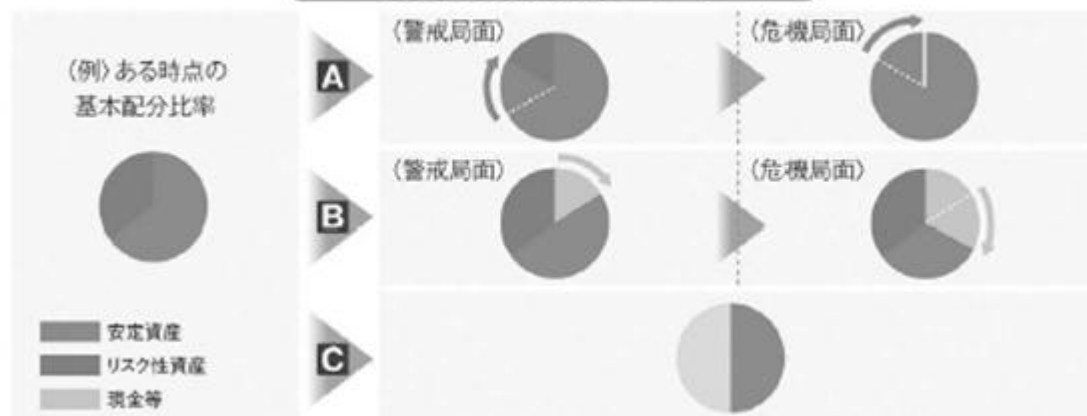
| | 警戒局面 | 危機局面 |
|--------------------------------|---|-----------------------------------|
| A リスク性資産の下落時 | リスク性資産を 半分売却 | リスク性資産を 全て売却 (安定資産比率最大100%) |
| B 安定資産の下落時 [*] | 安定資産を 4分の1売却 | 安定資産を 半分売却 |
| C 安定資産、 リスク性資産の下落時 | リスク性資産を全て売却し、基本配分比率の8資産の 合計額のうち半分を現金等 [*] に入れ替えます。 ※現金等の比率は50%を超える場合があります。 | |

※2017年1月末時点

※各投資行動は基本配分比率に対するものです。

※安定資産の下落時には、国内債券、為替ヘッジ先進国債券それぞれにおいて局面を判断して投資行動を決定します。

(ご参考) 配分比率変更のイメージ



※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

(略)

(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28年10月1日現在）

(略)

大株主の状況

(平成28年10月1日現在)

| 株主名 | 住所 | 所有株数 | 所有比率 |
|--------------------|--------------------|----------------------|--------------------|
| 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 | 28,000株 ¹ | 70.0% ² |
| 第一生命ホールディングス株式会社 | 東京都千代田区有楽町一丁目13番1号 | 12,000株 | 30.0% ² |

(略)

< 訂正後 >

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（平成29年1月31日現在）

(略)

大株主の状況

(平成29年1月31日現在)

| 株主名 | 住所 | 所有株数 | 所有比率 |
|--------------------|--------------------|----------------------|--------------------|
| 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 | 28,000株 ¹ | 70.0% ² |
| 第一生命ホールディングス株式会社 | 東京都千代田区有楽町一丁目13番1号 | 12,000株 | 30.0% ² |

(略)

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

(略)

運用体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

< 訂正後 >

(略)

運用体制は平成29年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（略）

3【投資リスク】

＜リスク管理体制＞

＜訂正前＞

（略）

上記体制は平成28年10月1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29年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

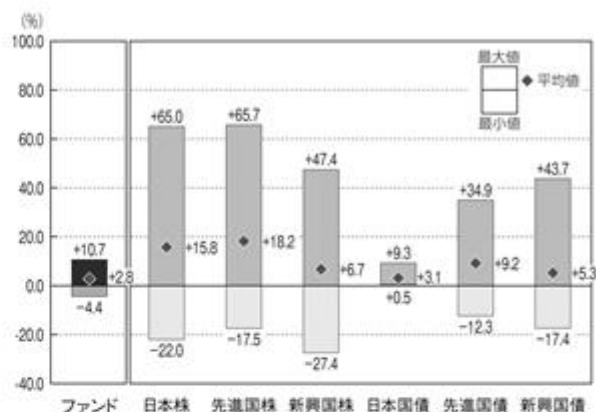
<更新・訂正後>

（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～2017年1月

代表的な資産クラス:2012年2月～2017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】

（５）【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

上記は、平成28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29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・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

平成29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 37,545,018,347 | 93.39 |
| 内 日本 | 37,545,018,347 | 93.39 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 2,656,469,595 | 6.61 |
| 純資産総額 | 40,201,487,942 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 9,384,721,000 | 23.34 |
| - | 9,384,721,000 | 23.34 |

（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29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式 | 278,463,817,875 | 96.28 |
| 内 日本 | 278,463,817,875 | 96.28 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 10,762,232,032 | 3.72 |
| 純資産総額 | 289,226,049,907 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引（買建） | 10,452,130,000 | 3.61 |
| 内 日本 | 10,452,130,000 | 3.61 |

（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29年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|--------|-----------------|---------|
| 国債証券 | | 320,097,024,300 | 83.77 |
| | 内 日本 | 320,097,024,300 | 83.77 |
| 地方債証券 | | 23,916,686,607 | 6.26 |
| | 内 日本 | 23,916,686,607 | 6.26 |
| 特殊債券 | | 18,948,291,491 | 4.96 |
| | 内 日本 | 18,948,291,491 | 4.96 |
| 社債券 | | 17,084,129,820 | 4.47 |
| | 内 日本 | 16,784,273,820 | 4.39 |
| | 内 オランダ | 200,002,000 | 0.05 |
| | 内 イギリス | 99,854,000 | 0.03 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 2,069,112,762 | 0.54 |
| 純資産総額 | | 382,115,244,980 | 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29年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------|----------------|---------|
| 投資証券 | | 29,739,875,100 | 98.73 |
| | 内 日本 | 29,739,875,100 | 98.73 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 381,762,815 | 1.27 |
| 純資産総額 | | 30,121,637,915 | 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29年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|-----------|-----------------|---------|
| 株式 | | 259,944,908,407 | 95.98 |
| | 内 アメリカ | 161,077,340,660 | 59.47 |
| | 内 イギリス | 18,170,321,652 | 6.71 |
| | 内 カナダ | 10,854,411,687 | 4.01 |
| | 内 スイス | 10,109,712,269 | 3.73 |
| | 内 ドイツ | 9,993,764,716 | 3.69 |
| | 内 フランス | 9,549,794,687 | 3.53 |
| | 内 オーストラリア | 7,251,985,382 | 2.68 |
| | 内 オランダ | 4,735,803,417 | 1.75 |
| | 内 アイルランド | 4,291,866,587 | 1.58 |
| | 内 スペイン | 3,313,936,135 | 1.22 |
| | 内 スウェーデン | 3,047,388,843 | 1.13 |
| | 内 香港 | 2,511,915,128 | 0.93 |
| | 内 シンガポール | 1,980,155,570 | 0.73 |
| | 内 デンマーク | 1,772,293,938 | 0.65 |
| | 内 イタリア | 1,756,606,331 | 0.65 |
| | 内 ジャージー | 1,637,980,411 | 0.60 |

| | | | |
|-----------------------|---------------|-----------------|--------|
| | 内 バミューダ | 1,214,671,442 | 0.45 |
| | 内 ベルギー | 1,208,335,424 | 0.45 |
| | 内 フィンランド | 1,021,469,564 | 0.38 |
| | 内 オランダ領キュラソー | 985,536,295 | 0.36 |
| | 内 ノルウェー | 717,429,674 | 0.26 |
| | 内 ケイマン諸島 | 668,046,105 | 0.25 |
| | 内 イスラエル | 651,194,346 | 0.24 |
| | 内 ルクセンブルグ | 360,658,350 | 0.13 |
| | 内 オーストリア | 229,878,998 | 0.08 |
| | 内 ニュージーランド | 182,615,223 | 0.07 |
| | 内 パナマ | 173,121,166 | 0.06 |
| | 内 ポルトガル | 162,898,632 | 0.06 |
| | 内 リベリア | 145,759,289 | 0.05 |
| | 内 イギリス領バージン諸島 | 56,707,217 | 0.02 |
| | 内 パプアニューギニア | 55,997,898 | 0.02 |
| | 内 マン島 | 32,023,491 | 0.01 |
| | 内 モーリシャス | 23,287,880 | 0.01 |
| 投資信託受益証券 | | 802,682,922 | 0.30 |
| | 内 オーストラリア | 680,260,493 | 0.25 |
| | 内 シンガポール | 122,422,429 | 0.05 |
| 投資証券 | | 6,122,013,845 | 2.26 |
| | 内 アメリカ | 5,345,469,865 | 1.97 |
| | 内 フランス | 343,927,798 | 0.13 |
| | 内 イギリス | 255,612,231 | 0.09 |
| | 内 香港 | 127,482,666 | 0.05 |
| | 内 カナダ | 49,521,285 | 0.02 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 3,968,736,590 | 1.47 |
| 純資産総額 | | 270,838,341,764 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（買建） | 319,718,600 | 0.12 |
| - | 319,718,600 | 0.12 |
| 為替予約取引（売建） | 140,086,000 | 0.05 |
| - | 140,086,000 | 0.05 |
| 株価指数先物取引（買建） | 3,743,603,504 | 1.38 |
| 内 アメリカ | 2,486,702,976 | 0.92 |
| 内 ドイツ | 677,042,010 | 0.25 |
| 内 イギリス | 280,957,418 | 0.10 |
| 内 オーストラリア | 156,785,947 | 0.06 |
| 内 カナダ | 142,115,153 | 0.05 |

（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29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 3,924,182,779 | 11.01 |
| 内 オーストラリア | 2,873,057,623 | 8.06 |
| 内 シンガポール | 1,041,896,194 | 2.92 |
| 内 カナダ | 9,228,962 | 0.03 |
| 投資証券 | 31,527,064,575 | 88.45 |
| 内 アメリカ | 25,884,236,849 | 72.62 |
| 内 イギリス | 1,711,370,862 | 4.80 |
| 内 フランス | 1,478,409,418 | 4.15 |
| 内 カナダ | 679,406,141 | 1.91 |
| 内 香港 | 621,424,966 | 1.74 |
| 内 スペイン | 268,637,350 | 0.75 |
| 内 ベルギー | 247,061,800 | 0.69 |
| 内 ニュージーランド | 183,729,739 | 0.52 |
| 内 オランダ | 158,032,017 | 0.44 |
| 内 アイルランド | 76,843,090 | 0.22 |
| 内 シンガポール | 67,151,956 | 0.19 |
| 内 ドイツ | 66,555,810 | 0.19 |
| 内 イタリア | 27,310,180 | 0.08 |
| 内 マン島 | 20,365,484 | 0.06 |
| 内 ガーンジー | 20,167,232 | 0.06 |
| 内 イスラエル | 16,361,681 | 0.05 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 192,896,805 | 0.54 |
| 純資産総額 | 35,644,144,159 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|-------------|---------|
| 為替予約取引（買建） | 117,772,910 | 0.33 |
| - | 117,772,910 | 0.33 |

（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29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 157,255,035,455 | 95.93 |
| 内 アメリカ | 70,078,291,184 | 42.75 |
| 内 フランス | 15,393,606,604 | 9.39 |
| 内 イタリア | 14,864,132,233 | 9.07 |
| 内 ドイツ | 11,702,692,788 | 7.14 |
| 内 イギリス | 11,394,356,813 | 6.95 |
| 内 スペイン | 8,663,027,903 | 5.28 |
| 内 ベルギー | 3,887,410,867 | 2.37 |
| 内 オランダ | 3,655,983,989 | 2.23 |
| 内 カナダ | 3,454,259,014 | 2.11 |
| 内 オーストラリア | 3,392,684,024 | 2.07 |
| 内 オーストリア | 2,387,550,600 | 1.46 |
| 内 メキシコ | 1,168,508,779 | 0.71 |
| 内 アイルランド | 1,168,236,450 | 0.71 |
| 内 デンマーク | 1,016,141,759 | 0.62 |
| 内 ポーランド | 960,440,242 | 0.59 |
| 内 フィンランド | 903,403,940 | 0.55 |
| 内 南アフリカ | 807,072,339 | 0.49 |
| 内 スウェーデン | 736,397,411 | 0.45 |
| 内 マレーシア | 655,548,311 | 0.40 |
| 内 シンガポール | 544,350,185 | 0.33 |
| 内 ノルウェー | 420,940,020 | 0.26 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 6,671,336,633 | 4.07 |
| 純資産総額 | 163,926,372,088 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|-----------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 160,484,252,868 | 97.90 |
| - | 160,484,252,868 | 97.90 |

（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29年1月31日現在

| 資産の種類 | | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------------|----------------|---------|
| 株式 | | 39,305,224,317 | 95.46 |
| | 内 韓国 | 5,864,622,886 | 14.24 |
| | 内 台湾 | 4,742,594,896 | 11.52 |
| | 内 ケイマン諸島 | 4,641,197,753 | 11.27 |
| | 内 中国 | 4,088,121,311 | 9.93 |
| | 内 インド | 3,309,740,597 | 8.04 |
| | 内 ブラジル | 3,198,397,940 | 7.77 |
| | 内 南アフリカ | 2,503,830,498 | 6.08 |
| | 内 ロシア | 1,686,997,503 | 4.10 |
| | 内 香港 | 1,561,431,103 | 3.79 |
| | 内 メキシコ | 1,072,689,412 | 2.61 |
| | 内 インドネシア | 990,133,059 | 2.40 |
| | 内 マレーシア | 981,412,972 | 2.38 |
| | 内 タイ | 915,590,123 | 2.22 |
| | 内 フィリピン | 486,206,513 | 1.18 |
| | 内 チリ | 470,726,247 | 1.14 |
| | 内 ポーランド | 468,999,320 | 1.14 |
| | 内 バミューダ | 411,518,644 | 1.00 |
| | 内 トルコ | 389,915,715 | 0.95 |
| | 内 カタール | 345,683,658 | 0.84 |
| | 内 アラブ首長国連邦 | 329,905,468 | 0.80 |
| | 内 コロンビア | 175,446,802 | 0.43 |
| | 内 オランダ | 137,770,599 | 0.33 |
| | 内 アメリカ | 136,863,443 | 0.33 |
| | 内 ハンガリー | 123,503,152 | 0.30 |
| | 内 ギリシャ | 75,682,616 | 0.18 |
| | 内 チェコ | 68,433,168 | 0.17 |
| | 内 エジプト | 52,241,338 | 0.13 |
| | 内 ペルー | 29,487,420 | 0.07 |
| | 内 マン島 | 26,854,444 | 0.07 |
| | 内 マルタ | 19,225,717 | 0.05 |
| 投資信託受益証券 | | 254,743,769 | 0.62 |
| | 内 メキシコ | 254,743,769 | 0.62 |
| 投資証券 | | 95,986,141 | 0.23 |
| | 内 南アフリカ | 45,513,574 | 0.11 |
| | 内 メキシコ | 35,473,830 | 0.09 |
| | 内 トルコ | 14,998,737 | 0.04 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 1,517,900,630 | 3.69 |
| 純資産総額 | | 41,173,854,857 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引（買建） | 1,481,831,807 | 3.60 |
| 内 アメリカ | 1,481,831,807 | 3.60 |

（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29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 国債証券 | 66,608,289,056 | 96.50 |
| 内 トルコ | 9,860,699,834 | 14.29 |
| 内 メキシコ | 8,700,920,742 | 12.61 |
| 内 ロシア | 8,673,210,835 | 12.56 |
| 内 ブラジル | 6,650,846,419 | 9.64 |
| 内 インドネシア | 6,496,709,207 | 9.41 |
| 内 コロンビア | 5,428,570,836 | 7.86 |
| 内 フィリピン | 5,224,242,161 | 7.57 |
| 内 ペルー | 3,293,152,668 | 4.77 |
| 内 パナマ | 3,179,859,366 | 4.61 |
| 内 ハンガリー | 3,142,083,093 | 4.55 |
| 内 南アフリカ | 2,281,568,755 | 3.31 |
| 内 クロアチア | 2,018,520,615 | 2.92 |
| 内 ルーマニア | 1,657,904,525 | 2.40 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 2,418,823,162 | 3.50 |
| 純資産総額 | 69,027,112,218 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引（買建） | 8,296,020,000 | 12.02 |
| - | 8,296,020,000 | 12.02 |

（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。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成29年1月31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 | 9,059,420,740 | 1.2805 11,600,756,782 | 1.2762 11,561,632,748 | - - | 28.76% |
| 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 | 7,270,674,749 | 1.3266 9,645,949,893 | 1.3155 9,564,572,632 | - - | 23.79% |
| 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 | 2,325,857,221 | 1.8382 4,275,581,678 | 1.8042 4,196,311,598 | - - | 10.44% |
| 4 | 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 1,675,422,408 | 2.2929 3,841,728,539 | 2.2509 3,771,208,298 | - - | 9.38% |
| 5 | 外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 846,750,636 | 2.9780 2,521,659,073 | 2.9451 2,493,765,298 | - - | 6.20% |
| 6 | 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 | 2,342,354,016 | 0.9813 2,298,786,231 | 0.9933 2,326,660,244 | - - | 5.79% |
| 7 | J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 1,054,499,329 | 1.8268 1,926,390,231 | 1.8273 1,926,886,623 | - - | 4.79% |
| 8 | 外国リート・パッシブ・ファ ンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 1,494,195,814 | 1.1786 1,761,163,437 | 1.1404 1,703,980,906 | - - | 4.24% |

(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29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 93.39% |
| 合計 | 93.39% |

(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29年1月31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 | 1,526,000 | 6,489.85 9,903,521,731 | 6,584.00 10,047,184,000 | - - | 3.47% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本 | 株式 銀行業 | 9,387,800 | 534.86 5,021,213,212 | 730.90 6,861,543,020 | - - | 2.37% |
| 3 | 日本電信電話 日本 | 株式 情報・通信業 | 994,500 | 5,258.96 5,230,036,902 | 4,979.00 4,951,615,500 | - - | 1.71% |
| 4 | ソフトバンクグループ 日本 | 株式 情報・通信業 | 557,700 | 5,150.50 2,872,435,284 | 8,701.00 4,852,547,700 | - - | 1.68% |
| 5 | 三井住友フィナンシャルグループ 日本 | 株式 銀行業 | 992,000 | 3,397.39 3,370,215,723 | 4,451.00 4,415,392,000 | - - | 1.53% |
| 6 | 本田技研工業 日本 | 株式 輸送用機器 | 1,129,500 | 3,106.46 3,508,756,900 | 3,387.00 3,825,616,500 | - - | 1.32% |
| 7 | KDDI 日本 | 株式 情報・通信業 | 1,225,600 | 3,195.64 3,916,582,281 | 3,030.00 3,713,568,000 | - - | 1.28% |
| 8 | みずほフィナンシャルグループ 日本 | 株式 銀行業 | 16,819,100 | 180.09 3,028,951,808 | 210.30 3,537,056,730 | - - | 1.22% |
| 9 | ソニー 日本 | 株式 電気機器 | 886,200 | 2,584.05 2,289,993,116 | 3,423.00 3,033,462,600 | - - | 1.05% |
| 10 | 日本たばこ産業 日本 | 株式 食料品 | 779,500 | 4,635.42 3,613,310,738 | 3,640.00 2,837,380,000 | - - | 0.98% |
| 11 | ファナック 日本 | 株式 電気機器 | 127,300 | 16,400.39 2,087,769,849 | 22,165.00 2,821,604,500 | - - | 0.98% |
| 12 | NTTドコモ 日本 | 株式 情報・通信業 | 925,700 | 2,834.82 2,624,202,080 | 2,706.50 2,505,407,050 | - - | 0.87% |
| 13 | キーエンス 日本 | 株式 電気機器 | 56,900 | 29,290.65 1,666,638,251 | 43,870.00 2,496,203,000 | - - | 0.86% |
| 14 | 東日本旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 242,800 | 10,712.35 2,600,958,672 | 10,230.00 2,483,844,000 | - - | 0.86% |
| 15 | 東京海上ホールディングス 日本 | 株式 保険業 | 501,900 | 3,927.25 1,971,087,004 | 4,731.00 2,374,488,900 | - - | 0.82% |
| 16 | 三菱商事 日本 | 株式 卸売業 | 929,600 | 1,871.62 1,739,858,801 | 2,549.50 2,370,015,200 | - - | 0.82% |
| 17 | セブン&アイ・ホールディングス 日本 | 株式 小売業 | 518,500 | 5,111.75 2,650,444,845 | 4,509.00 2,337,916,500 | - - | 0.81% |
| 18 | 武田薬品工業 日本 | 株式 医薬品 | 492,900 | 5,780.65 2,849,284,075 | 4,724.00 2,328,459,600 | - - | 0.81% |
| 19 | 三菱電機 日本 | 株式 電気機器 | 1,338,900 | 1,146.05 1,534,447,996 | 1,721.50 2,304,916,350 | - - | 0.80% |
| 20 | 信越化学工業 日本 | 株式 化学 | 235,800 | 5,982.11 1,410,581,964 | 9,747.00 2,298,342,600 | - - | 0.79% |

| | | | | | | | |
|----|---------------|------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------|-------|
| 21 | キヤノン 日本 | 株式 電気機器 | 675,700 | 3,349.96 2,263,572,584 | 3,345.00 2,260,216,500 | - - | 0.78% |
| 22 | アステラス製薬 日本 | 株式 医薬品 | 1,343,100 | 1,658.53 2,227,577,874 | 1,513.50 2,032,781,850 | - - | 0.70% |
| 23 | 村田製作所 日本 | 株式 電気機器 | 131,700 | 13,863.72 1,825,851,938 | 15,255.00 2,009,083,500 | - - | 0.69% |
| 24 | 三菱地所 日本 | 株式 不動産業 | 921,000 | 2,236.36 2,059,692,720 | 2,162.50 1,991,662,500 | - - | 0.69% |
| 25 | 日立製作所 日本 | 株式 電気機器 | 3,014,000 | 492.56 1,484,595,120 | 647.60 1,951,866,400 | - - | 0.67% |
| 26 | ダイキン工業 日本 | 株式 機械 | 171,400 | 7,741.00 1,326,808,240 | 11,225.00 1,923,965,000 | - - | 0.67% |
| 27 | 東海旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 104,400 | 22,228.54 2,320,660,228 | 18,270.00 1,907,388,000 | - - | 0.66% |
| 28 | 花王 日本 | 株式 化学 | 333,900 | 6,189.12 2,066,550,316 | 5,583.00 1,864,163,700 | - - | 0.64% |
| 29 | 三井物産 日本 | 株式 卸売業 | 1,120,100 | 1,324.01 1,483,025,891 | 1,656.50 1,855,445,650 | - - | 0.64% |
| 30 | ブリヂストン 日本 | 株式 ゴム製品 | 443,600 | 4,104.80 1,820,889,540 | 4,143.00 1,837,834,800 | - - | 0.64% |

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----|--------|
| 株式 | 96.28% |
| 合計 | 96.28% |

（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29年1月31日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|------------|-------|--------|
| 電気機器 | 国内 | 12.16% |
| 輸送用機器 | | 9.09% |
| 銀行業 | | 8.21% |
| 情報・通信業 | | 7.72% |
| 化学 | | 6.44% |
| 機械 | | 4.93% |
| 小売業 | | 4.47% |
| 医薬品 | | 4.46% |
| 卸売業 | | 4.32% |
| 食料品 | | 4.20% |
| 陸運業 | | 4.08% |
| サービス業 | | 3.49% |
| 建設業 | | 2.84% |
| 保険業 | | 2.60% |
| 不動産業 | | 2.43% |
| 電気・ガス業 | | 1.71% |
| その他製品 | | 1.68% |
| 精密機器 | | 1.48% |
| 鉄鋼 | | 1.29% |
| その他金融業 | | 1.22% |
| 証券、商品先物取引業 | | 1.19% |
| ガラス・土石製品 | | 0.94% |
| 非鉄金属 | | 0.91% |
| ゴム製品 | | 0.86% |
| 繊維製品 | | 0.69% |
| 金属製品 | | 0.68% |
| 空運業 | | 0.55% |
| 石油・石炭製品 | | 0.54% |
| 鉱業 | | 0.33% |
| パルプ・紙 | | 0.24% |
| 海運業 | | 0.24% |
| 倉庫・運輸関連業 | | 0.19% |
| 水産・農林業 | | 0.11% |
| 合計 | | 96.28% |

（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29年1月31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 | 129回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,500,000,000 | 101.02 4,546,250,000 | 100.95 4,542,885,000 | 0.100000 2021/9/20 | 1.19% |
| 2 | 124回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,500,000,000 | 100.97 4,543,985,000 | 100.81 4,536,630,000 | 0.100000 2020/6/20 | 1.19% |
| 3 | 122回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,500,000,000 | 100.94 4,542,525,000 | 100.73 4,533,165,000 | 0.100000 2019/12/20 | 1.19% |
| 4 | 343回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 4,500,000,000 | 102.99 4,634,870,000 | 100.32 4,514,670,000 | 0.100000 2026/6/20 | 1.18% |
| 5 | 118回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,200,000,000 | 101.14 4,248,216,000 | 100.89 4,237,590,000 | 0.200000 2019/6/20 | 1.11% |
| 6 | 116回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,200,000,000 | 101.02 4,243,092,000 | 100.79 4,233,264,000 | 0.200000 2018/12/20 | 1.11% |
| 7 | 128回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 101.62 4,065,155,000 | 100.92 4,036,920,000 | 0.100000 2021/6/20 | 1.06% |
| 8 | 117回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 101.10 4,044,000,000 | 100.83 4,033,280,000 | 0.200000 2019/3/20 | 1.06% |
| 9 | 366回 利付国庫債券(2年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 100.57 4,023,110,000 | 100.50 4,020,000,000 | 0.100000 2018/7/15 | 1.05% |
| 10 | 342回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 102.02 4,081,115,000 | 100.36 4,014,520,000 | 0.100000 2026/3/20 | 1.05% |
| 11 | 344回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 100.79 4,031,830,000 | 100.28 4,011,440,000 | 0.100000 2026/9/20 | 1.05% |
| 12 | 341回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 103.43 3,620,385,000 | 102.16 3,575,740,000 | 0.300000 2025/12/20 | 0.94% |
| 13 | 114回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 101.19 3,541,825,000 | 100.86 3,530,345,000 | 0.300000 2018/9/20 | 0.92% |
| 14 | 126回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 101.36 3,547,690,000 | 100.85 3,529,995,000 | 0.100000 2020/12/20 | 0.92% |
| 15 | 123回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 100.97 3,534,275,000 | 100.78 3,527,475,000 | 0.100000 2020/3/20 | 0.92% |

| | | | | | | | |
|----|------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|-------|
| 16 | 313回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 107.26 3,217,920,000 | 105.84 3,175,320,000 | 1.300000 2021/3/20 | 0.83% |
| 17 | 340回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 103.19 3,095,720,000 | 103.00 3,090,210,000 | 0.400000 2025/9/20 | 0.81% |
| 18 | 127回 利付国庫債券（5年） 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 101.57 3,047,255,000 | 100.89 3,026,730,000 | 0.100000 2021/3/20 | 0.79% |
| 19 | 125回 利付国庫債券（5年） 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 101.06 3,031,815,000 | 100.83 3,025,140,000 | 0.100000 2020/9/20 | 0.79% |
| 20 | 301回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 2,900,000,000 | 105.55 3,060,979,000 | 103.99 3,015,971,000 | 1.500000 2019/6/20 | 0.79% |
| 21 | 310回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 2,800,000,000 | 105.16 2,944,704,000 | 104.10 2,914,856,000 | 1.000000 2020/9/20 | 0.76% |
| 22 | 325回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 2,700,000,000 | 105.86 2,858,285,000 | 104.88 2,831,949,000 | 0.800000 2022/9/20 | 0.74% |
| 23 | 334回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 2,600,000,000 | 105.21 2,735,585,000 | 104.34 2,713,074,000 | 0.600000 2024/6/20 | 0.71% |
| 24 | 321回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 106.82 2,670,535,000 | 105.58 2,639,650,000 | 1.000000 2022/3/20 | 0.69% |
| 25 | 305回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 105.57 2,639,425,000 | 104.20 2,605,200,000 | 1.300000 2019/12/20 | 0.68% |
| 26 | 338回 利付国庫債券（10年） 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 103.40 2,585,075,000 | 102.95 2,573,925,000 | 0.400000 2025/3/20 | 0.67% |
| 27 | 149回 利付国庫債券（20年） 日本 | 国債証券 | 2,200,000,000 | 114.32 2,515,180,000 | 116.54 2,564,034,000 | 1.500000 2034/6/20 | 0.67% |
| 28 | 141回 利付国庫債券（20年） 日本 | 国債証券 | 2,100,000,000 | 118.13 2,480,775,000 | 119.76 2,515,128,000 | 1.700000 2032/12/20 | 0.66% |
| 29 | 365回 利付国庫債券（2年） 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 100.84 2,521,025,000 | 100.47 2,511,975,000 | 0.100000 2018/6/15 | 0.66% |
| 30 | 143回 利付国庫債券（20年） 日本 | 国債証券 | 2,100,000,000 | 116.03 2,436,735,000 | 118.26 2,483,628,000 | 1.600000 2033/3/20 | 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29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-------|--------|
| 国債証券 | 83.77% |
| 地方債証券 | 6.26% |
| 特殊債券 | 4.96% |
| 社債券 | 4.47% |
| 合計 | 99.46% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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29年1月31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 | 3,503 | 643,314.71 2,253,531,438 | 648,000.00 2,269,944,000 | - - | 7.54% |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 日本 | 投資証券 | 3,281 | 627,084.71 2,057,464,947 | 642,000.00 2,106,402,000 | - - | 6.99% |
| 3 | 野村不動産マスターファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 10,379 | 170,187.65 1,766,377,702 | 175,900.00 1,825,666,100 | - - | 6.06% |
| 4 | 日本リテールファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 6,396 | 252,482.74 1,614,879,660 | 241,600.00 1,545,273,600 | - - | 5.13% |
| 5 | ユナイテッド・アーバン投資法人 日本 | 投資証券 | 7,657 | 179,399.72 1,373,663,729 | 180,100.00 1,379,025,700 | - - | 4.58% |
| 6 | オリックス不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 6,327 | 178,947.75 1,132,202,415 | 184,700.00 1,168,596,900 | - - | 3.88% |
| 7 | 日本プロロジスリート投資法人 日本 | 投資証券 | 4,634 | 240,736.70 1,115,573,874 | 236,000.00 1,093,624,000 | - - | 3.63% |
| 8 | 大和ハウスリート投資法人 日本 | 投資証券 | 3,693 | 276,683.71 1,021,792,962 | 284,400.00 1,050,289,200 | - - | 3.49% |
| 9 | 日本プライムリアルティ投資法人 日本 | 投資証券 | 2,284 | 452,949.88 1,034,537,542 | 453,000.00 1,034,652,000 | - - | 3.43% |
| 10 | アドバンス・レジデンス投資法人 日本 | 投資証券 | 3,350 | 286,079.94 958,367,819 | 297,900.00 997,965,000 | - - | 3.31% |
| 11 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本 | 投資証券 | 1,634 | 549,526.71 897,926,648 | 552,000.00 901,968,000 | - - | 2.99% |
| 12 | G L P 投資法人 日本 | 投資証券 | 6,936 | 126,904.91 880,212,460 | 129,700.00 899,599,200 | - - | 2.99% |
| 13 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 9,428 | 89,889.53 847,478,527 | 79,300.00 747,640,400 | - - | 2.48% |
| 14 | 大和証券オフィス投資法人 日本 | 投資証券 | 1,148 | 634,782.08 728,729,828 | 594,000.00 681,912,000 | - - | 2.26% |
| 15 | ケネディクス・オフィス投資法人 日本 | 投資証券 | 1,015 | 632,276.21 641,760,358 | 666,000.00 675,990,000 | - - | 2.24% |
| 16 | 森ヒルズリート投資法人 日本 | 投資証券 | 4,256 | 160,683.93 683,870,825 | 153,500.00 653,296,000 | - - | 2.17% |
| 17 | フロンティア不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 1,231 | 522,044.98 642,637,378 | 514,000.00 632,734,000 | - - | 2.10% |
| 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 | 1,202 | 460,354.20 553,345,754 | 497,500.00 597,995,000 | - - | 1.99% |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------------|------|-------|---------------------------|---------------------------|--------|-------|
| 19 | 森トラスト総合リート投資法人 日本 | 投資証券 | 3,143 | 195,441.26 614,271,898 | 181,200.00 569,511,600 | - - | 1.89% |
| 20 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 2,206 | 240,968.98 531,577,585 | 238,200.00 525,469,200 | - - | 1.74% |
| 21 | ヒューリックリート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,540 | 185,585.72 471,387,734 | 196,000.00 497,840,000 | - - | 1.65% |
| 22 | インヴィンシブル投資法人 日本 | 投資証券 | 8,844 | 70,517.46 623,656,499 | 53,400.00 472,269,600 | - - | 1.57% |
| 23 | 産業ファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 875 | 559,401.27 489,476,112 | 527,000.00 461,125,000 | - - | 1.53% |
| 24 | ジャパンエクセレント投資法人 日本 | 投資証券 | 3,240 | 147,713.69 478,592,373 | 141,100.00 457,164,000 | - - | 1.52% |
| 25 | プレミアム投資法人 日本 | 投資証券 | 3,268 | 139,390.55 455,528,320 | 131,500.00 429,742,000 | - - | 1.43% |
| 26 | イオンリート投資法人 日本 | 投資証券 | 3,118 | 133,942.04 417,631,294 | 123,000.00 383,514,000 | - - | 1.27% |
| 27 | 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 日本 | 投資証券 | 2,743 | 118,816.47 325,913,593 | 126,500.00 346,989,500 | - - | 1.15% |
| 28 | 東急リアル・エステート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,426 | 149,252.41 362,086,351 | 140,400.00 340,610,400 | - - | 1.13% |
| 29 | 日本賃貸住宅投資法人 日本 | 投資証券 | 4,069 | 83,755.51 340,801,193 | 82,600.00 336,099,400 | - - | 1.12% |
| 30 | 積水ハウス・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,196 | 138,885.58 304,992,755 | 152,000.00 333,792,000 | - - | 1.11% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 投資証券 | 98.73% |
| 合計 | 98.73% |

（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29年1月31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 | 402,214 | 10,704.84 4,305,640,109 | 13,842.71 5,567,731,880 | - - | 2.06% |
| 2 | MICROSOFT CORP アメリカ | 株式 ソフトウェア | 553,414 | 5,750.03 3,182,147,273 | 7,412.44 4,102,151,003 | - - | 1.51% |
| 3 | EXXON MOBIL CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 309,835 | 9,277.33 2,874,441,713 | 9,657.91 2,992,360,589 | - - | 1.10% |
| 4 | AMAZON.COM INC アメリカ | 株式 インターネット 販売・通信 販売 | 30,084 | 58,629.95 1,763,823,480 | 94,505.54 2,843,104,900 | - - | 1.05% |
| 5 | JPMORGAN CHASE & CO アメリカ | 株式 商業銀行 | 269,975 | 6,560.50 1,771,171,269 | 9,791.07 2,643,345,284 | - - | 0.98% |
| 6 | JOHNSON & JOHNSON アメリカ | 株式 医薬品 | 204,804 | 11,663.94 2,388,822,338 | 12,875.32 2,636,918,122 | - - | 0.97% |
| 7 | 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 | 173,536 | 11,736.50 2,036,706,588 | 14,906.83 2,586,872,310 | - - | 0.96% |
| 8 | WELLS FARGO & CO アメリカ | 株式 商業銀行 | 358,022 | 5,380.11 1,926,198,174 | 6,382.46 2,285,062,812 | - - | 0.84% |
| 9 | GENERAL ELECTRIC CO アメリカ | 株式 コングロマ リット | 669,933 | 3,228.37 2,162,795,584 | 3,409.74 2,284,302,438 | - - | 0.84% |
| 10 | AT&T INC アメリカ | 株式 各種電気通信 サービス | 460,498 | 4,171.03 1,920,754,593 | 4,759.53 2,191,755,980 | - - | 0.81% |
| 11 | ALPHABET 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 | 23,139 | 77,786.95 1,799,912,431 | 91,312.03 2,112,869,275 | - - | 0.78% |
| 12 | ALPHABET INC-CL A アメリカ | 株式 インターネット ソフトウェア・サービス | 21,999 | 80,531.01 1,771,601,730 | 93,760.09 2,062,628,270 | - - | 0.76% |
| 13 | BANK OF AMERICA CORP アメリカ | 株式 商業銀行 | 761,401 | 1,363.34 1,038,050,818 | 2,611.93 1,988,733,347 | - - | 0.73% |
| 14 | NESTLE SA-REGISTERED スイス | 株式 食品 | 232,379 | 8,236.93 1,914,090,222 | 8,280.38 1,924,188,283 | - - | 0.71% |
| 15 | PROCTER & GAMBLE CO アメリカ | 株式 家庭用品 | 191,488 | 9,233.94 1,768,190,205 | 9,873.01 1,890,564,375 | - - | 0.70% |
| 16 | CHEVRON CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 140,802 | 9,816.08 1,382,124,197 | 12,726.23 1,791,879,227 | - - | 0.66% |

| | | | | | | | |
|----|---|-----------------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------|-------|
| 17 | VERIZON COMM INC アメリカ | 株式 各種電気通信 サービス | 305,099 | 5,725.50 1,746,845,000 | 5,618.79 1,714,290,169 | - - | 0.63% |
| 18 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ | 株式 各種金融サー ビス | 91,251 | 14,664.67 1,338,166,172 | 18,755.88 1,711,493,535 | - - | 0.63% |
| 19 | PFIZER INC アメリカ | 株式 医薬品 | 453,602 | 3,366.37 1,526,993,233 | 3,563.39 1,616,361,329 | - - | 0.60% |
| 20 | COMCAST CORP-CL A アメリカ | 株式 メディア | 179,552 | 6,493.51 1,165,924,143 | 8,574.44 1,539,558,820 | - - | 0.57% |
| 21 | INTEL CORP アメリカ | 株式 半導体・半導 体製造装置 | 353,216 | 3,282.75 1,159,520,199 | 4,258.77 1,504,265,774 | - - | 0.56% |
| 22 | HOME DEPOT INC アメリカ | 株式 専門小売り | 92,204 | 13,353.09 1,231,208,626 | 15,759.27 1,453,067,795 | - - | 0.54% |
| 23 | MERCK & CO. INC. アメリカ | 株式 医薬品 | 206,907 | 5,615.68 1,161,924,610 | 6,991.34 1,446,558,902 | - - | 0.53% |
| 24 | COCA-COLA CO/THE アメリカ | 株式 飲料 | 306,559 | 4,912.50 1,505,973,577 | 4,709.45 1,443,726,673 | - - | 0.53% |
| 25 | HSBC HOLDINGS PLC イギリス | 株式 商業銀行 | 1,486,352 | 629.05 935,002,777 | 968.52 1,439,567,584 | - - | 0.53% |
| 26 | THE WALT DISNEY CO アメリカ | 株式 メディア | 113,984 | 10,395.30 1,184,898,042 | 12,626.08 1,439,171,262 | - - | 0.53% |
| 27 | ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス | 株式 医薬品 | 52,476 | 27,973.94 1,467,960,762 | 26,762.57 1,404,393,148 | - - | 0.52% |
| 28 | CITIGROUP INC アメリカ | 株式 商業銀行 | 216,601 | 4,286.89 928,544,859 | 6,442.78 1,395,513,478 | - - | 0.52% |
| 29 | NOVARTIS AG-REG SHS スイス | 株式 医薬品 | 166,725 | 8,172.86 1,362,620,504 | 8,234.64 1,372,920,354 | - - | 0.51% |
| 30 | INTL BUSINESS MACHINES CORP アメリカ | 株式 情報技術サー ビス | 67,924 | 13,877.56 942,619,525 | 20,007.79 1,359,009,671 | - - | 0.50% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 株式 | 95.98% |
| 投資信託受益証券 | 0.30% |
| 投資証券 | 2.26% |
| 合計 | 98.53% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年1月31日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|-------------------------|-------|-------|
| 商業銀行 | 外国 | 9.60% |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 6.59% |
| 医薬品 | | 5.62% |
| 保険 | | 4.17% |
| ソフトウェア | | 3.50% |
| インターネットソフトウェア・サービス | | 2.91% |
| 資本市場 | | 2.82% |
| メディア | | 2.73% |
| 化学 | | 2.69% |
| 情報技術サービス | | 2.66% |
| 各種電気通信サービス | | 2.59% |
| 半導体・半導体製造装置 | | 2.46% |
| コンピュータ・周辺機器 | | 2.43% |
| バイオテクノロジー | | 2.26% |
| 食品 | | 2.17% |
| コングロマリット | | 2.13% |
| 飲料 | | 2.02% |
| 食品・生活必需品小売り | | 1.91% |
| 航空宇宙・防衛 | | 1.88% |
| ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス | | 1.88% |
| ヘルスケア機器・用品 | | 1.85% |
| 電力 | | 1.81% |
| 専門小売り | | 1.78% |
| ホテル・レストラン・レジャー | | 1.74% |
| インターネット販売・通信販売 | | 1.59% |
| 金属・鉱業 | | 1.59% |
| タバコ | | 1.58% |
| 機械 | | 1.51% |
| 家庭用品 | | 1.43% |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | | 1.17% |
| 総合公益事業 | | 1.07% |
| 自動車 | | 1.05% |
| 陸運・鉄道 | | 0.93% |
| 各種金融サービス | | 0.90% |
| 通信機器 | | 0.80% |
| エネルギー設備・サービス | | 0.79% |
| 電気設備 | | 0.75% |
| パーソナル用品 | | 0.64% |
| 航空貨物・物流サービス | | 0.60% |
| 専門サービス | | 0.59% |
| 消費者金融 | | 0.58% |
| 不動産管理・開発 | | 0.51% |
| ライフサイエンス・ツール／サービス | | 0.47% |
| 自動車部品 | | 0.45% |
| 家庭用耐久財 | | 0.45% |
| 電子装置・機器・部品 | | 0.42% |
| 複合小売り | | 0.39% |

| | |
|--------------------|--------|
| 建設関連製品 | 0.39% |
| 建設資材 | 0.37% |
| 商業サービス・用品 | 0.36% |
| 無線通信サービス | 0.35% |
| 商社・流通業 | 0.33% |
| 建設・土木 | 0.31% |
| 容器・包装 | 0.31% |
| 運送インフラ | 0.23% |
| ガス | 0.16% |
| 旅客航空輸送業 | 0.15% |
| 紙製品・林産品 | 0.10% |
| 販売 | 0.09% |
| 水道 | 0.09% |
| 海運業 | 0.08% |
| レジャー用品 | 0.08% |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.05% |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.04% |
| 貯蓄・抵当・不動産金融 | 0.03% |
| 各種消費者サービス | 0.01% |
| 合計 | 95.98% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31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 | 92,140 | 23,286.23 2,145,593,934 | 20,228.58 1,863,862,227 | - - | 5.23% |
| 2 | PUBLIC STORAGE アメリカ | 投資証券 | 43,710 | 26,847.29 1,173,495,183 | 24,468.01 1,069,496,800 | - - | 3.00% |
| 3 | PROLOGIS INC アメリカ | 投資証券 | 154,930 | 5,677.06 879,547,056 | 5,547.09 859,412,110 | - - | 2.41% |
| 4 | WELLTOWER INC アメリカ | 投資証券 | 106,260 | 8,161.70 867,263,215 | 7,550.15 802,279,512 | - - | 2.25% |
| 5 | AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ | 投資証券 | 40,250 | 19,873.05 799,890,558 | 19,587.83 788,410,523 | - - | 2.21% |
| 6 | UNIBAIL-RODAMCO SE フランス | 投資証券 | 29,110 | 28,354.68 825,404,982 | 25,701.42 748,168,481 | - - | 2.10% |
| 7 | EQUITY RESIDENTIAL アメリカ | 投資証券 | 107,180 | 7,421.00 795,383,196 | 6,908.26 740,428,057 | - - | 2.08% |
| 8 | VENTAS INC アメリカ | 投資証券 | 103,800 | 7,766.07 806,118,642 | 6,991.34 725,701,953 | - - | 2.04% |
| 9 | BOSTON PROPERTIES INC アメリカ | 投資証券 | 45,080 | 14,560.43 656,384,422 | 14,826.02 668,357,373 | - - | 1.88% |
| 10 | VORNADO REALTY TRUST アメリカ | 投資証券 | 50,420 | 11,099.45 559,634,387 | 12,162.87 613,252,142 | - - | 1.72% |
| 11 | SCENTRE GROUP オーストラリア | 投資信託受益 証券 | 1,556,500 | 401.64 625,156,713 | 380.56 592,344,753 | - - | 1.66% |

| | | | | | | | |
|----|---|--------------|---------|--------------------------|--------------------------|--------|-------|
| 12 | DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ | 投資証券 | 46,600 | 11,448.80 533,514,519 | 12,111.66 564,403,365 | - - | 1.58% |
| 13 | REALTY INCOME CORP アメリカ | 投資証券 | 75,880 | 7,219.48 547,814,898 | 6,747.79 512,022,677 | - - | 1.44% |
| 14 | LINK REIT 香港 | 投資証券 | 653,020 | 764.59 499,294,371 | 779.71 509,166,550 | - - | 1.43% |
| 15 | ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ | 投資証券 | 19,210 | 25,126.46 482,679,410 | 25,406.94 488,067,401 | - - | 1.37% |
| 16 | HCP INC アメリカ | 投資証券 | 137,220 | 3,588.24 492,378,747 | 3,422.26 469,603,436 | - - | 1.32% |
| 17 | GGP INC アメリカ | 投資証券 | 171,350 | 3,205.46 549,255,611 | 2,726.88 467,252,190 | - - | 1.31% |
| 18 | HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ | 投資証券 | 217,120 | 1,888.99 410,138,953 | 2,041.75 443,305,063 | - - | 1.24% |
| 19 | WESTFIELD CORP オーストラリア | 投資信託受益 証券 | 559,200 | 883.73 494,182,695 | 759.40 424,657,598 | - - | 1.19% |
| 20 | SL GREEN アメリカ | 投資証券 | 29,640 | 11,757.66 348,497,201 | 12,409.84 367,827,728 | - - | 1.03% |
| 21 | MID AMERICA アメリカ | 投資証券 | 33,210 | 10,852.84 360,423,102 | 10,789.18 358,308,933 | - - | 1.01% |
| 22 | KIMCO REALTY アメリカ | 投資証券 | 124,330 | 3,302.88 410,647,564 | 2,817.93 350,353,933 | - - | 0.98% |
| 23 | FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ | 投資証券 | 21,000 | 17,566.10 368,888,175 | 15,835.52 332,545,991 | - - | 0.93% |
| 24 | LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス | 投資証券 | 234,370 | 1,579.08 370,090,035 | 1,404.35 329,139,806 | - - | 0.92% |
| 25 | UDR INC アメリカ | 投資証券 | 78,200 | 4,012.65 313,789,487 | 3,943.51 308,382,990 | - - | 0.87% |
| 26 | EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ | 投資証券 | 36,820 | 9,601.97 353,544,771 | 8,228.46 302,972,007 | - - | 0.85% |
| 27 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ | 投資証券 | 23,240 | 11,580.32 269,126,691 | 12,764.92 296,656,963 | - - | 0.83% |
| 28 | IRON MOUNTAIN INC アメリカ | 投資証券 | 71,710 | 4,230.29 303,354,249 | 4,073.25 292,093,467 | - - | 0.82% |
| 29 | DUKE REALTY TRUST アメリカ | 投資証券 | 103,790 | 2,923.50 303,430,355 | 2,735.99 283,968,651 | - - | 0.80% |
| 30 | GOODMAN GROUP オーストラリア | 投資信託受益 証券 | 466,730 | 613.14 286,174,590 | 593.22 276,877,771 | - - | 0.78% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 投資信託受益証券 | 11.01% |
| 投資証券 | 88.45% |
| 合計 | 99.46% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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29年1月31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 1.25 10/31/18 アメリカ | 国債証券 | 2,446,915,000 | 100.75 2,465,459,770 | 100.17 2,451,099,224 | 1.250000 2018/10/31 | 1.50% |
| 2 | US T N/B 1.25 11/30/18 アメリカ | 国債証券 | 1,536,435,000 | 100.64 1,546,300,506 | 100.13 1,538,463,094 | 1.250000 2018/11/30 | 0.94% |
| 3 | US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,470,425,200 | 104.98 1,543,796,276 | 101.79 1,496,834,036 | 2.250000 2021/3/31 | 0.91% |
| 4 | US T N/B 2.625 11/15/20 アメリカ | 国債証券 | 1,349,786,600 | 104.04 1,404,364,413 | 103.37 1,395,341,897 | 2.625000 2020/11/15 | 0.85% |
| 5 | US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ | 国債証券 | 1,360,029,500 | 105.70 1,437,551,238 | 102.38 1,392,534,205 | 2.375000 2020/12/31 | 0.85% |
| 6 | US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,365,720,000 | 101.10 1,380,865,834 | 100.85 1,377,451,534 | 2.125000 2021/12/31 | 0.84% |
| 7 | US T N/B 1.375 01/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,365,720,000 | 101.34 1,384,071,862 | 98.46 1,344,797,169 | 1.375000 2021/1/31 | 0.82% |
| 8 | US T N/B 2.375 06/30/18 アメリカ | 国債証券 | 1,286,053,000 | 103.24 1,327,790,313 | 101.90 1,310,616,612 | 2.375000 2018/6/30 | 0.80% |
| 9 | US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ | 国債証券 | 1,263,291,000 | 106.04 1,339,622,911 | 103.08 1,302,263,527 | 2.750000 2023/11/15 | 0.79% |
| 10 | US T N/B 0.75 03/31/18 アメリカ | 国債証券 | 1,263,291,000 | 99.99 1,263,189,936 | 99.78 1,260,625,455 | 0.750000 2018/3/31 | 0.77% |
| 11 | US T N/B 0.75 07/15/19 アメリカ | 国債証券 | 1,251,910,000 | 99.74 1,248,681,210 | 98.55 1,233,857,457 | 0.750000 2019/7/15 | 0.75% |
| 12 | US T N/B 1.0 09/15/18 アメリカ | 国債証券 | 1,229,148,000 | 100.76 1,238,611,756 | 99.84 1,227,267,403 | 1.000000 2018/9/15 | 0.75% |
| 13 | US T N/B 0.875 05/31/18 アメリカ | 国債証券 | 1,138,100,000 | 100.60 1,144,996,886 | 99.86 1,136,540,803 | 0.875000 2018/5/31 | 0.69% |
| 14 | US T N/B 0.75 08/31/18 アメリカ | 国債証券 | 1,138,100,000 | 100.00 1,138,100,000 | 99.48 1,132,272,928 | 0.750000 2018/8/31 | 0.69% |
| 15 | US T N/B 1.0 11/15/19 アメリカ | 国債証券 | 1,138,100,000 | 98.89 1,125,501,233 | 98.83 1,124,806,992 | 1.000000 2019/11/15 | 0.69% |
| 16 | US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ | 国債証券 | 1,138,100,000 | 101.32 1,153,158,201 | 98.14 1,117,022,388 | 1.375000 2021/4/30 | 0.68% |
| 17 | US T N/B 1.125 06/30/21 アメリカ | 国債証券 | 1,138,100,000 | 100.47 1,143,471,832 | 96.89 1,102,705,090 | 1.125000 2021/6/30 | 0.67% |

| | | | | | | | |
|----|---------------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|-------|
| 18 | US T N/B 1.625 04/30/23 アメリカ | 国債証券 | 1,115,338,000 | 101.80 1,135,438,439 | 96.63 1,077,862,643 | 1.625000 2023/4/30 | 0.66% |
| 19 | US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ | 国債証券 | 1,069,814,000 | 100.10 1,070,894,512 | 98.76 1,056,644,589 | 1.000000 2019/11/30 | 0.64% |
| 20 | US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ | 国債証券 | 1,024,290,000 | 101.00 1,034,532,900 | 99.57 1,019,926,524 | 1.250000 2019/10/31 | 0.62% |
| 21 | US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ | 国債証券 | 1,012,909,000 | 103.04 1,043,729,317 | 100.27 1,015,674,241 | 2.000000 2021/11/15 | 0.62% |
| 22 | US T N/B 1.5 02/28/19 アメリカ | 国債証券 | 967,385,000 | 101.70 983,859,566 | 100.50 972,289,641 | 1.500000 2019/2/28 | 0.59% |
| 23 | US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ | 国債証券 | 910,480,000 | 109.42 996,329,159 | 106.32 968,022,336 | 3.625000 2020/2/15 | 0.59% |
| 24 | US T N/B 1.125 03/31/20 アメリカ | 国債証券 | 910,480,000 | 100.35 913,712,204 | 98.75 899,162,733 | 1.125000 2020/3/31 | 0.55% |
| 25 | US T N/B 2.125 08/31/20 アメリカ | 国債証券 | 874,060,800 | 104.12 910,115,808 | 101.61 888,194,363 | 2.125000 2020/8/31 | 0.54% |
| 26 | US T N/B 2.0 09/30/20 アメリカ | 国債証券 | 871,784,600 | 103.61 903,332,572 | 101.14 881,792,687 | 2.000000 2020/9/30 | 0.54% |
| 27 | US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ | 国債証券 | 876,337,000 | 103.30 905,310,749 | 98.38 862,157,867 | 2.250000 2025/11/15 | 0.53% |
| 28 | US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ | 国債証券 | 864,956,000 | 101.99 882,185,923 | 98.10 848,530,485 | 1.750000 2022/9/30 | 0.52% |
| 29 | US T N/B 1.75 02/28/22 アメリカ | 国債証券 | 853,575,000 | 102.46 874,588,309 | 98.90 844,236,889 | 1.750000 2022/2/28 | 0.52% |
| 30 | US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ | 国債証券 | 876,337,000 | 99.72 873,904,538 | 93.17 816,562,053 | 1.625000 2026/2/15 | 0.50% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 国債証券 | 95.93% |
| 合計 | 95.93% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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29年1月31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 | 8,300 | 128,231.99 1,064,325,518 | 194,313.00 1,612,797,900 | - - | 3.92% |
| 2 | 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 | 475,400 | 2,454.04 1,166,653,593 | 2,998.54 1,425,509,719 | - - | 3.46% |
| 3 | TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾 | 株式 半導体・半導体製造装置 | 2,061,083 | 579.73 1,194,890,868 | 669.65 1,380,214,536 | - - | 3.35% |
| 4 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネットソフトウェア・サービス | 93,900 | 9,388.09 881,542,191 | 11,497.08 1,079,576,394 | - - | 2.62% |
| 5 | NASPERS LTD 南アフリカ | 株式 メディア | 36,630 | 18,108.76 663,324,158 | 18,181.23 665,978,597 | - - | 1.62% |
| 6 | CHINA MOBILE LIMITED 香港 | 株式 無線通信サービス | 513,500 | 1,314.93 675,220,768 | 1,288.75 661,778,003 | - - | 1.61% |
| 7 | CHINA CONSTRUCTION BANK 中国 | 株式 商業銀行 | 7,032,530 | 74.72 525,487,548 | 85.08 598,369,847 | - - | 1.45% |
| 8 | BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネットソフトウェア・サービス | 22,700 | 20,989.29 476,456,960 | 19,884.88 451,386,848 | - - | 1.10% |
| 9 | IND & COMM BK OF CHINA - H 中国 | 株式 商業銀行 | 6,165,235 | 63.88 393,848,289 | 70.12 432,322,307 | - - | 1.05% |
| 10 | HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾 | 株式 電子装置・機器・部品 | 1,294,532 | 272.58 352,865,193 | 302.15 391,151,905 | - - | 0.95% |
| 11 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル | 株式 商業銀行 | 270,098 | 1,095.80 295,975,905 | 1,355.53 366,127,562 | - - | 0.89% |
| 12 | BANK OF CHINA LTD 中国 | 株式 商業銀行 | 6,641,200 | 47.55 315,854,806 | 51.93 344,889,470 | - - | 0.84% |
| 13 | SBERBANK ADR ロシア | 株式 商業銀行 | 232,555 | 875.03 203,492,826 | 1,353.20 314,693,635 | - - | 0.76% |
| 14 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド | 株式 貯蓄・抵当・不動産金融 | 125,716 | 1,893.45 238,037,574 | 2,304.79 289,749,231 | - - | 0.70% |
| 15 | GAZPROM PAO ADR ロシア | 株式 石油・ガス・消耗燃料 | 509,755 | 501.00 255,389,420 | 566.43 288,741,732 | - - | 0.70% |
| 16 | BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル | 株式 商業銀行 | 233,315 | 958.72 223,683,888 | 1,177.90 274,822,671 | - - | 0.67% |

| | | | | | | | |
|----|---|----------------------------------|-----------|---------------------------|---------------------------|--------|-------|
| 17 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国 | 株式 保険 | 436,000 | 555.09 242,019,908 | 588.26 256,484,412 | - - | 0.62% |
| 18 | SK HYNIX INC 韓国 | 株式 半導体・半導 体製造装置 | 48,682 | 2,752.90 134,017,055 | 5,191.41 252,728,708 | - - | 0.61% |
| 19 | INFOSYS LTD インド | 株式 情報技術サー ビス | 153,655 | 1,961.84 301,446,597 | 1,594.90 245,065,588 | - - | 0.60% |
| 20 | AMBEV SA ブラジル | 株式 飲料 | 394,095 | 689.73 271,819,654 | 617.70 243,435,634 | - - | 0.59% |
| 21 | LUKOIL SPON ADR ロシア | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 36,954 | 4,826.13 178,345,067 | 6,471.23 239,138,077 | - - | 0.58% |
| 22 | SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国 | 株式 コンピュー タ・周辺機器 | 1,475 | 105,545.81 155,680,080 | 157,301.00 232,018,975 | - - | 0.56% |
| 23 | CNOOC LTD 香港 | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 1,478,000 | 142.72 210,940,683 | 144.35 213,353,438 | - - | 0.52% |
| 24 | AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ | 株式 無線通信サー ビス | 2,767,278 | 73.20 202,575,944 | 72.42 200,414,021 | - - | 0.49% |
| 25 | CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国 | 株式 保険 | 621,000 | 288.94 179,432,781 | 316.13 196,322,008 | - - | 0.48% |
| 26 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国 | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 2,129,200 | 78.08 166,250,433 | 91.10 193,971,610 | - - | 0.47% |
| 27 | RELIANCE INDUSTRIES LTD インド | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 108,265 | 1,780.57 192,773,889 | 1,755.26 190,033,656 | - - | 0.46% |
| 28 | NETEASE INC-ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネッ トソフトウェ ア・サービス | 6,600 | 18,408.41 121,495,566 | 28,508.26 188,154,561 | - - | 0.46% |
| 29 | JD.COM INC ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネッ ト販売・通信 販売 | 55,800 | 2,931.68 163,587,967 | 3,250.41 181,373,078 | - - | 0.44% |
| 30 | VALE SA-PREF A ブラジル | 株式 金属・鉱業 | 161,696 | 533.62 86,284,524 | 1,108.01 179,161,755 | - - | 0.44% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 株式 | 95.46% |
| 投資信託受益証券 | 0.62% |
| 投資証券 | 0.23% |
| 合計 | 96.31% |

（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29年1月31日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|-------------------------|-------|--------|
| 商業銀行 | 外国 | 16.15% |
| インターネットソフトウェア・サービス | | 8.31% |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 7.36% |
| コンピュータ・周辺機器 | | 5.58% |
| 半導体・半導体製造装置 | | 5.02% |
| 無線通信サービス | | 3.80% |
| 金属・鉱業 | | 3.41% |
| 保険 | | 3.31% |
| 自動車 | | 2.48% |
| 電子装置・機器・部品 | | 2.46% |
| 化学 | | 2.44% |
| メディア | | 2.18% |
| 不動産管理・開発 | | 1.99% |
| コングロマリット | | 1.88% |
| 食品 | | 1.79% |
| 各種電気通信サービス | | 1.78% |
| 食品・生活必需品小売り | | 1.74% |
| 情報技術サービス | | 1.60% |
| 医薬品 | | 1.43% |
| 各種金融サービス | | 1.35% |
| 資本市場 | | 1.29% |
| 電力 | | 1.19% |
| 飲料 | | 1.00% |
| インターネット販売・通信販売 | | 0.95% |
| 運送インフラ | | 0.93% |
| 建設・土木 | | 0.84% |
| 貯蓄・抵当・不動産金融 | | 0.84% |
| 建設資材 | | 0.83% |
| パーソナル用品 | | 0.82% |
| 自動車部品 | | 0.77% |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | | 0.70% |
| 家庭用耐久財 | | 0.70% |
| ホテル・レストラン・レジャー | | 0.68% |
| タバコ | | 0.68% |
| 複合小売り | | 0.66% |
| 機械 | | 0.63% |
| ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス | | 0.57% |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | | 0.55% |

| | |
|---------------------|--------|
| ガス | 0.48% |
| 専門小売り | 0.38% |
| 各種消費者サービス | 0.37% |
| 紙製品・林産品 | 0.36% |
| 家庭用品 | 0.36% |
| 水道 | 0.27% |
| エクイティ不動産投資信託（REITs） | 0.25% |
| 航空宇宙・防衛 | 0.24% |
| 電気設備 | 0.23% |
| バイオテクノロジー | 0.22% |
| 旅客航空輸送業 | 0.21% |
| 消費者金融 | 0.20% |
| 陸運・鉄道 | 0.16% |
| ソフトウェア | 0.15% |
| 商業サービス・用品 | 0.13% |
| 総合公益事業 | 0.09% |
| 航空貨物・物流サービス | 0.08% |
| エネルギー設備・サービス | 0.08% |
| ライフサイエンス・ツール／サービス | 0.07% |
| 容器・包装 | 0.07% |
| レジャー用品 | 0.07% |
| 海運業 | 0.06% |
| 商社・流通業 | 0.06% |
| ヘルスケア機器・用品 | 0.05% |
| 販売 | 0.05% |
| 建設関連製品 | 0.04% |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.04% |
| 通信機器 | 0.03% |
| 合計 | 95.46% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31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 | 2,648,643,225 | 121.58 3,220,371,131 | 119.90 3,175,882,145 | 7.500000 2030/3/31 | 4.60% |
| 2 | RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 ロシア | 国債証券 | 956,004,000 | 115.70 1,106,113,699 | 113.80 1,087,989,912 | 11.000000 2018/7/24 | 1.58% |
| 3 | PERU 8.75 11/21/33 ペルー | 国債証券 | 717,003,000 | 154.98 1,111,224,906 | 148.38 1,063,960,751 | 8.750000 2033/11/21 | 1.54% |
| 4 | BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル | 国債証券 | 1,035,671,000 | 95.80 992,238,258 | 96.62 1,000,717,103 | 4.250000 2025/1/7 | 1.45% |
| 5 | PERU 5.625 11/18/50 ペルー | 国債証券 | 796,670,000 | 122.00 971,943,090 | 115.21 917,843,507 | 5.625000 2050/11/18 | 1.33% |
| 6 | UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ | 国債証券 | 864,956,000 | 109.12 943,883,235 | 101.97 882,038,881 | 5.550000 2045/1/21 | 1.28% |
| 7 | PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ | 国債証券 | 705,622,000 | 131.02 924,528,706 | 123.10 868,691,244 | 6.700000 2036/1/26 | 1.26% |
| 8 | UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ | 国債証券 | 785,289,000 | 119.41 937,751,721 | 108.87 854,983,398 | 6.050000 2040/1/11 | 1.24% |
| 9 | UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ | 国債証券 | 933,242,000 | 101.55 947,798,299 | 91.50 853,916,430 | 4.750000 2044/3/8 | 1.24% |
| 10 | RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア | 国債証券 | 796,670,000 | 106.84 851,213,670 | 106.14 845,593,504 | 4.875000 2023/9/16 | 1.23% |
| 11 | PERU 7.35 07/21/25 ペルー | 国債証券 | 637,336,000 | 134.60 857,894,089 | 128.68 820,187,698 | 7.350000 2025/7/21 | 1.19% |
| 12 | HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー | 国債証券 | 728,384,000 | 113.74 828,519,728 | 112.11 816,664,140 | 6.375000 2021/3/29 | 1.18% |
| 13 | UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19 メキシコ | 国債証券 | 751,146,000 | 110.47 829,794,400 | 108.27 813,303,331 | 5.950000 2019/3/19 | 1.18% |
| 14 | RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア | 国債証券 | 728,384,000 | 108.47 790,088,367 | 108.50 790,369,478 | 5.625000 2042/4/4 | 1.15% |
| 15 | TURKEY 6.75 04/03/18 トルコ | 国債証券 | 751,146,000 | 105.74 794,325,514 | 104.11 782,070,680 | 6.750000 2018/4/3 | 1.13% |
| 16 | COLOMBIA 7.375 03/18/19 コロンビア | 国債証券 | 694,241,000 | 113.74 789,682,066 | 110.90 769,913,269 | 7.375000 2019/3/18 | 1.12% |
| 17 | UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ | 国債証券 | 762,527,000 | 105.26 802,679,168 | 100.74 768,245,952 | 4.000000 2023/10/2 | 1.11% |
| 18 | TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ | 国債証券 | 694,241,000 | 118.20 820,595,138 | 110.34 766,094,943 | 7.375000 2025/2/5 | 1.11% |

| | | | | | | | |
|----|---|------|-------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-------|
| 19 | BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル | 国債証券 | 728,384,000 | 103.91 756,904,786 | 104.20 758,976,128 | 4.875000 2021/1/22 | 1.10% |
| 20 | PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン | 国債証券 | 478,002,000 | 166.97 798,157,269 | 157.94 754,975,478 | 9.500000 2030/2/2 | 1.09% |
| 21 | UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 メキシコ | 国債証券 | 751,146,000 | 105.54 792,800,460 | 99.97 750,995,770 | 4.125000 2026/1/21 | 1.09% |
| 22 | BRAZIL 5.875 01/15/19 ブラジル | 国債証券 | 694,241,000 | 109.07 757,223,454 | 107.60 747,003,316 | 5.875000 2019/1/15 | 1.08% |
| 23 | RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19 ロシア | 国債証券 | 728,384,000 | 101.59 740,026,990 | 102.08 743,548,954 | 3.500000 2019/1/16 | 1.08% |
| 24 | ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア | 国債証券 | 648,717,000 | 118.22 766,923,025 | 114.35 741,814,376 | 6.750000 2022/2/7 | 1.07% |
| 25 | INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア | 国債証券 | 694,241,000 | 108.30 751,918,769 | 106.63 740,303,890 | 4.875000 2021/5/5 | 1.07% |
| 26 | BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル | 国債証券 | 864,956,000 | 83.95 726,187,467 | 85.25 737,374,990 | 5.000000 2045/1/27 | 1.07% |
| 27 | UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ | 国債証券 | 717,003,000 | 103.96 745,398,595 | 100.70 722,022,021 | 3.625000 2022/3/15 | 1.05% |
| 28 | INDONESIA 11.625 03/04/19 インドネシア | 国債証券 | 591,812,000 | 121.68 720,171,470 | 119.73 708,623,852 | 11.625000 2019/3/4 | 1.03% |
| 29 | COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア | 国債証券 | 637,336,000 | 110.00 701,126,505 | 110.50 704,256,280 | 6.125000 2041/1/18 | 1.02% |
| 30 | COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア | 国債証券 | 660,098,000 | 105.11 693,854,046 | 105.25 694,753,145 | 5.625000 2044/2/26 | 1.01% |

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 国債証券 | 96.50% |
| 合計 | 96.50% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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29年1月31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・ポンド売/ 円買 2017年03月 | 売建 | 25,300,000 | 3,565,491,800 | 3,601,455,000 | 8.96% |
| | | アメリカ・ドル売/ 円買 2017年03月 | 売建 | 16,900,000 | 1,954,877,000 | 1,921,023,000 | 4.78% |
| | | オーストラリア・ドル 売/円買 2017年0 3月 | 売建 | 15,800,000 | 1,344,499,600 | 1,357,220,000 | 3.38% |
| | | ユーロ売/円買 201 7年03月 | 売建 | 11,100,000 | 1,359,045,600 | 1,351,647,000 | 3.36% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2017年03月 | 売建 | 13,300,000 | 1,162,637,800 | 1,153,376,000 | 2.87% |

（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）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29年1月31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 2903月 | 買建 | 689 | 10,667,538,436 | 10,452,130,000 | 3.61% |

（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29年1月31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 2017年02月 | 買建 | 1,820,000 | 208,801,684 | 207,116,000 | 0.08% |
| | | ユーロ買/円売 201 7年02月 | 買建 | 480,000 | 59,066,400 | 58,440,000 | 0.02% |
| | | イギリス・ポンド買/ 円売 2017年02月 | 買建 | 180,000 | 25,997,580 | 25,635,600 | 0.01% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2017年02月 | 買建 | 170,000 | 14,845,964 | 14,752,600 | 0.01% |
| | | オーストラリア・ドル 買/円売 2017年0 2月 | 買建 | 160,000 | 13,859,840 | 13,774,400 | 0.01% |
| | | アメリカ・ドル売/円 買 2017年02月 | 売建 | 820,000 | 93,320,428 | 93,316,000 | 0.03% |
| | | ユーロ売/円買 201 7年02月 | 売建 | 210,000 | 25,567,836 | 25,567,500 | 0.01% |
| | | イギリス・ポンド売/ 円買 2017年02月 | 売建 | 70,000 | 9,969,820 | 9,969,400 | 0.00% |
| | | オーストラリア・ドル 売/円買 2017年0 2月 | 売建 | 70,000 | 6,026,580 | 6,026,300 | 0.00% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2017年02月 | 売建 | 60,000 | 5,207,190 | 5,206,800 | 0.00% |
| 株価指数先物 取引 | シカゴ商品 取引所 | S & P 500 E M I N I F U T M a r 17 | 買建 | 192 | 2,476,406,016 | 2,486,702,976 | 0.92% |
| | E U R E X 取引所 | D J E U R O S T O X X 50 M a r 17 | 買建 | 171 | 683,685,907 | 677,042,010 | 0.25% |
| | I C E - E U | F T S E 100 I N D E X F U T U R E M a r 17 | 買建 | 28 | 281,550,863 | 280,957,418 | 0.10% |
| | シドニー先 物取引所 | S P I 200 F U T U R E S M a r 1 7 | 買建 | 13 | 157,205,685 | 156,785,947 | 0.06% |
| | 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 17 | 買建 | 9 | 142,089,116 | 142,115,153 | 0.05% |

(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29年1月31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 2017年02月 | 買建 | 820,000 | 93,817,660 | 93,316,000 | 0.26% |
| | | オーストラリア・ドル 買/円売 2017年0 2月 | 買建 | 215,000 | 18,544,660 | 18,509,350 | 0.05% |
| | | シンガポール・ドル 買/円売 2017年0 2月 | 買建 | 45,000 | 3,604,680 | 3,604,500 | 0.01% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2017年02月 | 買建 | 27,000 | 2,357,888 | 2,343,060 | 0.01% |

（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29年1月31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2017年02月 | 売建 | 620,193,000 | 72,220,985,940 | 70,577,963,400 | 43.05% |
| | | ユーロ売/円買201 7年02月 | 売建 | 532,520,800 | 65,487,949,348 | 64,834,407,400 | 39.55% |
| | | イギリス・ポンド売/ 円買2017年02月 | 売建 | 82,441,200 | 11,866,770,504 | 11,741,275,704 | 7.16% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2017年02月 | 売建 | 40,183,500 | 3,491,374,658 | 3,487,124,130 | 2.13% |
| | | オーストラリア・ドル 売/円買2017年0 2月 | 売建 | 39,644,500 | 3,342,485,716 | 3,412,598,560 | 2.08% |
| | | メキシコ・ペソ売/円 買2017年02月 | 売建 | 216,344,100 | 1,218,235,790 | 1,181,238,786 | 0.72% |
| | | デンマーク・クローネ 売/円買2017年0 2月 | 売建 | 63,323,900 | 1,046,662,839 | 1,036,612,243 | 0.63% |
| | | ポーランド・ズロチ 売/円買2017年0 2月 | 売建 | 34,854,300 | 972,090,418 | 977,663,115 | 0.60% |
| | | 南アフリカ・ランド 売/円買2017年0 2月 | 売建 | 99,714,900 | 844,416,393 | 839,599,458 | 0.51% |
| | | スウェーデン・クロー ナ売/円買2017年 02月 | 売建 | 58,868,200 | 755,539,369 | 758,811,098 | 0.46% |
| | | マレーシア・リングッ ト売/円買2017年 03月 | 売建 | 25,370,000 | 647,338,383 | 652,009,000 | 0.40% |
| | | シンガポール・ドル 売/円買2017年0 2月 | 売建 | 6,933,500 | 558,889,051 | 555,373,350 | 0.34% |
| | | ノルウェー・クローネ 売/円買2017年0 2月 | 売建 | 31,401,800 | 424,706,254 | 429,576,624 | 0.26% |

(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29年1月31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 17 | 買建 | 285 | 1,437,888,059 | 1,481,831,807 | 3.60% |

（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29年1月31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 2017年02月 | 買建 | 72,900,000 | 8,362,895,420 | 8,296,020,000 | 12.02% |

（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）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29年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記特定計算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 |
| 第7計算期間末 (平成27年7月13日) | 28,752 | 28,830 | 1.1117 | 1.1147 |
| 第8計算期間末 (平成28年1月12日) | 31,162 | 31,249 | 1.0760 | 1.0790 |
| 第9計算期間末 (平成28年7月11日) | 31,925 | 32,011 | 1.1223 | 1.1253 |
| 第10計算期間末 (平成29年1月11日) | 38,014 | 38,115 | 1.1200 | 1.1230 |
| 平成28年1月末日 | 31,234 | - | 1.0867 | - |
| 2月末日 | 31,289 | - | 1.0902 | - |
| 3月末日 | 31,698 | - | 1.1049 | - |
| 4月末日 | 31,678 | - | 1.1027 | - |
| 5月末日 | 31,996 | - | 1.1074 | - |
| 6月末日 | 32,239 | - | 1.1150 | - |
| 7月末日 | 32,171 | - | 1.1256 | - |
| 8月末日 | 32,692 | - | 1.1242 | - |
| 9月末日 | 34,042 | - | 1.1205 | - |
| 10月末日 | 34,330 | - | 1.1146 | - |
| 11月末日 | 35,113 | - | 1.1106 | - |
| 12月末日 | 37,544 | - | 1.1204 | - |
| 平成29年1月末日 | 40,201 | - | 1.1098 | - |

【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 |
| 第7計算期間 | 0.0030 |
| 第8計算期間 | 0.0030 |
| 第9計算期間 | 0.0030 |
| 第10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 |
| 第7計算期間 | 1.7 |
| 第8計算期間 | 2.9 |
| 第9計算期間 | 4.6 |
| 第10計算期間 | 0.1 |

（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 |
| 第7計算期間 | 16,792,100,733 | 843,066,957 |
| 第8計算期間 | 5,531,718,781 | 2,433,705,327 |
| 第9計算期間 | 2,334,562,803 | 2,849,184,376 |
| 第10計算期間 | 8,018,264,356 | 2,525,414,015 |

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

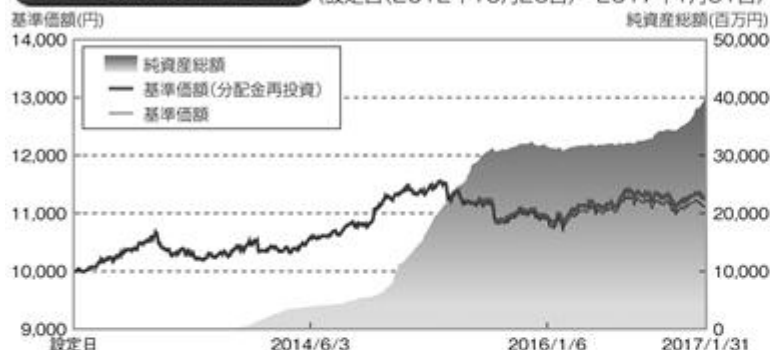
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2017年1月31日

基準価額・純資産の推移

《設定日(2012年10月26日)～2017年1月31日》



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したも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6期 (2015.01.13) | 30円 |
| 第7期 (2015.07.13) | 30円 |
| 第8期 (2016.01.12) | 30円 |
| 第9期 (2016.07.11) | 30円 |
| 第10期 (2017.01.11) | 30円 |
| 設定来累計 | 150円 |

(注)分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

(注)投資比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

■組入銘柄一覧

| 順位 | 銘柄名 | 投資比率 |
|----|------------------------------|--------|
| 1 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 28.76% |
| 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 | 23.79% |
| 3 | エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 10.44% |
| 4 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 9.38% |
| 5 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 6.20% |
| 6 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 5.79% |
| 7 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 4.79% |
| 8 | 外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド | 4.24% |

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) | △23.34 |

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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 | 83.77 |
| 内 日本 | 83.77 |
| 地方債証券 | 6.26 |
| 内 日本 | 6.26 |
| 特殊債券 | 4.96 |
| 内 日本 | 4.96 |
| 社債券 | 4.47 |
| 内 日本 | 4.39 |
| 内 オランダ | 0.05 |
| 内 イギリス | 0.03 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 0.54 |
| 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 | 129回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2021/9/20 | 1.19% |
| 2 | 124回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2020/6/20 | 1.19% |
| 3 | 122回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2019/12/20 | 1.19% |
| 4 | 343回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2026/6/20 | 1.18% |
| 5 | 118回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.200000 | 2019/6/20 | 1.11% |

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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 | 96.28 |
| 内 日本 | 96.28 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 3.72 |
| 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 | 3.47% |
| 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 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.71% |
| 4 | ソフトバンクグループ | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.68% |
| 5 | 三井住友フィナンシャルグループ | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.53% |

組入上位5業種(国内株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率 |
|----|--------|--------|
| 1 | 電気機器 | 12.16% |
| 2 | 輸送用機器 | 9.09% |
| 3 | 銀行業 | 8.21% |
| 4 | 情報・通信業 | 7.72% |
| 5 | 化学 | 6.44% |

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) | 3.61 |

○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:2017年1月31日

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(注)投資比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。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 | 95.93 |
| 内 アメリカ | 42.75 |
| 内 フランス | 9.39 |
| 内 イタリア | 9.07 |
| 内 ドイツ | 7.14 |
| 内 イギリス | 6.95 |
| 内 その他 | 20.63 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 4.07 |
| 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) | △97.90 |

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 1.25 10/31/18 | 国債証券 | アメリカ | 1.250000 | 2018/10/31 | 1.50% |
| 2 | US T N/B 1.25 11/30/18 | 国債証券 | アメリカ | 1.250000 | 2018/11/30 | 0.94% |
| 3 | US T N/B 2.25 03/31/21 | 国債証券 | アメリカ | 2.250000 | 2021/3/31 | 0.91% |
| 4 | US T N/B 2.625 11/15/20 | 国債証券 | アメリカ | 2.625000 | 2020/11/15 | 0.85% |
| 5 | US T N/B 2.375 12/31/20 | 国債証券 | アメリカ | 2.375000 | 2020/12/31 | 0.85% |

■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 | 95.98 |
| 内 アメリカ | 59.47 |
| 内 イギリス | 6.71 |
| 内 カナダ | 4.01 |
| 内 スイス | 3.73 |
| 内 ドイツ | 3.69 |
| 内 その他 | 18.37 |
| 投資信託受益証券 | 0.30 |
| 内 オーストラリア | 0.25 |
| 内 シンガポール | 0.05 |
| 投資証券 | 2.26 |
| 内 アメリカ | 1.97 |
| 内 フランス | 0.13 |
| 内 イギリス | 0.09 |
| 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) | 1.47 |
| 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) | 0.12 |
| 為替予約取引(売建) | △0.05 |
| 株価指数先物取引(買建) | 1.38 |

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 | 2.06% |
| 2 | MICROSOFT CORP | 株式 | アメリカ | ソフトウェア | 1.51% |
| 3 | EXXON MOBIL CORP | 株式 | アメリカ | 石油・ガス・消耗燃料 | 1.10% |
| 4 | AMAZON.COM INC | 株式 | アメリカ | インターネット販売・通信販売 | 1.05% |
| 5 | JPMORGAN CHASE & CO | 株式 | アメリカ | 商業銀行 | 0.98% |

組入上位5業種(外国株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率 |
|----|------------|-------|
| 1 | 商業銀行 | 9.60% |
| 2 | 石油・ガス・消耗燃料 | 6.59% |
| 3 | 医薬品 | 5.62% |
| 4 | 保険 | 4.17% |
| 5 | ソフトウェア | 3.50% |

■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 | 98.73 |
| 内 日本 | 98.73 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1.27 |
| 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 | 7.54% |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 日本 | 6.99% |
| 3 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 日本 | 6.06% |
| 4 | 日本リートファンド投資法人 | 日本 | 5.13% |
| 5 | ユナイテッドアーバン投資法人 | 日本 | 4.58% |

■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 | 11.01 |
| 内 オーストラリア | 8.06 |
| 内 シンガポール | 2.92 |
| 内 カナダ | 0.03 |
| 投資証券 | 88.45 |
| 内 アメリカ | 72.62 |
| 内 イギリス | 4.80 |
| 内 フランス | 4.15 |
| 内 カナダ | 1.91 |
| 内 香港 | 1.74 |
| 内 その他 | 3.23 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 0.54 |
| 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) | 0.33 |

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 | 5.23% |
| 2 | PUBLIC STORAGE | アメリカ | 3.00% |
| 3 | PROLOGIS INC | アメリカ | 2.41% |
| 4 | WELLTOWER INC | アメリカ | 2.25% |
| 5 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | アメリカ | 2.21% |

○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:2017年1月31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 | 96.50 |
| 内 トルコ | 14.29 |
| 内 メキシコ | 12.61 |
| 内 ロシア | 12.56 |
| 内 ブラジル | 9.64 |
| 内 インドネシア | 9.41 |
| 内 その他 | 37.99 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 3.50 |
| 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 | 4.60% |
| 2 | RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 | 国債証券 | ロシア | 11.000000 | 2018/7/24 | 1.58% |
| 3 | PERU 8.75 11/21/33 | 国債証券 | ペルー | 8.750000 | 2033/11/21 | 1.54% |
| 4 | BRAZIL 4.25 01/07/25 | 国債証券 | ブラジル | 4.250000 | 2025/1/7 | 1.45% |
| 5 | PERU 5.625 11/18/50 | 国債証券 | ペルー | 5.625000 | 2050/11/18 | 1.33% |

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) | 12.02 |

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|----------------------|---------|
| 株式 | 95.46 |
| 内 韓国 | 14.24 |
| 内 台湾 | 11.52 |
| 内 ケイマン諸島 | 11.27 |
| 内 中国 | 9.93 |
| 内 インド | 8.04 |
| 内 その他 | 40.46 |
| 投資信託受益証券 | 0.62 |
| 内 メキシコ | 0.62 |
| 投資証券 | 0.23 |
| 内 南アフリカ | 0.11 |
| 内 メキシコ | 0.09 |
| 内 トルコ | 0.04 |
| コールローン、その他の資産(負債控除後) | 3.69 |
| 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 | 3.92% |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD | 株式 | ケイマン諸島 | インターネットソフトウェアサービス | 3.46% |
| 3 | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 株式 | 台湾 | 半導体・半導体製造装置 | 3.35% |
| 4 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 株式 | ケイマン諸島 | インターネットソフトウェアサービス | 2.62% |
| 5 | NASPERS LTD | 株式 | 南アフリカ | メディア | 1.62% |

組入上位5業種(外国株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率 |
|----|--------------------|--------|
| 1 | 商業銀行 | 16.15% |
| 2 | インターネットソフトウェア・サービス | 8.31% |
| 3 | 石油・ガス・消耗燃料 | 7.36% |
| 4 | コンピュータ・周辺機器 | 5.58% |
| 5 | 半導体・半導体製造装置 | 5.02% |

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) | 3.60 |

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として算出してあります。

※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2017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・訂正いたします。

<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10期計算期間（平成28年7月12日から平成29年1月11日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任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9期 平成28年7月11日現在 | 第10期 平成29年1月11日現在 |
|-----------------|---------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 416,382,261 | 1,303,443,883 |
| 親投資信託受益証券 | 31,405,285,602 | 37,302,015,864 |
| 派生商品評価勘定 | 545,715,600 | 53,586,540 |
| 流動資産合計 | 32,367,383,463 | 38,659,046,287 |
| 資産合計 | 32,367,383,463 | 38,659,046,287 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 48,128,800 | 85,156,040 |
| 未払収益分配金 | 85,342,980 | 101,821,531 |
| 未払解約金 | 70,785,375 | 197,686,634 |
| 未払受託者報酬 | 8,442,525 | 9,267,541 |
| 未払委託者報酬 | 227,949,544 | 250,224,929 |
| その他未払費用 | 777,989 | 833,984 |
| 流動負債合計 | 441,427,213 | 644,990,659 |
| 負債合計 | 441,427,213 | 644,990,659 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 28,447,660,191 | 1 33,940,510,532 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 3,478,296,059 | 4,073,545,096 |
| （分配準備積立金） | 558,734,954 | 506,978,684 |
| 元本等合計 | 31,925,956,250 | 38,014,055,628 |
| 純資産合計 | 31,925,956,250 | 38,014,055,628 |
| 負債純資産合計 | 32,367,383,463 | 38,659,046,287 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第9期 自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 第10期 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|---|-------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 74,135 | 98 |
| 有価証券売買等損益 | 664,817,350 | 1,006,730,262 |
| 為替差損益 | 988,958,269 | 688,078,060 |
| 営業収益合計 | 1,653,849,754 | 318,652,300 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 238,504 | 1,548,825 |
| 受託者報酬 | 8,442,525 | 9,267,541 |
| 委託者報酬 | 227,949,544 | 250,224,929 |
| その他費用 | 778,890 | 844,784 |
| 営業費用合計 | 237,409,463 | 261,886,079 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 1,416,440,291 | 56,766,221 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 1,416,440,291 | 56,766,221 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 1,416,440,291 | 56,766,221 |
| 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（ ） | 68,821,387 | 10,122,394 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 2,200,189,647 | 3,478,296,059 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 234,618,917 | 937,831,778 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 234,618,917 | 937,831,778 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 218,788,429 | 307,649,825 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 218,788,429 | 307,649,825 |
| 分配金 | 1 85,342,980 | 1 101,821,531 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 3,478,296,059 | 4,073,545,096 |

(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。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第9期 平成28年7月11日現在 | 第10期 平成29年1月11日現在 |
|-------------|---------------------|----------------------|
| 1 . 1 期首元本額 | 28,962,281,764円 | 28,447,660,191円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,334,562,803円 | 8,018,264,356円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,849,184,376円 | 2,525,414,015円 |
| 2 . 受益権の総数 | 28,447,660,191口 | 33,940,510,532口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第9期 自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 第10期 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|----------------|--|--|
| 1 . 1 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（301,233,405円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,919,561,105円）及び分配準備積立金（342,844,529円）より分配対象収益は3,563,639,039円（1万口当たり1,252.70円）であり、うち85,342,980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。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（94,360,062円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（3,566,566,412円）及び分配準備積立金（514,440,153円）より分配対象収益は4,175,366,627円（1万口当たり1,230.20円）であり、うち101,821,531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。 |

（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9期 自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 第10期 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|-------------------------|---|--------------------------------------|
| 1．金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3．金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

２．金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第9期 平成28年7月11日現在 | 第10期 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|--|----------------------|
| １． 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| ２． 時価の算定方法 | <p>(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| ３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第9期 平成28年7月11日現在 | 第10期 平成29年1月11日現在 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 418,032,705 | 812,624,838 |
| 合計 | 418,032,705 | 812,624,838 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

| 種類 | 第9期 平成28年7月11日 現在 | | | | 第10期 平成29年1月11日 現在 | | | |
|------------|----------------------|-----------|----------------|-------------|-----------------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 9,697,177,600 | - | 9,157,759,000 | 539,418,600 | 8,977,903,500 | - | 9,009,473,000 | 31,569,500 |
| アメリカ・ドル | 467,939,200 | - | 452,655,000 | 15,284,200 | 1,856,795,100 | - | 1,886,399,000 | 29,603,900 |
| イギリス・ポンド | 3,915,917,900 | - | 3,554,460,000 | 361,457,900 | 3,396,411,780 | - | 3,345,255,000 | 51,156,780 |
| オーストラリア・ドル | 1,622,952,200 | - | 1,607,384,000 | 15,568,200 | 1,308,312,160 | - | 1,327,404,000 | 19,091,840 |
| カナダ・ドル | 1,649,875,100 | - | 1,585,788,000 | 64,087,100 | 1,095,629,240 | - | 1,127,847,000 | 32,217,760 |
| ユーロ | 2,040,493,200 | - | 1,957,472,000 | 83,021,200 | 1,320,755,220 | - | 1,322,568,000 | 1,812,780 |
| 買 建 | 2,167,826,800 | - | 2,125,995,000 | 41,831,800 | - | - | - | - |
| アメリカ・ドル | 131,781,000 | - | 130,767,000 | 1,014,000 | - | - | - | - |
| イギリス・ポンド | 1,355,278,600 | - | 1,315,020,000 | 40,258,600 | - | - | - | - |
| オーストラリア・ドル | 156,170,700 | - | 159,222,000 | 3,051,300 | - | - | - | - |
| カナダ・ドル | 155,178,000 | - | 153,960,000 | 1,218,000 | - | - | - | - |
| ユーロ | 369,418,500 | - | 367,026,000 | 2,392,500 | - | - | - | - |
| 合計 | 11,865,004,400 | - | 11,283,754,000 | 497,586,800 | 8,977,903,500 | - | 9,009,473,000 | 31,569,500 |

（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）

| | 第9期 平成28年7月11日現在 | 第10期 平成29年1月11日現在 |
|--------------|---------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,1223円 | 1,1200円 |
| （1万口当たり純資産額） | （11,223円） | （11,200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29年1月11日現在

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|--------------|--------------------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 1,657,754,563 | 3,801,728,539 | |
| | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 8,918,982,259 | 11,420,756,782 | |
| | J - R E I T インデックスファンド・マザーファンド | 1,043,453,876 | 1,906,390,231 | |
| | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 826,420,611 | 2,461,659,073 | |
| | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,450,999,269 | 1,711,163,437 | |
| | 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 | 7,180,183,835 | 9,525,949,893 | |
| | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 2,342,354,016 | 2,298,786,231 | |
| | エマージング債券パッシブ・マザーファンド | 2,270,942,339 | 4,175,581,678 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 25,691,090,768 | 37,302,015,864 | |
| 合計 | | 25,691,090,768 | 37,302,015,864 | |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 1,828,226,218 | 9,742,283,611 |
| 株式 | 2 | 269,406,635,500 | 290,967,130,996 |
| 派生商品評価勘定 | | 50,151,548 | 48,038,424 |
| 未収入金 | | - | 723,088 |
| 未収配当金 | | 377,127,537 | 382,674,497 |
| 前払金 | | 31,495,000 | - |
| 流動資産合計 | | 271,693,635,803 | 301,140,850,616 |
| 資産合計 | | 271,693,635,803 | 301,140,850,616 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 61,296 | 3,123,328 |
| 前受金 | | - | 7,256,000 |
| 未払解約金 | | 134,055,000 | 230,382,000 |
| 流動負債合計 | | 134,116,296 | 240,761,328 |
| 負債合計 | | 134,116,296 | 240,761,328 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 147,673,783,029 | 131,210,790,341 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 123,885,736,478 | 169,689,298,947 |
| 元本等合計 | | 271,559,519,507 | 300,900,089,288 |
| 純資産合計 | | 271,559,519,507 | 300,900,089,288 |
| 負債純資産合計 | | 271,693,635,803 | 301,140,850,616 |

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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--|------------------|------------------|
| 1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 137,895,802,136円 | 147,673,783,029円 |
| 同期中追加設定元本額 | 29,768,712,440円 | 9,639,079,750円 |
| 同期中一部解約元本額 | 19,990,731,547円 | 26,102,072,438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 | 6,375,520,105円 | 6,264,153,363円 |
| D I A M国内株式パッシブ・ファンド | 1,517,074,465円 | 1,939,783,051円 |
| M I T O ラップ型ファンド（安定型） | 9,129,781円 | 4,829,084円 |
| M I T O ラップ型ファンド（中立型） | 18,120,418円 | 12,125,194円 |
| M I T O ラップ型ファンド（積極型） | 38,387,875円 | 25,790,682円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 19,030,231円 | 14,387,127円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 16,030,252円 | 11,695,488円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 15,535,935円 | 13,446,785円 |
| D I A M国内株式インデックスファンド＜D C年金＞ | 38,875,576,225円 | 37,202,520,698円 |
| D I A Mバランス・ファンド＜D C年金＞1 安定型 | 919,699,441円 | 834,342,825円 |
| D I A Mバランス・ファンド＜D C年金＞2 安定・成長型 | 3,081,394,557円 | 2,934,010,309円 |
| D I A Mバランス・ファンド＜D C年金＞3 成長型 | 3,096,646,645円 | 2,972,946,997円 |

| | | |
|--|----------------|----------------|
| DIAM DC バランス30 インデックスファンド | 408,716,759円 | 388,762,191円 |
| DIAM DC バランス50 インデックスファンド | 1,309,764,939円 | 1,259,504,097円 |
| DIAM DC バランス70 インデックスファンド | 1,144,685,427円 | 1,110,130,669円 |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型> | 64,694,612円 | 59,701,755円 |
| マネックス資産設計ファンド< 育成型> | 1,345,850,624円 | 1,326,073,224円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 30,643,797円 | 31,399,302円 |
| DIAM DC 8資産バラン スファンド（新興国10） | 30,983,724円 | 34,624,546円 |
| DIAM DC 8資産バラン スファンド（新興国20） | 64,287,197円 | 67,708,056円 |
| DIAM DC 8資産バラン スファンド（新興国30） | 125,235,921円 | 135,592,368円 |
| 投資のソムリエ | 1,071,677,253円 | 1,657,754,563円 |
| クルーズコントロール | 339,669,799円 | 2,114,151,120円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 24,728,210円 | 49,029,800円 |
| DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金> | 107,114,949円 | 111,573,577円 |
| DIAM DC バランス・F （成長型） | 78,510,194円 | 117,305,991円 |
| クルーズコントロール<DC年 金> | 91,475円 | 834,609円 |
| DIAMコア資産設計ファンド （堅実型） | 3,858,249円 | 23,449,979円 |
| DIAMコア資産設計ファンド （積極型） | 6,868,427円 | 52,178,275円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 3,612,277円 | 14,041,767円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 433,022円 | 1,946,192円 |
| リスク抑制世界8資産バラン スファンド | - 円 | 308,417円 |
| DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド（適格機関 投資家限定） | 250,610,082円 | 297,550,647円 |
| DIAMワールドバランス25 VA（適格機関投資家限定） | 124,900,758円 | 89,036,727円 |
| DIAMグローバル・バラン スファンド25VA（適格機関投 資家限定） | 295,019,238円 | 221,073,539円 |
| DIAMグローバル・バラン スファンド50VA（適格機関投 資家限定） | 479,199,961円 | 420,742,486円 |
| DIAM国際分散バランスファ ンド30VA（適格機関投資家 限定） | 37,607,363円 | 28,397,862円 |
| DIAM国際分散バランスファ ンド50VA（適格機関投資家 限定） | 149,336,920円 | 123,576,045円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A（適格機関投資家 限定） | 39,191,992円 | 30,732,422円 |
| D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A（適格機関投資家 限定） | 54,896,174円 | 34,193,002円 |
| D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限 定） | 3,943,186,781円 | 1,475,082,939円 |
| D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限 定） | 1,395,832,066円 | 565,911,402円 |
| D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定） | 1,986,426,285円 | 1,538,646,735円 |
| D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限 定） | 1,621,942,721円 | 1,345,964,796円 |
| D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定） | 4,256,723,178円 | 3,664,912,196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） | 351,862,082円 | 286,143,893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） | 890,989,010円 | 524,618,280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） | 1,034,171,932円 | 833,834,770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） | 4,234,272,836円 | 3,287,226,831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） | 46,003,219円 | 51,147,517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） | 1,490,614,509円 | 1,122,253,720円 |
| D I A M世界バランスファンド 3 5 V A（適格機関投資家限 定） | 5,637,233,765円 | 4,941,715,812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） | 22,802,924,565円 | 19,074,904,863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） | 834,560,866円 | 705,123,751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） | 2,618,968,856円 | 2,158,376,756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） | 14,367,734,306円 | 12,087,103,172円 |
| D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定） | 8,463,623円 | 6,771,701円 |

| | | | |
|-----|---|-------------------|-------------------|
| | D I A Mバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 3,687,271円 | 563,380円 |
| | D I A Mバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 1,287,419円 | 5,160,286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） | 12,955,028,403円 | 10,838,905,774円 |
| | D I A M世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定） | 117,577,546円 | 97,767,082円 |
| | D I A M国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 46,345,852円 | 34,287,827円 |
| | D I A Mバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 49,758,274円 | 37,297,374円 |
| | D I A Mバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 85,470円 | 73,509円 |
| | D I A Mバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定） | 134,219円 | 119,094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） | 729,123,003円 | 621,830,741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） | 1,971,158,603円 | 1,622,373,744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） | 2,597,804,800円 | 2,159,696,264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） | 105,546,296円 | 91,571,301円 |
| | 計 | 147,673,783,029円 | 131,210,790,341円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 147,673,783,029口 | 131,210,790,341口 |
| 3 . | 2 差入代用有価証券 | 株式 2,650,500,000円 | 株式 3,456,000,000円 |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1． 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3． 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 株式 | 25,475,911,220 | 32,981,281,426 |
| 合計 | 25,475,911,220 | 32,981,281,426 |

（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28年2月9日から平成28年7月11日まで及び平成28年2月9日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

| 種類 | 平成28年7月11日 現在 | | | | 平成29年1月11日 現在 | | | |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 先物取引 | | | | | | | | |
| 買 建 | 3,433,095,000 | - | 3,483,275,000 | 50,180,000 | 8,412,448,000 | - | 8,457,540,000 | 45,092,000 |
| 合計 | 3,433,095,000 | - | 3,483,275,000 | 50,180,000 | 8,412,448,000 | - | 8,457,540,000 | 45,092,000 |

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報に関する注記）

| | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| １口当たり純資産額 | 1.8389円 | 2.2933円 |
| （１万口当たり純資産額） | (18,389円) | (22,933円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年1月11日現在

| 銘 柄 | 株 式 数 | 評価額（円） | | 備考 |
|-----------------|---------|----------|-------------|----|
| | | 単 価 | 金 額 | |
| 極洋 | 5,800 | 2,745.00 | 15,921,000 | |
| 日本水産 | 187,400 | 553.00 | 103,632,200 | |
| マルハニチロ | 27,400 | 3,185.00 | 87,269,000 | |
| ハウスイ | 12,000 | 134.00 | 1,608,000 | |
| カネコ種苗 | 5,100 | 1,563.00 | 7,971,300 | |
| サカタのタネ | 21,300 | 3,220.00 | 68,586,000 | |
| ホクト | 14,700 | 2,109.00 | 31,002,300 | |
| ホクリヨウ | 1,800 | 754.00 | 1,357,200 | |
| ショーボンドホールディングス | 15,100 | 4,985.00 | 75,273,500 | |
| ミライト・ホールディングス | 44,400 | 1,069.00 | 47,463,600 | |
| タマホーム | 11,000 | 553.00 | 6,083,000 | |
| サンヨーホームズ | 3,400 | 659.00 | 2,240,600 | |
| 住石ホールディングス | 40,900 | 97.00 | 3,967,300 | |
| 日鉄鉱業 | 4,000 | 5,670.00 | 22,680,000 | |
| 三井松島産業 | 8,900 | 1,317.00 | 11,721,300 | |
| 国際石油開発帝石 | 759,500 | 1,151.50 | 874,564,250 | |
| 日本海洋掘削 | 5,000 | 2,444.00 | 12,220,000 | |
| 石油資源開発 | 22,800 | 2,596.00 | 59,188,800 | |
| K & Oエナジーグループ | 9,700 | 1,819.00 | 17,644,300 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 3,400 | 1,521.00 | 5,171,400 | |
| 安藤・間 | 103,600 | 785.00 | 81,326,000 | |
| 東急建設 | 51,100 | 949.00 | 48,493,900 | |
| コムシスホールディングス | 56,300 | 2,159.00 | 121,551,700 | |
| ミサワホーム | 17,000 | 1,102.00 | 18,734,000 | |
| ピーアールホールディングス | 13,200 | 267.00 | 3,524,400 | |
| 高松コンストラクショングループ | 10,900 | 2,480.00 | 27,032,000 | |
| 東建コーポレーション | 5,900 | 8,380.00 | 49,442,000 | |
| ヤマウラ | 7,100 | 578.00 | 4,103,800 | |
| 大成建設 | 733,000 | 846.00 | 620,118,000 | |
| 大林組 | 432,400 | 1,104.00 | 477,369,600 | |
| 清水建設 | 441,000 | 1,082.00 | 477,162,000 | |
| 飛島建設 | 139,000 | 185.00 | 25,715,000 | |
| 長谷工コーポレーション | 168,200 | 1,263.00 | 212,436,600 | |
| 松井建設 | 15,900 | 1,066.00 | 16,949,400 | |
| 銭高組 | 21,000 | 497.00 | 10,437,000 | |
| 鹿島建設 | 634,000 | 825.00 | 523,050,000 | |
| 不動テトラ | 116,700 | 215.00 | 25,090,500 | |
| 大末建設 | 5,100 | 991.00 | 5,054,100 | |
| 鉄建建設 | 88,000 | 350.00 | 30,800,000 | |
| 西松建設 | 166,000 | 592.00 | 98,272,000 | |
| 三井住友建設 | 551,900 | 124.00 | 68,435,600 | |
| 大豊建設 | 52,000 | 561.00 | 29,172,000 | |
| 前田建設工業 | 89,000 | 1,046.00 | 93,094,000 | |

| | | | | |
|---------------|---------|-----------|---------------|--|
| 佐田建設 | 10,100 | 450.00 | 4,545,000 | |
| ナカノフドー建設 | 11,100 | 610.00 | 6,771,000 | |
| 奥村組 | 118,000 | 675.00 | 79,650,000 | |
| 東鉄工業 | 17,300 | 3,150.00 | 54,495,000 | |
| イチケン | 13,000 | 453.00 | 5,889,000 | |
| 浅沼組 | 46,000 | 366.00 | 16,836,000 | |
| 戸田建設 | 168,000 | 653.00 | 109,704,000 | |
| 熊谷組 | 226,000 | 306.00 | 69,156,000 | |
| 青木あすなる建設 | 9,500 | 814.00 | 7,733,000 | |
| 北野建設 | 30,000 | 329.00 | 9,870,000 | |
| 植木組 | 18,000 | 265.00 | 4,770,000 | |
| 三井ホーム | 19,000 | 531.00 | 10,089,000 | |
| 矢作建設工業 | 19,700 | 1,106.00 | 21,788,200 | |
| ピーエス三菱 | 15,200 | 397.00 | 6,034,400 | |
| 日本ハウスホールディングス | 29,400 | 527.00 | 15,493,800 | |
| 大東建託 | 53,000 | 17,700.00 | 938,100,000 | |
| 新日本建設 | 17,200 | 947.00 | 16,288,400 | |
| N I P P O | 33,000 | 2,202.00 | 72,666,000 | |
| 東亜道路工業 | 27,000 | 355.00 | 9,585,000 | |
| 前田道路 | 45,000 | 2,001.00 | 90,045,000 | |
| 日本道路 | 43,000 | 461.00 | 19,823,000 | |
| 東亜建設工業 | 11,700 | 2,013.00 | 23,552,100 | |
| 若築建設 | 84,000 | 157.00 | 13,188,000 | |
| 東洋建設 | 41,500 | 420.00 | 17,430,000 | |
| 五洋建設 | 160,100 | 575.00 | 92,057,500 | |
| 大林道路 | 15,000 | 715.00 | 10,725,000 | |
| 世紀東急工業 | 21,000 | 506.00 | 10,626,000 | |
| 福田組 | 23,000 | 1,149.00 | 26,427,000 | |
| 日本ドライケミカル | 1,800 | 2,413.00 | 4,343,400 | |
| 住友林業 | 99,200 | 1,580.00 | 156,736,000 | |
| 日本基礎技術 | 16,300 | 363.00 | 5,916,900 | |
| 日成ビルド工業 | 43,000 | 568.00 | 24,424,000 | |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 76,000 | 83.00 | 6,308,000 | |
| 巴コーポレーション | 18,100 | 374.00 | 6,769,400 | |
| パナホーム | 54,000 | 966.00 | 52,164,000 | |
| 大和ハウス工業 | 425,900 | 3,292.00 | 1,402,062,800 | |
| ライト工業 | 27,700 | 1,215.00 | 33,655,500 | |
| 積水ハウス | 453,600 | 1,968.00 | 892,684,800 | |
| 日特建設 | 12,500 | 482.00 | 6,025,000 | |
| 北陸電気工事 | 7,100 | 921.00 | 6,539,100 | |
| ユアテック | 23,000 | 818.00 | 18,814,000 | |
| 西部電気工業 | 2,400 | 2,272.00 | 5,452,800 | |
| 四電工 | 6,000 | 445.00 | 2,670,000 | |
| 中電工 | 18,200 | 2,567.00 | 46,719,400 | |
| 関電工 | 57,000 | 1,074.00 | 61,218,000 | |
| きんでん | 95,900 | 1,480.00 | 141,932,000 | |
| 東京エネシス | 15,000 | 1,045.00 | 15,675,000 | |
| トーエネック | 20,000 | 579.00 | 11,580,000 | |
| 住友電設 | 10,000 | 1,300.00 | 13,000,000 | |
| 日本電設工業 | 23,500 | 1,897.00 | 44,579,500 | |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|--|
| 協和エクシオ | 56,500 | 1,716.00 | 96,954,000 | |
| 新日本空調 | 11,200 | 1,272.00 | 14,246,400 | |
| 日本工営 | 9,000 | 2,564.00 | 23,076,000 | |
| N D S | 2,300 | 2,955.00 | 6,796,500 | |
| 九電工 | 28,000 | 3,175.00 | 88,900,000 | |
| 三機工業 | 32,000 | 1,004.00 | 32,128,000 | |
| 日揮 | 134,500 | 2,106.00 | 283,257,000 | |
| 中外炉工業 | 44,000 | 232.00 | 10,208,000 | |
| ヤマト | 13,200 | 582.00 | 7,682,400 | |
| 太平電業 | 20,000 | 1,147.00 | 22,940,000 | |
| 高砂熱学工業 | 39,700 | 1,539.00 | 61,098,300 | |
| 三晃金属工業 | 1,300 | 3,270.00 | 4,251,000 | |
| N E C ネットエスアイ | 13,900 | 2,190.00 | 30,441,000 | |
| 朝日工業社 | 3,200 | 2,980.00 | 9,536,000 | |
| 明星工業 | 26,200 | 594.00 | 15,562,800 | |
| 大気社 | 19,100 | 2,895.00 | 55,294,500 | |
| ダイダン | 19,000 | 960.00 | 18,240,000 | |
| 日比谷総合設備 | 16,100 | 1,694.00 | 27,273,400 | |
| 東芝プラントシステム | 23,400 | 1,636.00 | 38,282,400 | |
| 日本製粉 | 42,900 | 1,662.00 | 71,299,800 | |
| 日清製粉グループ本社 | 158,200 | 1,755.00 | 277,641,000 | |
| 日東富士製粉 | 800 | 3,850.00 | 3,080,000 | |
| 昭和産業 | 60,000 | 612.00 | 36,720,000 | |
| 鳥越製粉 | 11,800 | 785.00 | 9,263,000 | |
| 中部飼料 | 15,900 | 1,029.00 | 16,361,100 | |
| フィード・ワン | 87,700 | 169.00 | 14,821,300 | |
| 東洋精糖 | 24,000 | 116.00 | 2,784,000 | |
| 日本甜菜製糖 | 7,400 | 2,393.00 | 17,708,200 | |
| 三井製糖 | 10,300 | 2,515.00 | 25,904,500 | |
| 塩水港精糖 | 16,300 | 253.00 | 4,123,900 | |
| 日新製糖 | 6,100 | 1,710.00 | 10,431,000 | |
| ネクスト | 33,400 | 810.00 | 27,054,000 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 8,300 | 1,345.00 | 11,163,500 | |
| 日本M & A センター | 38,800 | 3,315.00 | 128,622,000 | |
| アコーディア・ゴルフ | 40,700 | 1,202.00 | 48,921,400 | |
| 中広 | 1,400 | 694.00 | 971,600 | |
| タケエイ | 11,900 | 990.00 | 11,781,000 | |
| トラスト・テック | 5,500 | 1,763.00 | 9,696,500 | |
| コシダカホールディングス | 4,600 | 2,228.00 | 10,248,800 | |
| パソナグループ | 11,700 | 830.00 | 9,711,000 | |
| C D S | 3,400 | 1,037.00 | 3,525,800 | |
| リンクアンドモチベーション | 29,800 | 432.00 | 12,873,600 | |
| G C A | 12,000 | 851.00 | 10,212,000 | |
| エス・エム・エス | 18,500 | 2,692.00 | 49,802,000 | |
| テンブホールディングス | 104,000 | 1,898.00 | 197,392,000 | |
| リニカル | 8,000 | 1,382.00 | 11,056,000 | |
| クックパッド | 30,000 | 1,065.00 | 31,950,000 | |
| エスクリ | 4,900 | 623.00 | 3,052,700 | |
| アイ・ケイ・ケイ | 6,200 | 697.00 | 4,321,400 | |
| 森永製菓 | 28,200 | 4,745.00 | 133,809,000 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|--|
| 中村屋 | 3,400 | 5,140.00 | 17,476,000 | |
| 江崎グリコ | 36,100 | 5,440.00 | 196,384,000 | |
| 名糖産業 | 6,400 | 1,417.00 | 9,068,800 | |
| 不二家 | 83,000 | 220.00 | 18,260,000 | |
| 山崎製パン | 105,700 | 2,241.00 | 236,873,700 | |
| 第一屋製パン | 24,000 | 135.00 | 3,240,000 | |
| モロゾフ | 23,000 | 528.00 | 12,144,000 | |
| 亀田製菓 | 8,100 | 5,360.00 | 43,416,000 | |
| 寿スピリッツ | 10,300 | 2,723.00 | 28,046,900 | |
| カルビー | 58,800 | 3,605.00 | 211,974,000 | |
| 森永乳業 | 130,000 | 832.00 | 108,160,000 | |
| 六甲バター | 6,500 | 2,430.00 | 15,795,000 | |
| ヤクルト本社 | 77,300 | 5,490.00 | 424,377,000 | |
| 明治ホールディングス | 85,400 | 9,100.00 | 777,140,000 | |
| 雪印メグミルク | 31,100 | 3,205.00 | 99,675,500 | |
| プリマハム | 91,000 | 424.00 | 38,584,000 | |
| 日本ハム | 98,000 | 3,145.00 | 308,210,000 | |
| 林兼産業 | 4,700 | 874.00 | 4,107,800 | |
| 丸大食品 | 69,000 | 492.00 | 33,948,000 | |
| S Foods | 7,800 | 2,982.00 | 23,259,600 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 83,300 | 1,058.00 | 88,131,400 | |
| 学情 | 5,500 | 1,240.00 | 6,820,000 | |
| スタジオアリス | 5,500 | 2,227.00 | 12,248,500 | |
| シミックホールディングス | 6,900 | 1,543.00 | 10,646,700 | |
| システナ | 10,200 | 1,796.00 | 18,319,200 | |
| N J S | 3,100 | 1,357.00 | 4,206,700 | |
| デジタルアーツ | 5,700 | 2,686.00 | 15,310,200 | |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 21,200 | 2,158.00 | 45,749,600 | |
| 総合警備保障 | 48,900 | 4,550.00 | 222,495,000 | |
| キューブシステム | 5,800 | 691.00 | 4,007,800 | |
| いちご | 120,700 | 459.00 | 55,401,300 | |
| 日本駐車場開発 | 153,400 | 166.00 | 25,464,400 | |
| コア | 5,400 | 1,245.00 | 6,723,000 | |
| カカクコム | 96,000 | 1,966.00 | 188,736,000 | |
| アイロムグループ | 3,900 | 1,396.00 | 5,444,400 | |
| ルネサンス | 7,000 | 1,526.00 | 10,682,000 | |
| ディップ | 17,400 | 2,465.00 | 42,891,000 | |
| S B S ホールディングス | 12,800 | 821.00 | 10,508,800 | |
| オプトホールディング | 9,300 | 739.00 | 6,872,700 | |
| 新日本科学 | 13,900 | 616.00 | 8,562,400 | |
| ツクイ | 32,000 | 787.00 | 25,184,000 | |
| キャリアデザインセンター | 2,900 | 1,346.00 | 3,903,400 | |
| エムスリー | 116,500 | 3,150.00 | 366,975,000 | |
| ツカダ・グローバルホールディング | 9,900 | 674.00 | 6,672,600 | |
| アウトソーシング | 7,700 | 3,750.00 | 28,875,000 | |
| ウェルネット | 10,200 | 1,370.00 | 13,974,000 | |
| ワールドホールディングス | 3,100 | 2,099.00 | 6,506,900 | |
| ディー・エヌ・エー | 60,300 | 2,707.00 | 163,232,100 | |
| 博報堂D Yホールディングス | 186,400 | 1,474.00 | 274,753,600 | |
| ぐるなび | 19,500 | 2,391.00 | 46,624,500 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|--|
| エスアールジータカミヤ | 14,700 | 625.00 | 9,187,500 | |
| ジャパンベストレスキューシステム | 17,300 | 247.00 | 4,273,100 | |
| ファンコミュニケーションズ | 34,200 | 752.00 | 25,718,400 | |
| ライク | 2,900 | 2,090.00 | 6,061,000 | |
| WDBホールディングス | 4,900 | 1,346.00 | 6,595,400 | |
| ティア | 6,800 | 647.00 | 4,399,600 | |
| パリュコマース | 12,900 | 338.00 | 4,360,200 | |
| インフォマート | 57,200 | 687.00 | 39,296,400 | |
| サッポロホールディングス | 47,300 | 3,035.00 | 143,555,500 | |
| アサヒグループホールディングス | 270,600 | 3,763.00 | 1,018,267,800 | |
| 麒麟ホールディングス | 620,900 | 1,937.00 | 1,202,683,300 | |
| 宝ホールディングス | 104,500 | 1,071.00 | 111,919,500 | |
| オエノンホールディングス | 38,000 | 274.00 | 10,412,000 | |
| 養命酒製造 | 4,600 | 1,881.00 | 8,652,600 | |
| コカ・コーラウエスト | 48,900 | 3,355.00 | 164,059,500 | |
| コカ・コーライーストジャパン | 56,200 | 2,503.00 | 140,668,600 | |
| サントリー食品インターナショナル | 98,800 | 4,860.00 | 480,168,000 | |
| ダイドードリンコ | 6,700 | 6,120.00 | 41,004,000 | |
| 伊藤園 | 42,800 | 3,875.00 | 165,850,000 | |
| キーコーヒー | 12,800 | 2,237.00 | 28,633,600 | |
| ユニカフェ | 4,200 | 980.00 | 4,116,000 | |
| ジャパンフーズ | 2,100 | 1,266.00 | 2,658,600 | |
| 日清オイリオグループ | 83,000 | 564.00 | 46,812,000 | |
| 不二製油グループ本社 | 38,500 | 2,380.00 | 91,630,000 | |
| J - オイルミルズ | 6,700 | 4,020.00 | 26,934,000 | |
| ローソン | 44,100 | 8,200.00 | 361,620,000 | |
| サンエー | 9,600 | 5,500.00 | 52,800,000 | |
| カワチ薬品 | 9,800 | 3,040.00 | 29,792,000 | |
| エービーシー・マート | 23,100 | 6,600.00 | 152,460,000 | |
| ハードオフコーポレーション | 5,700 | 1,209.00 | 6,891,300 | |
| 高千穂交易 | 5,200 | 1,021.00 | 5,309,200 | |
| アスクル | 15,500 | 3,910.00 | 60,605,000 | |
| ゲオホールディングス | 21,200 | 1,376.00 | 29,171,200 | |
| アダストリア | 19,500 | 3,165.00 | 61,717,500 | |
| ジーフット | 7,700 | 843.00 | 6,491,100 | |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 1,900 | 730.00 | 1,387,000 | |
| 伊藤忠食品 | 3,200 | 4,420.00 | 14,144,000 | |
| くらコーポレーション | 8,300 | 4,855.00 | 40,296,500 | |
| キャンドウ | 6,700 | 1,735.00 | 11,624,500 | |
| エレマテック | 5,100 | 2,012.00 | 10,261,200 | |
| パルグループホールディングス | 6,500 | 3,055.00 | 19,857,500 | |
| JALUX | 4,100 | 2,099.00 | 8,605,900 | |
| エディオン | 49,200 | 1,123.00 | 55,251,600 | |
| あらた | 5,700 | 2,746.00 | 15,652,200 | |
| サーラコーポレーション | 16,000 | 647.00 | 10,352,000 | |
| ワッツ | 5,600 | 1,117.00 | 6,255,200 | |
| トーメンデバイス | 1,900 | 2,090.00 | 3,971,000 | |
| ハローズ | 4,200 | 2,388.00 | 10,029,600 | |
| J Pホールディングス | 38,800 | 272.00 | 10,553,600 | |
| あみやき亭 | 2,500 | 3,990.00 | 9,975,000 | |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|--|
| 東京エレクトロン デバイス | 4,700 | 1,606.00 | 7,548,200 | |
| ひらまつ | 17,600 | 677.00 | 11,915,200 | |
| フィールズ | 9,700 | 1,393.00 | 13,512,100 | |
| 双日 | 749,600 | 296.00 | 221,881,600 | |
| ゲンキー | 2,500 | 5,900.00 | 14,750,000 | |
| アルフレッサ ホールディングス | 150,300 | 1,946.00 | 292,483,800 | |
| 大黒天物産 | 3,000 | 5,120.00 | 15,360,000 | |
| ハニーズ | 11,200 | 1,155.00 | 12,936,000 | |
| ファーマライズホールディングス | 3,100 | 531.00 | 1,646,100 | |
| キッコーマン | 101,000 | 3,710.00 | 374,710,000 | |
| 味の素 | 297,100 | 2,327.00 | 691,351,700 | |
| キュービー | 73,400 | 2,795.00 | 205,153,000 | |
| ハウス食品グループ本社 | 53,400 | 2,433.00 | 129,922,200 | |
| カゴメ | 51,800 | 2,942.00 | 152,395,600 | |
| 焼津水産化学工業 | 7,100 | 1,164.00 | 8,264,400 | |
| アリアケジャパン | 11,800 | 6,140.00 | 72,452,000 | |
| ピエトロ | 1,700 | 1,645.00 | 2,796,500 | |
| エバラ食品工業 | 3,600 | 2,075.00 | 7,470,000 | |
| ニチレイ | 71,000 | 2,406.00 | 170,826,000 | |
| 横浜冷凍 | 31,600 | 1,033.00 | 32,642,800 | |
| 東洋水産 | 70,900 | 4,130.00 | 292,817,000 | |
| イトアンド | 1,800 | 2,188.00 | 3,938,400 | |
| 日清食品ホールディングス | 56,300 | 6,130.00 | 345,119,000 | |
| 永谷園ホールディングス | 7,000 | 1,424.00 | 9,968,000 | |
| 一正蒲鉾 | 5,100 | 1,144.00 | 5,834,400 | |
| フジッコ | 14,000 | 2,403.00 | 33,642,000 | |
| ロック・フィールド | 15,100 | 1,552.00 | 23,435,200 | |
| 日本たばこ産業 | 799,100 | 3,861.00 | 3,085,325,100 | |
| ケンコーマヨネーズ | 5,000 | 3,190.00 | 15,950,000 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 8,500 | 2,431.00 | 20,663,500 | |
| なとり | 7,300 | 1,927.00 | 14,067,100 | |
| 北の達人コーポレーション | 3,100 | 515.00 | 1,596,500 | |
| ユーグレナ | 46,400 | 1,281.00 | 59,438,400 | |
| 片倉工業 | 16,900 | 1,373.00 | 23,203,700 | |
| グンゼ | 101,000 | 404.00 | 40,804,000 | |
| ヒューリック | 264,800 | 1,059.00 | 280,423,200 | |
| 神栄 | 18,000 | 185.00 | 3,330,000 | |
| 山下医科器械 | 1,100 | 1,782.00 | 1,960,200 | |
| ラサ商事 | 5,800 | 624.00 | 3,619,200 | |
| アルペン | 11,300 | 2,080.00 | 23,504,000 | |
| ラクーン | 5,600 | 480.00 | 2,688,000 | |
| クオール | 14,400 | 1,492.00 | 21,484,800 | |
| アルコニックス | 7,300 | 1,708.00 | 12,468,400 | |
| 神戸物産 | 6,900 | 4,110.00 | 28,359,000 | |
| ジェイアイエヌ | 8,600 | 5,860.00 | 50,396,000 | |
| ビックカメラ | 72,900 | 1,086.00 | 79,169,400 | |
| DCMホールディングス | 77,000 | 1,061.00 | 81,697,000 | |
| MonotaRO | 45,000 | 2,609.00 | 117,405,000 | |
| 東京一番フーズ | 2,400 | 561.00 | 1,346,400 | |
| ダイヤモンドダイニング | 2,900 | 1,312.00 | 3,804,800 | |

| | | | | |
|---------------------|---------|----------|-------------|--|
| あい ホールディングス | 22,600 | 2,358.00 | 53,290,800 | |
| ディービーエックス | 4,600 | 1,324.00 | 6,090,400 | |
| きちり | 3,900 | 672.00 | 2,620,800 | |
| アークランドサービスホールディングス | 4,000 | 2,922.00 | 11,688,000 | |
| J．フロント リテイリング | 160,700 | 1,714.00 | 275,439,800 | |
| ドトール・日レスホールディングス | 22,200 | 2,208.00 | 49,017,600 | |
| マツモトキヨシホールディングス | 24,000 | 5,800.00 | 139,200,000 | |
| ブロンコピリー | 6,600 | 2,917.00 | 19,252,200 | |
| スタートトゥデイ | 116,000 | 2,010.00 | 233,160,000 | |
| トレジャー・ファクトリー | 3,700 | 913.00 | 3,378,100 | |
| 物語コーポレーション | 3,400 | 4,230.00 | 14,382,000 | |
| ココカラファイン | 13,200 | 4,500.00 | 59,400,000 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 252,600 | 1,336.00 | 337,473,600 | |
| 東洋紡 | 533,000 | 181.00 | 96,473,000 | |
| ユニチカ | 370,000 | 87.00 | 32,190,000 | |
| 富士紡ホールディングス | 6,600 | 3,505.00 | 23,133,000 | |
| 日清紡ホールディングス | 71,400 | 1,154.00 | 82,395,600 | |
| 倉敷紡績 | 136,000 | 240.00 | 32,640,000 | |
| ダイワボウホールディングス | 108,000 | 289.00 | 31,212,000 | |
| シキボウ | 73,000 | 153.00 | 11,169,000 | |
| 日東紡績 | 109,000 | 468.00 | 51,012,000 | |
| トヨタ紡織 | 45,000 | 2,632.00 | 118,440,000 | |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 23,500 | 1,569.00 | 36,871,500 | |
| H a m e e | 1,900 | 935.00 | 1,776,500 | |
| ウエルシアホールディングス | 12,600 | 7,170.00 | 90,342,000 | |
| クリエイトSDホールディングス | 18,700 | 2,576.00 | 48,171,200 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 23,300 | 1,012.00 | 23,579,600 | |
| 八洲電機 | 10,100 | 632.00 | 6,383,200 | |
| U K Cホールディングス | 8,200 | 2,235.00 | 18,327,000 | |
| 丸善C H Iホールディングス | 15,300 | 373.00 | 5,706,900 | |
| O C H Iホールディングス | 3,300 | 1,280.00 | 4,224,000 | |
| T O K A Iホールディングス | 55,900 | 807.00 | 45,111,300 | |
| ミサワ | 1,800 | 527.00 | 948,600 | |
| エー・ピーカンパニー | 2,300 | 817.00 | 1,879,100 | |
| 三洋貿易 | 7,000 | 1,616.00 | 11,312,000 | |
| チムニー | 3,400 | 2,890.00 | 9,826,000 | |
| シュッピン | 4,900 | 1,437.00 | 7,041,300 | |
| ビューティガレージ | 1,200 | 1,118.00 | 1,341,600 | |
| ウイン・パートナーズ | 9,400 | 1,000.00 | 9,400,000 | |
| ネクステージ | 2,200 | 1,929.00 | 4,243,800 | |
| ジョイフル本田 | 20,600 | 3,170.00 | 65,302,000 | |
| 鳥貴族 | 3,200 | 2,655.00 | 8,496,000 | |
| 麒麟堂ホールディングス | 4,100 | 870.00 | 3,567,000 | |
| ホットランド | 4,900 | 1,142.00 | 5,595,800 | |
| すかいらく | 54,500 | 1,586.00 | 86,437,000 | |
| 綿半ホールディングス | 5,100 | 1,682.00 | 8,578,200 | |
| 日本毛織 | 37,900 | 861.00 | 32,631,900 | |
| ダイトウボウ | 20,000 | 72.00 | 1,440,000 | |

| | | | | |
|---------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| トーア紡コーポレーション | 5,800 | 551.00 | 3,195,800 | |
| ダイドーリミテッド | 15,500 | 419.00 | 6,494,500 | |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 42,000 | 1,013.00 | 42,546,000 | |
| 三栄建築設計 | 5,100 | 1,759.00 | 8,970,900 | |
| 野村不動産ホールディングス | 84,200 | 1,978.00 | 166,547,600 | |
| 三重交通グループホールディングス | 22,700 | 398.00 | 9,034,600 | |
| サムティ | 10,100 | 1,162.00 | 11,736,200 | |
| ディア・ライフ | 8,800 | 390.00 | 3,432,000 | |
| エー・ディー・ワークス | 118,500 | 46.00 | 5,451,000 | |
| 日本商業開発 | 7,100 | 2,026.00 | 14,384,600 | |
| プレサンスコーポレーション | 19,800 | 1,432.00 | 28,353,600 | |
| ユニゾホールディングス | 10,500 | 3,175.00 | 33,337,500 | |
| THEグローバル社 | 4,900 | 461.00 | 2,258,900 | |
| 日本管理センター | 9,200 | 1,357.00 | 12,484,400 | |
| サンセイランディック | 2,700 | 728.00 | 1,965,600 | |
| エストラスト | 2,400 | 692.00 | 1,660,800 | |
| フージャースホールディングス | 16,500 | 628.00 | 10,362,000 | |
| オープンハウス | 18,400 | 2,821.00 | 51,906,400 | |
| 東急不動産ホールディングス | 307,100 | 700.00 | 214,970,000 | |
| 飯田グループホールディングス | 105,900 | 2,288.00 | 242,299,200 | |
| ムゲンエステート | 4,000 | 764.00 | 3,056,000 | |
| 帝国繊維 | 14,100 | 1,574.00 | 22,193,400 | |
| ブックオフコーポレーション | 7,600 | 820.00 | 6,232,000 | |
| 日本コークス工業 | 109,500 | 108.00 | 11,826,000 | |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 3,900 | 941.00 | 3,669,900 | |
| ミタチ産業 | 3,300 | 623.00 | 2,055,900 | |
| B E E N O S | 1,500 | 1,596.00 | 2,394,000 | |
| あさひ | 9,500 | 1,330.00 | 12,635,000 | |
| 日本調剤 | 4,500 | 4,555.00 | 20,497,500 | |
| コスモス薬品 | 6,400 | 22,660.00 | 145,024,000 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 24,400 | 3,015.00 | 73,566,000 | |
| トーエル | 6,200 | 978.00 | 6,063,600 | |
| 一六堂 | 3,600 | 398.00 | 1,432,800 | |
| ソフトクリエイイトホールディングス | 6,200 | 1,352.00 | 8,382,400 | |
| セブン&アイ・ホールディングス | 531,500 | 4,548.00 | 2,417,262,000 | |
| 薬王堂 | 6,400 | 2,265.00 | 14,496,000 | |
| クリエイイト・レストランツ・ホールディングス | 34,100 | 1,054.00 | 35,941,400 | |
| 明治電機工業 | 4,300 | 1,219.00 | 5,241,700 | |
| ツルハホールディングス | 29,300 | 11,380.00 | 333,434,000 | |
| デリカフーズ | 3,000 | 1,004.00 | 3,012,000 | |
| スターティア | 2,600 | 534.00 | 1,388,400 | |
| サンマルクホールディングス | 8,200 | 3,545.00 | 29,069,000 | |
| フェリシモ | 3,700 | 1,008.00 | 3,729,600 | |
| トリドールホールディングス | 15,600 | 2,531.00 | 39,483,600 | |
| 帝人 | 110,100 | 2,436.00 | 268,203,600 | |
| 東レ | 978,000 | 981.10 | 959,515,800 | |
| クラレ | 226,800 | 1,793.00 | 406,652,400 | |
| 旭化成 | 841,000 | 1,049.00 | 882,209,000 | |

| | | | | |
|-------------------------|---------|----------|-------------|--|
| サカイオーベックス | 3,300 | 1,852.00 | 6,111,600 | |
| 稲葉製作所 | 7,300 | 1,376.00 | 10,044,800 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 39,000 | 199.00 | 7,761,000 | |
| トーカロ | 8,900 | 2,564.00 | 22,819,600 | |
| アルファ | 4,600 | 1,122.00 | 5,161,200 | |
| SUMCO | 140,700 | 1,532.00 | 215,552,400 | |
| 川田テクノロジーズ | 2,500 | 8,400.00 | 21,000,000 | |
| ファーストブラザーズ | 1,400 | 1,848.00 | 2,587,200 | |
| シーアールイー | 1,900 | 1,538.00 | 2,922,200 | |
| 住江織物 | 34,000 | 254.00 | 8,636,000 | |
| 日本フェルト | 7,900 | 512.00 | 4,044,800 | |
| イチカワ | 9,000 | 302.00 | 2,718,000 | |
| エコナックホールディングス | 44,000 | 58.00 | 2,552,000 | |
| 日東製網 | 1,500 | 2,192.00 | 3,288,000 | |
| 芦森工業 | 30,000 | 164.00 | 4,920,000 | |
| アツギ | 110,000 | 128.00 | 14,080,000 | |
| コメダホールディングス | 17,200 | 1,879.00 | 32,318,800 | |
| サツドラホールディングス | 1,700 | 2,023.00 | 3,439,100 | |
| ダイユー・リックホールディングス | 4,200 | 799.00 | 3,355,800 | |
| パロックジャパンリミテッド | 7,400 | 1,350.00 | 9,990,000 | |
| クスリのアオキホールディングス | 11,300 | 5,220.00 | 58,986,000 | |
| ダイニック | 27,000 | 188.00 | 5,076,000 | |
| 共和レザー | 7,900 | 905.00 | 7,149,500 | |
| セーレン | 33,600 | 1,455.00 | 48,888,000 | |
| ソトー | 5,200 | 1,179.00 | 6,130,800 | |
| 東海染工 | 19,000 | 149.00 | 2,831,000 | |
| 小松精練 | 19,100 | 754.00 | 14,401,400 | |
| ワコールホールディングス | 80,000 | 1,378.00 | 110,240,000 | |
| ホギメディカル | 8,500 | 7,470.00 | 63,495,000 | |
| レナウン | 36,600 | 115.00 | 4,209,000 | |
| クラウドディア | 3,600 | 560.00 | 2,016,000 | |
| T S Iホールディングス | 55,300 | 727.00 | 40,203,100 | |
| T I S | 42,100 | 2,516.00 | 105,923,600 | |
| ネオス | 4,200 | 446.00 | 1,873,200 | |
| 電算システム | 4,500 | 1,732.00 | 7,794,000 | |
| グリー | 77,400 | 630.00 | 48,762,000 | |
| コーエーテクモホールディングス | 30,100 | 2,012.00 | 60,561,200 | |
| 三菱総合研究所 | 5,000 | 3,255.00 | 16,275,000 | |
| ボルテージ | 2,600 | 1,060.00 | 2,756,000 | |
| 電算 | 1,500 | 2,400.00 | 3,600,000 | |
| A G S | 2,600 | 1,452.00 | 3,775,200 | |
| ファインデックス | 9,200 | 984.00 | 9,052,800 | |
| ヒト・コミュニケーションズ | 2,900 | 1,697.00 | 4,921,300 | |
| ブレインパッド | 2,000 | 1,391.00 | 2,782,000 | |
| K L a b | 24,300 | 663.00 | 16,110,900 | |
| ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 8,900 | 1,054.00 | 9,380,600 | |
| イーブクイニシアティブジャパン | 2,100 | 907.00 | 1,904,700 | |
| ネクソン | 139,700 | 1,733.00 | 242,100,100 | |
| アイスタイル | 19,400 | 856.00 | 16,606,400 | |

| | | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|--|
| エムアップ | 3,700 | 650.00 | 2,405,000 | |
| エイチーム | 7,000 | 2,296.00 | 16,072,000 | |
| テクノスジャパン | 9,800 | 1,340.00 | 13,132,000 | |
| e n i s h | 4,000 | 549.00 | 2,196,000 | |
| コロプラ | 35,300 | 1,010.00 | 35,653,000 | |
| モバイルクリエイト | 8,600 | 386.00 | 3,319,600 | |
| オルトプラス | 5,300 | 767.00 | 4,065,100 | |
| ブロードリーフ | 31,400 | 644.00 | 20,221,600 | |
| ハーツユナイテッドグループ | 6,700 | 1,717.00 | 11,503,900 | |
| メディアドゥ | 2,800 | 1,426.00 | 3,992,800 | |
| ブイキューブ | 7,100 | 678.00 | 4,813,800 | |
| サイバーリンクス | 2,000 | 1,050.00 | 2,100,000 | |
| ディー・エル・イー | 3,800 | 777.00 | 2,952,600 | |
| フィックスターズ | 1,800 | 3,720.00 | 6,696,000 | |
| VOYAGE GROUP | 4,500 | 1,123.00 | 5,053,500 | |
| オブティム | 1,100 | 5,740.00 | 6,314,000 | |
| 特種東海製紙 | 7,900 | 3,995.00 | 31,560,500 | |
| ペリサーブ | 1,500 | 3,150.00 | 4,725,000 | |
| ティーガイア | 12,700 | 1,883.00 | 23,914,100 | |
| 日本アジアグループ | 14,500 | 450.00 | 6,525,000 | |
| 豆蔵ホールディングス | 9,500 | 1,011.00 | 9,604,500 | |
| テクマトリックス | 4,000 | 2,052.00 | 8,208,000 | |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 266,300 | 250.00 | 66,575,000 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 10,400 | 5,240.00 | 54,496,000 | |
| ザップラス | 7,800 | 433.00 | 3,377,400 | |
| インターネットイニシアティブ | 18,700 | 1,795.00 | 33,566,500 | |
| さくらインターネット | 8,800 | 997.00 | 8,773,600 | |
| GMOクラウド | 2,900 | 1,367.00 | 3,964,300 | |
| SRAホールディングス | 6,700 | 2,619.00 | 17,547,300 | |
| MINORIソリューションズ | 2,700 | 1,107.00 | 2,988,900 | |
| システムインテグレータ | 2,000 | 645.00 | 1,290,000 | |
| 朝日ネット | 12,100 | 505.00 | 6,110,500 | |
| アドソル日進 | 2,600 | 1,204.00 | 3,130,400 | |
| フリービット | 7,200 | 881.00 | 6,343,200 | |
| コムチュア | 2,200 | 3,465.00 | 7,623,000 | |
| サイバーコム | 1,600 | 969.00 | 1,550,400 | |
| 王子ホールディングス | 527,000 | 506.00 | 266,662,000 | |
| 日本製紙 | 60,400 | 2,115.00 | 127,746,000 | |
| 三菱製紙 | 19,400 | 810.00 | 15,714,000 | |
| 北越紀州製紙 | 75,500 | 700.00 | 52,850,000 | |
| 中越パルプ工業 | 54,000 | 247.00 | 13,338,000 | |
| 巴川製紙所 | 22,000 | 228.00 | 5,016,000 | |
| 大王製紙 | 53,800 | 1,309.00 | 70,424,200 | |
| メディカル・データ・ビジョン | 2,100 | 2,593.00 | 5,445,300 | |
| g u m i | 13,200 | 905.00 | 11,946,000 | |
| PCIホールディングス | 1,500 | 2,649.00 | 3,973,500 | |
| パイプドHD | 1,800 | 1,104.00 | 1,987,200 | |
| L I N E | 21,200 | 4,050.00 | 85,860,000 | |
| レンゴー | 130,100 | 666.00 | 86,646,600 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|--|
| トーモク | 43,000 | 337.00 | 14,491,000 | |
| ザ・バック | 9,600 | 2,766.00 | 26,553,600 | |
| AOI TYO HOLDINGS | 10,734 | 849.00 | 9,113,166 | |
| 昭和電工 | 89,700 | 1,768.00 | 158,589,600 | |
| 住友化学 | 992,000 | 570.00 | 565,440,000 | |
| 住友精化 | 5,600 | 4,550.00 | 25,480,000 | |
| 日産化学工業 | 73,800 | 4,005.00 | 295,569,000 | |
| ラサ工業 | 52,000 | 140.00 | 7,280,000 | |
| クレハ | 10,200 | 4,645.00 | 47,379,000 | |
| 多木化学 | 8,000 | 807.00 | 6,456,000 | |
| テイカ | 21,000 | 693.00 | 14,553,000 | |
| 石原産業 | 24,200 | 960.00 | 23,232,000 | |
| 片倉コープアグリ | 17,000 | 235.00 | 3,995,000 | |
| 日東エフシー | 8,000 | 937.00 | 7,496,000 | |
| 日本曹達 | 81,000 | 563.00 | 45,603,000 | |
| 東ソー | 390,000 | 823.00 | 320,970,000 | |
| トクヤマ | 210,000 | 451.00 | 94,710,000 | |
| セントラル硝子 | 137,000 | 548.00 | 75,076,000 | |
| 東亜合成 | 84,200 | 1,186.00 | 99,861,200 | |
| 大阪ソーダ | 58,000 | 482.00 | 27,956,000 | |
| 関東電化工業 | 28,000 | 1,068.00 | 29,904,000 | |
| デンカ | 279,000 | 535.00 | 149,265,000 | |
| イビデン | 90,000 | 1,636.00 | 147,240,000 | |
| 信越化学工業 | 241,700 | 9,448.00 | 2,283,581,600 | |
| 日本カーバイド工業 | 46,000 | 157.00 | 7,222,000 | |
| 堺化学工業 | 50,000 | 403.00 | 20,150,000 | |
| エア・ウォーター | 111,100 | 2,159.00 | 239,864,900 | |
| 大陽日酸 | 103,900 | 1,358.00 | 141,096,200 | |
| 日本化学工業 | 50,000 | 244.00 | 12,200,000 | |
| 日本パーカライジング | 68,800 | 1,396.00 | 96,044,800 | |
| 高圧ガス工業 | 20,000 | 771.00 | 15,420,000 | |
| チタン工業 | 17,000 | 199.00 | 3,383,000 | |
| 四国化成工業 | 19,000 | 1,092.00 | 20,748,000 | |
| 戸田工業 | 27,000 | 289.00 | 7,803,000 | |
| ステラ ケミファ | 6,400 | 3,290.00 | 21,056,000 | |
| 保土谷化学工業 | 4,700 | 2,760.00 | 12,972,000 | |
| 日本触媒 | 21,200 | 7,610.00 | 161,332,000 | |
| 大日精化工業 | 56,000 | 669.00 | 37,464,000 | |
| カネカ | 182,000 | 983.00 | 178,906,000 | |
| 協和発酵キリン | 161,300 | 1,655.00 | 266,951,500 | |
| 三菱瓦斯化学 | 125,500 | 2,056.00 | 258,028,000 | |
| 三井化学 | 612,000 | 541.00 | 331,092,000 | |
| J S R | 135,400 | 1,962.00 | 265,654,800 | |
| 東京応化工業 | 25,200 | 3,920.00 | 98,784,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 8,900 | 1,012.00 | 9,006,800 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 908,060 | 786.00 | 713,735,160 | |
| K H ネオケム | 16,500 | 1,240.00 | 20,460,000 | |
| ダイセル | 181,800 | 1,301.00 | 236,521,800 | |
| 住友ベークライト | 119,000 | 665.00 | 79,135,000 | |
| 積水化学工業 | 305,900 | 1,894.00 | 579,374,600 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|--|
| 日本ゼオン | 114,000 | 1,188.00 | 135,432,000 | |
| アイカ工業 | 43,200 | 3,085.00 | 133,272,000 | |
| 宇部興産 | 679,000 | 261.00 | 177,219,000 | |
| 積水樹脂 | 20,800 | 1,859.00 | 38,667,200 | |
| タキロン | 28,000 | 531.00 | 14,868,000 | |
| 旭有機材 | 43,000 | 228.00 | 9,804,000 | |
| 日立化成 | 74,900 | 2,977.00 | 222,977,300 | |
| ニチバン | 13,000 | 857.00 | 11,141,000 | |
| リケンテクノス | 29,100 | 549.00 | 15,975,900 | |
| 大倉工業 | 32,000 | 512.00 | 16,384,000 | |
| 積水化成成品工業 | 18,200 | 839.00 | 15,269,800 | |
| 群栄化学工業 | 3,200 | 3,415.00 | 10,928,000 | |
| タイガースポリマー | 6,700 | 824.00 | 5,520,800 | |
| ミライアル | 5,000 | 1,015.00 | 5,075,000 | |
| ダイキアクシス | 2,300 | 1,158.00 | 2,663,400 | |
| ダイキョーニシカワ | 23,700 | 1,435.00 | 34,009,500 | |
| 日本化薬 | 87,000 | 1,447.00 | 125,889,000 | |
| カーリットホールディングス | 12,700 | 563.00 | 7,150,100 | |
| E P Sホールディングス | 16,700 | 1,390.00 | 23,213,000 | |
| レグス | 3,000 | 851.00 | 2,553,000 | |
| プレステージ・インターナショナル | 19,200 | 821.00 | 15,763,200 | |
| フェイス | 3,500 | 1,292.00 | 4,522,000 | |
| アミューズ | 7,500 | 1,837.00 | 13,777,500 | |
| 野村総合研究所 | 94,930 | 3,610.00 | 342,697,300 | |
| ドリームインキュベータ | 4,100 | 2,044.00 | 8,380,400 | |
| サイバネットシステム | 10,400 | 674.00 | 7,009,600 | |
| クイック | 7,000 | 1,069.00 | 7,483,000 | |
| T A C | 8,200 | 234.00 | 1,918,800 | |
| C Eホールディングス | 1,800 | 1,138.00 | 2,048,400 | |
| ケネディクス | 180,400 | 442.00 | 79,736,800 | |
| 電通 | 149,800 | 5,700.00 | 853,860,000 | |
| インテージホールディングス | 7,100 | 2,003.00 | 14,221,300 | |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 6,300 | 763.00 | 4,806,900 | |
| 東邦システムサイエンス | 4,300 | 681.00 | 2,928,300 | |
| ぴあ | 4,100 | 2,966.00 | 12,160,600 | |
| イオンファンタジー | 4,000 | 3,340.00 | 13,360,000 | |
| ソースネクスト | 6,800 | 613.00 | 4,168,400 | |
| シーティーエス | 3,800 | 1,390.00 | 5,282,000 | |
| ネクシィーズグループ | 4,900 | 1,431.00 | 7,011,900 | |
| メディカルシステムネットワーク | 14,500 | 446.00 | 6,467,000 | |
| 日本精化 | 11,300 | 924.00 | 10,441,200 | |
| 扶桑化学工業 | 9,600 | 2,398.00 | 23,020,800 | |
| A D E K A | 57,900 | 1,627.00 | 94,203,300 | |
| 日油 | 108,000 | 1,183.00 | 127,764,000 | |
| ミヨシ油脂 | 51,000 | 148.00 | 7,548,000 | |
| 新日本理化 | 21,600 | 164.00 | 3,542,400 | |
| ハリマ化成グループ | 11,600 | 794.00 | 9,210,400 | |
| 花王 | 342,400 | 5,399.00 | 1,848,617,600 | |
| 第一工業製薬 | 30,000 | 392.00 | 11,760,000 | |
| 三洋化成工業 | 8,400 | 5,040.00 | 42,336,000 | |

| | | | | |
|-----------------|-----------|----------|---------------|--|
| 武田薬品工業 | 505,300 | 4,970.00 | 2,511,341,000 | |
| アステラス製薬 | 1,376,900 | 1,670.00 | 2,299,423,000 | |
| 大日本住友製薬 | 95,400 | 2,116.00 | 201,866,400 | |
| 塩野義製薬 | 182,400 | 5,716.00 | 1,042,598,400 | |
| 田辺三菱製薬 | 157,100 | 2,313.00 | 363,372,300 | |
| わかもと製薬 | 7,000 | 250.00 | 1,750,000 | |
| あすか製薬 | 14,700 | 1,817.00 | 26,709,900 | |
| 日本新薬 | 30,900 | 5,980.00 | 184,782,000 | |
| ピオフェルミン製薬 | 2,200 | 3,030.00 | 6,666,000 | |
| 中外製薬 | 134,200 | 3,515.00 | 471,713,000 | |
| 科研製薬 | 25,200 | 6,320.00 | 159,264,000 | |
| エーザイ | 165,900 | 6,799.00 | 1,127,954,100 | |
| 理研ビタミン | 4,300 | 4,550.00 | 19,565,000 | |
| ロート製薬 | 66,000 | 1,898.00 | 125,268,000 | |
| 小野薬品工業 | 306,100 | 2,593.50 | 793,870,350 | |
| 久光製薬 | 38,000 | 6,060.00 | 230,280,000 | |
| 有機合成薬品工業 | 9,400 | 270.00 | 2,538,000 | |
| 持田製薬 | 9,200 | 8,530.00 | 78,476,000 | |
| 参天製薬 | 248,300 | 1,486.00 | 368,973,800 | |
| 扶桑薬品工業 | 4,600 | 2,886.00 | 13,275,600 | |
| 日本ケミファ | 1,800 | 5,540.00 | 9,972,000 | |
| ツムラ | 45,300 | 3,285.00 | 148,810,500 | |
| 日医工 | 31,500 | 1,794.00 | 56,511,000 | |
| テルモ | 197,300 | 4,370.00 | 862,201,000 | |
| みらかホールディングス | 34,300 | 5,350.00 | 183,505,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 23,900 | 2,955.00 | 70,624,500 | |
| 生化学工業 | 25,000 | 1,768.00 | 44,200,000 | |
| 栄研化学 | 11,300 | 2,970.00 | 33,561,000 | |
| 日水製薬 | 5,500 | 1,302.00 | 7,161,000 | |
| 鳥居薬品 | 9,200 | 2,677.00 | 24,628,400 | |
| J C R ファーマ | 10,400 | 2,964.00 | 30,825,600 | |
| 東和薬品 | 6,200 | 4,805.00 | 29,791,000 | |
| 富士製薬工業 | 4,400 | 2,826.00 | 12,434,400 | |
| 沢井製薬 | 22,900 | 6,520.00 | 149,308,000 | |
| ゼリア新薬工業 | 27,600 | 1,823.00 | 50,314,800 | |
| 第一三共 | 396,600 | 2,498.00 | 990,706,800 | |
| キョーリン製薬ホールディングス | 32,900 | 2,655.00 | 87,349,500 | |
| 大幸薬品 | 6,700 | 1,851.00 | 12,401,700 | |
| ダイト | 7,500 | 2,290.00 | 17,175,000 | |
| 大塚ホールディングス | 289,800 | 5,706.00 | 1,653,598,800 | |
| 大正製薬ホールディングス | 28,800 | 9,850.00 | 283,680,000 | |
| ペプチドリーム | 22,900 | 6,190.00 | 141,751,000 | |
| 大日本塗料 | 77,000 | 245.00 | 18,865,000 | |
| 日本ペイントホールディングス | 104,000 | 3,235.00 | 336,440,000 | |
| 関西ペイント | 141,600 | 2,217.00 | 313,927,200 | |
| 神東塗料 | 11,000 | 222.00 | 2,442,000 | |
| 中国塗料 | 38,600 | 870.00 | 33,582,000 | |
| 日本特殊塗料 | 9,500 | 1,741.00 | 16,539,500 | |
| 藤倉化成 | 18,300 | 651.00 | 11,913,300 | |
| 太陽ホールディングス | 11,000 | 4,725.00 | 51,975,000 | |

| | | | | |
|-----------------------|---------|----------|-------------|--|
| D I C | 53,200 | 3,625.00 | 192,850,000 | |
| サカタインクス | 27,500 | 1,463.00 | 40,232,500 | |
| 東洋インキＳＣホールディングス | 133,000 | 553.00 | 73,549,000 | |
| T & K T O K A | 9,800 | 1,060.00 | 10,388,000 | |
| アルプス技研 | 5,400 | 2,597.00 | 14,023,800 | |
| サニックス | 22,000 | 200.00 | 4,400,000 | |
| ダイオーズ | 2,700 | 1,067.00 | 2,880,900 | |
| 日本空調サービス | 12,800 | 627.00 | 8,025,600 | |
| オリエンタルランド | 145,300 | 6,681.00 | 970,749,300 | |
| フォーカスシステムズ | 5,100 | 514.00 | 2,621,400 | |
| ダスキン | 34,400 | 2,408.00 | 82,835,200 | |
| パーク２４ | 64,400 | 3,165.00 | 203,826,000 | |
| 明光ネットワークジャパン | 16,700 | 1,181.00 | 19,722,700 | |
| ファルコホールディングス | 6,400 | 1,507.00 | 9,644,800 | |
| クレスコ | 2,900 | 2,447.00 | 7,096,300 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 132,100 | 1,696.00 | 224,041,600 | |
| 秀英予備校 | 2,900 | 441.00 | 1,278,900 | |
| 田谷 | 2,800 | 646.00 | 1,808,800 | |
| ラウンドワン | 42,000 | 811.00 | 34,062,000 | |
| リゾートトラスト | 52,100 | 2,234.00 | 116,391,400 | |
| オービック | 43,800 | 5,190.00 | 227,322,000 | |
| ジャストシステム | 20,600 | 1,180.00 | 24,308,000 | |
| T D C ソフトウェアエンジニアリング | 5,700 | 1,177.00 | 6,708,900 | |
| ヤフー | 910,900 | 477.00 | 434,499,300 | |
| ビー・エム・エル | 17,600 | 2,814.00 | 49,526,400 | |
| ワタベウェディング | 2,100 | 428.00 | 898,800 | |
| トレンドマイクロ | 67,300 | 4,240.00 | 285,352,000 | |
| りらいあコミュニケーションズ | 22,200 | 1,163.00 | 25,818,600 | |
| インフォメーション・ディベロプメント | 3,750 | 1,198.00 | 4,492,500 | |
| リソー教育 | 22,900 | 618.00 | 14,152,200 | |
| 日本オラクル | 20,400 | 6,120.00 | 124,848,000 | |
| 早稲田アカデミー | 2,000 | 1,042.00 | 2,084,000 | |
| アルファシステムズ | 4,300 | 2,006.00 | 8,625,800 | |
| フューチャー | 16,800 | 773.00 | 12,986,400 | |
| C A C H o l d i n g s | 9,600 | 922.00 | 8,851,200 | |
| ソフトバンク・テクノロジー | 3,000 | 3,620.00 | 10,860,000 | |
| トーセ | 3,600 | 853.00 | 3,070,800 | |
| ユー・エス・エス | 162,700 | 1,921.00 | 312,546,700 | |
| オービックビジネスコンサルタント | 6,500 | 5,200.00 | 33,800,000 | |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 28,800 | 3,055.00 | 87,984,000 | |
| アイティフォー | 16,800 | 630.00 | 10,584,000 | |
| 東京個別指導学院 | 4,400 | 918.00 | 4,039,200 | |
| 東計電算 | 2,300 | 2,140.00 | 4,922,000 | |
| サイバーエージェント | 70,800 | 2,969.00 | 210,205,200 | |
| 楽天 | 686,800 | 1,216.50 | 835,492,200 | |
| エクスネット | 1,300 | 1,896.00 | 2,464,800 | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 4,900 | 901.00 | 4,414,900 | |
| テー・オー・ダブリュー | 10,900 | 668.00 | 7,281,200 | |
| 大塚商会 | 34,200 | 5,450.00 | 186,390,000 | |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|--|
| 総合メディカル | 6,200 | 4,285.00 | 26,567,000 | |
| サイボウズ | 17,200 | 469.00 | 8,066,800 | |
| ソフトブレイン | 17,500 | 430.00 | 7,525,000 | |
| セントラルスポーツ | 4,600 | 2,960.00 | 13,616,000 | |
| パラカ | 3,700 | 2,104.00 | 7,784,800 | |
| 電通国際情報サービス | 7,900 | 1,863.00 | 14,717,700 | |
| デジタルガレージ | 19,900 | 2,062.00 | 41,033,800 | |
| イーエムシステムズ | 4,400 | 1,673.00 | 7,361,200 | |
| ウェザーニューズ | 4,300 | 3,565.00 | 15,329,500 | |
| C I J | 11,900 | 527.00 | 6,271,300 | |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 1,500 | 1,527.00 | 2,290,500 | |
| 日本エンタープライズ | 13,400 | 283.00 | 3,792,200 | |
| WOWOW | 6,100 | 3,400.00 | 20,740,000 | |
| スカラ | 8,000 | 813.00 | 6,504,000 | |
| フルキャストホールディングス | 13,500 | 982.00 | 13,257,000 | |
| 富士フイルムホールディングス | 267,300 | 4,480.00 | 1,197,504,000 | |
| コニカミノルタ | 301,200 | 1,195.00 | 359,934,000 | |
| 資生堂 | 255,700 | 3,110.00 | 795,227,000 | |
| ライオン | 167,000 | 1,901.00 | 317,467,000 | |
| 高砂香料工業 | 8,900 | 3,155.00 | 28,079,500 | |
| マンダム | 13,500 | 5,120.00 | 69,120,000 | |
| ミルボン | 7,300 | 4,455.00 | 32,521,500 | |
| ファンケル | 28,700 | 1,688.00 | 48,445,600 | |
| コーセー | 21,800 | 9,930.00 | 216,474,000 | |
| コタ | 5,000 | 1,304.00 | 6,520,000 | |
| シーズ・ホールディングス | 17,500 | 3,330.00 | 58,275,000 | |
| シーボン | 1,600 | 2,516.00 | 4,025,600 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 13,700 | 10,510.00 | 143,987,000 | |
| ノエビアホールディングス | 8,500 | 3,830.00 | 32,555,000 | |
| アジュバンコスメジャパン | 2,800 | 936.00 | 2,620,800 | |
| エステー | 9,300 | 1,623.00 | 15,093,900 | |
| アグロ カネショウ | 5,300 | 1,209.00 | 6,407,700 | |
| コニシ | 21,200 | 1,310.00 | 27,772,000 | |
| 長谷川香料 | 17,100 | 1,973.00 | 33,738,300 | |
| 星光PMC | 7,400 | 1,193.00 | 8,828,200 | |
| 小林製薬 | 37,400 | 5,110.00 | 191,114,000 | |
| 荒川化学工業 | 11,500 | 1,876.00 | 21,574,000 | |
| メック | 10,500 | 983.00 | 10,321,500 | |
| 日本高純度化学 | 3,900 | 2,509.00 | 9,785,100 | |
| タカラバイオ | 28,900 | 1,595.00 | 46,095,500 | |
| J C U | 4,200 | 5,650.00 | 23,730,000 | |
| 新田ゼラチン | 8,400 | 764.00 | 6,417,600 | |
| O A T アグリオ | 1,600 | 1,366.00 | 2,185,600 | |
| デクセリアルズ | 35,300 | 1,164.00 | 41,089,200 | |
| アース製薬 | 9,700 | 4,795.00 | 46,511,500 | |
| イハラケミカル工業 | 18,700 | 1,122.00 | 20,981,400 | |
| 北興化学工業 | 13,000 | 438.00 | 5,694,000 | |
| 大成ラミック | 3,900 | 3,200.00 | 12,480,000 | |
| クミアイ化学工業 | 27,900 | 711.00 | 19,836,900 | |
| 日本農薬 | 30,800 | 636.00 | 19,588,800 | |

| | | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|--|
| 昭和シェル石油 | 120,400 | 1,120.00 | 134,848,000 | |
| 富士興産 | 4,600 | 460.00 | 2,116,000 | |
| ニチレキ | 16,600 | 954.00 | 15,836,400 | |
| 東燃ゼネラル石油 | 219,000 | 1,266.00 | 277,254,000 | |
| ユシロ化学工業 | 7,300 | 1,476.00 | 10,774,800 | |
| ビーピー・カストロール | 5,500 | 1,419.00 | 7,804,500 | |
| 富士石油 | 31,400 | 385.00 | 12,089,000 | |
| MORESCO | 4,500 | 1,665.00 | 7,492,500 | |
| 出光興産 | 63,900 | 3,185.00 | 203,521,500 | |
| JXホールディングス | 1,494,900 | 510.30 | 762,847,470 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 40,700 | 1,702.00 | 69,271,400 | |
| 横浜ゴム | 81,300 | 2,129.00 | 173,087,700 | |
| 東洋ゴム工業 | 71,200 | 1,493.00 | 106,301,600 | |
| ブリヂストン | 454,800 | 4,207.00 | 1,913,343,600 | |
| 住友ゴム工業 | 126,100 | 1,879.00 | 236,941,900 | |
| 藤倉ゴム工業 | 11,400 | 666.00 | 7,592,400 | |
| オカモト | 41,000 | 1,093.00 | 44,813,000 | |
| アキレス | 11,000 | 1,674.00 | 18,414,000 | |
| フコク | 5,300 | 950.00 | 5,035,000 | |
| ニッタ | 12,100 | 3,155.00 | 38,175,500 | |
| クリエートメディック | 4,400 | 958.00 | 4,215,200 | |
| 住友理工 | 24,900 | 1,131.00 | 28,161,900 | |
| 三ツ星ベルト | 33,000 | 1,034.00 | 34,122,000 | |
| パンドー化学 | 24,500 | 1,050.00 | 25,725,000 | |
| 旭硝子 | 664,000 | 834.00 | 553,776,000 | |
| 日本板硝子 | 61,400 | 900.00 | 55,260,000 | |
| 石塚硝子 | 19,000 | 200.00 | 3,800,000 | |
| 有沢製作所 | 22,700 | 671.00 | 15,231,700 | |
| 日本山村硝子 | 53,000 | 208.00 | 11,024,000 | |
| 日本電気硝子 | 278,000 | 638.00 | 177,364,000 | |
| オハラ | 5,200 | 863.00 | 4,487,600 | |
| 住友大阪セメント | 250,000 | 458.00 | 114,500,000 | |
| 太平洋セメント | 813,000 | 388.00 | 315,444,000 | |
| リソルホールディングス | 14,000 | 347.00 | 4,858,000 | |
| 日本ヒューム | 13,000 | 719.00 | 9,347,000 | |
| 日本コンクリート工業 | 29,500 | 353.00 | 10,413,500 | |
| 三谷セキサン | 6,800 | 3,075.00 | 20,910,000 | |
| アジアパイルホールディングス | 16,700 | 557.00 | 9,301,900 | |
| 東海カーボン | 126,000 | 386.00 | 48,636,000 | |
| 日本カーボン | 66,000 | 282.00 | 18,612,000 | |
| 東洋炭素 | 7,500 | 1,952.00 | 14,640,000 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 7,500 | 2,950.00 | 22,125,000 | |
| TOTO | 99,000 | 4,735.00 | 468,765,000 | |
| 日本碍子 | 170,100 | 2,309.00 | 392,760,900 | |
| 日本特殊陶業 | 116,100 | 2,504.00 | 290,714,400 | |
| ダントーホールディングス | 12,000 | 195.00 | 2,340,000 | |
| MARUWA | 5,000 | 3,690.00 | 18,450,000 | |
| 品川リフラクトリーズ | 34,000 | 263.00 | 8,942,000 | |
| 黒崎播磨 | 29,000 | 329.00 | 9,541,000 | |
| ヨータイ | 8,000 | 357.00 | 2,856,000 | |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|---------------|--|
| イソライト工業 | 6,800 | 300.00 | 2,040,000 | |
| 東京窯業 | 17,000 | 195.00 | 3,315,000 | |
| ニッカトー | 4,800 | 418.00 | 2,006,400 | |
| フジインコーポレーテッド | 11,500 | 2,230.00 | 25,645,000 | |
| エーアンドエーマテリアル | 29,000 | 130.00 | 3,770,000 | |
| ニチアス | 70,000 | 1,150.00 | 80,500,000 | |
| 新日鐵住金 | 607,500 | 2,741.50 | 1,665,461,250 | |
| 神戸製鋼所 | 232,900 | 1,159.00 | 269,931,100 | |
| 中山製鋼所 | 15,100 | 745.00 | 11,249,500 | |
| 合同製鐵 | 7,500 | 2,143.00 | 16,072,500 | |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 368,200 | 1,877.00 | 691,111,400 | |
| 日新製鋼 | 61,400 | 1,544.00 | 94,801,600 | |
| 東京製鐵 | 68,100 | 896.00 | 61,017,600 | |
| 共英製鋼 | 14,300 | 2,272.00 | 32,489,600 | |
| 大和工業 | 27,000 | 3,325.00 | 89,775,000 | |
| 東京鐵鋼 | 28,000 | 477.00 | 13,356,000 | |
| 大阪製鐵 | 8,500 | 2,250.00 | 19,125,000 | |
| 淀川製鋼所 | 18,600 | 3,155.00 | 58,683,000 | |
| 東洋鋼鈑 | 32,200 | 384.00 | 12,364,800 | |
| 丸一鋼管 | 45,100 | 3,890.00 | 175,439,000 | |
| モリ工業 | 4,200 | 2,010.00 | 8,442,000 | |
| 大同特殊鋼 | 226,000 | 501.00 | 113,226,000 | |
| 日本高周波鋼業 | 49,000 | 90.00 | 4,410,000 | |
| 日本冶金工業 | 111,600 | 193.00 | 21,538,800 | |
| 山陽特殊製鋼 | 80,000 | 586.00 | 46,880,000 | |
| 愛知製鋼 | 7,900 | 5,110.00 | 40,369,000 | |
| 日立金属 | 137,100 | 1,608.00 | 220,456,800 | |
| 日本金属 | 3,300 | 1,291.00 | 4,260,300 | |
| 大平洋金属 | 86,000 | 372.00 | 31,992,000 | |
| 新日本電工 | 76,300 | 265.00 | 20,219,500 | |
| 栗本鐵工所 | 6,400 | 2,386.00 | 15,270,400 | |
| 虹 技 | 19,000 | 260.00 | 4,940,000 | |
| 日本鑄鉄管 | 14,000 | 194.00 | 2,716,000 | |
| 日本製鋼所 | 44,500 | 2,150.00 | 95,675,000 | |
| 三菱製鋼 | 93,000 | 236.00 | 21,948,000 | |
| 日亜鋼業 | 18,800 | 276.00 | 5,188,800 | |
| 日本精線 | 9,000 | 594.00 | 5,346,000 | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 22,000 | 512.00 | 11,264,000 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 304,500 | 262.00 | 79,779,000 | |
| 三井金属鉱業 | 366,000 | 301.00 | 110,166,000 | |
| 東邦亜鉛 | 76,000 | 477.00 | 36,252,000 | |
| 三菱マテリアル | 84,000 | 3,750.00 | 315,000,000 | |
| 住友金属鉱山 | 349,000 | 1,594.50 | 556,480,500 | |
| DOWAホールディングス | 149,000 | 920.00 | 137,080,000 | |
| 古河機械金属 | 210,000 | 220.00 | 46,200,000 | |
| エス・サイエンス | 65,100 | 38.00 | 2,473,800 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 14,700 | 1,643.00 | 24,152,100 | |
| 東邦チタニウム | 22,800 | 793.00 | 18,080,400 | |
| UACJ | 171,000 | 329.00 | 56,259,000 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|--|
| 古河電気工業 | 45,200 | 3,510.00 | 158,652,000 | |
| 住友電気工業 | 507,500 | 1,656.00 | 840,420,000 | |
| フジクラ | 177,200 | 671.00 | 118,901,200 | |
| 昭和電線ホールディングス | 162,000 | 91.00 | 14,742,000 | |
| 東京特殊電線 | 2,000 | 1,300.00 | 2,600,000 | |
| タツタ電線 | 25,200 | 471.00 | 11,869,200 | |
| 沖電線 | 15,000 | 240.00 | 3,600,000 | |
| カナレ電気 | 2,000 | 2,162.00 | 4,324,000 | |
| 平河ヒューテック | 6,400 | 1,288.00 | 8,243,200 | |
| リョービ | 82,000 | 479.00 | 39,278,000 | |
| アーレスティ | 15,600 | 1,270.00 | 19,812,000 | |
| アサヒホールディングス | 20,300 | 2,127.00 | 43,178,100 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 95,600 | 2,201.00 | 210,415,600 | |
| ホッカンホールディングス | 35,000 | 469.00 | 16,415,000 | |
| コロナ | 7,100 | 1,175.00 | 8,342,500 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 23,700 | 1,389.00 | 32,919,300 | |
| ＯＳＪＢホールディングス | 44,200 | 259.00 | 11,447,800 | |
| 駒井ハルテック | 2,600 | 2,176.00 | 5,657,600 | |
| 高田機工 | 12,000 | 235.00 | 2,820,000 | |
| 三和ホールディングス | 133,700 | 1,142.00 | 152,685,400 | |
| 文化シャッター | 37,500 | 919.00 | 34,462,500 | |
| 三協立山 | 17,600 | 1,725.00 | 30,360,000 | |
| アルインコ | 9,300 | 1,056.00 | 9,820,800 | |
| 東洋シャッター | 3,600 | 649.00 | 2,336,400 | |
| ＬＩＸＩＬグループ | 187,600 | 2,712.00 | 508,771,200 | |
| 日本ファイルコン | 10,100 | 578.00 | 5,837,800 | |
| ノーリツ | 26,300 | 2,013.00 | 52,941,900 | |
| 長府製作所 | 14,400 | 2,613.00 | 37,627,200 | |
| リンナイ | 22,900 | 9,650.00 | 220,985,000 | |
| ユニプレス | 24,800 | 2,342.00 | 58,081,600 | |
| ダイニチ工業 | 7,200 | 748.00 | 5,385,600 | |
| 日東精工 | 19,500 | 430.00 | 8,385,000 | |
| 三洋工業 | 17,000 | 199.00 | 3,383,000 | |
| 岡部 | 28,000 | 964.00 | 26,992,000 | |
| ジーテクト | 14,100 | 2,162.00 | 30,484,200 | |
| 中国工業 | 2,300 | 707.00 | 1,626,100 | |
| 東ブレ | 25,900 | 2,982.00 | 77,233,800 | |
| 高周波熱錬 | 25,000 | 917.00 | 22,925,000 | |
| 東京製綱 | 9,100 | 1,952.00 | 17,763,200 | |
| サンコール | 7,300 | 560.00 | 4,088,000 | |
| モリテックスチール | 7,200 | 292.00 | 2,102,400 | |
| パイオラックス | 6,800 | 7,700.00 | 52,360,000 | |
| 日本発条 | 126,600 | 1,115.00 | 141,159,000 | |
| 中央発條 | 15,000 | 325.00 | 4,875,000 | |
| アドバネクス | 2,400 | 1,860.00 | 4,464,000 | |
| 三浦工業 | 55,100 | 1,775.00 | 97,802,500 | |
| タクマ | 43,100 | 1,015.00 | 43,746,500 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 21,800 | 3,740.00 | 81,532,000 | |
| インターワークス | 2,600 | 1,141.00 | 2,966,600 | |
| Keepers 技研 | 1,500 | 1,831.00 | 2,746,500 | |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|--|
| ファーストロジック | 800 | 2,218.00 | 1,774,400 | |
| イー・ガーディアン | 4,400 | 1,493.00 | 6,569,200 | |
| リブセンス | 9,300 | 452.00 | 4,203,600 | |
| ジャパンマテリアル | 9,800 | 1,784.00 | 17,483,200 | |
| ベクトル | 11,000 | 1,180.00 | 12,980,000 | |
| ウチヤマホールディングス | 6,300 | 436.00 | 2,746,800 | |
| サクセスホールディングス | 1,100 | 1,245.00 | 1,369,500 | |
| キャリアリンク | 3,100 | 789.00 | 2,445,900 | |
| I B J | 10,600 | 669.00 | 7,091,400 | |
| アサンテ | 5,000 | 1,812.00 | 9,060,000 | |
| N・フィールド | 6,400 | 1,432.00 | 9,164,800 | |
| M & Aキャピタルパートナーズ | 1,700 | 3,185.00 | 5,414,500 | |
| ライドオン・エクスプレス | 3,100 | 904.00 | 2,802,400 | |
| E R Iホールディングス | 3,900 | 790.00 | 3,081,000 | |
| アビスト | 2,100 | 3,755.00 | 7,885,500 | |
| ウィルグループ | 5,600 | 736.00 | 4,121,600 | |
| 日本ビューホテル | 2,000 | 1,500.00 | 3,000,000 | |
| リクルートホールディングス | 293,700 | 4,700.00 | 1,380,390,000 | |
| エラン | 1,700 | 1,296.00 | 2,203,200 | |
| ツガミ | 36,000 | 687.00 | 24,732,000 | |
| オークマ | 88,000 | 1,101.00 | 96,888,000 | |
| 東芝機械 | 80,000 | 477.00 | 38,160,000 | |
| アマダホールディングス | 181,200 | 1,329.00 | 240,814,800 | |
| アイダエンジニアリング | 38,300 | 1,119.00 | 42,857,700 | |
| 滝澤鉄工所 | 41,000 | 164.00 | 6,724,000 | |
| 富士機械製造 | 41,000 | 1,367.00 | 56,047,000 | |
| 牧野フライス製作所 | 67,000 | 926.00 | 62,042,000 | |
| オーエスジー | 61,300 | 2,388.00 | 146,384,400 | |
| ダイジェット工業 | 17,000 | 183.00 | 3,111,000 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 38,600 | 880.00 | 33,968,000 | |
| D M G森精機 | 79,700 | 1,443.00 | 115,007,100 | |
| ソディック | 34,100 | 979.00 | 33,383,900 | |
| ディスコ | 15,700 | 14,340.00 | 225,138,000 | |
| 日東工器 | 7,800 | 2,564.00 | 19,999,200 | |
| パンチ工業 | 5,000 | 907.00 | 4,535,000 | |
| 日本郵政 | 350,600 | 1,487.00 | 521,342,200 | |
| ベルシステム24ホールディングス | 20,500 | 1,022.00 | 20,951,000 | |
| ソラスト | 6,200 | 1,312.00 | 8,134,400 | |
| 豊田自動織機 | 117,100 | 5,670.00 | 663,957,000 | |
| 豊和工業 | 7,900 | 641.00 | 5,063,900 | |
| O K K | 50,000 | 122.00 | 6,100,000 | |
| 石川製作所 | 3,500 | 705.00 | 2,467,500 | |
| 東洋機械金属 | 9,200 | 463.00 | 4,259,600 | |
| 津田駒工業 | 30,000 | 168.00 | 5,040,000 | |
| エンシュウ | 34,000 | 106.00 | 3,604,000 | |
| 島精機製作所 | 17,600 | 3,985.00 | 70,136,000 | |
| N Cホールディングス | 4,400 | 940.00 | 4,136,000 | |
| フリーー | 2,700 | 3,530.00 | 9,531,000 | |
| ヤマシンフィルタ | 2,700 | 1,285.00 | 3,469,500 | |
| 日阪製作所 | 18,000 | 919.00 | 16,542,000 | |

| | | | | |
|--------------|---------|-----------|---------------|--|
| やまびこ | 24,700 | 1,733.00 | 42,805,100 | |
| ペガサスミシン製造 | 13,000 | 729.00 | 9,477,000 | |
| ナブテスコ | 70,000 | 2,800.00 | 196,000,000 | |
| 三井海洋開発 | 13,500 | 1,930.00 | 26,055,000 | |
| レオン自動機 | 11,400 | 900.00 | 10,260,000 | |
| S M C | 40,400 | 29,045.00 | 1,173,418,000 | |
| 新川 | 11,300 | 839.00 | 9,480,700 | |
| ホソカワミクロン | 22,000 | 800.00 | 17,600,000 | |
| ユニオンツール | 5,800 | 3,155.00 | 18,299,000 | |
| オイレス工業 | 17,400 | 2,122.00 | 36,922,800 | |
| 日精エー・エス・ピー機械 | 4,300 | 2,396.00 | 10,302,800 | |
| サトーホールディングス | 16,800 | 2,414.00 | 40,555,200 | |
| 日本エアーテック | 4,400 | 650.00 | 2,860,000 | |
| 日精樹脂工業 | 10,400 | 1,081.00 | 11,242,400 | |
| オカダアイヨン | 2,900 | 1,110.00 | 3,219,000 | |
| ワイエイシイ | 5,100 | 1,299.00 | 6,624,900 | |
| 小松製作所 | 621,300 | 2,653.50 | 1,648,619,550 | |
| 住友重機械工業 | 393,000 | 781.00 | 306,933,000 | |
| 日立建機 | 60,100 | 2,552.00 | 153,375,200 | |
| 日工 | 4,000 | 2,211.00 | 8,844,000 | |
| 巴工業 | 5,500 | 1,808.00 | 9,944,000 | |
| 井関農機 | 138,000 | 235.00 | 32,430,000 | |
| T O W A | 11,000 | 1,614.00 | 17,754,000 | |
| 丸山製作所 | 29,000 | 192.00 | 5,568,000 | |
| 北川鉄工所 | 6,200 | 2,459.00 | 15,245,800 | |
| シンニッタン | 11,200 | 681.00 | 7,627,200 | |
| ローツェ | 4,800 | 1,890.00 | 9,072,000 | |
| タカキタ | 3,600 | 573.00 | 2,062,800 | |
| クボタ | 646,600 | 1,700.00 | 1,099,220,000 | |
| 荏原実業 | 3,800 | 1,346.00 | 5,114,800 | |
| 東洋エンジニアリング | 85,000 | 310.00 | 26,350,000 | |
| 三菱化工機 | 45,000 | 222.00 | 9,990,000 | |
| 月島機械 | 25,500 | 1,245.00 | 31,747,500 | |
| 帝国電機製作所 | 9,800 | 1,045.00 | 10,241,000 | |
| 東京機械製作所 | 52,000 | 81.00 | 4,212,000 | |
| 新東工業 | 30,500 | 1,033.00 | 31,506,500 | |
| 澁谷工業 | 11,200 | 2,423.00 | 27,137,600 | |
| アイチコーポレーション | 19,100 | 846.00 | 16,158,600 | |
| 小森コーポレーション | 32,300 | 1,517.00 | 48,999,100 | |
| 鶴見製作所 | 10,000 | 1,763.00 | 17,630,000 | |
| 住友精密工業 | 22,000 | 368.00 | 8,096,000 | |
| 酒井重工業 | 26,000 | 356.00 | 9,256,000 | |
| 荏原製作所 | 59,200 | 3,355.00 | 198,616,000 | |
| 石井鐵工所 | 2,000 | 1,887.00 | 3,774,000 | |
| 西島製作所 | 13,200 | 1,192.00 | 15,734,400 | |
| 北越工業 | 14,600 | 806.00 | 11,767,600 | |
| 千代田化工建設 | 104,000 | 826.00 | 85,904,000 | |
| ダイキン工業 | 175,700 | 11,110.00 | 1,952,027,000 | |
| オルガノ | 25,000 | 487.00 | 12,175,000 | |
| トーヨーカネツ | 62,000 | 330.00 | 20,460,000 | |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|--|
| 栗田工業 | 76,100 | 2,624.00 | 199,686,400 | |
| 椿本チエイン | 76,000 | 952.00 | 72,352,000 | |
| 大同工業 | 27,000 | 264.00 | 7,128,000 | |
| 日機装 | 44,500 | 1,081.00 | 48,104,500 | |
| 木村化工機 | 11,800 | 344.00 | 4,059,200 | |
| 新興プランテック | 29,600 | 847.00 | 25,071,200 | |
| アネスト岩田 | 23,400 | 1,180.00 | 27,612,000 | |
| ダイフク | 64,200 | 2,450.00 | 157,290,000 | |
| サムコ | 3,400 | 1,110.00 | 3,774,000 | |
| 加藤製作所 | 7,100 | 3,055.00 | 21,690,500 | |
| 油研工業 | 25,000 | 226.00 | 5,650,000 | |
| タダノ | 67,300 | 1,469.00 | 98,863,700 | |
| フジテック | 37,400 | 1,385.00 | 51,799,000 | |
| C K D | 38,500 | 1,468.00 | 56,518,000 | |
| キトー | 16,200 | 1,288.00 | 20,865,600 | |
| 平和 | 39,800 | 2,747.00 | 109,330,600 | |
| 理想科学工業 | 12,800 | 2,025.00 | 25,920,000 | |
| S A N K Y O | 35,700 | 3,855.00 | 137,623,500 | |
| 日本金銭機械 | 11,900 | 1,537.00 | 18,290,300 | |
| マースエンジニアリング | 7,300 | 2,250.00 | 16,425,000 | |
| 福島工業 | 8,000 | 3,675.00 | 29,400,000 | |
| オーイズミ | 5,500 | 732.00 | 4,026,000 | |
| ダイコク電機 | 5,300 | 1,888.00 | 10,006,400 | |
| 竹内製作所 | 23,500 | 2,594.00 | 60,959,000 | |
| アマノ | 39,800 | 2,202.00 | 87,639,600 | |
| J U K I | 20,300 | 1,106.00 | 22,451,800 | |
| サンデンホールディングス | 79,000 | 374.00 | 29,546,000 | |
| 蛇の目ミシン工業 | 12,600 | 858.00 | 10,810,800 | |
| ブラザー工業 | 166,300 | 2,146.00 | 356,879,800 | |
| マックス | 20,000 | 1,458.00 | 29,160,000 | |
| モリタホールディングス | 22,600 | 1,635.00 | 36,951,000 | |
| グローリー | 41,100 | 3,760.00 | 154,536,000 | |
| 新晃工業 | 9,000 | 1,503.00 | 13,527,000 | |
| 大和冷機工業 | 20,600 | 962.00 | 19,817,200 | |
| セガサミーホールディングス | 127,600 | 1,813.00 | 231,338,800 | |
| 日本ピストンリング | 5,100 | 2,162.00 | 11,026,200 | |
| リケン | 6,000 | 4,365.00 | 26,190,000 | |
| T P R | 14,400 | 3,325.00 | 47,880,000 | |
| ツバキ・ナカシマ | 14,400 | 1,735.00 | 24,984,000 | |
| ホシザキ | 28,200 | 9,500.00 | 267,900,000 | |
| 大豊工業 | 10,400 | 1,652.00 | 17,180,800 | |
| 日本精工 | 264,300 | 1,352.00 | 357,333,600 | |
| N T N | 298,000 | 481.00 | 143,338,000 | |
| ジェイテクト | 137,100 | 1,910.00 | 261,861,000 | |
| 不二越 | 129,000 | 538.00 | 69,402,000 | |
| ミネベア | 207,400 | 1,115.00 | 231,251,000 | |
| 日本トムソン | 41,200 | 517.00 | 21,300,400 | |
| T H K | 90,900 | 2,563.00 | 232,976,700 | |
| ユーシン精機 | 5,700 | 3,015.00 | 17,185,500 | |
| 前澤給装工業 | 5,000 | 1,549.00 | 7,745,000 | |

| | | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|--|
| イーグル工業 | 13,900 | 1,621.00 | 22,531,900 | |
| 前澤工業 | 9,600 | 381.00 | 3,657,600 | |
| 日本ピラー工業 | 13,100 | 1,275.00 | 16,702,500 | |
| キッツ | 61,700 | 671.00 | 41,400,700 | |
| 日立製作所 | 3,090,000 | 665.10 | 2,055,159,000 | |
| 東芝 | 2,878,000 | 301.10 | 866,565,800 | |
| 三菱電機 | 1,372,600 | 1,632.50 | 2,240,769,500 | |
| 富士電機 | 388,000 | 614.00 | 238,232,000 | |
| 東洋電機製造 | 5,100 | 1,655.00 | 8,440,500 | |
| 安川電機 | 149,100 | 1,883.00 | 280,755,300 | |
| シンフォニア テクノロジー | 83,000 | 286.00 | 23,738,000 | |
| 明電舎 | 118,000 | 403.00 | 47,554,000 | |
| オリジン電気 | 19,000 | 325.00 | 6,175,000 | |
| 山洋電気 | 34,000 | 867.00 | 29,478,000 | |
| デンヨー | 11,900 | 1,653.00 | 19,670,700 | |
| 日立工機 | 34,400 | 1,491.00 | 51,290,400 | |
| 三櫻工業 | 16,500 | 834.00 | 13,761,000 | |
| マキタ | 83,900 | 7,880.00 | 661,132,000 | |
| 東芝テック | 81,000 | 607.00 | 49,167,000 | |
| 芝浦メカトロニクス | 21,000 | 272.00 | 5,712,000 | |
| マブチモーター | 36,300 | 6,150.00 | 223,245,000 | |
| 日本電産 | 166,800 | 10,445.00 | 1,742,226,000 | |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 1,500 | 3,030.00 | 4,545,000 | |
| 東光高岳 | 6,500 | 2,132.00 | 13,858,000 | |
| ダブル・スコープ | 12,200 | 1,753.00 | 21,386,600 | |
| 宮越ホールディングス | 4,500 | 509.00 | 2,290,500 | |
| ダイヘン | 70,000 | 731.00 | 51,170,000 | |
| 田淵電機 | 19,600 | 410.00 | 8,036,000 | |
| ヤーマン | 1,600 | 5,550.00 | 8,880,000 | |
| JVCケンウッド | 94,600 | 316.00 | 29,893,600 | |
| ミマキエンジニアリング | 11,600 | 685.00 | 7,946,000 | |
| 第一精工 | 5,900 | 1,383.00 | 8,159,700 | |
| 日新電機 | 25,900 | 1,320.00 | 34,188,000 | |
| 大崎電気工業 | 25,000 | 1,190.00 | 29,750,000 | |
| オムロン | 136,800 | 4,500.00 | 615,600,000 | |
| 日東工業 | 18,800 | 1,609.00 | 30,249,200 | |
| I D E C | 16,800 | 1,118.00 | 18,782,400 | |
| 不二電機工業 | 1,400 | 1,432.00 | 2,004,800 | |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 248,000 | 488.00 | 121,024,000 | |
| サクサホールディングス | 33,000 | 226.00 | 7,458,000 | |
| メルコホールディングス | 7,100 | 3,265.00 | 23,181,500 | |
| テクノメディカ | 2,900 | 2,027.00 | 5,878,300 | |
| 日本電気 | 1,769,000 | 328.00 | 580,232,000 | |
| 富士通 | 1,241,000 | 683.50 | 848,223,500 | |
| 沖電気工業 | 55,700 | 1,685.00 | 93,854,500 | |
| 岩崎通信機 | 58,000 | 90.00 | 5,220,000 | |
| 電気興業 | 37,000 | 590.00 | 21,830,000 | |
| サンケン電気 | 75,000 | 527.00 | 39,525,000 | |
| ナカヨ | 13,000 | 405.00 | 5,265,000 | |
| アイホン | 7,300 | 1,992.00 | 14,541,600 | |

| | | | | |
|---------------|-----------|-----------|---------------|--|
| ルネサスエレクトロニクス | 66,800 | 1,002.00 | 66,933,600 | |
| セイコーエプソン | 191,600 | 2,374.00 | 454,858,400 | |
| ワコム | 99,900 | 329.00 | 32,867,100 | |
| アルバック | 23,700 | 3,670.00 | 86,979,000 | |
| アクセル | 5,500 | 1,030.00 | 5,665,000 | |
| E I Z O | 12,700 | 3,555.00 | 45,148,500 | |
| ジャパンディスプレイ | 240,300 | 334.00 | 80,260,200 | |
| 日本信号 | 35,500 | 1,007.00 | 35,748,500 | |
| 京三製作所 | 30,000 | 401.00 | 12,030,000 | |
| 能美防災 | 14,600 | 1,774.00 | 25,900,400 | |
| ホーチキ | 9,400 | 1,464.00 | 13,761,600 | |
| エレコム | 11,200 | 1,967.00 | 22,030,400 | |
| 日本無線 | 7,900 | 1,391.00 | 10,988,900 | |
| パナソニック | 1,470,200 | 1,211.50 | 1,781,147,300 | |
| アンリツ | 93,700 | 683.00 | 63,997,100 | |
| 富士通ゼネラル | 44,000 | 2,697.00 | 118,668,000 | |
| 日立国際電気 | 33,700 | 2,554.00 | 86,069,800 | |
| ソニー | 908,500 | 3,510.00 | 3,188,835,000 | |
| T D K | 72,500 | 8,110.00 | 587,975,000 | |
| 帝国通信工業 | 28,000 | 180.00 | 5,040,000 | |
| ミツミ電機 | 45,500 | 657.00 | 29,893,500 | |
| タムラ製作所 | 50,000 | 457.00 | 22,850,000 | |
| アルプス電気 | 118,800 | 2,860.00 | 339,768,000 | |
| 池上通信機 | 41,000 | 171.00 | 7,011,000 | |
| パイオニア | 193,500 | 257.00 | 49,729,500 | |
| 日本電波工業 | 12,400 | 908.00 | 11,259,200 | |
| 鈴木 | 5,100 | 518.00 | 2,641,800 | |
| 日本トリム | 3,100 | 4,715.00 | 14,616,500 | |
| ローランド ディー・ジー・ | 6,600 | 3,085.00 | 20,361,000 | |
| 日本コロムビア | 3,900 | 649.00 | 2,531,100 | |
| フォスター電機 | 15,100 | 2,059.00 | 31,090,900 | |
| クラリオン | 68,000 | 439.00 | 29,852,000 | |
| S M K | 33,000 | 435.00 | 14,355,000 | |
| ヨコオ | 9,300 | 1,019.00 | 9,476,700 | |
| ティアック | 96,000 | 53.00 | 5,088,000 | |
| ホシデン | 39,000 | 959.00 | 37,401,000 | |
| ヒロセ電機 | 20,800 | 14,700.00 | 305,760,000 | |
| 日本航空電子工業 | 41,000 | 1,755.00 | 71,955,000 | |
| T O A | 15,200 | 1,044.00 | 15,868,800 | |
| 日立マクセル | 19,200 | 2,078.00 | 39,897,600 | |
| 古野電気 | 16,200 | 894.00 | 14,482,800 | |
| ユニデンホールディングス | 38,000 | 175.00 | 6,650,000 | |
| アルパイン | 30,700 | 1,589.00 | 48,782,300 | |
| スミダコーポレーション | 10,600 | 1,095.00 | 11,607,000 | |
| アイコム | 7,100 | 2,290.00 | 16,259,000 | |
| リオン | 5,000 | 1,614.00 | 8,070,000 | |
| 本多通信工業 | 3,600 | 1,300.00 | 4,680,000 | |
| 船井電機 | 13,800 | 952.00 | 13,137,600 | |
| 横河電機 | 139,500 | 1,732.00 | 241,614,000 | |
| 新電元工業 | 50,000 | 440.00 | 22,000,000 | |

| | | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|--|
| アズビル | 39,000 | 3,345.00 | 130,455,000 | |
| 東亜ディーケーケー | 6,600 | 552.00 | 3,643,200 | |
| 日本光電工業 | 53,800 | 2,684.00 | 144,399,200 | |
| チノー | 4,800 | 1,141.00 | 5,476,800 | |
| 共和電業 | 15,000 | 404.00 | 6,060,000 | |
| 日本電子材料 | 5,300 | 608.00 | 3,222,400 | |
| 堀場製作所 | 25,500 | 5,680.00 | 144,840,000 | |
| アドバンテスト | 87,700 | 1,962.00 | 172,067,400 | |
| 小野測器 | 6,500 | 881.00 | 5,726,500 | |
| エスベック | 11,400 | 1,362.00 | 15,526,800 | |
| パナソニック デバイス S U N X | 11,400 | 815.00 | 9,291,000 | |
| キーエンス | 29,200 | 83,170.00 | 2,428,564,000 | |
| 日置電機 | 6,800 | 2,165.00 | 14,722,000 | |
| シスメックス | 100,000 | 6,920.00 | 692,000,000 | |
| 日本マイクロニクス | 24,100 | 1,148.00 | 27,666,800 | |
| メガチップス | 12,000 | 2,588.00 | 31,056,000 | |
| O B A R A G R O U P | 7,500 | 5,160.00 | 38,700,000 | |
| イマジカ・ロボット ホールディングス | 10,700 | 727.00 | 7,778,900 | |
| 澤藤電機 | 8,000 | 217.00 | 1,736,000 | |
| デンソー | 317,300 | 5,064.00 | 1,606,807,200 | |
| コーセル | 17,900 | 1,332.00 | 23,842,800 | |
| イリソ電子工業 | 4,100 | 6,870.00 | 28,167,000 | |
| 新日本無線 | 9,900 | 412.00 | 4,078,800 | |
| オブテックスグループ | 9,500 | 2,595.00 | 24,652,500 | |
| 千代田インテグレ | 6,800 | 2,403.00 | 16,340,400 | |
| アイ・オー・データ機器 | 4,100 | 1,297.00 | 5,317,700 | |
| レーザーテック | 15,100 | 2,233.00 | 33,718,300 | |
| スタンレー電気 | 92,000 | 3,120.00 | 287,040,000 | |
| 岩崎電気 | 46,000 | 194.00 | 8,924,000 | |
| ウシオ電機 | 78,100 | 1,465.00 | 114,416,500 | |
| 岡谷電機産業 | 7,500 | 415.00 | 3,112,500 | |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 11,800 | 567.00 | 6,690,600 | |
| 日本セラミック | 10,500 | 2,071.00 | 21,745,500 | |
| 遠藤照明 | 6,600 | 922.00 | 6,085,200 | |
| 古河電池 | 9,000 | 766.00 | 6,894,000 | |
| 双信電機 | 6,900 | 298.00 | 2,056,200 | |
| 山一電機 | 11,900 | 1,177.00 | 14,006,300 | |
| 図研 | 8,400 | 1,305.00 | 10,962,000 | |
| 日本電子 | 47,000 | 532.00 | 25,004,000 | |
| カシオ計算機 | 103,500 | 1,672.00 | 173,052,000 | |
| ファナック | 130,500 | 20,275.00 | 2,645,887,500 | |
| 日本シイエムケイ | 27,800 | 709.00 | 19,710,200 | |
| エンプラス | 5,800 | 3,505.00 | 20,329,000 | |
| 大真空 | 4,700 | 1,448.00 | 6,805,600 | |
| ローム | 62,200 | 7,210.00 | 448,462,000 | |
| 浜松ホトニクス | 100,400 | 3,205.00 | 321,782,000 | |
| 三井ハイテック | 17,000 | 869.00 | 14,773,000 | |
| 新光電気工業 | 48,600 | 857.00 | 41,650,200 | |
| 京セラ | 211,200 | 5,892.00 | 1,244,390,400 | |

| | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|----------------|---|
| 協栄産業 | 16,000 | 164.00 | 2,624,000 | |
| 太陽誘電 | 62,600 | 1,377.00 | 86,200,200 | |
| 村田製作所 | 135,000 | 15,355.00 | 2,072,925,000 | |
| ユーシン | 17,100 | 768.00 | 13,132,800 | |
| 双葉電子工業 | 21,000 | 2,010.00 | 42,210,000 | |
| 日東電工 | 97,200 | 8,918.00 | 866,829,600 | |
| 北陸電気工業 | 53,000 | 141.00 | 7,473,000 | |
| 東海理化電機製作所 | 33,900 | 2,377.00 | 80,580,300 | |
| ニチコン | 40,400 | 1,060.00 | 42,824,000 | |
| 日本ケミコン | 111,000 | 260.00 | 28,860,000 | |
| K O A | 17,800 | 1,189.00 | 21,164,200 | |
| 三井造船 | 464,000 | 183.00 | 84,912,000 | |
| 日立造船 | 101,800 | 622.00 | 63,319,600 | |
| 三菱重工業 | 2,156,000 | 530.70 | 1,144,189,200 | |
| 川崎重工業 | 1,001,000 | 364.00 | 364,364,000 | |
| I H I | 989,000 | 312.00 | 308,568,000 | |
| 名村造船所 | 38,600 | 789.00 | 30,455,400 | |
| サノヤスホールディングス | 15,700 | 294.00 | 4,615,800 | |
| 日本車輛製造 | 47,000 | 278.00 | 13,066,000 | |
| ニチュ三菱フォークリフト | 14,900 | 836.00 | 12,456,400 | |
| 近畿車輛 | 2,000 | 2,652.00 | 5,304,000 | |
| F P G | 45,300 | 1,043.00 | 47,247,900 | |
| 島根銀行 | 2,800 | 1,398.00 | 3,914,400 | |
| じもとホールディングス | 91,400 | 198.00 | 18,097,200 | |
| 全国保証 | 35,800 | 4,015.00 | 143,737,000 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 612,300 | 443.00 | 271,248,900 | |
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ | 18,400 | 4,285.00 | 78,844,000 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 208,200 | 802.00 | 166,976,400 | |
| かんば生命保険 | 48,000 | 2,487.00 | 119,376,000 | |
| ゆうちょ銀行 | 359,600 | 1,424.00 | 512,070,400 | |
| 富山第一銀行 | 32,300 | 540.00 | 17,442,000 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 831,400 | 571.10 | 474,812,540 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 86,100 | 1,243.00 | 107,022,300 | |
| 日産自動車 | 1,539,900 | 1,172.00 | 1,804,762,800 | |
| いすゞ自動車 | 372,900 | 1,511.00 | 563,451,900 | |
| トヨタ自動車 | 1,564,400 | 6,912.00 | 10,813,132,800 | * |
| 日野自動車 | 183,600 | 1,219.00 | 223,808,400 | |
| 三菱自動車工業 | 471,700 | 688.00 | 324,529,600 | |
| エフテック | 6,800 | 1,353.00 | 9,200,400 | |
| レシップホールディングス | 4,500 | 901.00 | 4,054,500 | |
| G M B | 2,200 | 1,168.00 | 2,569,600 | |
| ファルテック | 2,400 | 1,367.00 | 3,280,800 | |
| 武蔵精密工業 | 15,000 | 3,310.00 | 49,650,000 | |
| 日産車体 | 56,500 | 1,147.00 | 64,805,500 | |
| 新明和工業 | 52,000 | 1,091.00 | 56,732,000 | |
| 極東開発工業 | 25,600 | 1,613.00 | 41,292,800 | |
| 日信工業 | 28,700 | 1,878.00 | 53,898,600 | |
| トピー工業 | 10,600 | 3,205.00 | 33,973,000 | |

| | | | | |
|--------------|-----------|-----------|---------------|--|
| ティラド | 50,000 | 306.00 | 15,300,000 | |
| 曙ブレーキ工業 | 59,900 | 319.00 | 19,108,100 | |
| タチエス | 21,900 | 1,936.00 | 42,398,400 | |
| N O K | 62,300 | 2,365.00 | 147,339,500 | |
| フタバ産業 | 39,300 | 700.00 | 27,510,000 | |
| K Y B | 144,000 | 557.00 | 80,208,000 | |
| 市光工業 | 27,000 | 389.00 | 10,503,000 | |
| 大同メタル工業 | 16,200 | 1,165.00 | 18,873,000 | |
| プレス工業 | 68,400 | 529.00 | 36,183,600 | |
| ミクニ | 16,500 | 405.00 | 6,682,500 | |
| カルソニックカンセイ | 87,000 | 1,790.00 | 155,730,000 | |
| 太平洋工業 | 26,400 | 1,486.00 | 39,230,400 | |
| ケーヒン | 29,600 | 2,068.00 | 61,212,800 | |
| 河西工業 | 16,700 | 1,385.00 | 23,129,500 | |
| アイシン精機 | 117,700 | 5,130.00 | 603,801,000 | |
| 富士機工 | 12,900 | 490.00 | 6,321,000 | |
| マツダ | 407,400 | 1,860.50 | 757,967,700 | |
| 今仙電機製作所 | 11,800 | 1,017.00 | 12,000,600 | |
| 本田技研工業 | 1,158,000 | 3,471.00 | 4,019,418,000 | |
| スズキ | 255,100 | 4,209.00 | 1,073,715,900 | |
| 富士重工業 | 399,500 | 4,874.00 | 1,947,163,000 | |
| 安永 | 4,300 | 1,790.00 | 7,697,000 | |
| ヤマハ発動機 | 181,800 | 2,549.00 | 463,408,200 | |
| ショーワ | 33,500 | 815.00 | 27,302,500 | |
| 小糸製作所 | 77,100 | 6,170.00 | 475,707,000 | |
| T B K | 16,300 | 517.00 | 8,427,100 | |
| エクセディ | 17,500 | 3,310.00 | 57,925,000 | |
| ミツバ | 23,700 | 2,005.00 | 47,518,500 | |
| 豊田合成 | 41,500 | 2,788.00 | 115,702,000 | |
| 愛三工業 | 22,500 | 995.00 | 22,387,500 | |
| 盟和産業 | 1,800 | 1,225.00 | 2,205,000 | |
| ヨロズ | 12,000 | 1,687.00 | 20,244,000 | |
| エフ・シー・シー | 21,100 | 2,114.00 | 44,605,400 | |
| 新家工業 | 29,000 | 165.00 | 4,785,000 | |
| シマノ | 51,900 | 19,060.00 | 989,214,000 | |
| タカタ | 23,300 | 887.00 | 20,667,100 | |
| テイ・エス テック | 29,900 | 3,040.00 | 90,896,000 | |
| ジャムコ | 7,500 | 2,552.00 | 19,140,000 | |
| 小野建 | 11,000 | 1,385.00 | 15,235,000 | |
| はるやまホールディングス | 5,700 | 872.00 | 4,970,400 | |
| ノジマ | 14,700 | 1,291.00 | 18,977,700 | |
| 佐島電機 | 10,100 | 737.00 | 7,443,700 | |
| カップ・クリエイト | 17,900 | 1,299.00 | 23,252,100 | |
| エコートレーディング | 3,200 | 693.00 | 2,217,600 | |
| 伯東 | 8,600 | 1,058.00 | 9,098,800 | |
| コンドーテック | 10,200 | 872.00 | 8,894,400 | |
| 中山福 | 7,700 | 816.00 | 6,283,200 | |
| ライトオン | 9,500 | 1,036.00 | 9,842,000 | |
| ナガイレーベン | 18,400 | 2,463.00 | 45,319,200 | |
| ジーンズメイト | 4,600 | 198.00 | 910,800 | |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|-------------|--|
| 三菱食品 | 14,000 | 3,425.00 | 47,950,000 | |
| 良品計画 | 16,800 | 22,000.00 | 369,600,000 | |
| 三城ホールディングス | 15,900 | 474.00 | 7,536,600 | |
| 松田産業 | 9,300 | 1,549.00 | 14,405,700 | |
| 第一興商 | 20,600 | 4,705.00 | 96,923,000 | |
| メディバルホールディングス | 127,000 | 1,856.00 | 235,712,000 | |
| アドヴァン | 13,000 | 1,146.00 | 14,898,000 | |
| S P K | 2,800 | 2,408.00 | 6,742,400 | |
| 萩原電気 | 4,300 | 2,166.00 | 9,313,800 | |
| アルビス | 3,400 | 3,845.00 | 13,073,000 | |
| アズワン | 9,900 | 5,170.00 | 51,183,000 | |
| スズデン | 4,400 | 1,034.00 | 4,549,600 | |
| 尾家産業 | 4,500 | 1,144.00 | 5,148,000 | |
| シモジマ | 7,900 | 1,151.00 | 9,092,900 | |
| ドウシシャ | 15,000 | 2,113.00 | 31,695,000 | |
| 小津産業 | 2,900 | 2,180.00 | 6,322,000 | |
| コナカ | 16,000 | 590.00 | 9,440,000 | |
| 高速 | 7,700 | 1,109.00 | 8,539,300 | |
| ハウス オブ ローゼ | 1,800 | 1,562.00 | 2,811,600 | |
| G - 7ホールディングス | 3,800 | 1,794.00 | 6,817,200 | |
| たけびし | 4,400 | 1,231.00 | 5,416,400 | |
| イオン北海道 | 12,600 | 598.00 | 7,534,800 | |
| コジマ | 19,000 | 294.00 | 5,586,000 | |
| ヒマラヤ | 4,100 | 878.00 | 3,599,800 | |
| コーナン商事 | 18,000 | 2,259.00 | 40,662,000 | |
| 黒田電気 | 17,300 | 2,405.00 | 41,606,500 | |
| ネットワンシステムズ | 54,900 | 768.00 | 42,163,200 | |
| エコス | 5,000 | 1,418.00 | 7,090,000 | |
| ワタミ | 15,000 | 1,181.00 | 17,715,000 | |
| マルシェ | 3,300 | 828.00 | 2,732,400 | |
| リックス | 3,000 | 1,549.00 | 4,647,000 | |
| システムソフト | 22,800 | 169.00 | 3,853,200 | |
| ドンキホーテホールディングス | 82,200 | 4,335.00 | 356,337,000 | |
| 丸文 | 11,400 | 704.00 | 8,025,600 | |
| 西松屋チェーン | 22,300 | 1,422.00 | 31,710,600 | |
| ゼンショーホールディングス | 65,800 | 1,963.00 | 129,165,400 | |
| ハビネット | 10,700 | 1,314.00 | 14,059,800 | |
| 幸楽苑ホールディングス | 8,200 | 1,687.00 | 13,833,400 | |
| ハークスレイ | 3,100 | 1,157.00 | 3,586,700 | |
| 橋本総業ホールディングス | 2,600 | 1,532.00 | 3,983,200 | |
| 日本ライフライン | 10,900 | 2,286.00 | 24,917,400 | |
| サイゼリヤ | 20,900 | 2,769.00 | 57,872,100 | |
| エクセル | 5,500 | 1,580.00 | 8,690,000 | |
| V Tホールディングス | 43,000 | 580.00 | 24,940,000 | |
| マルカキカイ | 4,100 | 1,636.00 | 6,707,600 | |
| アルゴグラフィックス | 5,800 | 2,286.00 | 13,258,800 | |
| 魚力 | 4,000 | 1,281.00 | 5,124,000 | |
| I D O M | 34,300 | 661.00 | 22,672,300 | |
| 日本エム・ディ・エム | 9,600 | 913.00 | 8,764,800 | |
| ポブラ | 3,500 | 502.00 | 1,757,000 | |

| | | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|--|
| フジ・コーポレーション | 2,000 | 2,058.00 | 4,116,000 | |
| ユナイテッドアローズ | 16,900 | 3,450.00 | 58,305,000 | |
| 進和 | 7,500 | 1,808.00 | 13,560,000 | |
| エスケイジャパン | 2,700 | 327.00 | 882,900 | |
| ダイترون | 5,900 | 963.00 | 5,681,700 | |
| ハイデイ日高 | 11,600 | 2,786.00 | 32,317,600 | |
| シークス | 9,100 | 4,045.00 | 36,809,500 | |
| 京都きもの友禅 | 8,400 | 973.00 | 8,173,200 | |
| コロワイド | 42,200 | 1,943.00 | 81,994,600 | |
| ピーシーデボコーポレーション | 16,900 | 643.00 | 10,866,700 | |
| 田中商事 | 4,100 | 702.00 | 2,878,200 | |
| オーハシテクニカ | 7,200 | 1,520.00 | 10,944,000 | |
| 壱番屋 | 11,500 | 3,800.00 | 43,700,000 | |
| 白銅 | 3,300 | 1,464.00 | 4,831,200 | |
| トップカルチャー | 5,000 | 484.00 | 2,420,000 | |
| P L A N T | 2,900 | 1,204.00 | 3,491,600 | |
| スギホールディングス | 27,800 | 5,380.00 | 149,564,000 | |
| 島津製作所 | 166,000 | 1,897.00 | 314,902,000 | |
| J M S | 24,000 | 309.00 | 7,416,000 | |
| クボテック | 3,000 | 623.00 | 1,869,000 | |
| 長野計器 | 8,500 | 714.00 | 6,069,000 | |
| ブイ・テクノロジー | 2,600 | 13,120.00 | 34,112,000 | |
| スター精密 | 22,500 | 1,562.00 | 35,145,000 | |
| 東京計器 | 43,000 | 240.00 | 10,320,000 | |
| 愛知時計電機 | 1,800 | 3,870.00 | 6,966,000 | |
| オーバル | 13,000 | 278.00 | 3,614,000 | |
| 東京精密 | 24,800 | 3,570.00 | 88,536,000 | |
| マニー | 17,100 | 2,890.00 | 49,419,000 | |
| ニコン | 224,200 | 1,870.00 | 419,254,000 | |
| トプコン | 64,800 | 1,750.00 | 113,400,000 | |
| オリンパス | 205,400 | 4,095.00 | 841,113,000 | |
| 理研計器 | 11,000 | 1,690.00 | 18,590,000 | |
| S C R E E Nホールディングス | 26,400 | 7,140.00 | 188,496,000 | |
| キャノン電子 | 11,700 | 1,776.00 | 20,779,200 | |
| タムロン | 11,400 | 2,061.00 | 23,495,400 | |
| H O Y A | 264,800 | 4,903.00 | 1,298,314,400 | |
| ノーリツ鋼機 | 12,300 | 891.00 | 10,959,300 | |
| エー・アンド・デイ | 12,000 | 484.00 | 5,808,000 | |
| キャノン | 692,700 | 3,325.00 | 2,303,227,500 | |
| リコー | 386,900 | 1,017.00 | 393,477,300 | |
| シチズン時計 | 140,800 | 708.00 | 99,686,400 | |
| リズム時計工業 | 52,000 | 186.00 | 9,672,000 | |
| 大研医器 | 10,800 | 820.00 | 8,856,000 | |
| メニコン | 8,900 | 3,485.00 | 31,016,500 | |
| スノーピーク | 1,600 | 3,080.00 | 4,928,000 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 12,400 | 4,655.00 | 57,722,000 | |
| トランザクション | 2,800 | 1,692.00 | 4,737,600 | |
| S H O B I | 5,000 | 424.00 | 2,120,000 | |
| ニホンフラッシュ | 5,300 | 1,349.00 | 7,149,700 | |
| 前田工織 | 12,900 | 1,304.00 | 16,821,600 | |

| | | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|--|
| 永大産業 | 17,000 | 513.00 | 8,721,000 | |
| アートネイチャー | 13,800 | 723.00 | 9,977,400 | |
| ダンロップスポーツ | 8,200 | 1,089.00 | 8,929,800 | |
| バンダイナムコホールディングス | 141,900 | 3,260.00 | 462,594,000 | |
| アイフィスジャパン | 2,400 | 425.00 | 1,020,000 | |
| 共立印刷 | 22,400 | 329.00 | 7,369,600 | |
| S H O E I | 5,800 | 2,147.00 | 12,452,600 | |
| フランスベッドホールディングス | 16,300 | 956.00 | 15,582,800 | |
| マーベラス | 21,400 | 803.00 | 17,184,200 | |
| パイロットコーポレーション | 22,500 | 4,875.00 | 109,687,500 | |
| 萩原工業 | 3,600 | 2,669.00 | 9,608,400 | |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 23,300 | 1,808.00 | 42,126,400 | |
| トッパン・フォームズ | 22,900 | 1,215.00 | 27,823,500 | |
| フジシールインターナショナル | 28,800 | 2,544.00 | 73,267,200 | |
| タカラトミー | 50,100 | 1,284.00 | 64,328,400 | |
| 廣済堂 | 13,000 | 396.00 | 5,148,000 | |
| アーク | 54,900 | 130.00 | 7,137,000 | |
| レック | 4,200 | 3,280.00 | 13,776,000 | |
| タカノ | 5,900 | 907.00 | 5,351,300 | |
| プロネクサス | 12,100 | 1,113.00 | 13,467,300 | |
| ホクシン | 9,700 | 212.00 | 2,056,400 | |
| ウッドワン | 22,000 | 275.00 | 6,050,000 | |
| 大建工業 | 9,100 | 2,169.00 | 19,737,900 | |
| きもと | 23,400 | 249.00 | 5,826,600 | |
| 凸版印刷 | 363,000 | 1,154.00 | 418,902,000 | |
| 大日本印刷 | 371,000 | 1,194.00 | 442,974,000 | |
| 図書印刷 | 17,000 | 488.00 | 8,296,000 | |
| 共同印刷 | 40,000 | 422.00 | 16,880,000 | |
| 日本写真印刷 | 21,600 | 3,020.00 | 65,232,000 | |
| 光村印刷 | 3,000 | 257.00 | 771,000 | |
| 藤森工業 | 10,000 | 2,995.00 | 29,950,000 | |
| 宝印刷 | 6,300 | 1,555.00 | 9,796,500 | |
| 前澤化成工業 | 8,900 | 1,202.00 | 10,697,800 | |
| アシックス | 127,900 | 2,357.00 | 301,460,300 | |
| ツツミ | 4,900 | 2,049.00 | 10,040,100 | |
| J S P | 6,300 | 2,745.00 | 17,293,500 | |
| ニチハ | 17,900 | 2,944.00 | 52,697,600 | |
| エフピコ | 12,000 | 5,480.00 | 65,760,000 | |
| 小松ウオール工業 | 4,400 | 1,982.00 | 8,720,800 | |
| ヤマハ | 86,700 | 3,645.00 | 316,021,500 | |
| 河合楽器製作所 | 5,100 | 2,347.00 | 11,969,700 | |
| クリナップ | 15,100 | 947.00 | 14,299,700 | |
| ピジョン | 77,800 | 3,045.00 | 236,901,000 | |
| 天馬 | 8,900 | 2,049.00 | 18,236,100 | |
| 兼松サステック | 14,000 | 188.00 | 2,632,000 | |
| キングジム | 10,900 | 849.00 | 9,254,100 | |
| リンテック | 30,600 | 2,581.00 | 78,978,600 | |
| T A S A K I | 2,700 | 1,593.00 | 4,301,100 | |
| 信越ポリマー | 26,400 | 897.00 | 23,680,800 | |

| | | | | |
|----------------------|-----------|-----------|---------------|--|
| 東リ | 32,300 | 420.00 | 13,566,000 | |
| イトーキ | 27,200 | 738.00 | 20,073,600 | |
| 任天堂 | 79,200 | 25,145.00 | 1,991,484,000 | |
| 三菱鉛筆 | 10,600 | 6,230.00 | 66,038,000 | |
| 松風 | 6,700 | 1,381.00 | 9,252,700 | |
| タカラスタANDARD | 26,600 | 1,957.00 | 52,056,200 | |
| コクヨ | 66,900 | 1,405.00 | 93,994,500 | |
| ナカバヤシ | 23,000 | 275.00 | 6,325,000 | |
| ニフコ | 23,600 | 6,210.00 | 146,556,000 | |
| 立川ブラインド工業 | 5,700 | 893.00 | 5,090,100 | |
| グローブライド | 6,300 | 1,948.00 | 12,272,400 | |
| 岡村製作所 | 45,000 | 1,071.00 | 48,195,000 | |
| 日本バルカー工業 | 10,400 | 1,594.00 | 16,577,600 | |
| MUTOHホールディングス | 16,000 | 262.00 | 4,192,000 | |
| 伊藤忠商事 | 930,200 | 1,578.00 | 1,467,855,600 | |
| 丸紅 | 1,249,700 | 677.70 | 846,921,690 | |
| スクロール | 19,300 | 348.00 | 6,716,400 | |
| 高島 | 22,000 | 203.00 | 4,466,000 | |
| ヨンドシーホールディングス | 9,700 | 2,472.00 | 23,978,400 | |
| 三陽商会 | 71,000 | 182.00 | 12,922,000 | |
| 長瀬産業 | 76,100 | 1,546.00 | 117,650,600 | |
| ナイガイ | 51,000 | 64.00 | 3,264,000 | |
| 蝶理 | 8,100 | 1,787.00 | 14,474,700 | |
| 豊田通商 | 141,400 | 3,040.00 | 429,856,000 | |
| オンワードホールディングス | 87,000 | 903.00 | 78,561,000 | |
| 三共生興 | 19,300 | 422.00 | 8,144,600 | |
| 兼松 | 270,000 | 198.00 | 53,460,000 | |
| 美津濃 | 69,000 | 584.00 | 40,296,000 | |
| ツカモトコーポレーション | 23,000 | 133.00 | 3,059,000 | |
| ユニー・ファミリーマートホールディングス | 55,700 | 7,790.00 | 433,903,000 | |
| ルック | 24,000 | 178.00 | 4,272,000 | |
| 三井物産 | 1,148,300 | 1,648.50 | 1,892,972,550 | |
| 日本紙パルプ商事 | 66,000 | 374.00 | 24,684,000 | |
| 東京エレクトロン | 85,800 | 11,155.00 | 957,099,000 | |
| 日立ハイテクノロジーズ | 44,000 | 4,715.00 | 207,460,000 | |
| カメイ | 16,500 | 1,240.00 | 20,460,000 | |
| 東都水産 | 2,000 | 1,908.00 | 3,816,000 | |
| OUGホールディングス | 20,000 | 266.00 | 5,320,000 | |
| スターゼン | 5,300 | 4,765.00 | 25,254,500 | |
| セイコーホールディングス | 91,000 | 430.00 | 39,130,000 | |
| 山善 | 48,700 | 988.00 | 48,115,600 | |
| 椿本興業 | 15,000 | 368.00 | 5,520,000 | |
| 住友商事 | 799,400 | 1,423.00 | 1,137,546,200 | |
| 日本ユニシス | 35,100 | 1,479.00 | 51,912,900 | |
| 内田洋行 | 31,000 | 495.00 | 15,345,000 | |
| 三菱商事 | 953,000 | 2,565.50 | 2,444,921,500 | |
| 第一実業 | 29,000 | 696.00 | 20,184,000 | |
| キヤノンマーケティングジャパン | 36,200 | 2,004.00 | 72,544,800 | |
| 西華産業 | 41,000 | 348.00 | 14,268,000 | |

| | | | | |
|-------------------|---------|----------|-------------|--|
| 佐藤商事 | 11,400 | 868.00 | 9,895,200 | |
| 菱洋エレクトロ | 12,200 | 1,487.00 | 18,141,400 | |
| 東京産業 | 12,900 | 493.00 | 6,359,700 | |
| ユアサ商事 | 12,000 | 3,010.00 | 36,120,000 | |
| 神鋼商事 | 3,100 | 2,467.00 | 7,647,700 | |
| 小林産業 | 9,400 | 260.00 | 2,444,000 | |
| 阪和興業 | 127,000 | 772.00 | 98,044,000 | |
| カナデン | 12,200 | 1,090.00 | 13,298,000 | |
| 菱電商事 | 20,000 | 756.00 | 15,120,000 | |
| ニプロ | 89,000 | 1,323.00 | 117,747,000 | |
| フルサト工業 | 7,000 | 1,733.00 | 12,131,000 | |
| 岩谷産業 | 141,000 | 624.00 | 87,984,000 | |
| すてきナイスグループ | 54,000 | 157.00 | 8,478,000 | |
| 昭光通商 | 47,000 | 103.00 | 4,841,000 | |
| ニチモウ | 19,000 | 179.00 | 3,401,000 | |
| 極東貿易 | 19,000 | 247.00 | 4,693,000 | |
| イワキ | 20,000 | 227.00 | 4,540,000 | |
| 兼松エレクトロニクス | 8,000 | 2,668.00 | 21,344,000 | |
| 三愛石油 | 34,100 | 839.00 | 28,609,900 | |
| 稲畑産業 | 30,400 | 1,330.00 | 40,432,000 | |
| G S I クレオス | 31,000 | 137.00 | 4,247,000 | |
| 明和産業 | 11,900 | 395.00 | 4,700,500 | |
| キムラタン | 588,000 | 8.00 | 4,704,000 | |
| ゴールドウイン | 5,700 | 5,350.00 | 30,495,000 | |
| ユニ・チャーム | 272,900 | 2,562.00 | 699,169,800 | |
| デサント | 30,800 | 1,342.00 | 41,333,600 | |
| キング | 6,900 | 415.00 | 2,863,500 | |
| ワキタ | 27,000 | 1,027.00 | 27,729,000 | |
| ヤマトインターナショナル | 8,700 | 409.00 | 3,558,300 | |
| 東邦ホールディングス | 40,700 | 2,385.00 | 97,069,500 | |
| サンゲツ | 43,500 | 2,100.00 | 91,350,000 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 20,500 | 726.00 | 14,883,000 | |
| シナネンホールディングス | 5,400 | 2,219.00 | 11,982,600 | |
| 伊藤忠エネクス | 28,000 | 931.00 | 26,068,000 | |
| サンリオ | 39,100 | 2,301.00 | 89,969,100 | |
| サンワ テクノス | 7,600 | 954.00 | 7,250,400 | |
| リョーサン | 18,900 | 3,550.00 | 67,095,000 | |
| 新光商事 | 13,900 | 1,278.00 | 17,764,200 | |
| トーホー | 5,800 | 2,607.00 | 15,120,600 | |
| 三信電気 | 14,100 | 1,183.00 | 16,680,300 | |
| 東陽テクニカ | 16,900 | 1,046.00 | 17,677,400 | |
| モスフードサービス | 16,600 | 3,455.00 | 57,353,000 | |
| 加賀電子 | 11,500 | 2,032.00 | 23,368,000 | |
| 三益半導体工業 | 10,000 | 1,677.00 | 16,770,000 | |
| ソーダニッカ | 13,600 | 510.00 | 6,936,000 | |
| 立花エレテック | 8,600 | 1,374.00 | 11,816,400 | |
| 木曽路 | 15,600 | 2,340.00 | 36,504,000 | |
| サトレストランシシステムズ | 15,300 | 824.00 | 12,607,200 | |
| 千趣会 | 23,000 | 728.00 | 16,744,000 | |
| タカキュー | 10,700 | 204.00 | 2,182,800 | |

| | | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|--|
| ケーヨー | 21,500 | 570.00 | 12,255,000 | |
| 上新電機 | 30,000 | 1,080.00 | 32,400,000 | |
| 日本瓦斯 | 23,300 | 3,285.00 | 76,540,500 | |
| ベスト電器 | 41,400 | 159.00 | 6,582,600 | |
| ロイヤルホールディングス | 21,000 | 1,937.00 | 40,677,000 | |
| 東天紅 | 10,000 | 156.00 | 1,560,000 | |
| いなげや | 14,100 | 1,533.00 | 21,615,300 | |
| 島忠 | 32,800 | 2,826.00 | 92,692,800 | |
| チヨダ | 15,000 | 2,827.00 | 42,405,000 | |
| ライフコーポレーション | 9,600 | 3,275.00 | 31,440,000 | |
| リンガーハット | 13,100 | 2,324.00 | 30,444,400 | |
| さが美 | 11,000 | 128.00 | 1,408,000 | |
| MR MAX | 16,000 | 416.00 | 6,656,000 | |
| テンアライド | 13,100 | 384.00 | 5,030,400 | |
| AOKIホールディングス | 25,300 | 1,452.00 | 36,735,600 | |
| オークワ | 18,000 | 1,158.00 | 20,844,000 | |
| コメリ | 19,600 | 2,770.00 | 54,292,000 | |
| 青山商事 | 26,500 | 4,070.00 | 107,855,000 | |
| しまむら | 14,700 | 15,400.00 | 226,380,000 | |
| はせがわ | 4,800 | 450.00 | 2,160,000 | |
| 高島屋 | 213,000 | 1,003.00 | 213,639,000 | |
| 松屋 | 27,700 | 1,055.00 | 29,223,500 | |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 65,000 | 1,864.00 | 121,160,000 | |
| 近鉄百貨店 | 49,000 | 364.00 | 17,836,000 | |
| 丸栄 | 28,000 | 90.00 | 2,520,000 | |
| パルコ | 12,000 | 1,065.00 | 12,780,000 | |
| 丸井グループ | 133,600 | 1,749.00 | 233,666,400 | |
| クレディセゾン | 96,300 | 2,117.00 | 203,867,100 | |
| アクシアル リテイリング | 9,800 | 4,050.00 | 39,690,000 | |
| 井筒屋 | 7,000 | 407.00 | 2,849,000 | |
| イオン | 522,500 | 1,699.00 | 887,727,500 | |
| イズミ | 25,200 | 5,060.00 | 127,512,000 | |
| 東武ストア | 1,500 | 2,926.00 | 4,389,000 | |
| フォーバル | 5,700 | 742.00 | 4,229,400 | |
| 平和堂 | 25,700 | 2,808.00 | 72,165,600 | |
| フジ | 14,100 | 2,333.00 | 32,895,300 | |
| ヤオコー | 14,400 | 4,735.00 | 68,184,000 | |
| ゼビオホールディングス | 17,200 | 1,814.00 | 31,200,800 | |
| ケーズホールディングス | 58,500 | 2,128.00 | 124,488,000 | |
| PALTAC | 20,300 | 2,874.00 | 58,342,200 | |
| 三谷産業 | 13,700 | 366.00 | 5,014,200 | |
| Olympicグループ | 7,600 | 636.00 | 4,833,600 | |
| 日産東京販売ホールディングス | 18,700 | 348.00 | 6,507,600 | |
| 新生銀行 | 1,209,000 | 203.00 | 245,427,000 | |
| あおぞら銀行 | 803,000 | 418.00 | 335,654,000 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 9,624,200 | 737.70 | 7,099,772,340 | |
| りそなホールディングス | 1,485,900 | 626.30 | 930,619,170 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 265,100 | 4,334.00 | 1,148,943,400 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 1,016,900 | 4,571.00 | 4,648,249,900 | |
| 第四銀行 | 156,000 | 530.00 | 82,680,000 | |

| | | | | |
|-----------------|------------|----------|---------------|--|
| 北越銀行 | 13,700 | 2,735.00 | 37,469,500 | |
| 千葉銀行 | 490,000 | 732.00 | 358,680,000 | |
| 群馬銀行 | 282,100 | 649.00 | 183,082,900 | |
| 武蔵野銀行 | 20,200 | 3,520.00 | 71,104,000 | |
| 千葉興業銀行 | 34,900 | 597.00 | 20,835,300 | |
| 筑波銀行 | 52,900 | 356.00 | 18,832,400 | |
| 七十七銀行 | 199,000 | 574.00 | 114,226,000 | |
| 青森銀行 | 99,000 | 396.00 | 39,204,000 | |
| 秋田銀行 | 83,000 | 381.00 | 31,623,000 | |
| 山形銀行 | 71,000 | 490.00 | 34,790,000 | |
| 岩手銀行 | 8,300 | 4,755.00 | 39,466,500 | |
| 東邦銀行 | 113,000 | 443.00 | 50,059,000 | |
| 東北銀行 | 66,000 | 158.00 | 10,428,000 | |
| みちのく銀行 | 63,000 | 198.00 | 12,474,000 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 515,000 | 534.00 | 275,010,000 | |
| 静岡銀行 | 345,000 | 1,009.00 | 348,105,000 | |
| 十六銀行 | 170,000 | 423.00 | 71,910,000 | |
| スルガ銀行 | 129,900 | 2,575.00 | 334,492,500 | |
| 八十二銀行 | 244,800 | 689.00 | 168,667,200 | |
| 山梨中央銀行 | 79,000 | 554.00 | 43,766,000 | |
| 大垣共立銀行 | 169,000 | 463.00 | 78,247,000 | |
| 福井銀行 | 109,000 | 299.00 | 32,591,000 | |
| 北國銀行 | 135,000 | 433.00 | 58,455,000 | |
| 清水銀行 | 4,300 | 3,810.00 | 16,383,000 | |
| 富山銀行 | 2,500 | 4,485.00 | 11,212,500 | |
| 滋賀銀行 | 119,000 | 649.00 | 77,231,000 | |
| 南都銀行 | 12,300 | 4,580.00 | 56,334,000 | |
| 百五銀行 | 114,000 | 487.00 | 55,518,000 | |
| 京都銀行 | 227,000 | 885.00 | 200,895,000 | |
| 紀陽銀行 | 47,700 | 1,880.00 | 89,676,000 | |
| 三重銀行 | 5,700 | 2,460.00 | 14,022,000 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 84,400 | 2,034.00 | 171,669,600 | |
| 広島銀行 | 375,000 | 555.00 | 208,125,000 | |
| 山陰合同銀行 | 76,300 | 1,002.00 | 76,452,600 | |
| 中国銀行 | 90,000 | 1,701.00 | 153,090,000 | |
| 鳥取銀行 | 4,100 | 1,933.00 | 7,925,300 | |
| 伊予銀行 | 135,700 | 822.00 | 111,545,400 | |
| 百十四銀行 | 139,000 | 400.00 | 55,600,000 | |
| 四国銀行 | 98,000 | 291.00 | 28,518,000 | |
| 阿波銀行 | 108,000 | 710.00 | 76,680,000 | |
| 大分銀行 | 73,000 | 440.00 | 32,120,000 | |
| 宮崎銀行 | 85,000 | 382.00 | 32,470,000 | |
| 佐賀銀行 | 77,000 | 306.00 | 23,562,000 | |
| 十八銀行 | 78,000 | 358.00 | 27,924,000 | |
| 沖縄銀行 | 12,300 | 4,255.00 | 52,336,500 | |
| 琉球銀行 | 26,200 | 1,540.00 | 40,348,000 | |
| セブン銀行 | 476,100 | 336.00 | 159,969,600 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 17,242,700 | 215.60 | 3,717,526,120 | |
| 高知銀行 | 48,000 | 136.00 | 6,528,000 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 119,000 | 1,275.00 | 151,725,000 | |

| | | | | |
|----------------------|-----------|----------|---------------|--|
| アクリーティブ | 10,600 | 496.00 | 5,257,600 | |
| 芙蓉総合リース | 14,500 | 5,650.00 | 81,925,000 | |
| 興銀リース | 23,800 | 2,614.00 | 62,213,200 | |
| 東京センチュリー | 25,500 | 4,040.00 | 103,020,000 | |
| SBIホールディングス | 143,400 | 1,554.00 | 222,843,600 | |
| 日本証券金融 | 55,700 | 633.00 | 35,258,100 | |
| アイフル | 212,900 | 351.00 | 74,727,900 | |
| 日本アジア投資 | 12,200 | 516.00 | 6,295,200 | |
| ポケットカード | 9,600 | 580.00 | 5,568,000 | |
| 長野銀行 | 4,200 | 2,037.00 | 8,555,400 | |
| 名古屋銀行 | 10,600 | 4,260.00 | 45,156,000 | |
| 北洋銀行 | 207,000 | 489.00 | 101,223,000 | |
| 愛知銀行 | 4,300 | 6,760.00 | 29,068,000 | |
| 第三銀行 | 7,200 | 1,874.00 | 13,492,800 | |
| 中京銀行 | 5,200 | 2,344.00 | 12,188,800 | |
| 大光銀行 | 45,000 | 266.00 | 11,970,000 | |
| 愛媛銀行 | 15,000 | 1,389.00 | 20,835,000 | |
| トマト銀行 | 5,000 | 1,614.00 | 8,070,000 | |
| みなと銀行 | 11,500 | 2,153.00 | 24,759,500 | |
| 京葉銀行 | 103,000 | 544.00 | 56,032,000 | |
| 関西アーバン銀行 | 17,800 | 1,445.00 | 25,721,000 | |
| 栃木銀行 | 70,000 | 591.00 | 41,370,000 | |
| 北日本銀行 | 4,000 | 3,110.00 | 12,440,000 | |
| 東和銀行 | 238,000 | 116.00 | 27,608,000 | |
| 福島銀行 | 139,000 | 101.00 | 14,039,000 | |
| 大東銀行 | 67,000 | 170.00 | 11,390,000 | |
| リコーリース | 10,000 | 3,600.00 | 36,000,000 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 81,100 | 2,098.00 | 170,147,800 | |
| アコム | 255,300 | 503.00 | 128,415,900 | |
| ジャックス | 70,000 | 523.00 | 36,610,000 | |
| オリエントコーポレーション | 274,400 | 215.00 | 58,996,000 | |
| 日立キャピタル | 29,900 | 2,961.00 | 88,533,900 | |
| アプラスフィナンシャル | 61,400 | 119.00 | 7,306,600 | |
| オリックス | 899,300 | 1,845.00 | 1,659,208,500 | |
| 三菱UFJリース | 322,100 | 609.00 | 196,158,900 | |
| ジャフコ | 21,200 | 3,900.00 | 82,680,000 | |
| トモニホールディングス | 104,700 | 631.00 | 66,065,700 | |
| 大和証券グループ本社 | 1,188,000 | 738.90 | 877,813,200 | |
| 野村ホールディングス | 2,596,600 | 699.40 | 1,816,062,040 | |
| 岡三証券グループ | 108,000 | 750.00 | 81,000,000 | |
| 丸三証券 | 40,400 | 996.00 | 40,238,400 | |
| 東洋証券 | 46,000 | 292.00 | 13,432,000 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 145,700 | 639.00 | 93,102,300 | |
| 光世証券 | 31,000 | 204.00 | 6,324,000 | |
| 水戸証券 | 39,600 | 327.00 | 12,949,200 | |
| いちよし証券 | 28,400 | 912.00 | 25,900,800 | |
| 松井証券 | 72,500 | 1,020.00 | 73,950,000 | |
| SOMPOホールディングス | 265,500 | 3,993.00 | 1,060,141,500 | |
| だいこう証券ビジネス | 6,400 | 629.00 | 4,025,600 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| 日本取引所グループ | 394,900 | 1,687.00 | 666,196,300 | |
| マネックスグループ | 136,500 | 328.00 | 44,772,000 | |
| カブドットコム証券 | 94,900 | 408.00 | 38,719,200 | |
| 極東証券 | 17,000 | 1,793.00 | 30,481,000 | |
| 岩井コスモホールディングス | 12,000 | 1,110.00 | 13,320,000 | |
| 藍澤證券 | 23,800 | 672.00 | 15,993,600 | |
| フィデアホールディングス | 123,300 | 213.00 | 26,262,900 | |
| 池田泉州ホールディングス | 134,600 | 550.00 | 74,030,000 | |
| アニコム ホールディングス | 8,600 | 2,341.00 | 20,132,600 | |
| MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス | 379,500 | 3,713.00 | 1,409,083,500 | |
| ソニーフィナンシャルホールディング ス | 121,700 | 1,850.00 | 225,145,000 | |
| マネーパートナーズグループ | 16,300 | 553.00 | 9,013,900 | |
| 小林洋行 | 4,300 | 293.00 | 1,259,900 | |
| 第一生命ホールディングス | 765,900 | 1,989.00 | 1,523,375,100 | |
| 東京海上ホールディングス | 514,500 | 4,811.00 | 2,475,259,500 | |
| イー・ギャランティ | 3,800 | 2,523.00 | 9,587,400 | |
| アサックス | 2,300 | 1,625.00 | 3,737,500 | |
| NECキャピタルソリューション | 5,100 | 1,821.00 | 9,287,100 | |
| T & Dホールディングス | 462,900 | 1,589.00 | 735,548,100 | |
| アドバンスクリエイト | 3,100 | 1,851.00 | 5,738,100 | |
| 三井不動産 | 673,000 | 2,699.50 | 1,816,763,500 | |
| 三菱地所 | 945,000 | 2,317.00 | 2,189,565,000 | |
| 平和不動産 | 24,000 | 1,612.00 | 38,688,000 | |
| 東京建物 | 147,400 | 1,563.00 | 230,386,200 | |
| ダイビル | 32,700 | 1,013.00 | 33,125,100 | |
| 京阪神ビルディング | 21,100 | 620.00 | 13,082,000 | |
| 住友不動産 | 304,000 | 3,104.00 | 943,616,000 | |
| 太平洋興発 | 54,000 | 102.00 | 5,508,000 | |
| 大京 | 236,000 | 243.00 | 57,348,000 | |
| テーオーシー | 49,300 | 948.00 | 46,736,400 | |
| 東京楽天地 | 21,000 | 542.00 | 11,382,000 | |
| レオパレス 2 1 | 160,100 | 675.00 | 108,067,500 | |
| スターツコーポレーション | 13,000 | 2,035.00 | 26,455,000 | |
| フジ住宅 | 16,200 | 770.00 | 12,474,000 | |
| 空港施設 | 15,400 | 588.00 | 9,055,200 | |
| 明和地所 | 7,000 | 751.00 | 5,257,000 | |
| 住友不動産販売 | 11,400 | 2,768.00 | 31,555,200 | |
| ゴールドクレスト | 11,400 | 2,229.00 | 25,410,600 | |
| リログループ | 5,100 | 16,920.00 | 86,292,000 | |
| 日本エスリード | 5,000 | 1,362.00 | 6,810,000 | |
| 日神不動産 | 15,100 | 546.00 | 8,244,600 | |
| 日本エスコン | 17,100 | 452.00 | 7,729,200 | |
| タカラレーベン | 55,400 | 732.00 | 40,552,800 | |
| サンヨーハウジング名古屋 | 6,600 | 1,110.00 | 7,326,000 | |
| イオンモール | 81,800 | 1,695.00 | 138,651,000 | |
| ファースト住建 | 4,800 | 1,504.00 | 7,219,200 | |
| ランド | 64,400 | 18.00 | 1,159,200 | |
| 東祥 | 2,900 | 5,400.00 | 15,660,000 | |

| | | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|--|
| トーセイ | 17,400 | 875.00 | 15,225,000 | |
| 穴吹興産 | 1,400 | 2,640.00 | 3,696,000 | |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 78,900 | 1,059.00 | 83,555,100 | |
| サンフロンティア不動産 | 13,600 | 1,064.00 | 14,470,400 | |
| エフ・ジェー・ネクスト | 11,200 | 749.00 | 8,388,800 | |
| ランドビジネス | 8,000 | 283.00 | 2,264,000 | |
| グランディハウス | 11,400 | 431.00 | 4,913,400 | |
| 東武鉄道 | 687,000 | 594.00 | 408,078,000 | |
| 相鉄ホールディングス | 206,000 | 593.00 | 122,158,000 | |
| 東京急行電鉄 | 699,000 | 886.00 | 619,314,000 | |
| 京浜急行電鉄 | 353,000 | 1,384.00 | 488,552,000 | |
| 小田急電鉄 | 206,100 | 2,361.00 | 486,602,100 | |
| 京王電鉄 | 360,000 | 989.00 | 356,040,000 | |
| 京成電鉄 | 96,400 | 2,909.00 | 280,427,600 | |
| 富士急行 | 35,000 | 1,154.00 | 40,390,000 | |
| 新京成電鉄 | 17,000 | 421.00 | 7,157,000 | |
| 東日本旅客鉄道 | 248,900 | 10,495.00 | 2,612,205,500 | |
| 西日本旅客鉄道 | 123,900 | 7,368.00 | 912,895,200 | |
| 東海旅客鉄道 | 107,000 | 19,585.00 | 2,095,595,000 | |
| 西武ホールディングス | 177,700 | 2,084.00 | 370,326,800 | |
| 鴻池運輸 | 18,200 | 1,558.00 | 28,355,600 | |
| 西日本鉄道 | 155,000 | 557.00 | 86,335,000 | |
| ハマキョウレックス | 8,400 | 2,207.00 | 18,538,800 | |
| サカイ引越センター | 4,500 | 2,708.00 | 12,186,000 | |
| 近鉄グループホールディングス | 1,295,000 | 458.00 | 593,110,000 | |
| 阪急阪神ホールディングス | 162,500 | 3,945.00 | 641,062,500 | |
| 南海電気鉄道 | 272,000 | 598.00 | 162,656,000 | |
| 京阪ホールディングス | 288,000 | 787.00 | 226,656,000 | |
| 神戸電鉄 | 32,000 | 380.00 | 12,160,000 | |
| 名古屋鉄道 | 469,000 | 569.00 | 266,861,000 | |
| 山陽電気鉄道 | 47,000 | 610.00 | 28,670,000 | |
| ランコム | 3,700 | 5,870.00 | 21,719,000 | |
| 日本通運 | 498,000 | 636.00 | 316,728,000 | |
| ヤマトホールディングス | 230,100 | 2,401.50 | 552,585,150 | |
| 山九 | 169,000 | 720.00 | 121,680,000 | |
| 日新 | 53,000 | 374.00 | 19,822,000 | |
| 丸運 | 7,500 | 253.00 | 1,897,500 | |
| 丸全昭和運輸 | 43,000 | 458.00 | 19,694,000 | |
| センコー | 57,900 | 813.00 | 47,072,700 | |
| トナミホールディングス | 26,000 | 369.00 | 9,594,000 | |
| ニッコンホールディングス | 43,600 | 2,485.00 | 108,346,000 | |
| 日本石油輸送 | 1,500 | 2,475.00 | 3,712,500 | |
| 福山通運 | 78,000 | 653.00 | 50,934,000 | |
| セイノーホールディングス | 91,200 | 1,353.00 | 123,393,600 | |
| 神奈川中央交通 | 15,000 | 731.00 | 10,965,000 | |
| 日立物流 | 26,800 | 2,395.00 | 64,186,000 | |
| 丸和運輸機関 | 3,200 | 2,901.00 | 9,283,200 | |
| C & F ロジホールディングス | 13,100 | 1,330.00 | 17,423,000 | |
| 日本郵船 | 1,087,000 | 229.00 | 248,923,000 | |
| 商船三井 | 675,000 | 348.00 | 234,900,000 | |

| | | | | |
|-----------------------|-----------|-----------|---------------|--|
| 川崎汽船 | 488,000 | 278.00 | 135,664,000 | |
| N S ユナイテッド海運 | 58,000 | 206.00 | 11,948,000 | |
| 明治海運 | 11,700 | 434.00 | 5,077,800 | |
| 飯野海運 | 66,600 | 474.00 | 31,568,400 | |
| 共栄タンカー | 11,000 | 225.00 | 2,475,000 | |
| 九州旅客鉄道 | 95,800 | 3,085.00 | 295,543,000 | |
| 日本航空 | 231,800 | 3,592.00 | 832,625,600 | |
| A N A ホールディングス | 2,388,000 | 323.40 | 772,279,200 | |
| パスコ | 12,000 | 426.00 | 5,112,000 | |
| 三菱倉庫 | 84,000 | 1,693.00 | 142,212,000 | |
| 三井倉庫ホールディングス | 74,000 | 346.00 | 25,604,000 | |
| 住友倉庫 | 94,000 | 627.00 | 58,938,000 | |
| 澁澤倉庫 | 33,000 | 360.00 | 11,880,000 | |
| ヤマタネ | 6,400 | 1,641.00 | 10,502,400 | |
| 東陽倉庫 | 22,800 | 298.00 | 6,794,400 | |
| 乾汽船 | 9,500 | 979.00 | 9,300,500 | |
| 日本トランスシティ | 30,000 | 436.00 | 13,080,000 | |
| ケイヒン | 24,000 | 156.00 | 3,744,000 | |
| 中央倉庫 | 7,600 | 1,087.00 | 8,261,200 | |
| 安田倉庫 | 9,900 | 769.00 | 7,613,100 | |
| 東洋埠頭 | 38,000 | 192.00 | 7,296,000 | |
| 宇徳 | 10,700 | 421.00 | 4,504,700 | |
| 上組 | 153,000 | 1,134.00 | 173,502,000 | |
| サンリツ | 1,700 | 531.00 | 902,700 | |
| キムラユニティー | 3,400 | 1,221.00 | 4,151,400 | |
| キューソー流通システム | 3,900 | 2,433.00 | 9,488,700 | |
| 郵船ロジスティクス | 11,800 | 1,188.00 | 14,018,400 | |
| 近鉄エクスプレス | 23,000 | 1,642.00 | 37,766,000 | |
| 東海運 | 7,200 | 459.00 | 3,304,800 | |
| エーアイティー | 8,000 | 1,137.00 | 9,096,000 | |
| 内外トランスライン | 4,000 | 1,078.00 | 4,312,000 | |
| 東京放送ホールディングス | 83,700 | 1,993.00 | 166,814,100 | |
| 日本テレビホールディングス | 115,900 | 2,170.00 | 251,503,000 | |
| 朝日放送 | 12,400 | 729.00 | 9,039,600 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 34,700 | 2,383.00 | 82,690,100 | |
| スカパー J S A T ホールディングス | 82,500 | 539.00 | 44,467,500 | |
| テレビ東京ホールディングス | 10,300 | 2,331.00 | 24,009,300 | |
| 日本 B S 放送 | 2,900 | 1,066.00 | 3,091,400 | |
| U - N E X T | 3,400 | 693.00 | 2,356,200 | |
| ワイヤレスゲート | 4,100 | 1,747.00 | 7,162,700 | |
| コネクシオ | 11,200 | 1,510.00 | 16,912,000 | |
| 日本通信 | 106,800 | 171.00 | 18,262,800 | |
| クロップス | 1,400 | 575.00 | 805,000 | |
| 日本電信電話 | 1,019,500 | 5,047.00 | 5,145,416,500 | |
| K D D I | 1,256,500 | 3,054.00 | 3,837,351,000 | |
| 光通信 | 15,300 | 11,050.00 | 169,065,000 | |
| N T T ドコモ | 949,000 | 2,761.00 | 2,620,189,000 | |
| エムティーアイ | 19,500 | 734.00 | 14,313,000 | |
| G M O インターネット | 46,400 | 1,569.00 | 72,801,600 | |
| カドカワ | 36,800 | 1,755.00 | 64,584,000 | |

| | | | | |
|---------------|-----------|----------|-------------|--|
| 学研ホールディングス | 42,000 | 334.00 | 14,028,000 | |
| ゼンリン | 16,800 | 2,388.00 | 40,118,400 | |
| 昭文社 | 7,100 | 699.00 | 4,962,900 | |
| インプレスホールディングス | 11,100 | 144.00 | 1,598,400 | |
| 東京電力ホールディングス | 1,091,600 | 477.00 | 520,693,200 | |
| 中部電力 | 424,000 | 1,600.50 | 678,612,000 | |
| 関西電力 | 525,200 | 1,298.00 | 681,709,600 | |
| 中国電力 | 177,800 | 1,358.00 | 241,452,400 | |
| 北陸電力 | 126,000 | 1,320.00 | 166,320,000 | |
| 東北電力 | 321,400 | 1,442.00 | 463,458,800 | |
| 四国電力 | 115,900 | 1,187.00 | 137,573,300 | |
| 九州電力 | 284,200 | 1,296.00 | 368,323,200 | |
| 北海道電力 | 120,500 | 920.00 | 110,860,000 | |
| 沖縄電力 | 18,900 | 2,700.00 | 51,030,000 | |
| 電源開発 | 102,400 | 2,756.00 | 282,214,400 | |
| エフオン | 5,400 | 1,033.00 | 5,578,200 | |
| イーレックス | 5,400 | 3,350.00 | 18,090,000 | |
| 東京瓦斯 | 1,380,000 | 529.70 | 730,986,000 | |
| 大阪瓦斯 | 1,248,000 | 448.60 | 559,852,800 | |
| 東邦瓦斯 | 324,000 | 945.00 | 306,180,000 | |
| 北海道瓦斯 | 32,000 | 278.00 | 8,896,000 | |
| 広島ガス | 26,700 | 378.00 | 10,092,600 | |
| 西部瓦斯 | 145,000 | 256.00 | 37,120,000 | |
| 静岡ガス | 39,600 | 813.00 | 32,194,800 | |
| メタウォーター | 7,300 | 2,832.00 | 20,673,600 | |
| アイネット | 7,400 | 1,139.00 | 8,428,600 | |
| 松竹 | 84,000 | 1,360.00 | 114,240,000 | |
| 東宝 | 83,000 | 3,325.00 | 275,975,000 | |
| エイチ・アイ・エス | 21,900 | 3,060.00 | 67,014,000 | |
| 東映 | 47,000 | 1,024.00 | 48,128,000 | |
| ラックランド | 2,200 | 1,907.00 | 4,195,400 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 78,500 | 5,700.00 | 447,450,000 | |
| 共立メンテナンス | 10,900 | 7,220.00 | 78,698,000 | |
| イチネンホールディングス | 14,300 | 1,186.00 | 16,959,800 | |
| 建設技術研究所 | 8,600 | 1,038.00 | 8,926,800 | |
| スペース | 7,300 | 1,254.00 | 9,154,200 | |
| アインホールディングス | 15,300 | 8,020.00 | 122,706,000 | |
| 燦ホールディングス | 2,700 | 1,573.00 | 4,247,100 | |
| ピー・シー・エー | 1,800 | 1,458.00 | 2,624,400 | |
| スバル興業 | 10,000 | 558.00 | 5,580,000 | |
| 東京テアトル | 53,000 | 160.00 | 8,480,000 | |
| タナベ経営 | 2,800 | 1,295.00 | 3,626,000 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 1,700 | 1,029.00 | 1,749,300 | |
| ナガワ | 2,500 | 4,535.00 | 11,337,500 | |
| よみうりランド | 27,000 | 496.00 | 13,392,000 | |
| 東京都競馬 | 92,000 | 276.00 | 25,392,000 | |
| 常磐興産 | 5,100 | 1,593.00 | 8,124,300 | |
| カナモト | 18,800 | 3,170.00 | 59,596,000 | |
| 東京ドーム | 53,600 | 1,149.00 | 61,586,400 | |
| D T S | 13,100 | 2,602.00 | 34,086,200 | |

| | | | | |
|----------------------|---------|-----------|---------------|--|
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 48,900 | 3,105.00 | 151,834,500 | |
| シーイーシー | 7,600 | 1,855.00 | 14,098,000 | |
| カプコン | 29,800 | 2,742.00 | 81,711,600 | |
| 西尾レントオール | 10,800 | 3,565.00 | 38,502,000 | |
| アイ・エス・ビー | 2,300 | 947.00 | 2,178,100 | |
| アゴーラ・ホスピタリティ・グループ | 72,000 | 38.00 | 2,736,000 | |
| 日本空港ビルデング | 40,500 | 4,255.00 | 172,327,500 | |
| トランス・コスモス | 15,600 | 2,858.00 | 44,584,800 | |
| 乃村工藝社 | 28,800 | 1,733.00 | 49,910,400 | |
| ジャステック | 8,100 | 1,083.00 | 8,772,300 | |
| S C S K | 34,500 | 4,235.00 | 146,107,500 | |
| 藤田観光 | 44,000 | 366.00 | 16,104,000 | |
| K N T - C Tホールディングス | 72,000 | 151.00 | 10,872,000 | |
| 日本管財 | 11,600 | 1,820.00 | 21,112,000 | |
| トーカイ | 6,000 | 4,055.00 | 24,330,000 | |
| 白洋舎 | 500 | 2,727.00 | 1,363,500 | |
| セコム | 139,800 | 8,642.00 | 1,208,151,600 | |
| 日本システムウエア | 4,200 | 1,518.00 | 6,375,600 | |
| セントラル警備保障 | 6,000 | 2,073.00 | 12,438,000 | |
| アイネス | 16,100 | 1,257.00 | 20,237,700 | |
| 丹青社 | 23,300 | 815.00 | 18,989,500 | |
| メイテック | 16,300 | 4,435.00 | 72,290,500 | |
| T K C | 11,800 | 3,360.00 | 39,648,000 | |
| アサツー ディ・ケイ | 21,900 | 2,990.00 | 65,481,000 | |
| 富士ソフト | 18,900 | 2,830.00 | 53,487,000 | |
| 応用地質 | 12,700 | 1,405.00 | 17,843,500 | |
| 船井総研ホールディングス | 17,300 | 1,798.00 | 31,105,400 | |
| N S D | 27,000 | 1,869.00 | 50,463,000 | |
| 進学会 | 5,700 | 575.00 | 3,277,500 | |
| 丸紅建材リース | 12,000 | 232.00 | 2,784,000 | |
| オオバ | 10,100 | 466.00 | 4,706,600 | |
| コナミホールディングス | 57,300 | 4,735.00 | 271,315,500 | |
| 学究社 | 3,700 | 1,495.00 | 5,531,500 | |
| ベネッセホールディングス | 45,000 | 3,315.00 | 149,175,000 | |
| イオンディライト | 15,200 | 3,425.00 | 52,060,000 | |
| ナック | 8,300 | 994.00 | 8,250,200 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 3,700 | 3,160.00 | 11,692,000 | |
| ニチイ学館 | 23,400 | 869.00 | 20,334,600 | |
| ダイセキ | 23,500 | 2,248.00 | 52,828,000 | |
| ステップ | 4,600 | 1,388.00 | 6,384,800 | |
| 日鉄住金物産 | 11,100 | 4,630.00 | 51,393,000 | |
| 元気寿司 | 3,300 | 2,158.00 | 7,121,400 | |
| トラスコ中山 | 29,000 | 2,554.00 | 74,066,000 | |
| ヤマダ電機 | 424,700 | 637.00 | 270,533,900 | |
| オートバックスセブン | 47,000 | 1,787.00 | 83,989,000 | |
| アーランドサカモト | 21,500 | 1,414.00 | 30,401,000 | |
| ニトリホールディングス | 54,900 | 13,100.00 | 719,190,000 | |
| グルメ杵屋 | 9,000 | 1,028.00 | 9,252,000 | |

| | | | | |
|-----------------|-------------|-----------|-----------------|--|
| 愛眼 | 10,800 | 198.00 | 2,138,400 | |
| ケーユーホールディングス | 6,700 | 838.00 | 5,614,600 | |
| 吉野家ホールディングス | 44,200 | 1,633.00 | 72,178,600 | |
| 加藤産業 | 19,900 | 2,778.00 | 55,282,200 | |
| イノテック | 11,000 | 602.00 | 6,622,000 | |
| イエローハット | 12,000 | 2,566.00 | 30,792,000 | |
| 松屋フーズ | 6,100 | 3,975.00 | 24,247,500 | |
| J B C Cホールディングス | 10,700 | 812.00 | 8,688,400 | |
| J Kホールディングス | 12,800 | 605.00 | 7,744,000 | |
| サガミチェーン | 16,000 | 1,313.00 | 21,008,000 | |
| 日伝 | 5,300 | 3,195.00 | 16,933,500 | |
| 関西スーパーマーケット | 10,400 | 1,546.00 | 16,078,400 | |
| ミロク情報サービス | 9,500 | 1,778.00 | 16,891,000 | |
| 北沢産業 | 11,000 | 211.00 | 2,321,000 | |
| 杉本商事 | 7,400 | 1,537.00 | 11,373,800 | |
| 因幡電機産業 | 17,800 | 4,015.00 | 71,467,000 | |
| 王将フードサービス | 9,300 | 4,450.00 | 41,385,000 | |
| プレナス | 14,200 | 2,354.00 | 33,426,800 | |
| ミニストップ | 9,400 | 2,060.00 | 19,364,000 | |
| アークス | 23,700 | 2,611.00 | 61,880,700 | |
| バローホールディングス | 27,300 | 3,080.00 | 84,084,000 | |
| パイテックホールディングス | 5,200 | 1,282.00 | 6,666,400 | |
| ミスミグループ本社 | 142,700 | 1,945.00 | 277,551,500 | |
| アルテック | 11,200 | 224.00 | 2,508,800 | |
| ベルク | 5,600 | 4,320.00 | 24,192,000 | |
| 大 庄 | 6,900 | 1,619.00 | 11,171,100 | |
| タキヒヨー | 19,000 | 471.00 | 8,949,000 | |
| ファーストリテイリング | 21,200 | 38,560.00 | 817,472,000 | |
| ソフトバンクグループ | 571,700 | 8,495.00 | 4,856,591,500 | |
| 蔵王産業 | 2,100 | 1,434.00 | 3,011,400 | |
| スズケン | 57,800 | 3,885.00 | 224,553,000 | |
| サンドラッグ | 24,200 | 8,590.00 | 207,878,000 | |
| サックスパー ホールディングス | 12,000 | 1,200.00 | 14,400,000 | |
| ジェコス | 8,800 | 1,152.00 | 10,137,600 | |
| ヤマザワ | 2,700 | 1,838.00 | 4,962,600 | |
| やまや | 2,600 | 1,750.00 | 4,550,000 | |
| ルネサスイーストン | 11,200 | 541.00 | 6,059,200 | |
| ベルーナ | 31,700 | 799.00 | 25,328,300 | |
| 合計 | 194,680,274 | | 290,967,130,996 | |

*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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 2,669,800,351 | 1,810,993,822 |
| 国債証券 | | 322,571,545,900 | 322,898,743,100 |
| 地方債証券 | | 24,847,419,058 | 23,972,716,425 |
| 特殊債券 | | 21,383,050,814 | 18,970,399,799 |
| 社債券 | | 18,810,793,240 | 17,116,038,660 |
| 未収入金 | | - | 1,722,720,000 |
| 未収利息 | | 871,382,620 | 853,274,556 |
| 前払費用 | | 7,312,311 | 16,404,130 |
| 流動資産合計 | | 391,161,304,294 | 387,361,290,492 |
| 資産合計 | | 391,161,304,294 | 387,361,290,492 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 2,553,334,000 | - |
| 未払解約金 | | 203,965,000 | 187,691,000 |
| 流動負債合計 | | 2,757,299,000 | 187,691,000 |
| 負債合計 | | 2,757,299,000 | 187,691,000 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 292,253,585,690 | 302,351,149,022 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 96,150,419,604 | 84,822,450,470 |
| 元本等合計 | | 388,404,005,294 | 387,173,599,492 |
| 純資産合計 | | 388,404,005,294 | 387,173,599,492 |
| 負債純資産合計 | | 391,161,304,294 | 387,361,290,492 |

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、地方債証券、特殊債券及び社債券</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> |
|--------------------|---|

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|---|------------------|------------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 332,334,674,604円 | 292,253,585,690円 |
| 同期中追加設定元本額 | 28,402,466,785円 | 37,966,858,814円 |
| 同期中一部解約元本額 | 68,483,555,699円 | 27,869,295,482円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| D I A M国内債券パッシブ・ファンド | 9,941,134,725円 | 10,854,182,784円 |
| M I T O ラップ型ファンド（安定型） | 172,180,702円 | 136,287,516円 |
| M I T O ラップ型ファンド（中立型） | 123,653,996円 | 123,830,945円 |
| M I T O ラップ型ファンド（積極型） | 36,694,771円 | 46,215,676円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 358,912,607円 | 406,021,206円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 109,095,285円 | 119,424,698円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 14,849,516円 | 24,093,768円 |
| たわらノーロード 国内債券 | 843,892,595円 | 901,143,539円 |
| たわらノーロード 国内債券＜ラップ向け＞ | 755,274円 | 755,274円 |
| D I A M国内債券インデックスファンド＜DC年金＞ | 12,136,230,303円 | 12,171,985,997円 |
| D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞1安定型 | 4,455,584,454円 | 4,811,241,049円 |
| D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞2安定・成長型 | 6,480,666,778円 | 6,822,072,744円 |
| D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞3成長型 | 2,577,558,464円 | 2,649,526,618円 |
| D I A M DC バランス30インデックスファンド | 1,635,560,673円 | 1,641,032,476円 |
| D I A M DC バランス50インデックスファンド | 1,752,431,130円 | 1,722,626,088円 |
| D I A M DC バランス70インデックスファンド | 244,957,185円 | 244,923,243円 |
| マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞ | 107,376,967円 | 98,797,552円 |

| | | |
|--------------------------------------|-----------------|-----------------|
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞ | 2,232,067,996円 | 2,195,866,560円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 8,622,472円 | 4,978,002円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10） | 241,882,463円 | 353,017,386円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20） | 180,929,656円 | 250,995,189円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30） | 42,599,566円 | 60,859,020円 |
| 投資のソムリエ | 8,397,162,509円 | 8,918,982,259円 |
| クルーズコントロール | 603,930,416円 | 4,082,782,511円 |
| 投資のソムリエ＜DC年金＞ | 193,382,273円 | 263,430,477円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞ | 830,691,516円 | 1,121,552,998円 |
| D I A M D C バランス・F（成長型） | 60,028,288円 | 114,156,112円 |
| クルーズコントロール＜DC年金＞ | 162,357円 | 1,612,582円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型） | 1,845,659円 | 12,066,843円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド（積極型） | 3,267,039円 | 26,868,545円 |
| 投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型 | 42,386,066円 | 113,106,192円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 1,164,445円 | 462,426円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | - 円 | 2,413,062円 |
| みずほエマージングボンドオープン | 10,801,911円 | 10,801,911円 |
| D I A M高金利通貨ファンド | 9,608,918円 | 9,608,918円 |
| D I A Mエマージング債券ファンド | 9,450,010円 | 9,450,010円 |
| D I A M国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け） | 31,069,835,454円 | 31,050,583,696円 |
| D I A Mアクティブアロケーション私募ファンド（適格機関投資家限定） | 1,017,679,760円 | 720,300,635円 |
| D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定） | 565,187,887円 | 512,582,948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） | 487,442,086円 | 464,509,485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） | 263,811,800円 | 294,451,872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） | 120,775,930円 | 116,088,208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） | 308,201,994円 | 324,560,165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） | 134,933,432円 | 134,546,633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） | 100,766,131円 | 79,812,989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） | 8,142,086,582円 | 3,873,885,819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） | 2,882,754,786円 | 1,486,248,373円 |

| | | |
|---|------------------|------------------|
| D I A Mバランスファンド２５ＶＡ （適格機関投資家限定） | 7,291,850,962円 | 7,186,488,246円 |
| D I A Mバランスファンド３７．５Ｖ Ａ（適格機関投資家限定） | 3,347,753,977円 | 3,535,321,999円 |
| D I A Mバランスファンド５０ＶＡ （適格機関投資家限定） | 5,855,728,654円 | 6,415,378,240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） | 726,773,720円 | 751,554,552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） | 3,065,894,724円 | 2,297,736,149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） | 4,268,643,026円 | 4,381,704,478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） | 5,825,783,266円 | 5,754,159,456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） | 839,267,900円 | 812,385,968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） | 6,155,191,528円 | 5,909,722,696円 |
| D I A M世界バランスファンド３５Ｖ Ａ（適格機関投資家限定） | 6,389,387,464円 | 6,745,903,203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） | 83,661,791,662円 | 89,058,950,692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） | 1,148,667,373円 | 1,234,322,032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） | 7,204,561,225円 | 7,560,187,206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） | 26,346,101,006円 | 28,217,510,574円 |
| D I A Mバランス３０ＶＡ（適格機関 投資家限定） | 93,379,444円 | 94,990,409円 |
| D I A Mバランス５０ＶＡ（適格機関 投資家限定） | 12,695,134円 | 2,469,333円 |
| D I A Mバランス７０ＶＡ（適格機関 投資家限定） | 1,771,365円 | 9,097,607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） | 29,694,944,222円 | 31,637,535,869円 |
| D I A M世界バランス２５ＶＡ（適格 機関投資家限定） | 532,331,561円 | 562,537,512円 |
| D I A M国内バランス３０ＶＡ（適格 機関投資家限定） | 149,060,577円 | 140,361,156円 |
| D I A Mバランス２０ＶＡ（適格機関 投資家限定） | 686,289,506円 | 657,286,245円 |
| D I A Mバランス４０ＶＡ（適格機関 投資家限定） | 414,302円 | 453,278円 |
| D I A Mバランス６０ＶＡ（適格機関 投資家限定） | 308,265円 | 349,123円 |
| 計 | 292,253,585,690円 | 302,351,149,022円 |
| ２． 受益権の総数 | 292,253,585,690口 | 302,351,149,022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28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1． 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 同左 |
| 3． 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

２．金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|---|--------------|
| １． 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| ２． 時価の算定方法 | <p>(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(２)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 国債証券 | 17,818,346,000 | 1,960,142,200 |
| 地方債証券 | 17,098,491 | 126,766,942 |
| 特殊債券 | 22,523,087 | 131,484,282 |
| 社債券 | 76,252,550 | 123,096,030 |
| 合計 | 17,889,173,954 | 1,578,794,946 |

（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28年2月16日から平成28年7月11日まで及び平成28年2月16日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.3290円 | 1.2805円 |
| （1万口当たり純資産額） | (13,290円) | (12,805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29年1月11日現在

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|------|---------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 3 6 1 回 利付国庫債券(2年) | 1,000,000,000 | 1,004,650,000 | |
| | 3 6 3 回 利付国庫債券(2年) | 1,000,000,000 | 1,005,020,000 | |
| | 3 6 4 回 利付国庫債券(2年) | 1,500,000,000 | 1,507,830,000 | |
| | 3 6 5 回 利付国庫債券(2年) | 2,500,000,000 | 2,513,350,000 | |
| | 3 6 6 回 利付国庫債券(2年) | 4,000,000,000 | 4,022,280,000 | |
| | 3 6 7 回 利付国庫債券(2年) | 500,000,000 | 502,945,000 | |
| | 3 6 9 回 利付国庫債券(2年) | 1,000,000,000 | 1,006,340,000 | |
| | 3 7 0 回 利付国庫債券(2年) | 1,000,000,000 | 1,006,640,000 | |
| | 1 0 9 回 利付国庫債券(5年) | 2,000,000,000 | 2,009,820,000 | |
| | 1 1 0 回 利付国庫債券(5年) | 2,000,000,000 | 2,014,560,000 | |
| | 1 1 2 回 利付国庫債券(5年) | 1,500,000,000 | 1,514,670,000 | |
| | 1 1 3 回 利付国庫債券(5年) | 2,000,000,000 | 2,016,680,000 | |
| | 1 1 4 回 利付国庫債券(5年) | 3,500,000,000 | 3,533,145,000 | |
| | 1 1 6 回 利付国庫債券(5年) | 4,200,000,000 | 4,236,708,000 | |
| | 1 1 7 回 利付国庫債券(5年) | 4,000,000,000 | 4,038,120,000 | |
| | 1 1 8 回 利付国庫債券(5年) | 4,200,000,000 | 4,243,638,000 | |
| | 1 2 0 回 利付国庫債券(5年) | 1,500,000,000 | 1,516,605,000 | |
| | 1 2 1 回 利付国庫債券(5年) | 2,000,000,000 | 2,016,740,000 | |
| | 1 2 2 回 利付国庫債券(5年) | 4,500,000,000 | 4,539,150,000 | |
| | 1 2 3 回 利付国庫債券(5年) | 4,000,000,000 | 4,035,800,000 | |
| | 1 2 4 回 利付国庫債券(5年) | 4,500,000,000 | 4,541,940,000 | |
| | 1 2 5 回 利付国庫債券(5年) | 3,000,000,000 | 3,029,460,000 | |
| | 1 2 6 回 利付国庫債券(5年) | 4,200,000,000 | 4,242,378,000 | |
| | 1 2 7 回 利付国庫債券(5年) | 3,000,000,000 | 3,031,530,000 | |
| | 1 2 8 回 利付国庫債券(5年) | 4,000,000,000 | 4,043,720,000 | |
| | 1 2 9 回 利付国庫債券(5年) | 4,500,000,000 | 4,550,895,000 | |
| | 2 回 利付国庫債券(40年) | 600,000,000 | 843,018,000 | |
| | 3 回 利付国庫債券(40年) | 700,000,000 | 989,387,000 | |
| | 4 回 利付国庫債券(40年) | 800,000,000 | 1,137,248,000 | |
| | 5 回 利付国庫債券(40年) | 800,000,000 | 1,093,576,000 | |
| | 6 回 利付国庫債券(40年) | 700,000,000 | 939,785,000 | |
| | 7 回 利付国庫債券(40年) | 800,000,000 | 1,026,928,000 | |
| | 8 回 利付国庫債券(40年) | 1,000,000,000 | 1,187,640,000 | |
| | 9 回 利付国庫債券(40年) | 800,000,000 | 684,128,000 | |
| | 2 9 0 回 利付国庫債券(10年) | 1,000,000,000 | 1,020,260,000 | |
| | 2 9 3 回 利付国庫債券(10年) | 1,200,000,000 | 1,235,904,000 | |
| | 2 9 6 回 利付国庫債券(10年) | 2,000,000,000 | 2,059,380,000 | |
| | 2 9 7 回 利付国庫債券(10年) | 2,300,000,000 | 2,373,508,000 | |
| | 2 9 9 回 利付国庫債券(10年) | 900,000,000 | 930,177,000 | |
| | 3 0 1 回 利付国庫債券(10年) | 2,900,000,000 | 3,021,249,000 | |

| | | | | |
|------|-------------|---------------|---------------|--|
| 303回 | 利付国庫債券（10年） | 1,300,000,000 | 1,356,329,000 | |
| 305回 | 利付国庫債券（10年） | 2,500,000,000 | 2,610,275,000 | |
| 306回 | 利付国庫債券（10年） | 1,500,000,000 | 1,575,810,000 | |
| 308回 | 利付国庫債券（10年） | 800,000,000 | 840,456,000 | |
| 309回 | 利付国庫債券（10年） | 1,000,000,000 | 1,043,670,000 | |
| 310回 | 利付国庫債券（10年） | 2,800,000,000 | 2,920,372,000 | |
| 312回 | 利付国庫債券（10年） | 2,200,000,000 | 2,317,986,000 | |
| 313回 | 利付国庫債券（10年） | 3,000,000,000 | 3,182,340,000 | |
| 315回 | 利付国庫債券（10年） | 1,500,000,000 | 1,589,295,000 | |
| 317回 | 利付国庫債券（10年） | 1,000,000,000 | 1,058,220,000 | |
| 318回 | 利付国庫債券（10年） | 1,000,000,000 | 1,053,510,000 | |
| 319回 | 利付国庫債券（10年） | 1,500,000,000 | 1,591,215,000 | |
| 320回 | 利付国庫債券（10年） | 1,500,000,000 | 1,583,775,000 | |
| 321回 | 利付国庫債券（10年） | 2,500,000,000 | 2,645,275,000 | |
| 324回 | 利付国庫債券（10年） | 2,000,000,000 | 2,099,460,000 | |
| 325回 | 利付国庫債券（10年） | 2,700,000,000 | 2,839,725,000 | |
| 326回 | 利付国庫債券（10年） | 1,700,000,000 | 1,781,175,000 | |
| 328回 | 利付国庫債券（10年） | 1,500,000,000 | 1,564,320,000 | |
| 329回 | 利付国庫債券（10年） | 1,200,000,000 | 1,268,280,000 | |
| 330回 | 利付国庫債券（10年） | 1,700,000,000 | 1,799,331,000 | |
| 332回 | 利付国庫債券（10年） | 2,500,000,000 | 2,614,875,000 | |
| 333回 | 利付国庫債券（10年） | 2,000,000,000 | 2,092,920,000 | |
| 334回 | 利付国庫債券（10年） | 2,600,000,000 | 2,722,018,000 | |
| 335回 | 利付国庫債券（10年） | 2,000,000,000 | 2,080,040,000 | |
| 336回 | 利付国庫債券（10年） | 1,500,000,000 | 1,560,735,000 | |
| 337回 | 利付国庫債券（10年） | 1,300,000,000 | 1,331,993,000 | |
| 338回 | 利付国庫債券（10年） | 2,500,000,000 | 2,582,850,000 | |
| 339回 | 利付国庫債券（10年） | 2,300,000,000 | 2,376,567,000 | |
| 340回 | 利付国庫債券（10年） | 3,000,000,000 | 3,101,520,000 | |
| 341回 | 利付国庫債券（10年） | 3,500,000,000 | 3,588,970,000 | |
| 342回 | 利付国庫債券（10年） | 4,000,000,000 | 4,029,320,000 | |
| 343回 | 利付国庫債券（10年） | 4,500,000,000 | 4,529,610,000 | |
| 344回 | 利付国庫債券（10年） | 5,000,000,000 | 5,026,500,000 | |
| 345回 | 利付国庫債券（10年） | 500,000,000 | 502,220,000 | |
| 1回 | 利付国庫債券（30年） | 100,000,000 | 132,657,000 | |
| 2回 | 利付国庫債券（30年） | 100,000,000 | 128,256,000 | |
| 3回 | 利付国庫債券（30年） | 200,000,000 | 254,602,000 | |
| 4回 | 利付国庫債券（30年） | 200,000,000 | 272,234,000 | |
| 5回 | 利付国庫債券（30年） | 200,000,000 | 254,018,000 | |
| 6回 | 利付国庫債券（30年） | 200,000,000 | 260,644,000 | |
| 7回 | 利付国庫債券（30年） | 300,000,000 | 387,747,000 | |
| 8回 | 利付国庫債券（30年） | 300,000,000 | 365,901,000 | |
| 11回 | 利付国庫債券（30年） | 400,000,000 | 482,412,000 | |
| 12回 | 利付国庫債券（30年） | 300,000,000 | 380,961,000 | |
| 13回 | 利付国庫債券（30年） | 300,000,000 | 376,425,000 | |
| 14回 | 利付国庫債券（30年） | 500,000,000 | 660,760,000 | |
| 15回 | 利付国庫債券（30年） | 200,000,000 | 267,790,000 | |
| 16回 | 利付国庫債券（30年） | 400,000,000 | 536,520,000 | |
| 17回 | 利付国庫債券（30年） | 200,000,000 | 265,160,000 | |
| 18回 | 利付国庫債券（30年） | 820,000,000 | 1,073,134,000 | |

| | | | | |
|-----|-------------|---------------|---------------|--|
| 19回 | 利付国庫債券（30年） | 200,000,000 | 262,084,000 | |
| 20回 | 利付国庫債券（30年） | 300,000,000 | 403,911,000 | |
| 21回 | 利付国庫債券（30年） | 500,000,000 | 656,235,000 | |
| 22回 | 利付国庫債券（30年） | 470,000,000 | 633,964,200 | |
| 23回 | 利付国庫債券（30年） | 600,000,000 | 810,384,000 | |
| 24回 | 利付国庫債券（30年） | 300,000,000 | 405,345,000 | |
| 25回 | 利付国庫債券（30年） | 400,000,000 | 526,224,000 | |
| 26回 | 利付国庫債券（30年） | 700,000,000 | 935,228,000 | |
| 27回 | 利付国庫債券（30年） | 900,000,000 | 1,224,801,000 | |
| 28回 | 利付国庫債券（30年） | 800,000,000 | 1,092,832,000 | |
| 29回 | 利付国庫債券（30年） | 1,100,000,000 | 1,487,057,000 | |
| 30回 | 利付国庫債券（30年） | 1,000,000,000 | 1,336,710,000 | |
| 31回 | 利付国庫債券（30年） | 1,100,000,000 | 1,454,321,000 | |
| 32回 | 利付国庫債券（30年） | 1,200,000,000 | 1,616,784,000 | |
| 33回 | 利付国庫債券（30年） | 1,300,000,000 | 1,673,945,000 | |
| 34回 | 利付国庫債券（30年） | 1,200,000,000 | 1,603,752,000 | |
| 35回 | 利付国庫債券（30年） | 1,500,000,000 | 1,945,230,000 | |
| 36回 | 利付国庫債券（30年） | 1,400,000,000 | 1,820,798,000 | |
| 37回 | 利付国庫債券（30年） | 1,400,000,000 | 1,793,064,000 | |
| 38回 | 利付国庫債券（30年） | 1,000,000,000 | 1,260,110,000 | |
| 39回 | 利付国庫債券（30年） | 800,000,000 | 1,027,888,000 | |
| 40回 | 利付国庫債券（30年） | 700,000,000 | 884,065,000 | |
| 41回 | 利付国庫債券（30年） | 800,000,000 | 991,400,000 | |
| 42回 | 利付国庫債券（30年） | 1,000,000,000 | 1,239,680,000 | |
| 43回 | 利付国庫債券（30年） | 800,000,000 | 993,248,000 | |
| 44回 | 利付国庫債券（30年） | 800,000,000 | 993,584,000 | |
| 45回 | 利付国庫債券（30年） | 1,000,000,000 | 1,192,490,000 | |
| 46回 | 利付国庫債券（30年） | 1,200,000,000 | 1,432,704,000 | |
| 47回 | 利付国庫債券（30年） | 1,200,000,000 | 1,464,780,000 | |
| 48回 | 利付国庫債券（30年） | 1,100,000,000 | 1,287,011,000 | |
| 49回 | 利付国庫債券（30年） | 1,000,000,000 | 1,171,240,000 | |
| 50回 | 利付国庫債券（30年） | 1,200,000,000 | 1,218,732,000 | |
| 51回 | 利付国庫債券（30年） | 1,300,000,000 | 1,149,252,000 | |
| 52回 | 利付国庫債券（30年） | 1,300,000,000 | 1,216,657,000 | |
| 39回 | 利付国庫債券（20年） | 400,000,000 | 413,792,000 | |
| 40回 | 利付国庫債券（20年） | 720,000,000 | 751,060,800 | |
| 42回 | 利付国庫債券（20年） | 800,000,000 | 849,528,000 | |
| 43回 | 利付国庫債券（20年） | 860,000,000 | 931,964,800 | |
| 45回 | 利付国庫債券（20年） | 900,000,000 | 973,971,000 | |
| 46回 | 利付国庫債券（20年） | 500,000,000 | 540,890,000 | |
| 47回 | 利付国庫債券（20年） | 950,000,000 | 1,033,163,000 | |
| 48回 | 利付国庫債券（20年） | 500,000,000 | 552,365,000 | |
| 50回 | 利付国庫債券（20年） | 780,000,000 | 847,181,400 | |
| 51回 | 利付国庫債券（20年） | 600,000,000 | 657,162,000 | |
| 52回 | 利付国庫債券（20年） | 550,000,000 | 607,843,500 | |
| 54回 | 利付国庫債券（20年） | 700,000,000 | 780,997,000 | |
| 55回 | 利付国庫債券（20年） | 810,000,000 | 899,326,800 | |
| 57回 | 利付国庫債券（20年） | 1,130,000,000 | 1,254,130,500 | |
| 58回 | 利付国庫債券（20年） | 600,000,000 | 668,988,000 | |
| 60回 | 利付国庫債券（20年） | 990,000,000 | 1,078,644,600 | |

| | | | | |
|---------|-------------|---------------|---------------|--|
| 6 1 回 | 利付国庫債券（20年） | 800,000,000 | 854,456,000 | |
| 6 2 回 | 利付国庫債券（20年） | 800,000,000 | 845,520,000 | |
| 6 4 回 | 利付国庫債券（20年） | 600,000,000 | 679,386,000 | |
| 6 5 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,100,000,000 | 1,250,557,000 | |
| 6 7 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,900,000,000 | 2,166,209,000 | |
| 7 0 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,250,000,000 | 1,476,275,000 | |
| 7 2 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,250,000,000 | 1,453,400,000 | |
| 7 3 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,190,000,000 | 1,379,924,000 | |
| 7 5 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,400,000,000 | 1,641,178,000 | |
| 7 8 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,450,000,000 | 1,681,608,500 | |
| 8 1 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,400,000,000 | 1,642,452,000 | |
| 8 3 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,400,000,000 | 1,660,428,000 | |
| 8 5 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,400,000,000 | 1,666,854,000 | |
| 8 8 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,200,000,000 | 1,455,540,000 | |
| 9 0 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,200,000,000 | 1,450,056,000 | |
| 9 2 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,300,000,000 | 1,563,432,000 | |
| 9 3 回 | 利付国庫債券（20年） | 700,000,000 | 836,990,000 | |
| 9 4 回 | 利付国庫債券（20年） | 800,000,000 | 964,648,000 | |
| 9 5 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,200,000,000 | 1,476,384,000 | |
| 9 7 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,400,000,000 | 1,713,530,000 | |
| 9 9 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,400,000,000 | 1,703,758,000 | |
| 1 0 0 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,300,000,000 | 1,600,976,000 | |
| 1 0 2 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,400,000,000 | 1,760,990,000 | |
| 1 0 5 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,300,000,000 | 1,594,762,000 | |
| 1 0 7 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,700,000,000 | 2,089,878,000 | |
| 1 0 9 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,600,000,000 | 1,933,776,000 | |
| 1 1 1 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,600,000,000 | 1,996,672,000 | |
| 1 1 3 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,500,000,000 | 1,858,320,000 | |
| 1 1 4 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,500,000,000 | 1,862,850,000 | |
| 1 1 6 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,800,000,000 | 2,263,770,000 | |
| 1 1 8 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,000,000,000 | 1,233,850,000 | |
| 1 1 9 回 | 利付国庫債券（20年） | 900,000,000 | 1,086,948,000 | |
| 1 2 1 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,900,000,000 | 2,324,042,000 | |
| 1 2 3 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,900,000,000 | 2,379,693,000 | |
| 1 2 5 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,800,000,000 | 2,283,822,000 | |
| 1 2 8 回 | 利付国庫債券（20年） | 700,000,000 | 859,691,000 | |
| 1 2 9 回 | 利付国庫債券（20年） | 900,000,000 | 1,092,798,000 | |
| 1 3 0 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,500,000,000 | 1,822,875,000 | |
| 1 3 2 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,800,000,000 | 2,163,294,000 | |
| 1 3 4 回 | 利付国庫債券（20年） | 900,000,000 | 1,095,219,000 | |
| 1 3 5 回 | 利付国庫債券（20年） | 800,000,000 | 961,920,000 | |
| 1 3 7 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,700,000,000 | 2,045,015,000 | |
| 1 4 0 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,600,000,000 | 1,925,456,000 | |
| 1 4 1 回 | 利付国庫債券（20年） | 2,100,000,000 | 2,529,765,000 | |
| 1 4 3 回 | 利付国庫債券（20年） | 2,100,000,000 | 2,498,139,000 | |
| 1 4 5 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,400,000,000 | 1,687,126,000 | |
| 1 4 6 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,600,000,000 | 1,928,336,000 | |
| 1 4 7 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,700,000,000 | 2,021,929,000 | |
| 1 4 8 回 | 利付国庫債券（20年） | 1,500,000,000 | 1,759,590,000 | |
| 1 4 9 回 | 利付国庫債券（20年） | 2,200,000,000 | 2,579,654,000 | |

| | | | | |
|---------|------------------|-----------------|-----------------|--|
| | 150回 利付国庫債券（20年） | 1,700,000,000 | 1,964,554,000 | |
| | 151回 利付国庫債券（20年） | 1,800,000,000 | 2,017,332,000 | |
| | 152回 利付国庫債券（20年） | 1,600,000,000 | 1,791,120,000 | |
| | 153回 利付国庫債券（20年） | 1,900,000,000 | 2,158,343,000 | |
| | 154回 利付国庫債券（20年） | 1,500,000,000 | 1,675,125,000 | |
| | 155回 利付国庫債券（20年） | 1,600,000,000 | 1,726,416,000 | |
| | 156回 利付国庫債券（20年） | 1,500,000,000 | 1,453,395,000 | |
| | 157回 利付国庫債券（20年） | 1,800,000,000 | 1,673,226,000 | |
| | 158回 利付国庫債券（20年） | 2,000,000,000 | 1,963,060,000 | |
| | 159回 利付国庫債券（20年） | 400,000,000 | 398,932,000 | |
| 国債証券 合計 | | 292,420,000,000 | 322,898,743,100 | |
| 地方債証券 | 659回 東京都公募公債 | 203,500,000 | 208,241,550 | |
| | 667回 東京都公募公債 | 300,000,000 | 310,314,000 | |
| | 680回 東京都公募公債 | 200,000,000 | 209,086,000 | |
| | 685回 東京都公募公債 | 500,000,000 | 519,410,000 | |
| | 688回 東京都公募公債 | 200,000,000 | 206,926,000 | |
| | 697回 東京都公募公債 | 500,000,000 | 524,585,000 | |
| | 701回 東京都公募公債 | 700,000,000 | 732,284,000 | |
| | 708回 東京都公募公債 | 500,000,000 | 524,375,000 | |
| | 720回 東京都公募公債 | 300,000,000 | 316,311,000 | |
| | 726回 東京都公募公債 | 400,000,000 | 418,952,000 | |
| | 5回 東京都公募公債 20年 | 100,000,000 | 116,418,000 | |
| | 9回 東京都公募公債 20年 | 200,000,000 | 243,178,000 | |
| | 10回 東京都公募公債 20年 | 300,000,000 | 362,796,000 | |
| | 21年度6回 北海道公募公債 | 200,000,000 | 208,406,000 | |
| | 22年度12回 北海道公募公債 | 200,000,000 | 210,550,000 | |
| | 166回 神奈川県公募公債 | 300,000,000 | 311,097,000 | |
| | 194回 神奈川県公募公債 | 300,000,000 | 313,635,000 | |
| | 208回 神奈川県公募公債 | 300,000,000 | 310,104,000 | |
| | 319回 大阪府公募公債 | 200,000,000 | 206,394,000 | |
| | 336回 大阪府公募公債 | 200,000,000 | 209,382,000 | |
| | 345回 大阪府公募公債 | 300,000,000 | 315,033,000 | |
| | 356回 大阪府公募公債 | 200,000,000 | 210,630,000 | |
| | 364回 大阪府公募公債 | 300,000,000 | 312,993,000 | |
| | 374回 大阪府公募公債 | 300,000,000 | 317,277,000 | |
| | 26年度11回 京都府公募公債 | 350,000,000 | 360,080,000 | |
| | 26年度17回 兵庫県公募公債 | 200,000,000 | 205,402,000 | |
| | 1回 兵庫県公募公債（12年） | 300,000,000 | 322,086,000 | |
| | 21年度5回 静岡県公募公債 | 197,000,000 | 204,554,950 | |
| | 22年度8回 静岡県公募公債 | 200,000,000 | 207,664,000 | |
| | 23年度9回 静岡県公募公債 | 200,000,000 | 210,180,000 | |
| | 1回 静岡県公募公債 20年 | 100,000,000 | 117,661,000 | |
| | 20年度4回 愛知県公募公債 | 100,000,000 | 102,726,000 | |
| | 22年度6回 愛知県公募公債 | 200,000,000 | 208,490,000 | |
| | 23年度20回 愛知県公募公債 | 500,000,000 | 527,910,000 | |
| | 25年度4回 愛知県公募公債 | 300,000,000 | 315,591,000 | |
| | 22年度1回 広島県公募公債 | 200,000,000 | 209,248,000 | |
| | 21年度4回 埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 207,328,000 | |
| | 23年度2回 埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 210,384,000 | |
| | 26年度5回 埼玉県公募公債 | 400,000,000 | 415,368,000 | |

| | | | | |
|----------|-------------------------|----------------|----------------|--|
| | 2 1 年度 3 回 福岡県公募公債 | 200,000,000 | 208,136,000 | |
| | 2 5 年度 1 1 回 福岡県公募公債 | 200,000,000 | 208,756,000 | |
| | 2 1 年度 6 回 千葉県公募公債 | 200,000,000 | 207,624,000 | |
| | 2 4 年度 7 回 千葉県公募公債 | 300,000,000 | 312,741,000 | |
| | 2 5 年度 5 回 千葉県公募公債 | 200,000,000 | 210,426,000 | |
| | 6 5 回 共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,618,000 | |
| | 8 0 回 共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 208,842,000 | |
| | 9 4 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 525,330,000 | |
| | 9 9 回 共同発行市場公募地方債 | 700,000,000 | 736,456,000 | |
| | 1 0 6 回 共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 314,583,000 | |
| | 1 0 9 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 527,465,000 | |
| | 1 1 1 回 共同発行市場公募地方債 | 700,000,000 | 733,341,000 | |
| | 1 1 9 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 523,360,000 | |
| | 1 2 1 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 516,620,000 | |
| | 1 2 6 回 共同発行市場公募地方債 | 793,900,000 | 834,190,425 | |
| | 1 2 7 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 521,055,000 | |
| | 1 2 8 回 共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 312,342,000 | |
| | 1 3 7 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 517,740,000 | |
| | 1 3 9 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 516,870,000 | |
| | 1 4 2 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 509,170,000 | |
| | 1 4 4 回 共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 411,564,000 | |
| | 1 4 6 回 共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 414,348,000 | |
| | 1 4 8 回 共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 518,070,000 | |
| | 4 8 8 回 名古屋市公募公債 1 0 年 | 450,000,000 | 467,100,000 | |
| | 4 回 京都市公募公債 2 0 年 | 100,000,000 | 122,418,000 | |
| | 2 2 年度 3 回 横浜市公募公債 | 200,000,000 | 208,606,000 | |
| | 2 2 年度 5 回 横浜市公募公債 | 200,000,000 | 209,960,000 | |
| | 2 3 年度 4 回 横浜市公募公債 | 450,000,000 | 472,738,500 | |
| | 2 5 年度 2 回 横浜市公募公債 | 400,000,000 | 421,884,000 | |
| | 2 5 年度 4 回 札幌市公募公債 | 200,000,000 | 209,704,000 | |
| | 2 回 川崎市公募公債 1 5 年 | 100,000,000 | 105,682,000 | |
| | 2 1 年度 2 回 北九州市公募公債 | 200,000,000 | 208,216,000 | |
| | 2 3 年度 1 回 千葉市公募公債 | 200,000,000 | 211,710,000 | |
| 地方債証券 合計 | | 22,844,400,000 | 23,972,716,425 | |
| 特殊債券 | 4 6 回 日本政策投資銀行債券 | 200,000,000 | 204,008,000 | |
| | 4 8 回 高速道路機構債 | 700,000,000 | 726,159,000 | |
| | 9 6 回 高速道路機構債 | 700,000,000 | 730,247,000 | |
| | 1 1 6 回 高速道路機構債 | 100,000,000 | 104,515,000 | |
| | 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 108,028,000 | |
| | 1 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 300,000,000 | 330,726,000 | |
| | 5 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 200,000,000 | 203,584,000 | |
| | 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 707,000,000 | 725,714,290 | |
| | 6 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 162,000,000 | 166,187,700 | |
| | 6 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 401,000,000 | 412,637,020 | |

| | | | |
|---------------------------|---------------|---------------|--|
| 7 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 600,000,000 | 616,524,000 | |
| 7 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 700,000,000 | 722,687,000 | |
| 8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 100,000,000 | 103,715,000 | |
| 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 300,000,000 | 310,680,000 | |
| 1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 400,000,000 | 419,740,000 | |
| 1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1,000,000,000 | 1,044,390,000 | |
| 1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 500,000,000 | 516,970,000 | |
| 1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 500,000,000 | 528,515,000 | |
| 1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 330,000,000 | 349,648,200 | |
| 2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 500,000,000 | 516,190,000 | |
| 8 回 政保地方公営企業金融機構債券 | 651,000,000 | 674,234,190 | |
| 3 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 101,000,000 | 104,957,180 | |
| 5 回 地方公共団体金融機構債券 | 500,000,000 | 519,490,000 | |
| 8 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 311,886,000 | |
| 1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 500,000,000 | 520,745,000 | |
| 1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 207,250,000 | |
| 2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 314,613,000 | |
| 2 4 回 地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 315,651,000 | |
| 3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 314,634,000 | |
| 4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 400,000,000 | 420,096,000 | |
| 5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 500,000,000 | 529,590,000 | |
| 6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 311,670,000 | |
| 1 9 回 都市再生機構債券 | 200,000,000 | 204,840,000 | |
| 3 7 回 住宅金融支援機構債券 | 300,000,000 | 311,472,000 | |
| 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券 | 56,085,000 | 59,894,854 | |
| 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券 | 39,518,000 | 42,190,997 | |
| 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券 | 58,521,000 | 62,518,569 | |
| 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券 | 62,727,000 | 67,532,515 | |
| 1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券 | 26,464,000 | 27,667,847 | |
| 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券 | 134,930,000 | 140,139,647 | |
| 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 37,710,000 | 38,674,244 | |
| 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 21,756,000 | 23,331,134 | |
| 4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 82,528,000 | 88,509,629 | |
| 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 61,899,000 | 66,098,228 | |
| 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 110,485,000 | 117,349,433 | |
| 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 204,225,000 | 219,253,917 | |
| 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 378,568,000 | 403,152,205 | |
| 7 5 5 号 利付商工債 | 260,000,000 | 260,988,000 | |

| | | | | |
|---------|----------------------|----------------|----------------|--|
| | い第769号 利付商工債 | 200,000,000 | 201,180,000 | |
| | い第779号 利付商工債 | 200,000,000 | 201,248,000 | |
| | 760号 利附農林債 | 300,000,000 | 301,998,000 | |
| | 764号 利附農林債 | 500,000,000 | 503,410,000 | |
| | 282回 利附信金中金債 | 300,000,000 | 301,209,000 | |
| | 293回 利附信金中金債 | 400,000,000 | 402,192,000 | |
| | 302回 利附信金中金債 | 300,000,000 | 301,686,000 | |
| | 186号 利附商工債（3年） | 200,000,000 | 200,476,000 | |
| | 21回 政保中日本高速道路債券 | 300,000,000 | 306,951,000 | |
| | 5回 中日本高速道路債券 | 200,000,000 | 206,500,000 | |
| | 55回 鉄道建設運輸施設債 | 500,000,000 | 524,255,000 | |
| 特殊債券 合計 | | 18,287,416,000 | 18,970,399,799 | |
| 社債券 | 1回 スタンダード・チャータード円貨社債 | 100,000,000 | 99,869,000 | |
| | 337回 東京交通債 | 200,000,000 | 217,654,000 | |
| | 27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債 | 200,000,000 | 200,198,000 | |
| | 22回 中日本高速道路債券 | 300,000,000 | 311,280,000 | |
| | 7回 キリンホールディングス社債 | 100,000,000 | 104,391,000 | |
| | 9回 日本たばこ産業社債 | 200,000,000 | 200,992,000 | |
| | 3回 セブン&アイ・ホールディングス社債 | 100,000,000 | 102,777,000 | |
| | 41回 住友化学社債 | 100,000,000 | 104,216,000 | |
| | 37回 三菱化学社債 | 100,000,000 | 103,124,000 | |
| | 8回 プリヂストン社債 | 200,000,000 | 200,794,000 | |
| | 64回 新日本製鐵社債 | 100,000,000 | 104,433,000 | |
| | 11回 パナソニック社債 | 100,000,000 | 101,253,000 | |
| | 12回 パナソニック社債 | 200,000,000 | 201,588,000 | |
| | 56回 日産自動車社債 | 100,000,000 | 101,355,000 | |
| | 14回 トヨタ自動車社債 | 200,000,000 | 210,094,000 | |
| | 16回 トヨタ自動車社債 | 100,000,000 | 103,260,000 | |
| | 49回 伊藤忠商事社債 | 100,000,000 | 103,237,000 | |
| | 94回 丸紅社債 | 100,000,000 | 103,964,000 | |
| | 45回 住友商事社債 | 100,000,000 | 103,476,000 | |
| | 47回 住友商事社債 | 100,000,000 | 102,362,000 | |
| | 69回 三菱商事社債 | 300,000,000 | 308,037,000 | |
| | 48回 クレディセゾン社債 | 100,000,000 | 103,369,000 | |
| | 7回 みずほコーポレート銀行劣後社債 | 100,000,000 | 105,557,000 | |
| | 7回 東京三菱銀行劣後社債 | 200,000,000 | 211,440,000 | |
| | 25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債 | 200,000,000 | 208,448,000 | |
| | 28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債 | 200,000,000 | 210,816,000 | |
| | 32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債 | 300,000,000 | 318,270,000 | |
| | 4回 りそな銀行劣後社債 | 100,000,000 | 106,246,000 | |
| | 6回 りそな銀行劣後社債 | 100,000,000 | 105,763,000 | |
| | 7回 三菱UFJ信託銀行劣後債 | 200,000,000 | 209,318,000 | |
| | 9回 三菱UFJ信託銀行劣後債 | 100,000,000 | 106,152,000 | |
| | 12回 住友信託銀行劣後債 | 100,000,000 | 104,292,000 | |
| | 10回 三井住友信託銀行社債 | 200,000,000 | 206,416,000 | |
| | 10回 セブン銀行社債 | 100,000,000 | 104,305,000 | |
| | 20回 三井住友銀行劣後社債 | 200,000,000 | 210,406,000 | |

| | | | | |
|---------|----------------|-------------|-------------|--|
| 2 2 回 | 三井住友銀行劣後社債 | 200,000,000 | 209,084,000 | |
| 2 3 回 | 三井住友銀行劣後社債 | 400,000,000 | 421,868,000 | |
| 1 4 回 | みずほ銀行劣後特約付社債 | 200,000,000 | 210,560,000 | |
| 2 3 回 | ホンダファイナンス社債 | 100,000,000 | 100,372,000 | |
| 1 5 回 | トヨタファイナンス社債 | 200,000,000 | 211,576,000 | |
| 4 7 回 | 日立キャピタル社債 | 200,000,000 | 206,500,000 | |
| 1 6 4 回 | オリックス社債 | 100,000,000 | 102,426,000 | |
| 1 6 7 回 | オリックス社債 | 200,000,000 | 200,986,000 | |
| 1 4 回 | 大和証券グループ本社社債 | 100,000,000 | 103,552,000 | |
| 2 6 回 | 野村ホールディングス社債 | 100,000,000 | 105,191,000 | |
| 4 6 回 | 野村ホールディングス社債 | 200,000,000 | 201,382,000 | |
| 3 8 回 | 三井不動産社債 | 200,000,000 | 208,262,000 | |
| 7 2 回 | 三菱地所社債 | 100,000,000 | 114,128,000 | |
| 9 0 回 | 三菱地所社債 | 100,000,000 | 102,105,000 | |
| 9 6 回 | 三菱地所社債 | 200,000,000 | 207,628,000 | |
| 8 7 回 | 住友不動産社債 | 100,000,000 | 102,040,000 | |
| 8 回 | エヌ・ティ・ティ都市開発社債 | 100,000,000 | 102,380,000 | |
| 1 5 回 | 東日本旅客鉄道社債 | 300,000,000 | 328,116,000 | |
| 1 9 回 | 東日本旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 111,546,000 | |
| 3 9 回 | 東日本旅客鉄道社債 | 300,000,000 | 346,341,000 | |
| 5 2 回 | 東日本旅客鉄道社債 | 300,000,000 | 306,294,000 | |
| 5 6 回 | 東日本旅客鉄道社債 | 300,000,000 | 310,011,000 | |
| 9 回 | 西日本旅客鉄道社債 | 200,000,000 | 222,552,000 | |
| 1 0 回 | 西日本旅客鉄道社債 | 300,000,000 | 337,998,000 | |
| 5 回 | 東海旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 107,806,000 | |
| 6 回 | 東海旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 111,637,000 | |
| 1 1 回 | 東海旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 106,108,000 | |
| 1 4 回 | 東海旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 114,526,000 | |
| 1 5 回 | 東海旅客鉄道社債 | 200,000,000 | 209,638,000 | |
| 2 3 回 | 東海旅客鉄道社債 | 100,000,000 | 102,795,000 | |
| 6 0 回 | 日本電信電話社債 | 300,000,000 | 313,914,000 | |
| 1 5 回 | ＮＴＴドコモ社債 | 200,000,000 | 205,652,000 | |
| 4 5 5 回 | 東京電力社債 | 200,000,000 | 206,598,000 | |
| 5 4 2 回 | 東京電力社債 | 500,000,000 | 509,145,000 | |
| 4 7 6 回 | 中部電力社債 | 100,000,000 | 103,041,000 | |
| 4 9 6 回 | 中部電力社債 | 500,000,000 | 519,005,000 | |
| 4 1 0 回 | 関西電力社債 | 300,000,000 | 310,626,000 | |
| 4 9 2 回 | 関西電力社債 | 200,000,000 | 202,174,000 | |
| 4 9 3 回 | 関西電力社債 | 200,000,000 | 202,164,000 | |
| 3 7 7 回 | 中国電力社債 | 200,000,000 | 211,344,000 | |
| 2 6 0 回 | 北陸電力社債 | 100,000,000 | 107,374,000 | |
| 2 8 1 回 | 北陸電力社債 | 200,000,000 | 205,052,000 | |
| 4 7 1 回 | 東北電力社債 | 200,000,000 | 211,900,000 | |
| 4 7 3 回 | 東北電力社債 | 300,000,000 | 304,989,000 | |
| 2 3 7 回 | 四国電力社債 | 100,000,000 | 103,712,000 | |
| 2 5 3 回 | 四国電力社債 | 200,000,000 | 209,860,000 | |
| 4 2 3 回 | 九州電力社債 | 200,000,000 | 204,412,000 | |
| 4 2 4 回 | 九州電力社債 | 200,000,000 | 212,148,000 | |
| 4 2 6 回 | 九州電力社債 | 400,000,000 | 419,644,000 | |
| 3 2 0 回 | 北海道電力社債 | 200,000,000 | 203,524,000 | |

| | | | | |
|--------|-------------------|-----------------|-----------------|--|
| | 3 2 1 回 北海道電力社債 | 161,000,000 | 167,288,660 | |
| | 1 3 回 電源開発社債 | 200,000,000 | 228,114,000 | |
| | 3 8 回 電源開発社債 | 300,000,000 | 314,406,000 | |
| | 1 7 回 東京ガス社債 | 100,000,000 | 103,761,000 | |
| | 1 8 回 大阪ガス社債 | 100,000,000 | 107,868,000 | |
| | 2 7 回 N T T データ社債 | 100,000,000 | 103,763,000 | |
| 社債券 合計 | | 16,361,000,000 | 17,116,038,660 | |
| 合計 | | 349,912,816,000 | 382,957,897,984 | |

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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 1,299,284,011 | 416,711,515 |
| 投資証券 | | 23,706,646,700 | 29,785,016,500 |
| 未収配当金 | | 165,028,773 | 244,430,214 |
| 流動資産合計 | | 25,170,959,484 | 30,446,158,229 |
| 資産合計 | | 25,170,959,484 | 30,446,158,229 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 1,220,761,659 | 346,446,495 |
| 未払解約金 | | - | 10,447,000 |
| 流動負債合計 | | 1,220,761,659 | 356,893,495 |
| 負債合計 | | 1,220,761,659 | 356,893,495 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 13,431,805,489 | 16,468,770,229 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 10,518,392,336 | 13,620,494,505 |
| 元本等合計 | | 23,950,197,825 | 30,089,264,734 |
| 純資産合計 | | 23,950,197,825 | 30,089,264,734 |
| 負債純資産合計 | | 25,170,959,484 | 30,446,158,229 |

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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--|-----------------|-----------------|
| 1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 15,337,732,833円 | 13,431,805,489円 |
| 同期中追加設定元本額 | 7,382,146,033円 | 5,275,030,189円 |
| 同期中一部解約元本額 | 9,288,073,377円 | 2,238,065,449円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| MITO ラップ型ファンド（安定型） | 770,094円 | 557,314円 |
| MITO ラップ型ファンド（中立型） | 1,796,596円 | 1,611,236円 |
| MITO ラップ型ファンド（積極型） | 4,124,246円 | 3,753,394円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 1,604,893円 | 1,659,417円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 1,589,159円 | 1,554,325円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 1,669,466円 | 1,957,290円 |
| たわらノーロード 国内リート | 451,232,885円 | 477,367,537円 |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ向け> | 5,015,341円 | 58,995,435円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 16,125,924円 | 14,829,308円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 341,068,239円 | 335,652,444円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | 4,609,929円 | 3,962,722円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10） | 9,473,646円 | 13,096,570円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20） | 27,212,976円 | 33,814,651円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30） | 58,441,189円 | 76,095,479円 |
| 投資のソムリエ | 360,195,576円 | 1,043,453,876円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 8,275,506円 | 30,812,192円 |

| | | | |
|-----|--|-----------------|-----------------|
| | D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金> | 32,820,619円 | 40,650,681円 |
| | 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 1,819,886円 | 8,656,798円 |
| | ダイナミック・ナビゲーション | 345,841円 | 164,273円 |
| | リスク抑制世界8資産バランスファンド | - 円 | 188,090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） | 993,509,510円 | 977,920,018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） | 1,072,040,993円 | 1,052,894,526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） | 2,091,078,459円 | 1,888,734,682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） | 7,366,841,007円 | 8,041,376,195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） | 59,812,821円 | 57,813,260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） | 231,706,681円 | 909,317,488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） | 251,146,339円 | 1,354,403,360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） | 37,477,668円 | 37,477,668円 |
| | 計 | 13,431,805,489円 | 16,468,770,229円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 13,431,805,489口 | 16,468,770,229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28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|--------------------------|---|------------------------------|
| 1． 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 同左 |
| 3． 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

２．金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|---|--------------|
| １． 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| ２． 時価の算定方法 | <p>(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(２)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 投資証券 | 612,069,881 | 137,177,093 |
| 合計 | 612,069,881 | 137,177,093 |

（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28年6月7日から平成28年7月11日まで及び平成28年6月7日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.7831円 | 1.8270円 |
| （1万口当たり純資産額） | （17,831円） | （18,270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29年1月11日現在

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|------|-----------------------|-------------|---------------|----|
| 投資証券 | GLP投資法人 | 7,069 | 945,832,200 | |
| | MCUBS MidCity投資法人 | 659 | 223,730,500 | |
| | SIA不動産投資法人 | 235 | 92,472,500 | |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 3,797 | 280,978,000 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 638 | 83,195,200 | |
| | さくら総合リート投資法人 | 825 | 67,897,500 | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 1,648 | 883,328,000 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 3,345 | 1,010,190,000 | |
| | イオンリート投資法人 | 3,244 | 410,366,000 | |
| | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 2,021 | 199,472,700 | |
| | インヴィンシブル投資法人 | 9,108 | 478,170,000 | |
| | オリックス不動産投資法人 | 6,255 | 1,142,163,000 | |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 480 | 205,680,000 | |
| | ケネディクス・オフィス投資法人 | 1,003 | 650,947,000 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル投資法人 | 865 | 275,935,000 | |
| | ケネディクス商業リート投資法人 | 1,047 | 278,711,400 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 1,272 | 322,324,800 | |
| | サムティ・レジデンシャル投資法人 | 701 | 61,407,600 | |
| | ジャパン・シニアリビング投資法人 | 210 | 30,198,000 | |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 9,321 | 745,680,000 | |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 3,235 | 464,222,500 | |
| | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 3,244 | 2,085,892,000 | |
| | スターアジア不動産投資法人 | 854 | 84,631,400 | |
| | スターツプロシード投資法人 | 636 | 97,308,000 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 454 | 50,167,000 | |
| | ヒューリックリート投資法人 | 2,589 | 488,285,400 | |
| | フロンティア不動産投資法人 | 1,229 | 620,645,000 | |
| | プレミアム投資法人 | 3,263 | 440,178,700 | |
| | ヘルスケア&メディカル投資法人 | 299 | 31,664,100 | |
| | マリモ地方創生リート投資法人 | 225 | 19,980,000 | |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 7,540 | 1,369,264,000 | |
| | ラサールロジポート投資法人 | 2,725 | 304,927,500 | |
| | 阪急リート投資法人 | 1,480 | 217,116,000 | |
| | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 555 | 184,537,500 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 874 | 477,204,000 | |
| | 森トラスト総合リート投資法人 | 3,271 | 586,817,400 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 4,338 | 674,125,200 | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 405 | 250,290,000 | |
| | 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 | 2,739 | 344,292,300 | |

| | | | |
|--------------------|---------|----------------|--|
| 積水ハウス・リート投資法人 | 2,215 | 331,585,500 | |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 437 | 36,445,800 | |
| 大和ハウスリート投資法人 | 3,764 | 1,080,268,000 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 1,234 | 712,018,000 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 2,422 | 352,401,000 | |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 1,201 | 592,693,500 | |
| 日本ビルファンド投資法人 | 3,499 | 2,277,849,000 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 2,163 | 987,409,500 | |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 4,716 | 1,141,272,000 | |
| 日本ヘルスケア投資法人 | 185 | 32,763,500 | |
| 日本リート投資法人 | 971 | 272,753,900 | |
| 日本リテールファンド投資法人 | 6,324 | 1,544,320,800 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 2,180 | 528,868,000 | |
| 日本賃貸住宅投資法人 | 4,064 | 334,873,600 | |
| 福岡リート投資法人 | 1,851 | 342,249,900 | |
| 平和不動産リート投資法人 | 2,514 | 209,667,600 | |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 10,365 | 1,827,349,500 | |
| 投資証券 合計 | 143,803 | 29,785,016,500 | |
| 合計 | 143,803 | 29,785,016,500 | |

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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 2,149,484,159 | 4,450,881,435 |
| コール・ローン | | 555,810,350 | 136,302,820 |
| 株式 | | 234,745,691,060 | 263,044,401,726 |
| 投資信託受益証券 | | 849,632,766 | 833,914,594 |
| 投資証券 | | 6,182,483,947 | 6,182,633,954 |
| 派生商品評価勘定 | | 157,290,864 | 29,766,443 |
| 未収入金 | | 12,533,139 | 2,788,032 |
| 未収配当金 | | 327,009,097 | 330,630,621 |
| 差入委託証拠金 | | 1,743,893,635 | 1,428,687,077 |
| 流動資産合計 | | 246,723,829,017 | 276,440,006,702 |
| 資産合計 | | 246,723,829,017 | 276,440,006,702 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 2,775,706 | 880,817 |
| 未払金 | | 136,523,753 | - |
| 未払解約金 | | 138,690,000 | 229,401,000 |
| 流動負債合計 | | 277,989,459 | 230,281,817 |
| 負債合計 | | 277,989,459 | 230,281,817 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 102,470,324,899 | 92,727,414,724 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 143,975,514,659 | 183,482,310,161 |
| 元本等合計 | | 246,445,839,558 | 276,209,724,885 |
| 純資産合計 | | 246,445,839,558 | 276,209,724,885 |
| 負債純資産合計 | | 246,723,829,017 | 276,440,006,702 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-----|--|-----------------|------------------|
| 1 . | 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額 | 97,735,137,391円 | 102,470,324,899円 |
| | 同期中追加設定元本額 | 15,253,856,269円 | 5,887,330,395円 |
| | 同期中一部解約元本額 | 10,518,668,761円 | 15,630,240,570円 |
| | 元本の内訳 | | |
| | ファンド名 | | |
| | D I A M外国株式パッシブ・ ファンド | 1,860,301,307円 | 1,946,959,402円 |
| | M I T O ラップ型ファンド （安定型） | 7,070,818円 | 4,434,740円 |
| | M I T O ラップ型ファンド （中立型） | 16,314,685円 | 12,888,567円 |
| | M I T O ラップ型ファンド （積極型） | 37,700,196円 | 29,749,544円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド（安定型） | 14,738,824円 | 13,210,663円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド（中立型） | 14,433,689円 | 12,430,317円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド（積極型） | 15,258,200円 | 15,508,554円 |
| | たわらノーロード 先進国株式 | 1,621,487,264円 | 2,079,682,896円 |
| | たわらノーロード 先進国株式 ＜ラップ向け＞ | 426,031円 | 425,695円 |
| | たわらノーロード 先進国株式 ＜為替ヘッジあり＞ | - 円 | 61,132,652円 |
| | D I A M外国株式インデックス ファンド＜D C年金＞ | 35,148,925,218円 | 35,568,884,895円 |
| | D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞1 安定型 | 175,410,587円 | 179,962,215円 |
| | D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞2 安定・成長型 | 919,847,850円 | 953,771,814円 |
| | D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞3 成長型 | 1,122,290,696円 | 1,115,778,433円 |
| | D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド | 145,919,659円 | 153,484,704円 |
| | D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド | 406,699,674円 | 427,386,666円 |
| | D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド | 343,433,795円 | 346,239,329円 |
| | マネックス資産設計ファンド＜ 隔月分配型＞ | 45,778,536円 | 42,363,606円 |
| | マネックス資産設計ファンド＜ 育成型＞ | 951,244,965円 | 938,046,218円 |
| | マネックス資産設計ファンド エボリューション | 231,426,141円 | 228,756,848円 |
| | D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国1 0） | 23,489,567円 | 26,508,121円 |
| | D I A M D C 8資産バラン スファンド（新興国2 0） | 49,505,505円 | 51,983,023円 |

| | | |
|---|-----------------|-----------------------|
| D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国30） | 95,169,676円 | 104,518,603円 |
| 投資のソムリエ | 401,696,368円 | 826,420,611円 |
| クルーズコントロール | 126,776,777円 | 827,877,963円 |
| 投資のソムリエ＜DC年金＞ | 9,319,256円 | 24,426,190円 |
| D I A M 8 資産バランスファ ンドN＜DC年金＞ | 83,698,246円 | 87,168,309円 |
| D I A M D C バランス・F （成長型） | 28,675,864円 | 42,666,319円 |
| クルーズコントロール＜DC年 金＞ | 34,150円 | 325,530円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド （堅実型） | 943,122円 | 6,117,616円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド （積極型） | 1,679,841円 | 13,598,018円 |
| 投資のソムリエ＜DC年金＞リ スク抑制型 | 2,039,677円 | 2,348,013円 |
| ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バラン スファンド | 575,059円 - 円 | 1,595,132円 49,988円 |
| D I A M外国株式インデックス ファンドVA（適格機関投資家 専用） | 208,719,047円 | 173,737,690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） | 3,250,698,975円 | 3,216,630,874円 |
| D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド（適格機関 投資家限定） | 145,609,101円 | 172,145,175円 |
| D I A M先進国株式パッシブ ファンド（適格機関投資家限 定） | 392,381円 | 392,000円 |
| D I A Mワールドバランス25 VA（適格機関投資家限定） | 40,539,307円 | 29,023,964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） | 223,630,974円 | 168,073,193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） | 363,341,022円 | 320,310,030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） | 28,499,478円 | 21,588,870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） | 169,736,421円 | 140,963,619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） | 14,847,320円 | 11,674,565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） | 27,732,262円 | 17,327,751円 |

| | | |
|--|-----------------|----------------|
| D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限 定） | 2,989,076,156円 | 1,121,411,686円 |
| D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限 定） | 1,587,774,045円 | 645,440,187円 |
| D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定） | 1,003,393,476円 | 779,496,270円 |
| D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限 定） | 1,075,482,053円 | 895,242,912円 |
| D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定） | 3,225,603,207円 | 2,786,274,684円 |
| D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A（適格機関投 資家限定） | 1,334,768,278円 | 1,077,755,283円 |
| D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2（適格機関 投資家限定） | 2,026,788,286円 | 1,185,802,464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） | 1,567,593,129円 | 1,269,093,076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） | 1,067,314,685円 | 831,466,203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） | 12,333,699円 | 13,494,600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） | 5,086,524,668円 | 3,822,906,387円 |
| D I A M世界バランスファンド 3 5 V A（適格機関投資家限 定） | 1,739,502,696円 | 1,523,731,124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） | 11,521,229,462円 | 9,666,114,191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） | 632,413,399円 | 536,552,271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） | 1,984,726,533円 | 1,642,532,401円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A（適格機関投資 家限定） | 7,261,622,463円 | 6,133,183,873円 |
| D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定） | 32,096,738円 | 25,699,340円 |
| D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定） | 11,009,666円 | 1,714,626円 |
| D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定） | 3,528,117円 | 14,483,642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） | 9,817,602,164円 | 8,250,573,365円 |
| | D I A Mバランス２０ V A（適 格機関投資家限定） | 113,400,844円 | 85,433,865円 |
| | D I A Mバランス４０ V A（適 格機関投資家限定） | 187,990円 | 169,337円 |
| | D I A Mバランス６０ V A（適 格機関投資家限定） | 295,614円 | 274,012円 |
| | 計 | 102,470,324,899円 | 92,727,414,724円 |
| ２． | 受益権の総数 | 102,470,324,899口 | 92,727,414,724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28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|-------------------------|---|------------------------------|
| 1．金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3．金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 株式 | 24,559,598,481 | 45,803,894,661 |
| 投資信託受益証券 | 98,471,569 | 57,863,895 |
| 投資証券 | 1,013,874,167 | 572,776,282 |
| 合計 | 25,671,944,217 | 46,434,534,838 |

（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28年2月16日から平成28年7月11日まで及び平成28年2月16日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

| 種類 | 平成28年7月11日 現在 | | | | 平成29年1月11日 現在 | | | |
|------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
| | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | - | - | - | - | 968,141,605 | - | 968,068,200 | 73,405 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 643,540,875 | - | 643,522,500 | 18,375 |
| イギリス・ボンド | - | - | - | - | 74,870,980 | - | 74,867,800 | 3,180 |
| オーストラリア・ドル | - | - | - | - | 40,968,420 | - | 40,978,200 | 9,780 |
| カナダ・ドル | - | - | - | - | 38,533,800 | - | 38,522,000 | 11,800 |
| ユーロ | - | - | - | - | 170,227,530 | - | 170,177,700 | 49,830 |
| 買 建 | 1,051,156,245 | - | 1,050,283,100 | 873,145 | - | - | - | - |
| アメリカ・ドル | 733,254,870 | - | 732,816,000 | 438,870 | - | - | - | - |
| イギリス・ボンド | 78,270,828 | - | 78,228,000 | 42,828 | - | - | - | - |
| オーストラリア・ドル | 26,649,000 | - | 26,645,500 | 3,500 | - | - | - | - |
| カナダ・ドル | 42,537,180 | - | 42,427,000 | 110,180 | - | - | - | - |
| ユーロ | 170,444,367 | - | 170,166,600 | 277,767 | - | - | - | - |
| 合計 | 1,051,156,245 | - | 1,050,283,100 | 873,145 | 968,141,605 | - | 968,068,200 | 73,405 |

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
 - ２．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 - ３．換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

| 種類 | 平成28年7月11日 現在 | | | | 平成29年1月11日 現在 | | | |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 先物取引 | | | | | | | | |
| 買 建 | 5,077,497,639 | - | 5,232,885,942 | 155,388,303 | 5,114,184,278 | - | 5,142,996,499 | 28,812,221 |
| 合計 | 5,077,497,639 | - | 5,232,885,942 | 155,388,303 | 5,114,184,278 | - | 5,142,996,499 | 28,812,221 |

(注) １．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.4050円 | 2.9787円 |
| (1万口当たり純資産額) | (24,050円) | (29,787円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年1月11日現在

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------|---------------------------------------|---------|---------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | AMAZON.COM INC | 30,084 | 795.900 | 23,943,855.600 | |
| | ABBOTT LABORATORIES | 127,914 | 41.290 | 5,281,569.060 | |
| | AES CORP | 45,579 | 11.330 | 516,410.070 | |
| | INTL BUSINESS MACHINES CORP | 67,924 | 165.520 | 11,242,780.480 | |
| | ADOBE SYSTEMS INC | 37,684 | 108.260 | 4,079,669.840 | |
| | CHUBB LTD | 34,845 | 130.460 | 4,545,878.700 | |
| | AGCO CORP | 5,610 | 60.340 | 338,507.400 | |
| | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 15,671 | 145.260 | 2,276,369.460 | |
| | ALLEGHANY CORP | 1,054 | 599.500 | 631,873.000 | |
| | DU PONT (E.I.) DE NEMOURS | 65,207 | 73.560 | 4,796,626.920 | |
| | RALPH LAUREN CORP | 4,703 | 87.940 | 413,581.820 | |
| | ALLSTATE CORP | 27,316 | 73.750 | 2,014,555.000 | |
| | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 53,883 | 117.850 | 6,350,111.550 | |
| | AMGEN INC | 55,670 | 158.760 | 8,838,169.200 | |
| | HESS CORP | 20,421 | 61.450 | 1,254,870.450 | |
| | AMERICAN EXPRESS CO | 58,349 | 76.650 | 4,472,450.850 | |
| | AMERICAN ELECTRIC POWER | 36,960 | 62.120 | 2,295,955.200 | |
| | AFLAC INC | 30,673 | 69.430 | 2,129,626.390 | |
| | AMERICAN INTL GROUP | 79,535 | 67.200 | 5,344,752.000 | |
| | AMERCO | 551 | 369.080 | 203,363.080 | |
| | ANALOG DEVICES | 23,069 | 72.350 | 1,669,042.150 | |
| | ANADARKO PETROLEUM CORP | 41,003 | 69.580 | 2,852,988.740 | |
| | ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 17,266 | 143.670 | 2,480,606.220 | |
| | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 68,862 | 43.610 | 3,003,071.820 | |
| | TIME WARNER | 57,964 | 93.400 | 5,413,837.600 | |
| | JONES LANG LASALLE INC | 3,815 | 106.850 | 407,632.750 | |
| | VALERO ENERGY CORP | 35,405 | 66.530 | 2,355,494.650 | |
| | APACHE CORP | 28,309 | 62.870 | 1,779,786.830 | |
| | ANSYS INC | 5,619 | 94.190 | 529,253.610 | |
| | APPLE INC | 402,214 | 119.110 | 47,907,709.540 | |
| | APPLIED MATERIALS INC | 82,900 | 33.130 | 2,746,477.000 | |
| | ALBEMARLE CORP | 7,904 | 89.880 | 710,411.520 | |
| | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 44,421 | 44.460 | 1,974,957.660 | |
| | PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 7,831 | 77.130 | 604,005.030 | |
| | AMEREN CORP | 17,312 | 51.970 | 899,704.640 | |

| | | | | |
|-------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| ARROW ELECTRONICS INC | 7,403 | 73.100 | 541,159.300 | |
| AUTOLIV INC | 6,197 | 113.130 | 701,066.610 | |
| AUTODESK INC | 14,259 | 79.980 | 1,140,434.820 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 34,227 | 102.200 | 3,497,999.400 | |
| AUTOZONE INC | 2,229 | 793.680 | 1,769,112.720 | |
| AVERY DENNISON CORP | 7,368 | 72.730 | 535,874.640 | |
| AVNET INC | 10,288 | 46.970 | 483,227.360 | |
| BAKER HUGHES INC | 30,916 | 62.380 | 1,928,540.080 | |
| BALL CORP | 12,162 | 75.620 | 919,690.440 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B | 91,251 | 161.470 | 14,734,298.970 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 79,107 | 47.720 | 3,774,986.040 | |
| CR BARD INC | 5,309 | 232.660 | 1,235,191.940 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 37,687 | 46.510 | 1,752,822.370 | |
| BED BATH & BEYOND INC | 10,744 | 40.750 | 437,818.000 | |
| BECTON DICKINSON & CO | 15,808 | 170.940 | 2,702,219.520 | |
| AMETEK INC | 16,775 | 49.870 | 836,569.250 | |
| BE AEROSPACE INC | 8,229 | 61.360 | 504,931.440 | |
| VERIZON COMM INC | 305,099 | 52.760 | 16,097,023.240 | |
| WR BERKLEY CORP | 8,134 | 66.910 | 544,245.940 | |
| BEST BUY CO INC | 21,033 | 43.860 | 922,507.380 | |
| YUM! BRANDS INC | 28,494 | 64.980 | 1,851,540.120 | |
| FIRSTENERGY CORP | 30,796 | 30.370 | 935,274.520 | |
| H&R BLOCK INC | 16,114 | 23.650 | 381,096.100 | |
| BOEING CO | 44,146 | 159.070 | 7,022,304.220 | |
| ROBERT HALF INTL INC | 10,846 | 49.020 | 531,670.920 | |
| BORGWARNER INC | 14,648 | 40.770 | 597,198.960 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 100,578 | 23.610 | 2,374,646.580 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 9,894 | 73.140 | 723,647.160 | |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC | 1,838 | 429.940 | 790,229.720 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 124,492 | 59.980 | 7,467,030.160 | |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP INC | 3,788 | 143.270 | 542,706.760 | |
| INGREDION INC | 5,305 | 124.080 | 658,244.400 | |
| ONEOK INC | 16,401 | 56.070 | 919,604.070 | |
| UNITED RENTALS INC | 6,332 | 108.900 | 689,554.800 | |
| SEMPRA ENERGY | 18,176 | 101.060 | 1,836,866.560 | |
| FEDEX CORP | 18,672 | 188.420 | 3,518,178.240 | |
| VERISIGN INC | 6,321 | 79.250 | 500,939.250 | |
| AMPHENOL CORP | 23,304 | 67.790 | 1,579,778.160 | |
| BROWN-FORMAN CORP | 16,642 | 44.570 | 741,733.940 | |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 22,337 | 58.450 | 1,305,597.650 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 127,092 | 4.630 | 588,435.960 | |
| CSX CORP | 69,449 | 37.420 | 2,598,781.580 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| CABOT OIL & GAS CORP | 38,049 | 22.170 | 843,546.330 | |
| CAMPBELL SOUP CO | 14,050 | 60.010 | 843,140.500 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 23,239 | 37.630 | 874,483.570 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 13,081 | 149.240 | 1,952,208.440 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 24,212 | 75.220 | 1,821,226.640 | |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED | 27,339 | 54.250 | 1,483,140.750 | |
| CATERPILLAR INC | 44,065 | 93.830 | 4,134,618.950 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 9,832 | 88.210 | 867,280.720 | |
| CELGENE CORP | 57,620 | 119.980 | 6,913,247.600 | |
| CORE LABORATORIES N.V. | 3,612 | 121.430 | 438,605.160 | |
| CITRIX SYSTEMS INC | 10,896 | 90.650 | 987,722.400 | |
| CENTURYLINK INC | 39,384 | 25.200 | 992,476.800 | |
| CERNER CORP | 23,765 | 49.270 | 1,170,901.550 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 269,975 | 86.430 | 23,333,939.250 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 18,822 | 43.580 | 820,262.760 | |
| CIGNA CORP | 19,066 | 140.230 | 2,673,625.180 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 10,982 | 74.520 | 818,378.640 | |
| CINTAS CORP | 6,282 | 114.780 | 721,047.960 | |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 96,233 | 3.630 | 349,325.790 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 375,461 | 30.380 | 11,406,505.180 | |
| CLOROX COMPANY | 9,331 | 119.380 | 1,113,934.780 | |
| COCA-COLA CO/THE | 306,559 | 41.040 | 12,581,181.360 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 63,128 | 65.390 | 4,127,939.920 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A | 25,301 | 81.930 | 2,072,910.930 | |
| COMERICA INC | 12,068 | 69.610 | 840,053.480 | |
| COMCAST CORP-CL A | 179,552 | 70.920 | 12,733,827.840 | |
| CA INC | 22,732 | 33.010 | 750,383.320 | |
| COMPUTER SCIENCES CORP | 10,556 | 60.550 | 639,165.800 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 31,942 | 38.290 | 1,223,059.180 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 23,660 | 72.640 | 1,718,662.400 | |
| CMS ENERGY CORP | 22,372 | 41.510 | 928,661.720 | |
| COOPER COS INC | 3,794 | 181.800 | 689,749.200 | |
| MOLSON COORS BREWING CO | 13,855 | 96.410 | 1,335,760.550 | |
| CORNING INC | 79,197 | 24.490 | 1,939,534.530 | |
| WR GRACE & CO | 5,923 | 68.870 | 407,917.010 | |
| SEALED AIR CORP | 16,041 | 47.800 | 766,759.800 | |
| CUMMINS INC | 12,194 | 139.560 | 1,701,794.640 | |
| DR HORTON INC | 24,498 | 28.150 | 689,618.700 | |
| DANAHER CORP | 46,324 | 81.100 | 3,756,876.400 | |
| MOODY'S CORP | 12,924 | 94.670 | 1,223,515.080 | |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 45,469 | 56.660 | 2,576,273.540 | |
| TARGET CORP | 40,245 | 71.430 | 2,874,700.350 | |
| DEERE & CO | 20,474 | 104.890 | 2,147,517.860 | |

| | | | | |
|----------------------------|---------|---------|----------------|--|
| MORGAN STANLEY | 106,341 | 43.060 | 4,579,043.460 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 17,375 | 56.690 | 984,988.750 | |
| COSTAR GROUP INC | 2,278 | 194.200 | 442,387.600 | |
| THE WALT DISNEY CO | 113,984 | 108.380 | 12,353,585.920 | |
| DOLLAR TREE INC | 17,493 | 77.960 | 1,363,754.280 | |
| DOVER CORP | 10,736 | 77.020 | 826,886.720 | |
| DOW CHEMICAL | 83,895 | 57.670 | 4,838,224.650 | |
| OMNICOM GROUP | 16,993 | 85.240 | 1,448,483.320 | |
| DTE ENERGY CO | 13,122 | 97.430 | 1,278,476.460 | |
| DUKE ENERGY CORP | 51,765 | 76.500 | 3,960,022.500 | |
| FLOWERVE CORP | 8,406 | 49.010 | 411,978.060 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 9,436 | 72.250 | 681,751.000 | |
| EBAY INC | 82,914 | 30.250 | 2,508,148.500 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 761,401 | 22.940 | 17,466,538.940 | |
| CITIGROUP INC | 216,601 | 60.230 | 13,045,878.230 | |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 10,193 | 77.330 | 788,224.690 | |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 18,740 | 36.790 | 689,444.600 | |
| EATON CORP PLC | 34,800 | 67.210 | 2,338,908.000 | |
| EATON VANCE CORP | 9,184 | 43.210 | 396,840.640 | |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 20,877 | 25.770 | 538,000.290 | |
| DISH NETWORK CORP | 16,150 | 61.740 | 997,101.000 | |
| ECOLAB INC | 20,098 | 117.860 | 2,368,750.280 | |
| ELECTRONIC ARTS INC | 23,105 | 78.850 | 1,821,829.250 | |
| SALESFORCE.COM INC | 49,119 | 73.980 | 3,633,823.620 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 48,079 | 56.690 | 2,725,598.510 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 8,221 | 73.290 | 602,517.090 | |
| WEATHERFORD INTL PLC | 70,440 | 5.680 | 400,099.200 | |
| ENTERGY CORP | 13,984 | 71.240 | 996,220.160 | |
| EOG RESOURCES INC | 42,707 | 103.400 | 4,415,903.800 | |
| EQUIFAX INC | 8,495 | 120.040 | 1,019,739.800 | |
| EQT CORP | 13,874 | 63.340 | 878,779.160 | |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE | 16,134 | 77.350 | 1,247,964.900 | |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL | 14,279 | 52.870 | 754,930.730 | |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 47,994 | 72.500 | 3,479,565.000 | |
| EXXON MOBIL CORP | 309,835 | 85.930 | 26,624,121.550 | |
| FMC CORP | 10,694 | 57.700 | 617,043.800 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 34,612 | 118.580 | 4,104,290.960 | |
| ASSURANT INC | 4,960 | 94.200 | 467,232.000 | |
| FASTENAL CO | 21,654 | 46.510 | 1,007,127.540 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 57,732 | 27.070 | 1,562,805.240 | |
| M&T BANK CORP | 10,664 | 156.700 | 1,671,048.800 | |
| FISERV INC | 15,880 | 108.230 | 1,718,692.400 | |
| FLIR SYSTEMS INC | 11,623 | 35.770 | 415,754.710 | |
| MACY'S INC | 24,512 | 30.300 | 742,713.600 | |
| FORD MOTOR CO | 279,141 | 12.850 | 3,586,961.850 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 27,510 | 40.400 | 1,111,404.000 | |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 96,812 | 15.550 | 1,505,426.600 | |
| FLEX LTD | 44,363 | 14.620 | 648,587.060 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 12,176 | 52.420 | 638,265.920 | |
| TEGNA INC | 16,963 | 21.490 | 364,534.870 | |
| GAP INC/THE | 18,295 | 23.910 | 437,433.450 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 17,477 | 58.170 | 1,016,637.090 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 19,255 | 176.360 | 3,395,811.800 | |
| GENERAL MILLS INC | 43,879 | 60.450 | 2,652,485.550 | |
| GENUINE PARTS CO | 11,094 | 97.280 | 1,079,224.320 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 98,271 | 75.010 | 7,371,307.710 | |
| GARTNER INC | 6,829 | 97.620 | 666,646.980 | |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 18,097 | 32.070 | 580,370.790 | |
| MCKESSON CORP | 16,986 | 146.820 | 2,493,884.520 | |
| NVIDIA CORP | 39,760 | 106.470 | 4,233,247.200 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 669,933 | 31.370 | 21,015,798.210 | |
| WW GRAINGER INC | 4,486 | 230.720 | 1,035,009.920 | |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 22,236 | 15.450 | 343,546.200 | |
| HALLIBURTON CO | 64,633 | 54.640 | 3,531,547.120 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 29,522 | 43.500 | 1,284,207.000 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 27,115 | 242.570 | 6,577,285.550 | |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 12,901 | 58.500 | 754,708.500 | |
| HARMAN INTERNATIONAL INDUSTRIE | 5,679 | 110.650 | 628,381.350 | |
| HARRIS CORP | 8,954 | 101.710 | 910,711.340 | |
| HASBRO INC | 8,909 | 82.860 | 738,199.740 | |
| HENRY SCHEIN INC | 5,713 | 158.090 | 903,168.170 | |
| HELMERICH & PAYNE INC | 7,213 | 78.840 | 568,672.920 | |
| HERSHEY FOODS CORP | 11,306 | 104.830 | 1,185,207.980 | |
| HP INC | 131,066 | 14.690 | 1,925,359.540 | |
| F5 NETWORKS INC | 4,874 | 144.240 | 703,025.760 | |
| CROWN HOLDINGS INC NPR | 11,481 | 53.170 | 610,444.770 | |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 63,698 | 55.810 | 3,554,985.380 | |
| SBA COMMUNICATIONS CORP- CL A | 9,156 | 102.600 | 939,405.600 | |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 3,447 | 152.460 | 525,529.620 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 27,740 | 28.400 | 787,816.000 | |
| HOLLYFRONTIER CORP | 13,888 | 30.710 | 426,500.480 | |
| HOLOGIC INC | 17,500 | 40.435 | 707,612.500 | |
| UNUM GROUP | 16,000 | 44.600 | 713,600.000 | |
| HOME DEPOT INC | 92,204 | 136.100 | 12,548,964.400 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 12,887 | 90.400 | 1,164,984.800 | |
| HORMEL FOODS CORP | 23,322 | 34.920 | 814,404.240 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 31,952 | 24.950 | 797,202.400 | |
| HUMANA INC | 11,580 | 200.950 | 2,327,001.000 | |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 5,927 | 97.720 | 579,186.440 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 75,161 | 13.330 | 1,001,896.130 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| RED HAT INC | 13,472 | 71.660 | 965,403.520 | |
| BIOGEN INC | 16,273 | 297.790 | 4,845,936.670 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 23,599 | 122.570 | 2,892,529.430 | |
| INTUIT INC | 17,739 | 116.110 | 2,059,675.290 | |
| IDEXX LABORATORIES INC | 7,050 | 120.710 | 851,005.500 | |
| INGERSOLL-RAND PLC | 19,490 | 76.010 | 1,481,434.900 | |
| INTEL CORP | 353,216 | 36.540 | 12,906,512.640 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 5,578 | 115.480 | 644,147.440 | |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 28,375 | 53.780 | 1,526,007.500 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 29,157 | 23.310 | 679,649.670 | |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 7,931 | 57.290 | 454,366.990 | |
| INCYTE CORP | 12,360 | 119.300 | 1,474,548.000 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 204,804 | 116.160 | 23,790,032.640 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 29,304 | 48.430 | 1,419,192.720 | |
| KLA-TENCOR CORP | 11,724 | 79.330 | 930,064.920 | |
| DEVON ENERGY CORP | 34,184 | 46.700 | 1,596,392.800 | |
| WESTAR ENERGY INC | 9,911 | 54.580 | 540,942.380 | |
| KELLOGG CO | 18,922 | 71.660 | 1,355,950.520 | |
| KEYCORP | 81,264 | 18.480 | 1,501,758.720 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 26,663 | 114.360 | 3,049,180.680 | |
| BLACKROCK INC/NEW YORK | 9,030 | 380.310 | 3,434,199.300 | |
| KOHL'S CORP | 14,862 | 41.210 | 612,463.020 | |
| KROGER CO | 69,381 | 33.190 | 2,302,755.390 | |
| LAM RESEARCH CORP | 11,522 | 108.470 | 1,249,791.340 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 7,455 | 87.980 | 655,890.900 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 12,622 | 70.280 | 887,074.160 | |
| LEGGETT & PLATT INC | 9,588 | 48.010 | 460,319.880 | |
| LENNAR CORP | 14,850 | 43.730 | 649,390.500 | |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 21,462 | 23.610 | 506,717.820 | |
| ELI LILLY & CO | 74,120 | 76.270 | 5,653,132.400 | |
| L BRANDS INC | 18,583 | 61.350 | 1,140,067.050 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 17,276 | 67.160 | 1,160,256.160 | |
| LINEAR TECH CORP | 17,456 | 62.330 | 1,088,032.480 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 51,738 | 113.920 | 5,893,992.960 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 24,266 | 48.100 | 1,167,194.600 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 19,723 | 256.170 | 5,052,440.910 | |
| LOEWS CORP | 21,346 | 46.470 | 991,948.620 | |
| RANGE RESOURCES CORP | 13,697 | 33.360 | 456,931.920 | |
| LOWE'S COS INC | 65,195 | 71.210 | 4,642,535.950 | |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 47,031 | 75.430 | 3,547,548.330 | |
| SCANA CORP | 10,902 | 71.020 | 774,260.040 | |

| | | | | |
|----------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 32,198 | 29.620 | 953,704.760 | |
| MCCORMICK & CO INC | 9,163 | 89.790 | 822,745.770 | |
| MCDONALD'S CORPORATION | 63,662 | 120.250 | 7,655,355.500 | |
| S&P GLOBAL INC | 20,295 | 111.350 | 2,259,848.250 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 3,272 | 219.420 | 717,942.240 | |
| MANPOWERGROUP INC | 5,703 | 90.270 | 514,809.810 | |
| MARKEL CORPORATION | 989 | 896.670 | 886,806.630 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 15,776 | 99.140 | 1,564,032.640 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 38,323 | 67.510 | 2,587,185.730 | |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO | 4,056 | 75.330 | 305,538.480 | |
| MASCO CORP | 23,043 | 32.210 | 742,215.030 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 4,387 | 220.560 | 967,596.720 | |
| MATTEL INC | 24,003 | 29.910 | 717,929.730 | |
| METLIFE INC | 70,719 | 53.930 | 3,813,875.670 | |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 20,342 | 40.890 | 831,784.380 | |
| MEDTRONIC PLC | 104,227 | 74.900 | 7,806,602.300 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 43,373 | 38.380 | 1,664,655.740 | |
| CVS HEALTH CORP | 79,353 | 82.670 | 6,560,112.510 | |
| MERCK & CO. INC. | 206,907 | 59.920 | 12,397,867.440 | |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 7,176 | 132.060 | 947,662.560 | |
| MICROSOFT CORP | 553,414 | 62.620 | 34,654,784.680 | |
| MICRON TECH INC | 76,146 | 22.480 | 1,711,762.080 | |
| MIDDLEBY CORP | 4,100 | 132.410 | 542,881.000 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 15,176 | 64.850 | 984,163.600 | |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 34,922 | 14.560 | 508,464.320 | |
| 3M CO | 45,218 | 176.580 | 7,984,594.440 | |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 4,759 | 203.180 | 966,933.620 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 11,150 | 82.630 | 921,324.500 | |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 8,789 | 81.280 | 714,369.920 | |
| MURPHY OIL CORPORATION | 12,443 | 30.800 | 383,244.400 | |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 16,587 | 15.310 | 253,946.970 | |
| MYLAN NV | 34,754 | 38.950 | 1,353,668.300 | |
| ILLUMINA INC | 11,255 | 165.040 | 1,857,525.200 | |
| XCEL ENERGY INC | 37,554 | 40.290 | 1,513,050.660 | |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 26,938 | 37.760 | 1,017,178.880 | |
| NETAPP INC | 20,641 | 35.250 | 727,595.250 | |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 13,740 | 41.610 | 571,721.400 | |
| NEWELL BRANDS INC | 32,324 | 46.970 | 1,518,258.280 | |
| DUN & BRADSTREET CORP | 3,012 | 121.970 | 367,373.640 | |
| NEWMONT MINING CORP | 38,093 | 35.080 | 1,336,302.440 | |
| NIKE INC-CL B | 99,876 | 53.110 | 5,304,414.360 | |

| | | | | |
|---------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| NOBLE ENERGY INC | 31,005 | 36.990 | 1,146,874.950 | |
| NORDSTROM INC | 9,487 | 45.670 | 433,271.290 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 22,604 | 109.260 | 2,469,713.040 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 23,085 | 54.280 | 1,253,053.800 | |
| NISOURCE INC | 22,198 | 21.940 | 487,024.120 | |
| COACH INC | 19,175 | 35.480 | 680,329.000 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 16,090 | 89.270 | 1,436,354.300 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 12,620 | 233.110 | 2,941,848.200 | |
| WELLS FARGO & CO | 358,022 | 54.620 | 19,555,161.640 | |
| NUCOR CORP | 23,780 | 61.220 | 1,455,811.600 | |
| MONSANTO CO | 33,243 | 108.440 | 3,604,870.920 | |
| CHENIERE ENERGY INC | 15,927 | 43.350 | 690,435.450 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 37,294 | 88.980 | 3,318,420.120 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 56,546 | 69.350 | 3,921,465.100 | |
| OGE ENERGY CORP | 16,028 | 33.060 | 529,885.680 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 7,017 | 281.300 | 1,973,882.100 | |
| ORACLE CORP | 231,390 | 38.660 | 8,945,537.400 | |
| PACCAR INC | 26,578 | 66.250 | 1,760,792.500 | |
| EXELON CORP | 69,607 | 35.060 | 2,440,421.420 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 9,981 | 141.830 | 1,415,605.230 | |
| PATTERSON COS INC | 7,169 | 41.790 | 299,592.510 | |
| PAYCHEX INC | 23,141 | 60.810 | 1,407,204.210 | |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 6,526 | 64.890 | 423,472.140 | |
| MEDNAX INC | 7,824 | 68.870 | 538,838.880 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 5,255 | 96.130 | 505,163.150 | |
| PPL CORPORATION | 49,957 | 33.940 | 1,695,540.580 | |
| PEPSICO INC | 107,608 | 101.970 | 10,972,787.760 | |
| PENTAIR PLC | 11,775 | 56.930 | 670,350.750 | |
| PFIZER INC | 453,602 | 33.440 | 15,168,450.880 | |
| CONOCOPHILLIPS | 91,766 | 49.660 | 4,557,099.560 | |
| PVH CORP | 6,682 | 93.850 | 627,105.700 | |
| PG&E CORP | 37,651 | 60.070 | 2,261,695.570 | |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 12,977 | 181.270 | 2,352,340.790 | |
| ALTRIA GROUP INC | 146,055 | 67.720 | 9,890,844.600 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 36,446 | 118.670 | 4,325,046.820 | |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 5,010 | 83.740 | 419,537.400 | |
| GARMIN LTD | 7,795 | 47.930 | 373,614.350 | |
| AETNA INC | 26,111 | 122.670 | 3,203,036.370 | |
| FLUOR CORP (NEW) | 9,821 | 53.080 | 521,298.680 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 19,289 | 96.390 | 1,859,266.710 | |
| PRAXAIR INC | 21,868 | 115.850 | 2,533,407.800 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 32,574 | 161.660 | 5,265,912.840 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 18,304 | 73.480 | 1,344,977.920 | |
| QUEST DIAGNOSTICS | 10,378 | 93.000 | 965,154.000 | |

| | | | | |
|-------------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| PROCTER & GAMBLE CO | 191,488 | 83.490 | 15,987,333.120 | |
| PROGRESSIVE CORP | 44,358 | 36.320 | 1,611,082.560 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 37,115 | 43.460 | 1,613,017.900 | |
| PULTE GROUP INC | 25,477 | 18.690 | 476,165.130 | |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC | 39,870 | 15.850 | 631,939.500 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 10,769 | 77.880 | 838,689.720 | |
| QUALCOMM INC | 109,993 | 65.630 | 7,218,840.590 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 10,187 | 74.430 | 758,218.410 | |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 3,535 | 137.320 | 485,426.200 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 5,659 | 373.000 | 2,110,807.000 | |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC | 4,642 | 123.580 | 573,658.360 | |
| AUTONATION INC | 5,772 | 51.130 | 295,122.360 | |
| RESMED INC | 11,376 | 64.250 | 730,908.000 | |
| US BANCORP | 127,815 | 51.220 | 6,546,684.300 | |
| SEATTLE GENETICS INC /WA | 7,317 | 59.010 | 431,776.170 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 8,674 | 86.310 | 748,652.940 | |
| RITE AID CORP | 85,598 | 8.320 | 712,175.360 | |
| ROSS STORES INC | 30,542 | 66.770 | 2,039,289.340 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 7,820 | 186.000 | 1,454,520.000 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 9,667 | 139.530 | 1,348,836.510 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 13,567 | 85.930 | 1,165,812.310 | |
| RAYTHEON COMPANY | 21,940 | 146.610 | 3,216,623.400 | |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 4,399 | 235.260 | 1,034,908.740 | |
| FMC TECHNOLOGIES INC | 14,816 | 35.790 | 530,264.640 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 46,433 | 115.060 | 5,342,580.980 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 115,309 | 44.170 | 5,093,198.530 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 9,919 | 126.220 | 1,251,976.180 | |
| ROCKWELL COLLINS INC | 9,535 | 91.000 | 867,685.000 | |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC | 21,229 | 117.180 | 2,487,614.220 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 23,052 | 77.650 | 1,789,987.800 | |
| PRICELINE GROUP INC | 3,670 | 1,535.250 | 5,634,367.500 | |
| SCHLUMBERGER LTD | 103,570 | 84.600 | 8,762,022.000 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 88,020 | 41.190 | 3,625,543.800 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 15,255 | 113.670 | 1,734,035.850 | |
| BUNGE LTD | 11,367 | 70.400 | 800,236.800 | |
| SEI INVESTMENTS CO | 11,107 | 51.380 | 570,677.660 | |
| ANTHEM INC | 19,543 | 146.340 | 2,859,922.620 | |

| | | | | |
|--------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 14,348 | 84.830 | 1,217,140.840 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 21,442 | 58.650 | 1,257,573.300 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 5,958 | 278.880 | 1,661,567.040 | |
| CENTENE CORP | 13,899 | 62.120 | 863,405.880 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 9,565 | 47.760 | 456,824.400 | |
| ACUITY BRANDS INC | 3,087 | 208.940 | 644,997.780 | |
| SNAP-ON INC | 3,932 | 176.270 | 693,093.640 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 32,142 | 105.570 | 3,393,230.940 | |
| ADVANCE AUTO PARTS | 5,273 | 169.920 | 895,988.160 | |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 38,997 | 9.970 | 388,800.090 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 24,139 | 71.110 | 1,716,524.290 | |
| SOUTHERN CO | 73,354 | 48.380 | 3,548,866.520 | |
| BB&T CORP | 59,828 | 46.660 | 2,791,574.480 | |
| SOUTHWEST AIRLINES | 11,352 | 51.340 | 582,811.680 | |
| AT&T INC | 460,498 | 40.810 | 18,792,923.380 | |
| CHEVRON CORP | 140,802 | 114.960 | 16,186,597.920 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 11,590 | 117.750 | 1,364,722.500 | |
| STAPLES INC | 52,662 | 9.340 | 491,863.080 | |
| STATE STREET CORP | 29,122 | 81.300 | 2,367,618.600 | |
| STARBUCKS CORP | 108,982 | 57.880 | 6,307,878.160 | |
| STRYKER CORP | 25,117 | 121.900 | 3,061,762.300 | |
| NETFLIX INC | 31,878 | 129.890 | 4,140,633.420 | |
| STERICYCLE INC | 6,853 | 78.040 | 534,808.120 | |
| SUNTRUST BANKS INC | 37,716 | 55.700 | 2,100,781.200 | |
| SYMANTEC CORP | 46,581 | 25.130 | 1,170,580.530 | |
| SYNOPSIS INC | 10,656 | 60.690 | 646,712.640 | |
| SYSCO CORP | 40,782 | 55.330 | 2,256,468.060 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 2,837 | 662.200 | 1,878,661.400 | |
| TELEFLEX INC | 3,203 | 167.880 | 537,719.640 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 67,717 | 35.200 | 2,383,638.400 | |
| TESORO CORP | 9,395 | 81.590 | 766,538.050 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 74,880 | 74.600 | 5,586,048.000 | |
| TEXTRON INC | 19,076 | 49.940 | 952,655.440 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 29,340 | 147.780 | 4,335,865.200 | |
| TIFFANY & CO | 8,733 | 77.140 | 673,663.620 | |
| TOLL BROTHERS INC | 13,356 | 31.120 | 415,638.720 | |
| TORCHMARK CORP | 7,699 | 74.010 | 569,802.990 | |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 11,279 | 53.080 | 598,689.320 | |
| DAVITA INC | 12,245 | 63.630 | 779,149.350 | |
| TRACTOR SUPPLY CO | 9,276 | 76.350 | 708,222.600 | |
| TRIMBLE INC | 20,073 | 30.310 | 608,412.630 | |
| TYSON FOODS INC | 21,621 | 61.210 | 1,323,421.410 | |
| UGI CORP | 12,068 | 45.310 | 546,801.080 | |
| MARATHON OIL CORP | 66,702 | 17.480 | 1,165,950.960 | |

| | | | | |
|-------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| UNION PACIFIC CORP | 62,006 | 103.420 | 6,412,660.520 | |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 59,230 | 111.260 | 6,589,929.800 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 71,272 | 161.580 | 11,516,129.760 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 6,351 | 112.340 | 713,471.340 | |
| VALSPAR CORP | 6,122 | 105.110 | 643,483.420 | |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 6,848 | 89.990 | 616,251.520 | |
| VF CORP | 24,309 | 53.240 | 1,294,211.160 | |
| CBS CORP | 31,152 | 62.690 | 1,952,918.880 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 18,957 | 82.930 | 1,572,104.010 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 9,977 | 123.610 | 1,233,256.970 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 68,696 | 82.670 | 5,679,098.320 | |
| WAL-MART STORES INC | 116,011 | 68.230 | 7,915,430.530 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 34,095 | 69.490 | 2,369,261.550 | |
| WATERS CORP | 5,963 | 137.560 | 820,270.280 | |
| ALLERGAN PLC | 29,478 | 221.250 | 6,522,007.500 | |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 8,755 | 128.740 | 1,127,118.700 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 22,106 | 70.840 | 1,565,989.040 | |
| WABTEC CORP | 7,363 | 85.310 | 628,137.530 | |
| WHIRLPOOL CORP | 5,553 | 183.820 | 1,020,752.460 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 13,529 | 77.310 | 1,045,926.990 | |
| WYNN RESORTS LTD | 6,279 | 94.830 | 595,437.570 | |
| WHOLE FOODS MARKET INC | 22,675 | 30.730 | 696,802.750 | |
| NASDAQ INC | 9,132 | 67.200 | 613,670.400 | |
| CME GROUP INC | 25,149 | 116.300 | 2,924,828.700 | |
| WILLIAMS COS INC | 54,722 | 28.500 | 1,559,577.000 | |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 7,489 | 54.620 | 409,049.180 | |
| LKQ CORP | 22,948 | 31.260 | 717,354.480 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 16,383 | 37.240 | 610,102.920 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 23,117 | 58.100 | 1,343,097.700 | |
| FOOT LOCKER INC | 9,476 | 70.940 | 672,227.440 | |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 18,631 | 46.840 | 872,676.040 | |
| CARMAX INC | 13,513 | 65.680 | 887,533.840 | |
| XEROX CORP | 69,821 | 7.030 | 490,841.630 | |
| XILINX INC | 18,777 | 58.530 | 1,099,017.810 | |
| YAHOO! INC | 66,277 | 42.300 | 2,803,517.100 | |
| CIMAREX ENERGY CO | 7,003 | 141.340 | 989,804.020 | |
| TJX COMPANIES INC | 48,566 | 76.690 | 3,724,526.540 | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 94,700 | 6.920 | 655,324.000 | |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 20,000 | 60.000 | 1,200,000.000 | |
| SIGNATURE BANK | 4,171 | 151.190 | 630,613.490 | |
| CBRE GROUP INC | 20,976 | 30.960 | 649,416.960 | |

| | | | | |
|------------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| LIBERTY GLOBAL PLC | 16,073 | 34.010 | 546,642.730 | |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 94,000 | 14.560 | 1,368,640.000 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 3,935 | 166.360 | 654,626.600 | |
| T-MOBILE US INC | 21,188 | 58.740 | 1,244,583.120 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 33,734 | 56.610 | 1,909,681.740 | |
| MOSAIC CO/THE | 26,525 | 30.720 | 814,848.000 | |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS | 30,914 | 28.920 | 894,032.880 | |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC | 79,925 | 29.670 | 2,371,374.750 | |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP | 5,473 | 82.640 | 452,288.720 | |
| CELANESE CORP | 10,766 | 81.330 | 875,598.780 | |
| DEXCOM INC | 6,161 | 67.040 | 413,033.440 | |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A | 10,423 | 26.340 | 274,541.820 | |
| EXPEDIA INC | 9,786 | 117.620 | 1,151,029.320 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 18,475 | 32.730 | 604,686.750 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 11,627 | 114.730 | 1,333,965.710 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 50,537 | 32.710 | 1,653,065.270 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 46,298 | 56.770 | 2,628,337.460 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 14,696 | 30.710 | 451,314.160 | |
| VIACOM INC-CLASS B | 27,527 | 38.400 | 1,057,036.800 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 2,089 | 414.480 | 865,848.720 | |
| UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC | 6,191 | 73.660 | 456,029.060 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 3,812 | 253.270 | 965,465.240 | |
| MASTERCARD INC | 72,464 | 107.320 | 7,776,836.480 | |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP | 29,531 | 19.460 | 574,673.260 | |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 7,436 | 76.930 | 572,051.480 | |
| HANESBRANDS INC | 27,619 | 22.430 | 619,494.170 | |
| WESTERN UNION CO | 35,222 | 22.230 | 782,985.060 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 11,586 | 43.490 | 503,875.140 | |
| MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR | 18,099 | 16.980 | 307,321.020 | |
| SPECTRA ENERGY CORP | 51,646 | 41.730 | 2,155,187.580 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 8,330 | 66.020 | 549,946.600 | |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 18,440 | 19.500 | 359,580.000 | |
| DELTA AIR LINES INC | 14,611 | 50.930 | 744,138.230 | |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 6,354 | 49.880 | 316,937.520 | |
| DISCOVER FINANCIAL | 30,804 | 72.110 | 2,221,276.440 | |

| | | | | |
|---|---------|---------|----------------|--|
| TE CONNECTIVITY LTD | 27,026 | 67.600 | 1,826,957.600 | |
| CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX | 10,552 | 133.690 | 1,410,696.880 | |
| WABCO HOLDING INC | 4,379 | 106.550 | 466,582.450 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 9,052 | 69.900 | 632,734.800 | |
| VMWARE INC | 5,491 | 81.480 | 447,406.680 | |
| MERCADOLIBRE INC | 2,861 | 177.790 | 508,657.190 | |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC | 4,332 | 262.500 | 1,137,150.000 | |
| INVESCO LTD | 29,824 | 30.670 | 914,702.080 | |
| MSCI INC | 6,462 | 81.520 | 526,782.240 | |
| CALPINE CORP NPR | 27,876 | 11.850 | 330,330.600 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 115,885 | 90.520 | 10,489,910.200 | |
| VISA INC | 141,188 | 81.310 | 11,479,996.280 | |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 14,377 | 90.080 | 1,295,080.160 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 14,301 | 70.720 | 1,011,366.720 | |
| SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE | 6,585 | 74.290 | 489,199.650 | |
| SIGNET JEWELERS LTD | 6,095 | 87.460 | 533,068.700 | |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 16,085 | 25.760 | 414,349.600 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 39,747 | 48.970 | 1,946,410.590 | |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 11,624 | 54.170 | 629,672.080 | |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC | 1,826 | 119.810 | 218,773.060 | |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE | 140,475 | 21.570 | 3,030,045.750 | |
| XYLEM INC | 11,630 | 49.140 | 571,498.200 | |
| ALKERMES PLC | 12,053 | 58.490 | 704,979.970 | |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | 27,049 | 86.880 | 2,350,017.120 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 3,479 | 191.300 | 665,532.700 | |
| SPLUNK INC | 10,674 | 56.180 | 599,665.320 | |
| HCA HOLDINGS INC | 23,320 | 78.270 | 1,825,256.400 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 12,227 | 82.260 | 1,005,793.020 | |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 4,846 | 116.120 | 562,717.520 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 6,544 | 147.970 | 968,315.680 | |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO | 13,697 | 71.160 | 974,678.520 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 10,555 | 92.300 | 974,226.500 | |
| CIT GROUP INC | 16,266 | 42.990 | 699,275.340 | |
| NXP SEMICONDUCTOR NV | 22,652 | 98.630 | 2,234,166.760 | |
| TARGA RESOURCES CORP | 12,532 | 57.020 | 714,574.640 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| LEAR CORP | 5,132 | 142.770 | 732,695.640 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 21,500 | 74.250 | 1,596,375.000 | |
| FORTINET INC | 11,399 | 31.960 | 364,312.040 | |
| AON PLC | 20,606 | 112.630 | 2,320,853.780 | |
| TESLA MOTORS INC | 9,875 | 229.870 | 2,269,966.250 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV | 11,392 | 41.430 | 471,970.560 | |
| GENERAL MOTORS CO | 105,443 | 37.350 | 3,938,296.050 | |
| VANTIV INC | 12,141 | 61.710 | 749,221.110 | |
| TRIPADVISOR INC | 9,263 | 51.310 | 475,284.530 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 35,251 | 20.040 | 706,430.040 | |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 11,923 | 43.380 | 517,219.740 | |
| VOYA FINANCIAL INC | 13,525 | 40.360 | 545,869.000 | |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 20,532 | 70.470 | 1,446,890.040 | |
| PHILLIPS 66 | 34,686 | 83.760 | 2,905,299.360 | |
| FACEBOOK INC | 173,536 | 124.350 | 21,579,201.600 | |
| QUINTILES IMS HOLDINGS INC | 11,968 | 77.880 | 932,067.840 | |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 5,616 | 102.710 | 576,819.360 | |
| SERVICENOW INC | 12,640 | 81.670 | 1,032,308.800 | |
| WHITEWAVE FOODS CO | 14,444 | 55.380 | 799,908.720 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 7,048 | 134.680 | 949,224.640 | |
| WORKDAY INC | 8,710 | 74.350 | 647,588.500 | |
| ABBVIE INC | 121,323 | 64.070 | 7,773,164.610 | |
| ZOETIS INC | 34,481 | 53.930 | 1,859,560.330 | |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD | 12,224 | 45.220 | 552,769.280 | |
| COTY INC | 38,871 | 18.960 | 736,994.160 | |
| NEWS CORP/NEW-CL A | 30,263 | 12.000 | 363,156.000 | |
| MALLINCKRODT PLC | 9,419 | 53.750 | 506,271.250 | |
| CDW CORP | 9,877 | 52.240 | 515,974.480 | |
| SPRINT CORP | 63,882 | 8.760 | 559,606.320 | |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 10,199 | 48.480 | 494,447.520 | |
| ARCONIC INC | 34,259 | 20.710 | 709,503.890 | |
| ENVISION HEALTHCARE CORP | 4,730 | 65.220 | 308,490.600 | |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 5,006 | 35.600 | 178,213.600 | |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C | 18,330 | 35.080 | 643,016.400 | |
| XL GROUP LTD | 20,259 | 36.940 | 748,367.460 | |
| BROADCOM LTD | 29,475 | 180.570 | 5,322,300.750 | |
| DELL TECHNOLOGIES INC | 17,283 | 56.990 | 984,958.170 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 15,410 | 27.320 | 421,001.200 | |
| ANTERO RESOURCES CORP | 13,163 | 24.220 | 318,807.860 | |
| TWITTER INC | 43,692 | 17.370 | 758,930.040 | |
| PLAINS GP HOLDINGS LP | 7,837 | 33.260 | 260,658.620 | |
| PERRIGO CO PLC | 10,322 | 83.650 | 863,435.300 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 14,796 | 56.020 | 828,871.920 | |

| | | | | | |
|------------|---------------------------------|------------|---------|--|--|
| | ARAMARK | 17,307 | 34.020 | 588,784.140 | |
| | SABRE CORP | 17,624 | 24.940 | 439,542.560 | |
| | NAVIENT CORP | 22,636 | 16.820 | 380,737.520 | |
| | PARSLEY ENERGY INC | 10,949 | 36.670 | 401,499.830 | |
| | IHS MARKIT LTD | 26,741 | 36.610 | 978,988.010 | |
| | FNF GROUP | 20,571 | 34.040 | 700,236.840 | |
| | SYNCHRONY FINANCIAL | 62,691 | 36.960 | 2,317,059.360 | |
| | MOBILEYE NV | 14,001 | 40.370 | 565,220.370 | |
| | CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | 39,020 | 36.280 | 1,415,645.600 | |
| | CDK GLOBAL INC | 8,309 | 59.700 | 496,047.300 | |
| | QORVO INC | 10,599 | 56.400 | 597,783.600 | |
| | ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 11,389 | 31.460 | 358,297.940 | |
| | LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I | 7,818 | 75.540 | 590,571.720 | |
| | AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 14,710 | 27.280 | 401,288.800 | |
| | LIBERTY LILAC GROUP-C | 6,305 | 21.720 | 136,944.600 | |
| | NIELSEN HOLDINGS PLC | 26,840 | 41.750 | 1,120,570.000 | |
| | ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC | 5,128 | 110.920 | 568,797.760 | |
| | COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC | 16,090 | 31.500 | 506,835.000 | |
| | WESTROCK CO | 17,744 | 52.080 | 924,107.520 | |
| | KRAFT HEINZ CO | 45,382 | 85.910 | 3,898,767.620 | |
| | HILTON GRAND VACATIONS INC | 4,438 | 25.790 | 114,456.020 | |
| | FORTIVE CORP | 23,758 | 53.800 | 1,278,180.400 | |
| | WASTE CONNECTIONS INC | 10,157 | 81.200 | 824,748.400 | |
| | ALPHABET INC-CL A | 21,999 | 826.010 | 18,171,393.990 | |
| | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | 121,590 | 22.950 | 2,790,490.500 | |
| | PAYPAL HOLDINGS INC | 80,567 | 41.080 | 3,309,692.360 | |
| | CONDUENT INC | 13,964 | 13.420 | 187,396.880 | |
| | FIRST DATA CORP | 22,035 | 15.510 | 341,762.850 | |
| | ZILLOW GROUP INC-C | 8,134 | 36.650 | 298,111.100 | |
| | ALPHABET INC-CL C | 23,139 | 804.790 | 18,622,035.810 | |
| | L3 TECHNOLOGIES INC | 5,892 | 150.960 | 889,456.320 | |
| | CHARTER COMMUNICATIONS INC | 16,119 | 298.200 | 4,806,685.800 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | 23,283,810 | | 1,495,735,077.520 (173,445,439,589) | |
| イギリス・ポンド | ABERDEEN ASSET MGMT | 71,341 | 2.711 | 193,405.450 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 25,905 | 7.230 | 187,293.150 | |
| | ASHTED GROUP | 35,233 | 16.010 | 564,080.330 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 14,897 | 21.960 | 327,138.120 | |
| | BHP BILLITON PLC | 153,323 | 14.000 | 2,146,522.000 | |
| | BARCLAYS PLC | 1,247,081 | 2.362 | 2,945,605.320 | |
| | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 82,682 | 5.070 | 419,197.740 | |

| | | | | |
|--------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| BT GROUP PLC | 621,220 | 3.877 | 2,408,469.940 | |
| SKY PLC | 72,210 | 9.880 | 713,434.800 | |
| BUNZL PLC | 26,929 | 21.080 | 567,663.320 | |
| EASYJET PLC | 13,628 | 10.790 | 147,046.120 | |
| CAPITA PLC | 54,894 | 5.185 | 284,625.390 | |
| AVIVA PLC | 306,804 | 4.868 | 1,493,521.870 | |
| CRODA INTERNATIONAL | 10,965 | 32.680 | 358,336.200 | |
| DIAGEO PLC | 186,418 | 21.655 | 4,036,881.790 | |
| SCHRODERS PLC | 7,188 | 30.370 | 218,299.560 | |
| DCC PLC | 7,281 | 60.950 | 443,776.950 | |
| NATIONAL GRID PLC | 280,203 | 9.346 | 2,618,777.230 | |
| GKN PLC | 134,180 | 3.348 | 449,234.640 | |
| KINGFISHER PLC | 165,680 | 3.452 | 571,927.360 | |
| BAE SYSTEMS PLC | 241,905 | 6.100 | 1,475,620.500 | |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC | 11,987 | 28.870 | 346,064.690 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 138,548 | 46.720 | 6,472,962.560 | |
| COBHAM PLC | 142,739 | 1.646 | 234,948.390 | |
| NEXT PLC | 9,731 | 41.520 | 404,031.120 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 70,388 | 35.925 | 2,528,688.900 | |
| IMI PLC | 21,218 | 10.680 | 226,608.240 | |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 12,527 | 31.930 | 399,987.110 | |
| ANGLO AMERICAN PLC | 105,010 | 12.375 | 1,299,498.750 | |
| COMPASS GROUP PLC | 119,716 | 14.640 | 1,752,642.240 | |
| HSBC HOLDINGS PLC | 1,486,352 | 6.714 | 9,979,367.320 | |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 423,649 | 2.484 | 1,052,344.110 | |
| CENTRICA PLC | 392,766 | 2.268 | 890,793.280 | |
| UNILEVER PLC | 97,369 | 33.350 | 3,247,256.150 | |
| MEGGITT PLC | 62,181 | 4.528 | 281,555.560 | |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS | 155,682 | 2.460 | 382,977.720 | |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 55,599 | 8.905 | 495,109.090 | |
| RSA INSURANCE GROUP PLC GRP | 80,864 | 5.690 | 460,116.160 | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 25,308 | 26.640 | 674,205.120 | |
| PEARSON PLC | 65,009 | 8.185 | 532,098.660 | |
| PERSIMMON PLC | 23,150 | 19.890 | 460,453.500 | |
| PRUDENTIAL PLC | 194,275 | 15.800 | 3,069,545.000 | |
| RIO TINTO PLC | 90,216 | 32.935 | 2,971,263.960 | |
| VODAFONE GROUP PLC | 1,974,479 | 2.102 | 4,150,354.850 | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 46,978 | 67.830 | 3,186,517.740 | |
| RELX PLC | 80,689 | 14.510 | 1,170,797.390 | |
| OLD MUTUAL PLC | 389,986 | 2.091 | 815,460.720 | |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC | 146,260 | 6.675 | 976,285.500 | |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 279,442 | 2.266 | 633,215.570 | |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 40,884 | 10.640 | 435,005.760 | |
| TRAVIS PERKINS PLC | 20,357 | 14.510 | 295,380.070 | |
| SSE PLC | 73,043 | 15.270 | 1,115,366.610 | |
| BP PLC | 1,397,956 | 5.117 | 7,153,340.850 | |
| SHIRE PLC | 68,023 | 48.345 | 3,288,571.930 | |
| SAGE GROUP PLC(THE) | 85,271 | 6.615 | 564,067.660 | |
| SMITHS GROUP PLC | 31,720 | 14.830 | 470,407.600 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 251,434 | 7.007 | 1,761,798.030 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 4,885,554 | 0.665 | 3,248,893.410 | |
| TATE & LYLE PLC | 39,915 | 6.885 | 274,814.770 | |
| TAYLOR WIMPLEY PLC | 253,022 | 1.749 | 442,535.470 | |
| TESCO PLC | 624,703 | 2.130 | 1,330,617.390 | |
| 3I GROUP PLC | 78,491 | 7.160 | 561,995.560 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 66,155 | 12.260 | 811,060.300 | |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 363,678 | 15.940 | 5,797,027.320 | |
| WEIR GROUP | 18,336 | 19.950 | 365,803.200 | |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 24,907 | 29.530 | 735,503.710 | |
| BABCOCK INT'L GROUP | 21,302 | 9.525 | 202,901.550 | |
| WPP PLC | 97,555 | 18.780 | 1,832,082.900 | |
| WOLSELEY PLC | 18,238 | 50.250 | 916,459.500 | |
| ASTRAZENECA PLC | 94,192 | 46.600 | 4,389,347.200 | |
| WHITBREAD PLC | 12,159 | 40.510 | 492,561.090 | |
| CARNIVAL PLC | 13,153 | 42.980 | 565,315.940 | |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 120,290 | 3.397 | 408,625.130 | |
| INTERTEK GROUP PLC | 10,500 | 34.670 | 364,035.000 | |
| WILLIAM HILL PLC | 72,474 | 2.926 | 212,058.920 | |
| BURBERRY GROUP PLC | 35,774 | 15.330 | 548,415.420 | |
| INVESTEC PLC | 50,655 | 5.465 | 276,829.570 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 15,187 | 37.590 | 570,879.330 | |
| ITV PLC | 247,210 | 2.072 | 512,219.120 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 109,410 | 2.588 | 283,153.080 | |
| RANDGOLD RESOURCES LTD NPR | 6,998 | 67.100 | 469,565.800 | |
| G4S PLC | 122,250 | 2.411 | 294,744.750 | |
| ADMIRAL GROUP PLC | 15,893 | 17.800 | 282,895.400 | |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 10,726 | 29.490 | 316,309.740 | |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 324,139 | 22.490 | 7,289,886.110 | |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 277,839 | 23.385 | 6,497,265.010 | |
| INMARSAT PLC | 34,127 | 7.670 | 261,754.090 | |
| PETROFAC LTD | 21,809 | 9.285 | 202,496.560 | |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 11,457 | 19.270 | 220,776.390 | |

| | | | | | |
|---------------|--|------------|---------|-------------------------------------|--|
| | TUI AG-DI | 19,394 | 11.910 | 230,982.540 | |
| | STANDARD LIFE PLC | 155,609 | 3.615 | 562,526.530 | |
| | EXPERIAN PLC | 71,516 | 15.790 | 1,129,237.640 | |
| | MONDI PLC | 30,200 | 16.640 | 502,528.000 | |
| | TP ICAP PLC | 20,904 | 4.563 | 95,384.950 | |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 21,290 | 12.920 | 275,066.800 | |
| | FRESNILLO PLC NPR | 15,639 | 14.320 | 223,950.480 | |
| | GLENCORE PLC | 899,043 | 3.072 | 2,761,860.090 | |
| | DIXONS CARPHONE PLC | 84,639 | 3.446 | 291,665.990 | |
| | DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | 112,694 | 3.570 | 402,317.580 | |
| | MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 30,616 | 7.865 | 240,794.840 | |
| | COCA-COLA HBC AG | 13,406 | 17.830 | 239,028.980 | |
| | NEX GROUP PLC | 25,581 | 5.035 | 128,800.330 | |
| | ROYAL MAIL PLC | 55,060 | 4.503 | 247,935.180 | |
| | MERLIN ENTERTAINMENTS PLC | 50,037 | 4.695 | 234,923.710 | |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 76,348 | 4.043 | 308,674.960 | |
| | WORLDPAY GROUP PLC | 112,202 | 2.842 | 318,878.080 | |
| イギリス・ボンド 小計 | | 22,323,049 | | 135,923,331.100 (19,201,888,984) | |
| イスラエル・シュケル | BANK HAPOLIM BM | 78,428 | 23.420 | 1,836,783.760 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL BM | 124,270 | 15.730 | 1,954,767.100 | |
| | BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 188,230 | 7.050 | 1,327,021.500 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 1,760 | 393.700 | 692,912.000 | |
| | FRUTAROM INDUSTRIES LTD | 2,600 | 203.900 | 530,140.000 | |
| | ISRAEL CHEMICALS LTD | 49,411 | 17.220 | 850,857.420 | |
| | NICE LTD | 5,638 | 266.500 | 1,502,527.000 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 10,444 | 57.300 | 598,441.200 | |
| イスラエル・シュケル 小計 | | 460,781 | | 9,293,449.980 (280,104,583) | |
| オーストラリア・ドル | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 11,115 | 71.540 | 795,167.100 | |
| | AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 221,660 | 31.280 | 6,933,524.800 | |
| | AMCOR LTD | 80,741 | 15.060 | 1,215,959.460 | |
| | WESTPAC BANKING CORPORATION | 248,237 | 33.700 | 8,365,586.900 | |
| | BANK OF QUEENSLAND LTD | 30,569 | 12.230 | 373,858.870 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 114,125 | 5.960 | 680,185.000 | |
| | TELSTRA CORP LTD | 314,574 | 5.230 | 1,645,222.020 | |
| | BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 39,014 | 12.920 | 504,060.880 | |
| | AMP LTD | 200,498 | 5.230 | 1,048,604.540 | |
| | ASX LTD | 16,354 | 50.820 | 831,110.280 | |

| | | | | |
|--------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| BHP BILLITON LTD | 241,614 | 25.360 | 6,127,331.040 | |
| CALTEX AUSTRALIA LTD | 20,946 | 30.110 | 630,684.060 | |
| COMPUTERSHARE LT | 38,040 | 12.400 | 471,696.000 | |
| CSL LIMITED | 33,499 | 104.000 | 3,483,896.000 | |
| REA GROUP LTD | 4,119 | 57.260 | 235,853.940 | |
| TRANSURBAN GROUP | 149,591 | 10.500 | 1,570,705.500 | |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 48,601 | 10.090 | 490,384.090 | |
| COCHLEAR LTD | 3,992 | 128.270 | 512,053.840 | |
| ORIGIN ENERGY LTD | 143,330 | 6.750 | 967,477.500 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 127,579 | 84.820 | 10,821,250.780 | |
| BORAL LIMITED | 60,188 | 5.360 | 322,607.680 | |
| RIO TINTO LIMITED | 31,897 | 59.950 | 1,912,225.150 | |
| APA GROUP | 73,253 | 8.890 | 651,219.170 | |
| ARISTOCRAT LEISU | 44,406 | 15.600 | 692,733.600 | |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 171,471 | 6.160 | 1,056,261.360 | |
| TPG TELECOM LTD | 28,719 | 7.280 | 209,074.320 | |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 4,706 | 31.800 | 149,650.800 | |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 35,790 | 21.320 | 763,042.800 | |
| ORICA LTD | 25,308 | 17.980 | 455,037.840 | |
| CIMIC GROUP LTD | 8,709 | 36.080 | 314,220.720 | |
| SYDNEY AIRPORT | 85,130 | 6.020 | 512,482.600 | |
| MACQUARIE GROUP LTD | 21,869 | 87.740 | 1,918,786.060 | |
| SUNCORP GROUP LTD | 93,181 | 13.720 | 1,278,443.320 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 200,714 | 31.670 | 6,356,612.380 | |
| NEWCREST MINING LTD | 61,110 | 20.850 | 1,274,143.500 | |
| OIL SEARCH LTD | 93,715 | 7.350 | 688,805.250 | |
| INCITEC PIVOT LTD | 136,426 | 3.670 | 500,683.420 | |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 95,390 | 12.430 | 1,185,697.700 | |
| CHALLENGER FINANCIAL SERVICES | 45,707 | 11.390 | 520,602.730 | |
| SANTOS LTD | 133,862 | 4.160 | 556,865.920 | |
| SONIC HEALTHCARE | 26,192 | 21.800 | 570,985.600 | |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 70,776 | 4.830 | 341,848.080 | |
| WESFARMERS LTD | 86,331 | 42.280 | 3,650,074.680 | |
| ALUMINA LIMITED | 184,613 | 1.780 | 328,611.140 | |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 57,923 | 31.840 | 1,844,268.320 | |
| WOOLWORTHS LTD | 92,344 | 24.210 | 2,235,648.240 | |
| DUET GROUP | 207,776 | 2.750 | 571,384.000 | |
| SEEK LTD | 25,899 | 15.190 | 393,405.810 | |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD | 4,581 | 65.700 | 300,971.700 | |
| TATTS GROUP LTD | 109,937 | 4.350 | 478,225.950 | |
| AUSNET SERVICES | 165,066 | 1.590 | 262,454.940 | |

| | | | | | |
|---------------|--------------------------------|-----------|---------|-----------------------------------|--|
| | AGL ENERGY LTD | 46,315 | 22.160 | 1,026,340.400 | |
| | BRAMBLES LTD | 115,255 | 12.580 | 1,449,907.900 | |
| | CROWN RESORTS LTD | 32,861 | 11.580 | 380,530.380 | |
| | VOCUS COMMUNICATIONS LTD | 43,023 | 4.300 | 184,998.900 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 171,522 | 5.170 | 886,768.740 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 63,922 | 10.510 | 671,820.220 | |
| | HEALTHSCOPE LTD | 149,047 | 2.400 | 357,712.800 | |
| | MEDIBANK PVT LTD | 234,849 | 2.800 | 657,577.200 | |
| | SOUTH32 LTD(AUD) | 432,027 | 2.820 | 1,218,316.140 | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | 5,860,008 | | 86,835,660.060 (7,414,897,012) | |
| カナダ・ドル | AGNICO EAGLE MINES LTD | 16,141 | 58.680 | 947,153.880 | |
| | ALIMENTATION COUCHE TARD INC | 30,728 | 60.730 | 1,866,111.440 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 83,648 | 22.220 | 1,858,658.560 | |
| | ATCO LTD | 7,193 | 44.720 | 321,670.960 | |
| | BANK OF MONTREAL | 47,743 | 97.680 | 4,663,536.240 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 89,436 | 76.960 | 6,882,994.560 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 23,756 | 54.760 | 1,300,878.560 | |
| | BCE INC | 11,568 | 57.990 | 670,828.320 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT | 65,043 | 43.800 | 2,848,883.400 | |
| | VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN | 25,819 | 21.820 | 563,370.580 | |
| | BOMBARDIER INC 'B' | 151,615 | 2.470 | 374,489.050 | |
| | SAPUTO INC | 20,680 | 46.900 | 969,892.000 | |
| | BLACKBERRY LTD | 39,652 | 9.410 | 373,125.320 | |
| | CGI GROUP INC | 15,228 | 64.310 | 979,312.680 | |
| | CCL INDUSTRIES INC | 2,268 | 256.900 | 582,649.200 | |
| | CAE INC | 23,000 | 18.610 | 428,030.000 | |
| | CAMECO CORP | 32,627 | 15.650 | 510,612.550 | |
| | ROGERS COMM-CL B | 25,967 | 51.200 | 1,329,510.400 | |
| | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 30,159 | 110.690 | 3,338,299.710 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 84,339 | 41.180 | 3,473,080.020 | |
| | CANADIAN TIRE CORP-CL A | 4,862 | 141.510 | 688,021.620 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD | 9,119 | 36.190 | 330,016.610 | |
| | CANADIAN NATL RAILWAY CO | 57,306 | 91.690 | 5,254,387.140 | |
| | FIRST CAPITAL REALTY INC | 11,417 | 20.900 | 238,615.300 | |
| | AGRIUM INC | 9,382 | 135.940 | 1,275,389.080 | |
| | YAMANA GOLD INC | 67,520 | 4.220 | 284,934.400 | |
| | GILDAN ACTIVEWEAR INC | 13,930 | 33.940 | 472,784.200 | |
| | OPEN TEXT CORP | 9,878 | 83.480 | 824,615.440 | |
| | ELDORADO GOLD CORP | 46,790 | 4.470 | 209,151.300 | |
| | EMPIRE CO LTD | 15,093 | 15.750 | 237,714.750 | |
| | KINROSS GOLD CORP | 99,741 | 4.480 | 446,839.680 | |

| | | | | |
|--|---------|---------|----------------|--|
| FINNING INTERNATIONAL INC | 9,892 | 25.950 | 256,697.400 | |
| FORTIS INC | 29,002 | 40.910 | 1,186,471.820 | |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 55,296 | 15.870 | 877,547.520 | |
| TELUS CORP | 18,945 | 43.940 | 832,443.300 | |
| GREAT WEST LIFECO INC | 24,837 | 35.610 | 884,445.570 | |
| IMPERIAL OIL LTD | 21,542 | 45.600 | 982,315.200 | |
| ENBRIDGE INC | 68,827 | 56.660 | 3,899,737.820 | |
| IGM FINANCIAL INC | 8,426 | 40.520 | 341,421.520 | |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 87,995 | 4.710 | 414,456.450 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 144,196 | 24.550 | 3,540,011.800 | |
| LINAMAR CORP | 3,827 | 58.670 | 224,530.090 | |
| LOBLAW CO LTD | 17,936 | 70.040 | 1,256,237.440 | |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC | 6,524 | 54.500 | 355,558.000 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 29,208 | 60.120 | 1,755,984.960 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 46,405 | 51.640 | 2,396,354.200 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,805 | 633.160 | 1,142,853.800 | |
| METRO INC | 19,350 | 39.840 | 770,904.000 | |
| HUSKY ENERGY INC | 28,749 | 16.030 | 460,846.470 | |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 39,992 | 16.950 | 677,864.400 | |
| METHANEX CORP | 7,381 | 61.500 | 453,931.500 | |
| ONEX CORP | 6,646 | 88.930 | 591,028.780 | |
| GOLDCORP INC | 67,652 | 19.110 | 1,292,829.720 | |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 61,076 | 24.610 | 1,503,080.360 | |
| POWER CORP OF CANADA | 25,052 | 30.480 | 763,584.960 | |
| POWER FINANCIAL CORP | 17,484 | 33.990 | 594,281.160 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 110,868 | 92.970 | 10,307,397.960 | |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 12,459 | 57.910 | 721,500.690 | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 10,607 | 193.360 | 2,050,969.520 | |
| SHAW COMM INC-B | 34,029 | 27.940 | 950,770.260 | |
| SUNCOR ENERGY INC | 126,273 | 43.010 | 5,431,001.730 | |
| ENCANA CORP | 69,257 | 16.920 | 1,171,828.440 | |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 41,016 | 29.630 | 1,215,304.080 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 25,128 | 59.010 | 1,482,803.280 | |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$ | 138,562 | 67.100 | 9,297,510.200 | |
| TRANSCANADA CORP | 62,895 | 60.560 | 3,808,921.200 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 5,696 | 46.310 | 263,781.760 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 3,105 | 112.430 | 349,095.150 | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 10,718 | 94.360 | 1,011,350.480 | |

| | | | | | |
|-----------|---|-----------|---------|-------------------------------------|--|
| | SILVER WHEATON CORP | 33,943 | 26.990 | 916,121.570 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,494 | 599.800 | 896,101.200 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP NPR | 13,919 | 81.710 | 1,137,321.490 | |
| | WASTE CONNECTIONS INC | 2,429 | 107.370 | 260,801.730 | |
| | CI FINANCIAL CORP | 20,695 | 28.520 | 590,221.400 | |
| | VERESEN INC | 24,982 | 12.900 | 322,267.800 | |
| | TOURMALINE OIL CORP | 15,779 | 31.690 | 500,036.510 | |
| | KEYERA CORP | 13,728 | 39.660 | 544,452.480 | |
| | ALTAGAS LTD | 12,538 | 34.200 | 428,799.600 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 30,719 | 41.680 | 1,280,367.920 | |
| | DOLLARAMA INC | 9,286 | 98.120 | 911,142.320 | |
| | CENOVUS ENERGY INC W/I | 59,124 | 19.540 | 1,155,282.960 | |
| | VERMILION ENERGY INC | 8,291 | 56.330 | 467,032.030 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 22,997 | 21.790 | 501,104.630 | |
| | PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 14,493 | 30.040 | 435,369.720 | |
| | ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | 30,631 | 12.540 | 384,112.740 | |
| | INTER PIPELINE LTD | 24,083 | 28.950 | 697,202.850 | |
| | PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 14,961 | 32.780 | 490,421.580 | |
| | SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD | 17,231 | 27.000 | 465,237.000 | |
| | RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 17,390 | 65.630 | 1,141,305.700 | |
| | HYDRO ONE LTD | 16,612 | 23.650 | 392,873.800 | |
| カナダ・ドル 小計 | | 3,075,631 | | 123,980,786.970 (10,855,757,707) | |
| シンガポール・ドル | SINGAPORE TECH ENG | 125,000 | 3.360 | 420,000.000 | |
| | SEMBICORP INDUSTRIES | 81,400 | 3.060 | 249,084.000 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 123,700 | 3.660 | 452,742.000 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 692,140 | 0.425 | 294,159.500 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 133,100 | 17.990 | 2,394,469.000 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 29,000 | 8.640 | 250,560.000 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 10,244 | 41.560 | 425,740.640 | |
| | SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD | 42,300 | 4.940 | 208,962.000 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 68,900 | 7.240 | 498,836.000 | |
| | CAPITALAND LTD | 192,415 | 3.140 | 604,183.100 | |
| | GENTING SINGAPORE PLC | 416,400 | 0.945 | 393,498.000 | |
| | KEPPEL CORP LTD | 119,300 | 6.100 | 727,730.000 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 177,900 | 2.540 | 451,866.000 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 249,053 | 9.350 | 2,328,645.550 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 591,922 | 3.770 | 2,231,545.940 | |

| | | | | | |
|--------------|--------------------------------------|-----------|------------|-----------------------------------|--|
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 47,500 | 9.860 | 468,350.000 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 94,500 | 20.990 | 1,983,555.000 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 151,000 | 3.670 | 554,170.000 | |
| | YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 145,700 | 0.845 | 123,116.500 | |
| | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD | 172,100 | 2.550 | 438,855.000 | |
| シンガポール・ドル 小計 | | 3,663,574 | | 15,500,068.230 (1,250,855,506) | |
| スイス・フラン | CREDIT SUISSE GROUP AG | 145,106 | 15.890 | 2,305,734.340 | |
| | SYNGENTA AG | 6,872 | 413.400 | 2,840,884.800 | |
| | NESTLE SA-REGISTERED | 232,379 | 74.300 | 17,265,759.700 | |
| | CIE FINANC RICHEMONT | 39,674 | 70.900 | 2,812,886.600 | |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 52,476 | 243.400 | 12,772,658.400 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 2,835 | 180.600 | 512,001.000 | |
| | SIKA INHABER | 151 | 4,801.000 | 724,951.000 | |
| | SGS SA-REG | 405 | 2,098.000 | 849,690.000 | |
| | NOVARTIS AG-REG SHS | 166,725 | 75.400 | 12,571,065.000 | |
| | BALOISE HOLDING AG -R | 4,127 | 129.300 | 533,621.100 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG | 144 | 1,265.000 | 182,160.000 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 1,795 | 461.900 | 829,110.500 | |
| | ABB LTD | 137,622 | 22.120 | 3,044,198.640 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 10,926 | 69.850 | 763,181.100 | |
| | GEBERIT AG | 2,801 | 410.200 | 1,148,970.200 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 4,373 | 184.200 | 805,506.600 | |
| | LINDT & SPRUENGLI PART | 75 | 5,540.000 | 415,500.000 | |
| | LINDT & SPRUENGLI NAMEN | 6 | 64,320.000 | 385,920.000 | |
| | GIVAUDAN-REG | 692 | 1,845.000 | 1,276,740.000 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 11,053 | 284.100 | 3,140,157.300 | |
| | LAFARGEHOLCIM LTD | 20,941 | 53.900 | 1,128,719.900 | |
| | ACTELION | 7,435 | 231.400 | 1,720,459.000 | |
| | SONOVA HOLDING AG | 4,519 | 125.200 | 565,778.800 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG | 4,453 | 134.500 | 598,928.500 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 1,955 | 330.200 | 645,541.000 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 4,592 | 64.900 | 298,020.800 | |
| | SCHINDLER NAMEN | 1,663 | 178.000 | 296,014.000 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 2,618 | 294.300 | 770,477.400 | |
| | GALENICA HLDG NAMEN (NEW | 305 | 1,160.000 | 353,800.000 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING | 553 | 522.000 | 288,666.000 | |
| | SWISS PRIME SITE AG | 5,990 | 84.350 | 505,256.500 | |
| | DUFREY GROUP | 3,566 | 129.800 | 462,866.800 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,474 | 484.750 | 714,521.500 | |
| | ARYZTA AG | 7,191 | 44.780 | 322,012.980 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 15,227 | 47.460 | 722,673.420 | |
| | SWISS RE LTD | 23,838 | 95.850 | 2,284,872.300 | |

| | | | | | |
|----------------|---------------------------------------|-----------|------------|------------------------------------|--|
| | UBS GROUP AG | 277,078 | 16.780 | 4,649,368.840 | |
| スイス・フラン 小計 | | 1,203,635 | | 81,508,674.020 (9,298,509,533) | |
| スウェーデン・クローナ | ATLAS COPCO AB-A SHS | 48,377 | 286.600 | 13,864,848.200 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 29,157 | 257.000 | 7,493,349.000 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 221,748 | 53.700 | 11,907,867.600 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 13,153 | 147.900 | 1,945,328.700 | |
| | LUNDBERGS B | 2,606 | 552.000 | 1,438,512.000 | |
| | SKF AB-B SHS | 32,306 | 166.800 | 5,388,640.800 | |
| | SANDVIK AB | 75,199 | 116.100 | 8,730,603.900 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 121,939 | 94.650 | 11,541,526.350 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 27,150 | 215.000 | 5,837,250.000 | |
| | SWEDBANK AB | 66,507 | 215.000 | 14,299,005.000 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | 46,024 | 253.600 | 11,671,686.400 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 118,909 | 122.700 | 14,590,134.300 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 113,672 | 109.300 | 12,424,349.600 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 15,807 | 282.700 | 4,468,638.900 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 26,976 | 73.500 | 1,982,736.000 | |
| | NORDEA AB | 229,457 | 98.900 | 22,693,297.300 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 19,191 | 221.500 | 4,250,806.500 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 24,098 | 143.800 | 3,465,292.400 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 33,412 | 339.700 | 11,350,056.400 | |
| | HENNES&MAURITZ AB-B SHS | 72,617 | 243.700 | 17,696,762.900 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 75,670 | 165.900 | 12,553,653.000 | |
| | TELIA CO AB | 184,927 | 37.150 | 6,870,038.050 | |
| | LUNDIN PETROLEUM AB | 16,790 | 193.300 | 3,245,507.000 | |
| | BOLIDEN AB | 21,855 | 248.800 | 5,437,524.000 | |
| | ALFA LAVAL AB | 24,553 | 154.900 | 3,803,259.700 | |
| | KINNEVIK AB-B | 18,310 | 220.400 | 4,035,524.000 | |
| | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA | 5,332 | 426.800 | 2,275,697.600 | |
| | ICA GRUPPEN AB | 5,920 | 276.900 | 1,639,248.000 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 33,692 | 70.300 | 2,368,547.600 | |
| | HEXAGON AB | 16,702 | 343.000 | 5,728,786.000 | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | | 1,742,056 | | 234,998,477.200 (3,000,930,554) | |
| デンマーク・クローネ | CARLSBERG AS-B | 8,601 | 610.500 | 5,250,910.500 | |
| | A P MOLLER A/S | 481 | 11,640.000 | 5,598,840.000 | |
| | AP MOLLER MAERSK A | 273 | 11,090.000 | 3,027,570.000 | |
| | DANSKE BANK A/S | 52,545 | 218.600 | 11,486,337.000 | |
| | GENMAB A/S | 4,633 | 1,287.000 | 5,962,671.000 | |
| | NOVOZYMES-B SHS | 15,904 | 249.400 | 3,966,457.600 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 142,139 | 254.000 | 36,103,306.000 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 15,808 | 472.000 | 7,461,376.000 | |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|--|
| | TDC A/S | 68,939 | 36.600 | 2,523,167.400 | |
| | COLOPLAST-B | 8,286 | 486.000 | 4,026,996.000 | |
| | DSV A/S | 15,601 | 321.100 | 5,009,481.100 | |
| | WILLIAM DEMANT | 6,537 | 124.600 | 814,510.200 | |
| | TRYG A/S | 11,107 | 130.000 | 1,443,910.000 | |
| | PANDORA A/S | 8,251 | 866.000 | 7,145,366.000 | |
| | CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 7,708 | 388.600 | 2,995,328.800 | |
| | ISS A/S | 11,125 | 236.400 | 2,629,950.000 | |
| | DONG ENERGY A/S | 6,575 | 256.000 | 1,683,200.000 | |
| デンマーク・クローネ 小計 | | 384,513 | | 107,129,377.600 (1,764,420,849) | |
| ニュージーランド・ドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 97,992 | 6.610 | 647,727.120 | |
| | FLETCHER BUILDING LTD | 75,281 | 10.290 | 774,641.490 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 210,161 | 3.630 | 762,884.430 | |
| ニュージーランド・ドル 小計 | | 383,434 | | 2,185,253.040 (176,743,266) | |
| ノルウェー・クローネ | MARINE HARVEST | 31,839 | 147.000 | 4,680,333.000 | |
| | DNB ASA | 70,426 | 133.900 | 9,430,041.400 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 91,879 | 42.380 | 3,893,832.020 | |
| | TELENOR ASA | 53,178 | 132.500 | 7,046,085.000 | |
| | SCHIBSTED ASA | 9,131 | 203.700 | 1,859,984.700 | |
| | ORKLA ASA | 61,421 | 77.000 | 4,729,417.000 | |
| | STATOIL ASA | 81,414 | 159.700 | 13,001,815.800 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 14,576 | 356.300 | 5,193,428.800 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 16,683 | 136.500 | 2,277,229.500 | |
| ノルウェー・クローネ 小計 | | 430,547 | | 52,112,167.220 (702,993,136) | |
| ユーロ | CRH PLC | 62,222 | 32.295 | 2,009,459.490 | |
| | PADDY POWER BETFAIR PLC | 6,246 | 101.150 | 631,782.900 | |
| | KERRY GROUP PLC-A | 11,576 | 69.440 | 803,837.440 | |
| | BANK OF IRELAND | 2,198,637 | 0.243 | 534,268.790 | |
| | UMICORE | 7,660 | 55.260 | 423,291.600 | |
| | AIR LIQUIDE | 28,615 | 104.450 | 2,988,836.750 | |
| | AIRBUS SE | 42,705 | 65.200 | 2,784,366.000 | |
| | AXA | 146,095 | 24.285 | 3,547,917.070 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 34,622 | 15.190 | 525,908.180 | |
| | ADIDAS AG | 14,302 | 144.800 | 2,070,929.600 | |
| | ASSICURAZIONI GENERALI | 85,995 | 14.170 | 1,218,549.150 | |
| | ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA | 41,829 | 13.600 | 568,874.400 | |
| | DASSAULT AVIATION SA | 157 | 1,089.650 | 171,075.050 | |
| | DANONE | 43,220 | 61.200 | 2,645,064.000 | |
| | SAFRAN SA | 23,731 | 67.330 | 1,597,808.230 | |
| | INTESA SANPAOLO | 934,915 | 2.468 | 2,307,370.220 | |
| | INTESA SANPAOLO-RNC | 112,465 | 2.260 | 254,170.900 | |

| | | | | |
|-------------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 24,055 | 89.910 | 2,162,785.050 | |
| ACCOR SA | 10,385 | 38.315 | 397,901.270 | |
| BOSKALIS WESTMINSTER CT | 7,563 | 33.030 | 249,805.890 | |
| BOUYGUES | 13,996 | 33.870 | 474,044.520 | |
| BNP PARIBAS | 78,591 | 60.850 | 4,782,262.350 | |
| RELX NV | 70,826 | 15.740 | 1,114,801.240 | |
| THALES SA | 8,128 | 90.030 | 731,763.840 | |
| CAP GEMINI SA | 11,481 | 81.380 | 934,323.780 | |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 4,264 | 49.100 | 209,362.400 | |
| CHRISTIAN DIOR SE | 3,940 | 199.200 | 784,848.000 | |
| INGENICO GROUP | 4,334 | 77.800 | 337,185.200 | |
| UNICREDIT SPA | 378,245 | 2.680 | 1,013,696.600 | |
| NATIXIS | 70,166 | 5.485 | 384,860.510 | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 12,285 | 58.300 | 716,215.500 | |
| COMMERZBANK AG | 72,573 | 7.607 | 552,062.810 | |
| EIFFAGE | 4,777 | 68.240 | 325,982.480 | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 30,156 | 73.120 | 2,205,006.720 | |
| UNITED INTERNET | 9,882 | 38.340 | 378,875.880 | |
| FUCHS PETROLUB SE PREF | 5,546 | 39.320 | 218,068.720 | |
| PUBLICIS GROUPE | 15,068 | 66.140 | 996,597.520 | |
| MAN SE | 3,396 | 95.400 | 323,978.400 | |
| IBERDROLA SA | 415,050 | 5.968 | 2,477,018.400 | |
| ENI SPA | 188,983 | 15.550 | 2,938,685.650 | |
| JERONIMO MARTINS | 19,517 | 15.955 | 311,393.730 | |
| KBC GROUPE | 18,378 | 60.500 | 1,111,869.000 | |
| HANNOVER RUECK SE | 5,050 | 101.250 | 511,312.500 | |
| WARTSILA OYJ | 11,645 | 42.650 | 496,659.250 | |
| L'OREAL | 18,815 | 171.050 | 3,218,305.750 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 21,036 | 181.100 | 3,809,619.600 | |
| LAGARDERE S.C.A. | 9,600 | 25.510 | 244,896.000 | |
| GEA GROUP AG | 14,635 | 37.850 | 553,934.750 | |
| BOLLORE | 71,347 | 3.560 | 253,995.320 | |
| MEDIOBANCA SPA | 42,404 | 7.905 | 335,203.620 | |
| MICHELIN(CGDE)-B | 13,125 | 104.500 | 1,371,562.500 | |
| CONTINENTAL AG | 8,310 | 191.900 | 1,594,689.000 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 74,274 | 31.430 | 2,334,431.820 | |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 9,399 | 36.080 | 339,115.920 | |
| AXEL SPRINGER SE | 3,067 | 46.715 | 143,274.900 | |
| OMV AG | 9,766 | 33.775 | 329,846.650 | |
| PERNOD-RICARD | 16,110 | 104.800 | 1,688,328.000 | |
| PEUGEOT SA | 32,906 | 16.705 | 549,694.730 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD | 12,066 | 55.140 | 665,319.240 | |
| RENAULT SA | 14,360 | 88.070 | 1,264,685.200 | |
| REPSOL SA | 78,098 | 13.720 | 1,071,504.560 | |
| REMY COINTREAU | 1,860 | 79.680 | 148,204.800 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| MERCK KGAA | 8,752 | 101.950 | 892,266.400 | |
| COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN | 35,706 | 44.990 | 1,606,412.940 | |
| SAIPEM | 465,751 | 0.508 | 236,601.500 | |
| RWE AG | 39,183 | 11.810 | 462,751.230 | |
| SEB SA | 1,405 | 126.900 | 178,294.500 | |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 11,602 | 47.960 | 556,431.920 | |
| SOCIETE GENERALE-A | 56,243 | 46.390 | 2,609,112.770 | |
| VINCI S.A. | 37,818 | 65.910 | 2,492,584.380 | |
| SODEXO | 7,368 | 109.000 | 803,112.000 | |
| SOLVAY SA | 5,991 | 109.350 | 655,115.850 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 41,136 | 67.310 | 2,768,864.160 | |
| VIVENDI SA | 78,086 | 18.140 | 1,416,480.040 | |
| SAP SE | 73,292 | 84.000 | 6,156,528.000 | |
| TECHNIP-COFLEXIP S.A. | 8,870 | 68.020 | 603,337.400 | |
| TELEFONICA S.A | 347,856 | 9.188 | 3,196,100.920 | |
| TOTAL SA | 167,398 | 48.230 | 8,073,605.540 | |
| VALEO | 17,731 | 55.100 | 976,978.100 | |
| E.ON SE | 142,688 | 6.679 | 953,013.150 | |
| VOEST-ALPINE AG | 9,875 | 36.800 | 363,400.000 | |
| ZODIAC AEROSPACE | 15,282 | 22.845 | 349,117.290 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 8,614 | 98.180 | 845,722.520 | |
| METRO AG | 10,774 | 31.250 | 336,687.500 | |
| SIEMENS AG-REG | 56,800 | 117.750 | 6,688,200.000 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 41,826 | 23.180 | 969,526.680 | |
| ING GROEP NV-CVA | 286,593 | 13.640 | 3,909,128.520 | |
| BAYER AG | 61,471 | 100.850 | 6,199,350.350 | |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 42,303 | 10.090 | 426,837.270 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 13,253 | 114.200 | 1,513,492.600 | |
| DAIMLER AG | 71,139 | 72.230 | 5,138,369.970 | |
| BASF SE | 67,970 | 88.100 | 5,988,157.000 | |
| BEIERSDORF AG | 6,780 | 80.990 | 549,112.200 | |
| HOCHTIEF AG | 1,707 | 135.400 | 231,127.800 | |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 11,009 | 85.900 | 945,673.100 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 16,452 | 76.950 | 1,265,981.400 | |
| ORANGE | 152,528 | 14.610 | 2,228,434.080 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 33,059 | 43.050 | 1,423,189.950 | |
| RANDSTAD HOLDINGS | 7,794 | 54.390 | 423,915.660 | |
| ALLIANZ SE | 33,800 | 160.050 | 5,409,690.000 | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 191,094 | 2.740 | 523,597.560 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 98,527 | 19.785 | 1,949,356.690 | |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | 17,602 | 38.095 | 670,548.190 | |
| HERMES INTL | 1,875 | 396.200 | 742,875.000 | |
| ENDESA S.A. | 21,037 | 19.685 | 414,113.340 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 19,748 | 11.660 | 230,261.680 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 23,324 | 28.910 | 674,296.840 | |

| | | | | |
|---------------------------------|-----------|---------|---------------|--|
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 12,354 | 177.650 | 2,194,688.100 | |
| ARCELOR MITTAL (NL) | 130,747 | 7.554 | 987,662.830 | |
| SOCIETE BIC SA | 2,478 | 127.800 | 316,688.400 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 10,673 | 72.900 | 778,061.700 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 11,555 | 30.085 | 347,632.170 | |
| HEINEKEN NV | 17,373 | 70.980 | 1,233,135.540 | |
| AKZO NOBEL | 18,209 | 59.110 | 1,076,333.990 | |
| ASML HOLDING NV | 27,566 | 106.700 | 2,941,292.200 | |
| AEGON NV | 144,321 | 5.151 | 743,397.470 | |
| BANKINTER S.A. | 57,960 | 7.500 | 434,700.000 | |
| VOLKSWAGEN AG | 2,794 | 148.100 | 413,791.400 | |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 14,131 | 146.050 | 2,063,832.550 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 481,507 | 6.357 | 3,060,939.990 | |
| KERING | 5,479 | 216.650 | 1,187,025.350 | |
| CNP ASSURANCES | 13,987 | 17.605 | 246,241.130 | |
| FORTUM OYJ | 37,132 | 14.850 | 551,410.200 | |
| AGEAS | 12,993 | 38.345 | 498,216.580 | |
| UCB SA | 10,367 | 65.410 | 678,105.470 | |
| THYSSENKRUPP AG | 29,215 | 22.925 | 669,753.870 | |
| UNILEVER NV-CVA | 121,112 | 38.850 | 4,705,201.200 | |
| CARREFOUR SA | 43,732 | 22.970 | 1,004,524.040 | |
| GAS NATURAL SDG SA | 29,010 | 17.305 | 502,018.050 | |
| ATOS SE | 7,050 | 102.950 | 725,797.500 | |
| NOKIA OYJ | 442,720 | 4.568 | 2,022,344.960 | |
| TUI AG | 19,196 | 13.690 | 262,793.240 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 71,794 | 28.865 | 2,072,333.810 | |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 20,558 | 34.655 | 712,437.490 | |
| SANOFI | 86,452 | 78.310 | 6,770,056.120 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 45,866 | 10.715 | 491,454.190 | |
| ELISA OYJ | 9,517 | 31.280 | 297,691.760 | |
| BANCO SANTANDER SA | 1,078,026 | 5.115 | 5,514,102.990 | |
| METSO OYJ | 8,585 | 27.600 | 236,946.000 | |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 34,596 | 17.215 | 595,570.140 | |
| QIAGEN N.V. | 14,167 | 27.045 | 383,146.510 | |
| LINDE AG | 14,183 | 155.300 | 2,202,619.900 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 104,836 | 17.660 | 1,851,403.760 | |
| BMW VORZUG | 4,116 | 73.430 | 302,237.880 | |
| K & S | 14,982 | 22.765 | 341,065.230 | |
| ENEL SPA | 581,747 | 4.122 | 2,397,961.130 | |
| COLRUYT NV | 4,673 | 46.480 | 217,201.040 | |
| VOPAK (KON.) | 5,364 | 44.170 | 236,927.880 | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 242,088 | 16.245 | 3,932,719.560 | |
| BANCO POPULAR ESPANOL | 277,768 | 0.973 | 270,268.260 | |
| LEONARDO SPA | 34,431 | 13.480 | 464,129.880 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 81,774 | 16.450 | 1,345,182.300 | |

| | | | | |
|----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| KONINKLIJKE KPN NV | 276,563 | 2.861 | 791,246.740 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 794 | 413.350 | 328,199.900 | |
| UNIPOLSAI SPA | 91,992 | 2.076 | 190,975.390 | |
| EURAZEO | 4,063 | 56.090 | 227,893.670 | |
| BANCO SABADELL | 428,014 | 1.373 | 587,663.220 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 5,814 | 78.660 | 457,329.240 | |
| FRAPORT AG | 3,149 | 56.120 | 176,721.880 | |
| HEINEKEN HOLDING NV-A | 8,014 | 66.420 | 532,289.880 | |
| INDITEX | 83,755 | 31.630 | 2,649,170.650 | |
| JC DECAUX SA | 6,058 | 28.120 | 170,350.960 | |
| ANDRITZ AG | 6,265 | 48.675 | 304,948.870 | |
| MAPFRE SA | 84,474 | 2.903 | 245,228.020 | |
| ESSILOR INTL | 16,004 | 105.050 | 1,681,220.200 | |
| SNAM SPA | 186,129 | 3.806 | 708,406.970 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 85,585 | 12.085 | 1,034,294.720 | |
| ENAGAS | 18,095 | 24.055 | 435,275.220 | |
| WENDEL | 2,220 | 113.550 | 252,081.000 | |
| TENARIS SA | 38,237 | 16.790 | 641,999.230 | |
| TELECOM ITALIA SPA | 672,896 | 0.828 | 557,157.880 | |
| TELECOM ITALIA-RNC | 497,596 | 0.681 | 338,862.870 | |
| ATLANTIA SPA | 27,920 | 22.370 | 624,570.400 | |
| ILIAD SA | 2,102 | 182.900 | 384,455.800 | |
| PROXIMUS | 13,498 | 27.090 | 365,660.820 | |
| SES FDR | 30,439 | 20.785 | 632,674.610 | |
| TERNA SPA | 117,108 | 4.328 | 506,843.420 | |
| GRIFOLS SA | 25,309 | 19.350 | 489,729.150 | |
| FERROVIAL SA | 35,610 | 17.970 | 639,911.700 | |
| LANXESS AG | 6,856 | 63.600 | 436,041.600 | |
| NESTE OYJ | 10,692 | 32.990 | 352,729.080 | |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL | 9,641 | 19.020 | 183,371.820 | |
| KONE OYJ | 23,717 | 43.060 | 1,021,254.020 | |
| ENGIE | 110,924 | 11.930 | 1,323,323.320 | |
| ALSTOM | 12,046 | 26.700 | 321,628.200 | |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 12,542 | 18.095 | 226,947.490 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 20,751 | 9.020 | 187,174.020 | |
| DEUTSCHE WOHNEN AG | 26,714 | 30.600 | 817,448.400 | |
| ARKEMA SA | 4,241 | 90.040 | 381,859.640 | |
| LEGRAND SA | 19,920 | 53.410 | 1,063,927.200 | |
| ADP | 2,313 | 100.750 | 233,034.750 | |
| ORION OYJ | 8,051 | 43.440 | 349,735.440 | |
| RTL GROUP SA | 3,446 | 69.340 | 238,945.640 | |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 37,921 | 14.070 | 533,548.470 | |
| SYMRISE AG | 7,926 | 56.400 | 447,026.400 | |
| SCOR SE | 13,875 | 32.235 | 447,260.620 | |
| REXEL SA | 23,245 | 16.505 | 383,658.720 | |
| PRYSMIAN SPA | 14,925 | 24.480 | 365,364.000 | |

| | | | | | |
|--------|--|------------|---------|-------------------------------------|--|
| | CAIXABANK | 229,231 | 3.296 | 755,545.370 | |
| | BUREAU VERITAS SA | 21,480 | 19.000 | 408,120.000 | |
| | GROUPE EUROTUNNEL SE | 37,646 | 9.160 | 344,837.360 | |
| | SUEZ SA | 25,406 | 13.750 | 349,332.500 | |
| | ENGIE | 3,318 | 0.001 | 3.310 | |
| | AMADEUS IT GROUP SA | 33,099 | 43.805 | 1,449,901.690 | |
| | BRENTAG AG | 12,331 | 51.450 | 634,429.950 | |
| | INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA | 68,448 | 5.513 | 377,353.820 | |
| | DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA | 48,305 | 4.692 | 226,647.060 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 11,575 | 27.230 | 315,187.250 | |
| | EDENRED | 18,682 | 19.755 | 369,062.910 | |
| | BANKIA SA | 370,638 | 1.007 | 373,232.460 | |
| | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 61,541 | 4.090 | 251,702.690 | |
| | HUGO BOSS AG -ORD | 5,218 | 57.290 | 298,939.220 | |
| | OSRAM LICHT AG | 7,017 | 51.210 | 359,340.570 | |
| | GEMALTO | 6,103 | 55.440 | 338,350.320 | |
| | VONOVIA SE | 35,271 | 31.475 | 1,110,154.720 | |
| | FERRARI NV | 8,338 | 55.750 | 464,843.500 | |
| | DEUTSCHE BOERSE AG | 13,844 | 78.300 | 1,083,985.200 | |
| | INNOGY SE | 9,769 | 31.500 | 307,723.500 | |
| | CNH INDUSTRIAL NV | 78,645 | 8.470 | 666,123.150 | |
| | SFR GROUP SA | 8,774 | 26.900 | 236,020.600 | |
| | NN GROUP NV | 21,965 | 32.520 | 714,301.800 | |
| | ZALANDO SE | 6,674 | 37.240 | 248,539.760 | |
| | FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 70,110 | 10.150 | 711,616.500 | |
| | AENA SA | 5,256 | 132.800 | 697,996.800 | |
| | ABN AMRO GROUP NV | 19,363 | 22.080 | 427,535.040 | |
| | EXOR NV | 9,441 | 43.960 | 415,026.360 | |
| | ALTICE NV-A | 38,525 | 18.990 | 731,589.750 | |
| | COVESTRO AG | 5,966 | 64.090 | 382,360.940 | |
| | IBERDROLA SA-RTS | 415,050 | 0.134 | 55,616.700 | |
| | REPSOL SA-RTS | 78,090 | 0.363 | 28,346.670 | |
| | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 56,644 | 100.200 | 5,675,728.800 | |
| | POSTE ITALIANE SPA | 40,015 | 6.135 | 245,492.020 | |
| | SCHAEFFLER AG | 12,644 | 13.755 | 173,918.220 | |
| | LAFARGEHOLCIM LTD | 14,105 | 50.080 | 706,378.400 | |
| | UNIPER SE | 16,058 | 13.380 | 214,856.040 | |
| ユーロ 小計 | | 18,114,780 | | 264,889,869.280 (32,430,466,696) | |
| 香港・ドル | ASM PACIFIC TECH | 16,600 | 84.800 | 1,407,680.000 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 164,000 | 17.460 | 2,863,440.000 | |
| | BANK OF EAST ASIA | 76,260 | 31.750 | 2,421,255.000 | |

| | | | | |
|---|------------|---------|--------------------------------------|--|
| CLP HOLDINGS LTD | 130,500 | 75.500 | 9,852,750.000 | |
| PCCW LTD | 331,000 | 4.440 | 1,469,640.000 | |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 92,000 | 10.560 | 971,520.000 | |
| LI & FUNG LTD | 532,400 | 3.550 | 1,890,020.000 | |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 49,000 | 61.850 | 3,030,650.000 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 89,540 | 187.500 | 16,788,750.000 | |
| MTR CORP | 118,500 | 38.800 | 4,597,800.000 | |
| HANG LUNG GROUP LTD | 63,000 | 27.400 | 1,726,200.000 | |
| HANG SENG BANK LTD | 56,000 | 148.700 | 8,327,200.000 | |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 94,222 | 42.900 | 4,042,123.800 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 112,500 | 71.050 | 7,993,125.000 | |
| (THE) WHARF HOLDINGS LTD | 95,750 | 57.800 | 5,534,350.000 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 616,588 | 14.460 | 8,915,862.480 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 189,000 | 35.850 | 6,775,650.000 | |
| KERRY PROPERTIES LTD | 43,000 | 21.850 | 939,550.000 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 287,000 | 29.000 | 8,323,000.000 | |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS | 50,500 | 27.550 | 1,391,275.000 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 441,266 | 8.690 | 3,834,601.540 | |
| SINO LAND CO | 255,400 | 12.400 | 3,166,960.000 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 113,000 | 104.700 | 11,831,100.000 | |
| SWIRE PACIFIC LTD A | 42,500 | 77.500 | 3,293,750.000 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 113,500 | 28.150 | 3,195,025.000 | |
| WHEELOCK & CO LTD | 56,000 | 46.700 | 2,615,200.000 | |
| WYNN MACAU LTD | 124,400 | 13.000 | 1,617,200.000 | |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | 64,800 | 16.080 | 1,041,984.000 | |
| AIA GROUP LTD | 892,627 | 46.200 | 41,239,367.400 | |
| HKT TRUST / HKT LTD | 214,000 | 9.450 | 2,022,300.000 | |
| SANDS CHINA LTD | 198,000 | 35.300 | 6,989,400.000 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 104,200 | 22.700 | 2,365,340.000 | |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD | 230,000 | 6.470 | 1,488,100.000 | |
| WH GROUP LTD | 530,500 | 6.250 | 3,315,625.000 | |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 199,332 | 90.950 | 18,129,245.400 | |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD | 198,832 | 50.650 | 10,070,840.800 | |
| 香港・ドル 小計 | 6,985,717 | | 215,477,880.420 (3,221,394,311) | |
| 合計 | 87,911,535 | | 263,044,401,726 (263,044,401,726) | |

(2) 株式以外の有価証券

平成29年1月11日現在

| 種 類 | 通 貨 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------------------------------|---------------|------------------------------------|--------------------------------|------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | オーストラリア・ドル | DEXUS PROPERTY GROUP | 63,819.000 | 601,174.980 | |
| | | GOODMAN GROUP | 143,627.000 | 1,024,060.510 | |
| | | GPT GROUP | 144,955.000 | 732,022.750 | |
| | | LENDLEASE GROUP | 37,363.000 | 534,664.530 | |
| | | MIRVAC GROUP | 295,783.000 | 618,186.470 | |
| | | SCENTRE GROUP | 383,688.000 | 1,772,638.560 | |
| | | STOCKLAND | 193,279.000 | 879,419.450 | |
| | | VICINITY CENTRES | 270,443.000 | 808,624.570 | |
| | | WESTFIELD CORP | 140,035.000 | 1,334,533.550 | |
| | オーストラリア・ドル 小計 | 1,672,992.000 | 8,305,325.370 (709,191,734) | | |
| | シンガポール・ドル | ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 200,806.000 | 485,950.520 | |
| | | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 211,000.000 | 329,160.000 | |
| | | CAPITALAND MALL TRUST | 199,000.000 | 399,990.000 | |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | | 192,100.000 | 330,412.000 | | |
| シンガポール・ドル 小計 | 802,906.000 | 1,545,512.520 (124,722,860) | | | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | 2,475,898 | 833,914,594 (833,914,594) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | AGNC INVESTMENT CORP | 25,741.000 | 482,643.750 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 5,587.000 | 619,318.950 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 31,665.000 | 3,277,327.500 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 77,528.000 | 788,459.760 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 10,191.000 | 1,801,972.620 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 11,168.000 | 1,438,326.720 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 21,975.000 | 537,069.000 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 6,285.000 | 519,706.650 | |
| | | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 25,117.000 | 2,118,870.120 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 11,787.000 | 1,206,517.320 | |
| | | DUKE REALTY TRUST | 24,470.000 | 654,083.100 | |
| | | EQUINIX INC | 5,241.000 | 1,939,327.230 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 27,070.000 | 1,729,231.600 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 5,283.000 | 1,215,618.300 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 9,980.000 | 764,767.400 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 5,741.000 | 810,571.790 | |
| | | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 43,463.000 | 1,088,313.520 | |
| | | HCP INC | 34,130.000 | 1,025,606.500 | |

| | | | | |
|------------|------------------------------------|-------------|-----------------------------------|--|
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 58,146.000 | 1,048,372.380 | |
| | IRON MOUNTAIN INC | 19,265.000 | 641,524.500 | |
| | KIMCO REALTY | 32,980.000 | 829,117.200 | |
| | LIBERTY PROPERTY TRUST | 11,649.000 | 465,727.020 | |
| | MID AMERICA | 8,123.000 | 791,992.500 | |
| | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 10,544.000 | 472,898.400 | |
| | PARK HOTELS & RESORTS INC | 8,877.000 | 259,385.940 | |
| | PROLOGIS INC | 38,966.000 | 2,044,546.020 | |
| | PUBLIC STORAGE | 11,151.000 | 2,512,320.300 | |
| | REALTY INCOME CORP | 20,047.000 | 1,176,558.430 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 7,365.000 | 505,975.500 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 23,516.000 | 4,331,412.040 | |
| | SL GREEN | 7,722.000 | 818,918.100 | |
| | THE MACERICH COMPANY | 9,014.000 | 631,791.260 | |
| | UDR INC | 21,797.000 | 778,806.810 | |
| | VENTAS INC | 27,031.000 | 1,653,215.960 | |
| | VEREIT INC | 59,654.000 | 523,762.120 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 12,211.000 | 1,282,155.000 | |
| | WELLTOWER INC | 26,516.000 | 1,758,541.120 | |
| | WEYERHAEUSER CO | 57,008.000 | 1,751,855.840 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | 854,004.000 | 46,296,608.270 (5,368,554,694) | |
| イギリス・債券 | BRITISH LAND CO PLC | 71,871.000 | 451,349.880 | |
| | HAMMERSON PLC | 58,616.000 | 334,404.280 | |
| | INTU PROPERTIES PLC | 74,712.000 | 209,118.880 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 63,231.000 | 656,970.090 | |
| | SEGRO PLC | 50,928.000 | 240,482.010 | |
| イギリス・債券 小計 | | 319,358.000 | 1,892,325.140 (267,328,773) | |
| カナダ・ドル | H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 10,748.000 | 243,764.640 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 9,675.000 | 259,386.750 | |
| | SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2,582.000 | 82,908.020 | |
| カナダ・ドル 小計 | | 23,005.000 | 586,059.410 (51,315,362) | |
| ユーロ | FONCIERE DES REGIONS | 2,343.000 | 189,876.720 | |
| | GECINA SA | 3,212.000 | 410,654.200 | |
| | ICADE | 2,234.000 | 151,666.260 | |
| | KLEPIERRE | 17,042.000 | 623,311.150 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 7,221.000 | 1,607,033.550 | |
| ユーロ 小計 | | 32,052.000 | 2,982,541.880 (365,152,602) | |
| 香港・ドル | LINK REIT | 163,500.000 | 8,714,550.000 | |
| 香港・ドル 小計 | | 163,500.000 | 8,714,550.000 | |

| | | | | |
|------|----|-----------|----------------------------------|--|
| | | | (130,282,523) | |
| 投資証券 | 合計 | 1,391,919 | 6,182,633,954 (6,182,633,954) | |
| 合計 | | | 7,016,548,548 (7,016,548,548) | |

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 603銘柄 投資証券 38銘柄 | 62.79% -% | -% -% | -% 1.94% | 66.21% |
| イギリス・ポンド | 株式 106銘柄 投資証券 5銘柄 | 6.95% -% | -% -% | -% 0.10% | 7.21% |
| イスラエル・シェケル | 株式 8銘柄 | 0.10% | -% | -% | 0.10% |
| オーストラリア・ドル | 株式 60銘柄 投資信託 受益証券 9銘柄 | 2.68% -% | -% 0.26% | -% -% | 3.01% |
| カナダ・ドル | 株式 90銘柄 投資証券 3銘柄 | 3.93% -% | -% -% | -% 0.02% | 4.04% |
| シンガポール・ドル | 株式 20銘柄 投資信託 受益証券 4銘柄 | 0.45% -% | -% 0.05% | -% -% | 0.51% |
| スイス・フラン | 株式 37銘柄 | 3.37% | -% | -% | 3.44% |
| スウェーデン・クローナ | 株式 30銘柄 | 1.09% | -% | -% | 1.11% |
| デンマーク・クローネ | 株式 17銘柄 | 0.64% | -% | -% | 0.65% |
| ニュージーランド・ドル | 株式 3銘柄 | 0.06% | -% | -% | 0.07% |
| ノルウェー・クローネ | 株式 9銘柄 | 0.25% | -% | -% | 0.26% |
| ユーロ | 株式 235銘柄 投資証券 5銘柄 | 11.74% -% | -% -% | -% 0.13% | 12.14% |
| 香港・ドル | 株式 36銘柄 投資証券 1銘柄 | 1.17% -% | -% -% | -% 0.05% | 1.24% |

(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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 573,748,602 | 118,148,434 |
| コール・ローン | | 796,259,569 | 56,903,374 |
| 投資信託受益証券 | | 3,719,396,381 | 3,992,465,480 |
| 投資証券 | | 28,952,181,705 | 32,056,893,880 |
| 派生商品評価勘定 | | - | 4,380 |
| 未収入金 | | - | 227,989,108 |
| 未収配当金 | | 111,004,716 | 168,213,526 |
| 流動資産合計 | | 34,152,590,973 | 36,620,618,182 |
| 資産合計 | | 34,152,590,973 | 36,620,618,182 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 1,176,046 | 1,085 |
| 未払金 | | 1,227,595,788 | 271,160,938 |
| 未払解約金 | | 23,349,000 | 30,410,000 |
| 流動負債合計 | | 1,252,120,834 | 301,572,023 |
| 負債合計 | | 1,252,120,834 | 301,572,023 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 30,438,313,343 | 30,797,163,241 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 2,462,156,796 | 5,521,882,918 |
| 元本等合計 | | 32,900,470,139 | 36,319,046,159 |
| 純資産合計 | | 32,900,470,139 | 36,319,046,159 |
| 負債純資産合計 | | 34,152,590,973 | 36,620,618,182 |

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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--|-----------------|-----------------|
| 1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 26,797,491,574円 | 30,438,313,343円 |
| 同期中追加設定元本額 | 14,766,757,522円 | 10,808,500,845円 |
| 同期中一部解約元本額 | 11,125,935,753円 | 10,449,650,947円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| D I A M先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ） | 85,146,602円 | 109,705,308円 |
| D I A M先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ） | 31,624,429円 | 32,710,640円 |
| M I T O ラップ型ファンド（安定型） | 13,199,640円 | 9,243,698円 |
| M I T O ラップ型ファンド（中立型） | 30,478,935円 | 27,008,013円 |
| M I T O ラップ型ファンド（積極型） | 70,478,490円 | 62,645,962円 |

| | | |
|---|-----------------|----------------------|
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 27,512,661円 | 27,539,180円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 26,962,207円 | 26,049,440円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 28,522,170円 | 32,662,026円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 859,575,163円 | 1,048,687,394円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> | 7,057,290円 | 92,960,487円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 26,181,578円 | 24,182,932円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 543,841,270円 | 535,960,685円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 80,620,116円 | 65,018,582円 |
| D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国10） | 15,564,819円 | 20,292,719円 |
| D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国20） | 43,803,050円 | 52,151,631円 |
| D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国30） | 94,210,786円 | 117,262,106円 |
| 投資のソムリエ | 1,786,627,593円 | 1,450,999,269円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 41,327,733円 | 42,813,620円 |
| D I A M 8資産バランス ファンドN<DC年金> | 55,490,458円 | 66,829,184円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 6,032,939円 | 17,460,669円 |
| ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド | 554,926円 - 円 | 254,314円 385,174円 |
| D I A Mパッシブ資産分散 ファンド | 1,447,767,054円 | 1,464,781,548円 |
| D I A M外国リートインデック スファンド<DC年金> | 4,891,687円 | 10,551,392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） | 235,476,312円 | 624,304,901円 |
| D I A Mアクティブアロケー ション私募ファンド（適格機関 投資家限定） | 105,114,015円 | 138,121,629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） | 4,750,203,053円 | 4,222,058,627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） | 50,484,750円 | 50,484,750円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A（適格機関投資 家限定） | 12,783,502,187円 | 12,251,558,343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） | 3,036,946,149円 | 3,059,696,034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） | 3,586,745,115円 | 4,551,175,471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） | 562,370,166円 | 561,607,513円 |
| 計 | | 30,438,313,343円 | 30,797,163,241円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 30,438,313,343口 | 30,797,163,241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28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|-------------------------|--|------------------------------|
| 1．金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3．金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 投資信託受益証券 | 95,280,695 | 62,005,197 |
| 投資証券 | 792,841,986 | 579,946,476 |
| 合計 | 888,122,681 | 641,951,673 |

（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28年6月23日から平成28年7月11日まで及び平成28年6月23日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

| 種類 | 平成28年7月11日 現在 | | | | 平成29年1月11日 現在 | | | |
|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|---------------|-----------|------------|-------------|
| | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | - | - | - | - | 43,419,880 | - | 43,415,500 | 4,380 |
| イギリス・ポンド | - | - | - | - | 7,063,525 | - | 7,063,000 | 525 |
| オーストラリア・ドル | - | - | - | - | 11,953,900 | - | 11,953,200 | 700 |
| カナダ・ドル | - | - | - | - | 3,502,200 | - | 3,502,000 | 200 |
| シンガポール・ドル | - | - | - | - | 4,518,976 | - | 4,518,640 | 336 |
| ニュージーランド・ドル | - | - | - | - | 2,264,304 | - | 2,264,080 | 224 |
| ユーロ | - | - | - | - | 10,529,023 | - | 10,528,980 | 43 |
| 香港・ドル | - | - | - | - | 3,587,952 | - | 3,585,600 | 2,352 |
| 買 建 | 742,140,746 | - | 740,964,700 | 1,176,046 | 35,945,585 | - | 35,944,500 | 1,085 |
| アメリカ・ドル | 693,519,630 | - | 692,496,000 | 1,023,630 | 35,945,585 | - | 35,944,500 | 1,085 |
| カナダ・ドル | 19,420,100 | - | 19,285,000 | 135,100 | - | - | - | - |
| シンガポール・ドル | 29,201,016 | - | 29,183,700 | 17,316 | - | - | - | - |
| 合計 | 742,140,746 | - | 740,964,700 | 1,176,046 | 79,365,465 | - | 79,360,000 | 3,295 |

（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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0809円 | 1.1793円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,809円） | （11,793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29年1月11日現在

| 種 類 | 通 貨 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|------------|----------------------------------|---------------|---------------|----|
| 投資信託受益証券 | オーストラリア・ドル | 360 CAPITAL GROUP LTD | 62,283.000 | 54,186.210 | |
| | | 360 CAPITAL OFFICE FUND | 11,233.000 | 24,263.280 | |
| | | ABACUS PROPERTY GROUP | 75,880.000 | 230,675.200 | |
| | | ALE PROPERTY GROUP | 52,270.000 | 229,988.000 | |
| | | ARENA REIT | 69,760.000 | 134,288.000 | |
| | | ASPEN GROUP | 31,613.000 | 34,616.230 | |
| | | ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 13,740.000 | 89,310.000 | |
| | | BWP TRUST | 136,570.000 | 409,710.000 | |
| | | CHARTER HALL GROUP | 117,290.000 | 551,263.000 | |
| | | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 47,800.000 | 190,722.000 | |
| | | CHARTER HALL RETAIL REIT | 93,020.000 | 391,614.200 | |
| | | CROMWELL PROPERTY GROUP | 381,600.000 | 375,876.000 | |
| | | DEXUS PROPERTY GROUP | 278,040.000 | 2,619,136.800 | |
| | | FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 64,100.000 | 164,737.000 | |
| | | GDI PROPERTY GROUP | 149,910.000 | 149,160.450 | |
| | | GENERATION HEALTHCARE REIT | 39,700.000 | 76,422.500 | |
| | | GOODMAN GROUP | 457,780.000 | 3,263,971.400 | |
| | | GPT GROUP | 519,700.000 | 2,624,485.000 | |
| | | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 55,000.000 | 182,600.000 | |
| | | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 46,560.000 | 129,902.400 | |
| | | INDUSTRIA REIT | 43,830.000 | 92,043.000 | |
| | | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 52,000.000 | 140,400.000 | |
| | | INVESTA OFFICE FUND | 176,630.000 | 835,459.900 | |
| | | MIRVAC GROUP | 1,072,390.000 | 2,241,295.100 | |
| | | NATIONAL STORAGE REIT | 144,510.000 | 219,655.200 | |
| | | SCENTRE GROUP | 1,532,704.000 | 7,081,092.480 | |
| | | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 204,240.000 | 453,412.800 | |
| | | STOCKLAND | 691,300.000 | 3,145,415.000 | |
| | | VICINITY CENTRES | 938,780.000 | 2,806,952.200 | |
| | | VIVA ENERGY REIT | 116,910.000 | 282,922.200 | |
| | | WESTFIELD CORP | 550,060.000 | 5,242,071.800 | |

| | | | | |
|---------------|--|---------------|-----------------------------------|--|
| オーストラリア・ドル 小計 | | 8,227,203.000 | 34,467,647.350 (2,943,192,407) | |
| カナダ・ドル | KILLAM APARTMENT REIT | 8,810.000 | 105,896.200 | |
| カナダ・ドル 小計 | | 8,810.000 | 105,896.200 (9,272,271) | |
| シンガポール・ドル | AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT | 165,095.000 | 222,052.770 | |
| | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 242,000.000 | 171,820.000 | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 681,060.000 | 1,648,165.200 | |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 272,000.000 | 316,880.000 | |
| | CACHE LOGISTICS TRUST | 251,500.000 | 204,972.500 | |
| | CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | 302,000.000 | 167,610.000 | |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 614,010.000 | 957,855.600 | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 777,060.000 | 1,561,890.600 | |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 204,080.000 | 289,793.600 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 199,000.000 | 275,615.000 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 221,000.000 | 131,495.000 | |
| | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 152,000.000 | 193,800.000 | |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 159,000.000 | 315,615.000 | |
| | FRASERS COMMERCIAL TRUST | 170,080.000 | 216,852.000 | |
| | FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST | 306,000.000 | 287,640.000 | |
| | KEPPEL DC REIT | 232,000.000 | 285,360.000 | |
| | KEPPEL REIT | 502,000.000 | 529,610.000 | |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 563,000.000 | 208,310.000 | |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 505,000.000 | 739,825.000 | |
| | MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST | 525,000.000 | 511,875.000 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 340,020.000 | 564,433.200 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 430,020.000 | 451,521.000 | |
| | QUE COMMERCIAL REIT | 157,000.000 | 109,115.000 | |
| | QUE HOSPITALITY TRUST | 342,520.000 | 234,626.200 | |
| | PARKWAY LIFE REIT | 114,000.000 | 271,320.000 | |
| | SABANA SHARI'AH COMPLIANT IND REIT-RTS | 81,984.000 | 6,886.650 | |
| | SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 272,000.000 | 93,840.000 | |

訂正有価証券届出書（内国投資）

| | | | | | |
|-------------|---------|--------------------------------------|----------------|-----------------------------------|--|
| | | SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 201,000.000 | 134,670.000 | |
| | | SPH REIT | 225,500.000 | 219,862.500 | |
| | | STARHILL GLOBAL REIT | 398,000.000 | 306,460.000 | |
| | | SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 731,090.000 | 1,257,474.800 | |
| | | シンガポール・ドル 小計 | 10,336,019.000 | 12,887,246.620 (1,040,000,802) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | 18,572,032 | 3,992,465,480 (3,992,465,480) | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | ACADIA REALTY TRUST | 23,450.000 | 756,966.000 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 7,670.000 | 350,595.700 | |
| | | ALEXANDER'S INC. | 1,020.000 | 437,437.200 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 22,890.000 | 2,537,356.500 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 11,640.000 | 502,498.800 | |
| | | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 38,040.000 | 1,885,262.400 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT | 61,900.000 | 1,259,046.000 | |
| | | APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 45,190.000 | 1,999,657.500 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 45,360.000 | 918,993.600 | |
| | | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 10,040.000 | 143,572.000 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC | 8,050.000 | 113,424.500 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 23,460.000 | 184,630.200 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 39,530.000 | 6,989,694.600 | |
| | | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC | 5,070.000 | 70,168.800 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 44,260.000 | 5,700,245.400 | |
| | | BRANDYWINE REALTY TRUST | 50,800.000 | 820,928.000 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 75,360.000 | 1,841,798.400 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 25,200.000 | 2,083,788.000 | |
| | | CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 24,340.000 | 611,177.400 | |
| | | CARETRUST REIT INC | 18,180.000 | 281,062.800 | |
| | | CBL & ASSOCIATES | 49,510.000 | 544,610.000 | |
| | | CEDAR REALTY TRUST INC | 22,320.000 | 141,285.600 | |
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 11,250.000 | 227,250.000 | |
| | | CHESAPEAKE LODGING TRUST | 17,600.000 | 444,576.000 | |
| | | CITY OFFICE REIT INC | 5,980.000 | 74,331.400 | |
| | | COLONY STARWOOD HOMES | 14,400.000 | 412,704.000 | |

| | | | |
|------------------------------------|-------------|---------------|--|
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 35,810.000 | 762,394.900 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 3,470.000 | 80,226.400 | |
| CORECIVIC INC | 34,100.000 | 902,968.000 | |
| CORESITRE REALTY CORP | 9,830.000 | 806,060.000 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 27,490.000 | 843,668.100 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 99,260.000 | 829,813.600 | |
| CUBESMART | 51,600.000 | 1,396,812.000 | |
| CYRUSONE INC | 21,560.000 | 1,043,935.200 | |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 26,060.000 | 1,242,540.800 | |
| DDR CORP | 88,140.000 | 1,325,625.600 | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 58,080.000 | 652,238.400 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 45,730.000 | 4,680,922.800 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 41,420.000 | 1,525,084.400 | |
| DUKE REALTY TRUST | 101,930.000 | 2,724,588.900 | |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC | 21,930.000 | 1,031,587.200 | |
| EAST GROUP | 9,490.000 | 703,303.900 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 7,030.000 | 138,912.800 | |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 21,190.000 | 884,894.400 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 35,710.000 | 713,485.800 | |
| EPR PROPERTIES | 18,230.000 | 1,312,924.600 | |
| EQUITY COMMONWEALTH | 36,420.000 | 1,106,075.400 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 23,080.000 | 1,665,452.800 | |
| EQUITY ONE INC | 26,940.000 | 827,596.800 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 105,260.000 | 6,724,008.800 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 18,840.000 | 4,335,084.000 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 36,160.000 | 2,770,940.800 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 4,600.000 | 50,186.000 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 20,630.000 | 2,912,749.700 | |
| FELCOR LODGING TR INC | 37,690.000 | 300,012.400 | |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 33,920.000 | 941,280.000 | |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 17,080.000 | 183,268.400 | |
| FOREST CITY REALTY TRUST INC | 62,200.000 | 1,270,124.000 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 17,550.000 | 362,407.500 | |

| | | | |
|------------------------------------|-------------|---------------|--|
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 31,150.000 | 401,523.500 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 56,050.000 | 1,736,989.500 | |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 167,980.000 | 4,206,219.200 | |
| GEO GROUP INC | 21,760.000 | 817,305.600 | |
| GETTY REALTY CORP | 7,730.000 | 200,052.400 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 6,540.000 | 130,211.400 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 49,490.000 | 385,032.200 | |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST | 20,840.000 | 409,922.800 | |
| GRAMERCY PROPERTY TRSUT | 40,410.000 | 1,098,747.900 | |
| HCP INC | 134,500.000 | 4,041,725.000 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 33,620.000 | 1,017,005.000 | |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 40,500.000 | 1,180,170.000 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 11,600.000 | 240,120.000 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 28,830.000 | 1,490,511.000 | |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 47,260.000 | 1,446,628.600 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 212,800.000 | 3,836,784.000 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 34,900.000 | 1,227,433.000 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 16,420.000 | 147,780.000 | |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 35,540.000 | 247,358.400 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 70,600.000 | 2,350,980.000 | |
| ISTAR INC | 20,880.000 | 259,538.400 | |
| KILROY REALTY CORP | 26,560.000 | 1,934,896.000 | |
| KIMCO REALTY | 122,180.000 | 3,071,605.200 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 24,220.000 | 569,412.200 | |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 32,810.000 | 998,080.200 | |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 61,870.000 | 664,483.800 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 42,310.000 | 1,691,553.800 | |
| LIFE STORAGE INC | 13,460.000 | 1,141,273.400 | |
| LTC PROPERTIES INC | 11,370.000 | 530,979.000 | |
| MACK CALI | 26,010.000 | 742,325.400 | |
| MANULIFE US REIT | 160,000.000 | 135,200.000 | |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 5,660.000 | 65,033.400 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 91,500.000 | 1,133,685.000 | |

| | | | |
|---|-------------|---------------|--|
| MID AMERICA | 32,640.000 | 3,182,400.000 | |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 20,440.000 | 304,760.400 | |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC | 48,350.000 | 509,609.000 | |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 11,560.000 | 840,180.800 | |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 42,370.000 | 1,900,294.500 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 11,700.000 | 266,175.000 | |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 24,090.000 | 242,827.200 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 5,030.000 | 116,092.400 | |
| NORTHSTAR ASSET MANAGEMENT GROUP INC | 101,559.000 | 1,608,694.560 | |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 15,700.000 | 195,308.000 | |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP | 52,420.000 | 845,534.600 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 56,190.000 | 1,798,080.000 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 4,550.000 | 111,520.500 | |
| PARKWAY INC | 12,520.000 | 267,802.800 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 20,890.000 | 613,748.200 | |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 20,360.000 | 378,696.000 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 39,320.000 | 730,565.600 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 42,130.000 | 880,517.000 | |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 7,100.000 | 101,317.000 | |
| PROLOGIS INC | 152,210.000 | 7,986,458.700 | |
| PS BUSINESS PARKS | 5,660.000 | 665,785.800 | |
| PUBLIC STORAGE | 42,960.000 | 9,678,888.000 | |
| QTS REALTY TRUST INC | 13,830.000 | 696,340.500 | |
| QUALITY CARE PROPERTIES INC | 27,110.000 | 437,284.300 | |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 23,210.000 | 382,500.800 | |
| REALTY INCOME CORP | 74,400.000 | 4,366,536.000 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 30,100.000 | 2,067,870.000 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 31,690.000 | 657,884.400 | |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 68,870.000 | 1,039,248.300 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 19,340.000 | 461,839.200 | |

| | | | |
|---------------------------------|-------------|----------------|--|
| RLJ LODGING TRUST | 36,060.000 | 863,276.400 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 14,800.000 | 906,796.000 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 18,910.000 | 476,342.900 | |
| SAUL CENTERS INC | 3,450.000 | 225,492.000 | |
| SELECT INCOME REIT | 18,400.000 | 475,824.000 | |
| SENIOR HOUSING PTYS TRUST | 68,000.000 | 1,285,880.000 | |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 6,670.000 | 266,866.700 | |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 10,390.000 | 178,811.900 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 90,528.000 | 16,674,352.320 | |
| SL GREEN | 29,130.000 | 3,089,236.500 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 139,130.000 | 1,515,125.700 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 21,910.000 | 521,458.000 | |
| STORE CAPITAL CORP | 45,230.000 | 1,135,725.300 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 25,570.000 | 398,124.900 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 19,120.000 | 1,477,211.200 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 62,810.000 | 938,381.400 | |
| TANGER FACTORY OUTLET | 27,870.000 | 994,959.000 | |
| TAUBMAN CENTERS INC | 17,300.000 | 1,273,107.000 | |
| TERRENO REALTY CORP | 13,490.000 | 379,743.500 | |
| THE MACERICH COMPANY | 34,790.000 | 2,438,431.100 | |
| TIER REIT INC | 14,010.000 | 249,237.900 | |
| UDR INC | 76,800.000 | 2,744,064.000 | |
| UMH PROPERTIES INC | 7,890.000 | 114,405.000 | |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 3,670.000 | 236,825.100 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 26,610.000 | 738,161.400 | |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 8,470.000 | 197,520.400 | |
| VENTAS INC | 101,930.000 | 6,234,038.800 | |
| VEREIT INC | 280,740.000 | 2,464,897.200 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 49,490.000 | 5,196,450.000 | |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 53,750.000 | 565,987.500 | |
| WASHINGTON REIT | 21,630.000 | 697,351.200 | |
| WEINGARTEN REALTY INVST | 33,700.000 | 1,197,024.000 | |
| WELLTOWER INC | 104,370.000 | 6,921,818.400 | |
| WHEELER REIT INC | 16,560.000 | 28,152.000 | |
| WHITESTONE REIT | 8,330.000 | 114,787.400 | |
| WP CAREY INC | 30,600.000 | 1,856,196.000 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 30,560.000 | 585,224.000 | |

| | | | | |
|---------------|--|---------------|-------------------------------------|--|
| アメリカ・ドル 小計 | | 6,239,257.000 | 226,926,846.180 (26,314,437,083) | |
| イギリス・ポンド | ASSURA PLC | 459,290.000 | 260,417.430 | |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 41,940.000 | 300,080.700 | |
| | BRITISH LAND CO PLC | 293,870.000 | 1,845,503.600 | |
| | CAPITAL & REGIONAL PLC | 134,330.000 | 72,538.200 | |
| | DERWENT LONDON PLC | 32,000.000 | 860,480.000 | |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 140,420.000 | 147,441.000 | |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 99,130.000 | 654,753.650 | |
| | HAMMERSON PLC | 224,890.000 | 1,282,997.450 | |
| | HANSTEEN HOLDINGS PLC | 218,830.000 | 247,496.730 | |
| | INTU PROPERTIES PLC | 259,880.000 | 727,404.120 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 230,200.000 | 2,391,778.000 | |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 177,400.000 | 273,550.800 | |
| | MCKAY SECURITIES PLC | 29,060.000 | 54,255.020 | |
| | MUCKLOW (A & J) GROUP PLC | 16,720.000 | 77,915.200 | |
| | NEWRIVER REIT PLC | 68,680.000 | 237,152.040 | |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 175,630.000 | 194,949.300 | |
| | REDEFINE INTERNATIONAL PLC | 364,760.000 | 145,904.000 | |
| | REGIONAL REIT LTD | 59,530.000 | 63,994.750 | |
| | SAFESTORE HOLDINGS LTD | 60,880.000 | 213,140.880 | |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | 138,750.000 | 79,365.000 | |
| | SEGRO PLC | 239,550.000 | 1,131,155.100 | |
| | SHAFTESBURY PLC | 80,140.000 | 734,883.800 | |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 317,340.000 | 445,862.700 | |
| | WORKSPACE GROUP PLC | 34,570.000 | 269,300.300 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | 3,897,790.000 | 12,712,319.770 (1,795,869,413) | |
| イスラエル・シュケル | REIT 1 LTD | 49,200.000 | 555,468.000 | |
| イスラエル・シュケル 小計 | | 49,200.000 | 555,468.000 (16,741,806) | |
| カナダ・ドル | AGELLAN COMMERCIAL REIT | 3,240.000 | 34,992.000 | |
| | ALLIED PROPERTIES REIT | 12,150.000 | 427,072.500 | |
| | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 20,650.000 | 261,429.000 | |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 6,290.000 | 317,707.900 | |
| | BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES | 3,350.000 | 90,048.000 | |
| | CANADIAN APT PPTYS REIT | 19,300.000 | 607,950.000 | |
| | CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST | 10,230.000 | 484,902.000 | |

| | | | | |
|-------------|--|-------------|--------------------------------|--|
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 13,630.000 | 185,640.600 | |
| | COMINAR REAL ESTATE INVT TR | 24,890.000 | 370,114.300 | |
| | CROMBIE REAL ESTATE INV | 12,950.000 | 174,695.500 | |
| | CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9,390.000 | 139,253.700 | |
| | DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 18,550.000 | 174,184.500 | |
| | DREAM INDUSTRIAL REIT | 8,770.000 | 72,791.000 | |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | 15,030.000 | 294,738.300 | |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 6,880.000 | 303,339.200 | |
| | H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 40,090.000 | 909,241.200 | |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 10,790.000 | 77,903.800 | |
| | MILESTONE APARTMENTS REIT | 11,860.000 | 229,491.000 | |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 4,810.000 | 64,213.500 | |
| | MORGUARD REAL ESTATE INVT TR | 7,440.000 | 112,120.800 | |
| | NORTHVIEW APARTMENT REIT | 7,000.000 | 141,820.000 | |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9,860.000 | 99,093.000 | |
| | ONEREIT | 9,828.000 | 36,068.760 | |
| | PLAZA RETAIL REIT | 14,000.000 | 69,860.000 | |
| | PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST | 35,960.000 | 199,578.000 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 45,960.000 | 1,232,187.600 | |
| | SLATE OFFICE REIT | 4,920.000 | 39,409.200 | |
| | SLATE RETAIL REIT | 4,000.000 | 59,000.000 | |
| | SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 18,220.000 | 585,044.200 | |
| カナダ・ドル 小計 | | 410,038.000 | 7,793,889.560 (682,432,970) | |
| ニュージーランド・ドル | ARGOSY PROPERTY LTD | 238,270.000 | 250,183.500 | |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 286,410.000 | 353,716.350 | |
| | INVESTORE PROPERTY LTD | 65,120.000 | 90,516.800 | |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 376,620.000 | 542,332.800 | |
| | PRECINCT PROPERTIES | 293,900.000 | 364,436.000 | |
| | PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 125,780.000 | 202,505.800 | |
| | STRIDE STAPLED GROUP | 106,570.000 | 186,497.500 | |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 94,610.000 | 193,477.450 | |

| | | | | |
|----------------|---|---------------|-----------------------------------|--|
| ニュージーランド・ドル 小計 | | 1,587,280.000 | 2,183,666.200 (176,614,922) | |
| ユーロ | AEDIFICA | 4,010.000 | 287,918.000 | |
| | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 29,530.000 | 347,863.400 | |
| | ALTAREA | 750.000 | 140,625.000 | |
| | AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | 17,160.000 | 231,488.400 | |
| | BEFIMMO | 6,530.000 | 342,041.400 | |
| | BENI STABILI SPA | 306,270.000 | 166,304.610 | |
| | COFINIMMO SA | 5,840.000 | 626,340.000 | |
| | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 13,780.000 | 500,971.900 | |
| | FONCIERE DES REGIONS | 14,090.000 | 1,141,853.600 | |
| | GECINA SA | 11,610.000 | 1,484,338.500 | |
| | GREEN REIT PLC | 196,233.000 | 266,091.940 | |
| | HAMBORNER REIT AG | 23,610.000 | 211,026.180 | |
| | HIBERNIA REIT PLC | 200,400.000 | 244,087.200 | |
| | HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA | 30,970.000 | 347,328.550 | |
| | ICADE | 13,080.000 | 888,001.200 | |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 94,280.000 | 71,087.120 | |
| | INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 3,890.000 | 92,406.950 | |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 102,410.000 | 119,819.700 | |
| | KLEPIERRE | 59,790.000 | 2,186,819.250 | |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 26,680.000 | 184,358.800 | |
| | MERCIALYS | 16,200.000 | 313,308.000 | |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 134,600.000 | 1,402,532.000 | |
| | MONTEA SCA | 1,910.000 | 87,764.500 | |
| | NSI NV | 42,301.000 | 160,320.790 | |
| | RETAIL ESTATES | 1,600.000 | 118,624.000 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 28,590.000 | 6,362,704.500 | |
| | VASTNED RETAIL | 5,600.000 | 202,356.000 | |
| | WAREHOUSES DE PAUW | 4,540.000 | 382,812.800 | |
| | WERELDHAVE BELGIUM | 630.000 | 69,079.500 | |
| | WERELDHAVE NV | 11,560.000 | 509,564.800 | |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 1,000.000 | 35,490.000 | |
| ユーロ 小計 | | 1,409,444.000 | 19,525,328.590 (2,390,485,979) | |
| 香港・ドル | CHAMPION REIT | 612,070.000 | 2,656,383.800 | |
| | FORTUNE REAL ESTATE (HK) | 390,000.000 | 3,525,600.000 | |
| | LINK REIT | 642,020.000 | 34,219,666.000 | |
| | PROSPERITY REIT | 335,000.000 | 1,061,950.000 | |

訂正有価証券届出書（内容変更）

| | | | | | |
|---------|--|---------------------------------------|-------------|------------------------------------|---------------------------------|
| | | REGAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 261,000.000 | 542,880.000 | |
| | | SPRING REIT | 216,000.000 | 686,880.000 | |
| | | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 309,000.000 | 1,486,290.000 | |
| | | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 315,000.000 | 1,326,150.000 | |
| | | 香港・ドル 小計 | | 3,080,090.000 | 45,505,799.800 (680,311,707) |
| 投資証券 合計 | | | 16,673,099 | 32,056,893,880 (32,056,893,880) | |
| 合計 | | | | 36,049,359,360 (36,049,359,360) | |

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 159銘柄 | -% | 72.45% | 73.00% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 24銘柄 | -% | 4.94% | 4.98% |
| イスラエル・シェケル | 投資証券 1銘柄 | -% | 0.05% | 0.05% |
| オーストラリア・ドル | 投資信託受益証券 31銘柄 | 8.10% | -% | 8.16% |
| カナダ・ドル | 投資信託受益証券 1銘柄 | 0.03% | -% | 1.92% |
| | 投資証券 29銘柄 | -% | 1.88% | |
| シンガポール・ドル | 投資信託受益証券 31銘柄 | 2.86% | -% | 2.88% |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 8銘柄 | -% | 0.49% | 0.49% |
| ユーロ | 投資証券 31銘柄 | -% | 6.58% | 6.63% |
| 香港・ドル | 投資証券 8銘柄 | -% | 1.87% | 1.89% |

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 51,516,526 | 2,168,485,077 |
| コール・ローン | | 2,646,720,754 | 2,304,683,303 |
| 国債証券 | | 151,607,104,690 | 158,064,463,129 |
| 派生商品評価勘定 | | 3,394,437,172 | 981,610,002 |
| 未収入金 | | - | 1,452,761,375 |
| 未収利息 | | 1,114,323,206 | 1,177,754,150 |
| 前払費用 | | 148,676,033 | 101,152,220 |
| 流動資産合計 | | 158,962,778,381 | 166,250,909,256 |
| 資産合計 | | 158,962,778,381 | 166,250,909,256 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 3,127,814 | 70,791,468 |
| 未払金 | | 25,215,687 | 3,563,088,335 |
| 未払解約金 | | 51,419,000 | 49,903,000 |
| 流動負債合計 | | 79,762,501 | 3,683,782,803 |
| 負債合計 | | 79,762,501 | 3,683,782,803 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 114,155,950,265 | 122,533,641,088 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 44,727,065,615 | 40,033,485,365 |
| 元本等合計 | | 158,883,015,880 | 162,567,126,453 |
| 純資産合計 | | 158,883,015,880 | 162,567,126,453 |
| 負債純資産合計 | | 158,962,778,381 | 166,250,909,256 |

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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|---|------------------|------------------|
| 1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 136,783,689,294円 | 114,155,950,265円 |
| 同期中追加設定元本額 | 21,008,699,280円 | 34,705,515,698円 |
| 同期中一部解約元本額 | 43,636,438,309円 | 26,327,824,875円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| たわらノーロード 先進国債券 ＜為替ヘッジあり＞ | - 円 | 140,213,756円 |
| 投資のソムリエ | 6,101,488,111円 | 7,180,183,835円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞ | 140,525,350円 | 212,124,776円 |
| 投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型 | 34,857,922円 | 126,887,049円 |
| リスク抑制世界８資産バランス ファンド | - 円 | 2,712,426円 |
| 外国債券パッシブファンド２ （為替フルヘッジ）（適格機関 投資家限定） | 2,683,487,500円 | 2,679,868,690円 |
| ＤＩＡＭ世界アセットバランス ファンド２ＶＡ（適格機関投資 家限定） | 20,060,439,979円 | 21,456,684,775円 |
| ＤＩＡＭ世界アセットバランス ファンド４０ＶＡ（適格機関投 資家限定） | 1,102,177,379円 | 1,189,951,882円 |
| ＤＩＡＭ世界アセットバランス ファンド２５ＶＡ（適格機関投 資家限定） | 6,912,627,982円 | 7,288,597,632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） | 31,599,818,299円 | 34,010,101,198円 |
| | D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定） | 33,588,488円 | 34,168,975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） | 28,491,726,999円 | 30,501,046,644円 |
| | D I A Mバランス2 0 V A（適 格機関投資家限定） | 197,432,537円 | 189,760,127円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A（1 2 1 2） （適格機関投資家限定） | 3,090,156,932円 | 3,186,640,914円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A（1 3 0 3） （適格機関投資家限定） | 2,759,009,770円 | 2,771,576,680円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A（1 3 0 6） （適格機関投資家限定） | 10,482,487,331円 | 11,093,950,653円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A（1 3 0 9） （適格機関投資家限定） | 466,125,686円 | 469,171,076円 |
| 計 | | 114,155,950,265円 | 122,533,641,088円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 114,155,950,265口 | 122,533,641,088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28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|--------------------------|--|------------------------------|
| 1． 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3． 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 国債証券 | 3,111,062,623 | 5,309,812,827 |
| 合計 | 3,111,062,623 | 5,309,812,827 |

（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28年6月23日から平成28年7月11日まで及び平成28年6月23日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

| 種類 | 平成28年7月11日 現在 | | | | 平成29年1月11日 現在 | | | |
|-------------|-----------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|-------------|
| | 契約額等 （円） | うち 1年 超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | うち 1年 超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 155,118,548,565 | - | 151,727,239,207 | 3,391,309,358 | 160,694,427,864 | - | 159,783,609,330 | 910,818,534 |
| アメリカ・ドル | 67,235,047,173 | - | 66,111,026,696 | 1,124,020,477 | 71,328,448,038 | - | 70,954,077,492 | 374,370,546 |
| イギリス・ポンド | 12,089,475,961 | - | 11,519,430,062 | 570,045,899 | 11,664,890,307 | - | 11,439,766,174 | 225,124,133 |
| オーストラリア・ドル | 3,002,298,145 | - | 2,995,348,873 | 6,949,272 | 3,276,057,504 | - | 3,314,717,764 | 38,660,260 |
| カナダ・ドル | 3,171,652,118 | - | 3,099,710,536 | 71,941,582 | 3,449,017,176 | - | 3,473,207,500 | 24,190,324 |
| シンガポール・ドル | 538,930,659 | - | 529,285,848 | 9,644,811 | 558,889,051 | - | 559,117,440 | 228,389 |
| スウェーデン・クローナ | 770,506,456 | - | 746,336,499 | 24,169,957 | 717,164,027 | - | 713,517,365 | 3,646,662 |
| デンマーク・クローネ | 1,083,011,624 | - | 1,057,159,350 | 25,852,274 | 996,048,724 | - | 992,124,801 | 3,923,923 |
| ノルウェー・クローネ | 376,034,632 | - | 362,050,857 | 13,983,775 | 393,404,901 | - | 392,057,712 | 1,347,189 |
| ポーランド・ズロチ | 907,211,222 | - | 883,434,279 | 23,776,943 | 905,756,432 | - | 908,871,542 | 3,115,110 |

| | | | | | | | | |
|-----------|-----------------|---|-----------------|---------------|-----------------|---|-----------------|-------------|
| マレーシア・リン | 652,201,812 | - | 638,055,500 | 14,146,312 | 655,312,174 | - | 657,336,700 | 2,024,526 |
| ギット | | | | | | | | |
| メキシコ・ペソ | 1,355,969,521 | - | 1,330,000,250 | 25,969,271 | 1,218,235,790 | - | 1,144,460,289 | 73,775,501 |
| ユーロ | 63,231,514,627 | - | 61,759,198,092 | 1,472,316,535 | 64,686,787,347 | - | 64,397,746,540 | 289,040,807 |
| 南アフリカ・ランド | 704,694,615 | - | 696,202,365 | 8,492,250 | 844,416,393 | - | 836,608,011 | 7,808,382 |
| ド | | | | | | | | |
| 合計 | 155,118,548,565 | - | 151,727,239,207 | 3,391,309,358 | 160,694,427,864 | - | 159,783,609,330 | 910,818,534 |

（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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| １口当たり純資産額 | 1.3918円 | 1.3267円 |
| （１万口当たり純資産額） | (13,918円) | (13,267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29年1月11日現在

| 種 類 | 通 貨 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------|-------------------------|----------------|----------------|----|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | US T N/B 0.75 03/31/18 | 11,100,000.000 | 11,071,362.000 | |
| | | US T N/B 0.75 07/15/19 | 11,000,000.000 | 10,836,210.000 | |
| | | US T N/B 0.75 08/31/18 | 10,000,000.000 | 9,941,700.000 | |
| | | US T N/B 0.875 05/31/18 | 10,000,000.000 | 9,981,600.000 | |
| | | US T N/B 0.875 06/15/19 | 5,000,000.000 | 4,945,850.000 | |
| | | US T N/B 1.0 09/15/18 | 10,800,000.000 | 10,778,400.000 | |
| | | US T N/B 1.0 09/30/19 | 5,700,000.000 | 5,639,181.000 | |
| | | US T N/B 1.0 11/15/19 | 10,000,000.000 | 9,882,400.000 | |
| | | US T N/B 1.0 11/30/19 | 9,400,000.000 | 9,285,790.000 | |
| | | US T N/B 1.125 03/31/20 | 8,000,000.000 | 7,898,400.000 | |
| | | US T N/B 1.125 06/30/21 | 10,000,000.000 | 9,700,000.000 | |
| | | US T N/B 1.125 12/31/19 | 6,000,000.000 | 5,940,660.000 | |
| | | US T N/B 1.25 01/31/19 | 4,700,000.000 | 4,702,726.000 | |
| | | US T N/B 1.25 07/31/23 | 5,000,000.000 | 4,726,950.000 | |
| | | US T N/B 1.25 10/31/18 | 21,500,000.000 | 21,538,485.000 | |
| | | US T N/B 1.25 10/31/19 | 9,000,000.000 | 8,958,510.000 | |
| | | US T N/B 1.25 11/30/18 | 7,600,000.000 | 7,611,552.000 | |
| | | US T N/B 1.375 01/31/21 | 12,000,000.000 | 11,825,520.000 | |
| | | US T N/B 1.375 04/30/21 | 10,000,000.000 | 9,824,200.000 | |
| | | US T N/B 1.375 05/31/20 | 5,160,000.000 | 5,126,511.600 | |
| | | US T N/B 1.5 02/28/19 | 8,500,000.000 | 8,543,775.000 | |
| | | US T N/B 1.5 03/31/19 | 5,900,000.000 | 5,930,149.000 | |
| | | US T N/B 1.5 08/15/26 | 1,600,000.000 | 1,479,616.000 | |
| | | US T N/B 1.5 12/31/18 | 7,100,000.000 | 7,141,038.000 | |
| | | US T N/B 1.625 02/15/26 | 7,700,000.000 | 7,233,765.000 | |
| | | US T N/B 1.625 04/30/23 | 9,800,000.000 | 9,514,330.000 | |
| | | US T N/B 1.625 05/15/26 | 7,500,000.000 | 7,031,775.000 | |
| | | US T N/B 1.625 08/15/22 | 4,000,000.000 | 3,917,640.000 | |
| | | US T N/B 1.625 11/15/22 | 6,380,000.000 | 6,234,408.400 | |
| | | US T N/B 1.75 02/28/22 | 7,500,000.000 | 7,432,575.000 | |
| | | US T N/B 1.75 05/15/22 | 7,270,000.000 | 7,192,719.900 | |
| | | US T N/B 1.75 05/15/23 | 6,000,000.000 | 5,865,420.000 | |
| | | US T N/B 1.75 09/30/22 | 7,600,000.000 | 7,481,212.000 | |
| | | US T N/B 2.0 02/15/22 | 3,710,000.000 | 3,724,765.800 | |
| | | US T N/B 2.0 02/15/23 | 6,500,000.000 | 6,467,500.000 | |
| | | US T N/B 2.0 02/15/25 | 6,600,000.000 | 6,451,962.000 | |
| | | US T N/B 2.0 05/31/21 | 860,000.000 | 866,682.200 | |
| | | US T N/B 2.0 07/31/20 | 5,500,000.000 | 5,573,040.000 | |
| | | US T N/B 2.0 08/15/25 | 3,600,000.000 | 3,503,520.000 | |
| | | US T N/B 2.0 08/31/21 | 5,200,000.000 | 5,229,848.000 | |

| | | | |
|-------------------------|----------------|----------------|--|
| US T N/B 2.0 09/30/20 | 7,660,000.000 | 7,752,149.800 | |
| US T N/B 2.0 11/15/21 | 8,900,000.000 | 8,945,123.000 | |
| US T N/B 2.0 11/15/26 | 4,000,000.000 | 3,867,800.000 | |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | 5,900,000.000 | 5,810,556.000 | |
| US T N/B 2.125 08/31/20 | 7,680,000.000 | 7,810,790.400 | |
| US T N/B 2.125 09/30/21 | 4,800,000.000 | 4,852,848.000 | |
| US T N/B 2.125 12/31/21 | 12,000,000.000 | 12,127,440.000 | |
| US T N/B 2.125 12/31/22 | 6,000,000.000 | 6,016,860.000 | |
| US T N/B 2.25 03/31/21 | 12,920,000.000 | 13,169,226.800 | |
| US T N/B 2.25 07/31/18 | 6,100,000.000 | 6,208,885.000 | |
| US T N/B 2.25 08/15/46 | 2,200,000.000 | 1,882,540.000 | |
| US T N/B 2.25 11/15/24 | 6,600,000.000 | 6,587,592.000 | |
| US T N/B 2.25 11/15/25 | 7,700,000.000 | 7,635,628.000 | |
| US T N/B 2.375 06/30/18 | 11,300,000.000 | 11,518,429.000 | |
| US T N/B 2.375 08/15/24 | 5,510,000.000 | 5,559,479.800 | |
| US T N/B 2.375 12/31/20 | 11,950,000.000 | 12,255,203.000 | |
| US T N/B 2.5 02/15/45 | 3,500,000.000 | 3,176,495.000 | |
| US T N/B 2.5 02/15/46 | 3,650,000.000 | 3,302,666.000 | |
| US T N/B 2.5 05/15/24 | 5,990,000.000 | 6,104,648.600 | |
| US T N/B 2.5 05/15/46 | 3,550,000.000 | 3,211,898.000 | |
| US T N/B 2.5 08/15/23 | 6,700,000.000 | 6,843,380.000 | |
| US T N/B 2.625 04/30/18 | 4,300,000.000 | 4,391,848.000 | |
| US T N/B 2.625 08/15/20 | 5,650,000.000 | 5,844,416.500 | |
| US T N/B 2.625 11/15/20 | 11,860,000.000 | 12,274,151.200 | |
| US T N/B 2.75 02/15/19 | 3,700,000.000 | 3,812,850.000 | |
| US T N/B 2.75 02/15/24 | 4,630,000.000 | 4,800,337.700 | |
| US T N/B 2.75 08/15/42 | 2,220,000.000 | 2,138,304.000 | |
| US T N/B 2.75 11/15/23 | 11,100,000.000 | 11,511,033.000 | |
| US T N/B 2.75 11/15/42 | 2,700,000.000 | 2,598,102.000 | |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 2,800,000.000 | 2,755,788.000 | |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 3,970,000.000 | 3,888,416.500 | |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 2,000,000.000 | 1,962,640.000 | |
| US T N/B 3.0 05/15/42 | 1,710,000.000 | 1,726,894.800 | |
| US T N/B 3.0 05/15/45 | 3,150,000.000 | 3,163,765.500 | |
| US T N/B 3.0 11/15/44 | 3,700,000.000 | 3,720,498.000 | |
| US T N/B 3.0 11/15/45 | 4,900,000.000 | 4,917,591.000 | |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 1,260,000.000 | 1,301,731.200 | |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 2,800,000.000 | 2,888,592.000 | |
| US T N/B 3.125 05/15/19 | 4,500,000.000 | 4,687,875.000 | |
| US T N/B 3.125 05/15/21 | 100,000.000 | 105,515.000 | |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 3,810,000.000 | 3,926,967.000 | |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 2,850,000.000 | 2,945,047.500 | |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 3,800,000.000 | 4,101,606.000 | |
| US T N/B 3.5 02/15/39 | 1,000,000.000 | 1,109,920.000 | |
| US T N/B 3.5 05/15/20 | 5,210,000.000 | 5,536,198.100 | |
| US T N/B 3.625 02/15/20 | 8,000,000.000 | 8,513,680.000 | |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 3,270,000.000 | 3,686,140.200 | |
| US T N/B 3.625 08/15/19 | 6,200,000.000 | 6,557,678.000 | |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 2,600,000.000 | 2,930,668.000 | |

| | | | | |
|------------|------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
| | US T N/B 3.75 08/15/41 | 1,340,000.000 | 1,535,653.400 | |
| | US T N/B 3.75 11/15/43 | 5,300,000.000 | 6,106,978.000 | |
| | US T N/B 3.875 05/15/18 | 5,800,000.000 | 6,021,792.000 | |
| | US T N/B 3.875 08/15/40 | 1,650,000.000 | 1,925,715.000 | |
| | US T N/B 4.25 05/15/39 | 1,090,000.000 | 1,342,400.400 | |
| | US T N/B 4.25 11/15/40 | 1,500,000.000 | 1,849,560.000 | |
| | US T N/B 4.375 02/15/38 | 610,000.000 | 768,502.400 | |
| | US T N/B 4.375 05/15/40 | 1,460,000.000 | 1,831,497.000 | |
| | US T N/B 4.375 05/15/41 | 1,600,000.000 | 2,011,616.000 | |
| | US T N/B 4.375 11/15/39 | 1,300,000.000 | 1,627,730.000 | |
| | US T N/B 4.5 02/15/36 | 1,300,000.000 | 1,663,896.000 | |
| | US T N/B 4.5 05/15/38 | 650,000.000 | 831,896.000 | |
| | US T N/B 4.5 08/15/39 | 1,080,000.000 | 1,376,406.000 | |
| | US T N/B 4.625 02/15/40 | 1,920,000.000 | 2,490,892.800 | |
| | US T N/B 4.75 02/15/41 | 1,030,000.000 | 1,364,101.100 | |
| | US T N/B 5.0 05/15/37 | 690,000.000 | 937,316.700 | |
| | US T N/B 5.25 02/15/29 | 830,000.000 | 1,068,948.700 | |
| | US T N/B 5.25 11/15/28 | 700,000.000 | 898,128.000 | |
| | US T N/B 5.375 02/15/31 | 1,400,000.000 | 1,881,292.000 | |
| | US T N/B 5.5 08/15/28 | 630,000.000 | 821,286.900 | |
| | US T N/B 6.0 02/15/26 | 800,000.000 | 1,039,528.000 | |
| | US T N/B 6.125 11/15/27 | 950,000.000 | 1,282,566.500 | |
| | US T N/B 6.25 05/15/30 | 900,000.000 | 1,283,130.000 | |
| | US T N/B 6.25 08/15/23 | 1,200,000.000 | 1,505,616.000 | |
| | US T N/B 6.5 11/15/26 | 500,000.000 | 680,505.000 | |
| | US T N/B 8.0 11/15/21 | 2,100,000.000 | 2,694,720.000 | |
| | US T N/B 8.125 08/15/19 | 3,900,000.000 | 4,572,594.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | 601,410,000.000 (69,739,503,600) | 610,883,909.400 (70,838,098,134) | |
| イギリス・ボンド | UK TREASURY 0.5 07/22/22 | 600,000.000 | 589,560.000 | |
| | UK TREASURY 1.25 07/22/18 | 4,500,000.000 | 4,572,900.000 | |
| | UK TREASURY 1.5 01/22/21 | 2,000,000.000 | 2,076,000.000 | |
| | UK TREASURY 1.5 07/22/26 | 1,800,000.000 | 1,823,400.000 | |
| | UK TREASURY 1.75 07/22/19 | 2,800,000.000 | 2,905,812.000 | |
| | UK TREASURY 1.75 09/07/22 | 2,720,000.000 | 2,864,432.000 | |
| | UK TREASURY 1.75 09/07/37 | 300,000.000 | 288,900.000 | |
| | UK TREASURY 2.0 07/22/20 | 2,150,000.000 | 2,266,723.500 | |
| | UK TREASURY 2.0 09/07/25 | 1,850,000.000 | 1,967,697.000 | |
| | UK TREASURY 2.25 09/07/23 | 1,850,000.000 | 2,007,805.000 | |

| | | | |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| UK TREASURY 2.5 07/22/65 | 1,260,000.000 | 1,538,875.800 | |
| UK TREASURY 2.75 09/07/24 | 1,670,000.000 | 1,874,858.900 | |
| UK TREASURY 3.25 01/22/44 | 2,090,000.000 | 2,635,281.000 | |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45 | 2,060,000.000 | 2,720,848.000 | |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68 | 1,710,000.000 | 2,672,559.000 | |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 1,480,000.000 | 2,188,920.000 | |
| UK TREASURY 3.75 09/07/19 | 1,170,000.000 | 1,278,927.000 | |
| UK TREASURY 3.75 09/07/20 | 1,600,000.000 | 1,793,760.000 | |
| UK TREASURY 3.75 09/07/21 | 1,500,000.000 | 1,716,915.000 | |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60 | 1,360,000.000 | 2,247,808.000 | |
| UK TREASURY 4.0 03/07/22 | 1,200,000.000 | 1,402,080.000 | |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 1,900,000.000 | 2,618,010.000 | |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 1,650,000.000 | 2,208,360.000 | |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39 | 1,340,000.000 | 1,898,378.000 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27 | 1,200,000.000 | 1,538,160.000 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40 | 1,480,000.000 | 2,121,136.000 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46 | 1,530,000.000 | 2,312,595.000 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49 | 1,280,000.000 | 2,004,352.000 | |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 1,600,000.000 | 2,665,440.000 | |
| UK TREASURY 4.5 03/07/19 | 1,200,000.000 | 1,311,960.000 | |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34 | 2,000,000.000 | 2,802,600.000 | |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42 | 1,750,000.000 | 2,648,975.000 | |
| UK TREASURY 4.75 03/07/20 | 1,800,000.000 | 2,050,020.000 | |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30 | 1,460,000.000 | 2,022,976.000 | |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 1,350,000.000 | 2,027,835.000 | |

| | | | | |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|--|
| | UK TREASURY 5.0 03/07/25 | 1,550,000.000 | 2,016,395.000 | |
| | UK TREASURY 6.0 12/07/28 | 900,000.000 | 1,343,790.000 | |
| | UK TREASURY 8.0 06/07/21 | 1,520,000.000 | 2,015,368.000 | |
| イギリス・ボンド 小計 | | 63,180,000.000 (8,925,438,600) | 79,040,412.200 (11,166,039,031) | |
| オーストラリア・ドル | AUSTRALIAN 4.5 04/15/20 | 2,000,000.000 | 2,158,080.000 | |
| | AUSTRALIAN 5.25 03/15/19 | 2,000,000.000 | 2,143,740.000 | |
| | AUSTRALIAN 5.75 05/15/21 | 2,300,000.000 | 2,644,494.000 | |
| | AUSTRALIAN 1.75 11/21/20 | 2,000,000.000 | 1,975,660.000 | |
| | AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 1,100,000.000 | 1,037,080.000 | |
| | AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 2,260,000.000 | 2,294,871.800 | |
| | AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 480,000.000 | 441,086.400 | |
| | AUSTRALIAN 2.75 10/21/19 | 2,500,000.000 | 2,556,100.000 | |
| | AUSTRALIAN 2.75 11/21/27 | 2,250,000.000 | 2,236,725.000 | |
| | AUSTRALIAN 3.0 03/21/47 | 800,000.000 | 697,464.000 | |
| | AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 | 2,480,000.000 | 2,597,130.400 | |
| | AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 1,100,000.000 | 1,137,059.000 | |
| | AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 450,000.000 | 430,366.500 | |
| | AUSTRALIAN 3.25 10/21/18 | 2,900,000.000 | 2,973,109.000 | |
| | AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 900,000.000 | 942,957.000 | |
| | AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 2,700,000.000 | 3,051,594.000 | |
| | AUSTRALIAN 4.5 04/21/33 | 1,070,000.000 | 1,252,670.400 | |
| | AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 2,000,000.000 | 2,362,720.000 | |
| | AUSTRALIAN 5.5 01/21/18 | 800,000.000 | 830,680.000 | |
| | AUSTRALIAN 5.5 04/21/23 | 2,100,000.000 | 2,479,785.000 | |
| | AUSTRALIAN 5.75 07/15/22 | 2,000,000.000 | 2,358,580.000 | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | 36,190,000.000 (3,090,264,100) | 38,601,952.500 (3,296,220,724) | |
| カナダ・ドル | CANADA 8.0 06/01/27 | 350,000.000 | 555,698.500 | |
| | CANADA 0.25 05/01/18 | 1,500,000.000 | 1,491,705.000 | |

| | | | | | |
|--------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|
| | | CANADA 0.5 02/01/19 | 1,300,000.000 | 1,292,941.000 | |
| | | CANADA 0.5 08/01/18 | 2,400,000.000 | 2,391,336.000 | |
| | | CANADA 0.75 03/01/21 | 900,000.000 | 888,957.000 | |
| | | CANADA 0.75 09/01/20 | 1,700,000.000 | 1,685,805.000 | |
| | | CANADA 0.75 09/01/21 | 1,600,000.000 | 1,575,616.000 | |
| | | CANADA 1.0 06/01/27 | 500,000.000 | 462,520.000 | |
| | | CANADA 1.25 03/01/18 | 1,230,000.000 | 1,238,339.400 | |
| | | CANADA 1.25 09/01/18 | 1,950,000.000 | 1,966,068.000 | |
| | | CANADA 1.5 03/01/20 | 650,000.000 | 661,518.000 | |
| | | CANADA 1.5 06/01/23 | 1,300,000.000 | 1,310,192.000 | |
| | | CANADA 1.5 06/01/26 | 1,270,000.000 | 1,249,362.500 | |
| | | CANADA 1.75 03/01/19 | 400,000.000 | 408,244.000 | |
| | | CANADA 1.75 09/01/19 | 2,000,000.000 | 2,048,020.000 | |
| | | CANADA 2.25 06/01/25 | 1,250,000.000 | 1,313,712.500 | |
| | | CANADA 2.5 06/01/24 | 1,250,000.000 | 1,338,162.500 | |
| | | CANADA 2.75 06/01/22 | 1,810,000.000 | 1,953,152.900 | |
| | | CANADA 2.75 12/01/48 | 880,000.000 | 972,488.000 | |
| | | CANADA 2.75 12/01/64 | 460,000.000 | 524,901.400 | |
| | | CANADA 3.25 06/01/21 | 1,400,000.000 | 1,530,550.000 | |
| | | CANADA 3.5 06/01/20 | 1,430,000.000 | 1,551,178.200 | |
| | | CANADA 3.5 12/01/45 | 1,470,000.000 | 1,836,632.700 | |
| | | CANADA 3.75 06/01/19 | 1,350,000.000 | 1,443,784.500 | |
| | | CANADA 4.0 06/01/41 | 1,370,000.000 | 1,798,289.400 | |
| | | CANADA 4.25 06/01/18 | 1,200,000.000 | 1,258,536.000 | |
| | | CANADA 5.0 06/01/37 | 1,180,000.000 | 1,703,318.200 | |
| | | CANADA 5.75 06/01/29 | 960,000.000 | 1,358,208.000 | |
| | | CANADA 5.75 06/01/33 | 1,200,000.000 | 1,790,364.000 | |
| カナダ・ドル 小計 | | | 36,260,000.000 (3,174,925,600) | 39,599,600.700 (3,467,341,037) | |
| シンガポール・ドル | SINGAPORE 0.5 04/01/18 | 650,000.000 | 645,385.000 | | |
| | SINGAPORE 1.625 10/01/19 | 500,000.000 | 501,600.000 | | |
| | SINGAPORE 2.375 06/01/25 | 300,000.000 | 300,300.000 | | |
| | SINGAPORE 2.75 03/01/46 | 150,000.000 | 152,113.500 | | |
| | SINGAPORE 2.75 04/01/42 | 420,000.000 | 425,250.000 | | |
| | SINGAPORE 2.875 07/01/29 | 200,000.000 | 205,400.000 | | |
| | SINGAPORE 2.875 09/01/30 | 370,000.000 | 377,766.300 | | |
| | SINGAPORE 3.0 09/01/24 | 940,000.000 | 983,710.000 | | |
| | SINGAPORE 3.125 09/01/22 | 600,000.000 | 633,900.000 | | |
| | SINGAPORE 3.25 09/01/20 | 980,000.000 | 1,033,998.000 | | |
| | SINGAPORE 3.375 09/01/33 | 270,000.000 | 293,490.000 | | |
| | SINGAPORE 3.5 03/01/27 | 340,000.000 | 371,110.000 | | |
| | SINGAPORE 4.0 09/01/18 | 830,000.000 | 867,408.100 | | |
| シンガポール・ドル 小計 | | | 6,550,000.000 | 6,791,430.900 | |

| | | | | |
|----------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------------------|--|
| | | (528,585,000) | (548,068,474) | |
| スウェーデン・クローナ | SWEDEN 1.0 11/12/26 | 2,500,000.000 | 2,598,100.000 | |
| | SWEDEN 1.5 11/13/23 | 7,400,000.000 | 8,078,876.000 | |
| | SWEDEN 2.5 05/12/25 | 5,500,000.000 | 6,467,230.000 | |
| | SWEDEN 3.5 03/30/39 | 5,210,000.000 | 7,115,609.600 | |
| | SWEDEN 3.5 06/01/22 | 8,080,000.000 | 9,650,994.400 | |
| | SWEDEN 4.25 03/12/19 | 9,580,000.000 | 10,602,473.400 | |
| | SWEDEN 5.0 12/01/20 | 8,140,000.000 | 9,853,470.000 | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | | 46,410,000.000 (592,655,700) | 54,366,753.400 (694,263,441) | |
| デンマーク・クローネ | DENMARK 0.25 11/15/18 | 1,000,000.000 | 1,016,040.000 | |
| | DENMARK 1.5 11/15/23 | 4,570,000.000 | 5,037,054.000 | |
| | DENMARK 1.75 11/15/25 | 7,300,000.000 | 8,184,541.000 | |
| | DENMARK 3.0 11/15/21 | 8,830,000.000 | 10,182,314.500 | |
| | DENMARK 4.0 11/15/19 | 11,310,000.000 | 12,776,793.900 | |
| | DENMARK 4.5 11/15/39 | 11,100,000.000 | 18,885,429.000 | |
| | DENMARK 7.0 11/10/24 | 2,300,000.000 | 3,545,243.000 | |
| デンマーク・クローネ 小計 | | 46,410,000.000 (764,372,700) | 59,627,415.400 (982,063,532) | |
| ノルウェー・クローネ | NORWAY 1.5 02/19/26 | 1,800,000.000 | 1,794,240.000 | |
| | NORWAY 1.75 03/13/25 | 3,100,000.000 | 3,171,331.000 | |
| | NORWAY 2.0 05/24/23 | 5,600,000.000 | 5,855,640.000 | |
| | NORWAY 3.0 03/14/24 | 4,400,000.000 | 4,895,088.000 | |
| | NORWAY 3.75 05/25/21 | 6,560,000.000 | 7,339,000.000 | |
| | NORWAY 4.5 05/22/19 | 5,200,000.000 | 5,667,480.000 | |
| ノルウェー・クローネ 小計 | | 26,660,000.000 (359,643,400) | 28,722,779.000 (387,470,289) | |
| ポーランド・ズロチ | POLAND 1.5 04/25/20 | 1,500,000.000 | 1,454,250.000 | |
| | POLAND 1.75 07/25/21 | 2,000,000.000 | 1,910,400.000 | |
| | POLAND 2.0 04/25/21 | 2,500,000.000 | 2,425,500.000 | |
| | POLAND 2.5 07/25/26 | 2,000,000.000 | 1,831,900.000 | |
| | POLAND 2.5 07/25/27 | 600,000.000 | 543,360.000 | |
| | POLAND 3.25 07/25/19 | 2,000,000.000 | 2,046,800.000 | |
| | POLAND 3.25 07/25/25 | 3,600,000.000 | 3,543,084.000 | |
| | POLAND 3.75 04/25/18 | 4,530,000.000 | 4,645,515.000 | |
| | POLAND 4.0 10/25/23 | 2,570,000.000 | 2,683,722.500 | |
| | POLAND 5.25 10/25/20 | 2,880,000.000 | 3,146,400.000 | |
| | POLAND 5.5 10/25/19 | 2,110,000.000 | 2,291,460.000 | |
| | POLAND 5.75 04/25/29 | 900,000.000 | 1,080,234.000 | |
| | POLAND 5.75 09/23/22 | 2,180,000.000 | 2,478,442.000 | |
| | POLAND 5.75 10/25/21 | 1,780,000.000 | 2,009,086.000 | |
| ポーランド・ズロチ 小計 | | 31,150,000.000 (872,511,500) | 32,090,153.500 (898,845,200) | |
| マレーシア・リングギット | MALAYSIA 3.48 03/15/23 | 2,190,000.000 | 2,107,918.800 | |
| | MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 1,580,000.000 | 1,439,474.800 | |
| | MALAYSIA 3.58 09/28/18 | 2,170,000.000 | 2,178,029.000 | |
| | MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 340,000.000 | 299,397.200 | |
| | MALAYSIA 4.127 04/15/32 | 1,180,000.000 | 1,083,712.000 | |
| | MALAYSIA 4.16 07/15/21 | 3,960,000.000 | 4,022,568.000 | |

| | | | | |
|-----------------|--------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|--|
| | MALAYSIA 4.181 07/15/24 | 690,000.000 | 684,652.500 | |
| | MALAYSIA 4.24 02/07/18 | 2,200,000.000 | 2,221,516.000 | |
| | MALAYSIA 4.378 11/29/19 | 5,760,000.000 | 5,912,755.200 | |
| | MALAYSIA 4.392 04/15/26 | 1,480,000.000 | 1,473,310.400 | |
| | MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 620,000.000 | 603,229.000 | |
| | MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 1,720,000.000 | 1,731,180.000 | |
| | MALAYSIA 5.248 09/15/28 | 1,480,000.000 | 1,560,615.600 | |
| マレーシア・リングgit 小計 | | 25,370,000.000 (657,336,700) | 25,318,358.500 (655,998,669) | |
| メキシコ・ペソ | MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 9,880,000.000 | 11,782,591.600 | |
| | MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 25,720,000.000 | 29,359,894.400 | |
| | MEXICAN BONDS 4.75 06/14/18 | 18,450,000.000 | 17,883,769.500 | |
| | MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19 | 8,000,000.000 | 7,535,600.000 | |
| | MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 10,000,000.000 | 8,722,800.000 | |
| | MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22 | 10,000,000.000 | 9,549,500.000 | |
| | MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21 | 10,860,000.000 | 10,472,406.600 | |
| | MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 12,000,000.000 | 11,746,800.000 | |
| | MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 13,940,000.000 | 13,640,708.200 | |
| | MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 15,880,000.000 | 15,376,762.800 | |
| | MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20 | 20,000,000.000 | 20,391,600.000 | |
| | MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23 | 12,500,000.000 | 12,789,375.000 | |
| | MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 5,000,000.000 | 5,227,150.000 | |
| | MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 11,820,000.000 | 12,356,982.600 | |
| | MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18 | 24,000,000.000 | 24,612,720.000 | |
| メキシコ・ペソ 小計 | | 208,050,000.000 (1,106,826,000) | 211,448,660.700 (1,124,906,875) | |
| ユーロ | AUSTRIA 0.25 10/18/19 | 730,000.000 | 747,213.400 | |
| | AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 880,000.000 | 898,480.000 | |
| | AUSTRIA 07/15/23 | 600,000.000 | 599,040.000 | |
| | AUSTRIA 1.15 10/19/18 | 600,000.000 | 619,500.000 | |
| | AUSTRIA 1.2 10/20/25 | 830,000.000 | 891,295.500 | |
| | AUSTRIA 1.65 10/21/24 | 930,000.000 | 1,035,834.000 | |
| | AUSTRIA 1.75 10/20/23 | 830,000.000 | 930,679.000 | |
| | AUSTRIA 1.95 06/18/19 | 660,000.000 | 701,685.600 | |
| | AUSTRIA 2.4 05/23/34 | 600,000.000 | 732,888.000 | |

| | | | |
|-----------------------------|---------------|---------------|--|
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 650,000.000 | 918,976.500 | |
| AUSTRIA 3.4 11/22/22 | 900,000.000 | 1,086,993.000 | |
| AUSTRIA 3.5 09/15/21 | 1,330,000.000 | 1,568,735.000 | |
| AUSTRIA 3.65 04/20/22 | 800,000.000 | 963,200.000 | |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62 | 415,000.000 | 705,840.300 | |
| AUSTRIA 3.9 07/15/20 | 1,170,000.000 | 1,350,180.000 | |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 1,040,000.000 | 1,605,240.000 | |
| AUSTRIA 4.35 03/15/19 | 1,030,000.000 | 1,141,971.300 | |
| AUSTRIA 4.65 01/15/18 | 930,000.000 | 979,755.000 | |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26 | 700,000.000 | 984,200.000 | |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 650,000.000 | 1,034,351.500 | |
| BELGIUM 0.2 10/22/23 | 300,000.000 | 301,620.000 | |
| BELGIUM 0.8 06/22/25 | 1,500,000.000 | 1,536,435.000 | |
| BELGIUM 1.0 06/22/26 | 1,250,000.000 | 1,286,087.500 | |
| BELGIUM 1.0 06/22/31 | 890,000.000 | 870,295.400 | |
| BELGIUM 1.25 06/22/18 | 1,350,000.000 | 1,387,084.500 | |
| BELGIUM 1.6 06/22/47 | 480,000.000 | 459,859.200 | |
| BELGIUM 1.9 06/22/38 | 540,000.000 | 583,756.200 | |
| BELGIUM 2.15 06/22/66 | 290,000.000 | 292,755.000 | |
| BELGIUM 2.25 06/22/23 | 1,250,000.000 | 1,431,100.000 | |
| BELGIUM 2.6 06/22/24 | 1,500,000.000 | 1,756,035.000 | |
| BELGIUM 3.0 06/22/34 | 560,000.000 | 710,253.600 | |
| BELGIUM 3.0 09/28/19 | 1,220,000.000 | 1,339,425.800 | |
| BELGIUM 3.75 06/22/45 | 880,000.000 | 1,292,306.400 | |
| BELGIUM 3.75 09/28/20 | 1,650,000.000 | 1,911,591.000 | |
| BELGIUM 4.0 03/28/18 | 400,000.000 | 422,592.000 | |
| BELGIUM 4.0 03/28/19 | 1,080,000.000 | 1,191,909.600 | |
| BELGIUM 4.0 03/28/22 | 1,250,000.000 | 1,528,287.500 | |
| BELGIUM 4.0 03/28/32 | 710,000.000 | 991,316.200 | |
| BELGIUM 4.25 03/28/41 | 1,430,000.000 | 2,219,374.300 | |
| BELGIUM 4.25 09/28/21 | 1,650,000.000 | 2,008,347.000 | |
| BELGIUM 4.25 09/28/22 | 1,550,000.000 | 1,937,996.000 | |
| BELGIUM 4.5 03/28/26 | 850,000.000 | 1,152,940.000 | |
| BELGIUM 5.0 03/28/35 | 1,750,000.000 | 2,817,902.500 | |
| BELGIUM 5.5 03/28/28 | 1,700,000.000 | 2,558,738.000 | |
| BUNDESOBL 0.25 04/13/18 | 2,800,000.000 | 2,835,168.000 | |
| BUNDESOBL 0.25 10/11/19 | 1,700,000.000 | 1,746,461.000 | |
| BUNDESOBL 0.25 10/16/20 | 1,700,000.000 | 1,755,199.000 | |
| BUNDESOBL 0.5 02/23/18 | 2,500,000.000 | 2,534,675.000 | |
| BUNDESOBL 0.5 04/12/19 | 2,100,000.000 | 2,159,724.000 | |
| BUNDESOBL 04/09/21 | 1,500,000.000 | 1,534,500.000 | |
| BUNDESOBL 04/17/20 | 1,800,000.000 | 1,839,114.000 | |
| BUNDESOBL 1.0 02/22/19 | 1,200,000.000 | 1,244,988.000 | |
| BUNDESOBL 1.0 10/12/18 | 1,050,000.000 | 1,082,172.000 | |
| BUNDESOBL 10/08/21 | 1,100,000.000 | 1,125,740.000 | |
| BUNDESSCHAT 09/14/18 | 1,000,000.000 | 1,012,510.000 | |
| BUNDESSCHAT 12/14/18 | 2,000,000.000 | 2,028,700.000 | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 | 2,000,000.000 | 2,074,920.000 | |

| | | | |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26 | 2,050,000.000 | 2,106,887.500 | |
| DEUTSCHLAND 08/15/26 | 2,820,000.000 | 2,744,762.400 | |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24 | 1,750,000.000 | 1,887,952.500 | |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25 | 2,150,000.000 | 2,314,690.000 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23 | 1,300,000.000 | 1,442,155.000 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23 | 1,970,000.000 | 2,189,753.500 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24 | 2,100,000.000 | 2,344,503.000 | |
| DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22 | 2,100,000.000 | 2,321,424.000 | |
| DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24 | 750,000.000 | 850,005.000 | |
| DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22 | 2,450,000.000 | 2,738,291.500 | |
| DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22 | 1,000,000.000 | 1,123,360.000 | |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | 1,800,000.000 | 2,064,096.000 | |
| DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20 | 1,900,000.000 | 2,102,996.000 | |
| DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21 | 1,600,000.000 | 1,808,240.000 | |
| DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21 | 2,300,000.000 | 2,587,615.000 | |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 | 1,730,000.000 | 2,336,987.800 | |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 | 1,770,000.000 | 2,416,935.000 | |
| DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20 | 1,400,000.000 | 1,580,320.000 | |
| DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20 | 2,300,000.000 | 2,574,505.000 | |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21 | 1,700,000.000 | 1,993,165.000 | |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 1,420,000.000 | 2,139,414.600 | |
| DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19 | 1,410,000.000 | 1,559,883.000 | |
| DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19 | 2,400,000.000 | 2,616,192.000 | |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/18 | 490,000.000 | 512,956.500 | |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | 2,060,000.000 | 3,272,886.800 | |

| | | | |
|-------------------------------|---------------|---------------|--|
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/18 | 2,300,000.000 | 2,470,430.000 | |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 1,210,000.000 | 2,037,519.000 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 1,050,000.000 | 1,561,434.000 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 1,700,000.000 | 2,832,149.000 | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 1,450,000.000 | 2,624,543.500 | |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 | 1,690,000.000 | 2,819,477.700 | |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 1,300,000.000 | 2,036,034.000 | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24 | 1,180,000.000 | 1,707,932.000 | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | 800,000.000 | 1,382,696.000 | |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27 | 970,000.000 | 1,588,840.600 | |
| FINLAND 0.375 09/15/20 | 480,000.000 | 494,928.000 | |
| FINLAND 0.5 04/15/26 | 530,000.000 | 532,045.800 | |
| FINLAND 0.75 04/15/31 | 380,000.000 | 374,911.800 | |
| FINLAND 0.875 09/15/25 | 520,000.000 | 543,171.200 | |
| FINLAND 09/15/23 | 290,000.000 | 289,379.400 | |
| FINLAND 1.125 09/15/18 | 330,000.000 | 339,949.500 | |
| FINLAND 1.5 04/15/23 | 350,000.000 | 384,160.000 | |
| FINLAND 1.625 09/15/22 | 350,000.000 | 386,323.000 | |
| FINLAND 2.0 04/15/24 | 400,000.000 | 454,644.000 | |
| FINLAND 2.625 07/04/42 | 380,000.000 | 502,219.400 | |
| FINLAND 2.75 07/04/28 | 360,000.000 | 446,241.600 | |
| FINLAND 3.375 04/15/20 | 580,000.000 | 654,408.200 | |
| FINLAND 3.5 04/15/21 | 560,000.000 | 653,486.400 | |
| FINLAND 4.0 07/04/25 | 470,000.000 | 618,068.800 | |
| FINLAND 4.375 07/04/19 | 460,000.000 | 517,486.200 | |
| FRANCE BTAN 8.5 04/25/23 | 1,480,000.000 | 2,262,860.800 | |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/20 | 2,900,000.000 | 2,968,092.000 | |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26 | 2,150,000.000 | 2,036,824.000 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25 | 2,950,000.000 | 2,944,424.500 | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26 | 2,550,000.000 | 2,497,623.000 | |
| FRANCE OAT 0.5 11/25/19 | 2,200,000.000 | 2,265,780.000 | |
| FRANCE OAT 02/25/19 | 3,150,000.000 | 3,190,635.000 | |
| FRANCE OAT 05/25/20 | 2,400,000.000 | 2,436,168.000 | |
| FRANCE OAT 05/25/21 | 3,200,000.000 | 3,232,320.000 | |
| FRANCE OAT 05/25/22 | 800,000.000 | 800,848.000 | |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/18 | 5,720,000.000 | 5,850,301.600 | |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/19 | 2,170,000.000 | 2,253,935.600 | |

| | | | |
|-----------------------------|---------------|---------------|--|
| FRANCE OAT 1.0 11/25/18 | 4,000,000.000 | 4,123,000.000 | |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25 | 2,400,000.000 | 2,478,168.000 | |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 1,450,000.000 | 1,388,810.000 | |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31 | 2,460,000.000 | 2,556,382.800 | |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/23 | 2,850,000.000 | 3,144,462.000 | |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 470,000.000 | 430,129.900 | |
| FRANCE OAT 1.75 11/25/24 | 2,900,000.000 | 3,203,572.000 | |
| FRANCE OAT 2.25 05/25/24 | 3,000,000.000 | 3,427,470.000 | |
| FRANCE OAT 2.25 10/25/22 | 2,800,000.000 | 3,162,096.000 | |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 3,150,000.000 | 3,696,084.000 | |
| FRANCE OAT 2.5 10/25/20 | 2,900,000.000 | 3,219,928.000 | |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 3,100,000.000 | 3,692,193.000 | |
| FRANCE OAT 3.0 04/25/22 | 3,600,000.000 | 4,189,464.000 | |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 2,030,000.000 | 2,700,894.700 | |
| FRANCE OAT 3.25 10/25/21 | 2,900,000.000 | 3,379,225.000 | |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/20 | 3,000,000.000 | 3,393,030.000 | |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26 | 2,870,000.000 | 3,598,119.000 | |
| FRANCE OAT 3.75 04/25/21 | 3,050,000.000 | 3,582,316.500 | |
| FRANCE OAT 3.75 10/25/19 | 2,460,000.000 | 2,758,004.400 | |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55 | 1,130,000.000 | 1,782,123.000 | |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60 | 1,250,000.000 | 2,020,262.500 | |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38 | 2,350,000.000 | 3,425,736.000 | |
| FRANCE OAT 4.25 04/25/19 | 1,990,000.000 | 2,213,098.900 | |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/18 | 1,100,000.000 | 1,196,877.000 | |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/23 | 3,560,000.000 | 4,545,657.200 | |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41 | 2,710,000.000 | 4,260,743.300 | |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 2,400,000.000 | 3,713,760.000 | |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 2,500,000.000 | 3,811,425.000 | |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 2,700,000.000 | 4,456,080.000 | |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25 | 2,300,000.000 | 3,386,060.000 | |
| FRANCE OAT 8.5 10/25/19 | 1,480,000.000 | 1,862,432.000 | |
| IRISH 0.8 03/15/22 | 570,000.000 | 593,854.500 | |
| IRISH 1.0 05/15/26 | 660,000.000 | 664,989.600 | |
| IRISH 2.0 02/18/45 | 490,000.000 | 491,470.000 | |

| | | | |
|-----------------------------|---------------|---------------|--|
| IRISH 2.4 05/15/30 | 760,000.000 | 855,509.200 | |
| IRISH 3.4 03/18/24 | 670,000.000 | 805,634.800 | |
| IRISH 3.9 03/20/23 | 450,000.000 | 551,497.500 | |
| IRISH 4.4 06/18/19 | 790,000.000 | 884,405.000 | |
| IRISH 4.5 04/18/20 | 940,000.000 | 1,091,358.800 | |
| IRISH 4.5 10/18/18 | 490,000.000 | 533,536.500 | |
| IRISH 5.0 10/18/20 | 780,000.000 | 939,556.800 | |
| IRISH 5.4 03/13/25 | 950,000.000 | 1,302,051.000 | |
| IRISH 5.9 10/18/19 | 510,000.000 | 600,423.000 | |
| ITALY BTPS 0.1 04/15/19 | 3,300,000.000 | 3,305,940.000 | |
| ITALY BTPS 0.25 05/15/18 | 5,700,000.000 | 5,730,096.000 | |
| ITALY BTPS 0.3 10/15/18 | 3,150,000.000 | 3,171,892.500 | |
| ITALY BTPS 0.45 06/01/21 | 2,550,000.000 | 2,543,880.000 | |
| ITALY BTPS 0.7 05/01/20 | 2,500,000.000 | 2,539,750.000 | |
| ITALY BTPS 0.95 03/15/23 | 2,200,000.000 | 2,184,820.000 | |
| ITALY BTPS 1.05 12/01/19 | 1,800,000.000 | 1,846,746.000 | |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 1,600,000.000 | 1,506,640.000 | |
| ITALY BTPS 1.35 04/15/22 | 3,150,000.000 | 3,235,995.000 | |
| ITALY BTPS 1.45 09/15/22 | 1,350,000.000 | 1,390,149.000 | |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25 | 2,000,000.000 | 1,976,520.000 | |
| ITALY BTPS 1.5 08/01/19 | 2,500,000.000 | 2,589,650.000 | |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26 | 1,700,000.000 | 1,667,360.000 | |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 1,940,000.000 | 1,789,223.200 | |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25 | 1,600,000.000 | 1,629,392.000 | |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 1,000,000.000 | 950,600.000 | |
| ITALY BTPS 2.5 05/01/19 | 1,000,000.000 | 1,056,540.000 | |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/24 | 1,400,000.000 | 1,500,016.000 | |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47 | 900,000.000 | 839,970.000 | |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67 | 700,000.000 | 606,270.000 | |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 1,200,000.000 | 1,253,388.000 | |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 2,180,000.000 | 2,494,879.200 | |
| ITALY BTPS 3.75 03/01/21 | 2,450,000.000 | 2,784,131.000 | |
| ITALY BTPS 3.75 05/01/21 | 2,500,000.000 | 2,842,750.000 | |
| ITALY BTPS 3.75 08/01/21 | 2,000,000.000 | 2,287,600.000 | |
| ITALY BTPS 3.75 09/01/24 | 1,900,000.000 | 2,208,883.000 | |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37 | 2,300,000.000 | 2,775,640.000 | |

| | | | |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| ITALY BTPS 4.0 09/01/20 | 2,660,000.000 | 3,016,440.000 | |
| ITALY BTPS 4.25 02/01/19 | 2,520,000.000 | 2,741,760.000 | |
| ITALY BTPS 4.25 03/01/20 | 2,100,000.000 | 2,363,970.000 | |
| ITALY BTPS 4.5 02/01/18 | 1,382,000.000 | 1,450,422.820 | |
| ITALY BTPS 4.5 02/01/20 | 1,820,000.000 | 2,057,692.000 | |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/19 | 2,700,000.000 | 2,957,850.000 | |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/24 | 2,000,000.000 | 2,427,100.000 | |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26 | 1,550,000.000 | 1,895,960.000 | |
| ITALY BTPS 4.5 05/01/23 | 1,500,000.000 | 1,808,565.000 | |
| ITALY BTPS 4.75 08/01/23 | 2,100,000.000 | 2,580,060.000 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/21 | 2,200,000.000 | 2,617,120.000 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 2,200,000.000 | 2,797,850.000 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 1,400,000.000 | 1,851,724.000 | |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/22 | 1,600,000.000 | 1,939,200.000 | |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/25 | 2,500,000.000 | 3,149,250.000 | |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34 | 2,120,000.000 | 2,861,788.000 | |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39 | 1,690,000.000 | 2,301,273.000 | |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40 | 2,080,000.000 | 2,820,688.000 | |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 2,480,000.000 | 3,323,696.000 | |
| ITALY BTPS 5.5 09/01/22 | 2,360,000.000 | 2,957,103.600 | |
| ITALY BTPS 5.5 11/01/22 | 1,700,000.000 | 2,133,568.000 | |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 1,500,000.000 | 2,156,100.000 | |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31 | 2,650,000.000 | 3,841,440.000 | |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27 | 2,750,000.000 | 3,947,625.000 | |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 900,000.000 | 1,333,800.000 | |
| ITALY BTPS 9.0 11/01/23 | 1,270,000.000 | 1,913,128.000 | |
| NETHERLANDS 0.25 01/15/20 | 1,250,000.000 | 1,284,325.000 | |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | 1,200,000.000 | 1,197,096.000 | |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26 | 1,400,000.000 | 1,408,540.000 | |
| NETHERLANDS 01/15/22 | 550,000.000 | 559,625.000 | |
| NETHERLANDS 04/15/18 | 1,500,000.000 | 1,513,200.000 | |
| NETHERLANDS 1.25 01/15/18 | 590,000.000 | 601,634.800 | |
| NETHERLANDS 1.25 01/15/19 | 1,500,000.000 | 1,558,965.000 | |
| NETHERLANDS 1.75 07/15/23 | 1,640,000.000 | 1,836,111.200 | |

| | | | |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| NETHERLANDS 2.0 07/15/24 | 1,380,000.000 | 1,575,725.400 | |
| NETHERLANDS 2.25 07/15/22 | 1,660,000.000 | 1,890,291.800 | |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33 | 1,110,000.000 | 1,398,855.300 | |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 990,000.000 | 1,391,623.200 | |
| NETHERLANDS 3.25 07/15/21 | 1,450,000.000 | 1,695,630.000 | |
| NETHERLANDS 3.5 07/15/20 | 1,650,000.000 | 1,890,322.500 | |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/23 | 1,040,000.000 | 1,288,560.000 | |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 1,310,000.000 | 2,094,886.500 | |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37 | 1,380,000.000 | 2,168,256.000 | |
| NETHERLANDS 4.0 07/15/18 | 1,290,000.000 | 1,381,461.000 | |
| NETHERLANDS 4.0 07/15/19 | 1,170,000.000 | 1,308,528.000 | |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28 | 1,220,000.000 | 1,871,480.000 | |
| SPAIN 0.25 01/31/19 | 1,900,000.000 | 1,916,910.000 | |
| SPAIN 0.25 04/30/18 | 2,700,000.000 | 2,718,738.000 | |
| SPAIN 0.75 07/30/21 | 2,300,000.000 | 2,352,302.000 | |
| SPAIN 1.15 07/30/20 | 1,900,000.000 | 1,973,435.000 | |
| SPAIN 1.3 10/31/26 | 1,840,000.000 | 1,812,694.400 | |
| SPAIN 1.4 01/31/20 | 1,400,000.000 | 1,459,290.000 | |
| SPAIN 1.6 04/30/25 | 1,900,000.000 | 1,957,380.000 | |
| SPAIN 1.95 04/30/26 | 1,800,000.000 | 1,884,024.000 | |
| SPAIN 1.95 07/30/30 | 1,840,000.000 | 1,848,648.000 | |
| SPAIN 2.15 10/31/25 | 2,160,000.000 | 2,305,000.800 | |
| SPAIN 2.75 04/30/19 | 2,000,000.000 | 2,133,700.000 | |
| SPAIN 2.75 10/31/24 | 2,100,000.000 | 2,356,767.000 | |
| SPAIN 2.9 10/31/46 | 700,000.000 | 720,979.000 | |
| SPAIN 3.45 07/30/66 | 450,000.000 | 481,099.500 | |
| SPAIN 3.75 10/31/18 | 1,700,000.000 | 1,823,709.000 | |
| SPAIN 3.8 04/30/24 | 1,950,000.000 | 2,332,863.000 | |
| SPAIN 4.0 04/30/20 | 2,070,000.000 | 2,338,934.400 | |
| SPAIN 4.1 07/30/18 | 900,000.000 | 960,777.000 | |
| SPAIN 4.2 01/31/37 | 1,600,000.000 | 2,074,240.000 | |
| SPAIN 4.3 10/31/19 | 1,720,000.000 | 1,929,083.200 | |
| SPAIN 4.4 10/31/23 | 1,870,000.000 | 2,311,862.300 | |
| SPAIN 4.5 01/31/18 | 600,000.000 | 630,198.000 | |
| SPAIN 4.6 07/30/19 | 1,810,000.000 | 2,026,005.400 | |
| SPAIN 4.65 07/30/25 | 1,650,000.000 | 2,099,212.500 | |
| SPAIN 4.7 07/30/41 | 1,360,000.000 | 1,893,446.400 | |

| | | | | |
|---------|---------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|----------------|
| | SPAIN 4.8 01/31/24 | 1,480,000.000 | 1,874,420.000 | |
| | SPAIN 4.85 10/31/20 | 2,100,000.000 | 2,477,307.000 | |
| | SPAIN 4.9 07/30/40 | 1,350,000.000 | 1,922,400.000 | |
| | SPAIN 5.15 10/31/28 | 1,200,000.000 | 1,637,520.000 | |
| | SPAIN 5.15 10/31/44 | 1,030,000.000 | 1,522,535.700 | |
| | SPAIN 5.4 01/31/23 | 1,850,000.000 | 2,373,901.500 | |
| | SPAIN 5.5 04/30/21 | 2,000,000.000 | 2,454,640.000 | |
| | SPAIN 5.75 07/30/32 | 1,700,000.000 | 2,546,362.000 | |
| | SPAIN 5.85 01/31/22 | 2,350,000.000 | 2,992,913.000 | |
| | SPAIN 5.9 07/30/26 | 1,340,000.000 | 1,871,109.000 | |
| | SPAIN 6.0 01/31/29 | 2,090,000.000 | 3,059,739.100 | |
| | ユーロ 小計 | 440,447,000.000 (53,923,926,210) | 516,135,253.620 (63,190,439,101) | |
| | 南アフリカ・ランド | SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26 | 24,940,000.000 | 27,734,028.200 |
| | | SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36 | 12,410,000.000 | 8,944,631.600 |
| | | SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41 | 7,780,000.000 | 5,597,710.000 |
| | | SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21 | 16,150,000.000 | 15,373,023.500 |
| | | SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31 | 8,690,000.000 | 7,167,512.000 |
| | | SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30 | 6,020,000.000 | 5,473,203.400 |
| | | SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32 | 6,000,000.000 | 5,468,040.000 |
| | | SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37 | 5,100,000.000 | 4,646,049.000 |
| | | SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44 | 6,000,000.000 | 5,550,660.000 |
| | | SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48 | 11,460,000.000 | 10,574,600.400 |
| | 南アフリカ・ランド 小計 | 104,550,000.000 (882,402,000) | 96,529,458.100 (814,708,626) | |
| 国債証券 合計 | | 144,618,391,110 (144,618,391,110) | 158,064,463,129 (158,064,463,129) | |
| 合計 | | 144,618,391,110 (144,618,391,110) | 158,064,463,129 (158,064,463,129) | |

（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 | 43.57% | 44.82% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 38銘柄 | 6.87% | 7.06% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 21銘柄 | 2.03% | 2.09% |
| カナダ・ドル | 国債証券 29銘柄 | 2.13% | 2.19% |
| シンガポール・ドル | 国債証券 13銘柄 | 0.34% | 0.35% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 7銘柄 | 0.43% | 0.44% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 7銘柄 | 0.60% | 0.62% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 6銘柄 | 0.24% | 0.25% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 14銘柄 | 0.55% | 0.57% |
| マレーシア・リンギット | 国債証券 13銘柄 | 0.40% | 0.42% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 15銘柄 | 0.69% | 0.71% |
| ユーロ | 国債証券 271銘柄 | 38.87% | 39.98% |
| 南アフリカ・ランド | 国債証券 10銘柄 | 0.50% | 0.52% |

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 551,295,658 | 1,415,085,713 |
| コール・ローン | | 771,456,421 | 36,818,327 |
| 株式 | | 33,016,616,407 | 38,892,263,440 |
| 投資信託受益証券 | | 228,200,023 | 237,553,412 |
| 投資証券 | | 108,141,051 | 93,373,243 |
| 派生商品評価勘定 | | 56,533,988 | 19,708,307 |
| 未収入金 | | 762,225 | 269,818 |
| 未収配当金 | | 203,278,452 | 35,348,958 |
| 差入委託証拠金 | | 358,743,475 | 593,122,646 |
| 流動資産合計 | | 35,295,027,700 | 41,323,543,864 |
| 資産合計 | | 35,295,027,700 | 41,323,543,864 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 1,676,969 | - |
| 未払金 | | 722,729,675 | 7,137 |
| 未払解約金 | | 17,307,000 | 17,413,000 |
| 流動負債合計 | | 741,713,644 | 17,420,137 |
| 負債合計 | | 741,713,644 | 17,420,137 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 43,354,457,363 | 42,090,393,658 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 2 | 8,801,143,307 | 784,269,931 |
| 元本等合計 | | 34,553,314,056 | 41,306,123,727 |
| 純資産合計 | | 34,553,314,056 | 41,306,123,727 |
| 負債純資産合計 | | 35,295,027,700 | 41,323,543,864 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-----|---|-----------------|-----------------|
| 1 . | 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額 | 39,843,963,916円 | 43,354,457,363円 |
| | 同期中追加設定元本額 | 13,462,610,283円 | 7,916,578,101円 |
| | 同期中一部解約元本額 | 9,952,116,836円 | 9,180,641,806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> | 1,287,494,886円 | 1,586,101,353円 |
| | D I A M新興国株式インデック スファンド< 為替ヘッジなし> (ファンドラップ) | 109,971,037円 | 123,401,986円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 9,493,872円 | 5,258,828円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 25,710,953円 | 17,811,790円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 39,215,095円 | 27,031,131円 |
| | グローバル8 資産ラップファン ド (安定型) | 19,789,538円 | 15,666,314円 |
| | グローバル8 資産ラップファン ド (中立型) | 22,745,716円 | 17,178,142円 |
| | グローバル8 資産ラップファン ド (積極型) | 15,870,387円 | 13,966,414円 |
| | たわらノーロード 新興国株式 | 426,894,579円 | 860,025,858円 |
| | たわらノーロード 新興国株式 < ラップ向け> | 10,783,741円 | 302,701,465円 |
| | マネックス資産設計ファンド エボリューション | 534,755,049円 | 514,845,440円 |
| | D I A M D C 8 資産バラン スファンド (新興国10) | 35,045,169円 | 40,980,588円 |
| | D I A M D C 8 資産バラン スファンド (新興国20) | 98,599,627円 | 105,968,606円 |
| | D I A M D C 8 資産バラン スファンド (新興国30) | 212,453,833円 | 239,780,908円 |
| | 投資のソムリエ | 1,812,394,970円 | 2,342,354,016円 |
| | クルーズコントロール | 379,160,098円 | 2,326,917,948円 |
| | 投資のソムリエ< D C 年金> | 41,920,471円 | 69,207,042円 |
| | D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C 年金> | 124,852,987円 | 129,816,015円 |
| | クルーズコントロール< D C 年 金> | 102,607円 | 916,238円 |
| | D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) | 5,763,126円 | 34,356,782円 |
| | D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 10,101,934円 | 76,409,693円 |
| | 投資のソムリエ< D C 年金> リ スク抑制型 | 6,129,158円 | 11,904,041円 |
| | ダイナミック・ナビゲーション | 495,412円 | 624,782円 |

| | | | |
|-----|--|---|---|
| | リスク抑制世界8資産バランス ファンド | - 円 | 260,124円 |
| | エマージング株式パッシブファ ンドVA（適格機関投資家専 用） | 7,655,896,389円 | 6,552,597,287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） | 190,433,666円 | 189,946,132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） | 2,193,601,345円 | 2,135,654,775円 |
| | DIAM世界アセットバランス ファンド2VA（適格機関投資 家限定） | 17,217,537,348円 | 14,887,853,093円 |
| | DIAM世界アセットバランス ファンド3VA（適格機関投資 家限定） | 10,867,244,370円 | 9,460,856,867円 |
| | 計 | 43,354,457,363円 | 42,090,393,658円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 43,354,457,363口 | 42,090,393,658口 |
| 3 . | 2 元本の欠損 | 貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額 は8,801,143,307円でありま す。 | 貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額 は784,269,931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28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|-------------------------|---|------------------------------|
| 1．金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3．金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 株式 | 509,266,622 | 2,210,152,396 |
| 投資信託受益証券 | 1,113,663 | 28,280,754 |
| 投資証券 | 2,164,879 | 14,817,383 |
| 合計 | 512,545,164 | 2,223,615,767 |

（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28年4月19日から平成28年7月11日まで及び平成28年4月19日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

| 種類 | 平成28年7月11日 現在 | | | | 平成29年1月11日 現在 | | | |
|-----------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
| | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| | | | | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | 116,409,498 | - | 116,397,951 | 11,547 | 510,195,400 | - | 510,180,000 | 15,400 |
| アメリカ・ドル | 116,409,498 | - | 116,397,951 | 11,547 | 510,195,400 | - | 510,180,000 | 15,400 |
| 買 建 | 1,556,984,988 | - | 1,556,504,420 | 480,568 | - | - | - | - |
| アメリカ・ドル | 928,462,800 | - | 927,360,000 | 1,102,800 | - | - | - | - |
| インド・ルピー | 81,900,500 | - | 83,050,000 | 1,149,500 | - | - | - | - |
| タイ・バーツ | 23,548,743 | - | 23,480,600 | 68,143 | - | - | - | - |
| チェコ・コルナ | 1,346,847 | - | 1,343,970 | 2,877 | - | - | - | - |
| トルコ・リラ | 9,325,864 | - | 9,326,400 | 536 | - | - | - | - |
| ハンガリー・フォ リント | 926,640 | - | 920,140 | 6,500 | - | - | - | - |
| フィリピン・ペソ | 8,025,375 | - | 8,025,000 | 375 | - | - | - | - |
| ポーランド・ズロ チ | 9,165,604 | - | 9,147,600 | 18,004 | - | - | - | - |
| マレーシア・リン ギット | 28,225,705 | - | 28,218,300 | 7,405 | - | - | - | - |
| メキシコ・ペソ | 38,895,150 | - | 38,841,600 | 53,550 | - | - | - | - |
| 韓国・ウォン | 135,493,985 | - | 135,540,350 | 46,365 | - | - | - | - |
| 香港・ドル | 157,234,660 | - | 157,179,000 | 55,660 | - | - | - | - |
| 台湾・ドル | 116,409,498 | - | 116,064,000 | 345,498 | - | - | - | - |
| 南アフリカ・ラン ド | 18,023,617 | - | 18,007,460 | 16,157 | - | - | - | - |
| 合計 | 1,673,394,486 | - | 1,672,902,371 | 469,021 | 510,195,400 | - | 510,180,000 | 15,400 |

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

- 2．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 - 3．換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

| 種類 | 平成28年7月11日 現在 | | | | 平成29年1月11日 現在 | | | |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 先物取引 | | | | | | | | |
| 買 建 | 1,824,551,117 | - | 1,879,877,157 | 55,326,040 | 1,523,154,893 | - | 1,542,847,800 | 19,692,907 |
| 合計 | 1,824,551,117 | - | 1,879,877,157 | 55,326,040 | 1,523,154,893 | - | 1,542,847,800 | 19,692,907 |

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 0.7970円 | 0.9814円 |
| （1万口当たり純資産額） | (7,970円) | (9,814円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年1月11日現在

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------|--------------------------------------|---------|---------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | CTIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR | 31,200 | 43.710 | 1,363,752.000 | |
| | CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR | 19,673 | 13.100 | 257,716.300 | |
| | SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF | 65,400 | 5.455 | 356,757.000 | |
| | CREDICORP LTD | 5,549 | 165.000 | 915,585.000 | |
| | SINA CORP | 4,700 | 67.340 | 316,498.000 | |
| | MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR | 47,625 | 9.400 | 447,675.000 | |
| | NETEASE INC-ADR | 6,600 | 239.980 | 1,583,868.000 | |
| | SOUTHERN COPPER CORP | 6,780 | 34.180 | 231,740.400 | |
| | LUKOIL SPON ADR | 36,954 | 56.340 | 2,081,988.360 | |
| | GLOBAL TELECOM HOLDING GDR | 48,121 | 2.000 | 96,242.000 | |
| | GAZPROM PAO ADR | 509,755 | 5.228 | 2,664,999.140 | |
| | COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR | 93,041 | 4.000 | 372,164.000 | |
| | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE | 79,280 | 1.463 | 115,986.640 | |
| | SURGUTNEFTEGAZ ADR | 72,307 | 5.205 | 376,357.930 | |
| | SISTEMA PJSC GDR | 15,837 | 9.330 | 147,759.210 | |
| | NOVATEK OAO GDR | 8,095 | 128.000 | 1,036,160.000 | |
| | BAIDU INC -SPON ADR | 22,700 | 180.310 | 4,093,037.000 | |
| | MMC NORILSK NICKEL ADR | 50,414 | 17.600 | 887,286.400 | |
| | ROSTELECOM SPON ADR | 21,069 | 8.750 | 184,353.750 | |
| | ROSNEFT OIL CO GDR | 110,275 | 6.665 | 734,982.870 | |
| | NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH | 11,200 | 48.510 | 543,312.000 | |
| | SEVERSTAL GDR | 21,882 | 15.880 | 347,486.160 | |
| | TATNEFT ADR | 20,934 | 42.460 | 888,857.640 | |
| | VTB BANK OJSC GDR | 248,276 | 2.327 | 577,738.250 | |
| | DP WORLD LTD | 13,696 | 18.750 | 256,800.000 | |
| | MAGNIT PJSC GDR | 26,690 | 40.500 | 1,080,945.000 | |
| | VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR | 33,800 | 11.560 | 390,728.000 | |
| | RUSHYDRO PJSC ADR | 139,237 | 1.560 | 217,209.720 | |
| | TAL EDUCATION GROUP-ADR | 3,600 | 76.350 | 274,860.000 | |
| | SBERBANK ADR | 232,555 | 11.630 | 2,704,614.650 | |
| | PHOSAGRO PJSC GDR | 12,813 | 15.600 | 199,882.800 | |
| | YY INC-ADR | 2,400 | 42.240 | 101,376.000 | |
| | 58.COM INC ADR | 6,800 | 30.480 | 207,264.000 | |
| | QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR | 3,200 | 30.320 | 97,024.000 | |

| | | | | | |
|-------------------|---|-----------|------------|-----------------------------------|--|
| | WEIBO CORP ADR | 2,700 | 45.700 | 123,390.000 | |
| | JD.COM INC ADR | 55,800 | 26.900 | 1,501,020.000 | |
| | ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 93,900 | 96.750 | 9,084,825.000 | |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 34,000 | 26.180 | 890,120.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | 2,218,858 | | 37,752,362.220 (4,377,763,923) | |
| アラブ首長国連邦・ディルハム | FIRST GULF BANK PJSC | 75,484 | 13.300 | 1,003,937.200 | |
| | DUBAI ISLAMIC BANK PJSC | 101,220 | 5.930 | 600,234.600 | |
| | EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC | 144,932 | 18.900 | 2,739,214.800 | |
| | ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC | 164,030 | 7.470 | 1,225,304.100 | |
| | NATIONAL BANK OF ABU DHABI PJSC | 55,579 | 10.500 | 583,579.500 | |
| | EMAAR PROPERTIES PJSC | 293,731 | 7.680 | 2,255,854.080 | |
| | ALDAR PROPERTIES PJSC | 267,344 | 2.680 | 716,481.920 | |
| | EMAAR MALLS PJSC | 178,166 | 2.650 | 472,139.900 | |
| | DXB ENTERTAINMENTS PJSC | 272,783 | 1.300 | 354,617.900 | |
| アラブ首長国連邦・ディルハム 小計 | | 1,553,269 | | 9,951,364.000 (314,761,643) | |
| インド・ルピー | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 108,265 | 1,089.850 | 117,992,610.250 | |
| | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 42,429 | 660.300 | 28,015,868.700 | |
| | ASIAN PAINTS LTD | 24,080 | 923.600 | 22,240,288.000 | |
| | EICHER MOTORS LTD | 1,119 | 23,005.000 | 25,742,595.000 | |
| | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 31,126 | 1,213.500 | 37,771,401.000 | |
| | SHREE CEMENT LTD | 709 | 14,435.450 | 10,234,734.050 | |
| | ICICI BANK LTD | 91,887 | 260.200 | 23,908,997.400 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD | 34,445 | 479.250 | 16,507,766.250 | |
| | STATE BANK OF INDIA LTD | 129,282 | 248.300 | 32,100,720.600 | |
| | CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 2,923 | 1,192.150 | 3,484,654.450 | |
| | LIC HOUSING FINANCE LTD | 25,256 | 521.550 | 13,172,266.800 | |
| | TATA STEEL LTD | 25,639 | 431.900 | 11,073,484.100 | |
| | TATA MOTORS LTD | 132,116 | 516.250 | 68,204,885.000 | |
| | JSW STEEL LTD | 70,280 | 178.450 | 12,541,466.000 | |
| | TATA POWER CO LTD | 91,986 | 77.100 | 7,092,120.600 | |
| | NESTLE INDIA LTD | 1,963 | 5,905.750 | 11,592,987.250 | |
| | BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD | 49,099 | 128.250 | 6,296,946.750 | |
| | GAIL INDIA LTD | 26,335 | 440.700 | 11,605,834.500 | |
| | VEDANTA LTD | 86,499 | 232.600 | 20,119,667.400 | |
| | AXIS BANK LTD | 139,731 | 447.350 | 62,508,662.850 | |
| | TITAN COMPANY LTD | 25,302 | 361.450 | 9,145,407.900 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 105,658 | 198.450 | 20,967,830.100 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|------------|-----------------|--|
| LUPIN LTD | 18,493 | 1,488.500 | 27,526,830.500 | |
| ACC LTD | 3,300 | 1,319.600 | 4,354,680.000 | |
| BAJAJ FINANCE LTD | 13,840 | 899.750 | 12,452,540.000 | |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP | 125,716 | 1,217.250 | 153,027,801.000 | |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD | 48,253 | 467.750 | 22,570,340.750 | |
| INFOSYS LTD | 153,655 | 970.550 | 149,129,860.250 | |
| WIPRO LTD | 51,131 | 476.500 | 24,363,921.500 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 54,107 | 830.550 | 44,938,568.850 | |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD | 6,454 | 1,196.900 | 7,724,792.600 | |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 47,180 | 837.850 | 39,529,763.000 | |
| DABUR INDIA LTD | 44,319 | 277.650 | 12,305,170.350 | |
| HERO MOTOCORP LTD | 4,116 | 3,059.000 | 12,590,844.000 | |
| DR REDDYS LABORATORIES LTD | 9,660 | 3,041.850 | 29,384,271.000 | |
| BHARTI AIRTEL LTD | 82,983 | 320.100 | 26,562,858.300 | |
| UNITED SPIRITS LTD | 5,444 | 1,909.400 | 10,394,773.600 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | 80,338 | 638.550 | 51,299,829.900 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 6,922 | 739.350 | 5,117,780.700 | |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 8,833 | 5,674.850 | 50,125,950.050 | |
| GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD | 11,618 | 899.900 | 10,455,038.200 | |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 22,467 | 699.650 | 15,719,036.550 | |
| HAVELLS INDIA LTD | 20,340 | 367.550 | 7,475,967.000 | |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 36,648 | 328.050 | 12,022,376.400 | |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD | 12,785 | 939.450 | 12,010,868.250 | |
| CIPLA LTD/INDIA | 28,876 | 574.900 | 16,600,812.400 | |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 26,431 | 1,387.500 | 36,673,012.500 | |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 7,312 | 3,279.450 | 23,979,338.400 | |
| ASHOK LEYLAND LTD | 97,960 | 84.950 | 8,321,702.000 | |
| BOSCH LTD | 631 | 21,146.350 | 13,343,346.850 | |
| TATA CONSULTANCY SERVICES LTD | 39,455 | 2,315.350 | 91,352,134.250 | |
| NTPC LTD | 140,731 | 162.300 | 22,840,641.300 | |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 6,629 | 1,734.750 | 11,499,657.750 | |
| YES BANK LTD | 26,203 | 1,264.600 | 33,136,313.800 | |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 50,174 | 209.400 | 10,506,435.600 | |
| BHARAT FORGE LTD | 8,786 | 930.750 | 8,177,569.500 | |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 95,921 | 164.400 | 15,769,412.400 | |
| ITC LTD | 282,831 | 248.950 | 70,410,777.450 | |
| UNITED PHOSPHORUS LTD | 29,735 | 663.500 | 19,729,172.500 | |
| SIEMENS INDIA LTD | 5,885 | 1,172.550 | 6,900,456.750 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 10,178 | 1,562.850 | 15,906,687.300 | |

| | | | | | |
|------------|--|-----------|------------|--------------------------------------|--|
| | TECH MAHINDRA LTD | 19,661 | 473.500 | 9,309,483.500 | |
| | CAIRN INDIA LTD | 37,231 | 258.700 | 9,631,659.700 | |
| | IDEA CELLULAR LTD | 103,591 | 74.500 | 7,717,529.500 | |
| | MARICO LTD | 38,600 | 260.750 | 10,064,950.000 | |
| | POWER FINANCE CORP LTD | 51,530 | 129.200 | 6,657,676.000 | |
| | ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 68,842 | 293.900 | 20,232,663.800 | |
| | BAJAJ FINSERV LTD | 3,264 | 3,010.150 | 9,825,129.600 | |
| | BAJAJ AUTO LTD | 6,948 | 2,740.750 | 19,042,731.000 | |
| | COAL INDIA LTD | 59,515 | 300.600 | 17,890,209.000 | |
| | TATA MOTORS LTD | 31,568 | 326.300 | 10,300,638.400 | |
| | MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD | 23,715 | 281.250 | 6,669,843.750 | |
| | BHARTI INFRATEL LTD | 47,337 | 353.550 | 16,735,996.350 | |
| | INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD | 25,108 | 688.750 | 17,293,135.000 | |
| | CADILA HEALTHCARE LTD | 18,146 | 355.750 | 6,455,439.500 | |
| | IDFC BANK LTD | 114,421 | 61.850 | 7,076,938.850 | |
| インド・ルピー 小計 | | 3,621,946 | | 1,893,456,552.400 (3,237,810,705) | |
| インドネシア・ルピア | AKR CORPORINDO TBK PT | 150,400 | 6,250.000 | 940,000,000.000 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 144,301 | 21,950.000 | 3,167,406,950.000 | |
| | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT | 373,300 | 7,975.000 | 2,977,067,500.000 | |
| | UNILEVER INDONESIA TBK PT | 127,400 | 40,100.000 | 5,108,740,000.000 | |
| | PT ASTRA INTERNATIONAL TBK | 1,692,700 | 8,200.000 | 13,880,140,000.000 | |
| | TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK | 4,217,700 | 4,000.000 | 16,870,800,000.000 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT | 620,900 | 3,130.000 | 1,943,417,000.000 | |
| | GUDANG GARAM TBK PT | 40,500 | 63,000.000 | 2,551,500,000.000 | |
| | HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK | 782,000 | 3,950.000 | 3,088,900,000.000 | |
| | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT | 121,700 | 15,250.000 | 1,855,925,000.000 | |
| | SUMMARECON AGUNG TBK PT | 870,500 | 1,325.000 | 1,153,412,500.000 | |
| | BANK DANAMON INDONESIA TBK PT | 290,416 | 3,670.000 | 1,065,826,720.000 | |
| | BANK MANDIRI | 779,000 | 11,400.000 | 8,880,600,000.000 | |
| | MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK | 199,400 | 15,675.000 | 3,125,595,000.000 | |
| | BANK RAKYAT INDONESIA | 927,800 | 11,800.000 | 10,948,040,000.000 | |
| | PERUSAHAAN GAS NEGARA PT | 953,400 | 2,740.000 | 2,612,316,000.000 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT | 632,200 | 5,600.000 | 3,540,320,000.000 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 1,748,400 | 1,550.000 | 2,710,020,000.000 | |

| | | | | | |
|---------------|--|------------|------------|--|--|
| | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 241,600 | 9,125.000 | 2,204,600,000.000 | |
| | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 1,028,400 | 15,400.000 | 15,837,360,000.000 | |
| | XL AXIATA TBK PT | 290,700 | 2,670.000 | 776,169,000.000 | |
| | LIPPO KARAWACI TBK PT | 1,560,300 | 780.000 | 1,217,034,000.000 | |
| | MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT | 468,500 | 1,760.000 | 824,560,000.000 | |
| | JASA MARGA PERSERO TBK PT | 200,125 | 4,260.000 | 852,532,500.000 | |
| | BUMI SERPONG DAMAI PT | 592,800 | 1,740.000 | 1,031,472,000.000 | |
| | ADARO ENERGY PT | 1,223,000 | 1,685.000 | 2,060,755,000.000 | |
| | PAKUWON JATI TBK | 2,087,400 | 580.000 | 1,210,692,000.000 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT | 182,600 | 8,775.000 | 1,602,315,000.000 | |
| | TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT | 180,800 | 5,200.000 | 940,160,000.000 | |
| | WASKITA KARYA PERSERO TBK PT | 392,000 | 2,580.000 | 1,011,360,000.000 | |
| | PT SURYA CITRA MEDIA TBK | 535,800 | 2,830.000 | 1,516,314,000.000 | |
| インドネシア・ルピア 小計 | | 23,656,042 | | 117,505,350,170.000 (1,022,296,546) | |
| カタール・リアル | QATAR INSURANCE CO SAQ | 9,967 | 89.000 | 887,063.000 | |
| | QATAR NATIONAL BANK | 17,481 | 165.100 | 2,886,113.100 | |
| | COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC | 13,439 | 32.500 | 436,767.500 | |
| | OOREDOO QSC | 6,737 | 106.500 | 717,490.500 | |
| | DOHA BANK QSC | 10,788 | 35.200 | 379,737.600 | |
| | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 2,406 | 234.000 | 563,004.000 | |
| | INDUSTRIES QATAR QSC | 12,841 | 120.000 | 1,540,920.000 | |
| | QATAR ISLAMIC BANK SAQ | 5,187 | 106.700 | 553,452.900 | |
| | QATAR GAS TRANSPORT CO LTD | 23,294 | 23.530 | 548,107.820 | |
| | MASRAF AL RAYAN | 30,191 | 39.100 | 1,180,468.100 | |
| | BARWA REAL ESTATE CO | 7,916 | 34.200 | 270,727.200 | |
| | EZDAN HOLDING GROUP QSC | 66,339 | 15.380 | 1,020,293.820 | |
| | COMMERCIAL BANK QSC-RTS | 2,420 | 4.460 | 10,793.200 | |
| カタール・リアル 小計 | | 209,006 | | 10,994,938.740 (350,848,495) | |
| コロンビア・ペソ | INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP | 30,075 | 10,140.000 | 304,960,500.000 | |
| | CORP FINANCIERA COLOMBIANA SA | 7,787 | 37,460.000 | 291,701,020.000 | |
| | ECOPETROL SA | 413,049 | 1,390.000 | 574,138,110.000 | |
| | GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF | 9,067 | 37,500.000 | 340,012,500.000 | |
| | GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF | 247,861 | 1,205.000 | 298,672,505.000 | |
| | CEMENTOS ARGOS SA | 38,592 | 11,820.000 | 456,157,440.000 | |

| | | | | | |
|-------------|---|-----------|------------|------------------------------------|--|
| | GRUPO ARGOS SA | 24,430 | 19,680.000 | 480,782,400.000 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 37,502 | 28,280.000 | 1,060,556,560.000 | |
| | GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA | 19,160 | 38,200.000 | 731,912,000.000 | |
| コロンビア・ペソ 小計 | | 827,523 | | 4,538,893,035.000 (177,924,607) | |
| タイ・パーツ | BANGKOK BANK PCL | 19,700 | 171.500 | 3,378,550.000 | |
| | BEC WORLD PLC | 86,200 | 18.700 | 1,611,940.000 | |
| | BERLI JUCKER PCL NVDR | 100,100 | 47.500 | 4,754,750.000 | |
| | KRUNG THAI BANK PCL NVDR | 293,900 | 18.800 | 5,525,320.000 | |
| | ROBINSON DEPARTMENT STORE PCL-NVDR | 39,400 | 59.750 | 2,354,150.000 | |
| | SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR | 146,700 | 157.500 | 23,105,250.000 | |
| | TRUE CORP PCL NVDR | 834,855 | 7.100 | 5,927,470.500 | |
| | KASIKORNBANK PCL NVDR | 49,000 | 189.000 | 9,261,000.000 | |
| | TMB BANK PCL -NVDR | 1,010,000 | 2.280 | 2,302,800.000 | |
| | IRPC PCL NVDR | 863,400 | 5.100 | 4,403,340.000 | |
| | BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR | 127,000 | 20.300 | 2,578,100.000 | |
| | ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR | 10,100 | 200.000 | 2,020,000.000 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS PCL | 229,000 | 30.250 | 6,927,250.000 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE PCL | 86,300 | 153.000 | 13,203,900.000 | |
| | HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR | 361,920 | 10.200 | 3,691,584.000 | |
| | DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR | 45,500 | 84.750 | 3,856,125.000 | |
| | PTT PCL | 83,200 | 388.000 | 32,281,600.000 | |
| | THAI UNION GROUP PCL- NVDR | 164,100 | 21.200 | 3,478,920.000 | |
| | SIAM CEMENT PCL NVDR | 11,050 | 498.000 | 5,502,900.000 | |
| | KCE ELECTRONICS PCL-NVDR | 24,900 | 124.500 | 3,100,050.000 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR | 35,500 | 393.000 | 13,951,500.000 | |
| | SIAM CEMENT PCL FOREIGN | 22,700 | 498.000 | 11,304,600.000 | |
| | KASIKORNBANK PCL - FOREIGN | 96,400 | 190.000 | 18,316,000.000 | |
| | CENTRAL PATTANA PCL NVDR | 113,600 | 56.500 | 6,418,400.000 | |
| | BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR | 323,800 | 22.500 | 7,285,500.000 | |
| | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR | 30,300 | 184.500 | 5,590,350.000 | |
| | MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR | 183,910 | 36.000 | 6,620,760.000 | |
| | THAI OIL PCL NVDR | 70,200 | 69.000 | 4,843,800.000 | |
| | GLOW ENERGY PCL NVDR | 41,600 | 79.500 | 3,307,200.000 | |
| | CP ALL PCL NVDR | 413,500 | 62.000 | 25,637,000.000 | |

| | | | | | |
|------------|---|------------|------------|------------------------------------|--|
| | BTS GROUP HOLDINGS PCL | 515,300 | 8.700 | 4,483,110.000 | |
| | PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR | 114,545 | 96.000 | 10,996,320.000 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL NVDR | 57,922 | 37.000 | 2,143,114.000 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL FOREIGN | 54,933 | 37.000 | 2,032,521.000 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 171,808 | 63.500 | 10,909,808.000 | |
| | ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR | 93,000 | 30.250 | 2,813,250.000 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR | 578,400 | 7.650 | 4,424,760.000 | |
| タイ・パーツ 小計 | | 7,503,743 | | 280,342,992.500 (913,918,155) | |
| チェコ・コルナ | KOMERCNI BANKA AS | 5,707 | 885.500 | 5,053,548.500 | |
| | O2 CZECH REPUBLIC AS | 5,677 | 267.900 | 1,520,868.300 | |
| | CEZ | 13,588 | 423.700 | 5,757,235.600 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 35,735 | 81.850 | 2,924,909.750 | |
| チェコ・コルナ 小計 | | 60,707 | | 15,256,562.150 (69,112,226) | |
| チリ・ペソ | BANCO SANTANDER CHILE | 5,373,843 | 36.580 | 196,575,176.940 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES | 3,083 | 33,884.000 | 104,464,372.000 | |
| | BANCO DE CHILE | 2,049,363 | 78.390 | 160,649,565.570 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 102,793 | 1,348.300 | 138,595,801.900 | |
| | EMPRESAS COPEC SA | 36,937 | 6,517.500 | 240,736,897.500 | |
| | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 13,190 | 6,917.300 | 91,239,187.000 | |
| | ENTEL CHILE SA | 12,913 | 7,034.400 | 90,835,207.200 | |
| | ENEL GENERACION CHILE SA | 274,605 | 435.410 | 119,565,763.050 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 2,433,732 | 110.700 | 269,414,132.400 | |
| | COLBUN SA | 616,527 | 129.780 | 80,012,874.060 | |
| | AGUAS ANDINAS SA | 224,116 | 365.870 | 81,997,320.920 | |
| | EMBOTELLADORA ANDINA SA | 21,380 | 2,551.200 | 54,544,656.000 | |
| | LATAM AIRLINES GROUP SA | 24,937 | 5,754.900 | 143,509,941.300 | |
| | SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA | 8,243 | 20,267.000 | 167,060,881.000 | |
| | SACI FALABELLA | 50,696 | 5,225.300 | 264,901,808.800 | |
| | ITAU CORPBANCA | 13,410,500 | 5.597 | 75,058,568.500 | |
| | CENCOSUD SA | 118,522 | 1,869.600 | 221,588,731.200 | |
| | AES GENER SA | 257,135 | 226.100 | 58,138,223.500 | |
| | ENEL CHILE SA | 1,664,838 | 63.000 | 104,884,794.000 | |
| チリ・ペソ 小計 | | 26,697,353 | | 2,663,773,902.840 (460,832,885) | |
| トルコ・リラ | AKBANK TAS | 184,037 | 7.470 | 1,374,756.390 | |
| | ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS | 16,570 | 18.830 | 312,013.100 | |
| | ARCELIK | 20,283 | 20.120 | 408,093.960 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS | 112,625 | 4.970 | 559,746.250 | |

| | | | | | |
|----------------|---|-----------|------------|----------------------------------|--|
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 5,584 | 29.920 | 167,073.280 | |
| | KOC HOLDING AS | 52,699 | 13.360 | 704,058.640 | |
| | PETKIM PETROKIMYA HOLDING | 47,602 | 3.830 | 182,315.660 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS | 56,871 | 3.720 | 211,560.120 | |
| | TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS | 10,370 | 23.680 | 245,561.600 | |
| | TURK HAVA YOLLARI | 39,958 | 4.830 | 192,997.140 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 71,853 | 10.220 | 734,337.660 | |
| | TURKIYE GARANTI BANKASI AS | 194,188 | 7.410 | 1,438,933.080 | |
| | TURKIYE IS BANKASI | 134,746 | 5.160 | 695,289.360 | |
| | TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE | 10,559 | 71.500 | 754,968.500 | |
| | ULKER BISKUVI SANAYI AS | 14,893 | 15.650 | 233,075.450 | |
| | YAPI VE KREDI BANKASI AS | 78,404 | 3.310 | 259,517.240 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING AS | 79,625 | 9.060 | 721,402.500 | |
| | COCA-COLA ICECEK AS | 6,451 | 32.800 | 211,592.800 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 17,758 | 48.240 | 856,645.920 | |
| | TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO | 63,608 | 4.260 | 270,970.080 | |
| | TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | 15,347 | 14.180 | 217,620.460 | |
| | TURKIYE HALK BANKASI AS | 51,480 | 9.350 | 481,338.000 | |
| | TURK TELEKOMUNIKASYON AS | 39,975 | 5.160 | 206,271.000 | |
| トルコ・リラ 小計 | | 1,325,486 | | 11,440,138.190 (348,237,806) | |
| ハンガリー・フォリント | RICHTER GEDEON NYRT | 11,774 | 6,448.000 | 75,918,752.000 | |
| | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT | 3,236 | 20,970.000 | 67,858,920.000 | |
| | OTP BANK NYRT | 20,037 | 8,742.000 | 175,163,454.000 | |
| ハンガリー・フォリント 小計 | | 35,047 | | 318,941,126.000 (126,268,792) | |
| フィリピン・ペソ | AYALA LAND INC | 615,600 | 34.400 | 21,176,640.000 | |
| | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 157,720 | 75.000 | 11,829,000.000 | |
| | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND | 59,486 | 92.400 | 5,496,506.400 | |
| | AYALA CORP | 21,453 | 793.000 | 17,012,229.000 | |
| | ALLIANCE GLOBAL GROUP INC | 169,800 | 13.700 | 2,326,260.000 | |
| | DMCI HOLDINGS INC | 351,850 | 13.000 | 4,574,050.000 | |
| | GLOBE TELECOM INC | 2,960 | 1,826.000 | 5,404,960.000 | |
| | INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC | 40,680 | 75.450 | 3,069,306.000 | |

| | | | | | |
|-------------|--|-----------|-----------|----------------------------------|--|
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 236,480 | 76.300 | 18,043,424.000 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORP | 36,030 | 219.000 | 7,890,570.000 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 47,451 | 80.150 | 3,803,197.650 | |
| | BDO UNIBANK INC | 136,318 | 113.800 | 15,512,988.400 | |
| | MEGAWORLD CORP | 962,000 | 3.920 | 3,771,040.000 | |
| | PLDT INC | 8,220 | 1,590.000 | 13,069,800.000 | |
| | ROBINSONS LAND CORP | 131,600 | 27.350 | 3,599,260.000 | |
| | SECURITY BANK CORP | 9,450 | 215.000 | 2,031,750.000 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 690,275 | 31.300 | 21,605,607.500 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 72,860 | 170.000 | 12,386,200.000 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 19,988 | 690.000 | 13,791,720.000 | |
| | ENERGY DEVELOPMENT CORP | 809,000 | 5.250 | 4,247,250.000 | |
| | METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP | 1,180,800 | 7.100 | 8,383,680.000 | |
| | ABOITIZ POWER CORP | 122,900 | 43.700 | 5,370,730.000 | |
| | GT CAPITAL HOLDINGS INC | 6,900 | 1,320.000 | 9,108,000.000 | |
| フィリピン・ペソ 小計 | | 5,889,821 | | 213,504,168.950 (499,599,755) | |
| ブラジル・レアル | BRF SA | 51,092 | 45.920 | 2,346,144.640 | |
| | VALE SA | 106,827 | 28.540 | 3,048,842.580 | |
| | CIA PARANAENSE DE ENERGIA | 8,018 | 28.700 | 230,116.600 | |
| | VALE SA-PREF A | 161,696 | 26.170 | 4,231,584.320 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 19,500 | 60.040 | 1,170,780.000 | |
| | TIM PARTICIPACOES SA | 69,700 | 8.300 | 578,510.000 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA | 19,450 | 24.990 | 486,055.500 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA | 18,000 | 21.980 | 395,640.000 | |
| | BANCO DO BRASIL SA | 71,800 | 28.180 | 2,023,324.000 | |
| | INVESTIMENTOS ITAU SA | 325,078 | 8.700 | 2,828,178.600 | |
| | LOJAS AMERICANAS SA | 48,874 | 16.850 | 823,526.900 | |
| | LOJAS AMERICANAS SA | 14,670 | 12.600 | 184,842.000 | |
| | GERDAU SA | 76,630 | 11.980 | 918,027.400 | |
| | CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR | 13,106 | 55.640 | 729,217.840 | |
| | PETROLEO BRASILEIRO SA | 248,010 | 17.610 | 4,367,456.100 | |
| | PETROLEO BRASILEIRO SA | 328,912 | 15.480 | 5,091,557.760 | |
| | KROTON EDUCACIONAL SA | 115,968 | 13.390 | 1,552,811.520 | |
| | CCR SA | 73,820 | 16.430 | 1,212,862.600 | |
| | WEG SA | 47,540 | 15.230 | 724,034.200 | |
| | BANCO BRADESCO SA PREF | 233,315 | 30.370 | 7,085,776.550 | |
| | BANCO BRADESCO SA | 68,241 | 30.500 | 2,081,350.500 | |
| | NATURA COSMETICOS SA | 14,800 | 23.800 | 352,240.000 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 50,506 | 11.700 | 590,920.200 | |

| | | | | |
|---|-----------|---------|-----------------------------------|--|
| SUZANO PAPEL E CELULOSE SA | 31,400 | 13.610 | 427,354.000 | |
| CPFL ENERGIA SA | 17,474 | 25.240 | 441,043.760 | |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 270,098 | 35.750 | 9,656,003.500 | |
| PORTO SEGURO SA | 9,400 | 27.330 | 256,902.000 | |
| FIBRIA CELULOSE SA | 21,490 | 31.360 | 673,926.400 | |
| BRASKEM SA | 12,030 | 35.490 | 426,944.700 | |
| ENGIE BRASIL SA | 13,970 | 35.050 | 489,648.500 | |
| LOCALIZA RENT A CAR | 13,105 | 36.550 | 478,987.750 | |
| TELEFONICA BRASIL S.A. | 37,228 | 44.650 | 1,662,230.200 | |
| LOJAS RENNER SA | 54,200 | 22.900 | 1,241,180.000 | |
| EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA | 26,064 | 13.300 | 346,651.200 | |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 30,252 | 67.920 | 2,054,715.840 | |
| COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO | 9,500 | 37.580 | 357,010.000 | |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 16,800 | 53.500 | 898,800.000 | |
| EMBRAER SA | 56,360 | 16.450 | 927,122.000 | |
| M DIAS BRANCO SA | 2,800 | 123.000 | 344,400.000 | |
| ODONTOPREV SA | 22,300 | 11.260 | 251,098.000 | |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | 49,400 | 12.870 | 635,778.000 | |
| JBS SA | 61,100 | 12.050 | 736,255.000 | |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS | 64,349 | 7.450 | 479,400.050 | |
| CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO | 28,998 | 29.250 | 848,191.500 | |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA | 7,000 | 60.910 | 426,370.000 | |
| DURATEX SA | 27,734 | 7.560 | 209,669.040 | |
| SUL AMERICA SA | 15,448 | 18.800 | 290,422.400 | |
| HYPERMARCAS SA | 29,900 | 26.590 | 795,041.000 | |
| BM&FBOVESPA SA | 144,900 | 17.370 | 2,516,913.000 | |
| QUALICORP SA | 17,800 | 19.220 | 342,116.000 | |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA | 34,900 | 29.680 | 1,035,832.000 | |
| CETIP SA - MERCADOS ORGANIZADO | 19,459 | 46.030 | 895,697.770 | |
| CIELO SA | 85,423 | 26.580 | 2,270,543.340 | |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 58,300 | 29.560 | 1,723,348.000 | |
| AMBEV SA | 394,095 | 16.340 | 6,439,512.300 | |
| KLABIN SA | 46,700 | 16.410 | 766,347.000 | |
| RUMO LOGISTICA OPERADORA MULTIMODAL SA | 68,700 | 6.560 | 450,672.000 | |
| AES TIETE ENERGIA SA | 14,758 | 14.410 | 212,662.780 | |
| ブラジル・リアル 小計 | 3,998,988 | | 85,062,588.840 (3,087,771,974) | |

| | | | | | |
|-----------------|---|---------|-----------|---------------------------------|--|
| ポーランド・ズロチ | BANK MILLENNIUM SA | 52,647 | 5.740 | 302,193.780 | |
| | MBANK | 1,260 | 348.650 | 439,299.000 | |
| | BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA | 2,596 | 77.300 | 200,670.800 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 11,662 | 100.200 | 1,168,532.400 | |
| | BANK PEKAO SA | 13,007 | 129.550 | 1,685,056.850 | |
| | ORANGE POLSKA SA | 58,600 | 5.630 | 329,918.000 | |
| | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 26,795 | 88.300 | 2,365,998.500 | |
| | LPP SA | 112 | 5,420.000 | 607,040.000 | |
| | BANK ZACHODNI WBK SA | 2,975 | 324.050 | 964,048.750 | |
| | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA | 72,885 | 30.300 | 2,208,415.500 | |
| | CCC SA | 2,228 | 217.100 | 483,698.800 | |
| | SYNTHOS SA | 46,508 | 5.070 | 235,795.560 | |
| | EUROCASH SA | 6,142 | 40.550 | 249,058.100 | |
| | GRUPA LOTOS SA | 7,977 | 39.800 | 317,484.600 | |
| | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA | 150,232 | 5.770 | 866,838.640 | |
| | CYFROWY POLSAT SA | 16,740 | 24.920 | 417,160.800 | |
| | GRUPA AZOTY SA | 3,853 | 68.890 | 265,433.170 | |
| | POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA | 74,259 | 10.480 | 778,234.320 | |
| | TAURON POLSKA ENERGIA SA | 82,524 | 2.930 | 241,795.320 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA | 46,891 | 34.300 | 1,608,361.300 | |
| | JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA | 4,403 | 69.400 | 305,568.200 | |
| | ALIOR BANK SA | 7,434 | 59.250 | 440,464.500 | |
| ポーランド・ズロチ 小計 | | 691,730 | | 16,481,066.890 (461,634,684) | |
| マレーシア・リン ギット | AMMB HOLDINGS BHD | 152,500 | 4.450 | 678,625.000 | |
| | GENTING PLANTATIONS BHD | 22,600 | 10.960 | 247,696.000 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 251,500 | 4.800 | 1,207,200.000 | |
| | DIGI.COM BHD | 287,500 | 4.900 | 1,408,750.000 | |
| | MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD | 69,120 | 6.040 | 417,484.800 | |
| | RHB BANK BHD | 64,480 | 4.930 | 317,886.400 | |
| | HAP SENG CONSOLIDATED BHD | 54,700 | 9.000 | 492,300.000 | |
| | BERJAYA SPORTS TOTO BHD | 69,235 | 2.920 | 202,166.200 | |
| | GAMUDA BHD | 135,700 | 4.950 | 671,715.000 | |
| | GENTING BHD | 188,200 | 8.210 | 1,545,122.000 | |
| | YTL CORP BHD | 370,010 | 1.520 | 562,415.200 | |
| | HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD | 16,656 | 14.960 | 249,173.760 | |
| | HONG LEONG BANK BHD | 48,008 | 13.300 | 638,506.400 | |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------------|-----------|---------|---------------------------------|--|
| | IJM CORP BHD | 245,560 | 3.390 | 832,448.400 | |
| | IOI CORP BHD | 189,613 | 4.500 | 853,258.500 | |
| | KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 36,500 | 24.100 | 879,650.000 | |
| | MALAYAN BANKING BHD | 293,575 | 8.280 | 2,430,801.000 | |
| | LAFARGE MALAYSIA BHD | 26,700 | 7.200 | 192,240.000 | |
| | ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD | 86,100 | 3.740 | 322,014.000 | |
| | MISC BHD | 94,580 | 7.440 | 703,675.200 | |
| | PPB GROUP BHD | 40,500 | 16.380 | 663,390.000 | |
| | PETRONAS DAGANGAN BHD | 17,500 | 23.820 | 416,850.000 | |
| | PETRONAS GAS BHD | 58,700 | 20.980 | 1,231,526.000 | |
| | GENTING MALAYSIA BHD | 248,400 | 4.850 | 1,204,740.000 | |
| | BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD | 11,400 | 46.280 | 527,592.000 | |
| | TELEKOM MALAYSIA BHD | 95,000 | 6.160 | 585,200.000 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 286,250 | 13.800 | 3,950,250.000 | |
| | UMW HOLDINGS BHD | 36,300 | 4.610 | 167,343.000 | |
| | DIALOG GROUP BHD | 243,444 | 1.550 | 377,338.200 | |
| | PUBLIC BANK BHD(LOCAL) | 226,430 | 20.020 | 4,533,128.600 | |
| | YTL POWER INTERNATIONAL BHD | 145,863 | 1.450 | 211,501.350 | |
| | AIRASIA BHD | 107,200 | 2.190 | 234,768.000 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 192,100 | 8.450 | 1,623,245.000 | |
| | HARTALEGA HOLDINGS BHD | 63,700 | 4.810 | 306,397.000 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 219,100 | 4.740 | 1,038,534.000 | |
| | MAXIS BHD | 154,200 | 6.180 | 952,956.000 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 196,300 | 7.170 | 1,407,471.000 | |
| | SAPURA KENCANA PETROLEUM BHD | 319,200 | 1.720 | 549,024.000 | |
| | ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD | 125,500 | 2.700 | 338,850.000 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 282,100 | 6.380 | 1,799,798.000 | |
| | FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD | 119,200 | 1.760 | 209,792.000 | |
| | WESTPORTS HOLDINGS BHD | 83,500 | 4.300 | 359,050.000 | |
| | IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD | 139,639 | 2.210 | 308,602.190 | |
| マレーシア・リンギット 小計 | | 6,114,363 | | 37,850,474.200 (980,705,786) | |
| メキシコ・ペソ | ALFA SAB DE CV | 233,900 | 25.030 | 5,854,517.000 | |
| | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 42,300 | 130.910 | 5,537,493.000 | |
| | EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV | 15,600 | 141.230 | 2,203,188.000 | |
| | GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO | 152,500 | 30.720 | 4,684,800.000 | |
| | GRUPO TELEVISA SAB | 203,500 | 87.190 | 17,743,165.000 | |
| | GRUPO BIMBO SAB DE CV | 136,100 | 46.630 | 6,346,343.000 | |

| | | | | | |
|------------|--|-----------|-------------|------------------------------------|--|
| | GRUMA SAB DE CV | 18,425 | 265.180 | 4,885,941.500 | |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA | 22,125 | 163.400 | 3,615,225.000 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV | 46,900 | 81.410 | 3,818,129.000 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV | 207,400 | 95.500 | 19,806,700.000 | |
| | MEXICHEM SAB DE CV | 87,625 | 50.030 | 4,383,878.750 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 13,960 | 476.750 | 6,655,430.000 | |
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV | 130,300 | 34.660 | 4,516,198.000 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV | 17,090 | 304.560 | 5,204,930.400 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV | 317,752 | 59.540 | 18,918,954.080 | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE CV | 2,767,278 | 13.840 | 38,299,127.520 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA SA | 190,100 | 30.470 | 5,792,347.000 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 36,400 | 104.100 | 3,789,240.000 | |
| | WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | 433,100 | 35.790 | 15,500,649.000 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV | 30,000 | 164.490 | 4,934,700.000 | |
| | OHL MEXICO SAB DE CV | 70,200 | 21.120 | 1,482,624.000 | |
| | GENTERA SAB DE CV | 84,900 | 32.690 | 2,775,381.000 | |
| | INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV | 45,500 | 89.690 | 4,080,895.000 | |
| | GRUPO LALA SAB DE CV | 50,400 | 27.420 | 1,381,968.000 | |
| メキシコ・ペソ 小計 | | 5,353,355 | | 192,211,824.250 (1,022,566,905) | |
| ユーロ | PIRAEUS BANK S.A | 500,000 | 0.219 | 109,500.000 | |
| | ALPHA BANK A.E. | 100,000 | 1.980 | 198,000.000 | |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 3,998 | 0.253 | 1,011.490 | |
| | TITAN CEMENT CO. S.A. | 3,518 | 22.000 | 77,396.000 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 10,004 | 9.060 | 90,636.240 | |
| | FF GROUP | 3,130 | 19.050 | 59,626.500 | |
| | EUROBANK ERGASIAS | 1,630 | 0.664 | 1,082.320 | |
| | OPAP SA | 8,501 | 8.750 | 74,383.750 | |
| | JUMBO SA | 5,623 | 14.860 | 83,557.780 | |
| ユーロ 小計 | | 636,404 | | 695,194.080 (85,112,611) | |
| 韓国・ウォン | CHEIL WORLDWIDE INC | 5,627 | 16,350.000 | 92,001,450.000 | |
| | HANMI PHARM CO LTD | 1,068 | 56,300.000 | 60,128,400.000 | |
| | HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 3,205 | 101,000.000 | 323,705,000.000 | |
| | SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC | 2,766 | 266,500.000 | 737,139,000.000 | |
| | DONGBU INSURANCE CO LTD | 4,192 | 62,400.000 | 261,580,800.000 | |

| | | | | |
|---|--------|-------------|-------------------|--|
| COWAY CO LTD | 4,510 | 89,900.000 | 405,449,000.000 | |
| KT&G CORP | 9,779 | 99,500.000 | 973,010,500.000 | |
| S-1 CORPORATION | 1,579 | 90,400.000 | 142,741,600.000 | |
| KOREA GAS CORP | 2,424 | 47,700.000 | 115,624,800.000 | |
| CJ CORP | 1,242 | 190,000.000 | 235,980,000.000 | |
| KAKAO CORP | 2,569 | 82,000.000 | 210,658,000.000 | |
| SK TELECOM CO LTD | 1,695 | 225,000.000 | 381,375,000.000 | |
| DAELIM INDUSTRIAL CO | 2,400 | 84,700.000 | 203,280,000.000 | |
| MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD | 15,692 | 8,000.000 | 125,536,000.000 | |
| NCSOFT CORPORATION | 1,481 | 263,500.000 | 390,243,500.000 | |
| LG UPLUS CORP | 18,179 | 11,500.000 | 209,058,500.000 | |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD | 4,050 | 29,350.000 | 118,867,500.000 | |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT | 8,516 | 5,200.000 | 44,283,200.000 | |
| POSCO DAEWOO CORP | 3,600 | 27,250.000 | 98,100,000.000 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 787 | 848,000.000 | 667,376,000.000 | |
| LG CHEM LTD | 3,876 | 267,500.000 | 1,036,830,000.000 | |
| LG CHEM LTD | 607 | 178,500.000 | 108,349,500.000 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 167 | 527,000.000 | 88,009,000.000 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | 35,659 | 44,900.000 | 1,601,089,100.000 | |
| HYUNDAI DEVELOPMENT CO | 4,815 | 44,800.000 | 215,712,000.000 | |
| S-OIL CORP | 3,868 | 84,700.000 | 327,619,600.000 | |
| HANWHA CHEMICAL CORPORATION | 9,297 | 26,200.000 | 243,581,400.000 | |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 4,874 | 32,150.000 | 156,699,100.000 | |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 1,284 | 375,000.000 | 481,500,000.000 | |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 2,955 | 46,100.000 | 136,225,500.000 | |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES | 3,495 | 139,000.000 | 485,805,000.000 | |
| HYUNDAI MOBIS | 5,686 | 276,500.000 | 1,572,179,000.000 | |
| SK HYNIX INC | 48,682 | 49,750.000 | 2,421,929,500.000 | |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | 6,099 | 41,200.000 | 251,278,800.000 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 1,907 | 98,000.000 | 186,886,000.000 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 12,850 | 152,000.000 | 1,953,200,000.000 | |
| HYUNDAI STEEL CO | 6,608 | 56,600.000 | 374,012,800.000 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 21,291 | 12,250.000 | 260,814,750.000 | |
| KCC CORP | 483 | 359,000.000 | 173,397,000.000 | |
| KIA MOTORS CORP | 21,962 | 40,500.000 | 889,461,000.000 | |
| KOREA ZINC CO LTD | 725 | 479,500.000 | 347,637,500.000 | |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP | 21,543 | 42,250.000 | 910,191,750.000 | |
| HANWHA CORP | 3,785 | 37,600.000 | 142,316,000.000 | |

| | | | | |
|--|--------|---------------|--------------------|--|
| KOREAN AIR CO LTD | 2,950 | 26,050.000 | 76,847,500.000 | |
| OCI COMPANY LTD | 1,500 | 79,000.000 | 118,500,000.000 | |
| KOREA EXPRESS CO LTD | 591 | 168,000.000 | 99,288,000.000 | |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 1,423 | 85,800.000 | 122,093,400.000 | |
| KT CORP | 2,048 | 29,000.000 | 59,392,000.000 | |
| LG ELECTRONICS INC | 8,905 | 51,800.000 | 461,279,000.000 | |
| LOTTE CONFECTIONERY CO LTD | 430 | 172,500.000 | 74,175,000.000 | |
| LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD | 47 | 1,396,000.000 | 65,612,000.000 | |
| HANSSEM CO LTD | 869 | 191,500.000 | 166,413,500.000 | |
| LG CORP | 7,896 | 59,100.000 | 466,653,600.000 | |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 11,590 | 10,100.000 | 117,059,000.000 | |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCTION | 3,945 | 27,300.000 | 107,698,500.000 | |
| NAVER CORP | 2,347 | 792,000.000 | 1,858,824,000.000 | |
| HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD | 1,243 | 98,500.000 | 122,435,500.000 | |
| DONGSUH CO INC | 2,798 | 26,050.000 | 72,887,900.000 | |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD | 3,287 | 43,800.000 | 143,970,600.000 | |
| OTTOGI CORP | 112 | 627,000.000 | 70,224,000.000 | |
| AMOREPACIFIC GROUP | 2,351 | 121,000.000 | 284,471,000.000 | |
| KANGWON LAND INC | 9,832 | 34,800.000 | 342,153,600.000 | |
| POSCO | 6,174 | 249,500.000 | 1,540,413,000.000 | |
| SAMSUNG SDI CO LTD | 4,595 | 116,500.000 | 535,317,500.000 | |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | 4,716 | 50,700.000 | 239,101,200.000 | |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 8,300 | 1,862,000.000 | 15,454,600,000.000 | |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD | 20,301 | 10,500.000 | 213,160,500.000 | |
| HANWHA TECHWIN CO LTD | 3,141 | 46,400.000 | 145,742,400.000 | |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD | 1,475 | 1,477,000.000 | 2,178,575,000.000 | |
| SHINSEGAE CO LTD | 669 | 168,000.000 | 112,392,000.000 | |
| HYOSUNG CORP | 1,781 | 138,500.000 | 246,668,500.000 | |
| ORION CORP | 299 | 620,000.000 | 185,380,000.000 | |
| YUHAN CORP | 733 | 200,500.000 | 146,966,500.000 | |
| HANON SYSTEMS | 16,104 | 9,540.000 | 153,632,160.000 | |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD | 5,281 | 31,050.000 | 163,975,050.000 | |
| GS HOLDINGS CORP | 4,295 | 52,600.000 | 225,917,000.000 | |
| LG DISPLAY CO LTD | 19,437 | 31,600.000 | 614,209,200.000 | |
| SK NETWORKS CO LTD | 10,280 | 6,790.000 | 69,801,200.000 | |
| CELLTRION INC | 6,669 | 103,900.000 | 692,909,100.000 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 24,764 | 31,450.000 | 778,827,800.000 | |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 1,601 | 157,000.000 | 251,357,000.000 | |

| | | | | | |
|-----------|---|---------|-------------|---------------------------------------|--|
| | MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 6,755 | 20,500.000 | 138,477,500.000 | |
| | LOTTE SHOPPING CO | 928 | 210,000.000 | 194,880,000.000 | |
| | SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD | 5,814 | 110,500.000 | 642,447,000.000 | |
| | AMOREPACIFIC CORP | 2,682 | 293,500.000 | 787,167,000.000 | |
| | AMOREPACIFIC CORP-PREF | 752 | 186,500.000 | 140,248,000.000 | |
| | SAMSUNG CARD CO | 2,877 | 38,950.000 | 112,059,150.000 | |
| | SK INNOVATION CO LTD | 5,408 | 155,500.000 | 840,944,000.000 | |
| | CJ CHEILJEDANG CORP | 669 | 352,500.000 | 235,822,500.000 | |
| | KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD | 1,825 | 54,500.000 | 99,462,500.000 | |
| | LG INNOTEK CO LTD | 1,196 | 89,400.000 | 106,922,400.000 | |
| | SK HOLDINGS CO LTD | 3,820 | 229,500.000 | 876,690,000.000 | |
| | KB FINANCIAL GROUP INC | 33,223 | 43,250.000 | 1,436,894,750.000 | |
| | HYUNDAI WIA CORP | 1,454 | 74,100.000 | 107,741,400.000 | |
| | KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD | 5,708 | 69,700.000 | 397,847,600.000 | |
| | BNK FINANCIAL GROUP INC | 21,890 | 8,680.000 | 190,005,200.000 | |
| | HANMI PHARM CO LTD | 440 | 287,500.000 | 126,500,000.000 | |
| | HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD | 16,882 | 6,270.000 | 105,850,140.000 | |
| | O MEDIA HOLDINGS CO LTD | 1,537 | 75,000.000 | 115,275,000.000 | |
| | E-MART CO LTD | 1,648 | 183,000.000 | 301,584,000.000 | |
| | DGB FINANCIAL GROUP INC | 13,539 | 9,560.000 | 129,432,840.000 | |
| | GS RETAIL CO LTD | 2,482 | 48,000.000 | 119,136,000.000 | |
| | HANKOOK TIRE CO LTD NEW | 6,212 | 63,300.000 | 393,219,600.000 | |
| | BGF RETAIL CO LTD | 1,594 | 83,800.000 | 133,577,200.000 | |
| | SAMSUNG SDS CO LTD | 2,898 | 140,500.000 | 407,169,000.000 | |
| | WOORI BANK | 25,506 | 12,600.000 | 321,375,600.000 | |
| | SAMSUNG C&T CORP | 6,331 | 126,500.000 | 800,871,500.000 | |
| | SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 1,333 | 151,000.000 | 201,283,000.000 | |
| 韓国・ウォン 小計 | | 698,061 | | 58,402,668,640.000 (5,659,218,590) | |
| 香港・ドル | JIANGXI COPPER CO LTD | 100,000 | 11.440 | 1,144,000.000 | |
| | JIANGSU EXPRESS | 102,000 | 9.850 | 1,004,700.000 | |
| | CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD | 162,000 | 4.450 | 720,900.000 | |
| | CHINA MOBILE LIMITED | 513,500 | 84.100 | 43,185,350.000 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD | 104,500 | 22.150 | 2,314,675.000 | |
| | BEIJING ENTERPRISES | 42,000 | 37.650 | 1,581,300.000 | |
| | HUANENG POWER INTERNATIONAL IN | 358,000 | 5.030 | 1,800,740.000 | |
| | ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY | 276,000 | 3.850 | 1,062,600.000 | |
| | YANZHOU COAL MINING CO LTD | 158,000 | 5.460 | 862,680.000 | |

| | | | | |
|---|-----------|--------|----------------|--|
| HENGAN INTERNATIONAL GROUP | 60,500 | 59.800 | 3,617,900.000 | |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE | 67,020 | 11.030 | 739,230.600 | |
| CNOOC LTD | 1,478,000 | 9.730 | 14,380,940.000 | |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 250,000 | 11.060 | 2,765,000.000 | |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 354,000 | 8.260 | 2,924,040.000 | |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME | 321,120 | 22.000 | 7,064,640.000 | |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 230,888 | 18.500 | 4,271,428.000 | |
| CITIC LTD | 363,000 | 11.380 | 4,130,940.000 | |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL | 126,000 | 7.600 | 957,600.000 | |
| LENOVO GROUP LTD | 602,000 | 5.010 | 3,016,020.000 | |
| PETRO CHINA CO LTD | 1,758,000 | 6.180 | 10,864,440.000 | |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD | 496,742 | 9.100 | 4,520,352.200 | |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD | 136,790 | 16.500 | 2,257,035.000 | |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR | 2,129,200 | 5.900 | 12,562,280.000 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 77,000 | 16.720 | 1,287,440.000 | |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 62,000 | 35.200 | 2,182,400.000 | |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD | 268,000 | 6.000 | 1,608,000.000 | |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 130,000 | 7.820 | 1,016,600.000 | |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD | 108,000 | 20.350 | 2,197,800.000 | |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD | 326,000 | 3.280 | 1,069,280.000 | |
| CHINA EVERBRIGHT LTD | 78,000 | 14.800 | 1,154,400.000 | |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 144,000 | 11.160 | 1,607,040.000 | |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD | 440,000 | 8.270 | 3,638,800.000 | |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | 74,000 | 24.050 | 1,779,700.000 | |
| BYD CO LTD | 53,000 | 42.500 | 2,252,500.000 | |
| CHINA TELECOM CORP LTD | 1,156,000 | 3.690 | 4,265,640.000 | |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD | 146,000 | 7.620 | 1,112,520.000 | |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 950,000 | 1.250 | 1,187,500.000 | |
| SINOTRANS LTD | 147,000 | 3.490 | 513,030.000 | |
| CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL | 208,000 | 8.950 | 1,861,600.000 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 383,192 | 12.200 | 4,674,942.400 | |

| | | | | |
|---|-----------|---------|----------------|--|
| AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY | 164,000 | 5.410 | 887,240.000 | |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS | 161,200 | 12.700 | 2,047,240.000 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD | 260,000 | 7.590 | 1,973,400.000 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 621,000 | 21.100 | 13,103,100.000 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | 583,000 | 2.590 | 1,509,970.000 | |
| SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H | 160,000 | 5.280 | 844,800.000 | |
| SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 230,700 | 11.200 | 2,583,840.000 | |
| WEICHAİ POWER CO LTD | 84,720 | 13.260 | 1,123,387.200 | |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL | 297,000 | 4.430 | 1,315,710.000 | |
| SHANGHAI INDUSTRIAL | 41,000 | 21.250 | 871,250.000 | |
| TINGYI HOLDING CORP | 164,000 | 8.940 | 1,466,160.000 | |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD | 30,000 | 29.050 | 871,500.000 | |
| GUANGDONG INVESTMENTS LTD | 238,000 | 10.580 | 2,518,040.000 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS | 137,333 | 15.520 | 2,131,408.160 | |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD | 116,000 | 7.520 | 872,320.000 | |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 373,000 | 5.580 | 2,081,340.000 | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 230,000 | 14.780 | 3,399,400.000 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 475,400 | 198.000 | 94,129,200.000 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 436,000 | 39.800 | 17,352,800.000 | |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD | 366,000 | 5.040 | 1,844,640.000 | |
| GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS LTD | 970,240 | 0.930 | 902,323.200 | |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 272,000 | 2.840 | 772,480.000 | |
| AIR CHINA / HONG KONG | 162,000 | 5.180 | 839,160.000 | |
| ZTE CORP | 58,488 | 12.460 | 728,760.480 | |
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD | 250,000 | 3.650 | 912,500.000 | |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | 283,000 | 15.620 | 4,420,460.000 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS | 725,205 | 5.720 | 4,148,172.600 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD | 146,000 | 11.500 | 1,679,000.000 | |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 61,500 | 75.000 | 4,612,500.000 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK | 7,032,530 | 5.900 | 41,491,927.000 | |

| | | | | |
|---|-----------|--------|----------------|--|
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD | 47,000 | 48.000 | 2,256,000.000 | |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 228,000 | 7.710 | 1,757,880.000 | |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD | 141,000 | 7.700 | 1,085,700.000 | |
| CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL | 238,000 | 3.910 | 930,580.000 | |
| BANK OF CHINA LTD | 6,641,200 | 3.510 | 23,310,612.000 | |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 102,000 | 10.380 | 1,058,760.000 | |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD | 84,400 | 9.790 | 826,276.000 | |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 324,970 | 18.760 | 6,096,437.200 | |
| IND & COMM BK OF CHINA - H | 6,165,235 | 4.710 | 29,038,256.850 | |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES | 199,600 | 5.490 | 1,095,804.000 | |
| CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD | 370,000 | 9.210 | 3,407,700.000 | |
| CHINA COAL ENERGY CO | 162,000 | 3.830 | 620,460.000 | |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 54,000 | 15.880 | 857,520.000 | |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD | 45,500 | 40.950 | 1,863,225.000 | |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD | 105,000 | 13.840 | 1,453,200.000 | |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD | 489,142 | 4.300 | 2,103,310.600 | |
| CHINA CITIC BANK-H | 743,800 | 5.140 | 3,823,132.000 | |
| BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 527,000 | 4.630 | 2,440,010.000 | |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 60,000 | 40.000 | 2,400,000.000 | |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 85,000 | 23.150 | 1,967,750.000 | |
| FOSUN INTERNATIONAL | 215,528 | 11.140 | 2,400,981.920 | |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD | 316,000 | 2.240 | 707,840.000 | |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 249,500 | 3.460 | 863,270.000 | |
| SOHO CHINA LTD | 178,000 | 3.930 | 699,540.000 | |
| KINGSOFT CORP LTD | 65,000 | 16.600 | 1,079,000.000 | |
| GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 1,096,000 | 0.960 | 1,052,160.000 | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | 343,000 | 6.550 | 2,246,650.000 | |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP | 161,000 | 10.260 | 1,651,860.000 | |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 478,000 | 5.010 | 2,394,780.000 | |

| | | | | |
|--|-----------|--------|---------------|--|
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 219,600 | 27.700 | 6,082,920.000 | |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 349,000 | 5.210 | 1,818,290.000 | |
| CRRC CORP LTD - H | 354,450 | 7.270 | 2,576,851.500 | |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD | 104,000 | 12.540 | 1,304,160.000 | |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 200,500 | 7.850 | 1,573,925.000 | |
| SINOPHARM GROUP CO | 99,600 | 35.250 | 3,510,900.000 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD | 177,805 | 10.220 | 1,817,167.100 | |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK | 212,000 | 4.620 | 979,440.000 | |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP | 266,000 | 6.430 | 1,710,380.000 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD | 56,800 | 19.680 | 1,117,824.000 | |
| HUANENG RENEWABLES CORP LTD | 342,000 | 2.640 | 902,880.000 | |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 163,000 | 6.990 | 1,139,370.000 | |
| LONGFOR PROPERTIES CO LTD | 126,500 | 10.440 | 1,320,660.000 | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 64,600 | 37.150 | 2,399,890.000 | |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 491,380 | 8.410 | 4,132,505.800 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 257,000 | 3.660 | 940,620.000 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA | 2,049,000 | 3.270 | 6,700,230.000 | |
| FAR EAST HORIZON LTD | 166,000 | 6.780 | 1,125,480.000 | |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 181,000 | 16.140 | 2,921,340.000 | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 257,200 | 13.880 | 3,569,936.000 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD | 585,000 | 3.080 | 1,801,800.000 | |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 33,500 | 24.000 | 804,000.000 | |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD | 94,500 | 6.330 | 598,185.000 | |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD | 253,000 | 7.280 | 1,841,840.000 | |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP | 986,000 | 3.910 | 3,855,260.000 | |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD | 323,000 | 2.900 | 936,700.000 | |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD | 745,000 | 2.770 | 2,063,650.000 | |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD | 113,000 | 13.820 | 1,561,660.000 | |

| | | | | | |
|----------|---|------------|---------|------------------------------------|--|
| | CHINA VANKE CO LTD-H | 112,561 | 18.420 | 2,073,373.620 | |
| | CGN POWER CO LTD | 892,000 | 2.170 | 1,935,640.000 | |
| | FULLSHARE HOLDINGS LTD | 575,000 | 3.410 | 1,960,750.000 | |
| | GF SECURITIES CO LTD | 118,200 | 16.560 | 1,957,392.000 | |
| | FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | 40,400 | 23.700 | 957,480.000 | |
| | HUATAI SECURITIES CO LTD | 122,200 | 15.300 | 1,869,660.000 | |
| | 3SBIO INC | 90,000 | 7.760 | 698,400.000 | |
| | CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD | 430,000 | 2.820 | 1,212,600.000 | |
| | HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD | 1,840,000 | 0.385 | 708,400.000 | |
| 香港・ドル 小計 | | 63,474,439 | | 550,562,267.430 (8,230,905,898) | |
| 台湾・ドル | ACER INC | 235,532 | 13.300 | 3,132,575.600 | |
| | ASUSTEK COMPUTER INC | 58,554 | 270.500 | 15,838,857.000 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 37,616 | 101.500 | 3,818,024.000 | |
| | ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC | 528,729 | 34.400 | 18,188,277.600 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 197,928 | 26.200 | 5,185,713.600 | |
| | TAIWAN BUSINESS BANK | 326,380 | 8.160 | 2,663,260.800 | |
| | TAIWAN FERTILIZER CO LTD | 58,000 | 40.450 | 2,346,100.000 | |
| | VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP | 78,000 | 56.300 | 4,391,400.000 | |
| | MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD | 57,000 | 76.700 | 4,371,900.000 | |
| | CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 46,312 | 73.600 | 3,408,563.200 | |
| | QUANTA COMPUTER INC | 224,858 | 61.500 | 13,828,767.000 | |
| | HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 63,070 | 45.900 | 2,894,913.000 | |
| | EVA AIRWAYS CORP | 153,555 | 14.850 | 2,280,291.750 | |
| | CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 53,760 | 223.000 | 11,988,480.000 | |
| | CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 411,196 | 17.150 | 7,052,011.400 | |
| | CHINA AIRLINES | 232,156 | 9.380 | 2,177,623.280 | |
| | CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO | 162,169 | 62.300 | 10,103,128.700 | |
| | CHINA STEEL CORP | 977,058 | 24.550 | 23,986,773.900 | |
| | CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN | 292,162 | 31.750 | 9,276,143.500 | |
| | ADVANTECH CO LTD | 26,264 | 257.000 | 6,749,848.000 | |
| | COMPAL ELECTRONICS INC | 354,304 | 18.700 | 6,625,484.800 | |
| | DELTA ELECTRONICS INC | 161,663 | 160.500 | 25,946,911.500 | |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 57,000 | 47.750 | 2,721,750.000 | |
| | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 316,327 | 102.000 | 32,265,354.000 | |
| | AU OPTRONICS CORP | 731,194 | 12.800 | 9,359,283.200 | |

| | | | | |
|---------------------------------------|-----------|-----------|-----------------|--|
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 140,800 | 105.500 | 14,854,400.000 | |
| EVERGREEN MARINE CORP | 160,392 | 12.000 | 1,924,704.000 | |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 268,824 | 24.650 | 6,626,511.600 | |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 29,825 | 130.000 | 3,877,250.000 | |
| ECLAT TEXTILE CO LTD | 15,022 | 330.000 | 4,957,260.000 | |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 47,285 | 110.000 | 5,201,350.000 | |
| FORMOSA PLASTICS CORP | 342,633 | 89.500 | 30,665,653.500 | |
| FORMOSA TAFFETA CO LTD | 70,000 | 30.100 | 2,107,000.000 | |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO | 267,594 | 95.600 | 25,581,986.400 | |
| TRANSCEND INFORMATION INC | 12,897 | 86.700 | 1,118,169.900 | |
| GIANT MANUFACTURING | 23,151 | 196.000 | 4,537,596.000 | |
| MEDIATEK INC | 124,507 | 214.500 | 26,706,751.500 | |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | 557,936 | 52.000 | 29,012,672.000 | |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 621,632 | 16.450 | 10,225,846.400 | |
| HOTAI MOTOR CO LTD | 21,000 | 366.000 | 7,686,000.000 | |
| FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD | 134,000 | 73.100 | 9,795,400.000 | |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 833,141 | 12.050 | 10,039,349.050 | |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 679,920 | 49.200 | 33,452,064.000 | |
| CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING | 1,129,403 | 8.020 | 9,057,812.060 | |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD | 665,240 | 18.250 | 12,140,630.000 | |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 1,294,532 | 84.000 | 108,740,688.000 | |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 906,495 | 23.600 | 21,393,282.000 | |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 8,220 | 4,135.000 | 33,989,700.000 | |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 733,748 | 11.750 | 8,621,539.000 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO | 694,724 | 7.850 | 5,453,583.400 | |
| INVENTEC CO LTD | 207,005 | 23.450 | 4,854,267.250 | |
| HTC CORPORATION | 56,832 | 78.600 | 4,466,995.200 | |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 178,845 | 48.700 | 8,709,751.500 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 857,332 | 9.090 | 7,793,147.880 | |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,466,048 | 18.000 | 26,388,864.000 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|------------|---------|--------------------------------------|--|
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD | 820,282 | 17.400 | 14,272,906.800 | |
| MERIDA INDUSTRY CO LTD | 16,950 | 163.500 | 2,771,325.000 | |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC | 55,560 | 85.600 | 4,755,936.000 | |
| NAN YA PLASTICS CORP | 392,828 | 73.100 | 28,715,726.800 | |
| WISTRON CORP | 209,110 | 24.850 | 5,196,383.500 | |
| POU CHEN CORP | 188,990 | 39.800 | 7,521,802.000 | |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP | 406,297 | 53.700 | 21,818,148.900 | |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 47,392 | 228.500 | 10,829,072.000 | |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 93,480 | 108.500 | 10,142,580.000 | |
| PHISON ELECTRONICS CORP | 13,658 | 246.500 | 3,366,697.000 | |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 75,547 | 37.600 | 2,840,567.200 | |
| RUENTEX INDUSTRIES LTD | 45,715 | 57.800 | 2,642,327.000 | |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 76,588 | 85.500 | 6,548,274.000 | |
| SILICONWARE PRECISION INDS | 184,743 | 47.500 | 8,775,292.500 | |
| STANDARD FOODS CORP | 35,653 | 75.300 | 2,684,670.900 | |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP | 114,899 | 32.250 | 3,705,492.750 | |
| TAIWAN CEMENT CORP | 278,874 | 34.950 | 9,746,646.300 | |
| TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD | 156,000 | 27.850 | 4,344,600.000 | |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR | 2,061,083 | 184.000 | 379,239,272.000 | |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 1,003,525 | 11.650 | 11,691,066.250 | |
| YULON MOTOR CO | 65,149 | 26.900 | 1,752,508.100 | |
| INNOLUX CORPORATION | 750,345 | 12.800 | 9,604,416.000 | |
| WPG HOLDINGS CO LTD | 122,526 | 37.750 | 4,625,356.500 | |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 17,216 | 153.000 | 2,634,048.000 | |
| TAI MED BIOLOGICS INC | 13,000 | 165.000 | 2,145,000.000 | |
| PEGATRON CORP | 161,554 | 78.800 | 12,730,455.200 | |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 90,076 | 55.400 | 4,990,210.400 | |
| ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD | 188,000 | 10.300 | 1,936,400.000 | |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD | 34,385 | 64.500 | 2,217,832.500 | |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING | 643,523 | 14.200 | 9,138,026.600 | |
| OBI PHARMA INC | 9,000 | 294.500 | 2,650,500.000 | |
| CASETEK HOLDINGS LTD | 12,000 | 86.500 | 1,038,000.000 | |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 12,000 | 294.500 | 3,534,000.000 | |
| 台湾・ドル 小計 | 26,785,718 | | 1,311,187,200.670 (4,759,609,539) | |

| | | | | | |
|-----------|-------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| 南アフリカ・ランド | AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD | 112,536 | 0.310 | 34,886.160 | |
| | BIDVEST GROUP LTD | 26,558 | 175.000 | 4,647,650.000 | |
| | TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD | 36,673 | 75.600 | 2,772,478.800 | |
| | DISCOVERY LTD | 29,704 | 115.930 | 3,443,584.720 | |
| | REDEFINE PROPERTIES LTD | 380,354 | 11.300 | 4,298,000.200 | |
| | MASSMART HOLDINGS LTD | 7,992 | 122.000 | 975,024.000 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 78,154 | 45.700 | 3,571,637.800 | |
| | REMGRO LTD | 44,102 | 225.710 | 9,954,262.420 | |
| | THE FOSCHINI GROUP LTD | 17,301 | 153.680 | 2,658,817.680 | |
| | MMI HOLDINGS LTD | 82,706 | 24.490 | 2,025,469.940 | |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 174,607 | 26.280 | 4,588,671.960 | |
| | EXXARO RESOURCES LTD | 12,410 | 90.600 | 1,124,346.000 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 3,184 | 700.000 | 2,228,800.000 | |
| | LIBERTY HOLDINGS LTD | 8,524 | 114.450 | 975,571.800 | |
| | MTN GROUP LTD | 138,399 | 133.900 | 18,531,626.100 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 36,536 | 159.750 | 5,836,626.000 | |
| | TELKOM SA SOC LTD | 20,227 | 75.100 | 1,519,047.700 | |
| | FIRSTRAND LTD | 280,495 | 53.360 | 14,967,213.200 | |
| | PSG GROUP LTD | 8,154 | 221.760 | 1,808,231.040 | |
| | NASPERS LTD | 36,630 | 2,160.530 | 79,140,213.900 | |
| | CORONATION FUND MANAGERS LTD | 19,000 | 67.400 | 1,280,600.000 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 16,321 | 239.370 | 3,906,757.770 | |
| | NETCARE LTD | 77,025 | 32.100 | 2,472,502.500 | |
| | PICK'N PAY STORES LTD | 30,212 | 65.500 | 1,978,886.000 | |
| | RMB HOLDINGS LTD | 59,473 | 67.500 | 4,014,427.500 | |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 5,251 | 292.520 | 1,536,022.520 | |
| | SAPPI LTD | 45,540 | 88.100 | 4,012,074.000 | |
| | SASOL LTD | 46,142 | 404.110 | 18,646,443.620 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 35,731 | 168.140 | 6,007,810.340 | |
| | MR PRICE GROUP LTD | 20,254 | 152.050 | 3,079,620.700 | |
| | BRAIT SE | 28,931 | 79.350 | 2,295,674.850 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 107,593 | 150.640 | 16,207,809.520 | |
| | SPAR GROUP LTD/THE | 16,006 | 196.120 | 3,139,096.720 | |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 82,538 | 66.200 | 5,464,015.600 | |
| | IMPERIAL HOLDINGS LTD | 13,278 | 183.150 | 2,431,865.700 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | 30,426 | 276.500 | 8,412,789.000 | |
| | BARCLAYS AFRICA GROUP LTD | 35,478 | 167.320 | 5,936,178.960 | |
| | TIGER BRANDS LTD | 13,642 | 399.000 | 5,443,158.000 | |
| | SANLAM LTD | 116,489 | 65.700 | 7,653,327.300 | |
| | INVESTEC LTD | 21,436 | 90.750 | 1,945,317.000 | |

| | | | | |
|-------------------------------------|-------------|---------|------------------------------------|--|
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 57,577 | 47.520 | 2,736,059.040 | |
| PIONEER FOODS LTD | 10,707 | 155.600 | 1,666,009.200 | |
| NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENTS PLC | 20,406 | 159.000 | 3,244,554.000 | |
| MONDI LTD | 9,944 | 275.450 | 2,739,074.800 | |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD | 79,370 | 33.170 | 2,632,702.900 | |
| RMI HOLDINGS | 52,887 | 39.790 | 2,104,373.730 | |
| TSOGO SUN HOLDINGS LTD | 32,270 | 26.920 | 868,708.400 | |
| VODACOM GROUP PTY LTD | 30,522 | 152.550 | 4,656,131.100 | |
| SIBANYE GOLD LTD | 72,004 | 27.080 | 1,949,868.320 | |
| FORTRESS INCOME FUND LTD-A | 78,947 | 17.290 | 1,364,993.630 | |
| FORTRESS INCOME FUND LTD | 65,113 | 33.100 | 2,155,240.300 | |
| STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV | 248,033 | 67.650 | 16,779,432.450 | |
| BID CORP LTD | 27,891 | 239.390 | 6,676,826.490 | |
| 南アフリカ・ランド 小計 | 3,141,683 | | 320,540,511.380 (2,705,361,915) | |
| 合計 | 184,493,542 | | 38,892,263,440 (38,892,263,440) | |

(2) 株式以外の有価証券

平成29年1月11日現在

| 種 類 | 通 貨 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-------------|-----------|--------------------------------------|---------------|---------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | メキシコ・ペソ | CEMEX SAB DE CV | 1,171,911.000 | 19,817,015.010 | |
| | | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | 153,100.000 | 24,835,882.000 | |
| | メキシコ・ペソ | 小計 | 1,325,011.000 | 44,652,897.010 (237,553,412) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | 1,325,011 | 237,553,412 (237,553,412) | |
| 投資証券 | トルコ・リラ | EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM | 162,734.000 | 483,319.980 | |
| | トルコ・リラ | 小計 | 162,734.000 | 483,319.980 (14,712,260) | |
| | メキシコ・ペソ | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 216,100.000 | 6,247,451.000 | |
| | メキシコ・ペソ | 小計 | 216,100.000 | 6,247,451.000 (33,236,439) | |
| | 南アフリカ・ランド | HYPROP INVESTMENTS LTD | 20,836.000 | 2,521,364.360 | |
| | | RESILIENT REIT LTD | 24,659.000 | 2,860,690.590 | |
| | 南アフリカ・ランド | 小計 | 45,495.000 | 5,382,054.950 (45,424,544) | |
| 投資証券 合計 | | | 424,329 | 93,373,243 (93,373,243) | |
| 合計 | | | | 330,926,655 (330,926,655) | |

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 38銘柄 | 10.60% | -% | -% | 11.16% |
| アラブ首長国連邦・ディ ルハム | 株式 9銘柄 | 0.76% | -% | -% | 0.80% |
| インド・ルピー | 株式 76銘柄 | 7.84% | -% | -% | 8.25% |
| インドネシア・ルピア | 株式 31銘柄 | 2.47% | -% | -% | 2.61% |
| カタール・リアル | 株式 13銘柄 | 0.85% | -% | -% | 0.89% |
| コロンビア・ペソ | 株式 9銘柄 | 0.43% | -% | -% | 0.45% |
| タイ・バーツ | 株式 37銘柄 | 2.21% | -% | -% | 2.33% |
| チェコ・コルナ | 株式 4銘柄 | 0.17% | -% | -% | 0.18% |
| チリ・ペソ | 株式 19銘柄 | 1.12% | -% | -% | 1.17% |
| トルコ・リラ | 株式 23銘柄 投資証券 1銘柄 | 0.84% -% | -% -% | -% 0.04% | 0.93% |
| ハンガリー・フォリント | 株式 3銘柄 | 0.31% | -% | -% | 0.32% |
| フィリピン・ペソ | 株式 23銘柄 | 1.21% | -% | -% | 1.27% |
| ブラジル・レアル | 株式 58銘柄 | 7.48% | -% | -% | 7.87% |
| ポーランド・ズロチ | 株式 22銘柄 | 1.12% | -% | -% | 1.18% |
| マレーシア・リンギット | 株式 43銘柄 | 2.37% | -% | -% | 2.50% |
| メキシコ・ペソ | 株式 24銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄 | 2.48% -% -% | -% 0.58% -% | -% -% 0.08% | 3.30% |
| ユーロ | 株式 9銘柄 | 0.21% | -% | -% | 0.22% |
| 韓国・ウォン | 株式 108銘柄 | 13.70% | -% | -% | 14.43% |
| 香港・ドル | 株式 136銘柄 | 19.93% | -% | -% | 20.98% |
| 台湾・ドル | 株式 88銘柄 | 11.52% | -% | -% | 12.13% |
| 南アフリカ・ランド | 株式 53銘柄 投資証券 2銘柄 | 6.55% -% | -% -% | -% 0.11% | 7.01% |

(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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 1,340,658,664 | 1,392,947,346 |
| コール・ローン | | 2,447,769,702 | 40,367,352 |
| 国債証券 | | 50,188,470,405 | 59,705,345,865 |
| 派生商品評価勘定 | | - | 15,050 |
| 未収入金 | | - | 799,207,916 |
| 未収利息 | | 675,837,437 | 889,379,035 |
| 前払費用 | | 134,809,696 | 212,084,575 |
| 流動資産合計 | | 54,787,545,904 | 63,039,347,139 |
| 資産合計 | | 54,787,545,904 | 63,039,347,139 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 3,589,660 | - |
| 未払金 | | 3,088,785,435 | 449,924,800 |
| 未払解約金 | | 6,374,000 | 8,724,000 |
| 流動負債合計 | | 3,098,749,095 | 458,648,800 |
| 負債合計 | | 3,098,749,095 | 458,648,800 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 30,853,888,560 | 34,034,697,085 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 20,834,908,249 | 28,546,001,254 |
| 元本等合計 | | 51,688,796,809 | 62,580,698,339 |
| 純資産合計 | | 51,688,796,809 | 62,580,698,339 |
| 負債純資産合計 | | 54,787,545,904 | 63,039,347,139 |

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 | <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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--|-----------------|-----------------|
| 1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 | 32,117,451,125円 | 30,853,888,560円 |
| 同期中追加設定元本額 | 15,576,655,407円 | 14,679,295,389円 |
| 同期中一部解約元本額 | 16,840,217,972円 | 11,498,486,864円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ） | 94,766,105円 | 107,754,586円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | 66,007,340円 | 62,904,586円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10） | 16,757,240円 | 21,415,594円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20） | 46,563,531円 | 56,453,241円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30） | 101,573,970円 | 127,202,886円 |
| 投資のソムリエ | 2,864,387,945円 | 2,270,942,339円 |
| クルーズコントロール | 187,812,398円 | 1,232,756,282円 |
| 投資のソムリエ<D C年金> | 66,121,012円 | 67,005,956円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN<D C年金> | 58,760,088円 | 68,279,113円 |
| クルーズコントロール<D C年金> | 50,590円 | 484,717円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型） | 1,431,372円 | 9,088,948円 |

| | | |
|--|-----------------|----------------------|
| D I A Mコア資産設計ファンド （積極型） | 2,489,686円 | 20,186,811円 |
| 投資のソムリエ＜D C 年金＞リ スク抑制型 | 12,547,457円 | 5,239,965円 |
| ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界 8 資産バランス ファンド | 352,463円 - 円 | 161,183円 113,191円 |
| エマージング債券リスク抑制型 （適格機関投資家限定） | 3,120,641,050円 | 6,452,299,432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） | 503,111,358円 | - 円 |
| エマージング債券パッシブファ ンドV A（適格機関投資家専 用） | 3,663,571,532円 | 3,492,792,856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） | 8,223,044,392円 | 7,824,353,289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） | 5,179,610,606円 | 4,959,932,756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） | 3,037,431,770円 | 2,913,975,455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） | 3,606,856,655円 | 4,341,353,899円 |
| 計 | 30,853,888,560円 | 34,034,697,085円 |
| 2 . 受益権の総数 | 30,853,888,560口 | 34,034,697,085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28年1月13日 至 平成28年7月11日 | 自 平成28年7月12日 至 平成29年1月11日 |
|--------------------------|--|------------------------------|
| 1． 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3． 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|----------------------------|--|--------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） | 当期の 損益に含まれた 評価差額（円） |
| 国債証券 | 1,609,994,841 | 2,083,575,977 |
| 合計 | 1,609,994,841 | 2,083,575,977 |

（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28年4月19日から平成28年7月11日まで及び平成28年4月19日から平成29年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

| 種類 | 平成28年7月11日 現在 | | | | 平成29年1月11日 現在 | | | |
|-----------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
| | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） | 契約額等 （円） | うち 1年超 | 時価 （円） | 評価損益 （円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売 建 | - | - | - | - | 498,600,050 | - | 498,585,000 | 15,050 |
| アメリカ・ドル | - | - | - | - | 498,600,050 | - | 498,585,000 | 15,050 |
| 買 建 | 3,098,149,660 | - | 3,094,560,000 | 3,589,660 | - | - | - | - |
| アメリカ・ドル | 3,098,149,660 | - | 3,094,560,000 | 3,589,660 | - | - | - | - |
| 合計 | 3,098,149,660 | - | 3,094,560,000 | 3,589,660 | 498,600,050 | - | 498,585,000 | 15,050 |

（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28年7月11日現在 | 平成29年1月11日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.6753円 | 1.8387円 |
| （1万口当たり純資産額） | （16,753円） | （18,387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29年1月11日現在

| 種 類 | 通 貨 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------|------------------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | BRAZIL 2.625 01/05/23 | 5,000,000.000 | 4,505,000.000 | |
| | | BRAZIL 4.25 01/07/25 | 9,100,000.000 | 8,688,225.000 | |
| | | BRAZIL 4.875 01/22/21 | 4,400,000.000 | 4,583,480.000 | |
| | | BRAZIL 5.0 01/27/45 | 6,600,000.000 | 5,610,000.000 | |
| | | BRAZIL 5.625 01/07/41 | 4,700,000.000 | 4,371,000.000 | |
| | | BRAZIL 5.875 01/15/19 | 6,100,000.000 | 6,551,400.000 | |
| | | BRAZIL 6.0 04/07/26 | 2,800,000.000 | 2,971,500.000 | |
| | | BRAZIL 7.125 01/20/37 | 4,300,000.000 | 4,730,000.000 | |
| | | BRAZIL 8.25 01/20/34 | 2,800,000.000 | 3,367,280.000 | |
| | | BRAZIL 8.75 02/04/25 | 1,200,000.000 | 1,494,600.000 | |
| | | BRAZIL 8.875 04/15/24 | 1,600,000.000 | 1,966,400.000 | |
| | | BRAZIL 8.875 10/14/19 | 1,200,000.000 | 1,398,000.000 | |
| | | COLOMBIA 2.625 03/15/23 | 1,700,000.000 | 1,617,550.000 | |
| | | COLOMBIA 4.0 02/26/24 | 4,300,000.000 | 4,392,450.000 | |
| | | COLOMBIA 4.375 07/12/21 | 4,000,000.000 | 4,216,000.000 | |
| | | COLOMBIA 4.5 01/28/26 | 2,600,000.000 | 2,725,450.000 | |
| | | COLOMBIA 5.0 06/15/45 | 5,200,000.000 | 5,158,400.000 | |
| | | COLOMBIA 5.625 02/26/44 | 5,200,000.000 | 5,564,000.000 | |
| | | COLOMBIA 6.125 01/18/41 | 4,800,000.000 | 5,364,000.000 | |
| | | COLOMBIA 7.375 03/18/19 | 5,100,000.000 | 5,674,209.000 | |
| | | COLOMBIA 7.375 09/18/37 | 3,400,000.000 | 4,241,500.000 | |
| | | COLOMBIA 8.125 05/21/24 | 2,100,000.000 | 2,638,650.000 | |
| | | CROATIA 5.5 04/04/23 | 2,600,000.000 | 2,806,362.000 | |
| | | CROATIA 6.0 01/26/24 | 3,000,000.000 | 3,327,810.000 | |
| | | CROATIA 6.375 03/24/21 | 2,700,000.000 | 2,972,565.000 | |
| | | CROATIA 6.625 07/14/20 | 2,800,000.000 | 3,078,824.000 | |
| | | CROATIA 6.75 11/05/19 | 3,600,000.000 | 3,936,996.000 | |
| | | HUNGARY 4.0 03/25/19 | 1,200,000.000 | 1,247,712.000 | |
| | | HUNGARY 4.125 02/19/18 | 2,300,000.000 | 2,359,156.000 | |
| | | HUNGARY 5.375 02/21/23 | 3,900,000.000 | 4,310,904.000 | |
| | | HUNGARY 5.375 03/25/24 | 3,200,000.000 | 3,566,624.000 | |
| | | HUNGARY 5.75 11/22/23 | 3,200,000.000 | 3,627,136.000 | |
| | | HUNGARY 6.25 01/29/20 | 3,500,000.000 | 3,860,640.000 | |
| | | HUNGARY 6.375 03/29/21 | 5,800,000.000 | 6,566,470.000 | |
| | | HUNGARY 7.625 03/29/41 | 2,200,000.000 | 3,185,248.000 | |
| | | INDONESIA 11.625 03/04/19 | 3,200,000.000 | 3,832,704.000 | |
| | | INDONESIA 3.375 04/15/23 | 2,300,000.000 | 2,267,731.000 | |
| | | INDONESIA 3.75 04/25/22 | 2,200,000.000 | 2,234,848.000 | |
| | | INDONESIA 4.125 01/15/25 | 3,200,000.000 | 3,248,896.000 | |

| | | | |
|-------------------------------------|----------------|----------------|--|
| INDONESIA 4.625 04/15/43 | 2,200,000.000 | 2,209,174.000 | |
| INDONESIA 4.75 01/08/26 | 4,000,000.000 | 4,208,760.000 | |
| INDONESIA 4.875 05/05/21 | 5,100,000.000 | 5,436,549.000 | |
| INDONESIA 5.125 01/15/45 | 3,400,000.000 | 3,504,278.000 | |
| INDONESIA 5.25 01/17/42 | 3,700,000.000 | 3,847,223.000 | |
| INDONESIA 5.375 10/17/23 | 1,700,000.000 | 1,861,347.000 | |
| INDONESIA 5.875 01/15/24 | 2,800,000.000 | 3,141,684.000 | |
| INDONESIA 5.875 03/13/20 | 2,100,000.000 | 2,304,666.000 | |
| INDONESIA 5.95 01/08/46 | 2,000,000.000 | 2,281,460.000 | |
| INDONESIA 6.75 01/15/44 | 3,500,000.000 | 4,351,340.000 | |
| INDONESIA 7.75 01/17/38 | 3,100,000.000 | 4,126,441.000 | |
| PANAMA 3.75 03/16/25 | 3,000,000.000 | 3,033,750.000 | |
| PANAMA 3.875 03/17/28 | 2,400,000.000 | 2,408,400.000 | |
| PANAMA 5.2 01/30/20 | 5,000,000.000 | 5,393,750.000 | |
| PANAMA 6.7 01/26/36 | 5,600,000.000 | 6,907,040.000 | |
| PANAMA 7.125 01/29/26 | 2,600,000.000 | 3,269,500.000 | |
| PANAMA 9.375 04/01/29 | 2,300,000.000 | 3,312,000.000 | |
| PERU 5.625 11/18/50 | 6,400,000.000 | 7,473,920.000 | |
| PERU 6.55 03/14/37 | 3,200,000.000 | 4,073,280.000 | |
| PERU 7.35 07/21/25 | 4,800,000.000 | 6,158,400.000 | |
| PERU 8.75 11/21/33 | 5,500,000.000 | 8,207,100.000 | |
| PHILIPPINES 3.7 03/01/41 | 3,200,000.000 | 3,208,000.000 | |
| PHILIPPINES 3.95 01/20/40 | 3,600,000.000 | 3,720,384.000 | |
| PHILIPPINES 4.0 01/15/21 | 3,200,000.000 | 3,436,800.000 | |
| PHILIPPINES 4.2 01/21/24 | 1,800,000.000 | 1,965,402.000 | |
| PHILIPPINES 5.0 01/13/37 | 2,400,000.000 | 2,830,272.000 | |
| PHILIPPINES 5.5 03/30/26 | 2,000,000.000 | 2,415,640.000 | |
| PHILIPPINES 6.375 01/15/32 | 2,000,000.000 | 2,648,580.000 | |
| PHILIPPINES 6.375 10/23/34 | 3,600,000.000 | 4,867,776.000 | |
| PHILIPPINES 6.5 01/20/20 | 800,000.000 | 911,504.000 | |
| PHILIPPINES 7.75 01/14/31 | 3,500,000.000 | 5,108,495.000 | |
| PHILIPPINES 8.375 06/17/19 | 2,300,000.000 | 2,675,590.000 | |
| PHILIPPINES 9.5 02/02/30 | 3,400,000.000 | 5,508,884.000 | |
| PHILIPPINES 9.875 01/15/19 | 2,500,000.000 | 2,912,400.000 | |
| ROMANIA 4.375 08/22/23 | 2,400,000.000 | 2,507,088.000 | |
| ROMANIA 4.875 01/22/24 | 2,200,000.000 | 2,368,146.000 | |
| ROMANIA 6.125 01/22/44 | 2,000,000.000 | 2,460,240.000 | |
| ROMANIA 6.75 02/07/22 | 5,300,000.000 | 6,109,416.000 | |
| RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 | 4,800,000.000 | 5,121,888.000 | |
| RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 | 20,062,500.000 | 24,147,826.870 | |

| | | | |
|---------------------------------------|---------------|---------------|--|
| RUSSIAN FEDERATION 11.0 07/24/18 | 7,400,000.000 | 8,436,074.000 | |
| RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19 | 5,200,000.000 | 5,297,656.000 | |
| RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 | 3,400,000.000 | 3,562,996.000 | |
| RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 | 4,800,000.000 | 4,970,400.000 | |
| RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 | 6,000,000.000 | 6,396,480.000 | |
| RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 | 5,400,000.000 | 5,963,166.000 | |
| RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43 | 2,400,000.000 | 2,742,480.000 | |
| SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24 | 2,800,000.000 | 2,842,112.000 | |
| SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44 | 1,600,000.000 | 1,621,600.000 | |
| SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20 | 2,600,000.000 | 2,772,848.000 | |
| SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22 | 1,200,000.000 | 1,317,720.000 | |
| SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 | 3,400,000.000 | 3,700,322.000 | |
| SOUTH AFRICA 6.25 03/08/41 | 1,100,000.000 | 1,237,808.000 | |
| SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19 | 3,500,000.000 | 3,810,275.000 | |
| TURKEY 11.875 01/15/30 | 2,700,000.000 | 4,022,190.000 | |
| TURKEY 3.25 03/23/23 | 3,500,000.000 | 3,095,470.000 | |
| TURKEY 4.25 04/14/26 | 3,200,000.000 | 2,831,232.000 | |
| TURKEY 4.875 04/16/43 | 5,300,000.000 | 4,224,842.000 | |
| TURKEY 4.875 10/09/26 | 4,600,000.000 | 4,236,922.000 | |
| TURKEY 5.125 03/25/22 | 2,700,000.000 | 2,663,847.000 | |
| TURKEY 5.625 03/30/21 | 3,300,000.000 | 3,375,933.000 | |
| TURKEY 5.75 03/22/24 | 3,900,000.000 | 3,910,218.000 | |
| TURKEY 6.0 01/14/41 | 4,300,000.000 | 3,963,783.000 | |
| TURKEY 6.25 09/26/22 | 2,400,000.000 | 2,486,184.000 | |
| TURKEY 6.625 02/17/45 | 5,300,000.000 | 5,237,672.000 | |
| TURKEY 6.75 04/03/18 | 5,600,000.000 | 5,831,000.000 | |
| TURKEY 6.75 05/30/40 | 3,700,000.000 | 3,714,171.000 | |
| TURKEY 6.875 03/17/36 | 5,000,000.000 | 5,073,000.000 | |
| TURKEY 7.0 03/11/19 | 2,500,000.000 | 2,653,850.000 | |
| TURKEY 7.0 06/05/20 | 4,500,000.000 | 4,837,320.000 | |
| TURKEY 7.25 03/05/38 | 1,400,000.000 | 1,484,042.000 | |
| TURKEY 7.375 02/05/25 | 5,100,000.000 | 5,482,500.000 | |
| TURKEY 7.5 11/07/19 | 1,800,000.000 | 1,955,700.000 | |
| TURKEY 8.0 02/14/34 | 2,100,000.000 | 2,384,550.000 | |
| UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21 | 600,000.000 | 609,600.000 | |

| | | | | |
|---------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
| | UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25 | 4,600,000.000 | 4,425,200.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 | 5,300,000.000 | 5,313,250.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 | 6,700,000.000 | 6,706,700.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 | 5,600,000.000 | 5,552,400.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 | 6,000,000.000 | 5,389,980.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 | 8,200,000.000 | 7,482,500.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 5.125 01/15/20 | 2,800,000.000 | 3,011,400.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 | 4,600,000.000 | 4,686,250.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 | 5,000,000.000 | 4,662,500.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 5.95 03/19/19 | 5,600,000.000 | 6,046,600.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 | 5,900,000.000 | 6,364,625.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 | 3,600,000.000 | 4,274,280.000 | |
| | UNITED MEXICAN STATES 7.5 04/08/33 | 1,200,000.000 | 1,523,040.000 | |
| | アメリカ・ドル 小計 | 473,962,500.000 (54,960,691,500) | 514,878,801.870 (59,705,345,865) | |
| 国債証券 合計 | | 54,960,691,500 (54,960,691,500) | 59,705,345,865 (59,705,345,865) | |
| 合計 | | 54,960,691,500 (54,960,691,500) | 59,705,345,865 (59,705,345,865) | |

（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 127銘柄 | 95.41% | 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29年1月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 40,431,619,252円 |
| 負債総額 | 230,131,310円 |
| 純資産総額（ - ） | 40,201,487,942円 |
| 発行済数量 | 36,223,766,826口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1098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29年1月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 290,101,746,607円 |
| 負債総額 | 875,696,700円 |
| 純資産総額（ - ） | 289,226,049,907円 |
| 発行済数量 | 128,494,819,275口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.2509円 |

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 387,240,066,980円 |
| 負債総額 | 5,124,822,000円 |
| 純資産総額（ - ） | 382,115,244,980円 |
| 発行済数量 | 299,427,425,319口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2762円 |

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 30,309,266,215円 |
| 負債総額 | 187,628,300円 |
| 純資産総額（ - ） | 30,121,637,915円 |
| 発行済数量 | 16,484,493,223口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.8273円 |

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 271,145,311,063円 |
| 負債総額 | 306,969,299円 |
| 純資産総額（ - ） | 270,838,341,764円 |
| 発行済数量 | 91,962,554,107口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.9451円 |

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年1月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 35,751,800,472円 |
| 負債総額 | 107,656,313円 |
| 純資産総額（ - ） | 35,644,144,159円 |
| 発行済数量 | 31,255,612,192口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1404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29年1月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 164,017,465,030円 |
| 負債総額 | 91,092,942円 |
| 純資産総額（ - ） | 163,926,372,088円 |
| 発行済数量 | 124,611,491,856口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3155円 |

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 41,308,313,066円 |
| 負債総額 | 134,458,209円 |
| 純資産総額（ - ） | 41,173,854,857円 |
| 発行済数量 | 41,452,811,163口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.9933円 |

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年1月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 77,550,992,499円 |
| 負債総額 | 8,523,880,281円 |
| 純資産総額（ - ） | 69,027,112,218円 |
| 発行済数量 | 38,258,854,634口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.8042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・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1) 資本金の額（平成29年1月31日現在）

| | |
|------------|--|
| 資本金の額 | 20億円 |
| 発行する株式総数 | 100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株) |
| 発行済株式総数 | 40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株) |
| 種類株式の発行が可能 | |

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成29年1月31日現在）

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。

取締役は株主総会で選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役（監査等委員である取締役を除く。）の補欠として選任された取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、現任取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

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・訂正いたします。

<更新・訂正後>

「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る委託会社は、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）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

平成29年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

| 基本的性格 | 本数 | 純資産総額（単位：円） |
|------------|-------|--------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 38 | 1,153,760,242,911 |
| 追加型株式投資信託 | 868 | 11,607,919,733,086 |
| 単位型公社債投資信託 | 56 | 309,058,467,566 |
| 単位型株式投資信託 | 103 | 730,271,926,332 |
| 合計 | 1,065 | 13,801,010,369,895 |

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・訂正いたします。

<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31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28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。

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に变更いたしました。

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

| | 第30期 （平成27年3月31日現在） | 第31期 （平成28年3月31日現在） |
|-------------|------------------------|------------------------|
| （資産の部） | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 12,051,921 | 12,951,736 |
| 金銭の信託 | 14,169,657 | 13,094,914 |
| 前払費用 | 57,309 | 44,951 |
| 未収委託者報酬 | 4,622,292 | 4,460,404 |
| 未収運用受託報酬 | 1,737,052 | 1,859,778 |
| 未収投資助言報酬 | 2 312,206 | 2 277,603 |
| 未収収益 | 260,845 | 205,097 |
| 繰延税金資産 | 411,797 | 341,078 |
| その他 | 46,782 | 40,689 |
| 流動資産計 | 33,669,865 | 33,276,255 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 432,933 | 658,607 |
| 建物 | 1 138,967 | 1 29,219 |
| 車両運搬具 | 1 941 | 1 549 |
| 器具備品 | 1 243,908 | 1 184,683 |
| 建設仮勘定 | 49,116 | 444,155 |
| 無形固定資産 | 1,912,472 | 1,706,201 |
| 商標権 | 1 101 | 1 7 |
| ソフトウェア | 1 1,702,633 | 1 1,645,861 |
| ソフトウェア仮勘定 | 202,399 | 53,036 |
| 電話加入権 | 7,148 | 7,148 |
| 電信電話専用施設利用権 | 1 188 | 1 146 |
| 投資その他の資産 | 4,343,365 | 6,497,772 |
| 投資有価証券 | 613,137 | 458,701 |
| 関係会社株式 | 2,316,596 | 3,229,196 |
| 繰延税金資産 | 582,861 | 679,092 |
| 差入保証金 | 733,907 | 2,040,945 |
| その他 | 96,862 | 89,835 |
| 固定資産計 | 6,688,771 | 8,862,580 |
| 資産合計 | 40,358,637 | 42,138,836 |

（単位：千円）

| | 第30期 （平成27年3月31日現在） | 第31期 （平成28年3月31日現在） |
|--------------|------------------------|------------------------|
| （負債の部） | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 1,605,579 | 966,681 |
| 未払金 | 2,515,377 | 2,055,332 |
| 未払償還金 | 49,873 | 49,873 |
| 未払手数料 | 1,836,651 | 1,744,274 |
| その他未払金 | 628,852 | 261,185 |
| 未払費用 | 2 2,196,267 | 2 3,076,566 |
| 未払法人税等 | 1,539,263 | 1,223,957 |
| 未払消費税等 | 671,243 | 352,820 |
| 賞与引当金 | 722,343 | 728,769 |
| その他 | 30,000 | - |
| 流動負債計 | 9,280,074 | 8,404,128 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 868,928 | 997,396 |
| 役員退職慰労引当金 | 110,465 | 154,535 |
| 固定負債計 | 979,394 | 1,151,932 |
| 負債合計 | 10,259,468 | 9,556,060 |
| （純資産の部） | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | 2,428,478 | 2,428,478 |
| 資本準備金 | 2,428,478 | 2,428,478 |
| 利益剰余金 | 25,417,784 | 28,000,340 |
| 利益準備金 | 123,293 | 123,293 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 19,480,000 | 22,030,000 |
| 研究開発積立金 | 300,000 | 300,000 |
| 運用責任準備積立金 | 200,000 | 200,000 |
| 繰越利益剰余金 | 5,314,491 | 5,347,047 |
| 株主資本計 | 29,846,262 | 32,428,818 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 252,905 | 153,956 |
| 評価・換算差額等計 | 252,905 | 153,956 |
| 純資産合計 | 30,099,168 | 32,582,775 |
| 負債・純資産合計 | 40,358,637 | 42,138,836 |

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

| 第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日） |
|--|
| <p>「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）</p> <p>（１）概要 本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。</p> <p>（２）適用予定日 平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。</p> <p>（３）当該会計基準等の適用による影響 当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。</p> |

会計上の見積りの変更

| 第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日） |
|---|
| <p>当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。</p> <p>また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。</p> <p>これにより、従来の方と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。</p> |

追加情報

| 第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日） |
|---|
| <p>当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。</p> <p>１．商号 ：アセットマネジメントOne 株式会社 ２．代表者 ：西 恵正（現 D I A Mアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長） ３．本店所在地 ：東京都千代田区丸の内1 8 2 ４．統合日 ：平成28年10月1日</p> |

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）投資有価証券

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

負 債

（1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

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

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

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

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

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）
該当事項はありません。

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

| | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額（千円） | 当事業年度の損益に含まれた 評価差額（千円） |
|------------|----------------------------|---------------------------|
| 運用目的の金銭の信託 | 13,094,914 | 825,986 |

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

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

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

| | 第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|-----|--|--|
| 割引率 | 0.89% | 0.89% |

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

（１）サービスごとの情報

| | 投資信託 （千円） | 投資顧問 （千円） | その他 （千円） | 合計 （千円） |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 30,188,445 | 8,588,706 | 724,211 | 39,501,363 |

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金又は 出資金 | 事業の 内容又は 職業 | 議決権 等の所有 (被所有) 割合 | 関係内容 | | 取引の 内容 | 取引 金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|------------------------------|-----------------------------|---------------|-------------------|----------------------------|----------------|-------------------|---|------------------------|-------------------|------------------|
| | | | | | | 役員 の兼 任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 子 会 社 | DIAM International Ltd | London United kingdom | 9,000 千GBP | 資産の 運用 | (所有) 直接 100% | 兼務 2名 | 当社預 り資産 の運用 | 当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 増資の引受 | 800,617 912,600 | 未払 費用 - | 308,974 - |
| | DIAM U.S.A., Inc. | New York U.S.A. | 4,000 千USD | 資産の 運用 | (所有) 直接 100% | 兼務 2名 | 当社預 り資産 の運用 | 当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 | 473,948 | 未払 費用 | 157,130 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注3）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

（注4）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

（注5）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

| | 第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日） | 第31期 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日） |
|--------------|--|--|
| 1株当たり純資産額 | 1,254,132円02銭 | 1,357,615円66銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 213,583円46銭 | 213,606円51銭 |

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第30期 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日） | 第31期 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日） |
|--------------|--|--|
| 当期純利益 | 5,126,003千円 | 5,126,556千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益 | 5,126,003千円 | 5,126,556千円 |
| 期中平均株式数 | 24,000株 | 24,000株 |

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

| | 第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在) | |
|-------------|-------------------------------|------------|
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | | 11,605,537 |
| 金銭の信託 | | 11,792,364 |
| 前払費用 | | 122,161 |
| 未収委託者報酬 | | 4,755,701 |
| 未収運用受託報酬 | | 2,465,934 |
| 未収投資助言報酬 | | 261,221 |
| 未収収益 | | 181,959 |
| 繰延税金資産 | | 329,236 |
| その他 | | 122,804 |
| 流動資産計 | | 31,636,922 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | 1,541,889 |
| 建物 | 1 | 6,517 |
| 器具備品 | 1 | 152,176 |
| 建設仮勘定 | | 1,383,196 |
| 無形固定資産 | | 1,613,174 |
| ソフトウェア | | 1,421,245 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 184,656 |
| 電話加入権 | | 7,148 |
| 電信電話専用施設利用権 | | 124 |
| 投資その他の資産 | | 6,281,765 |
| 投資有価証券 | | 441,519 |
| 関係会社株式 | | 3,229,196 |
| 繰延税金資産 | | 713,716 |
| 差入保証金 | | 1,808,323 |
| その他 | | 89,010 |
| 固定資産計 | | 9,436,830 |
| 資産合計 | | 41,073,753 |

（単位：千円）

| | 第32期中間会計期間末 （平成28年9月30日現在） |
|--------------|-------------------------------|
| （負債の部） | |
| 流動負債 | |
| 預り金 | 1,080,224 |
| 未払金 | 2,651,649 |
| 未払償還金 | 49,873 |
| 未払手数料 | 1,865,871 |
| その他未払金 | 735,905 |
| 未払費用 | 2,673,720 |
| 未払法人税等 | 907,554 |
| 未払消費税等 | 69,484 |
| 賞与引当金 | 724,711 |
| 訴訟損失引当金 | 30,000 |
| その他 | 21,000 |
| 流動負債計 | 8,158,344 |
| 固定負債 | |
| 退職給付引当金 | 1,027,049 |
| 固定負債計 | 1,027,049 |
| 負債合計 | 9,185,394 |
| （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 | 27,317,845 |
| 利益準備金 | 123,293 |
| その他利益剰余金 | |
| 別途積立金 | 24,580,000 |
| 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 | 2,114,551 |
| 株主資本計 | 31,746,323 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 142,035 |
| 評価・換算差額等計 | 142,035 |
| 純資産合計 | 31,888,358 |
| 負債・純資産合計 | 41,073,753 |

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

| | | 第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日) | |
|-----------|--------|---------------------------------------|------------|
| 営業収益 | | | |
| 委託者報酬 | | 14,454,974 | |
| 運用受託報酬 | | 3,732,759 | |
| 投資助言報酬 | | 456,986 | |
| その他営業収益 | | 323,793 | |
| | 営業収益計 | | 18,968,513 |
| 営業費用 | | | |
| 支払手数料 | | 6,111,449 | |
| 広告宣伝費 | | 108,789 | |
| 公告費 | | 428 | |
| 調査費 | | 3,764,163 | |
| 調査費 | | 2,639,714 | |
| 委託調査費 | | 1,124,449 | |
| 委託計算費 | | 216,712 | |
| 営業雑経費 | | 278,529 | |
| 通信費 | | 17,844 | |
| 印刷費 | | 212,004 | |
| 協会費 | | 11,277 | |
| 諸会費 | | 18 | |
| 支払販売手数料 | | 37,384 | |
| | 営業費用計 | | 10,480,072 |
| 一般管理費 | | | |
| 給料 | | 2,330,263 | |
| 役員報酬 | | 124,419 | |
| 給料・手当 | | 2,205,843 | |
| 交際費 | | 16,973 | |
| 寄付金 | | 13,268 | |
| 旅費交通費 | | 100,973 | |
| 租税公課 | | 148,041 | |
| 不動産賃借料 | | 1,329,821 | |
| 退職給付費用 | | 121,590 | |
| 固定資産減価償却費 | 1 | 353,322 | |
| 福利厚生費 | | 11,020 | |
| 修繕費 | | 10,082 | |
| 賞与引当金繰入額 | | 724,711 | |
| 役員退職慰労金 | | 63,072 | |
| 機器リース料 | | 146 | |
| 事務委託費 | | 182,857 | |
| 事務用消耗品費 | | 37,442 | |
| 器具備品費 | | 236,524 | |
| 諸経費 | | 58,359 | |
| | 一般管理費計 | | 5,738,473 |
| 営業利益 | | | 2,749,968 |

（単位：千円）

| | 第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日至平成28年9月30日） | |
|--------------|---------------------------------------|-----------|
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 7,882 | |
| 受取利息 | 341 | |
| 為替差益 | 32,301 | |
| 雑収入 | 4,836 | |
| 営業外収益計 | | 45,361 |
| 営業外費用 | | |
| 金銭の信託運用損 | 59,768 | |
| 営業外費用計 | | 59,768 |
| 経常利益 | | 2,735,561 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産除却損 | 2,820 | |
| 固定資産売却損 | 1,780 | |
| 訴訟損失引当金繰入額 | 30,000 | |
| 特別損失計 | | 34,601 |
| 税引前中間純利益 | | 2,700,960 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 856,976 |
| 法人税等調整額 | | 17,520 |
| 法人税等合計 | | 839,455 |
| 中間純利益 | | 1,861,504 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28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 | 22,030,000 | 300,000 | 200,000 | 5,347,047 | 28,000,340 | 32,428,818 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 2,544,000 | 2,544,000 | 2,544,000 |
| 別途積立金の 積立 | | | | 2,550,000 | | | 2,550,000 | - | - |
| 中間純利益 | | | | | | | 1,861,504 | 1,861,504 | 1,861,504 |
| 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 | - | - | - | 2,550,000 | - | - | 3,232,495 | 682,495 | 682,495 |
| 当中間期末残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 24,580,000 | 300,000 | 200,000 | 2,114,551 | 27,317,845 | 31,746,323 |

| | 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 | 153,956 | 32,582,775 |
| 当中間期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | | 2,544,000 |
| 別途積立金の 積立 | | - |
| 中間純利益 | | 1,861,504 |
| 株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額) | 11,921 | 11,921 |
| 当中間期変動額 合計 | 11,921 | 694,416 |
| 当中間期末残高 | 142,035 | 31,888,358 |

重要な会計方針

| 項目 | 第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28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 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 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)訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる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32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日) |
|--|
| <p>法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。</p> <p>なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。</p> |

追加情報

| 第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日) |
|--|
| <p>1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。</p> <p>2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。</p> <p>これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。</p> |

注記事項

(中間貸借対照表関係)

| 項目 | 第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在) |
|------------------|------------------------------------|
| 1.有形固定資産の減価償却累計額 | 建物...790,504千円 器具備品...596,199千円 |

(中間損益計算書関係)

| 項目 | 第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日) | | |
|-------------|--|-----|-----------|
| 1 . 減価償却実施額 | 有形固定資産 | ... | 57,752千円 |
| | 無形固定資産 | ... | 295,570千円 |

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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28年6月29日 定時株主総会 | 普通株式 | 2,544,000 | 106,000 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月30日 |

（金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成28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 | 11,605,537 | 11,605,537 | - |
| （２）金銭の信託 | 11,792,364 | 11,792,364 | - |
| （３）投資有価証券 其他有価証券 | 363,823 | 363,823 | - |
| 資産計 | 23,761,725 | 23,761,725 | - |
| （１）未払法人税等 | 907,554 | 907,554 | - |
| 負債計 | 907,554 | 907,554 | - |

（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 | 77,696 |
| 関係会社株式 | 3,229,196 |
| 差入保証金 | 1,808,323 |

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。

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32期中間会計期間末
（平成28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3,229,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

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 | 349,644 | 146,101 | 203,542 |
| 債券 | - | - | - |
| その他（投資信託） | 14,179 | 13,000 | 1,179 |
| 小計 | 363,823 | 159,101 | 204,721 |
| 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 | 363,823 | 159,101 | 204,721 |

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

（金銭の信託関係）

第32期中間会計期間末
（平成28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。

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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 | 14,454,974 | 4,189,745 | 323,793 | 18,968,513 |

（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 | 1,928,739 |

（注）第一生命グループには、第一生命保険株式会社及び第一フロンティア生命保険株式会社が含まれております。

（1株当たり情報）

| 第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日） | | |
|--|------------|-----|
| 1株当たり純資産額 | 1,328,681円 | 62銭 |
| 1株当たり中間純利益金額 | 77,562円 | 67銭 |
| なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | | |

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日） |
|--------------|--|
| 中間純利益 | 1,861,504千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式に係る中間純利益 | 1,861,504千円 |
| 期中平均株式数 | 24,000株 |

（重要な後発事象）

第32期中間会計期間
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

当社（以下「DIAM」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAM、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1．結合当事企業

| 結合当事企業 | DIAM | MHAM | TB | 新光投信 |
|--------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 事業の内容 | 投資運用業務、投資助言・代理業務 | 投資運用業務、投資助言・代理業務 | 信託業務、銀行業務、投資運用業務 | 投資運用業務、投資助言・代理業務 |

2．企業結合日

平成28年10月1日

3．企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5．交付した株式数

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）に対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種種類株式15,510株を交付しました。

6．企業結合の主な目的

当社は、みずほフィナンシャルグループ及び第一生命保険株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、みずほフィナンシャルグループと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

7．取得企業を決定するに至った主な根拠

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるみずほフィナンシャルグループが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

8．実施予定の会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3．企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理することをそれぞれ予定しております。

（参考）みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該（参考）において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「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条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

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 | 江見 睦生 印 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 亀井 純子 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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第53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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

(注)1. 上記は、当社が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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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 | 湯原 | 尚 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」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28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28年4月1日から平成28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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、みずほ投信投資顧問株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

（注１）上記は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）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。

(1)貸借対照表

| | (単位： 千円) | |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 20,801,864 | 20,903,257 |
| 有価証券 | 127,840 | 82,540 |
| 前払費用 | 156,891 | 157,231 |
| 未収委託者報酬 | 1,827,951 | 2,183,032 |
| 未収運用受託報酬 | 1,812,198 | 1,713,643 |
| 繰延税金資産 | 185,882 | 162,369 |
| その他流動資産 | 159,069 | 293,051 |
| 貸倒引当金 | 1,092 | 1,185 |
| 流動資産合計 | 25,070,606 | 25,493,940 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物（純額） | 124,850 | 100,000 |
| 工具、器具及び備品（純額） | 71,443 | 90,655 |
| リース資産（純額） | 2,140 | 818 |
| 有形固定資産合計 | 1 198,434 | 1 191,474 |
| 無形固定資産 | | |
| 電話加入権 | 12,747 | 12,747 |
| その他無形固定資産 | 65 | 35 |
| 無形固定資産合計 | 12,812 | 12,782 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 3,987,168 | 3,260,206 |
| 長期差入保証金 | 360,258 | 340,503 |
| 前払年金費用 | 331,766 | 346,659 |
| 会員権 | 8,400 | 8,400 |
| その他 | 23,186 | 19,551 |
| 貸倒引当金 | 19,534 | 19,404 |
| 投資その他の資産合計 | 4,691,245 | 3,955,916 |
| 固定資産合計 | 4,902,492 | 4,160,172 |
| 資産合計 | 29,973,099 | 29,654,112 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 77,889 | 29,699 |
| リース債務 | 2,648 | 1,202 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 746 | 833 |
| 未払償還金 | 5,716 | 3,906 |
| 未払手数料 | 819,341 | 838,064 |
| その他未払金 | 86,205 | 9,022 |
| 未払金合計 | 912,009 | 851,826 |
| 未払費用 | 2,038,097 | 1,896,033 |
| 未払法人税等 | 393,574 | 570,376 |
| 未払消費税等 | 426,857 | 227,078 |
| 賞与引当金 | 328,900 | 318,000 |
| その他流動負債 | 3,075 | 999 |
| 流動負債合計 | 4,183,052 | 3,895,216 |
| 固定負債 | | |
| リース債務 | 2,088 | 886 |
| 役員退職慰労引当金 | 104,240 | 147,427 |
| 時効後支払損引当金 | 8,128 | 6,471 |
| 繰延税金負債 | 306,725 | 38,000 |
| その他固定負債 | 6,926 | 1,931 |
| 固定負債合計 | 428,109 | 194,716 |
| 負債合計 | 4,611,161 | 4,089,932 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,045,600 | 2,045,600 |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 2,266,400 | 2,266,400 |
| その他資本剰余金 | 2,450,074 | 2,450,074 |
| 資本剰余金合計 | 4,716,474 | 4,716,474 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 128,584 | 128,584 |
| その他利益剰余金 | | |
| 配当準備積立金 | 104,600 | 104,600 |
| 退職慰労積立金 | 100,000 | 100,000 |
| 別途積立金 | 9,800,000 | 9,800,000 |
| 繰越利益剰余金 | 7,739,742 | 8,908,993 |
| 利益剰余金合計 | 17,872,927 | 19,042,177 |
| 自己株式 | - | 377,863 |
| 株主資本合計 | 24,635,002 | 25,426,389 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 726,935 | 137,791 |
| 評価・換算差額等合計 | 726,935 | 137,791 |
| 純資産合計 | 25,361,937 | 25,564,180 |
| 負債純資産合計 | 29,973,099 | 29,654,112 |

(2)損益計算書

| | (単位： 千円) | |
|--------------|---|---|
| | 前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日) |
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 17,538,139 | 17,358,667 |
| 運用受託報酬 | 4,463,429 | 5,050,661 |
| 営業収益合計 | 22,001,569 | 22,409,329 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 8,480,510 | 7,999,728 |
| 広告宣伝費 | 247,790 | 205,521 |
| 公告費 | 1,140 | 152 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | 1,259,067 | 1,312,466 |
| 委託調査費 | 4,883,037 | 5,299,598 |
| 図書費 | 4,308 | 3,703 |
| 調査費合計 | 6,146,412 | 6,615,769 |
| 委託計算費 | 101,919 | 116,405 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 59,454 | 46,151 |
| 印刷費 | 128,143 | 246 |
| 協会費 | 18,777 | 20,221 |
| 諸会費 | 2,540 | 2,317 |
| その他 | 855,319 | 958,635 |
| 営業雑経費合計 | 1,064,234 | 1,027,572 |
| 営業費用合計 | 16,042,008 | 15,965,148 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |
| 役員報酬 | 142,983 | 143,812 |
| 給料手当 | 1,832,723 | 1,905,880 |
| 賞与 | 295,180 | 304,122 |
| 給料合計 | 2,270,886 | 2,353,814 |
| 交際費 | 775 | 775 |
| 寄付金 | - | 221 |
| 旅費交通費 | 91,851 | 87,228 |
| 租税公課 | 51,783 | 76,075 |
| 不動産賃借料 | 339,964 | 305,351 |
| 退職給付費用 | 126,451 | 119,608 |
| 福利厚生費 | 368,622 | 370,689 |
| 貸倒引当金繰入 | - | 93 |
| 賞与引当金繰入 | 319,122 | 301,698 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 27,249 | 47,768 |
| 固定資産減価償却費 | 31,216 | 44,257 |
| 諸経費 | 358,817 | 269,502 |
| 一般管理費合計 | 3,986,740 | 3,977,085 |
| 営業利益 | 1,972,819 | 2,467,095 |
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 7,027 | 4,242 |
| 受取利息 | 7,340 | 7,633 |
| 有価証券解約益 | 953 | 50,674 |
| 有価証券償還益 | - | 56,303 |
| 時効到来償還金等 | 21,856 | 1,962 |
| 時効後支払損引当金戻入額 | - | 1,311 |
| 雑収入 | 51,171 | 20,993 |
| 営業外収益合計 | 88,349 | 143,121 |
| 営業外費用 | | |
| 有価証券解約損 | - | 278 |
| 有価証券償還損 | 2,197 | 2,641 |
| ヘッジ会計に係る損失 | 2,240 | - |
| 時効後支払損引当金繰入額 | 17,685 | - |
| 雑損失 | 63,198 | 6,767 |

| | | | |
|--------------|---|-----------|-----------|
| 営業外費用合計 | | 85,321 | 9,688 |
| 経常利益 | | 1,975,847 | 2,600,528 |
| 特別利益 | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 10,500 | - |
| 特別利益合計 | | 10,500 | - |
| 特別損失 | | | |
| 減損損失 | 1 | 51,292 | - |
| 事業再構築費用 | 2 | 125,173 | - |
| 外国税負担損失 | 3 | 53,547 | - |
| 貸倒引当金繰入 | | 19,534 | - |
| 特別損失合計 | | 249,548 | - |
| 税引前当期純利益 | | 1,736,799 | 2,600,528 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 616,760 | 839,827 |
| 法人税等調整額 | | 16,247 | 40,166 |
| 法人税等合計 | | 633,008 | 879,993 |
| 当期純利益 | | 1,103,790 | 1,720,534 |

(3)株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | |
|-----------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | |
| 当期純利益 | | | | |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | |
| 当期末残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |

| | 株主資本 | | | | | | |
|-----------------------------|-----------|-------------|-----------|-------------|-----------|-------------|------------|
| | 利益剰余金 | | | | | | 株主資本 合計 |
| | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | | | | 利益剰余 金合計 | |
| 配当準備 積立金 | | 退職慰労 積立金 | 別途 積立金 | 繰越利益 剰余金 | | | |
| 当期首残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 6,988,395 | 17,121,579 | 23,883,654 |
| 当期変動額 | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | 352,443 | 352,443 | 352,443 |
| 当期純利益 | | | | | 1,103,790 | 1,103,790 | 1,103,790 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | | 751,347 | 751,347 | 751,347 |
| 当期末残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 7,739,742 | 17,872,927 | 24,635,002 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-----------------------------|--------------|------------|------------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 41,248 | 41,248 | 23,842,406 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 352,443 |
| 当期純利益 | | | 1,103,790 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | 768,183 | 768,183 | 768,183 |
| 当期変動額合計 | 768,183 | 768,183 | 1,519,530 |
| 当期末残高 | 726,935 | 726,935 | 25,361,937 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位： 千円）

| | 株主資本 | | | |
|---------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | |
| 当期純利益 | | | | |
| 自己株式の取得 | | | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | |
| 当期末残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |

| | 株主資本 | | | | | | | |
|-----------------------------|-----------|-------------|-------------|-----------|-------------|-------------|---------|------------|
| | 利益剰余金 | | | | | | 自己株式 | 株主資本 合計 |
| | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | | | | 利益剰余 金合計 | | |
| | | 配当準備 積立金 | 退職慰労 積立金 | 別途 積立金 | 繰越利益 剰余金 | | | |
| 当期首残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 7,739,742 | 17,872,927 | - | 24,635,002 |
| 当期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | 551,284 | 551,284 | | 551,284 |
| 当期純利益 | | | | | 1,720,534 | 1,720,534 | | 1,720,534 |
| 自己株式の取得 | | | | | | | 377,863 | 377,863 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額） | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | | 1,169,250 | 1,169,250 | 377,863 | 791,386 |
| 当期末残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 8,908,993 | 19,042,177 | 377,863 | 25,426,389 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---------------------|--------------|------------|------------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 726,935 | 726,935 | 25,361,937 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 551,284 |
| 当期純利益 | | | 1,720,534 |
| 自己株式の取得 | | | 377,863 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 589,143 | 589,143 | 589,143 |
| 当期変動額合計 | 589,143 | 589,143 | 202,242 |
| 当期末残高 | 137,791 | 137,791 | 25,564,180 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法（ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、決算日において発生していると認められる額を計上しております。

(4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）

(5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、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。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

7. その他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。

未適用の会計基準等

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

1. 概要

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

2. 適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

当社は、「追加情報」に記載のとおり、当社、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積りの変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ27,598千円減少しております。

追加情報

DIAMアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 西 恵正）、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

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

注記事項

（貸借対照表関係）

| 前事業年度 (平成27年3月31日) | | 当事業年度 (平成28年3月31日) | |
|-----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額 | 1 | 有形固定資産の減価償却累計額 |
| | 建物 111,156千円 | | 建物 136,006千円 |
| | 工具、器具及び備品 277,249千円 | | 工具、器具及び備品 226,657千円 |
| | リース資産 16,185千円 | | リース資産 17,508千円 |

（損益計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

| 場所 | 用途 | 種類 | 金額（千円） |
|-----------|--------|--------|--------|
| 本社（東京都港区） | 除却対象資産 | 建物 | 23,139 |
| 本社（東京都港区） | 除却対象資産 | 工具器具備品 | 4,253 |
| 本社（東京都港区） | 除却対象資産 | 原状回復費用 | 23,900 |

レイアウト変更により現行オフィス内部造作等の除却が決定した資産につき、「除却対象資産」としてグルーピングを行い、平成27年3月31日時点の帳簿価額および原状回復費用を減損損失（51,292千円）として特別損失に計上しました。

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものではありません。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式（株） | 1,052,070 | - | - | 1,052,070 |

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（円） | 1株当たり配当額（円） | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| 平成26年6月11日 第51回定時株主総会 | 普通株式 | 352,443,450 | 335 | 平成26年3月31日 | 平成26年6月12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 | 配当金の総額（円） | 配当の原資 | 1株当たり配当額（円） | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|-------------|-------|-------------|------------|------------|
| 平成27年6月11日 第52回定時株主総会 | 普通株式 | 551,284,680 | 利益剰余金 | 524 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月12日 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式（株） | 1,052,070 | - | - | 1,052,070 |

2 自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|---------|--------|----|--------|
| 普通株式（株） | - | 13,662 | - | 13,662 |

（変動事由の概要）

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

３．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 （円） | １株当たり 配当額 （円） | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|---------------|---------------------|------------|------------|
| 平成27年６月11日 第52回定時株主総会 | 普通株式 | 551,284,680 | 524 | 平成27年３月31日 | 平成27年６月12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 | 配当金の総額 （円） | 配当の原資 | １株当たり 配当額 （円） | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|----------------|-------|---------------------|------------|------------|
| 平成28年６月10日 第53回定時株主総会 | 普通株式 | 17,652,936,000 | 利益剰余金 | 17,000 | 平成28年３月31日 | 平成28年６月13日 |
| | | 1,346,815,176 | 資本剰余金 | 1,297 | 平成28年３月31日 | 平成28年６月13日 |
| | 合計 | 18,999,751,176 | | 18,297 | | |

（リース取引関係）

１．ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

リース資産の内容

有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「３．固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

（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

当社は、投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

（２）金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。

（３）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を半期ごとに把握する体制としています。

有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスクの管理

有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っています。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。

（４）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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、次表には含まれておりません。（（注２）を参照ください。）

前事業年度（平成27年３月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---------------------------|------------|------------|----|
| （１）現金及び預金 | 20,801,864 | 20,801,864 | - |
| （２）未収委託者報酬 | 1,827,951 | 1,827,951 | - |
| （３）未収運用受託報酬 | 1,812,198 | 1,812,198 | - |
| （４）有価証券及び投資有価証券 其他有価証券 | 4,054,289 | 4,054,289 | - |
| 資産計 | 28,496,304 | 28,496,304 | - |
| （１）未払手数料 | 819,341 | 819,341 | - |
| 負債計 | 819,341 | 819,341 | - |
| デリバティブ取引（１） | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (3,601) | (3,601) | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | 327 | 327 | - |
| デリバティブ取引計 | (3,274) | (3,274) | - |

（１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

当事業年度（平成28年３月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|---------------------------|------------|------------|----|
| （１）現金及び預金 | 20,903,257 | 20,903,257 | - |
| （２）未収委託者報酬 | 2,183,032 | 2,183,032 | - |
| （３）未収運用受託報酬 | 1,713,643 | 1,713,643 | - |
| （４）有価証券及び投資有価証券 其他有価証券 | 3,282,026 | 3,282,026 | - |
| 資産計 | 28,081,960 | 28,081,960 | - |
| （１）未払手数料 | 838,064 | 838,064 | - |
| 負債計 | 838,064 | 838,064 | - |
| デリバティブ取引（１） | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (220) | (220) | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | (1,564) | (1,564) | - |
| デリバティブ取引計 | (1,784) | (1,784) | - |

（１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

（１）現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（２）未収委託者報酬及び（３）未収運用受託報酬

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。

（４）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

負 債

（１）未払手数料

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

（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の貸借対照表計上額

（単位：千円）

| 区分 | 前事業年度 （平成27年３月31日） | 当事業年度 （平成28年３月31日） |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 非上場株式 | 60,720 | 60,720 |

上記については、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ため、「（４）有価証券及び投資有価証券　　其他有価証券」には含めておりません。

（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

前事業年度（平成27年３月31日）

（単位：千円）

| | １年以内 | １年超 ２年以内 | ２年超 ３年以内 | ３年超 ４年以内 | ４年超 ５年以内 | ５年超 |
|--|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------|
| 預金 | 20,800,853 | - | - | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 1,827,951 | - | - | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 1,812,198 | - | - | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託 | 127,840 | - | - | - | - | 3,300,657 |
| 合計 | 24,568,844 | - | - | - | - | 3,300,657 |

当事業年度（平成28年３月31日）

（単位：千円）

| | １年以内 | １年超 ２年以内 | ２年超 ３年以内 | ３年超 ４年以内 | ４年超 ５年以内 | ５年超 |
|--|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------|
| 預金 | 20,902,546 | - | - | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 2,183,032 | - | - | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 1,713,643 | - | - | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託 | 82,540 | - | - | - | - | 2,395,185 |
| 合計 | 24,881,762 | - | - | - | - | 2,395,185 |

（有価証券関係）

１　　其他有価証券

前事業年度（平成27年３月31日）

| 種類 | 貸借対照表計上額 （千円） | 取得原価（千円） | 差額（千円） |
|------------------------------------|------------------|-----------|-----------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託 | 3,740,183 | 2,664,442 | 1,075,740 |
| 小計 | 3,740,183 | 2,664,442 | 1,075,740 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託 | 314,105 | 316,720 | 2,615 |
| 小計 | 314,105 | 316,720 | 2,615 |
| 合計 | 4,054,289 | 2,981,163 | 1,073,125 |

当事業年度（平成28年3月31日）

| 種類 | 貸借対照表計上額 （千円） | 取得原価（千円） | 差額（千円） |
|------------------------------------|------------------|-----------|---------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託 | 2,698,875 | 2,500,000 | 198,875 |
| 小計 | 2,698,875 | 2,500,000 | 198,875 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託 | 583,151 | 583,423 | 271 |
| 小計 | 583,151 | 583,423 | 271 |
| 合計 | 3,282,026 | 3,083,423 | 198,603 |

- 2 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものではありません。

- 3 当事業年度中に解約・償還したその他有価証券
前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

| 種類 | 解約・償還額(千円) | 解約・償還益の合計額 (千円) | 解約・償還損の合計額 (千円) |
|--------|------------|--------------------|--------------------|
| 証券投資信託 | 102,729 | 953 | 2,197 |
| 合計 | 102,729 | 953 | 2,197 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 種類 | 解約・償還額(千円) | 解約・償還益の合計額 (千円) | 解約・償還損の合計額 (千円) |
|--------|------------|--------------------|--------------------|
| 証券投資信託 | 738,178 | 106,977 | 2,920 |
| 合計 | 738,178 | 106,977 | 2,920 |

（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

株式関連

前事業年度（平成27年3月31日）

| 区分 | 取引の種類 | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超 (千円) | 時価 (千円) | 評価損益 (千円) |
|------|----------------|--------------|-----------------------|------------|--------------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 売建 | 197,054 | - | 3,601 | 3,601 |
| 合計 | | 197,054 | - | 3,601 | 3,601 |

当事業年度（平成28年3月31日）

| 区分 | 取引の種類 | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超 (千円) | 時価 (千円) | 評価損益 (千円) |
|------|----------------|--------------|-----------------------|------------|--------------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 売建 | 148,005 | - | 220 | 220 |
| 合計 | | 148,005 | - | 220 | 220 |

（注）時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

前事業年度（平成27年3月31日）

| ヘッジ会計の方法 | 取引の種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超 (千円) | 時価 (千円) |
|-------------------|----------|---------|--------------|-----------------------|------------|
| ヘッジ対象に係る損益を認識する方法 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 売建 | 投資有価証券 | 131,145 | - | 3,325 |
| | 買建 | 投資有価証券 | 277,953 | - | 3,652 |
| 合計 | | | 409,098 | - | 327 |

（注）時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

| ヘッジ会計の方法 | 取引の種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超 (千円) | 時価 (千円) |
|-------------------|----------|---------|--------------|-----------------------|------------|
| ヘッジ対象に係る損益を認識する方法 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 売建 | 投資有価証券 | 117,467 | - | 147 |
| | 買建 | 投資有価証券 | 179,836 | - | 1,711 |
| 合計 | | | 297,303 | - | 1,564 |

（注）時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。

当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2．確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 退職給付引当金の期首残高 | 357,258千円 | 331,766千円 |
| 退職給付費用 | 150,018 | 51,208 |
| 退職給付の支払額 | 21,349 | - |
| 制度への拠出額 | 103,177 | 66,102 |
| 退職給付引当金の期末残高 | 331,766 | 346,659 |

（2）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 積立型制度の退職給付債務 | 669,318千円 | 727,842千円 |
| 年金資産 | 1,001,084 | 1,074,502 |
| 貸借対照表に計上された前払年金費用 | 331,766 | 346,659 |

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度58,362千円 当事業年度51,208千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

(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

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 有価証券償却超過額 | 4,795千円 | 4,551千円 |
| ソフトウェア償却超過額 | 69,263 | 52,651 |
| 賞与引当金損金算入限度超過額 | 108,734 | 98,134 |
| 社会保険料損金不算入額 | 15,665 | 14,233 |
| 役員退職慰労引当金 | 34,461 | 45,488 |
| 未払事業税 | 30,421 | 39,817 |
| その他 | 93,137 | 58,782 |
| 繰延税金資産小計 | 356,479 | 313,659 |
| 評価性引当額 | 24,103 | 22,331 |
| 繰延税金資産合計 | 332,375 | 291,328 |
| 繰延税金負債 | | |
| 前払年金費用 | 107,027 | 106,147 |
| その他有価証券評価差額金 | 346,190 | 60,812 |
| 繰延税金負債合計 | 453,218 | 166,959 |
| 繰延税金資産の純額 | 120,843 | 124,368 |

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な項目別の内訳

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

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年4月1日から平成30年3月31日までのものは30.86%、平成30年4月1日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。

その結果、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）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

| 顧客の種類等 | 営業収益（千円） | 関連するセグメント名 |
|-----------|-----------|------------|
| 適格機関投資家 A | 2,629,803 | 資産運用業 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

| 顧客の種類等 | 営業収益（千円） | 関連するセグメント名 |
|-----------|-----------|------------|
| 適格機関投資家 A | 3,061,207 | 資産運用業 |

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合 | 関連当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|-------------|---------|------------------|-----------|----------------------------|---------------|-------|--------------|---------|--------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 株式会社みずほ銀行 | 東京都千代田区 | 14,040億円 | 銀行業 | なし | 投資信託の販売 | 支払手数料 | 3,833,692 | 未払手数料 | 361,219 |
| 同一の親会社をもつ会社 | みずほ信託銀行株式会社 | 東京都中央区 | 2,473億円 | 信託銀行業 | なし | 信託財産の管理 | 委託者報酬 | 13,851,610 | 未収委託者報酬 | 1,661,682 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合 | 関連当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|-------------|---------|------------------|-----------|----------------------------|---------------|-------|--------------|---------|--------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 株式会社みずほ銀行 | 東京都千代田区 | 14,040億円 | 銀行業 | なし | 投資信託の販売 | 支払手数料 | 3,542,264 | 未払手数料 | 336,556 |
| 同一の親会社をもつ会社 | みずほ信託銀行株式会社 | 東京都中央区 | 2,473億円 | 信託銀行業 | なし | 信託財産の管理 | 委託者報酬 | 14,108,529 | 未収委託者報酬 | 2,053,638 |

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 1株当たり純資産額 | 24,106.70円 | 24,618.62円 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 1,049.16円 | 1,639.16円 |

(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、潜在株式が存在しないため、記載していません。

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。

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|------------------|--|--|
| 1株当たり当期純利益金額 | | |
| 当期純利益(千円) | 1,103,790 | 1,720,534 |
| 普通株式に帰属しない金額(千円) | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益(千円) | 1,103,790 | 1,720,534 |
| 期中平均株式数(株) | 1,052,070 | 1,049,643 |

(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54期中間会計期間
(平成28年9月30日)

| | |
|---------------|------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 現金及び預金 | 4,120,018 |
| 未収委託者報酬 | 2,064,997 |
| 未収運用受託報酬 | 1,959,028 |
| 繰延税金資産 | 140,728 |
| その他 | 398,383 |
| 貸倒引当金 | 1,207 |
| 流動資産合計 | 8,681,950 |
| 固定資産 | |
| 有形固定資産 | |
| 工具、器具及び備品（純額） | 62,971 |
| 有形固定資産合計 | 1 62,971 |
| 無形固定資産 | |
| 投資その他の資産 | 12,767 |
| 投資有価証券 | 815,525 |
| 繰延税金資産 | 73,719 |
| その他 | 638,830 |
| 貸倒引当金 | 19,404 |
| 投資その他の資産合計 | 1,508,671 |
| 固定資産合計 | 1,584,410 |
| 資産合計 | 10,266,360 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 793,859 |
| 未払費用 | 1,675,771 |
| 未払法人税等 | 253,697 |
| 賞与引当金 | 319,200 |
| その他 | 221,869 |
| 流動負債合計 | 3,264,398 |
| 固定負債 | |
| 役員退職慰労引当金 | 57,860 |
| 時効後支払損引当金 | 7,256 |
| 固定負債合計 | 65,116 |
| 負債合計 | 3,329,515 |
| 純資産の部 | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 2,045,600 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | 2,266,400 |
| その他資本剰余金 | 1,103,259 |
| 資本剰余金合計 | 3,369,659 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 128,584 |
| その他利益剰余金 | |
| 繰越利益剰余金 | 1,777,567 |
| 利益剰余金合計 | 1,906,152 |
| 自己株式 | 377,863 |
| 株主資本合計 | 6,943,548 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 6,703 |
| 評価・換算差額等合計 | 6,703 |
| 純資産合計 | 6,936,845 |
| 負債純資産合計 | 10,266,360 |

(2) 中間損益計算書

(単位： 千円)

| 第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日) | |
|---|-------------|
| 営業収益 | |
| 委託者報酬 | 7,935,613 |
| 運用受託報酬 | 2,105,866 |
| 営業収益合計 | 10,041,479 |
| 営業費用及び一般管理費 | 1 9,415,997 |
| 営業利益 | 625,482 |
| 営業外収益 | |
| 受取配当金 | 19,694 |
| 受取利息 | 439 |
| 有価証券解約益 | 76,483 |
| 有価証券償還益 | 3,474 |
| 時効到来償還金等 | 727 |
| 雑収入 | 17,708 |
| 営業外収益合計 | 118,528 |
| 営業外費用 | |
| 有価証券解約損 | 96 |
| 有価証券償還損 | 12 |
| 雑損失 | 6,303 |
| 営業外費用合計 | 6,412 |
| 経常利益 | 737,598 |
| 特別利益 | 700 |
| 特別損失 | 11,641 |
| 税引前中間純利益 | 726,657 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 236,054 |
| 法人税等調整額 | 26,308 |
| 法人税等合計 | 209,746 |
| 中間純利益 | 516,910 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位: 千円)

| | 株主資本 | | | |
|---------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |
| 当中間期変動額 | | | | |
| 積立金取崩 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | 1,346,815 | 1,346,815 |
| 中間純利益 | | | | |
| 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 | | | 1,346,815 | 1,346,815 |
| 当中間期末残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 1,103,259 | 3,369,659 |

| | 株主資本 | | | | | |
|-----------------------|-----------|-------------|-----------|-------------|------------|-------------|
| | 利益剰余金 | | | | | |
| | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | | | | 利益剰余金 合計 |
| 配当準備積立 金 | | 退職慰労積立 金 | 別途 積立金 | 繰越利益剰余 金 | | |
| 当期首残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 8,908,993 | 19,042,177 |
| 当中間期変動額 | | | | | | |
| 積立金取崩 | | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 10,004,600 | - |
| 剰余金の配当 | | | | | 17,652,936 | 17,652,936 |
| 中間純利益 | | | | | 516,910 | 516,910 |
| 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 | | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 7,131,425 | 17,136,025 |
| 当中間期末残高 | 128,584 | - | - | - | 1,777,567 | 1,906,152 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---------------------------|---------|------------|------------------|----------------|------------|
| | 自己株式 | 株主資本合計 | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算差額 等合計 | |
| 当期首残高 | 377,863 | 25,426,389 | 137,791 | 137,791 | 25,564,180 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 積立金取崩 | | - | | | - |
| 剰余金の配当 | | 18,999,751 | | | 18,999,751 |
| 中間純利益 | | 516,910 | | | 516,910 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | 144,494 | 144,494 | 144,494 |
| 当中間期変動額合計 | | 18,482,840 | 144,494 | 144,494 | 18,627,334 |
| 当中間期末残高 | 377,863 | 6,943,548 | 6,703 | 6,703 | 6,936,845 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、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

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、中間決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、中間決算日において発生していると認められる額を計上しております。

(4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

(5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建資産・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。

5. 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。

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

| | 第54期中間会計期間 (平成28年9月30日) |
|------------------|----------------------------|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額 | 476,786千円 |

（中間損益計算書関係）

| | |
|-----------|---|
| | 第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日) |
| 1 減価償却実施額 | 有形固定資産 114,327千円 無形固定資産 15千円 |

（中間株主資本等変動計算書関係）

第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当中間会計期間末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式（株） | 1,052,070 | - | - | 1,052,070 |

2 自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当中間会計期間末 |
|---------|---------|----|----|----------|
| 普通株式（株） | 13,662 | - | - | 13,662 |

3 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 (円) | 配当の原資 | 1株当たり 配当額 (円) | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|----------------|-------|---------------------|------------|------------|
| 平成28年6月10日 第53回定時株主総会 | 普通株式 | 17,652,936,000 | 利益剰余金 | 17,000 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月13日 |
| | | 1,346,815,176 | 資本剰余金 | 1,297 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月13日 |
| | 合計 | 18,999,751,176 | | 18,297 | | |

（金融商品関係）

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

（単位： 千円）

| | 中間貸借対照表計 上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------------|----------------|-----------|----|
| (1) 現金及び預金 | 4,120,018 | 4,120,018 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 2,064,997 | 2,064,997 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 1,959,028 | 1,959,028 | - |
| (4) 投資有価証券 その他有価証券 | 754,805 | 754,805 | - |
| 資産計 | 8,898,851 | 8,898,851 | - |
| (1) 未払手数料 | 785,089 | 785,089 | - |
| 負債計 | 785,089 | 785,089 | - |

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

負債

(1) 未払手数料

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の中間貸借対照表計上額

| 区分 | 中間貸借対照表計上額（千円） |
|-------|----------------|
| 非上場株式 | 60,720 |

上記については、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ため、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

1 其他有価証券

| 種類 | 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 | | | |
| 証券投資信託 | 151,830 | 150,000 | 1,830 |
| 小計 | 151,830 | 150,000 | 1,830 |
| 中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 証券投資信託 | 602,975 | 614,467 | 11,491 |
| 小計 | 602,975 | 614,467 | 11,491 |
| 合計 | 754,805 | 764,467 | 9,661 |

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの営業収益の記載を省略しております。

2 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

3 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

| 顧客の種類等 | 営業収益（千円） | 関連するセグメント名 |
|-----------|-----------|------------|
| 適格機関投資家 A | 1,177,474 | 資産運用業 |

（１株当たり情報）

１株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

| 第54期中間会計期間 (平成28年 9 月30日) | |
|------------------------------|-----------|
| １株当たり純資産額 | 6,680.26円 |

１株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 第54期中間会計期間 (自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日) | |
|---|-----------|
| １株当たり中間純利益金額 | 497.79円 |
| （算定上の基礎） | |
| 中間純利益金額（千円） | 516,910 |
| 普通株主に帰属しない金額（千円） | - |
| 普通株式に係る中間純利益金額（千円） | 516,910 |
| 普通株式の期中平均株式数（株） | 1,038,408 |

（注）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。

（重要な後発事象）

当社（以下「MHAM」という）は、平成28年 7 月13日付で締結した、MHAM、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合４社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月 1 日付で統合いたしました。

- １．企業結合日
平成28年10月 1 日

- ２．企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

（参考）新光投信株式会社の経理状況

1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第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。

当社の中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条および第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。

なお、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。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第57期事業年度（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社
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 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56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、新光投信株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

- () 1. 上記は、当社が、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。
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne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 | 湯原 | 尚 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」に掲げられている新光投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、新光投信株式会社の平成28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28年4月1日から平成28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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、新光投信株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にD I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

（注１）上記は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）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 13,427,042 | 14,861,160 |
| 有価証券 | 3,200,000 | 3,500,000 |
| 貯蔵品 | 5,117 | 4,282 |
| 立替金 | 23,184 | 14,857 |
| 前払金 | 64,821 | 67,307 |
| 前払費用 | 18,242 | 17,989 |
| 未収入金 | 872 | 153 |
| 未収委託者報酬 | 3,187,770 | 2,884,368 |
| 未収運用受託報酬 | 99,054 | 82,656 |
| 未収収益 | 6,338 | 8,528 |
| 繰延税金資産 | 372,215 | 326,063 |
| 流動資産合計 | 20,404,659 | 21,767,367 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物（純額） | 2 12,687 | 2 0 |
| 構築物（純額） | 2 1,444 | 2 0 |
| 器具・備品（純額） | 2 86,688 | 2 44,868 |
| 有形固定資産合計 | 100,820 | 44,868 |
| 無形固定資産 | | |
| 電話加入権 | 91 | 91 |
| ソフトウェア | 85,517 | 55,116 |
| ソフトウェア仮勘定 | 669 | 1,944 |
| 無形固定資産合計 | 86,278 | 57,152 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 5,101,854 | 2,858,652 |
| 関係会社株式 | 77,100 | 77,100 |
| 長期差入保証金 | 124,246 | 23,339 |
| 長期繰延税金資産 | - | 29,604 |
| 前払年金費用 | 396,211 | 378,381 |
| その他 | 6,632 | 6,632 |
| 投資その他の資産合計 | 5,706,044 | 3,373,710 |
| 固定資産合計 | 5,893,143 | 3,475,731 |
| 資産合計 | 26,297,802 | 25,243,098 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 17,893 | 19,103 |
| リース債務 | 345 | - |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 160 | 152 |
| 未払償還金 | 5,083 | 4,216 |
| 未払手数料 | 1 1,558,682 | 1 1,360,372 |
| その他未払金 | 952,018 | 516,568 |
| 未払金合計 | 2,515,945 | 1,881,309 |
| 未払費用 | 722,806 | 746,430 |
| 未払法人税等 | 1,222,883 | 857,031 |
| 賞与引当金 | 451,000 | 547,750 |
| 役員賞与引当金 | 66,000 | 44,000 |
| 外国税支払損失引当金 | 184,111 | - |
| 訴訟損失引当金 | 30,000 | 40,000 |
| 流動負債合計 | 5,210,985 | 4,135,625 |
| 固定負債 | | |
| 繰延税金負債 | 89,752 | - |
| 退職給付引当金 | 155,806 | 146,617 |
| 役員退職慰労引当金 | 39,333 | 48,333 |
| 執行役員退職慰労引当金 | 63,916 | 85,916 |
| 固定負債合計 | 348,809 | 280,867 |
| 負債合計 | 5,559,794 | 4,416,492 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 4,524,300 | 4,524,300 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 2,761,700 | 2,761,700 |
| 資本剰余金合計 | 2,761,700 | 2,761,700 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 360,493 | 360,493 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 8,900,000 | 8,900,000 |
| 繰越利益剰余金 | 3,981,245 | 4,185,368 |
| 利益剰余金合計 | 13,241,738 | 13,445,861 |
| 自己株式 | 72,415 | - |
| 株主資本合計 | 20,455,322 | 20,731,861 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 282,685 | 94,744 |

| | | |
|------------|------------|------------|
| 評価・換算差額等合計 | 282,685 | 94,744 |
| 純資産合計 | 20,738,008 | 20,826,605 |
| 負債純資産合計 | 26,297,802 | 25,243,098 |

(2) 損益計算書

(単位：千円)

| | 前事業年度 | | 当事業年度 | |
|-------------|-------|-------------|-------|-------------|
| | (自 | 平成26年4月 1日 | (自 | 平成27年4月 1日 |
| | 至 | 平成27年3月31日) | 至 | 平成28年3月31日) |
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | | 35,876,795 | | 39,283,623 |
| 運用受託報酬 | | 238,412 | | 232,145 |
| 営業収益合計 | | 36,115,207 | | 39,515,769 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 1 | 18,252,669 | 1 | 19,472,734 |
| 広告宣伝費 | | 456,430 | | 507,020 |
| 公告費 | | 548 | | 469 |
| 調査費 | | | | |
| 調査費 | | 623,792 | | 841,825 |
| 委託調査費 | | 5,966,340 | | 7,419,125 |
| 図書費 | | 5,254 | | 4,879 |
| 調査費合計 | | 6,595,388 | | 8,265,830 |
| 委託計算費 | | 1,352,318 | | 1,711,366 |
| 営業雑経費 | | | | |
| 通信費 | | 32,335 | | 30,454 |
| 印刷費 | | 103,093 | | 1,022 |
| 協会費 | | 18,150 | | 19,367 |
| 諸会費 | | 3,300 | | 3,117 |
| その他 | | 41,594 | | 44,518 |
| 営業雑経費合計 | | 198,475 | | 98,480 |
| 営業費用合計 | | 26,855,830 | | 30,055,901 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | | | | |
| 役員報酬 | | 96,445 | | 91,205 |
| 給料・手当 | | 1,368,552 | | 1,480,875 |
| 賞与 | | 336,076 | | 428,776 |
| 給料合計 | | 1,801,073 | | 2,000,857 |
| 交際費 | | 11,426 | | 10,708 |
| 寄付金 | | 3,198 | | 2,346 |
| 旅費交通費 | | 100,386 | | 109,240 |
| 租税公課 | | 68,508 | | 90,795 |
| 不動産賃借料 | | 206,753 | | 205,671 |
| 賞与引当金繰入 | | 451,000 | | 547,750 |
| 役員賞与引当金繰入 | | 66,000 | | 22,000 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | | 24,930 | | 22,210 |
| 退職給付費用 | | 191,900 | | 169,238 |
| 減価償却費 | | 70,676 | | 102,532 |

| | | |
|---------|-----------|-----------|
| 諸経費 | 573,824 | 647,510 |
| 一般管理費合計 | 3,569,678 | 3,930,859 |
| 営業利益 | 5,689,698 | 5,529,008 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|----------------|--|--|
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 163,006 | 65,772 |
| 有価証券利息 | 3,853 | 3,333 |
| 受取利息 | 10,741 | 10,751 |
| 時効成立分配金・償還金 | 5,080 | 923 |
| 受取保険金 | - | 10,300 |
| 雑益 | 487 | 2,845 |
| 営業外収益合計 | 183,170 | 93,926 |
| 営業外費用 | | |
| 支払利息 | 26 | 3 |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | 3,083 | 5,532 |
| 雑損 | 3,261 | 556 |
| 営業外費用合計 | 6,371 | 6,092 |
| 経常利益 | 5,866,496 | 5,616,842 |
| 特別利益 | | |
| 投資有価証券売却益 | 68,179 | 225,965 |
| 外国税支払損失引当金戻入益 | - | 43,200 |
| 特別利益合計 | 68,179 | 269,166 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産除却損 | 3,177 | 13,017 |
| 投資有価証券売却損 | 54,613 | 60,150 |
| 投資有価証券評価損 | 10,952 | 62,800 |
| 外国税支払損失引当金繰入額 | 184,111 | - |
| 訴訟損失引当金繰入額 | 30,000 | 10,000 |
| 合併関連費用 | 2 | 2 |
| その他特別損失 | 22,227 | - |
| 特別損失合計 | 305,082 | 310,625 |
| 税引前当期純利益 | 5,629,593 | 5,575,383 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,111,379 | 1,832,729 |
| 法人税等調整額 | 66,999 | 19,773 |
| 法人税等合計 | 2,044,380 | 1,852,503 |
| 当期純利益 | 3,585,212 | 3,722,880 |

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | |
|-------------------------|-----------|------------|------------|------------|-------------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | 利益剰余金 | | |
| | | 資 本 準備金 | 利 益 準備金 | その他利益剰余金 | |
| | | | | 別 途 積立金 | 繰 越 利 益 剰余金 |
| 当期首残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 2,889,165 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | | | | | 46,276 |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 2,935,441 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | 2,539,409 |
| 当期純利益 | | | | | 3,585,212 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | 1,045,803 |
| 当期末残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 3,981,245 |

| | 株主資本 | | | 評価・換算差額等 | 純資産合計 |
|-------------------------|-------------------|------------|-------------------|------------------|------------|
| | 利益剰余金 | 自 己 株 式 | 株 主 資 本 合 計 | その他有価証 券評価差額金 | |
| | 利 益 剰余金 合 計 | | | | |
| 当期首残高 | 12,149,658 | 72,415 | 19,363,242 | 50,874 | 19,414,117 |
| 会計方針の変更による累積 的影響額 | 46,276 | | 46,276 | | 46,276 |
| 会計方針の変更を反映した当 期首残高 | 12,195,935 | 72,415 | 19,409,519 | 50,874 | 19,460,393 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 2,539,409 | | 2,539,409 | | 2,539,409 |
| 当期純利益 | 3,585,212 | | 3,585,212 | | 3,585,212 |
| 株主資本以外の項目の当期 変動額（純額） | | | | 231,810 | 231,810 |
| 当期変動額合計 | 1,045,803 | - | 1,045,803 | 231,810 | 1,277,614 |
| 当期末残高 | 13,241,738 | 72,415 | 20,455,322 | 282,685 | 20,738,008 |

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | |
|----------------------|-----------|-----------|----------|-----------|---------|-------------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 別途積立金 |
| 当期首残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | - | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | |
| 当期純利益 | | | | | | |
| 自己株式の消却 | | | 72,415 | 72,415 | | |
| 利益剰余金から 資本剰余金への振替 | | | 72,415 | 72,415 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | - | - |
| 当期末残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | - | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 |

| | 株主資本 | | | | 評価・換算 差額等 | 純資産合計 |
|-------------------------|-------------------|-------------------|------------|-------------------|----------------------|------------|
| | 利益剰余金 | | 自 己 株 式 | 株 主 資 本 合 計 | その他有 価証券評 価差額金 | |
| | その他利益 剰余金 | 利 益 剰余金 合 計 | | | | |
| | 繰 越 利 益 剰余金 | | | | | |
| 当期首残高 | 3,981,245 | 13,241,738 | 72,415 | 20,455,322 | 282,685 | 20,738,008 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | 3,446,341 | 3,446,341 | | 3,446,341 | | 3,446,341 |
| 当期純利益 | 3,722,880 | 3,722,880 | | 3,722,880 | | 3,722,880 |
| 自己株式の消却 | | | 72,415 | - | | - |
| 利益剰余金から資本剰余金 への振替 | 72,415 | 72,415 | | - | | - |
| 株主資本以外の項目の当期 変動額（純額） | | | | - | 187,941 | 187,941 |
| 当期変動額合計 | 204,122 | 204,122 | 72,415 | 276,538 | 187,941 | 88,597 |
| 当期末残高 | 4,185,368 | 13,445,861 | - | 20,731,861 | 94,744 | 20,826,605 |

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）関連会社株式

総平均法による原価法

（2）その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20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）に基づく定額法により償却しております。

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

（2）役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

（3）外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

（4）訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

（5）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及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

（6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（7）執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4．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、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。

5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（未適用の会計基準）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

（追加情報）

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日に、新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

- 1．商 号 アセットマネジメントOne株式会社
- 2．代 表 者 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
- 3．本店所在地 東京都千代田区丸の内1-8-2
- 4．統 合 日 平成28年10月1日

注記事項

（貸借対照表関係）

１．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 未払手数料 | 777,631千円 | 570,839千円 |

２．資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 有形固定資産の減価償却累計額 | 573,602千円 | 657,201千円 |

（損益計算書関係）

１．各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

| | 前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|-------|---|---|
| 支払手数料 | 9,189,399千円 | 8,452,937千円 |

２．特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

| | 前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|------------|---|---|
| 固定資産・敷金の償却 | -千円 | 140,257千円 |
| その他 | -千円 | 24,400千円 |
| 合計 | -千円 | 164,657千円 |

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式（株） | 1,823,250 | - | - | 1,823,250 |

２．自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|---------|----|----|--------|
| 普通株式（株） | 9,386 | - | - | 9,386 |

３．配当に関する事項

(1)配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(千円) | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|-----------------------|-------|------------|-------------|-------------|-------------|
| 平成26年12月24日 臨時株主総会 | 普通株式 | 2,539,409 | 1,400 | 平成26年11月26日 | 平成26年12月25日 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|-----------|----|-------|-----------|
| 普通株式（株） | 1,823,250 | - | 9,386 | 1,813,864 |

(変動事由の概要)

自己株式の消却

２．自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|---------|----|-------|--------|
| 普通株式（株） | 9,386 | - | 9,386 | - |

(変動事由の概要)

自己株式の消却

３．配当に関する事項

(1)配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(千円) | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|---------------------|-------|------------|-------------|------------|-------------|
| 平成27年11月17日 取締役会 | 普通株式 | 3,446,341 | 1,900 | 平成27年12月8日 | 平成27年12月17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

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行っております。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

有価証券及び投資有価証券は、主に其他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上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ることがあります。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、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

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）。

前事業年度（平成27年3月31日）

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金及び預金 | 13,427,042 | 13,427,042 | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券 | 8,102,802 | 8,102,802 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 3,187,770 | 3,187,770 | - |

当事業年度（平成28年3月31日）

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金及び預金 | 14,861,160 | 14,861,160 | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券 | 6,159,600 | 6,159,600 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 2,884,368 | 2,884,368 | - |

（注）１．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金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。

(3) 未収委託者報酬

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（単位：千円）

| 区分 | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 非上場株式 | 276,151 | 276,151 |

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(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

前事業年度（平成27年3月31日）

| | 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 | 13,426,934 | - | - | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 3,200,000 | 2,060,328 | 1,537,061 | 63,735 |
| (3) 未収委託者報酬 | 3,187,770 | - | - | - |

当事業年度（平成28年3月31日）

| | 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 | 14,861,112 | - | - | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 3,500,000 | 529,761 | 1,249,513 | 11,916 |
| (3) 未収委託者報酬 | 2,884,368 | - | - | - |

（有価証券関係）

１．関連会社株式

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円）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。

２．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------|---------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | | | |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 2,787,026 | 2,215,104 | 571,921 |
| | 小計 | 2,787,026 | 2,215,104 | 571,921 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | | | |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 5,315,776 | 5,470,388 | 154,612 |
| | 小計 | 5,315,776 | 5,470,388 | 154,612 |
| 合計 | | 8,102,802 | 7,685,493 | 417,309 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）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。

当事業年度（平成28年3月31日）

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------|---------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | | | |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 1,119,150 | 869,274 | 249,875 |
| | 小計 | 1,119,150 | 869,274 | 249,875 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | | | |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 5,040,450 | 5,153,936 | 113,485 |
| | 小計 | 5,040,450 | 5,153,936 | 113,485 |
| 合計 | | 6,159,600 | 6,023,210 | 136,389 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額199,051千円）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。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

| | 売却額 (千円) | 売却益の合計額 (千円) | 売却損の合計額 (千円) |
|---------|-------------|-----------------|-----------------|
| (1)株式 | - | - | - |
| (2)債券 | | | |
| 国債・地方債等 | - | - | - |
| 社債 | - | - | - |
| その他 | - | - | - |
| (3)その他 | 503,565 | 68,179 | 54,613 |
| 合計 | 503,565 | 68,179 | 54,613 |

当事業年度（平成28年3月31日）

| | 売却額 (千円) | 売却益の合計額 (千円) | 売却損の合計額 (千円) |
|---------|-------------|-----------------|-----------------|
| (1)株式 | - | - | - |
| (2)債券 | | | |
| 国債・地方債等 | - | - | - |
| 社債 | - | - | - |
| その他 | - | - | - |
| (3)その他 | 2,209,763 | 225,965 | 60,150 |
| 合計 | 2,209,763 | 225,965 | 60,150 |

4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について62,800千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30～50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付企業年金制度（キャッシュバランス型）、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

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

（単位：千円）

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|------------------|--|--|
| 退職給付債務の期首残高 | 1,424,739 | 1,348,083 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | 71,902 | - |
| 会計方針の変更を反映した期首残高 | 1,352,836 | 1,348,083 |
| 勤務費用 | 90,967 | 91,804 |
| 利息費用 | 9,476 | 6,074 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 31,927 | 53,747 |
| 退職給付の支払額 | 73,269 | 60,817 |
| 過去勤務費用の発生額 | - | - |
| 退職給付債務の期末残高 | 1,348,083 | 1,438,892 |

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 年金資産の期首残高 | 1,157,054 | 1,329,170 |
| 期待運用収益 | 23,141 | 33,229 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 108,961 | 128,633 |
| 事業主からの拠出額 | 78,464 | 77,164 |
| 退職給付の支払額 | 38,450 | 28,253 |
| 年金資産の期末残高 | 1,329,170 | 1,282,678 |

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|
| 積立型制度の退職給付債務 | 1,111,797 | 1,185,792 |
| 年金資産 | 1,329,170 | 1,282,678 |
| | 217,373 | 96,885 |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 236,285 | 253,099 |
| 未積立退職給付債務 | 18,912 | 156,213 |
| 未認識数理計算上の差異 | 270,020 | 387,977 |
| 未認識過去勤務費用 | 10,703 | - |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 240,404 | 231,764 |
| 退職給付引当金 | 155,806 | 146,617 |
| 前払年金費用 | 396,211 | 378,381 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 240,404 | 231,764 |

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 勤務費用(注1) | 119,135 | 124,139 |
| 利息費用 | 9,476 | 6,074 |
| 期待運用収益 | 23,141 | 33,229 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 85,138 | 64,424 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | 16,055 | 10,703 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 174,553 | 150,705 |

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額（前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円）については「(1) 勤務費用」に含めて記載しております。

(5)年金資産に関する事項

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|----------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 年金資産の主な内訳 | | |
| 年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。 | | |
| 株式 | 39.4% | 33.8% |
| 債券 | 27.3% | 27.3% |
| 共同運用資産 | 21.0% | 24.5% |
| 生命保険一般勘定 | 10.6% | 11.1% |
| 現金及び預金 | 1.4% | 3.2% |
| 合計 | 100% | 100% |

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)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

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|-----------|--|--|
| 割引率 | 0.0720%～1.625% | 0.0120%～0.8060% |
| 長期期待運用収益率 | 2.0% | 2.5% |
| 予想昇給率(平均) | 2.6% | 2.6% |

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

（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

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 賞与引当金 | 170,920千円 | 182,614千円 |
| 減価償却超過額 | 896 | 25,871 |
| 退職給付引当金 | 70,882 | 71,201 |
| 役員退職慰労引当金 | 12,688 | 14,799 |
| 投資有価証券評価損 | 15,033 | 19,229 |
| 非上場株式評価損 | 25,733 | 24,425 |
| 未払事業税 | 90,342 | 57,445 |
| 外国税支払損失引当金 | 60,867 | - |
| 訴訟損失引当金 | 9,918 | 12,344 |
| その他 | 87,621 | 120,305 |
| 繰延税金資産小計 | 544,905 | 528,236 |
| 評価性引当額 | - | - |
| 繰延税金資産合計 | 544,905 | 528,236 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 134,624 | 56,708 |
| 前払年金費用 | 127,817 | 115,860 |
| 繰延税金負債合計 | 262,442 | 172,568 |
| 繰延税金資産の純額 | 282,463 | 355,668 |

（注）繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

| | | |
|-----------------|-----------|-----------|
| 流動資産 - 繰延税金資産 | 372,215千円 | 326,063千円 |
| 固定資産 - 長期繰延税金資産 | - | 29,604 |
| 固定負債 - 長期繰延税金負債 | 89,752 | - |

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な項目別の内訳

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

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。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従来の32.26%から、平成28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等については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については30.62%となります。

その結果、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）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

関連当事者情報

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（千円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-----|------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------|-------|----------|
| 親会社 | みずほ証券株式会社 | 東京都千代田区 | 125,167,284 | 金融商品取引業 | (被所有) 直接77.05 間接 7.74 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い | 9,189,399 | 未払手数料 | 777,631 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（千円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-----|------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------|-------|----------|
| 親会社 | みずほ証券株式会社 | 東京都千代田区 | 125,167,284 | 金融商品取引業 | (被所有) 直接76.98 間接 7.73 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い | 8,452,937 | 未払手数料 | 570,839 |

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（千円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-------------|----------------------|--------|--------------|-----------|-------------------|-----------|----------------|----------|---------|----------|
| 同一の親会社を持つ会社 | みずほ証券プロパティマネジメント株式会社 | 東京都中央区 | 4,110,000 | 不動産賃貸業 | 直接 4.05 | 事務所の賃借 | 事務所の賃借 | 175,210 | 長期差入保証金 | 116,378 |
| 同一の親会社を持つ会社 | 日本証券テクノロジー株式会社 | 東京都中央区 | 228,000 | 情報サービス業 | なし | 計算業務の委託 | 計算委託料支払 | 92,974 | その他未払金 | 8,479 |
| | | | | | | | ハウジングサービス料支払 | 16,824 | その他未払金 | 1,514 |
| | | | | | | | メールシステムサービス料支払 | 36,923 | その他未払金 | 3,323 |
| | | | | | | | IT関連業務支援 | 18,002 | その他未払金 | 1,736 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（千円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-------------|----------------------|--------|--------------|-----------|-------------------|-----------|----------------|----------|---------|----------|
| 同一の親会社を持つ会社 | みずほ証券プロパティマネジメント株式会社 | 東京都中央区 | 4,110,000 | 不動産賃貸業 | 直接 4.05 | 事務所の賃借 | 事務所の賃借 | 175,210 | 長期差入保証金 | 16,314 |
| 同一の親会社を持つ会社 | 日本証券テクノロジー株式会社 | 東京都中央区 | 228,000 | 情報サービス業 | なし | 計算業務の委託 | 計算委託料支払 | 96,300 | その他未払金 | 8,725 |
| | | | | | | | ハウジングサービス料支払 | 16,824 | その他未払金 | 1,514 |
| | | | | | | | メールシステムサービス料支払 | 36,923 | その他未払金 | 3,323 |
| | | | | | | | IT関連業務支援 | 18,163 | その他未払金 | 1,728 |

（注）１．上記（ア）～（イ）の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

（注）２．取引条件及び取引条件の決定方法等

- （１）代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- （２）事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
- なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。
- （３）計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

（１株当たり情報）

| | 前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日） | 当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日） |
|--------------|---|---|
| 1株当たり純資産額 | 11,433円05銭 | 11,481円90銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 1,976円56銭 | 2,052円45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。

| | 前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日） | 当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日） |
|--------------------|---|---|
| 当期純利益金額（千円） | 3,585,212 | 3,722,880 |
| 普通株主に帰属しない金額（千円） | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益金額（千円） | 3,585,212 | 3,722,880 |
| 期中平均株式数（千株） | 1,813 | 1,813 |

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

| 当中間会計期間 (平成28年9月30日) | |
|-------------------------|------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 現金及び預金 | 7,314,360 |
| 有価証券 | 101,520 |
| 未収委託者報酬 | 3,004,856 |
| 未収運用受託報酬 | 74,687 |
| 繰延税金資産 | 281,201 |
| その他 | 334,195 |
| 流動資産合計 | 11,110,820 |
| 固定資産 | |
| 有形固定資産 | |
| 器具・備品（純額） | 31,241 |
| 建設仮勘定 | 3,819 |
| 有形固定資産合計 | 35,061 |
| 無形固定資産 | |
| ソフトウェア | 52,424 |
| ソフトウェア仮勘定 | 20,936 |
| その他 | 91 |
| 無形固定資産合計 | 73,452 |
| 投資その他の資産 | |
| 投資有価証券 | 2,589,863 |
| 長期繰延税金資産 | 22,056 |
| 前払年金費用 | 352,195 |
| その他 | 29,332 |
| 投資その他の資産合計 | 2,993,448 |
| 固定資産合計 | 3,101,961 |
| 資産合計 | 14,212,782 |

(単位：千円)

| 当中間会計期間 (平成28年9月30日) | |
|-------------------------|------------|
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | |
| 未払収益分配金 | 153 |
| 未払償還金 | 4,216 |
| 未払手数料 | 1,406,798 |
| その他未払金 | 284,198 |
| 未払金合計 | 1,695,367 |
| 未払費用 | 801,111 |
| 未払法人税等 | 850,492 |
| 未払消費税等 | 2 113,638 |
| 賞与引当金 | 382,000 |
| 訴訟損失引当金 | 70,000 |
| 流動負債合計 | 3,912,609 |
| 固定負債 | |
| 退職給付引当金 | 160,185 |
| 固定負債合計 | 160,185 |
| 負債合計 | 4,072,794 |
| 純資産の部 | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 4,524,300 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | 2,761,700 |
| 資本剰余金合計 | 2,761,700 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 360,493 |
| その他利益剰余金 | |
| 繰越利益剰余金 | 2,473,372 |
| 利益剰余金合計 | 2,833,866 |
| 株主資本合計 | 10,119,866 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 20,122 |
| 評価・換算差額等合計 | 20,122 |
| 純資産合計 | 10,139,988 |
| 負債純資産合計 | 14,212,782 |

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

| | 当中間会計期間 (自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日) |
|--------------|--|
| 営業収益 | |
| 委託者報酬 | 19,468,460 |
| 運用受託報酬 | 95,090 |
| 営業収益合計 | 19,563,551 |
| 営業費用及び一般管理費 | 1 16,721,767 |
| 営業利益 | 2,841,783 |
| 営業外収益 | |
| 受取配当金 | 32,758 |
| 有価証券利息 | 522 |
| 受取利息 | 2,296 |
| 時効成立分配金・償還金 | 10 |
| その他 | 531 |
| 営業外収益合計 | 36,119 |
| 営業外費用 | |
| その他 | 34 |
| 営業外費用合計 | 34 |
| 経常利益 | 2,877,868 |
| 特別利益 | |
| 固定資産売却益 | 1,354 |
| 投資有価証券売却益 | 9,179 |
| 特別利益合計 | 10,533 |
| 特別損失 | |
| 固定資産売却損 | 3,996 |
| 投資有価証券評価損 | 58,055 |
| 固定資産除却損 | 50 |
| 訴訟損失引当金繰入額 | 30,000 |
| 合併関連費用 | 11,926 |
| 特別損失合計 | 104,028 |
| 税引前中間純利益 | 2,784,373 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 795,495 |
| 法人税等調整額 | 85,212 |
| 法人税等合計 | 880,707 |
| 中間純利益 | 1,903,666 |

(3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28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 | | |
| | | 資 本 準備金 | 利 益 準備金 | その他利益剰余金 | |
| | | | | 別 途 積立金 | 繰 越 利 益 剰余金 |
| 当期首残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 4,185,368 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 別途積立金取崩 | | | | 8,900,000 | 8,900,000 |
| 剰余金の配当 | | | | | 12,515,661 |
| 中間純利益 | | | | | 1,903,666 |
| 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 | - | - | - | 8,900,000 | 1,711,995 |
| 当中間期末残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | - | 2,473,372 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | 純資産合計 |
|---------------------------|-------------------|-------------------|------------------|------------|
| | 利益剰余金 | 株 主 資 本 合 計 | その他有価証 券評価差額金 | |
| | 利 益 剰余金 合 計 | | | |
| 当期首残高 | 13,445,861 | 20,731,861 | 94,744 | 20,826,605 |
| 当中間期変動額 | | | | |
| 別途積立金取崩 | - | - | | - |
| 剰余金の配当 | 12,515,661 | 12,515,661 | | 12,515,661 |
| 中間純利益 | 1,903,666 | 1,903,666 | | 1,903,666 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | 74,622 | 74,622 |
| 当中間期変動額合計 | 10,611,995 | 10,611,995 | 74,622 | 10,686,617 |
| 当中間期末残高 | 2,833,866 | 10,119,866 | 20,122 | 10,139,988 |

〔注記事項〕

（重要な会計方針）

１．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

２．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(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）に基づく定額法により償却しております。

３．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる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及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

過去勤務費用については、そ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（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、そ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（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

4. 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

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

（中間貸借対照表関係）

1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

| | 当中間会計期間 (平成28年9月30日) |
|----------------|-------------------------|
| 有形固定資産の減価償却累計額 | 498,091千円 |

2. 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

| | 当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日) |
|--------|--|
| 有形固定資産 | 9,695千円 |
| 無形固定資産 | 9,425千円 |

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当中間会計期間末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式（株） | 1,813,864 | - | - | 1,813,864 |

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28年6月15日 取締役会 | 普通株式 | 12,515,661 | 6,900 | 平成28年7月5日 | 平成28年7月27日 |

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの該当事項はありません。

（金融商品関係）

金融商品の時価等に関する事項

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）。

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

| | 中間貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------------|--------------------|------------|------------|
| (1) 現金及び預金 | 7,314,360 | 7,314,360 | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券 | 2,415,231 | 2,415,231 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 3,004,856 | 3,004,856 | - |
| (4) 未払手数料 | 1,406,798 | 1,406,798 | - |

（注）1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬

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。

(4) 未払手数料

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 | 276,151 |

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 77,100千円）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。

２．その他有価証券

| | 種類 | 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 | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | - | - | - |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 921,189 | 730,244 | 190,944 |
| | 小計 | 921,189 | 730,244 | 190,944 |
| 中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | - | - | - |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 1,494,041 | 1,656,021 | 161,979 |
| | 小計 | 1,494,041 | 1,656,021 | 161,979 |
| 合計 | | 2,415,231 | 2,386,265 | 28,965 |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額199,051千円）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。

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

３．主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

１株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに１株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 項目 | 当中間会計期間 (平成28年9月30日) |
|-------------------------------------|-------------------------|
| (１) 1株当たり純資産額 | 5,590円26銭 |
| (算定上の基礎) | |
| 純資産の部の合計額(千円) | 10,139,988 |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額(千円) | 10,139,988 |
| 普通株式の発行済株式数(株) | 1,813,864 |
| 普通株式の自己株式数(株) | - |
| １株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株) | 1,813,864 |

| 項目 | 当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日) |
|--------------------|--|
| (２) 1株当たり中間純利益金額 | 1,049円50銭 |
| (算定上の基礎) | |
| 中間純利益金額(千円) | 1,903,666 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 1,903,666 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 1,813,864 |

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載していません。

（追加情報）

役員賞与引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全取締役及び全監査役に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において74,853千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

執行役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月14日開催の取締役会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全執行役員に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計間において101,916千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

繰延税金資産

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

（重要な後発事象）

当社（以下「新光投信」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及びみずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

<更新・訂正後>

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成28年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでおります。

(2)販売会社

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

| 名 称 | 資本金の額 (単位:百万円) | 事 業 の 内 容 |
|------------|-------------------|----------------------------------|
| 株式会社みずほ銀行 | 1,404,065 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社イオン銀行 | 51,250 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社北都銀行 | 12,500 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社東北銀行 | 13,233 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社群馬銀行 | 48,652 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社常陽銀行 | 85,113 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社横浜銀行 | 215,628 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社北越銀行 | 24,538 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社八十二銀行 | 52,243 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社富山銀行 | 6,730 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社静岡銀行 | 90,845 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社京都銀行 | 42,103 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社南都銀行 | 29,249 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社佐賀銀行 | 16,062 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社宮崎銀行 | 14,697 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社北洋銀行 | 121,101 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社福島銀行 | 18,100 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社栃木銀行 | 27,408 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社東日本銀行 | 38,300 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社富山第一銀行 | 10,182 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 第一生命保険株式会社 | (1) 60,000 | 日本において保険業務を営んでおります。 |
| 八十二証券株式会社 | (2) 800 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |

| | | |
|---------------|-------------|----------------------------------|
| カブドットコム証券株式会社 | 7,196 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 株式会社SBI証券 | 47,937 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| ぐんぎん証券株式会社 | (3) 3,000 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| ごうぎん証券株式会社 | 3,000 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 静岡東海証券株式会社 | 600 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 高木証券株式会社 | 11,069 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 立花証券株式会社 | 6,695 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 楽天証券株式会社 | 7,495 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| マネックス証券株式会社 | 12,200 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 株式会社証券ジャパン | 3,000 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 浜銀TT証券株式会社 | 3,307 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |
| 水戸証券株式会社 | 12,272 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |

（注）資本金の額は平成28年3月末日現在

（ 1 ）平成28年10月1日現在

（ 2 ）平成28年9月30日現在

（ 3 ）平成28年10月3日現在

独立監査人の監査報告書

平成29年3月1日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエの平成28年7月12日から平成29年1月11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29年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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

アセットマネジメントOne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28年5月31日

DIAM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DIAMアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAMアセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRL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28年12月13日

アセットマネジメントOne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 | 湯原 | 尚 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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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な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、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28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28年4月1日から平成28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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

（注１）上記は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）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。